펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-12-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	1,466	0	1,466	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	0	1	장내
합계			1,468	0	1,468	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

152

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

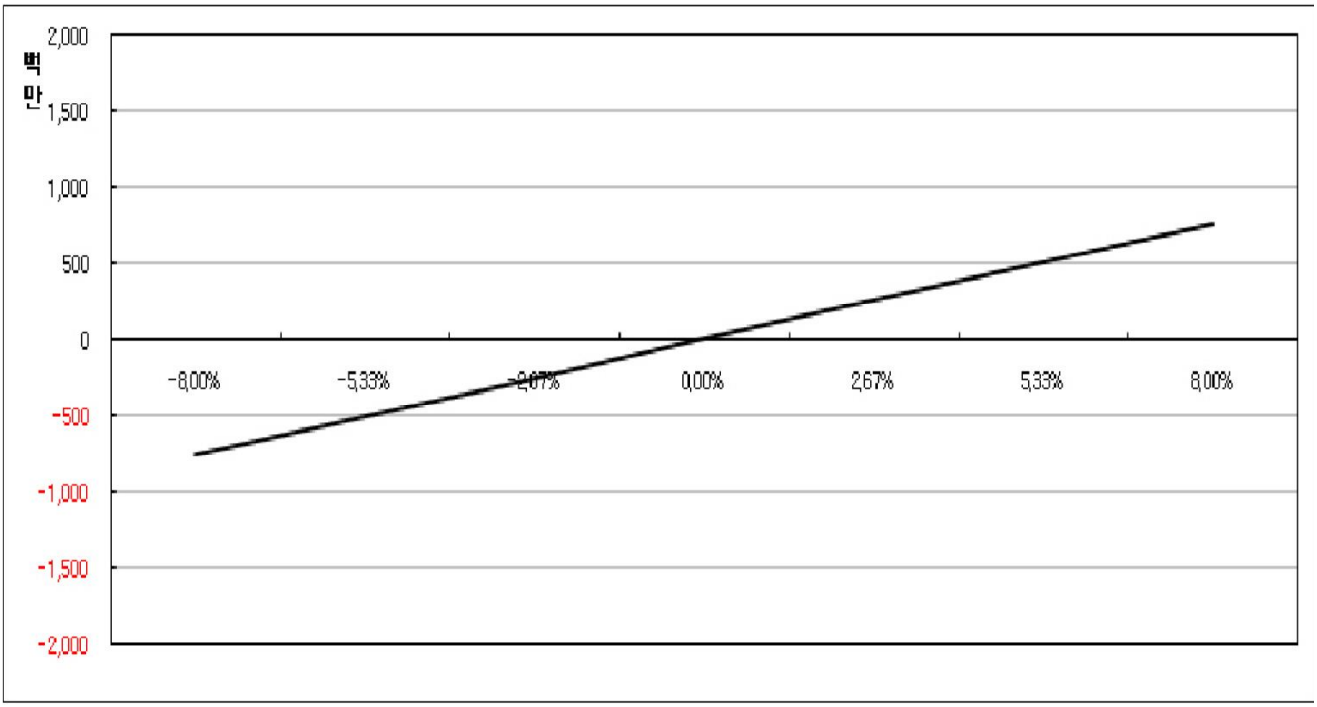
공시일: 2019-12-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	349	0	349	장내
합계			349	0	349	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

333

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

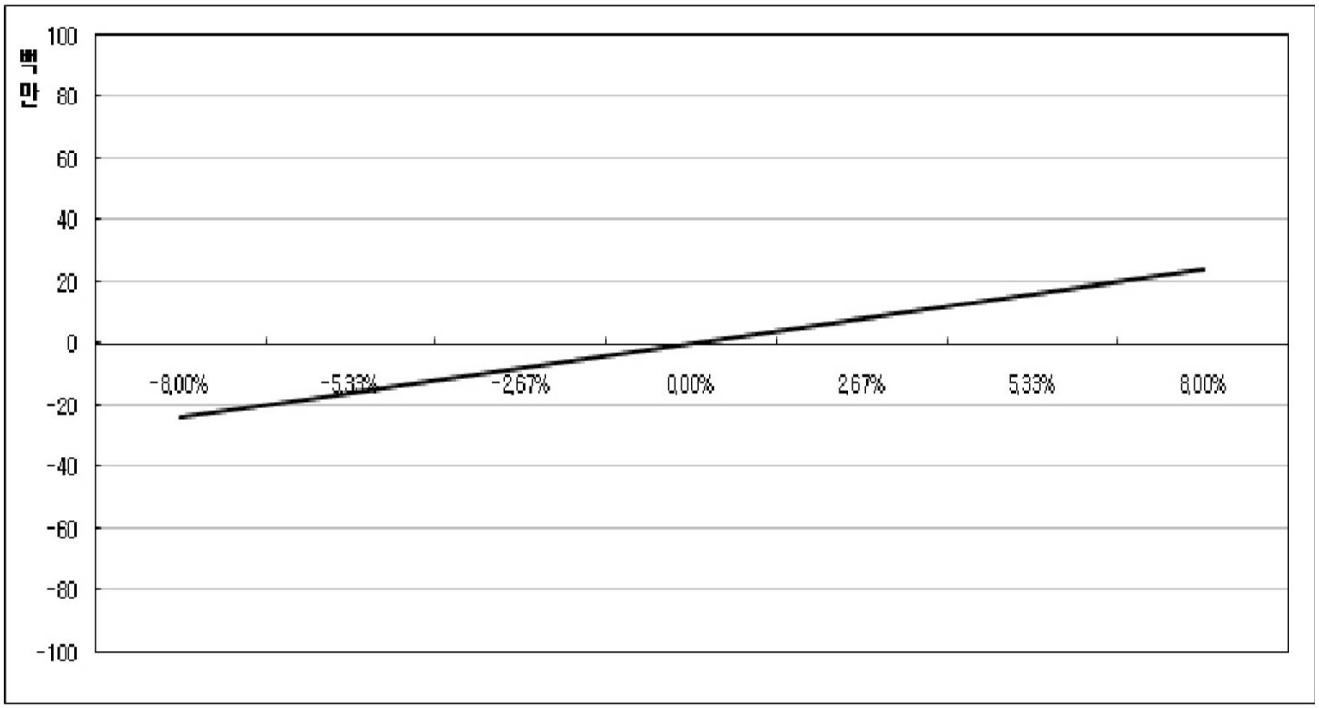
공시일: 2019-12-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	1,117	0	1,117	장내
합계			1,117	0	1,117	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

89

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

438

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

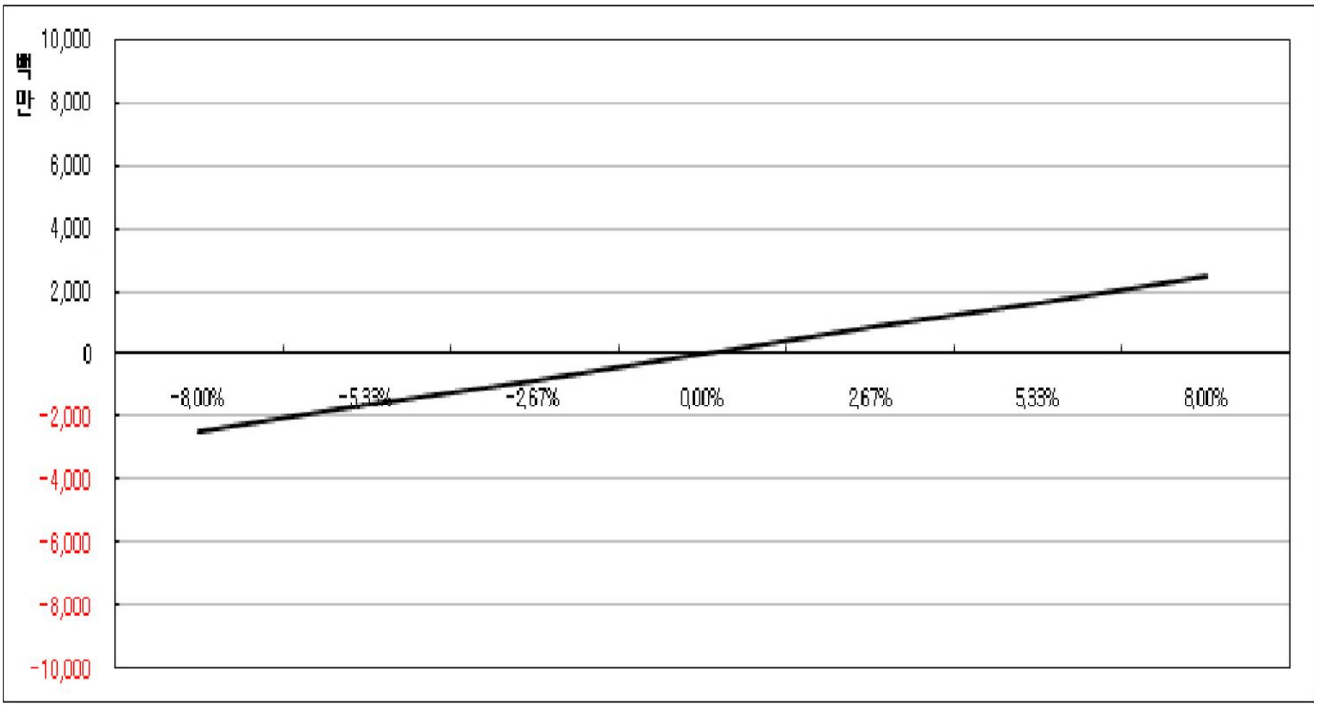
공시일: 2019-12-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	349	140	209	장내
누계	주가지수	선물	4,609	0	4,609	장내
합계			4,609	0	4,609	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

369

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

854

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

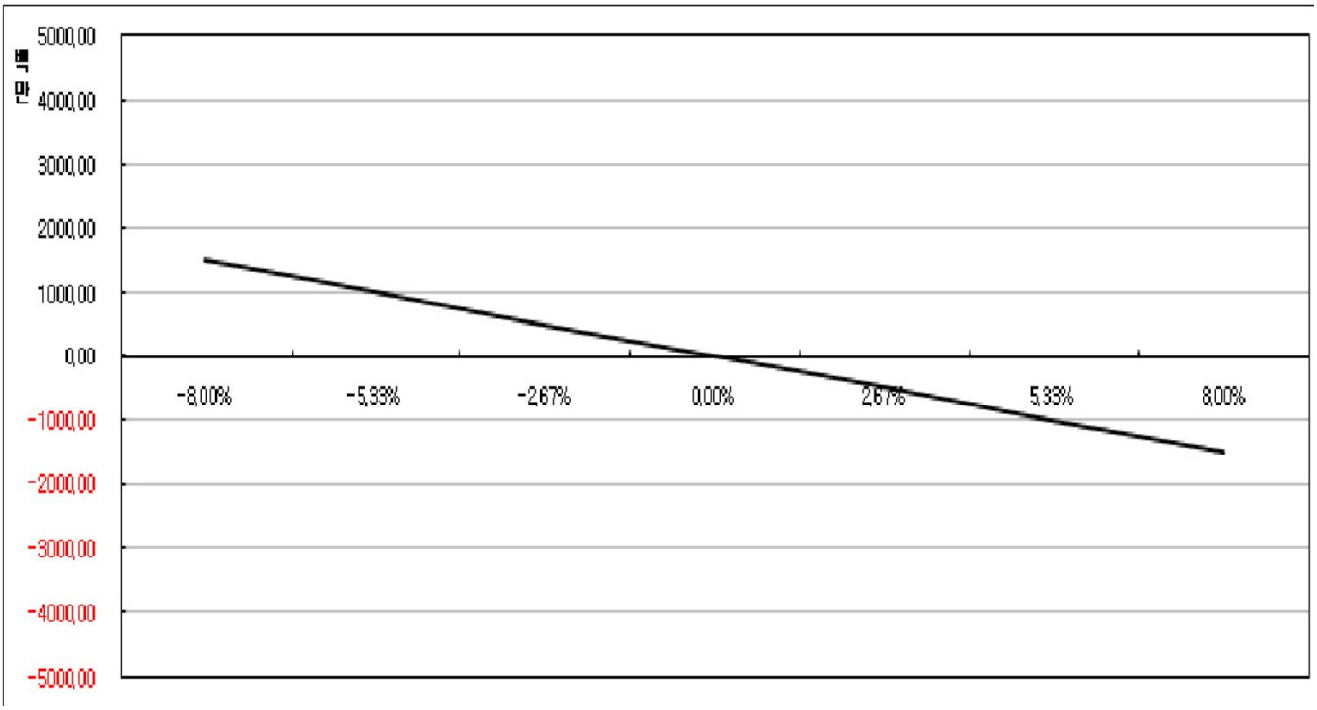
공시일: 2019-12-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	209	-209	장내
누계	주가지수	선물	0	2,025	-2,025	장내
합계			0	2,025	-2,025	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

162

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

127

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

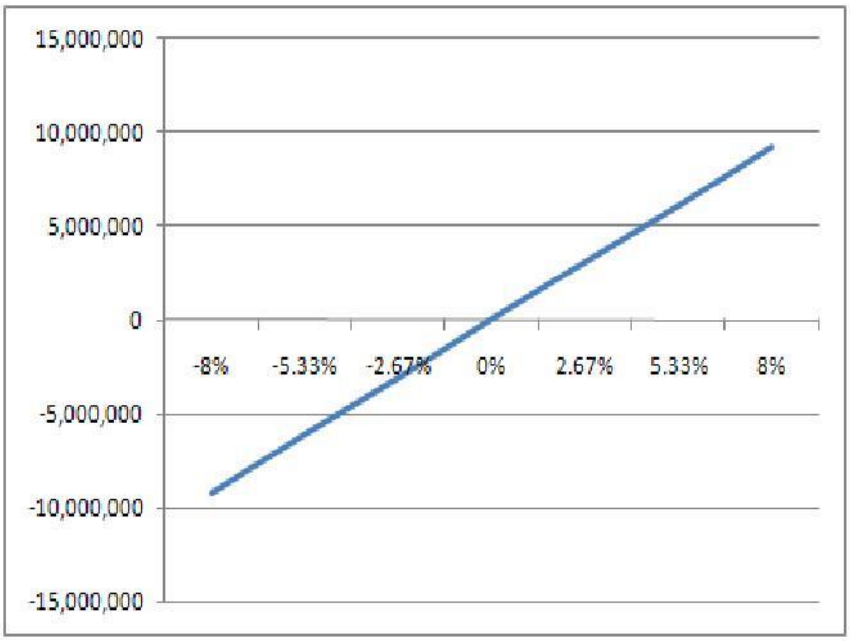
공시일: 2019-12-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	140	0	140	장내
누계	주가지수	선물	72,621	0	72,621	장내
합계			72,621	0	72,621	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,798

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,384