펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-03

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	1,749	0	1,749	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	3,368	-3,366	장내
합계			1,751	3,368	-1,617	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

218

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

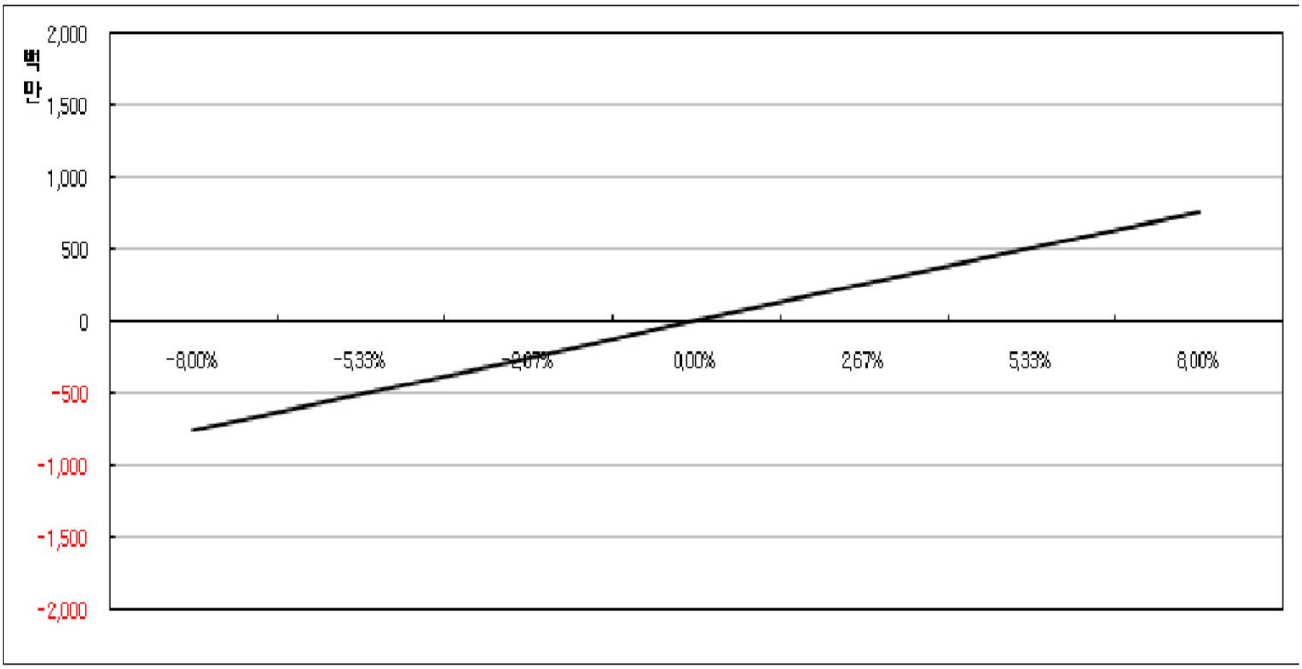
공시일: 2019-09-03

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)

403

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

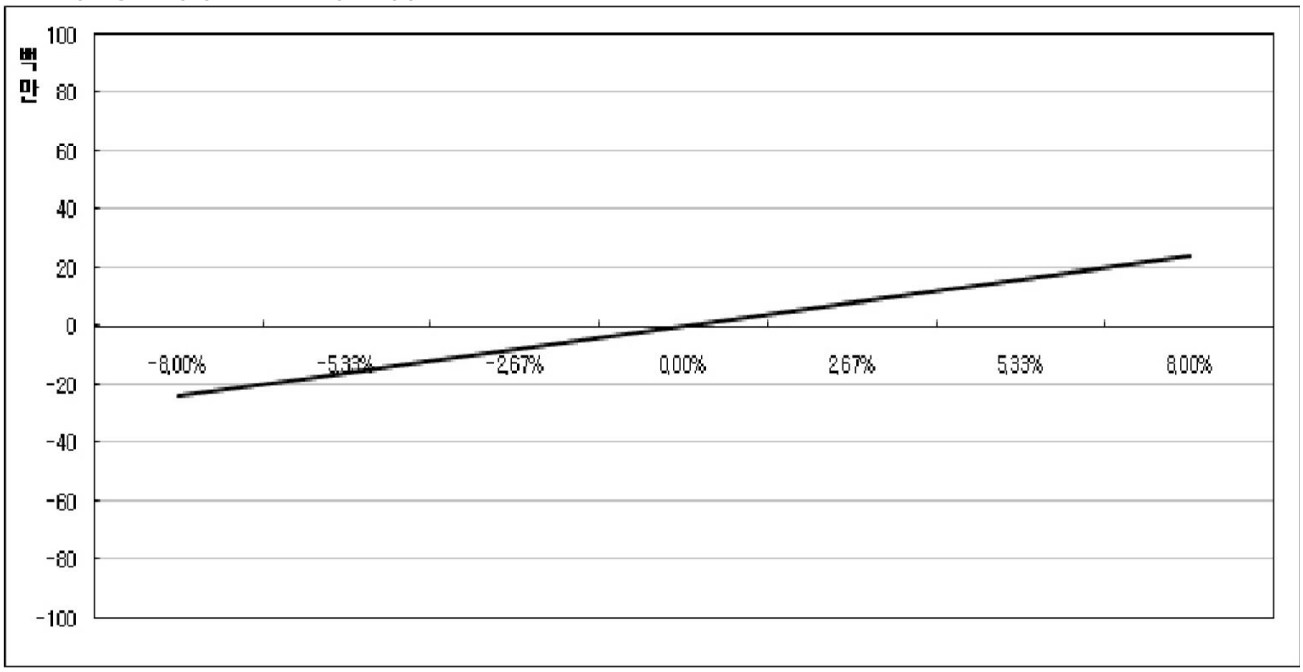
공시일: 2019-09-03

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)

492

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

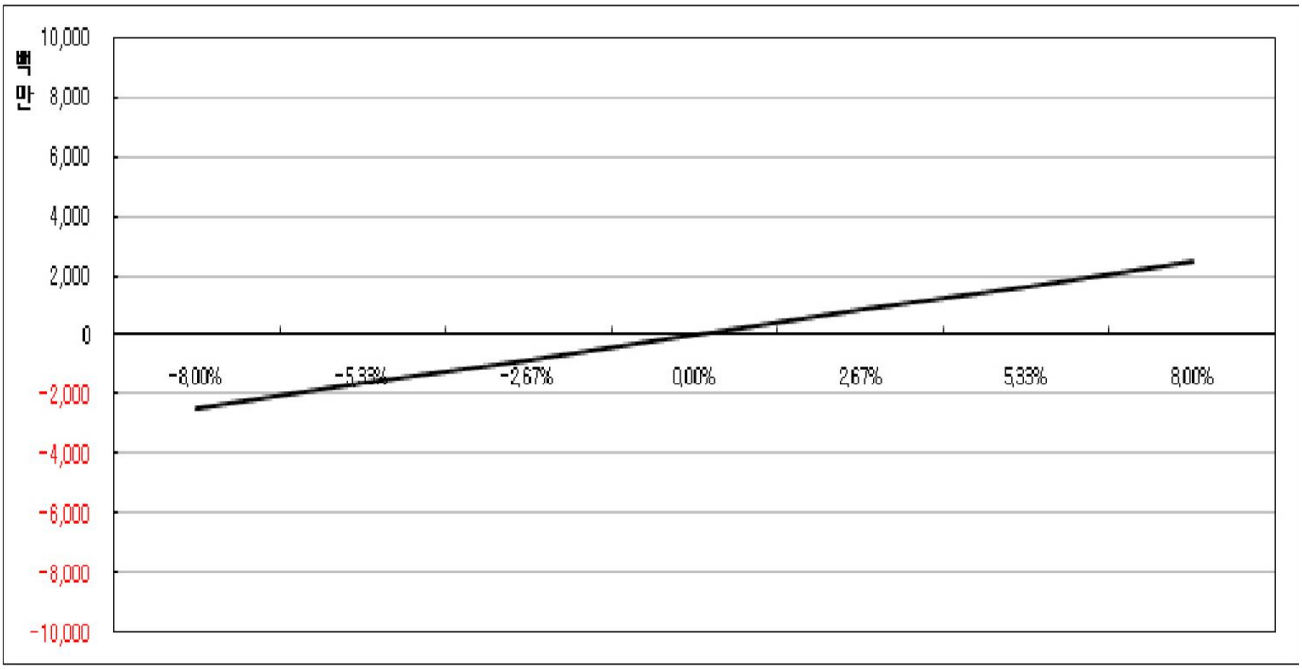
공시일: 2019-09-03

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	4,923	0	4,923	장내
합계			4,923	0	4,923	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

394

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

969

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

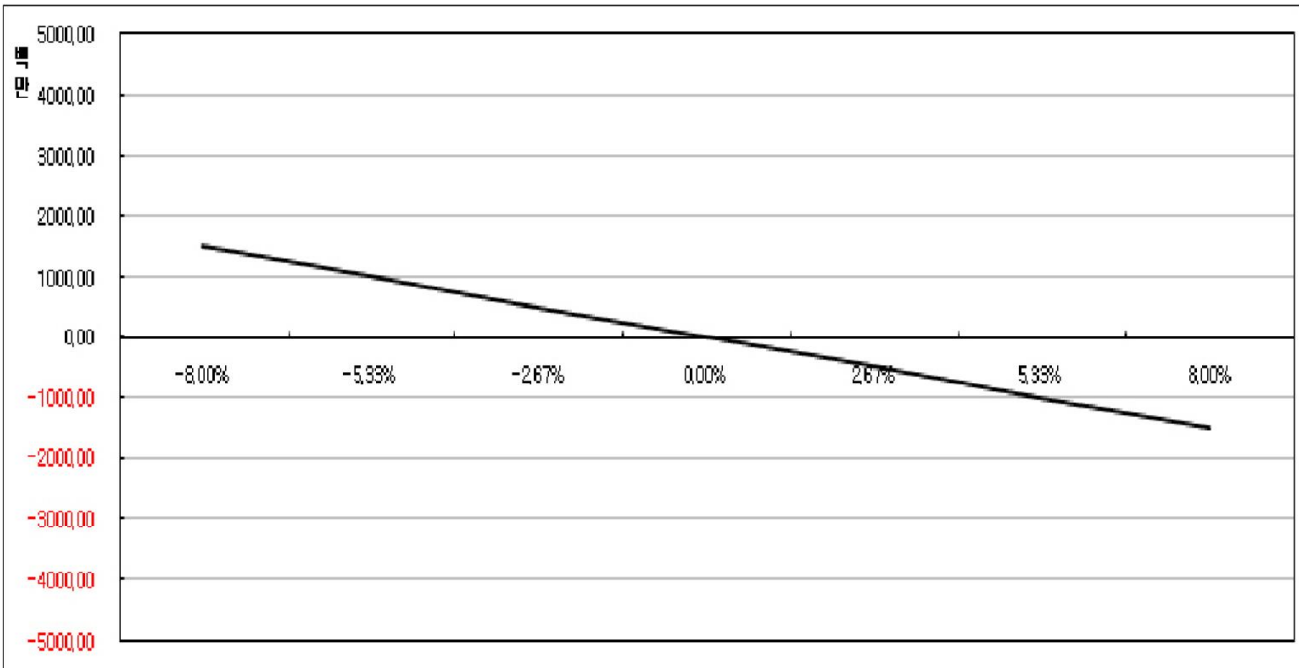
공시일: 2019-09-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	130	-130	장내
누계	주가지수	선물	0	1,878	-1,878	장내
합계			0	1,878	-1,878	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

150

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

131

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

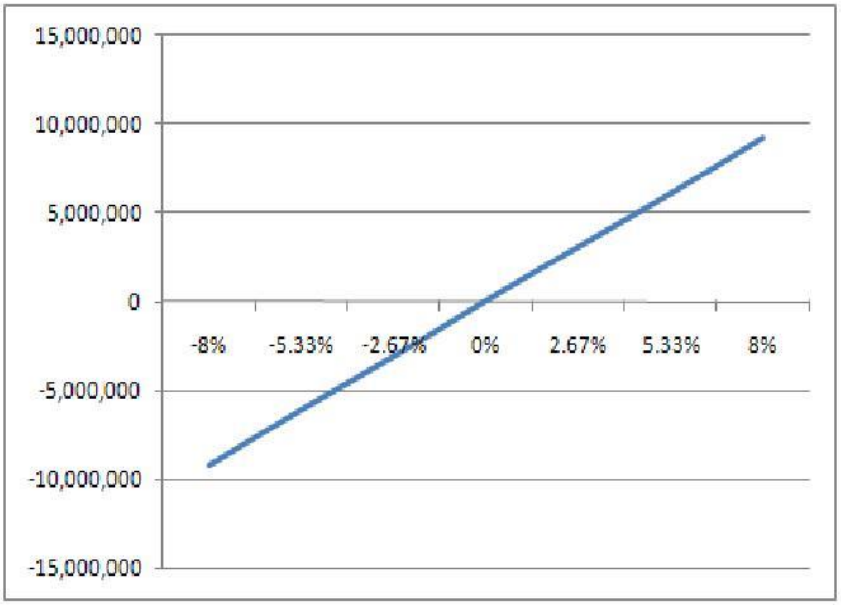
공시일: 2019-09-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	972	-972	장내
누계	주가지수	선물	68,721	0	68,721	장내
합계			68,721	0	68,721	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,503

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,333