펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,766	1,766	0	장내
누계	주가지수	선물	1,766	0	1,766	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	3,402	-3,401	장내
합계			1,767	3,402	-1,635	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

120

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

237

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

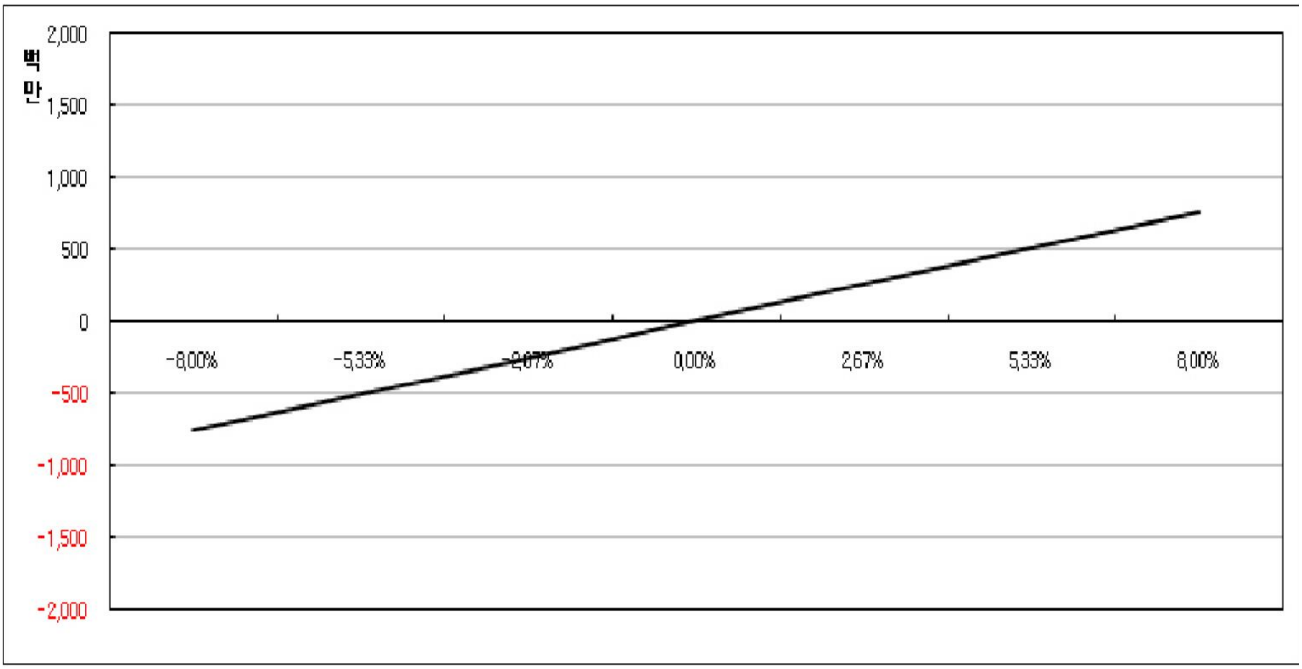
공시일: 2019-09-05

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	131	0	131	장내
합계			131	0	131	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

408

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

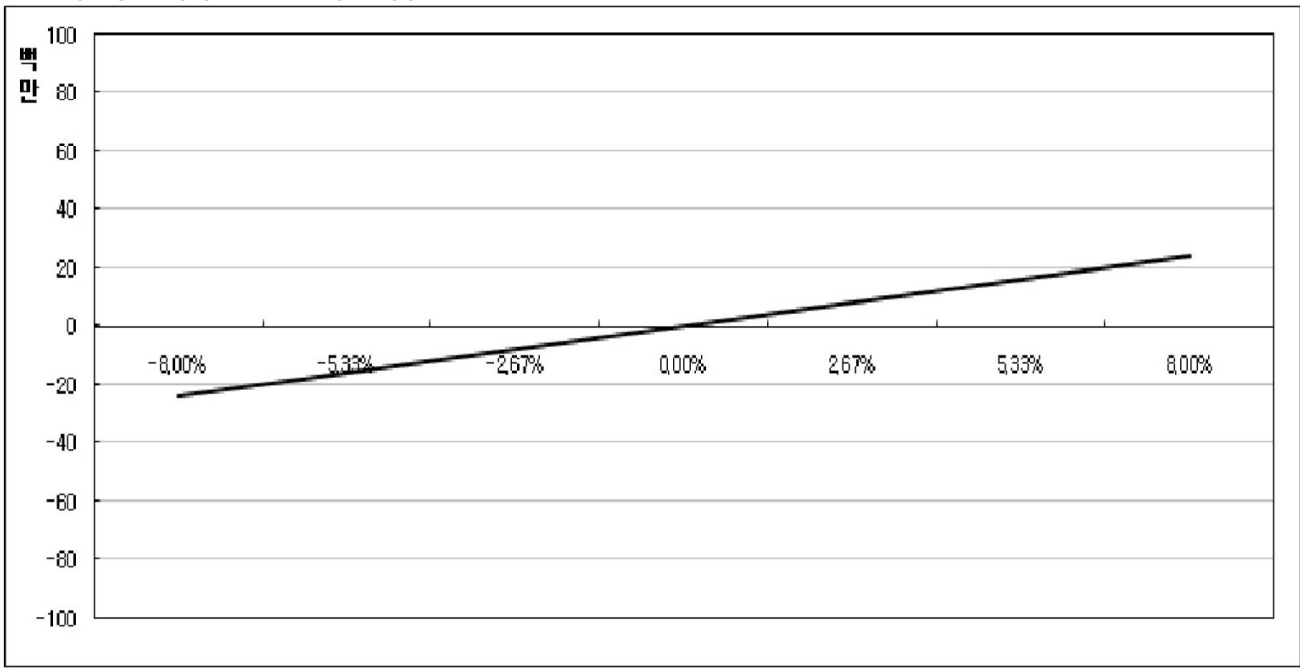
공시일: 2019-09-05

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	1,047	0	1,047	장내
합계			1,047	0	1,047	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

497

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

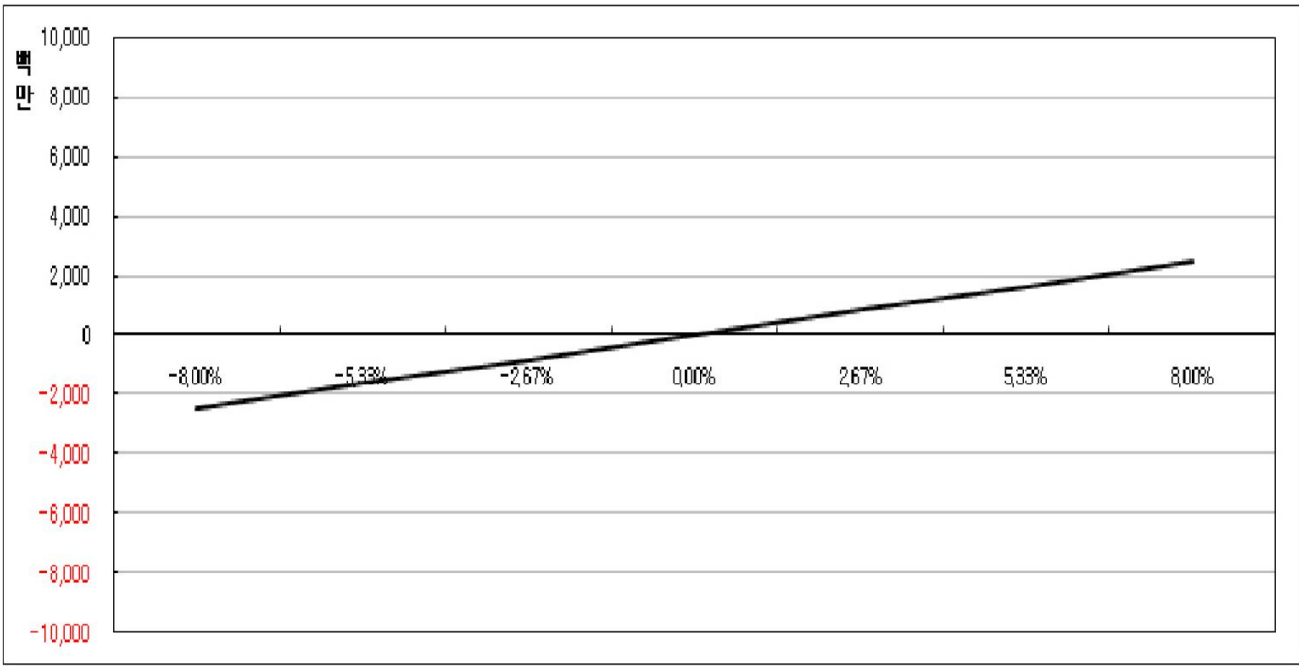
공시일: 2019-09-05

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	4,972	0	4,972	장내
합계			4,972	0	4,972	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

398

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

979

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

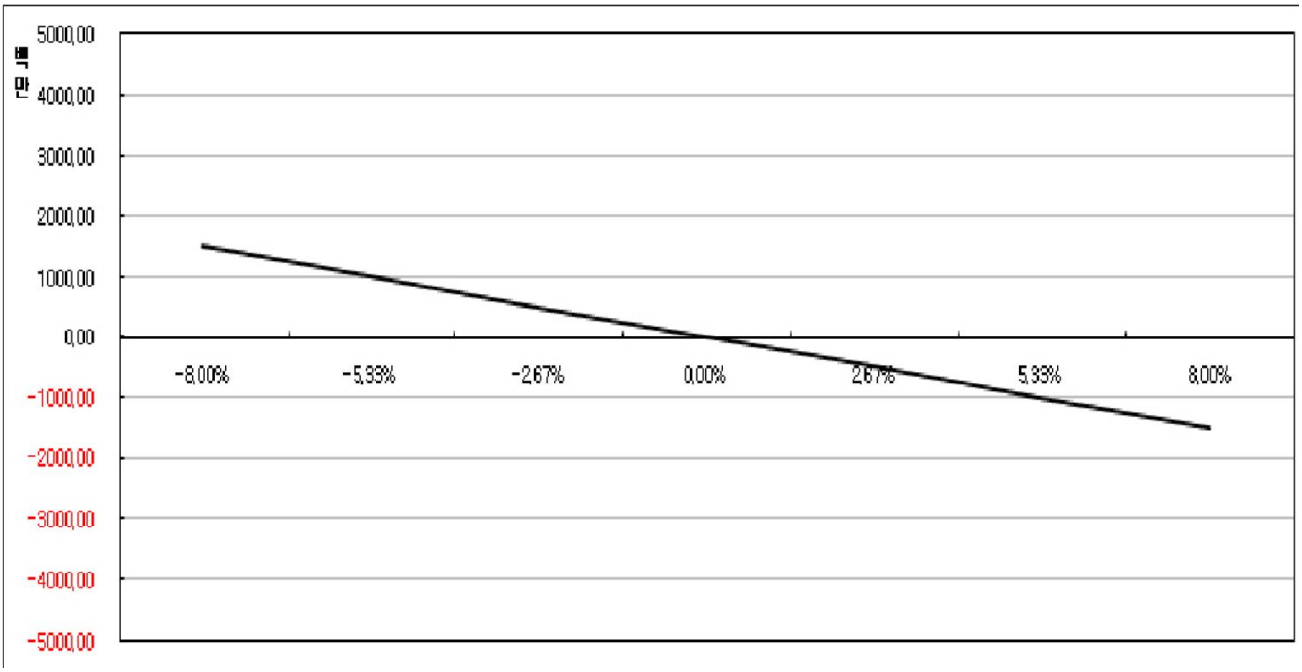
공시일: 2019-09-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	262	65	196	장내
누계	주가지수	선물	0	1,701	-1,701	장내
합계			0	1,701	-1,701	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

136

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

118

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

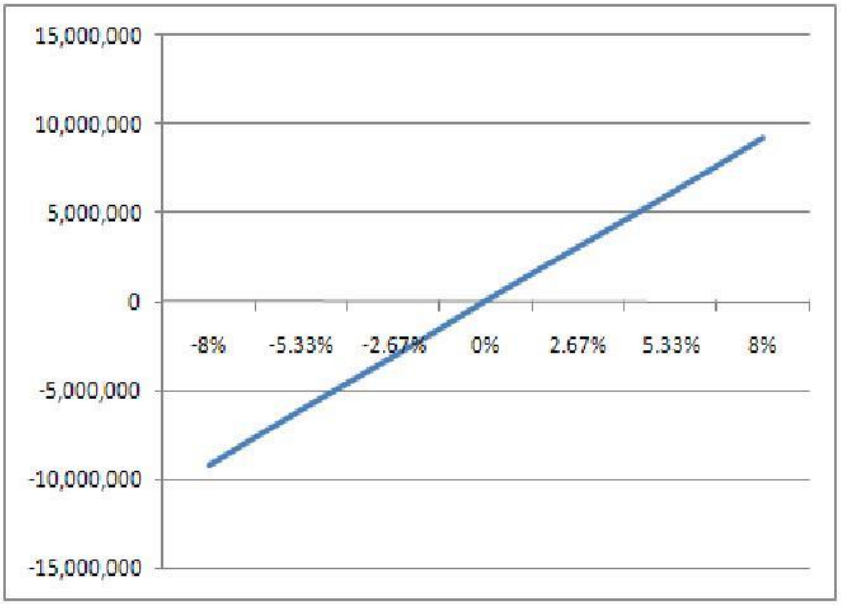
공시일: 2019-09-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	327	0	327	장내
누계	주가지수	선물	69,086	0	69,086	장내
합계			69,086	0	69,086	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,531

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,435