펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-12-26

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	1,465	0	1,465	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,783	-2,783	장내
합계			1,465	2,783	-1,318	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

102

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

251

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

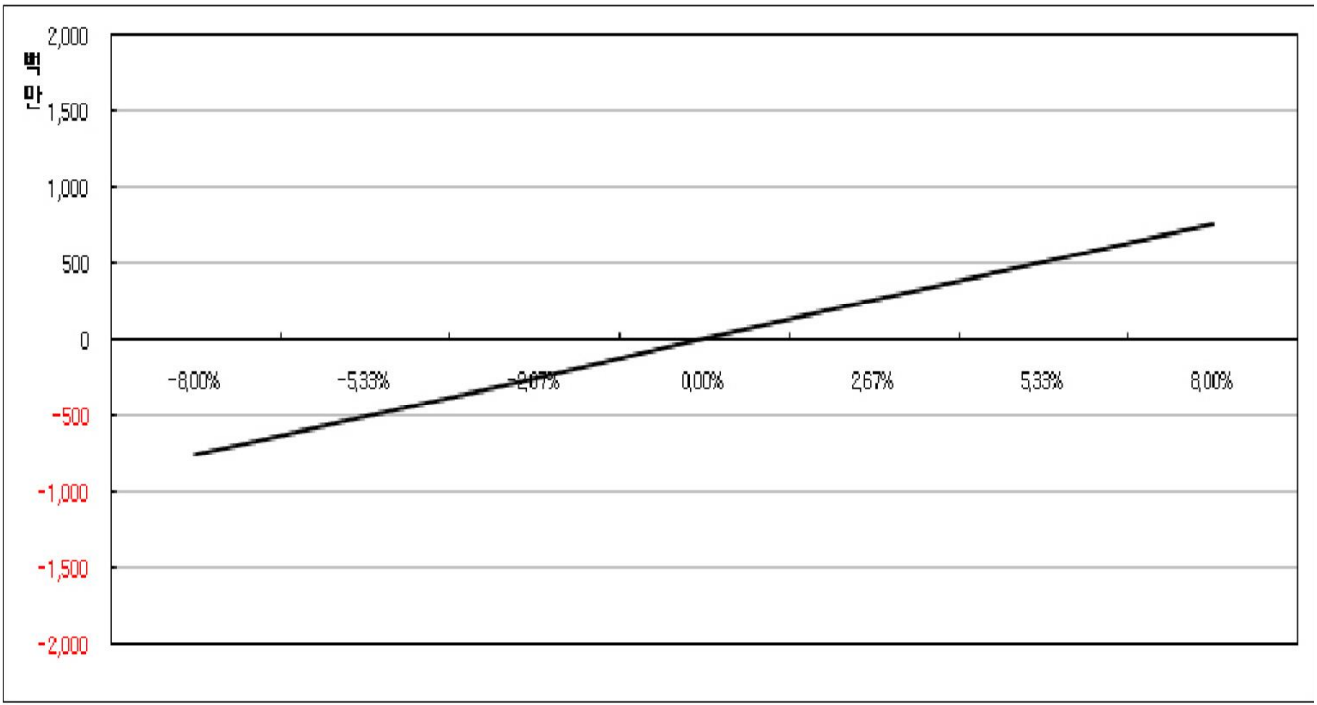
공시일: 2019-12-26

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	220	0	220	장내
합계			220	0	220	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

345

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

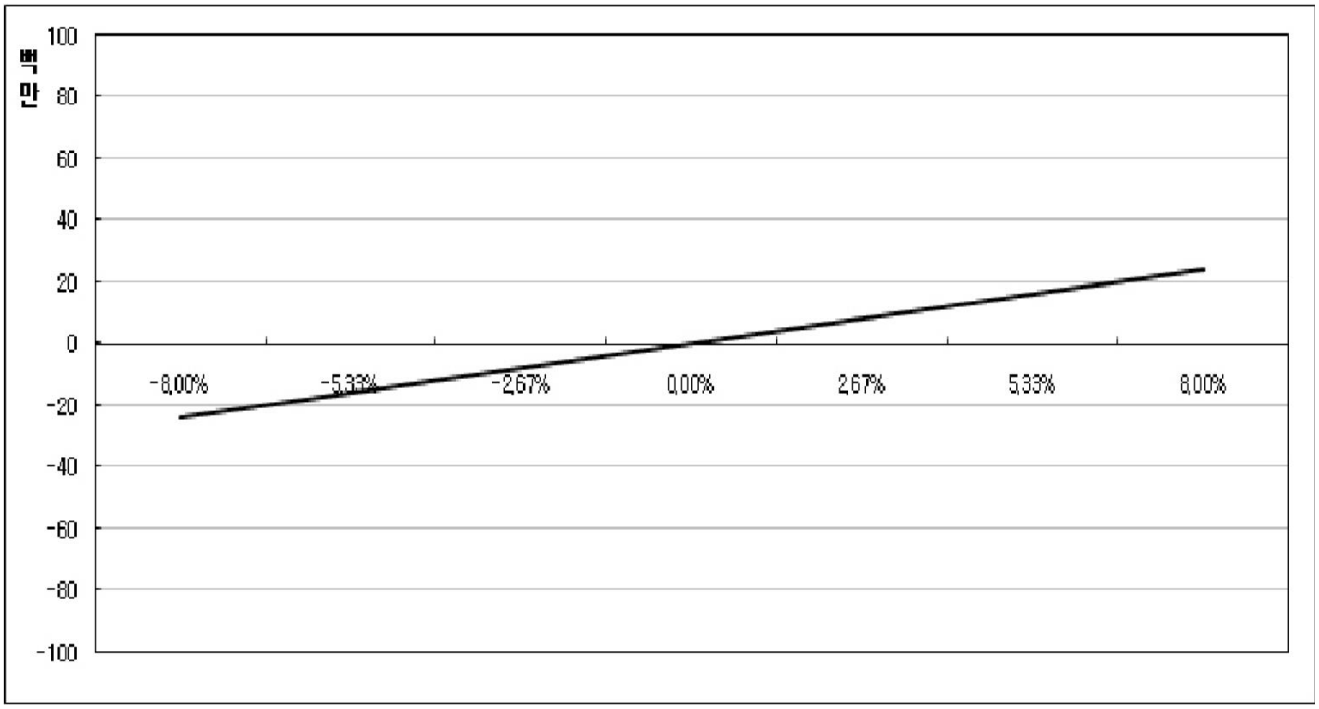
공시일: 2019-12-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	73	-73	장내
누계	주가지수	선물	1,245	0	1,245	장내
합계			1,245	0	1,245	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

98

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

463

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

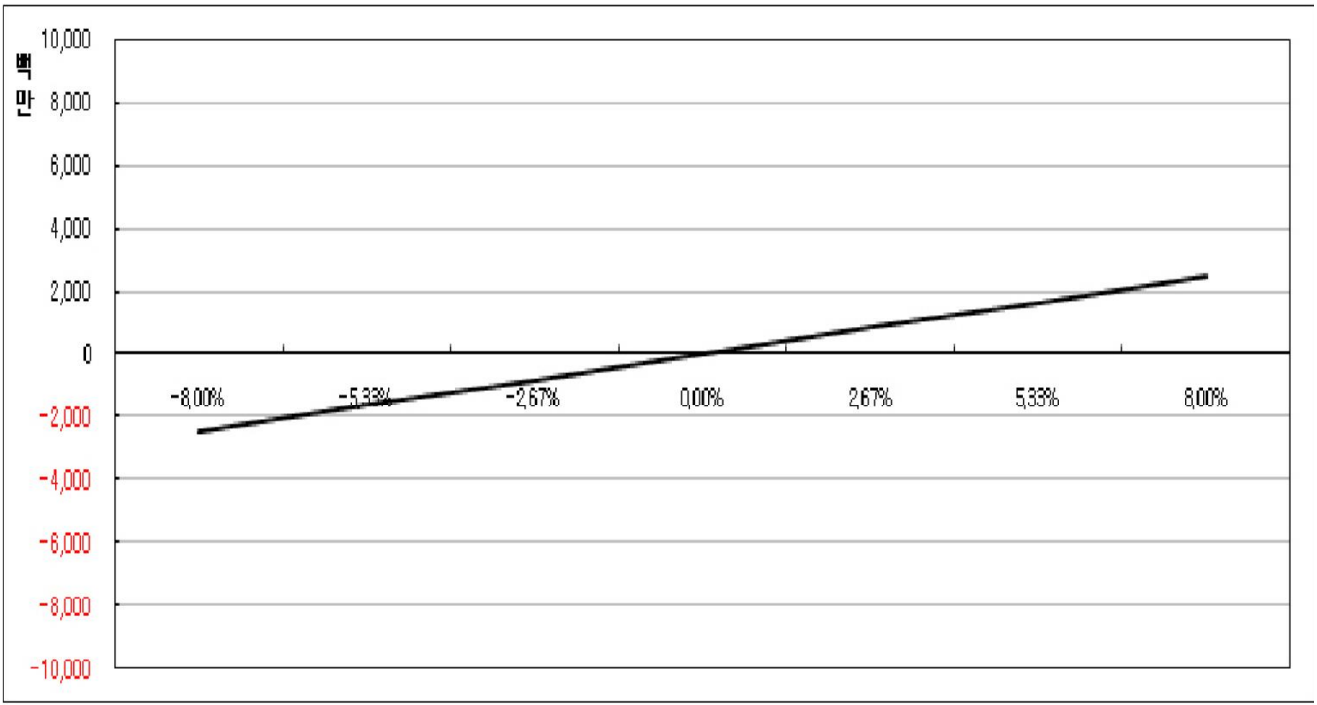
공시일: 2019-12-26

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	3,734	0	3,734	장내
합계			3,734	0	3,734	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

295

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

844

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

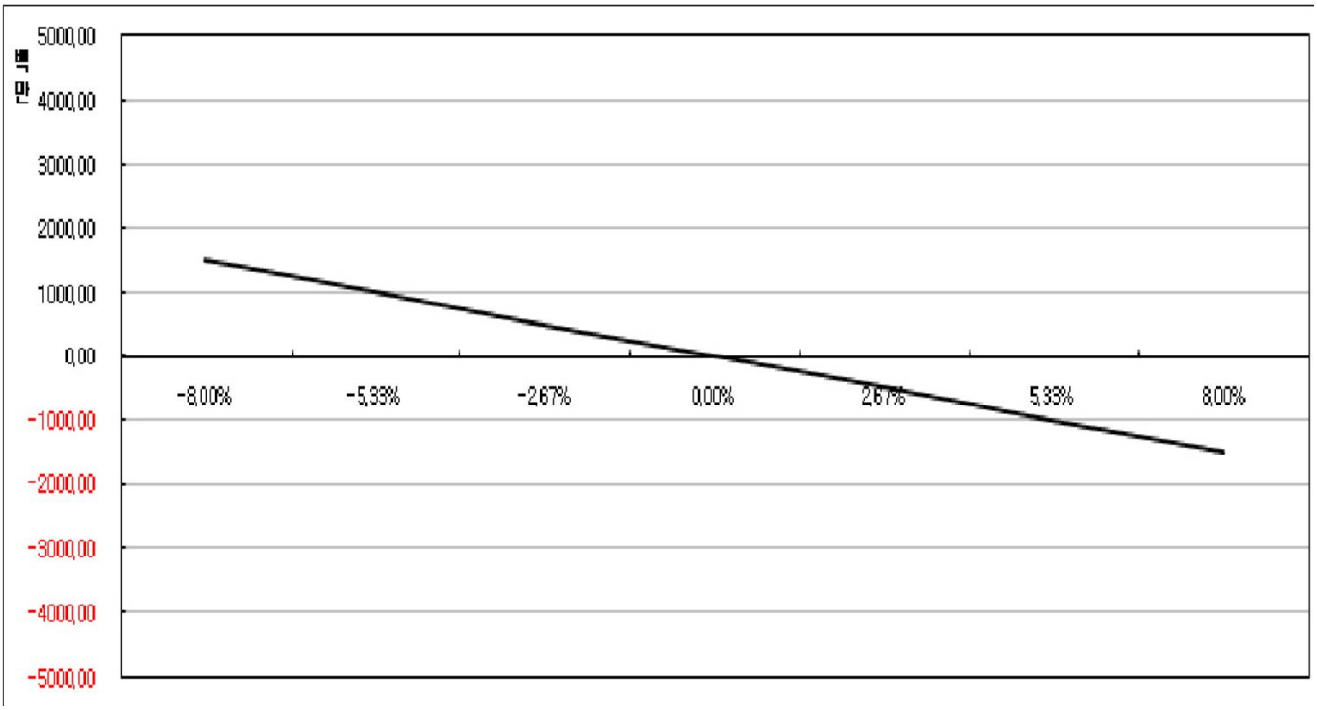
공시일: 2019-12-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	513	-513	장내
누계	주가지수	선물	0	2,343	-2,343	장내
합계			0	2,343	-2,343	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

185

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

146

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

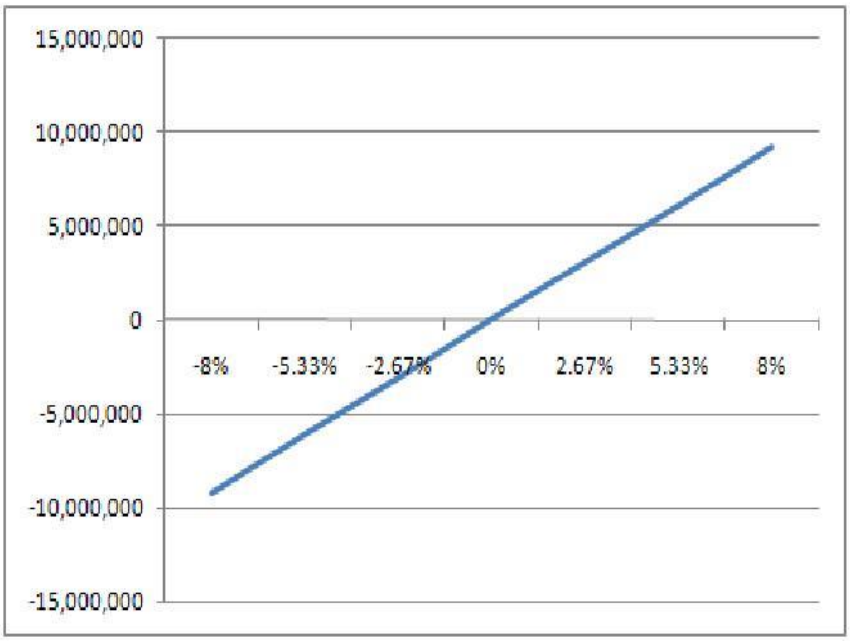
공시일: 2019-12-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	659	-659	장내
누계	주가지수	선물	53,674	0	53,674	장내
합계			53,674	0	53,674	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,247

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,022