펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	832	-832	장내
누계	주가지수	선물	1,729	0	1,729	장내
신규	주가지수	옵션	30	0	30	장내
누계	주가지수	옵션	5	3,329	-3,324	장내
합계			1,734	3,329	-1,595	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	310

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

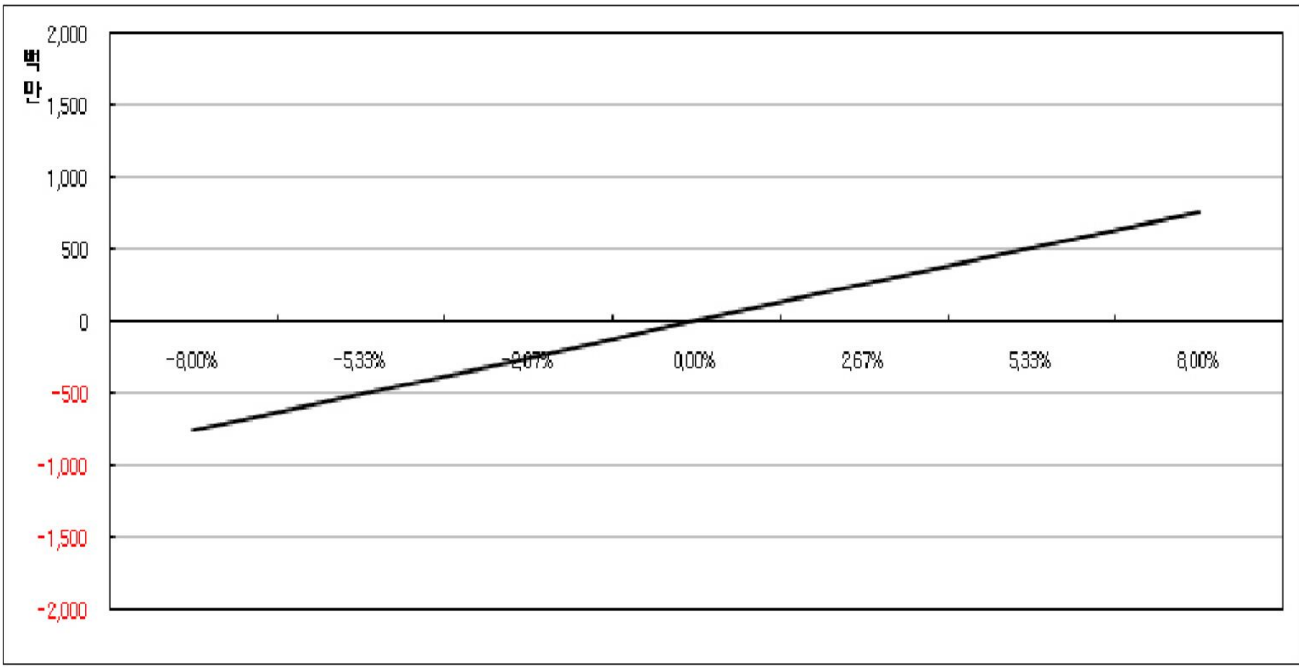
공시일: 2019-08-26

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	128	0	128	장내
합계			128	0	128	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

396

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

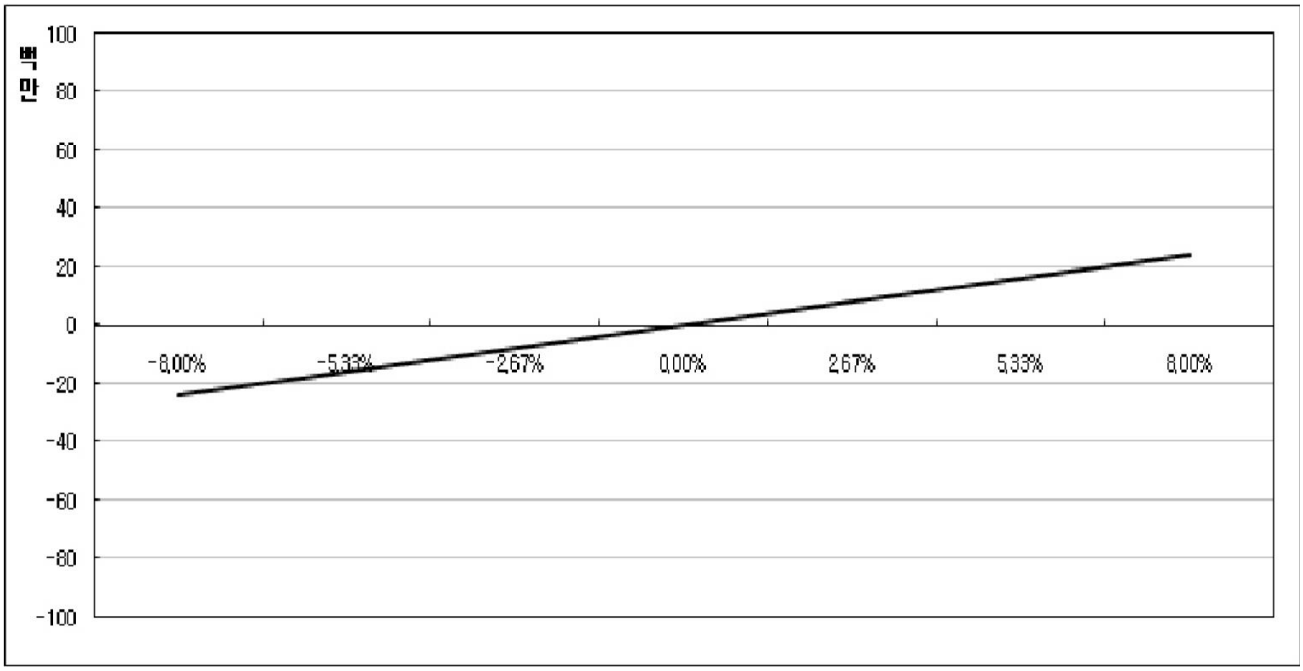
공시일: 2019-08-26

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	960	0	960	장내
합계			960	0	960	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

480

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

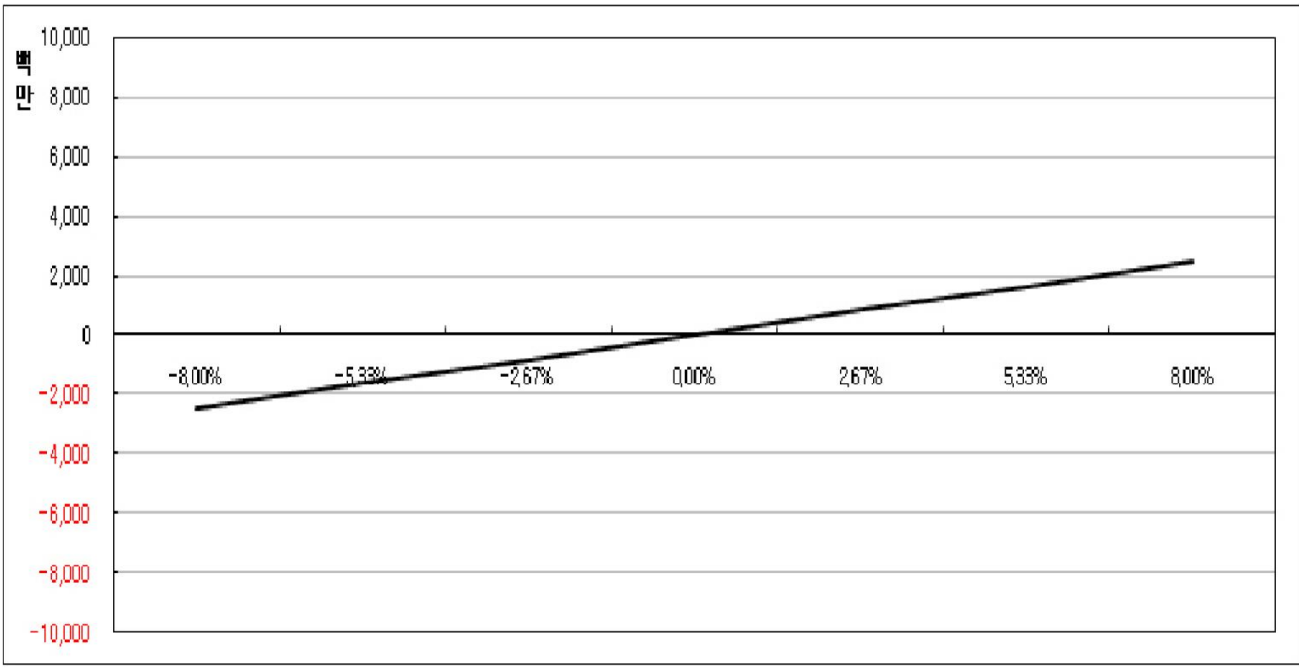
공시일: 2019-08-26

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	4,994	0	4,994	장내
합계			4,994	0	4,994	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

400

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

956

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

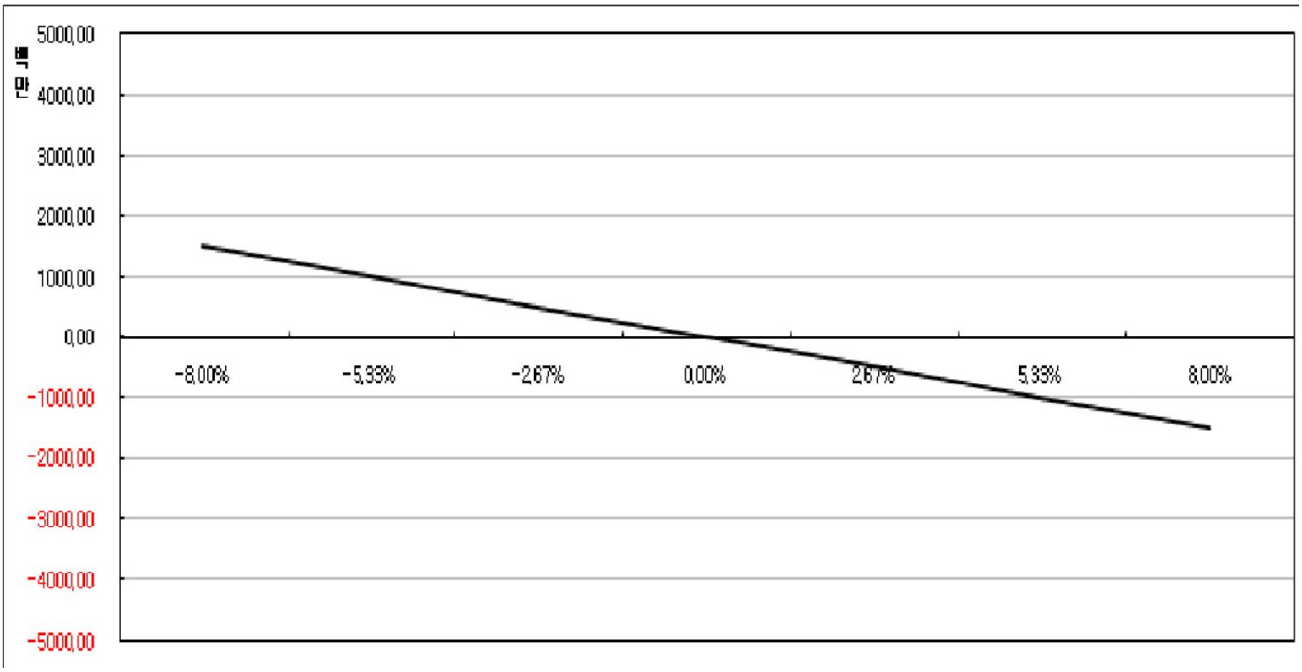
공시일: 2019-08-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	192	192	0	장내
누계	주가지수	선물	0	1,665	-1,665	장내
합계			0	1,665	-1,665	

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]

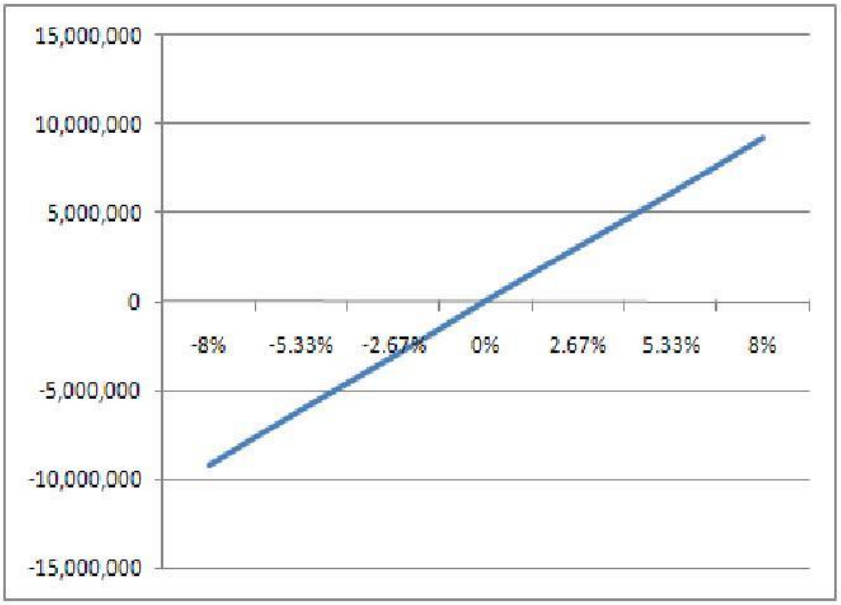
공시일: 2019-08-26

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	68,573	0	68,573	장내
합계			68,573	0	68,573	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,491

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,172