펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-12-13

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	1,497	0	1,497	장내
신규	주가지수	옵션	0	4,177	-4,177	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,894	-2,894	장내
합계			1,497	2,894	-1,397	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

396

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

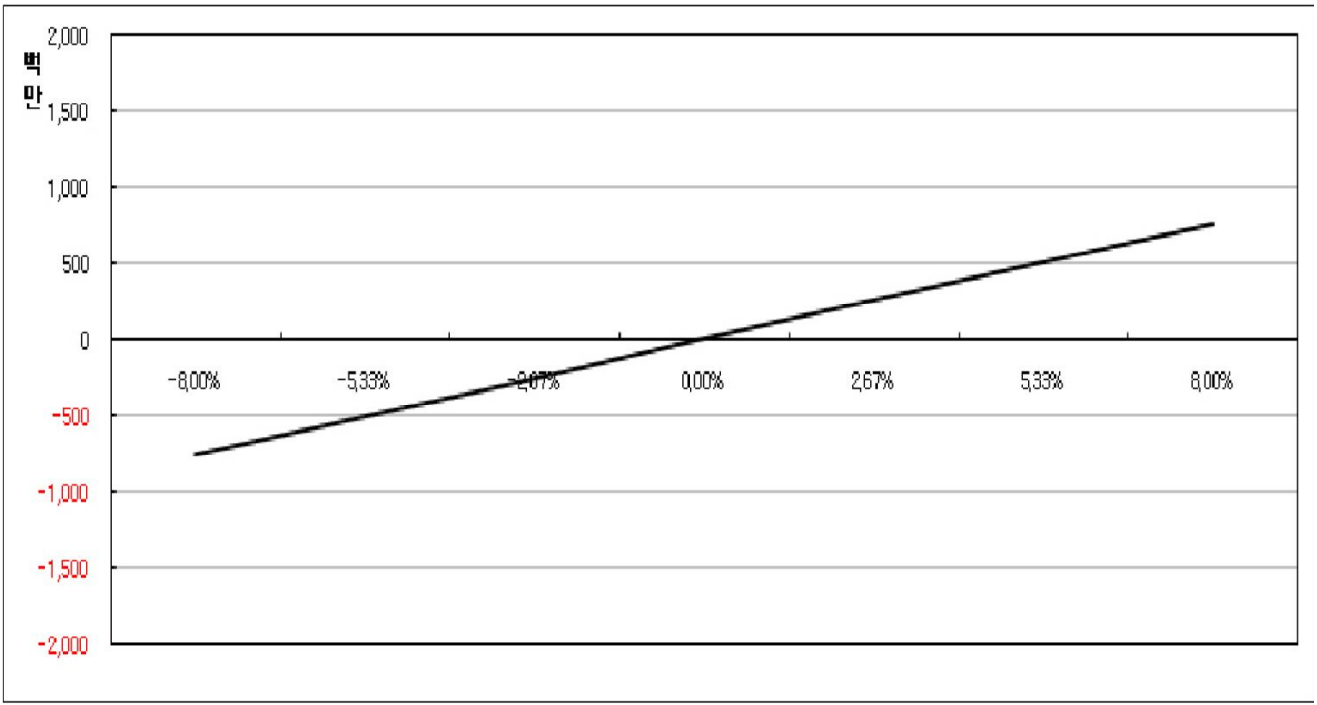
공시일: 2019-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	356	356	0	장내
누계	주가지수	선물	356	0	356	장내
합계			356	0	356	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

340

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

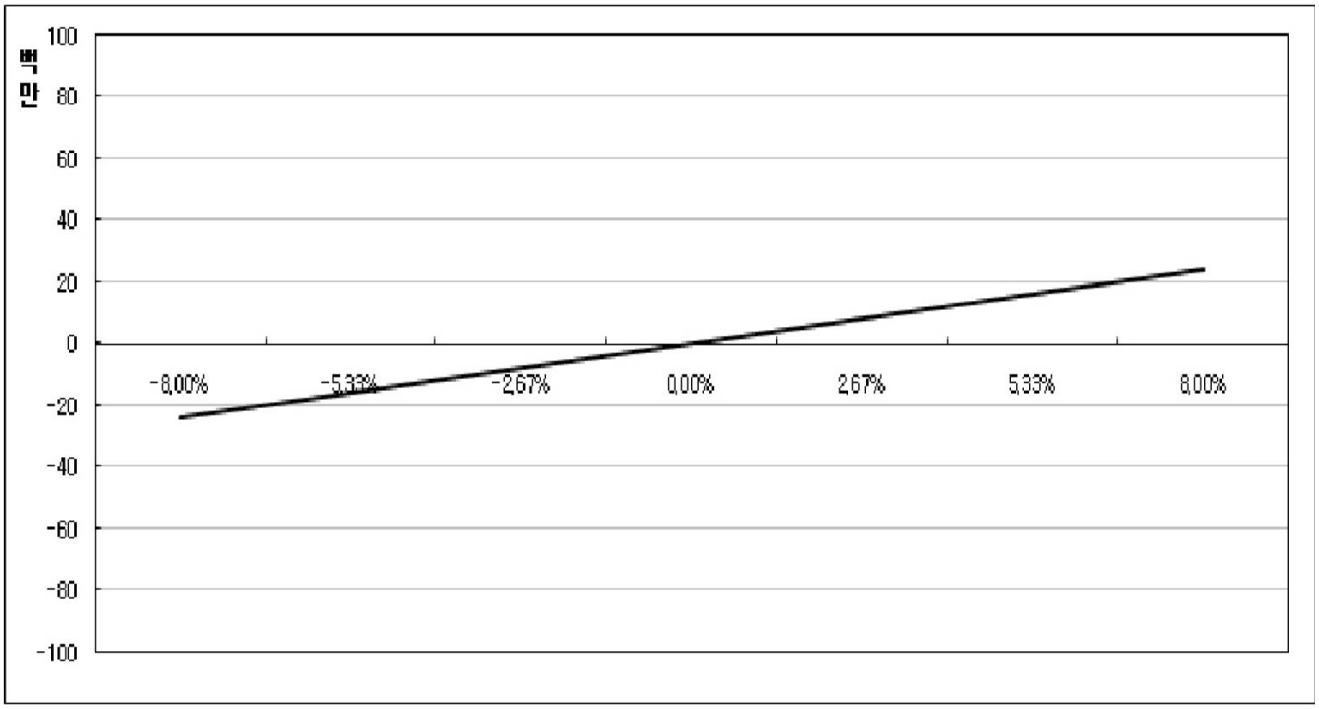
공시일: 2019-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

447

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

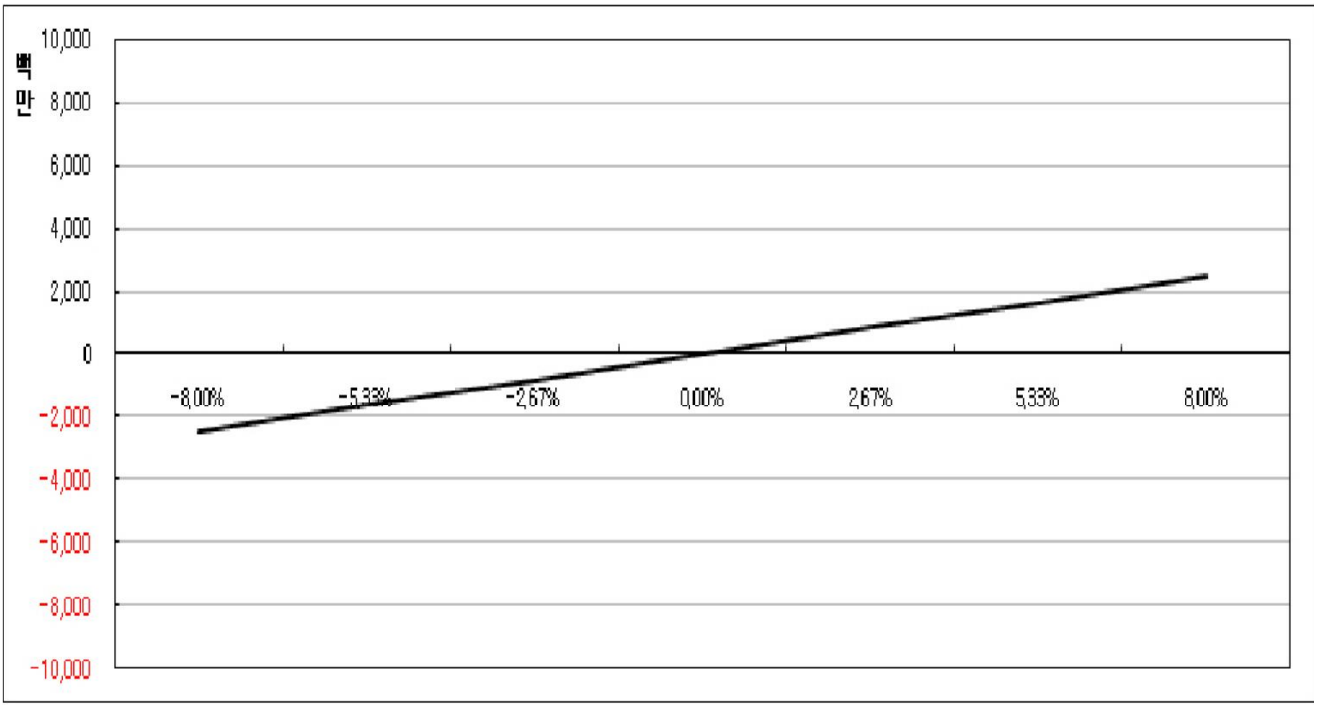
공시일: 2019-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	4,704	4,704	0	장내
누계	주가지수	선물	4,704	0	4,704	장내
합계			4,704	0	4,704	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

373

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

871

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

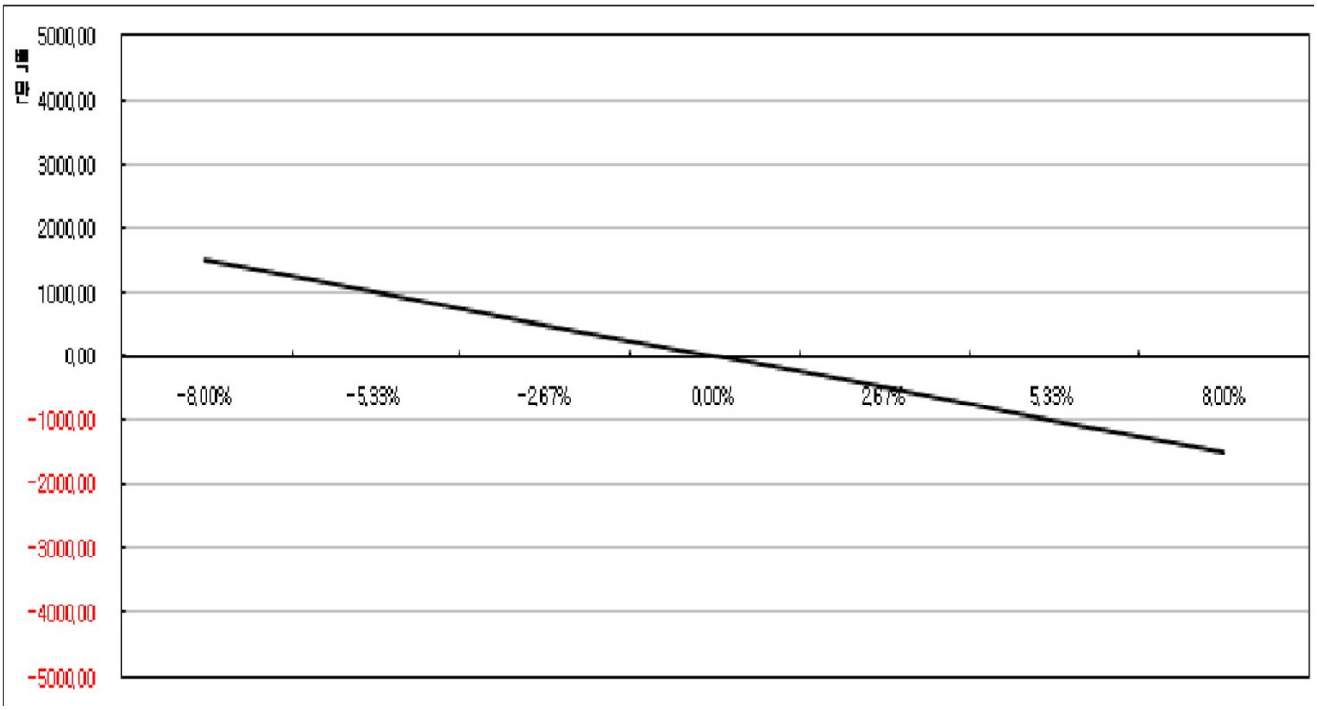
공시일: 2019-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,140	927	214	장내
누계	주가지수	선물	0	1,853	-1,853	장내
합계			0	1,853	-1,853	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

147

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

115

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

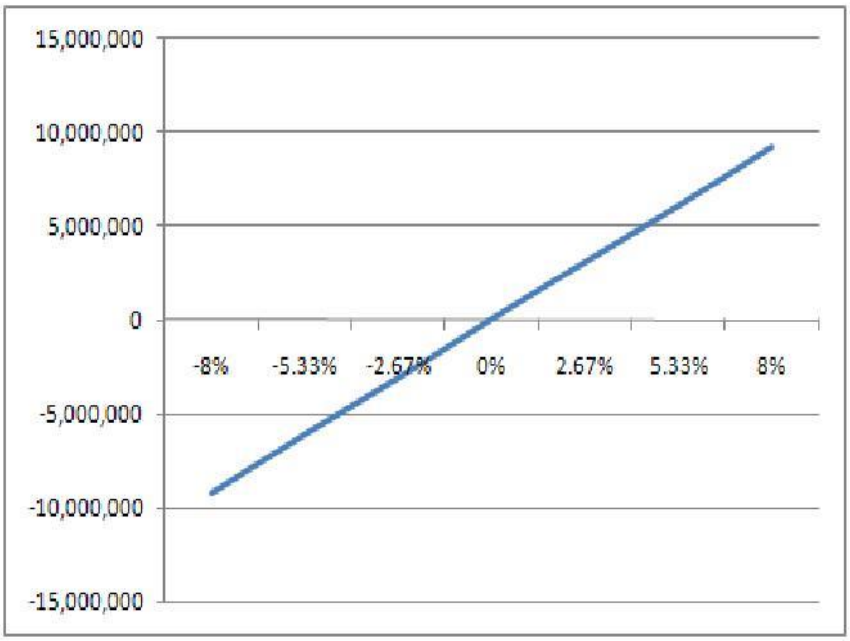
공시일: 2019-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	38,133	51,391	-13,258	장내
누계	주가지수	선물	61,227	0	61,227	장내
합계			61,227	0	61,227	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,859

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,386