펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-12-23

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	1,477	0	1,477	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,805	-2,805	장내
합계			1,477	2,805	-1,329	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	104

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	450

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

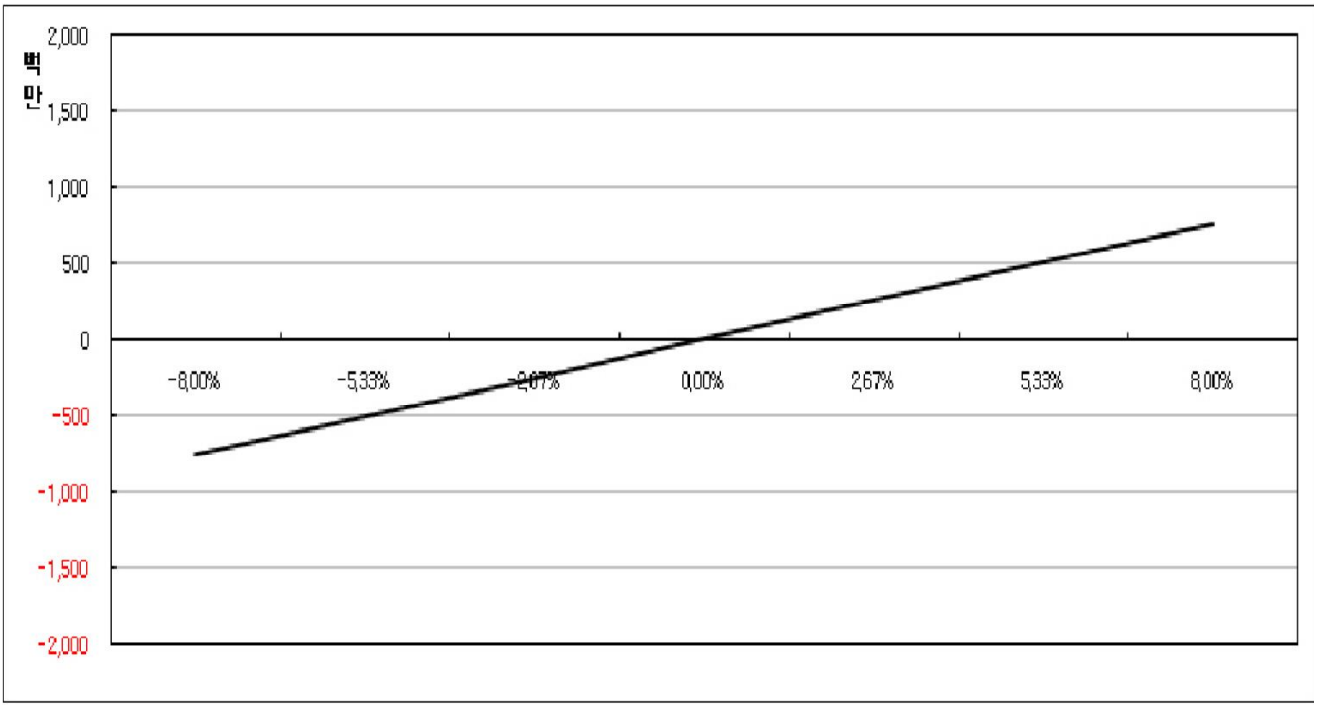
공시일: 2019-12-23

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	221	0	221	장내
합계			221	0	221	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

351

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

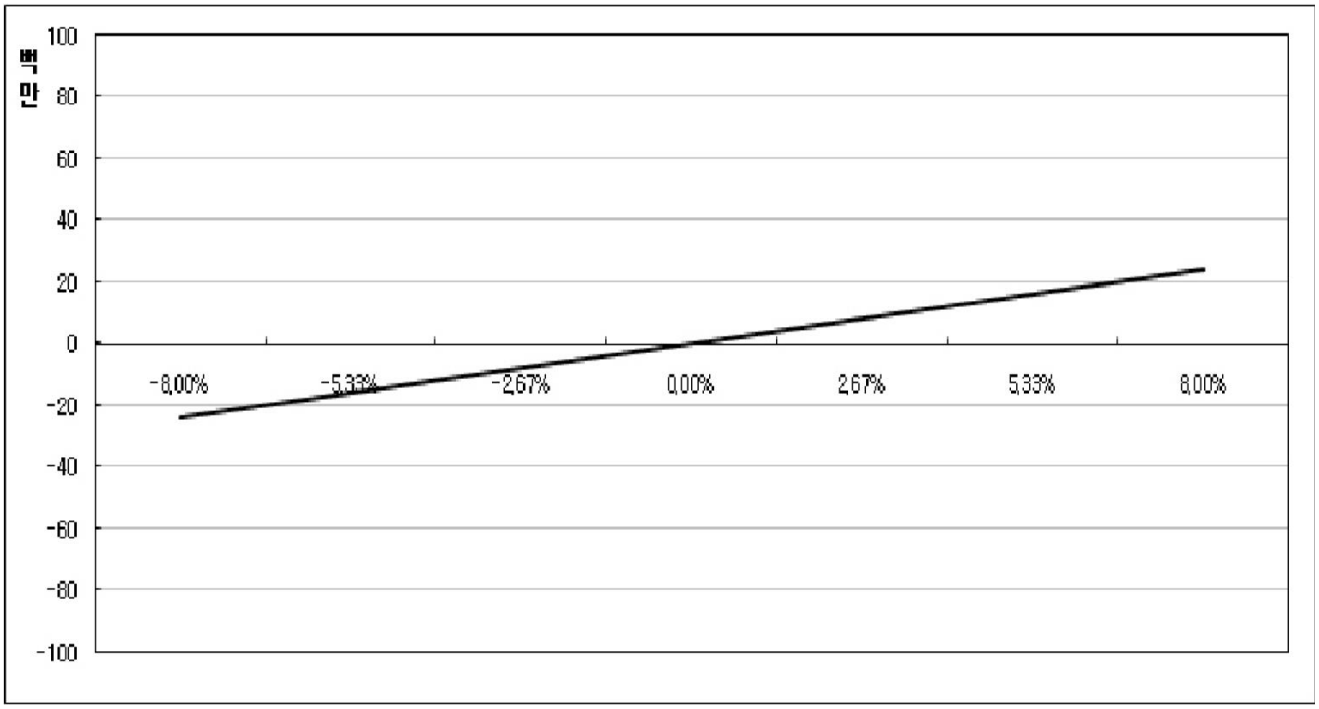
공시일: 2019-12-23

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	1,255	0	1,255	장내
합계			1,255	0	1,255	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

99

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

472

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

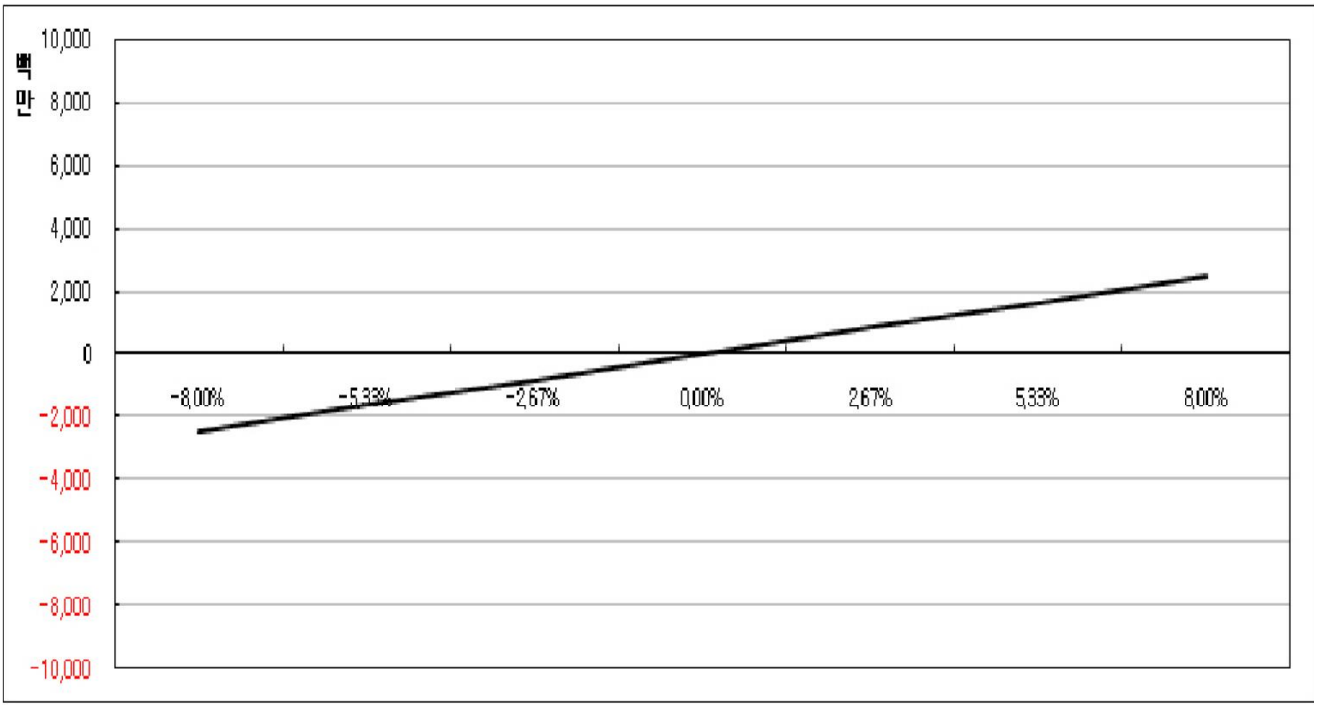
공시일: 2019-12-23

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	4,134	0	4,134	장내
합계			4,134	0	4,134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

327

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

877

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

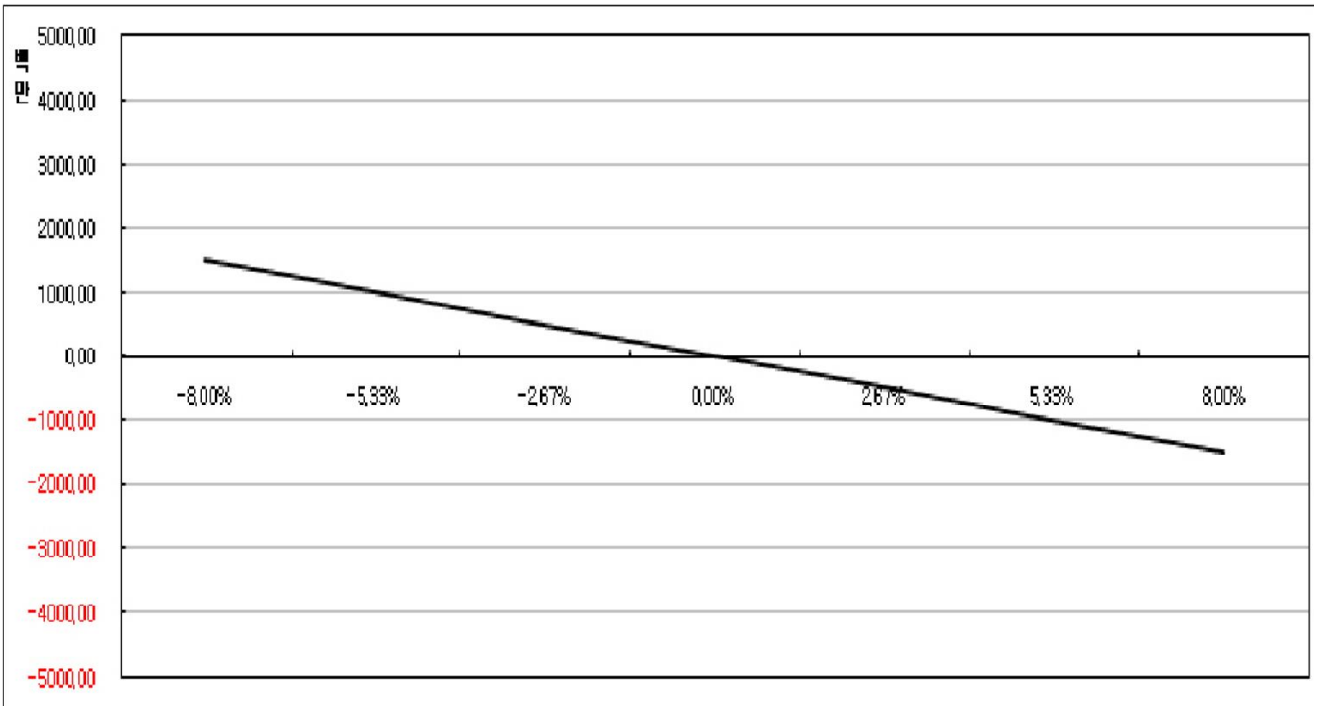
공시일: 2019-12-23

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	0	1,698	-1,698	장내
합계			0	1,698	-1,698	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

134

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

106

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

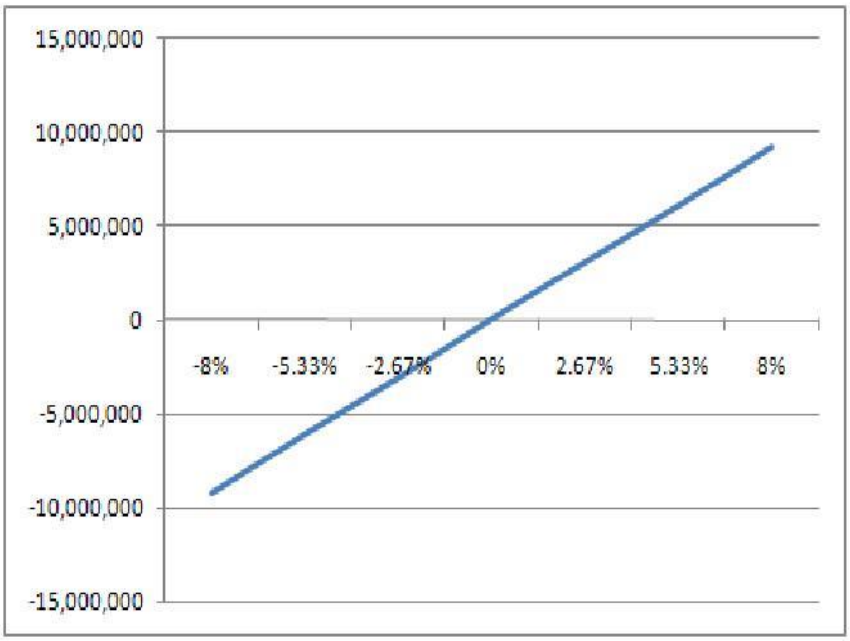
공시일: 2019-12-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	369	-369	장내
누계	주가지수	선물	56,035	0	56,035	장내
합계			56,035	0	56,035	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,436

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,265