펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-29

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	1,725	0	1,725	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	3,322	-3,317	장내
합계			1,730	3,322	-1,592	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	88

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	206

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

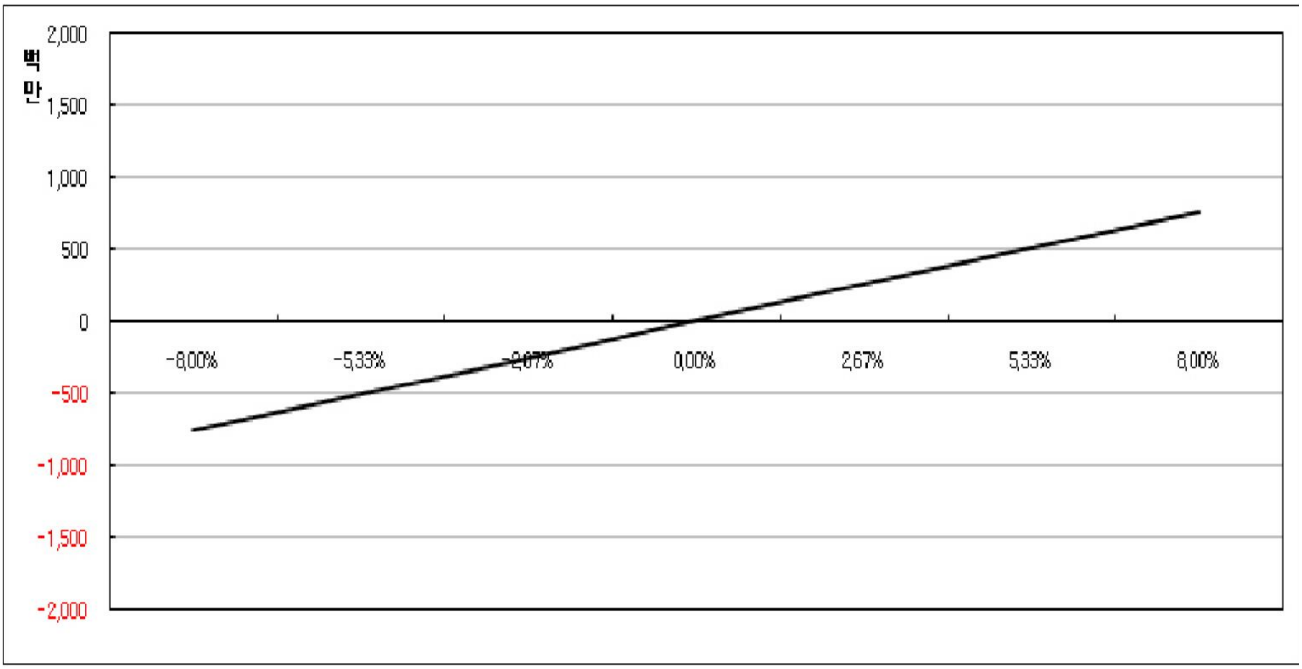
공시일: 2019-08-29

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)

397

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

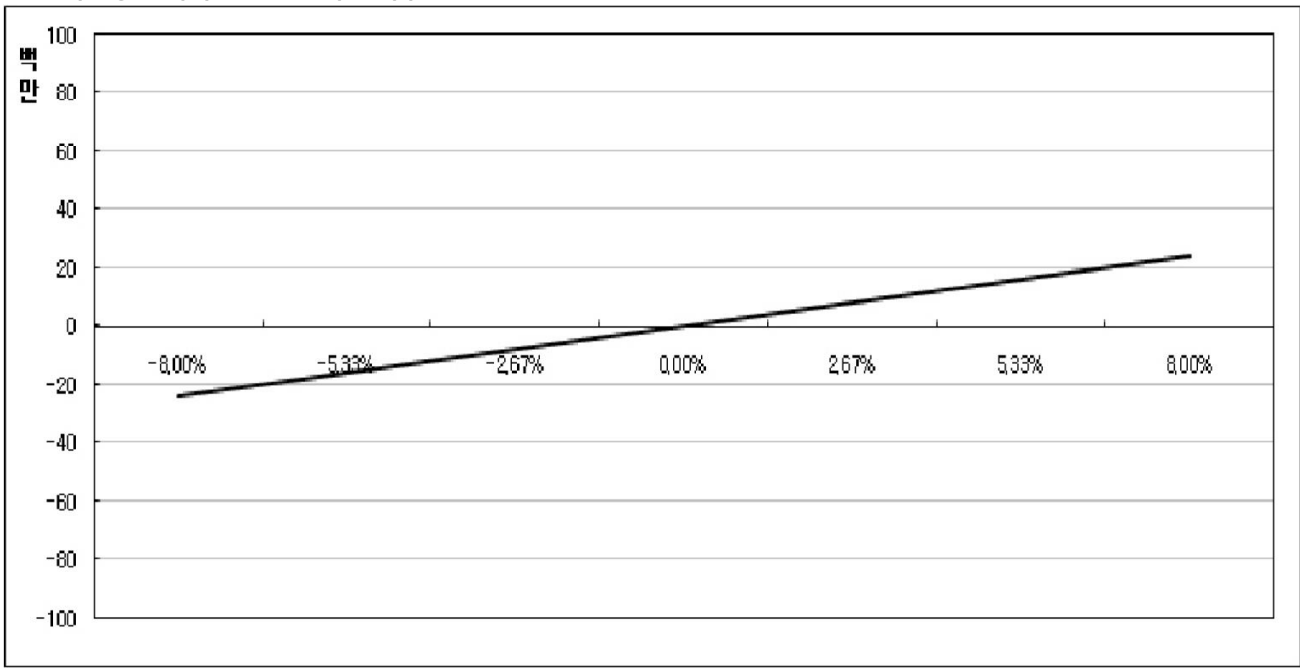
공시일: 2019-08-29

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	958	0	958	장내
합계			958	0	958	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

481

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

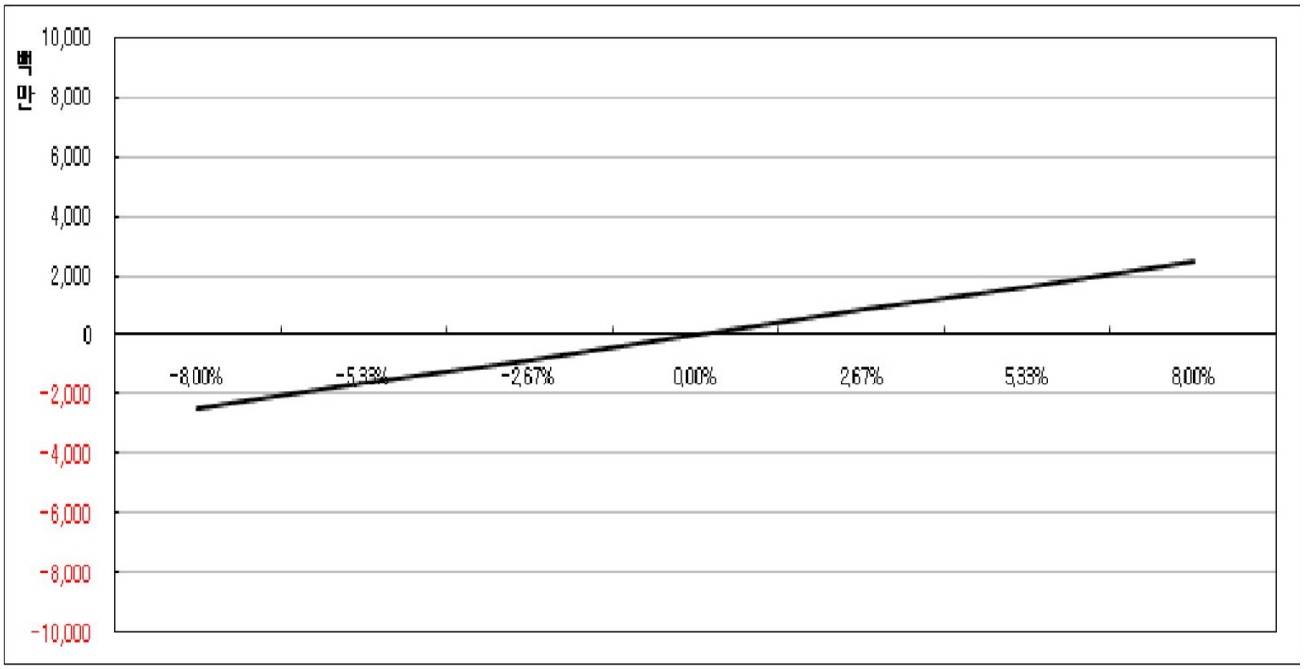
공시일: 2019-08-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	128	0	128	장내
누계	주가지수	선물	4,983	0	4,983	장내
합계			4,983	0	4,983	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

399

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

960

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

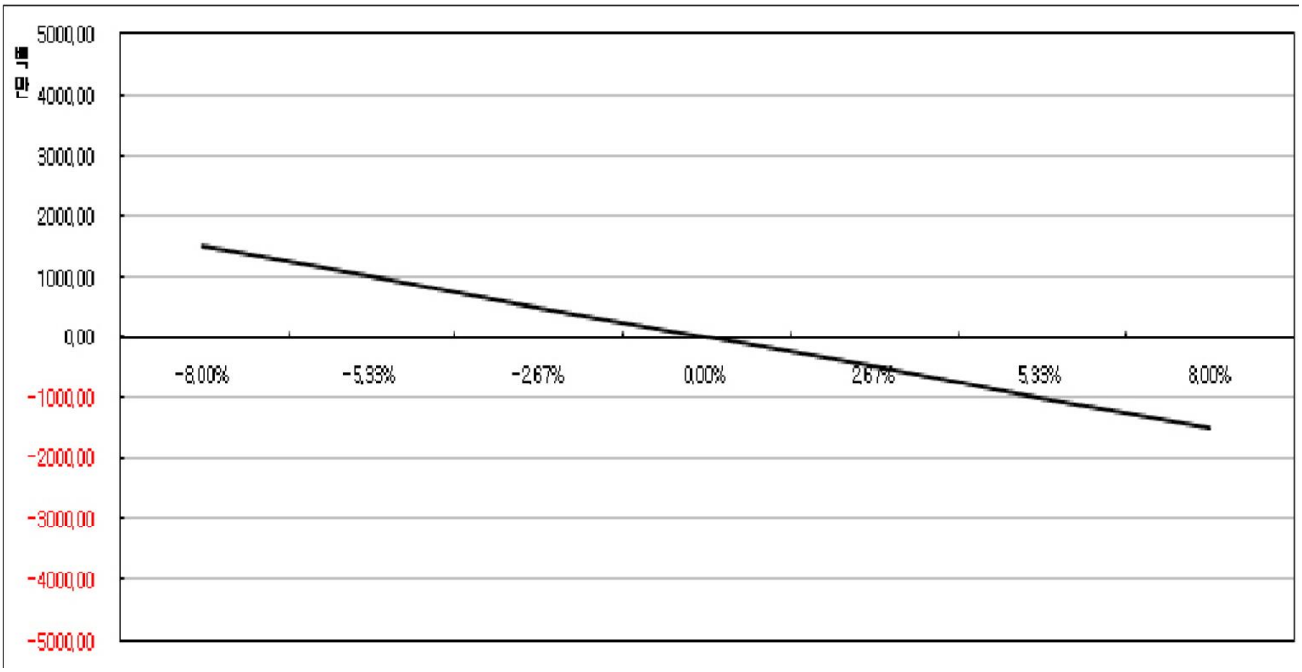
공시일: 2019-08-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	192	0	192	장내
누계	주가지수	선물	0	1,661	-1,661	장내
합계			0	1,661	-1,661	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

115

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

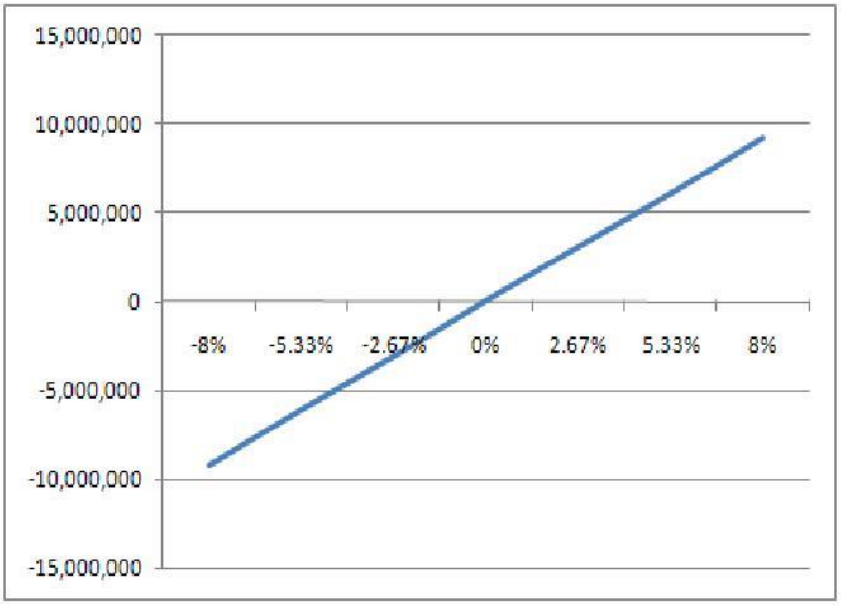
공시일: 2019-08-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	639	0	639	장내
누계	주가지수	선물	68,738	0	68,738	장내
합계			68,738	0	68,738	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,506

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,233