펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-02

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	1,748	0	1,748	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	3,367	-3,364	장내
합계			1,751	3,367	-1,616	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	270

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

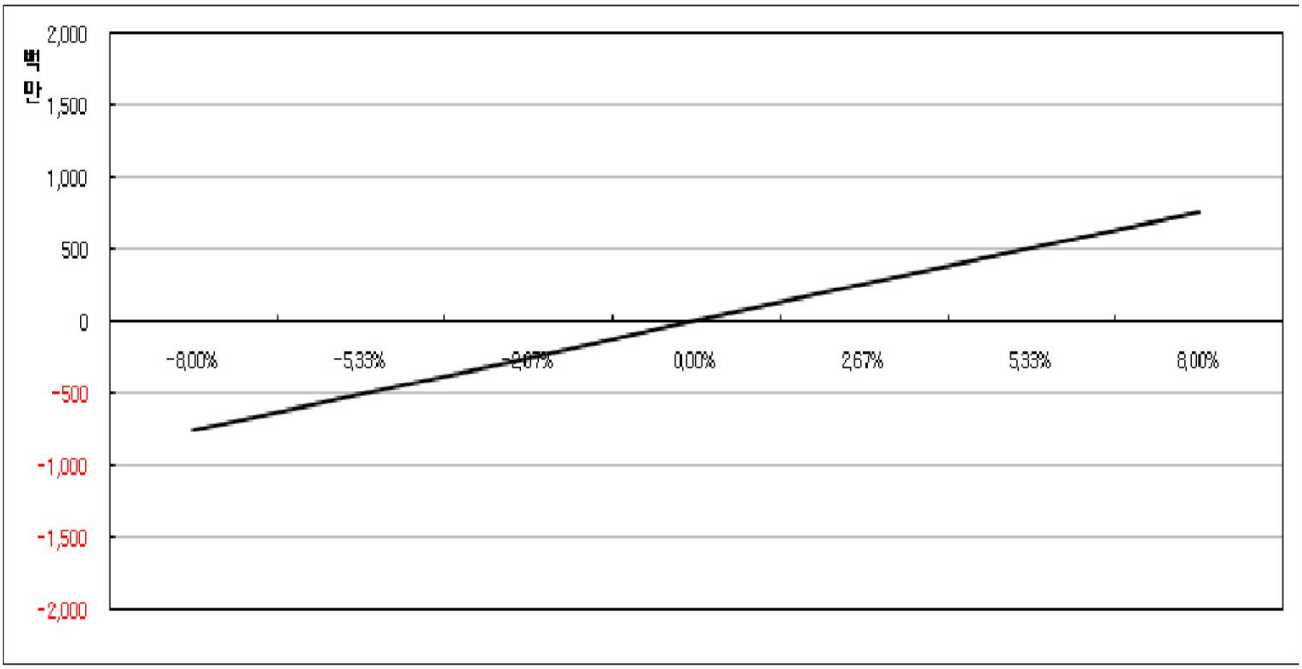
공시일: 2019-09-02

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	130	0	130	장내
합계			130	0	130	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

402

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

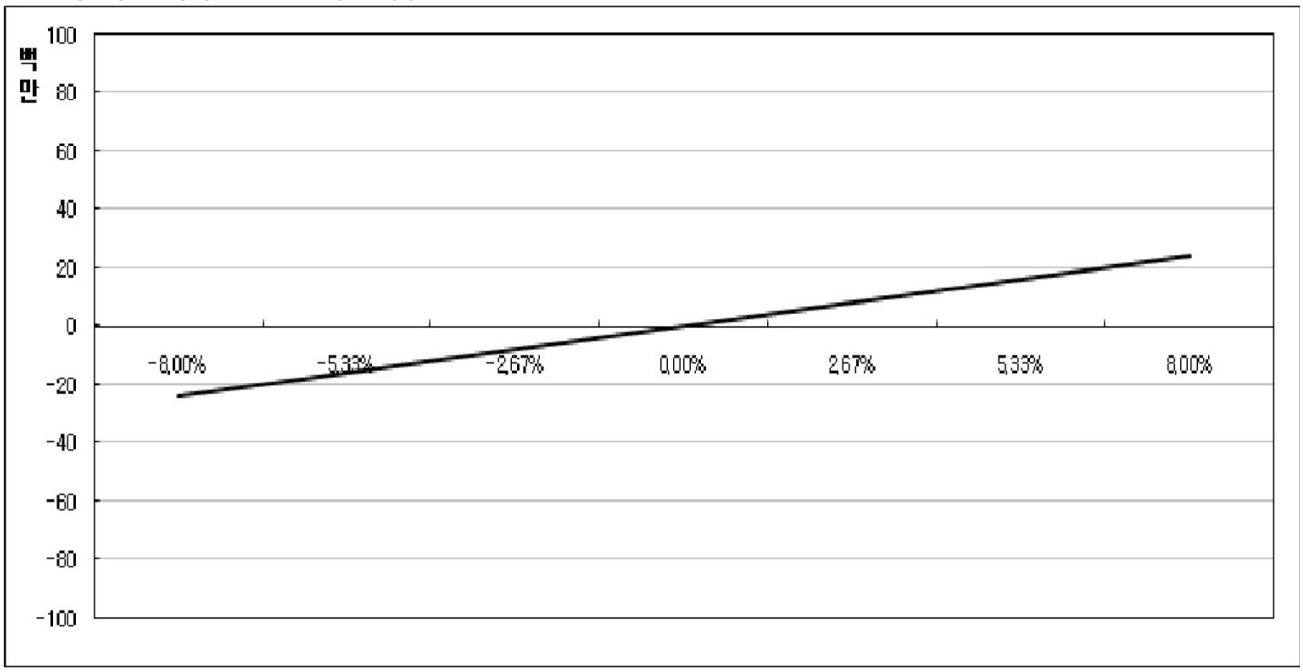
공시일: 2019-09-02

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	1,036	0	1,036	장내
합계			1,036	0	1,036	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

83

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

490

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

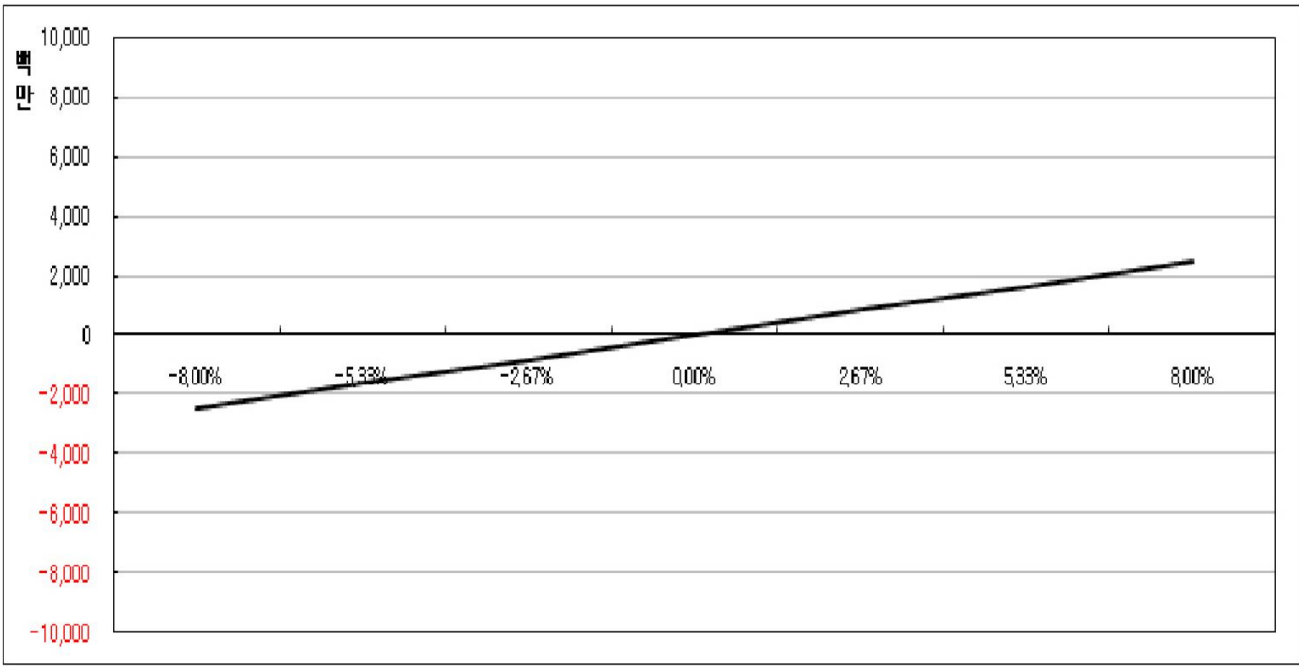
공시일: 2019-09-02

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	4,921	0	4,921	장내
합계			4,921	0	4,921	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

394

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

967

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

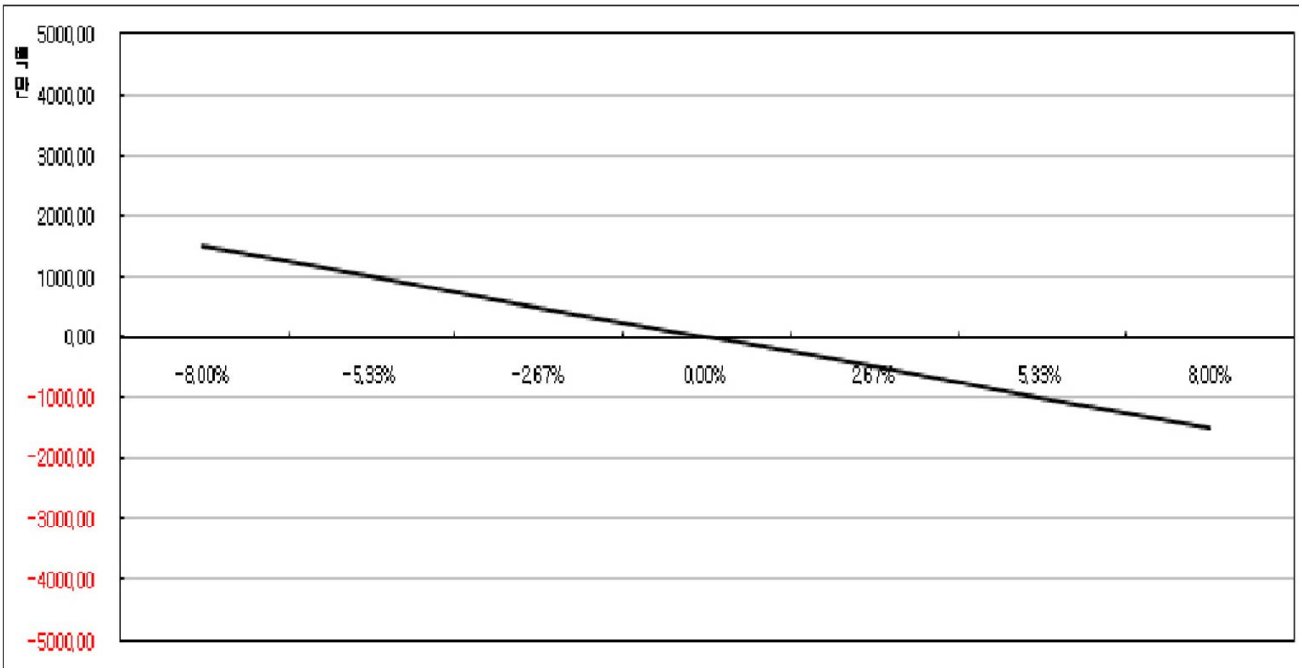
공시일: 2019-09-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	130	259	-130	장내
누계	주가지수	선물	0	1,748	-1,748	장내
합계			0	1,748	-1,748	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

140

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

121

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

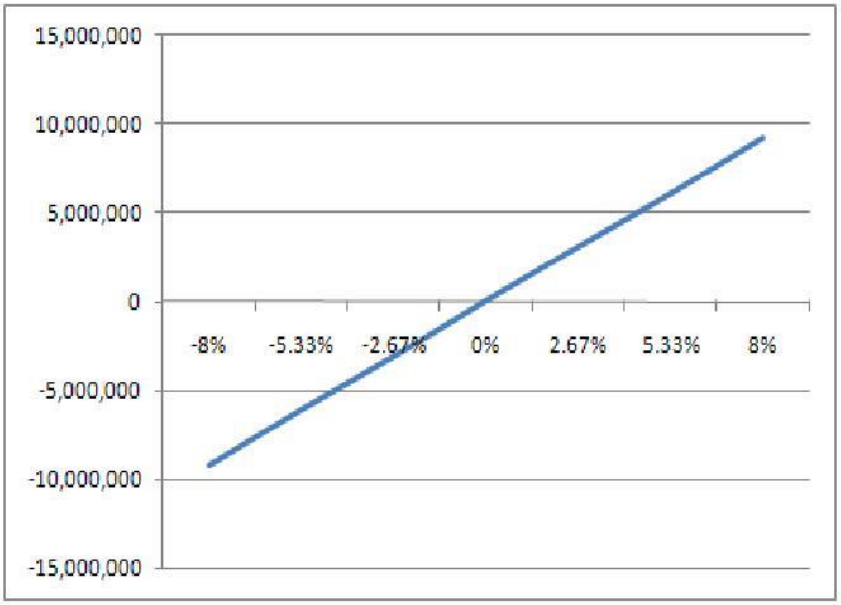
공시일: 2019-09-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	971	0	971	장내
누계	주가지수	선물	69,671	0	69,671	장내
합계			69,671	0	69,671	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,577

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,374