펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-12-31

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	1,469	0	1,469	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,791	-2,791	장내
합계			1,469	2,791	-1,322	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

99

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

293

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

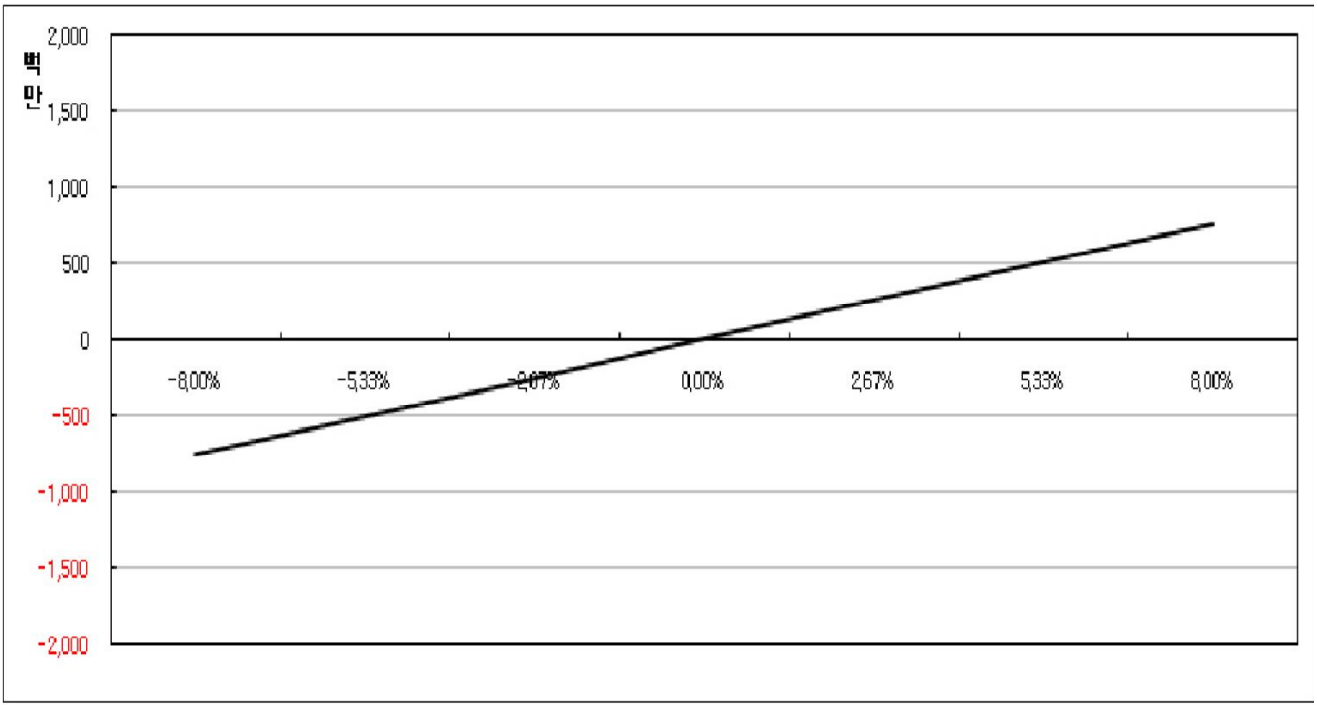
공시일: 2019-12-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	73	0	73	장내
누계	주가지수	선물	294	0	294	장내
합계			294	0	294	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

350

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

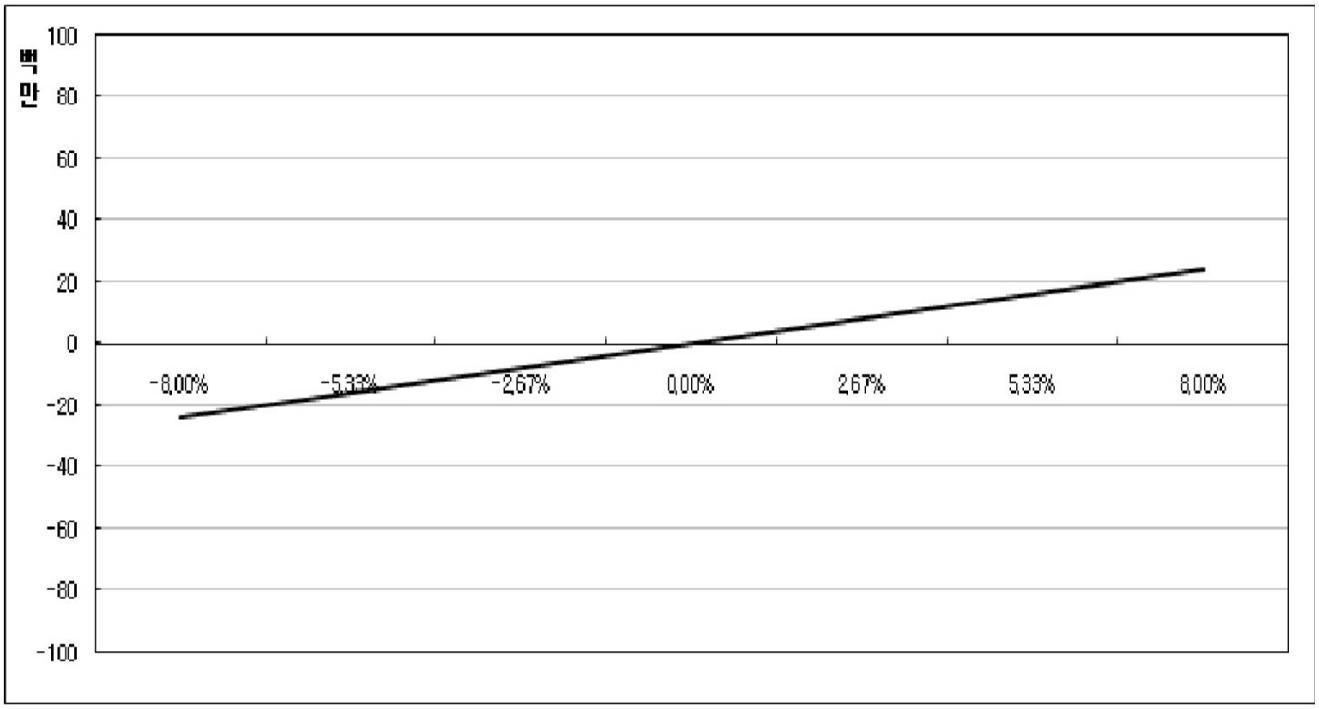
공시일: 2019-12-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	73	0	73	장내
누계	주가지수	선물	1,322	0	1,322	장내
합계			1,322	0	1,322	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

106

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

470

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

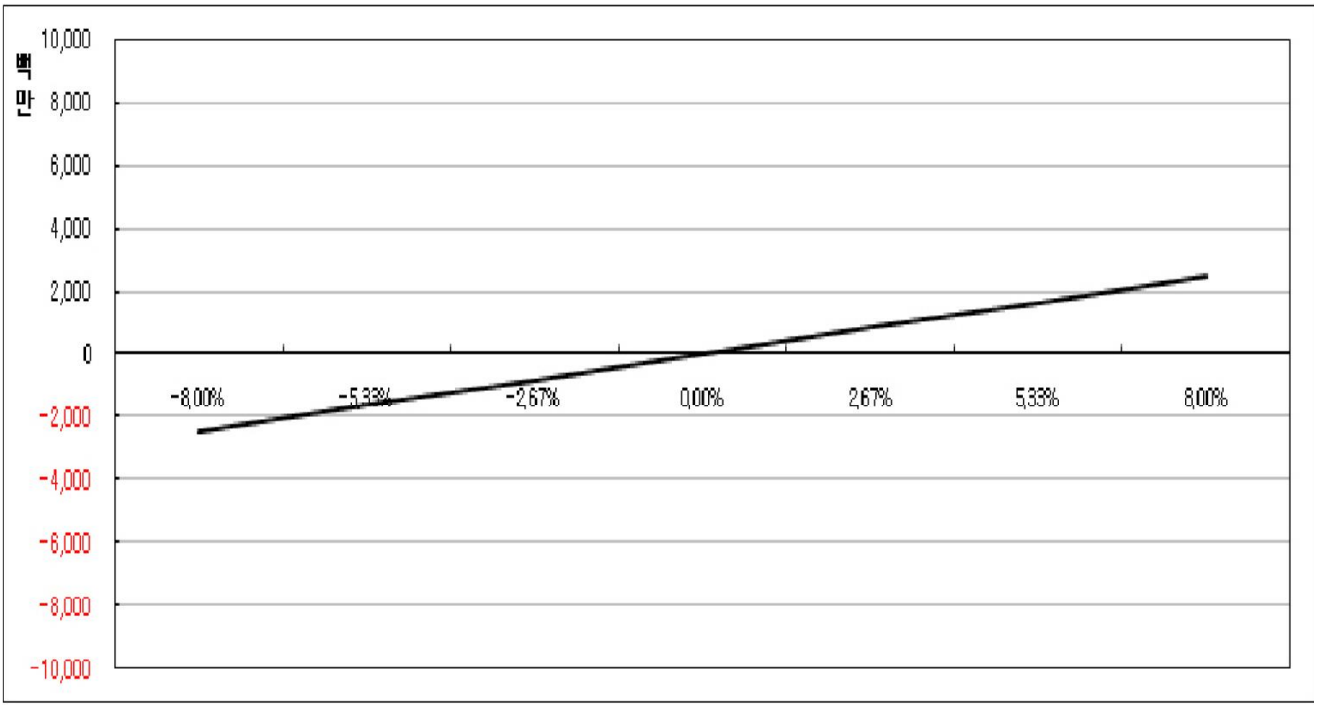
공시일: 2019-12-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	220	0	220	장내
누계	주가지수	선물	3,892	0	3,892	장내
합계			3,892	0	3,892	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

313

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

857

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

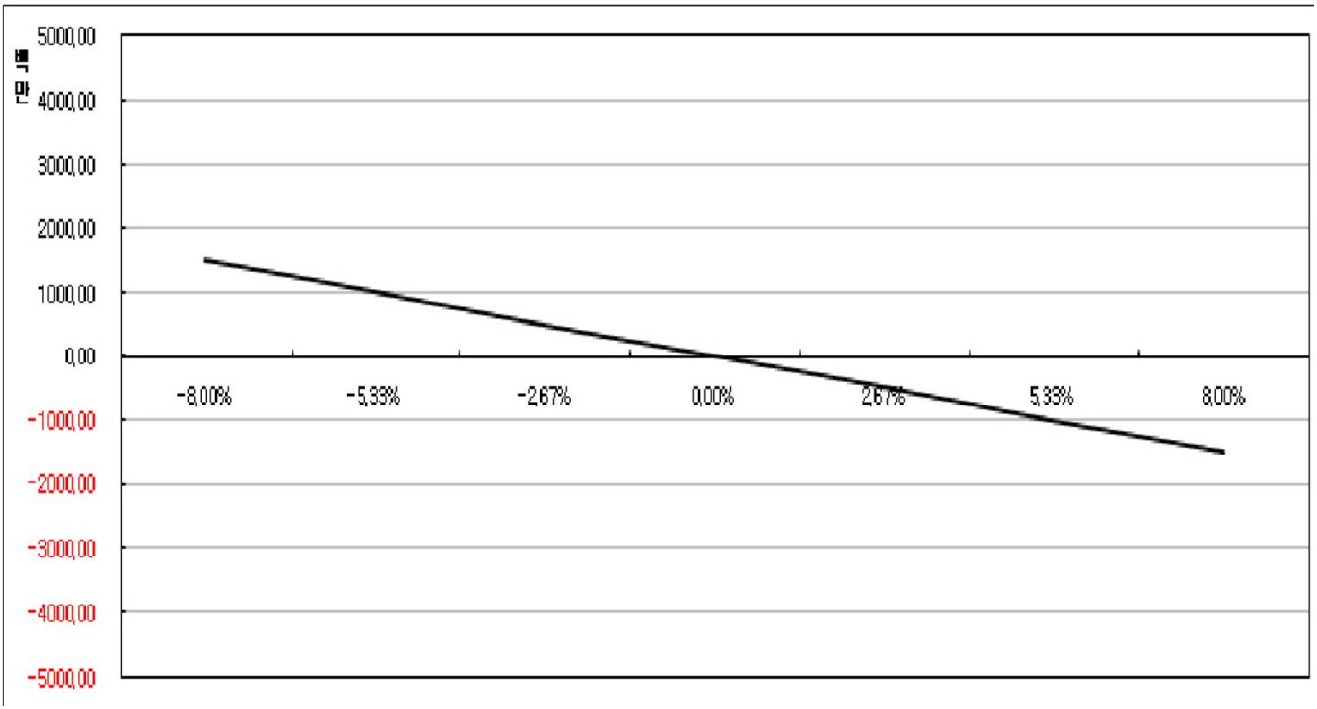
공시일: 2019-12-31

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	2,203	-2,203	장내
합계			0	2,203	-2,203	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

177

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

139

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

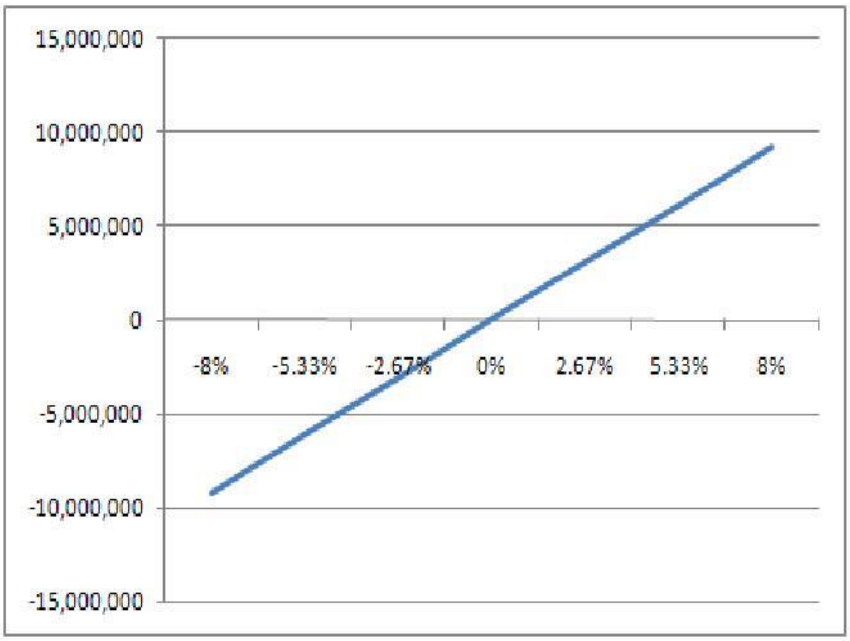
공시일: 2019-12-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,763	1,763	0	장내
누계	주가지수	선물	55,523	0	55,523	장내
합계			55,523	0	55,523	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,463

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,171