펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-11

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	1,814	0	1,814	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	3,494	-3,494	장내
합계			1,814	3,494	-1,680	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

134

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

146

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

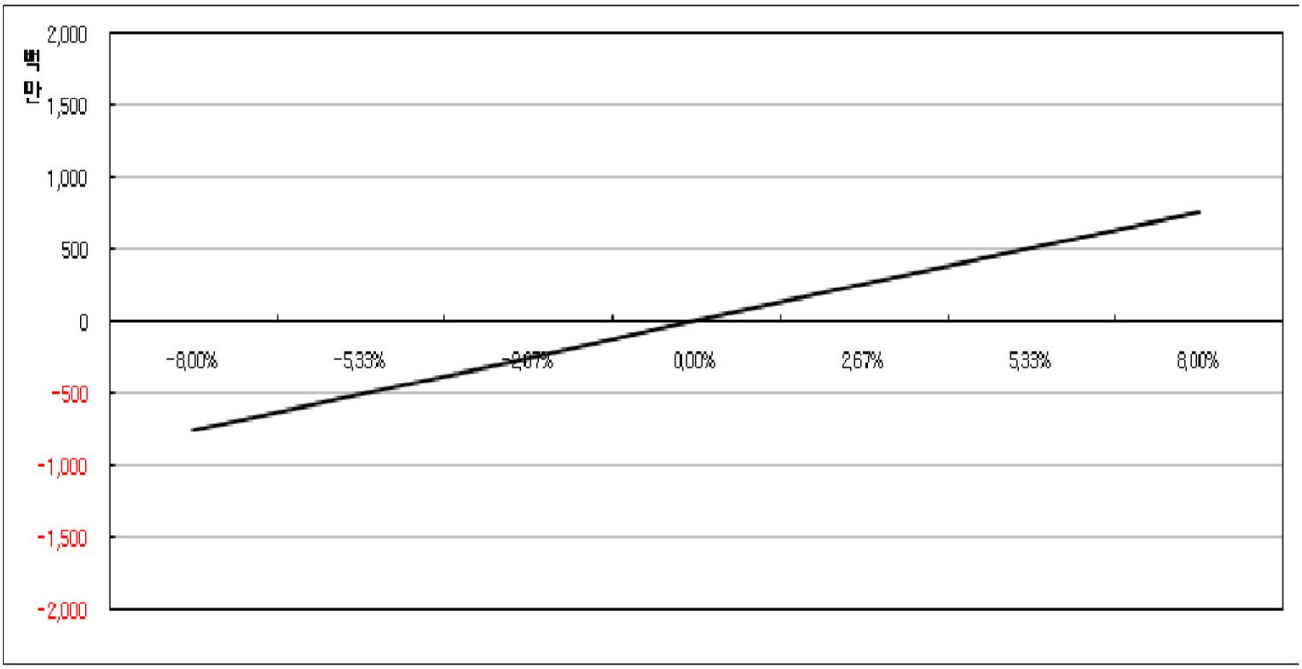
공시일: 2019-09-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	134	0	장내
누계	주가지수	선물	134	0	134	장내
합계			134	0	134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

420

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

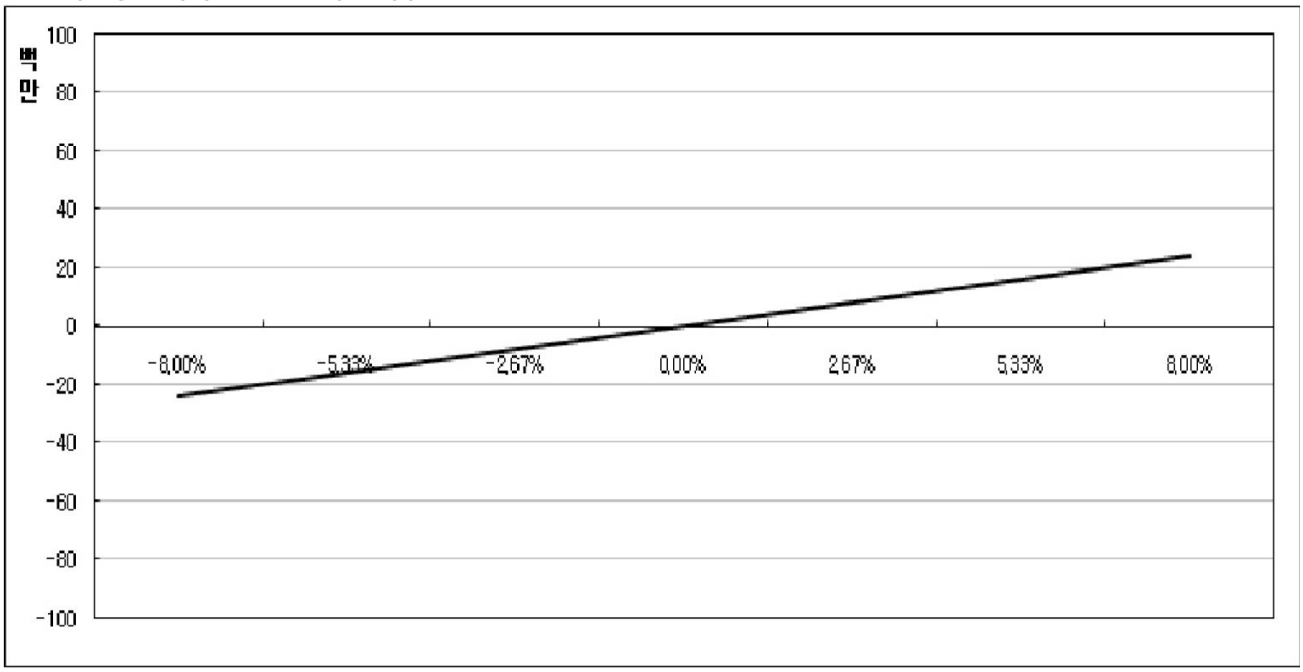
공시일: 2019-09-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,075	1,075	0	장내
누계	주가지수	선물	1,075	0	1,075	장내
합계			1,075	0	1,075	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

86

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

512

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

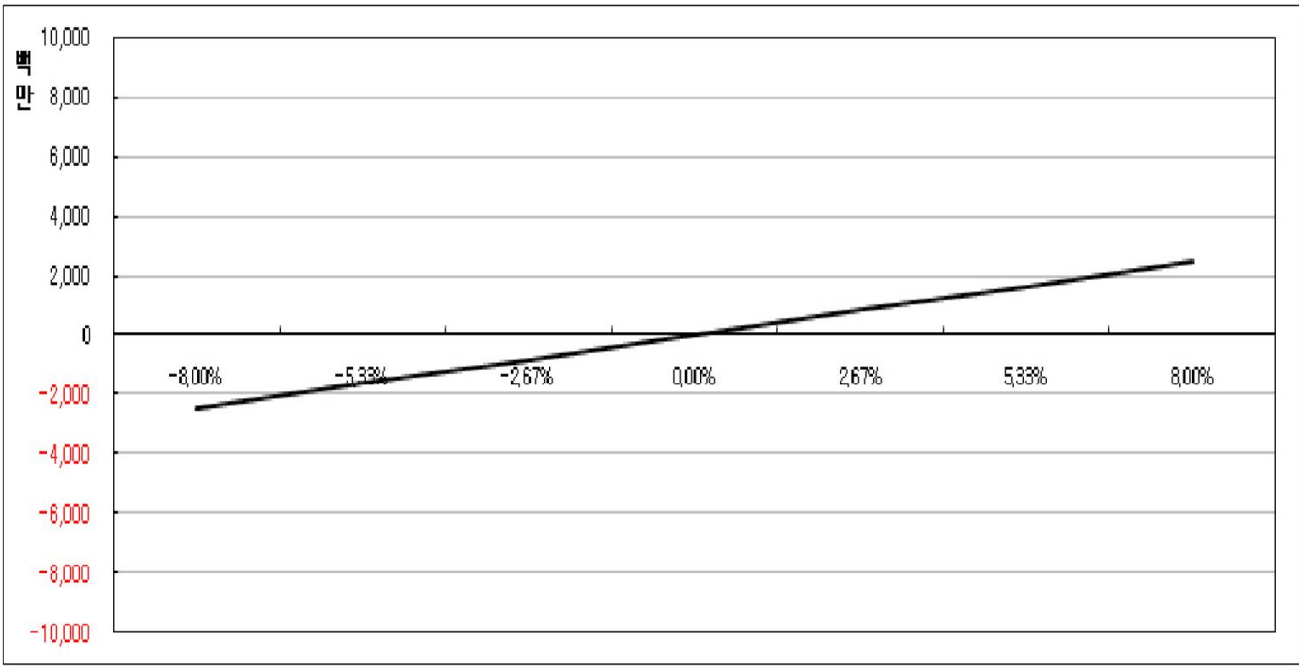
공시일: 2019-09-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,016	2,016	0	장내
누계	주가지수	선물	5,039	0	5,039	장내
합계			5,039	0	5,039	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

403

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,005

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

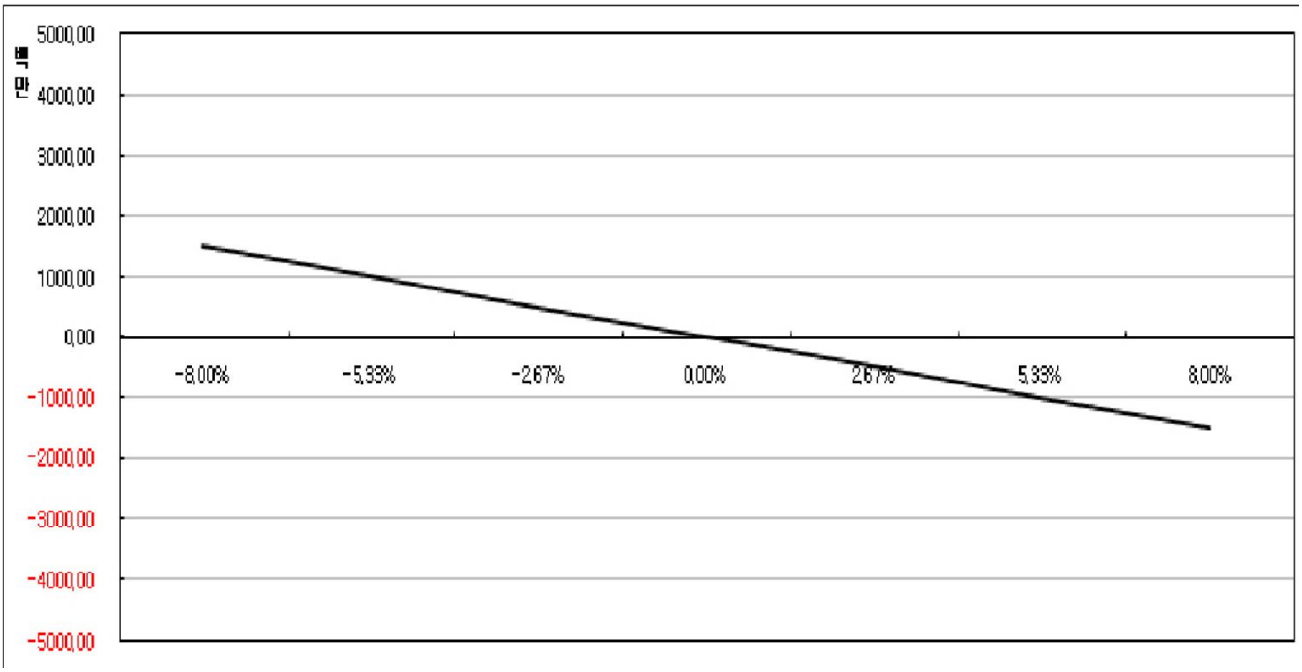
공시일: 2019-09-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	0	134	장내
누계	주가지수	선물	0	1,881	-1,881	장내
합계			0	1,881	-1,881	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

151

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

131

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

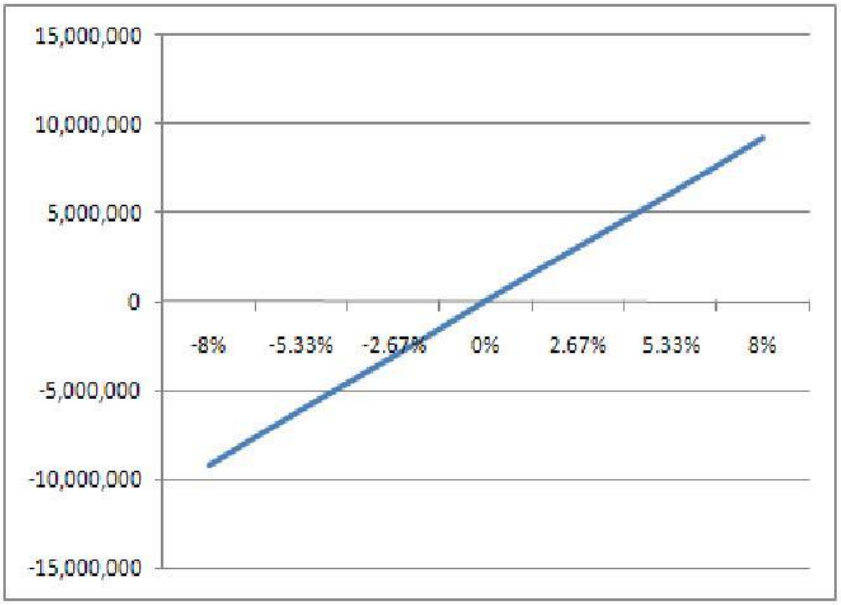
공시일: 2019-09-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	34,536	36,551	-2,016	장내
누계	주가지수	선물	67,929	0	67,929	장내
합계			67,929	0	67,929	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,437

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,541