펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-16

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	1,828	0	1,828	장내
신규	주가지수	옵션	199	5,351	-5,152	장내
누계	주가지수	옵션	6	3,320	-3,313	장내
합계			1,835	3,320	-1,485	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	79

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	406

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

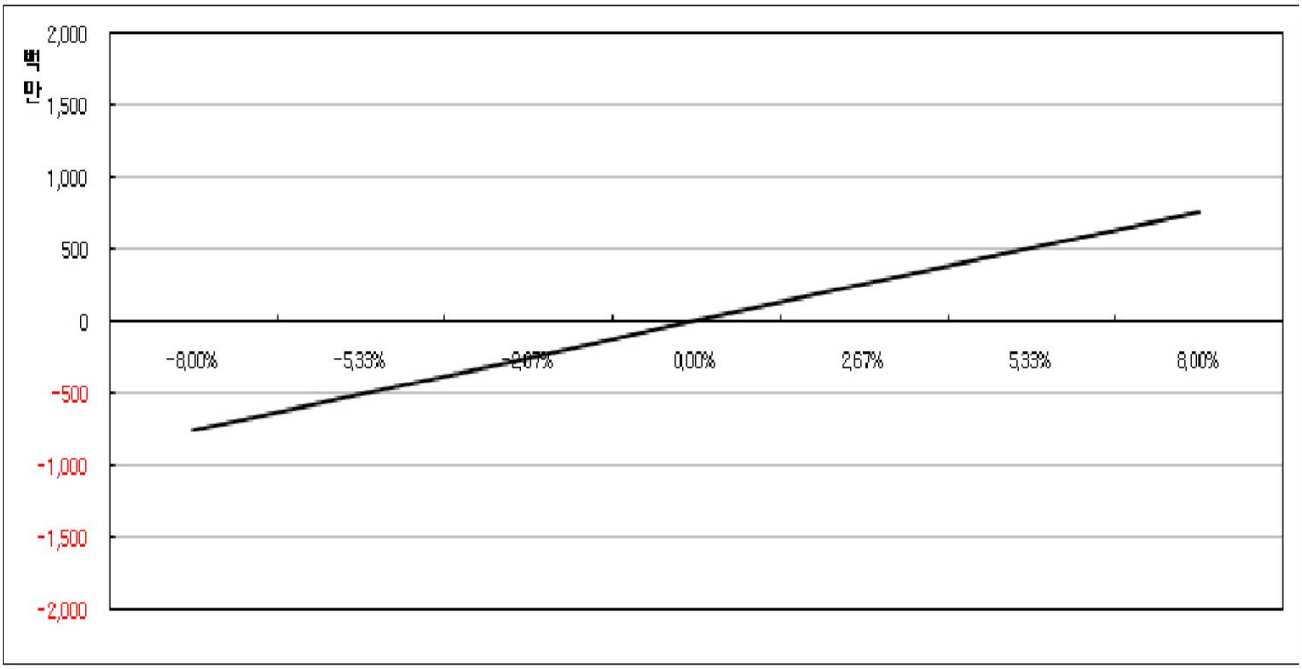
공시일: 2019-09-16

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	135	0	135	장내
합계			135	0	135	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

423

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

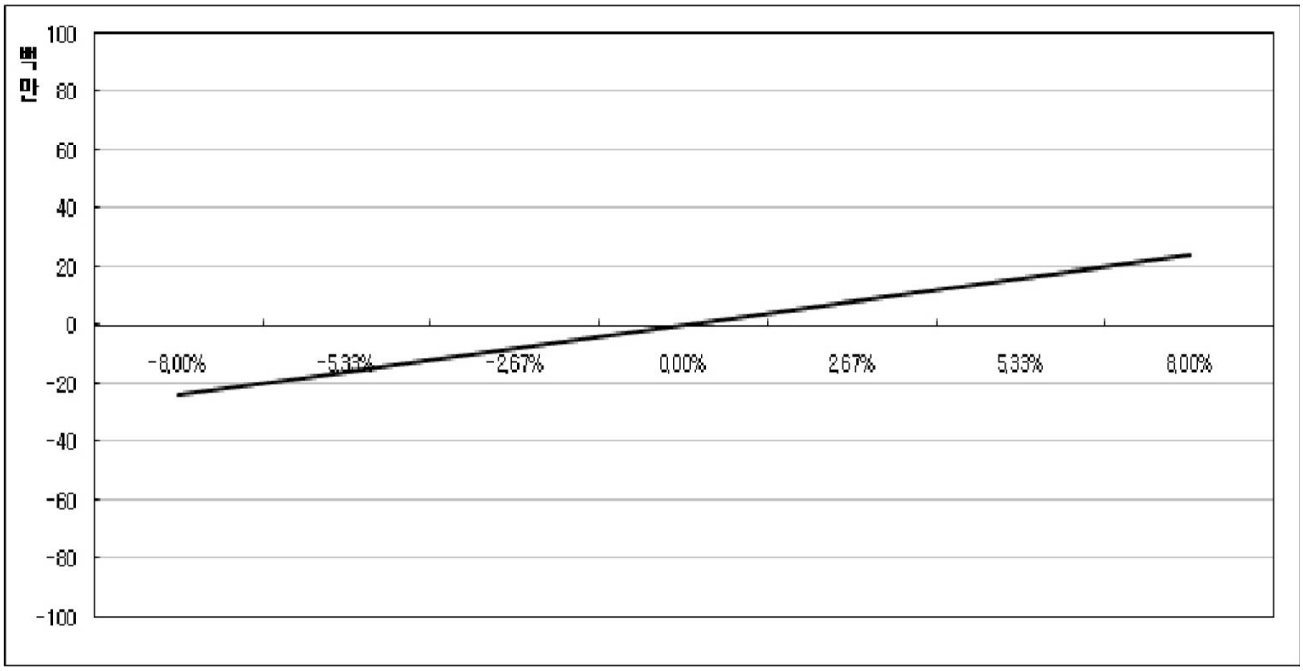
공시일: 2019-09-16

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	1,083	0	1,083	장내
합계			1,083	0	1,083	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

87

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

516

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

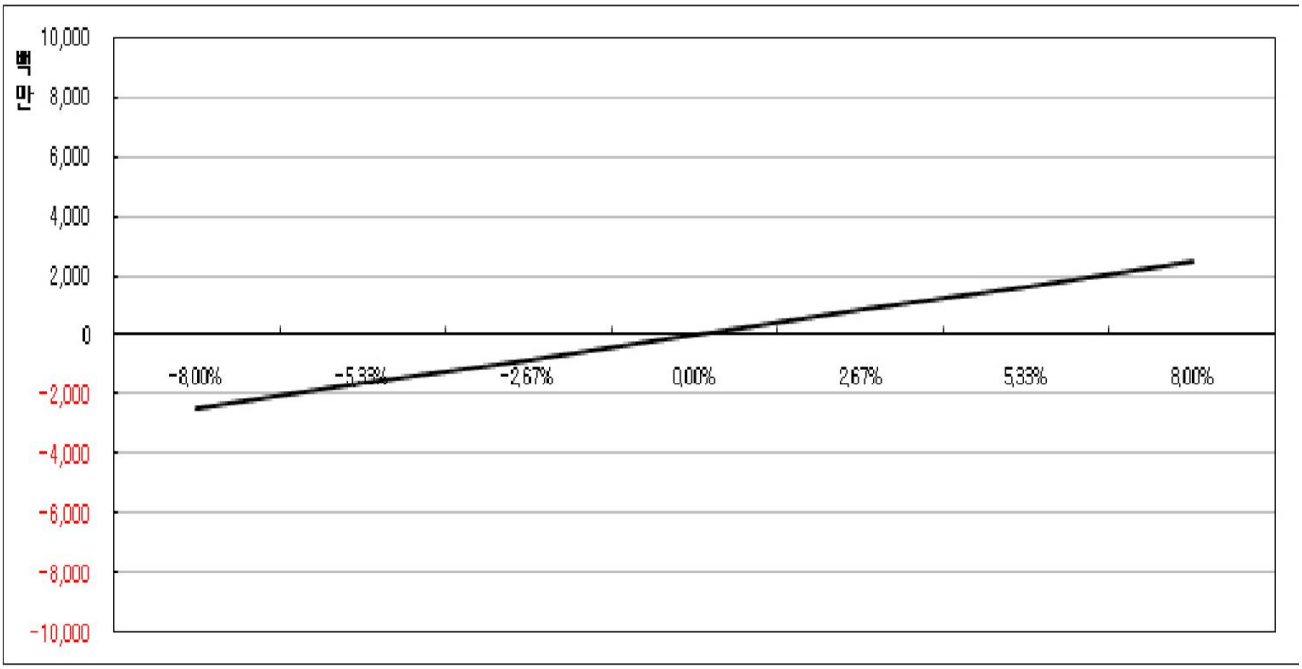
공시일: 2019-09-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,047	3,047	0	장내
누계	주가지수	선물	5,078	0	5,078	장내
합계			5,078	0	5,078	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

407

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,013

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

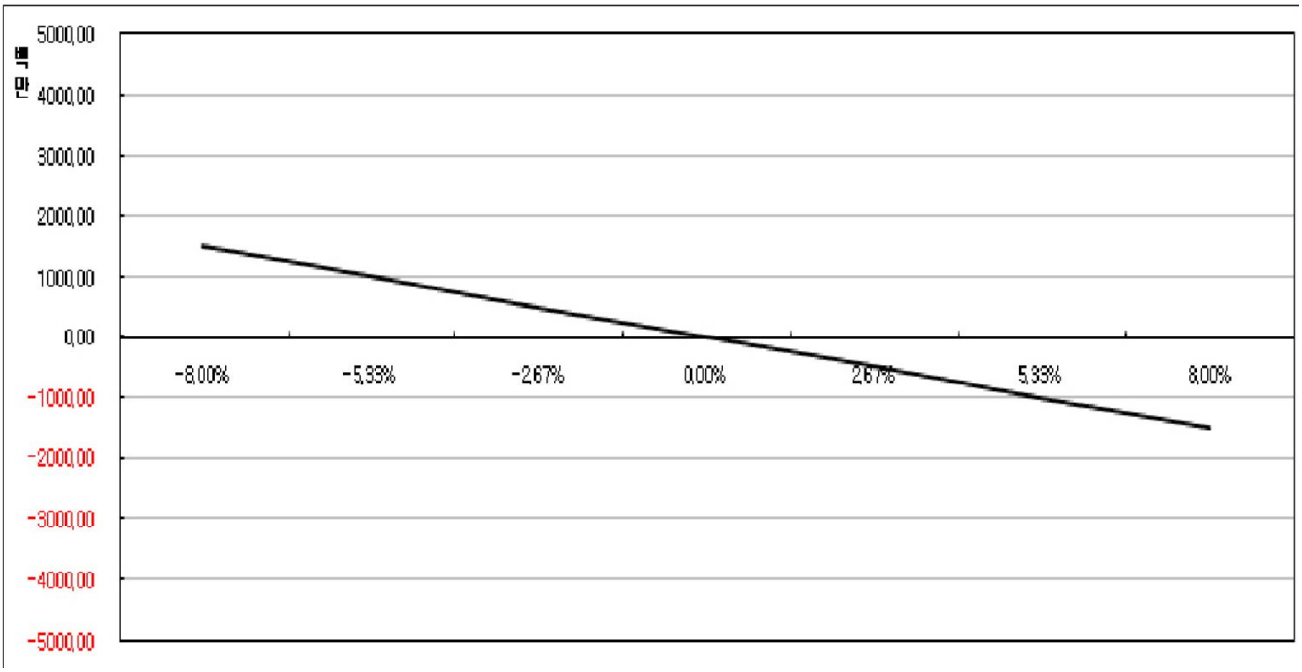
공시일: 2019-09-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,896	1,896	0	장내
누계	주가지수	선물	0	1,896	-1,896	장내
합계			0	1,896	-1,896	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

152

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

132

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

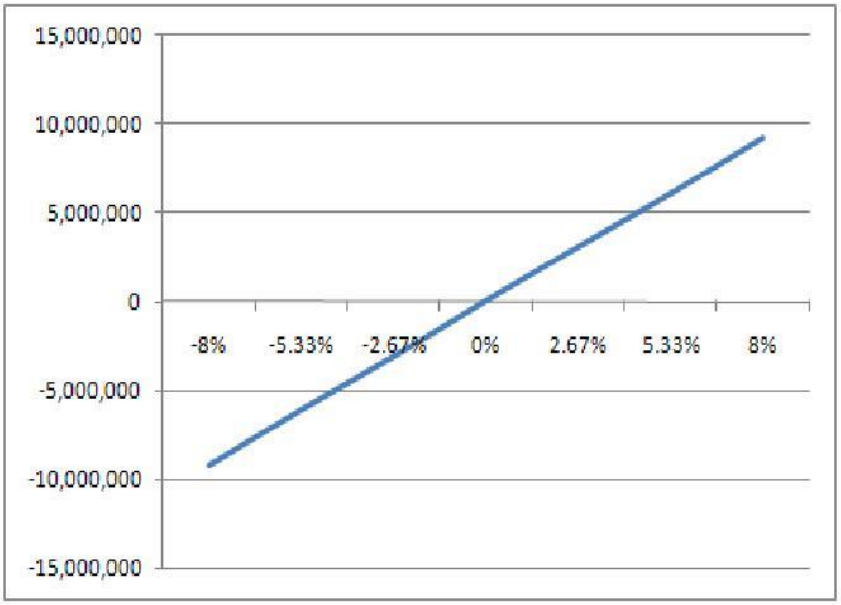
공시일: 2019-09-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	7,922	8,261	-339	장내
누계	주가지수	선물	68,116	0	68,116	장내
합계			68,116	0	68,116	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,457

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,596