펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,471	1,471	0	장내
누계	주가지수	선물	1,471	0	1,471	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	0	0	장내
합계			1,472	0	1,472	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

155

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

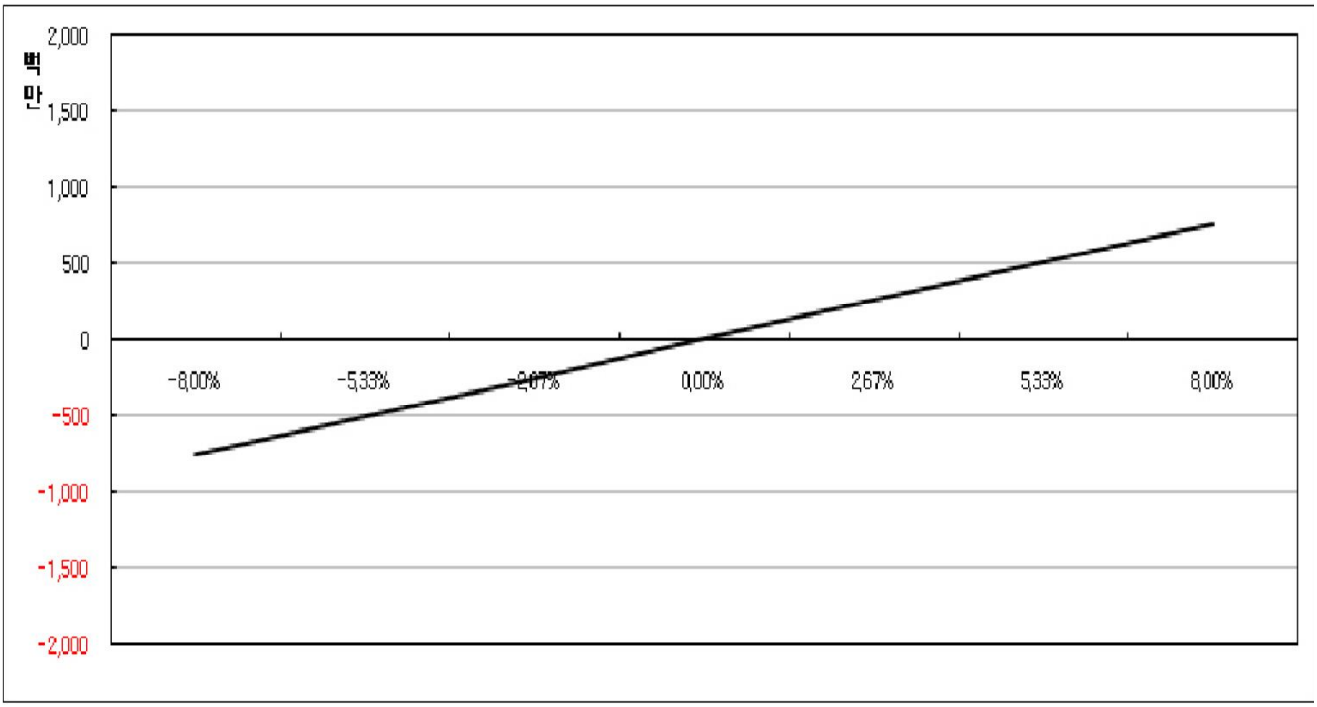
공시일: 2019-12-12

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	350	0	350	장내
합계			350	0	350	

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]

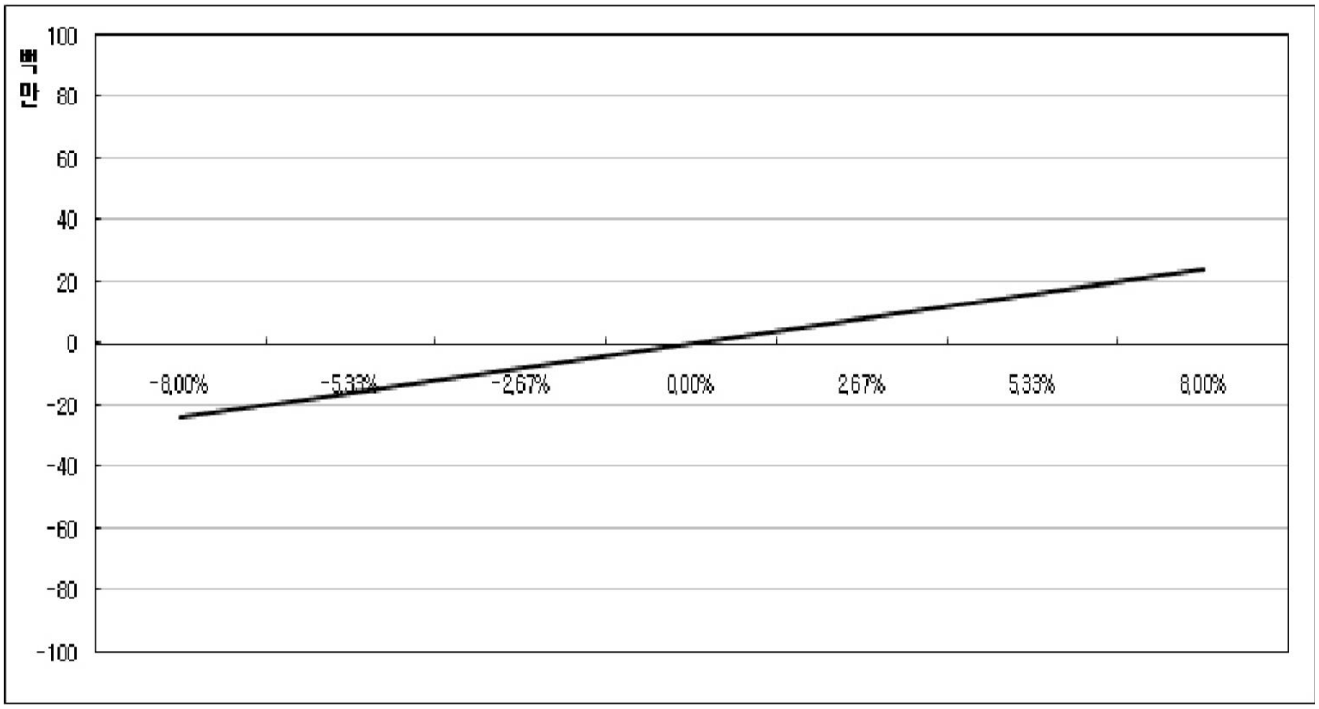
공시일: 2019-12-12

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	1,121	0	1,121	장내
합계			1,121	0	1,121	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

438

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

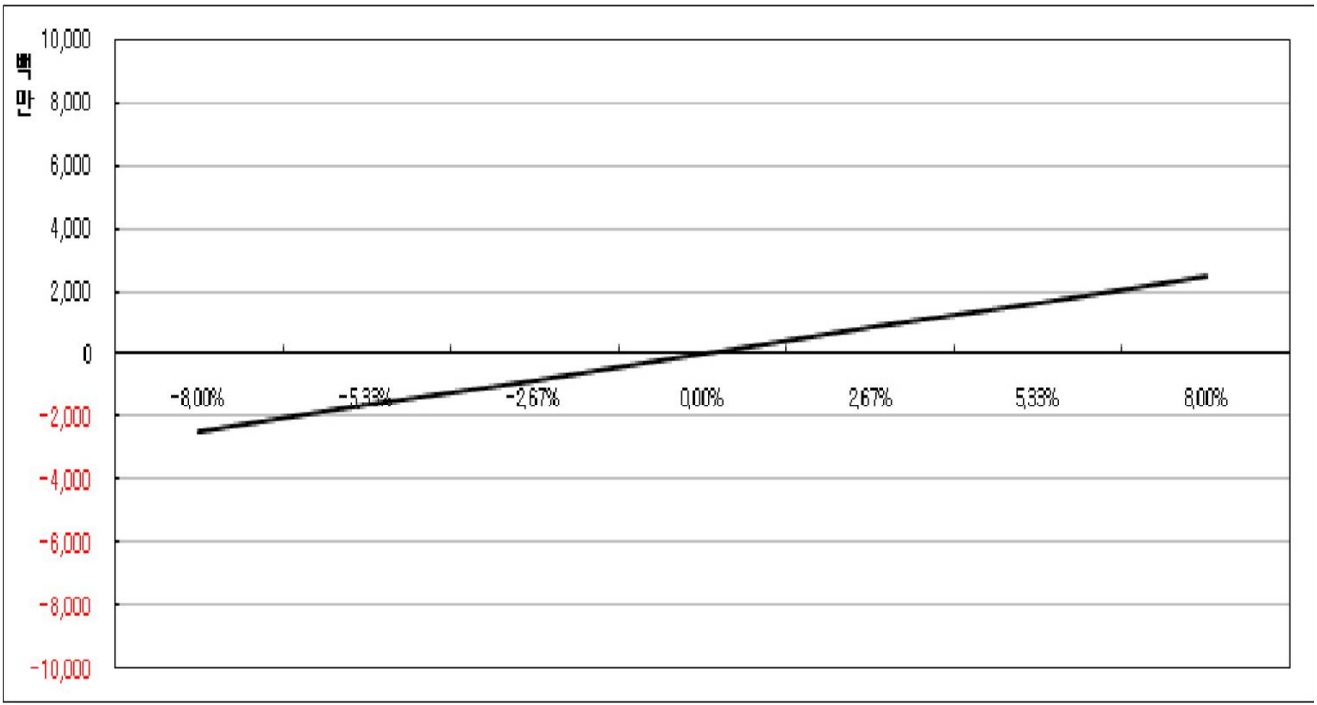
공시일: 2019-12-12

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	4,625	0	4,625	장내
합계			4,625	0	4,625	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

371

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

856

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

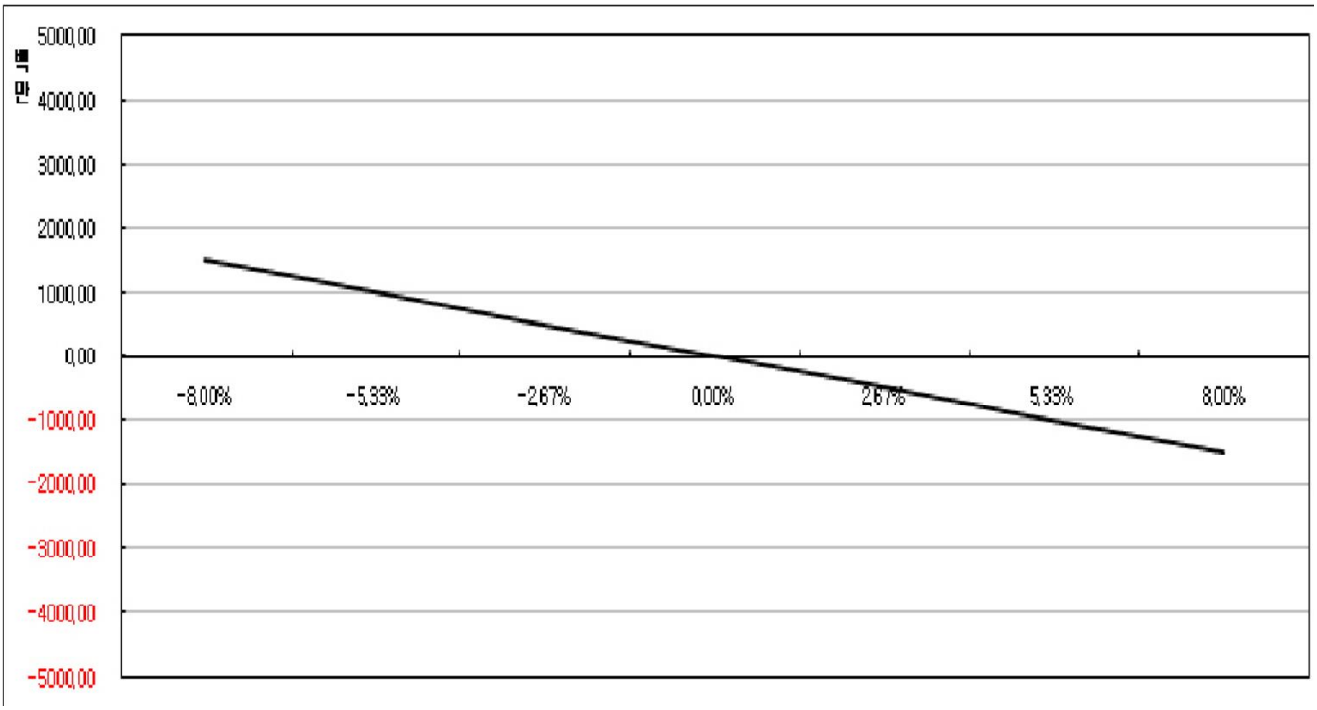
공시일: 2019-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,121	1,121	0	장내
누계	주가지수	선물	0	2,032	-2,032	장내
합계			0	2,032	-2,032	

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]

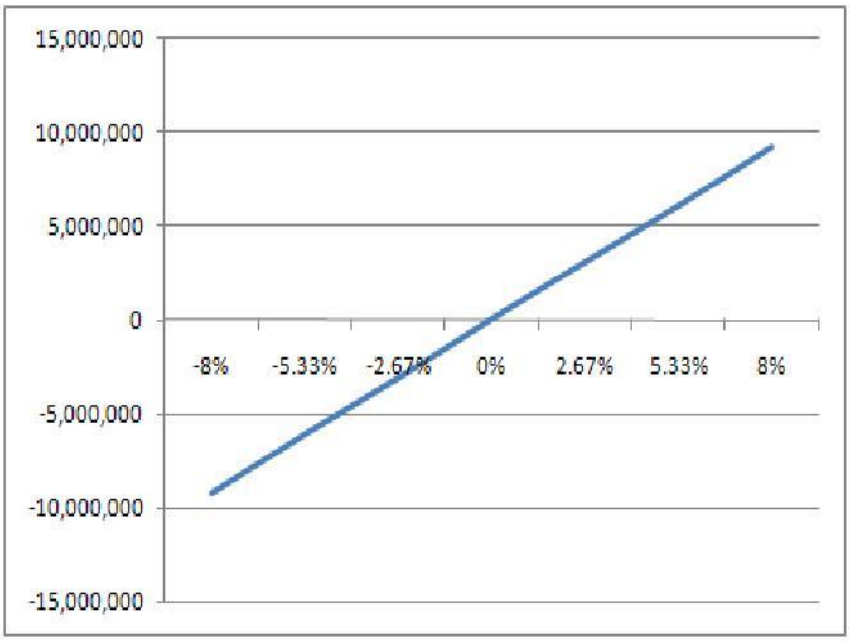
공시일: 2019-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	14,364	14,014	350	장내
누계	주가지수	선물	73,223	0	73,223	장내
합계			73,223	0	73,223	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,844

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,418