펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-12

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	2,676	0	2,676	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	5,352	-5,342	장내
합계			2,686	5,352	-2,666	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

130

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

938

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

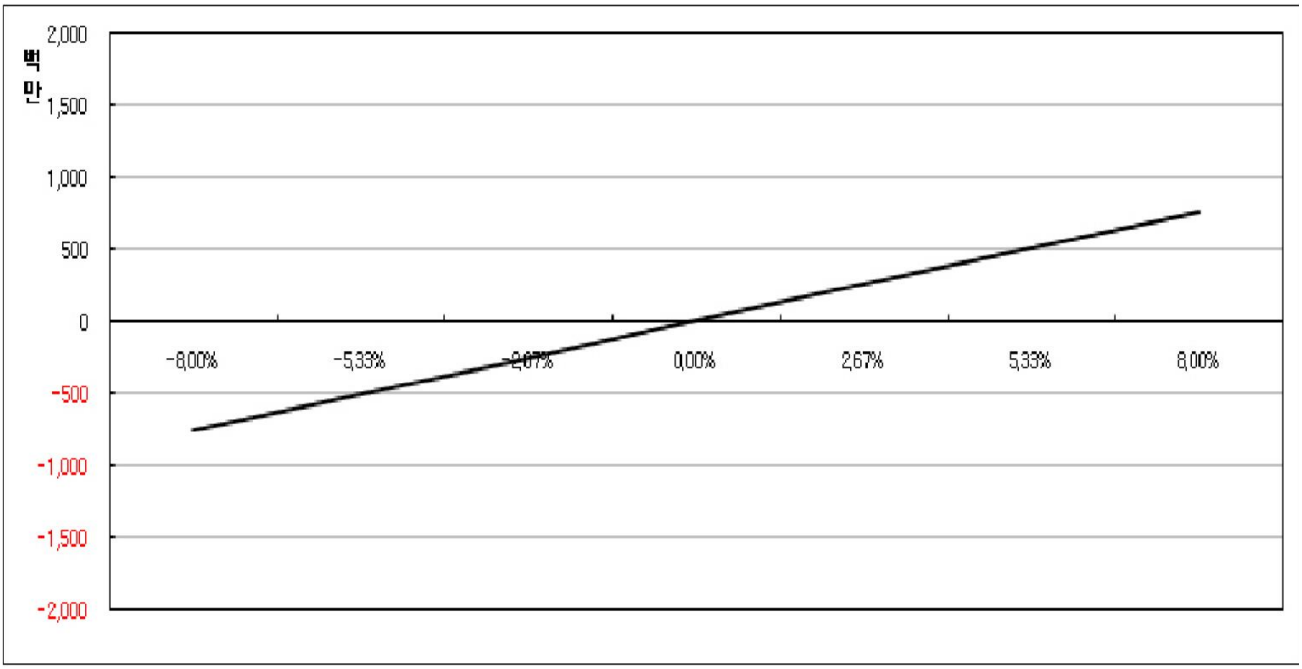
공시일: 2019-08-12

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	127	0	127	장내
합계			127	0	127	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

392

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

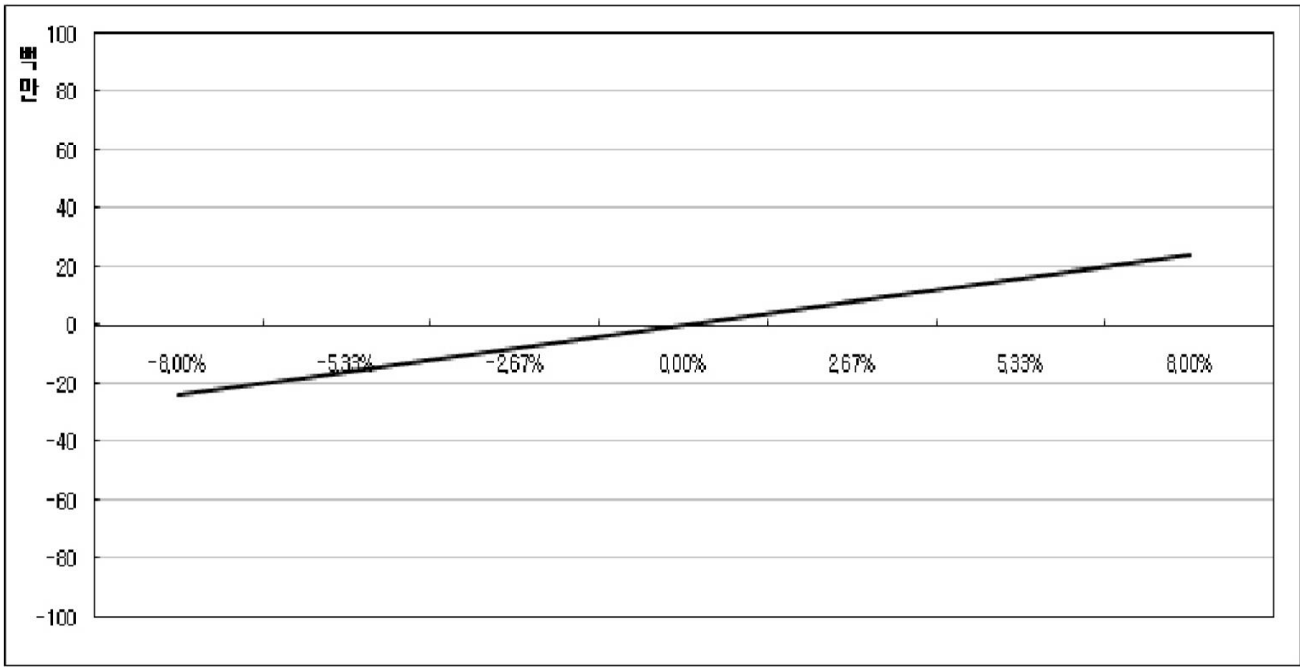
공시일: 2019-08-12

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	956	0	956	장내
합계			956	0	956	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

475

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

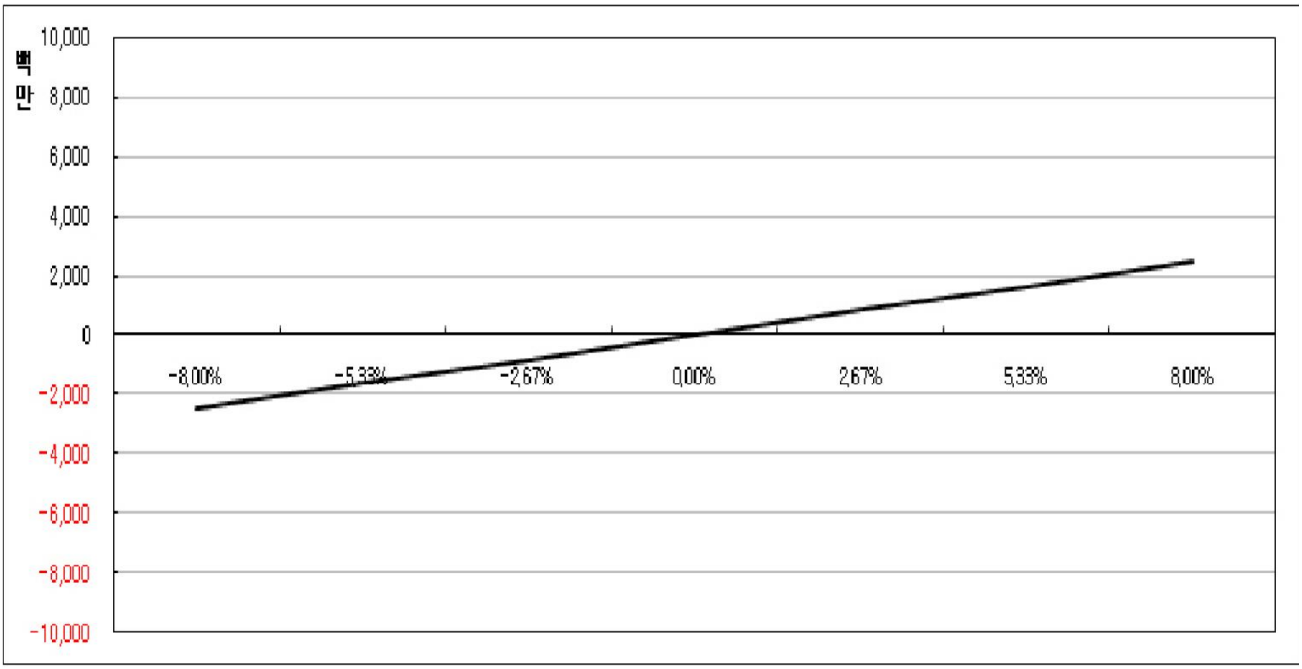
공시일: 2019-08-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	64	-64	장내
누계	주가지수	선물	4,715	0	4,715	장내
합계			4,715	0	4,715	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

378

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

933

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

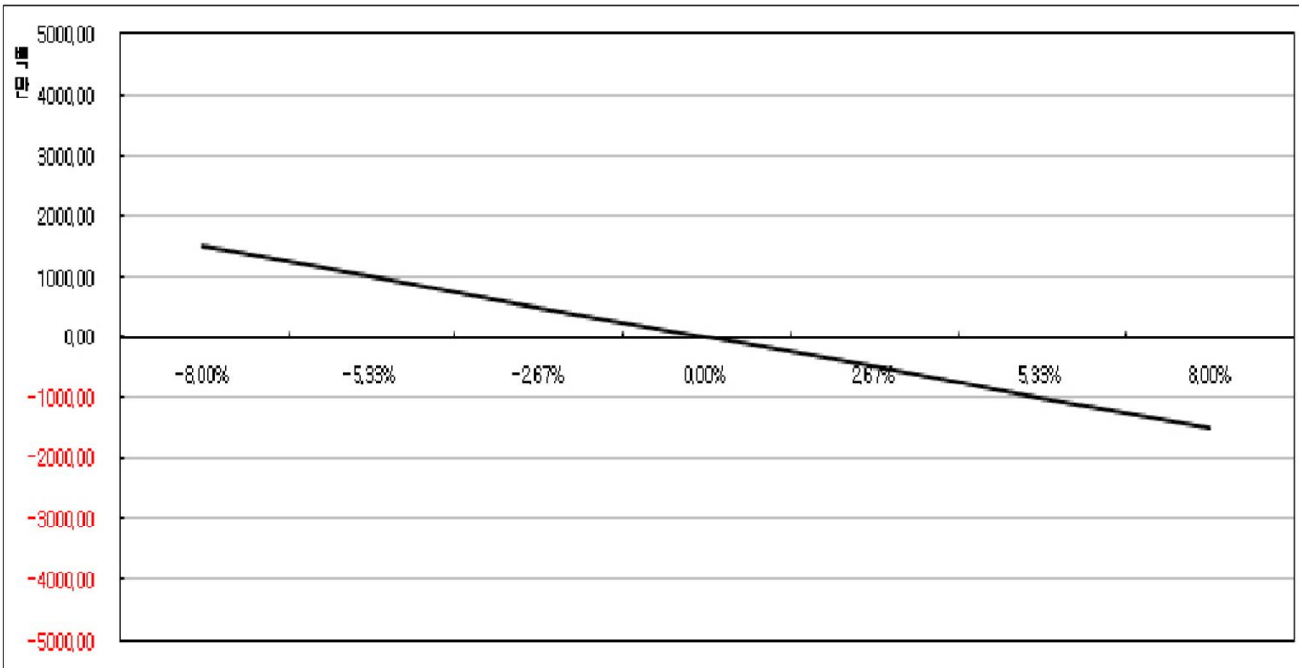
공시일: 2019-08-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	127	0	127	장내
누계	주가지수	선물	0	1,657	-1,657	장내
합계			0	1,657	-1,657	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

114

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

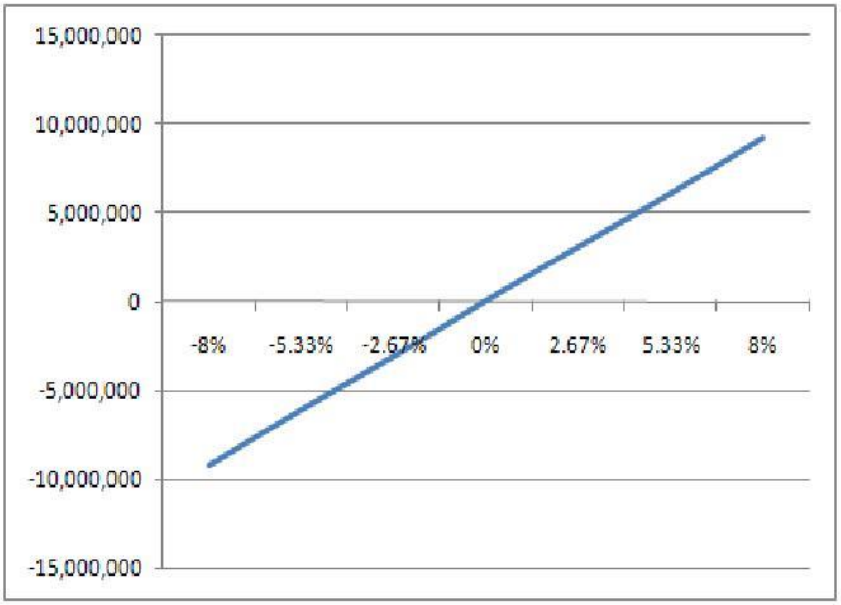
공시일: 2019-08-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,019	0	1,019	장내
누계	주가지수	선물	66,962	0	66,962	장내
합계			66,962	0	66,962	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,365

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,008