펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-14

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	2,655	0	2,655	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	14	5,309	-5,295	장내
합계			2,669	5,309	-2,641	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

117

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

478

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

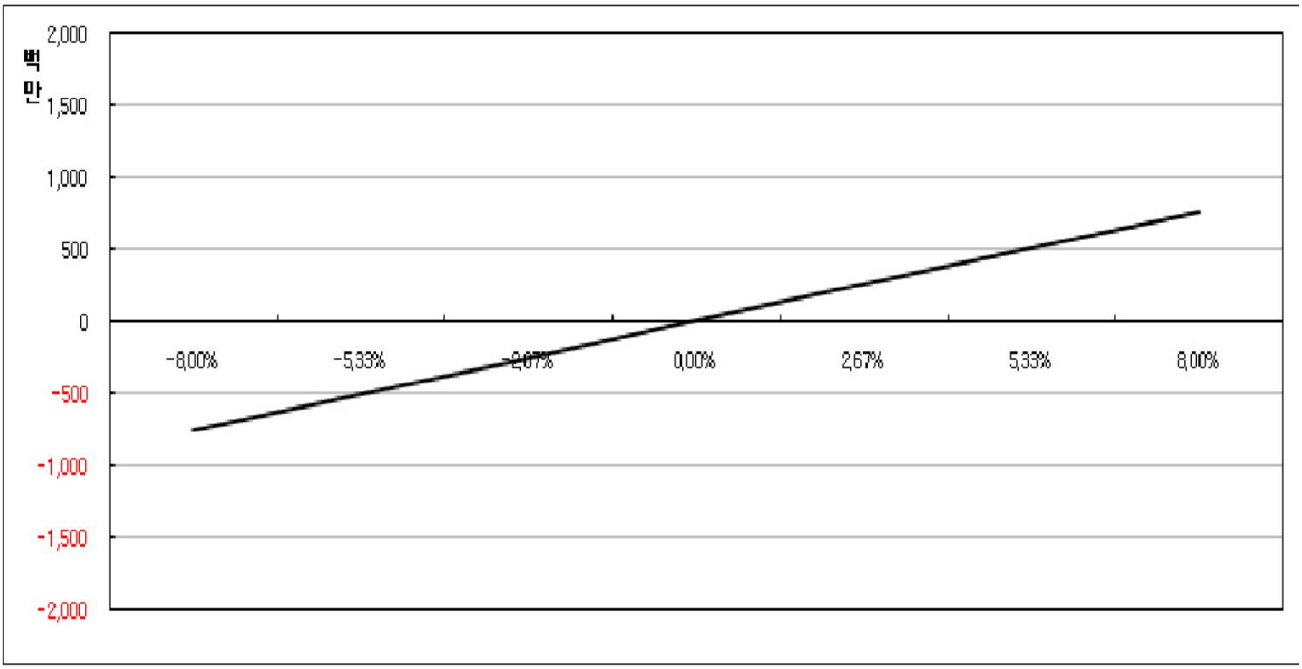
공시일: 2019-08-14

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	126	0	126	장내
합계			126	0	126	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

388

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

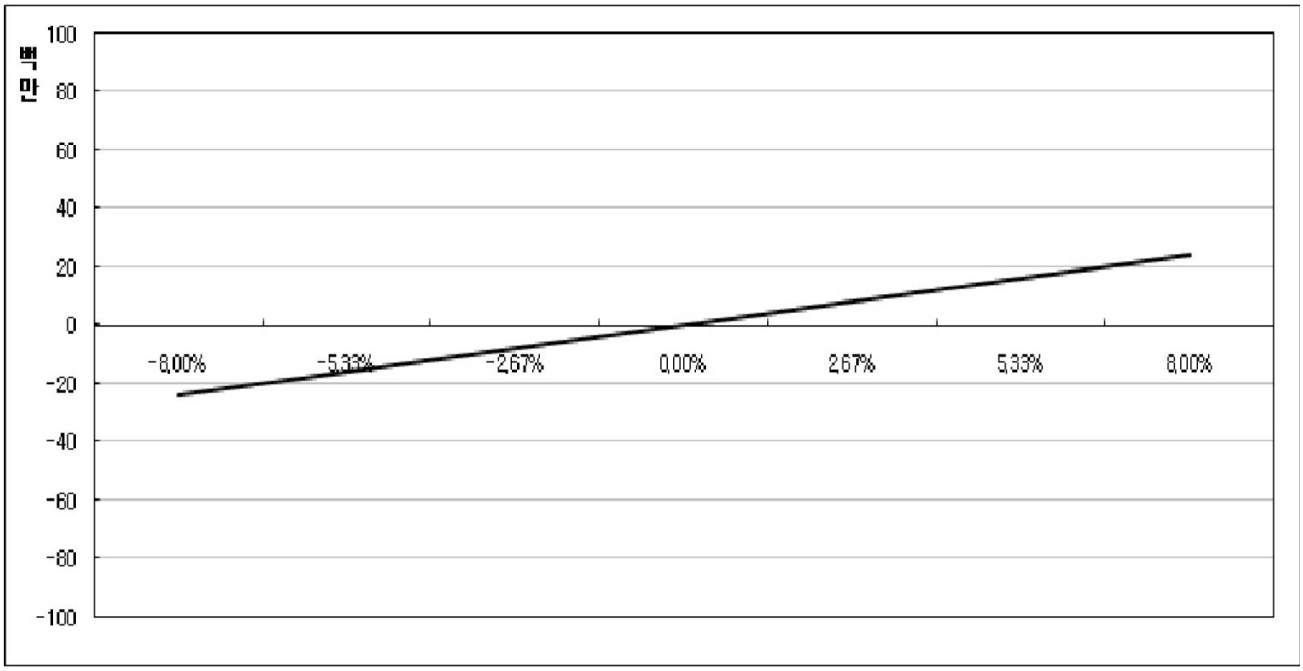
공시일: 2019-08-14

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	948	0	948	장내
합계			948	0	948	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

469

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

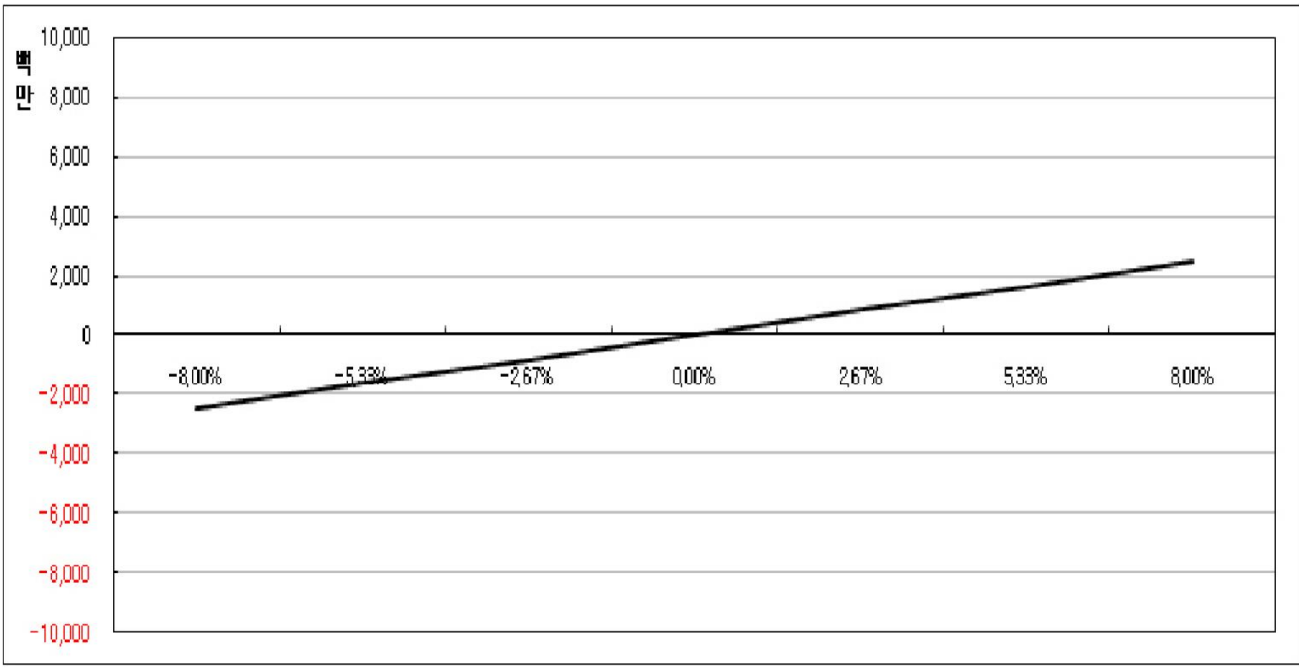
공시일: 2019-08-14

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	4,741	0	4,741	장내
합계			4,741	0	4,741	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

378

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

924

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

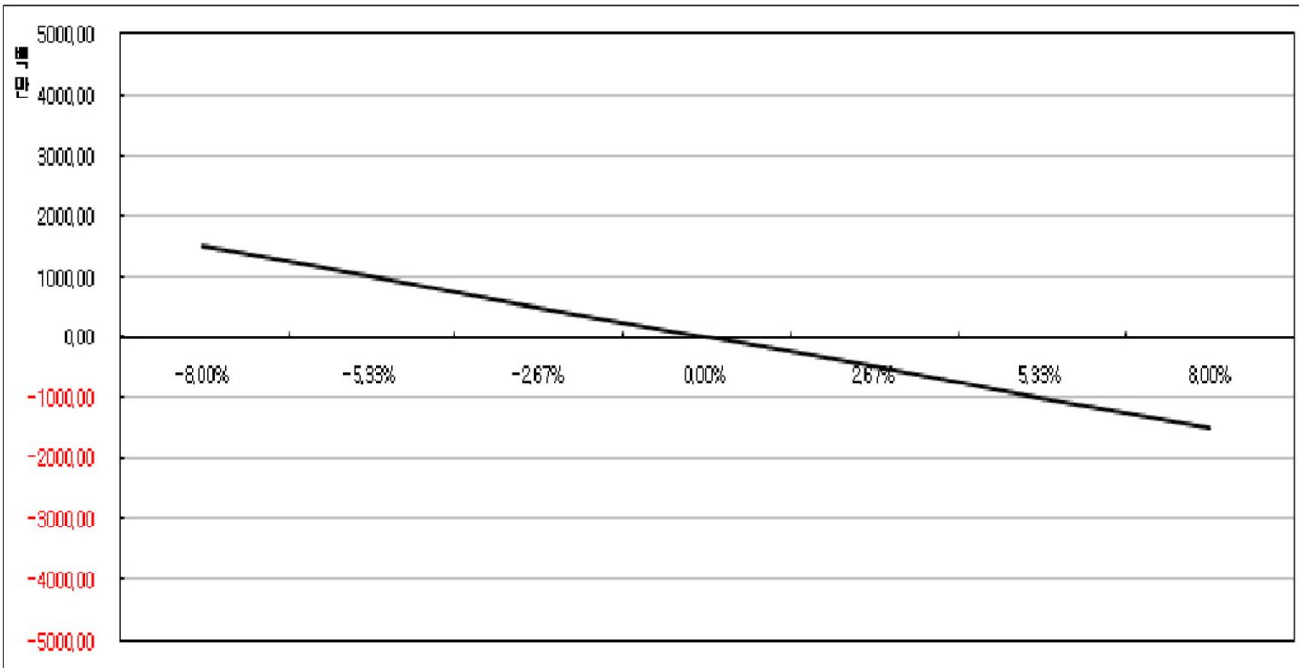
공시일: 2019-08-14

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	1,959	-1,959	장내
합계			0	1,959	-1,959	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

156

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

134

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

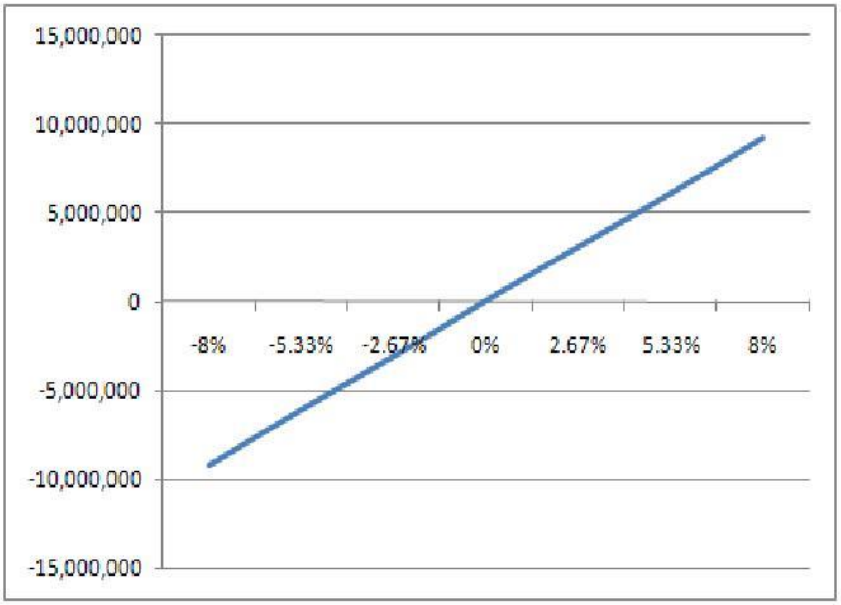
공시일: 2019-08-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	506	-506	장내
누계	주가지수	선물	66,241	0	66,241	장내
합계			66,241	0	66,241	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,283

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,866