펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-09

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	1,792	0	1,792	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	3,452	-3,452	장내
합계			1,792	3,452	-1,659	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

267

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

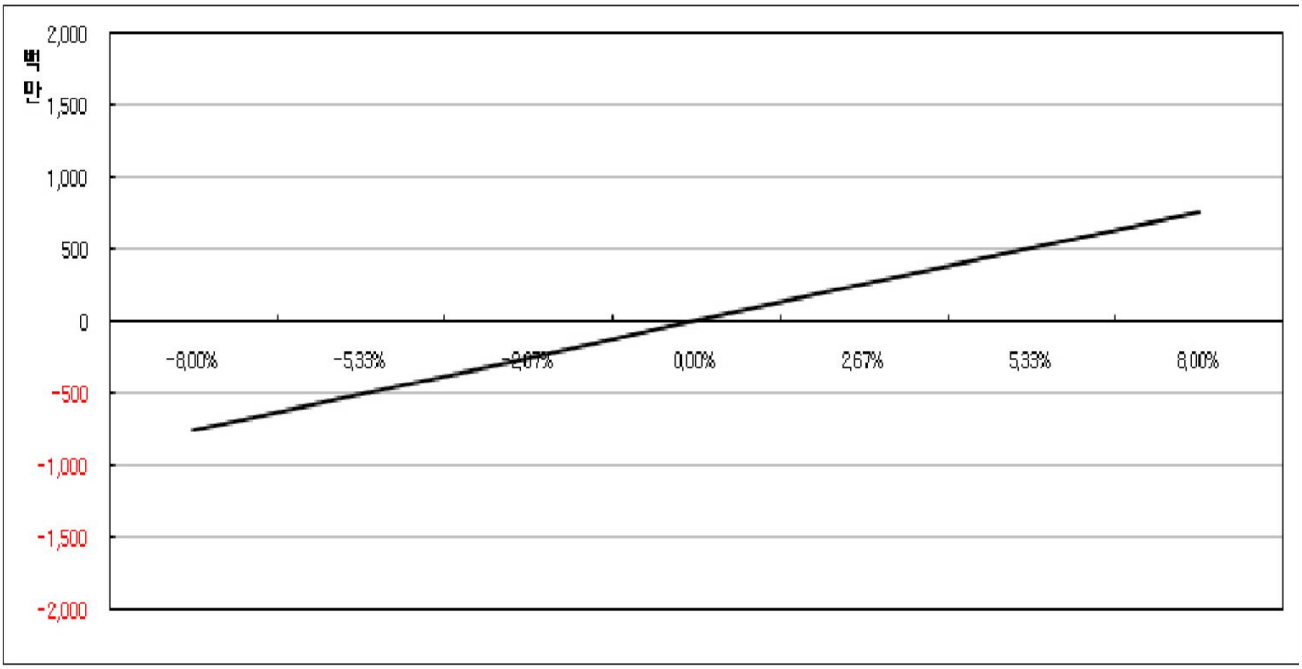
공시일: 2019-09-09

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	133	0	133	장내
합계			133	0	133	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

414

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

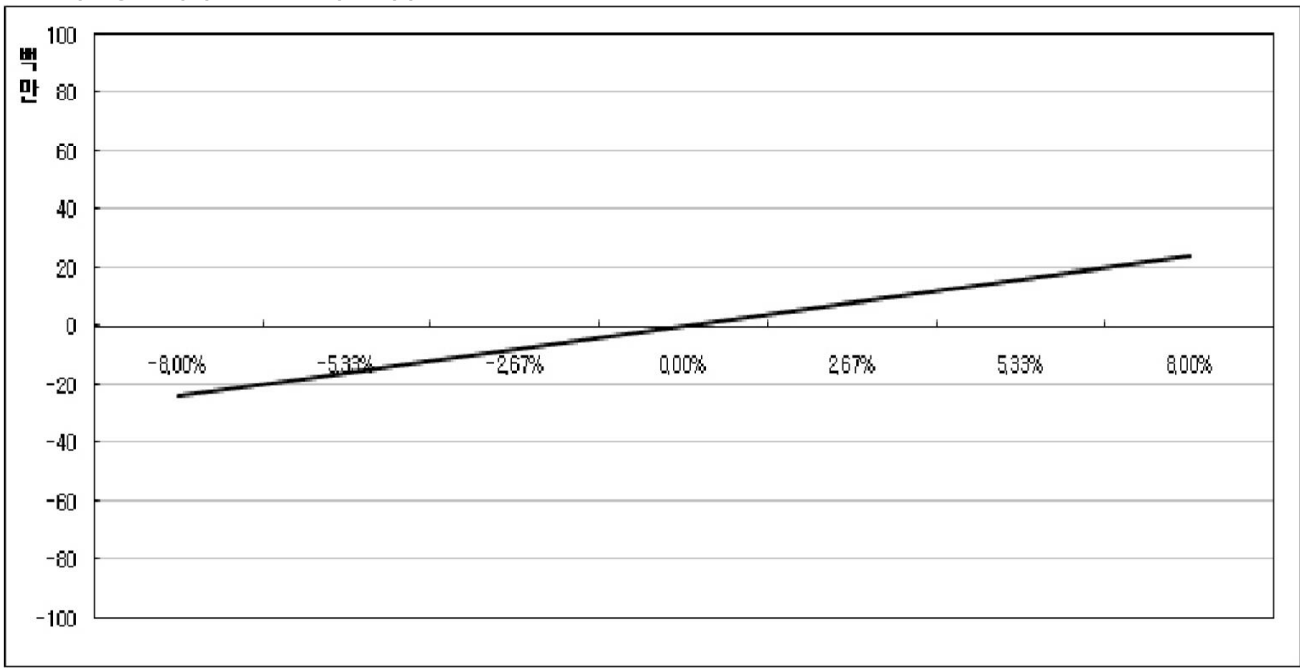
공시일: 2019-09-09

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	1,062	0	1,062	장내
합계			1,062	0	1,062	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

85

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

505

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

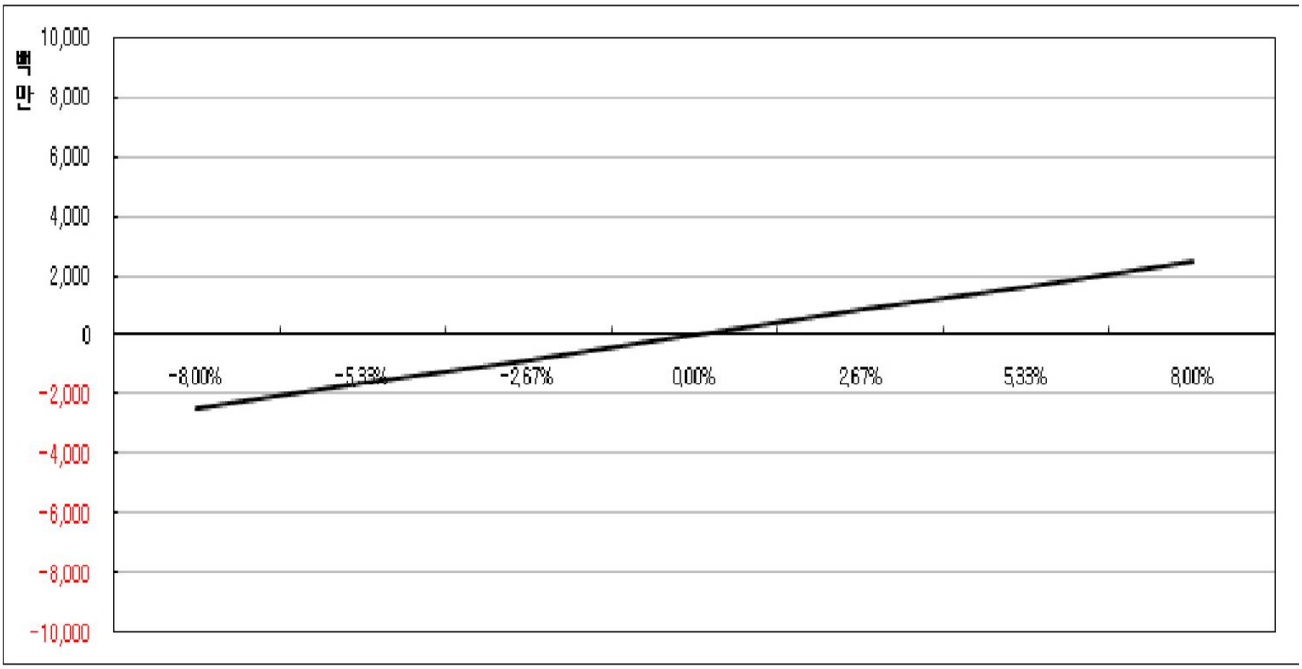
공시일: 2019-09-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	266	-266	장내
누계	주가지수	선물	4,979	0	4,979	장내
합계			4,979	0	4,979	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

399

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

990

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

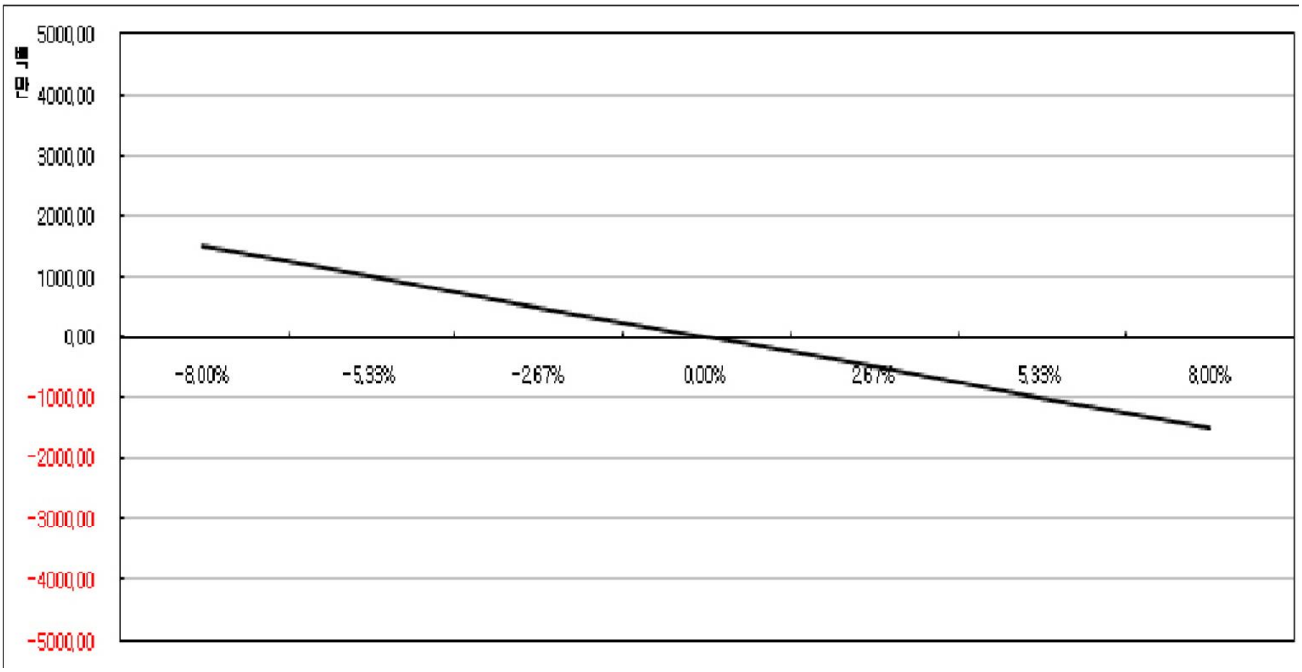
공시일: 2019-09-09

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	0	1,726	-1,726	장내
합계			0	1,726	-1,726	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

138

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

120

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

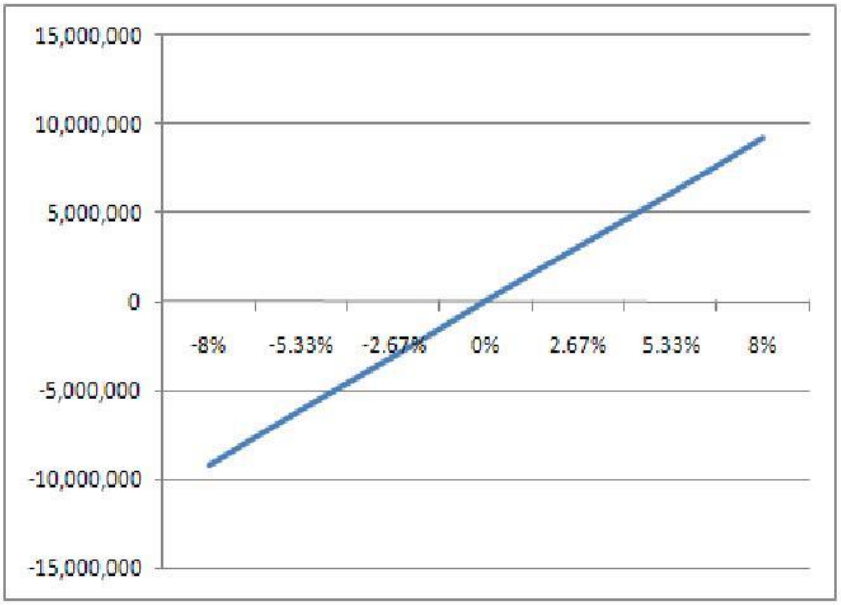
공시일: 2019-09-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	13,277	13,808	-531	장내
누계	주가지수	선물	68,772	0	68,772	장내
합계			68,772	0	68,772	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,508

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,501