펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	68	-68	장내
누계	주가지수	선물	1,766	0	1,766	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	3,328	-3,322	장내
합계			1,772	3,328	-1,556	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

357

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

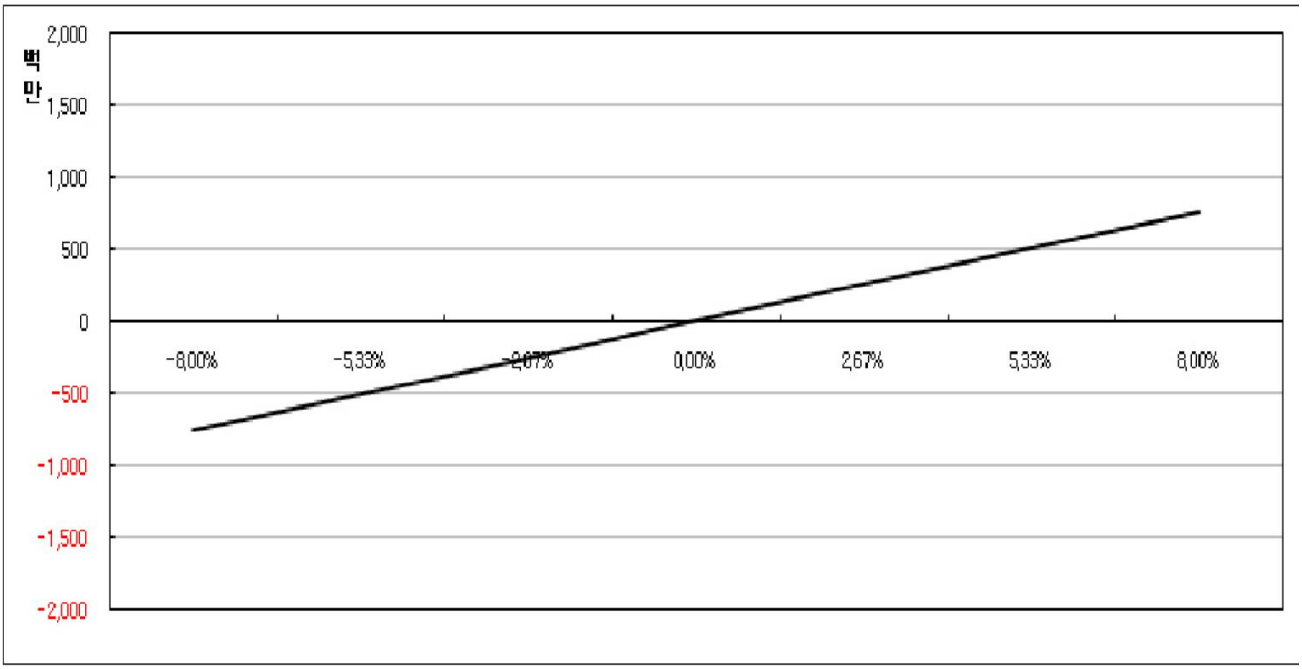
공시일: 2019-09-18

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	136	0	136	장내
합계			136	0	136	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

424

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

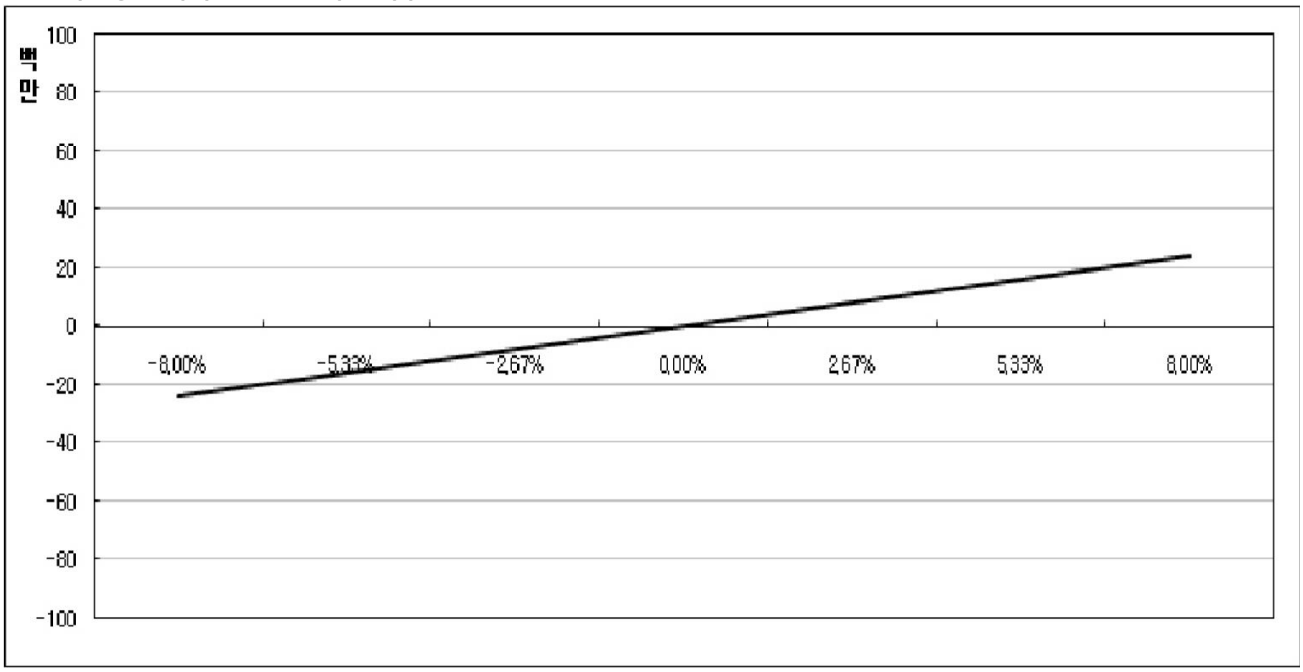
공시일: 2019-09-18

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	1,087	0	1,087	장내
합계			1,087	0	1,087	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

87

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

518

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

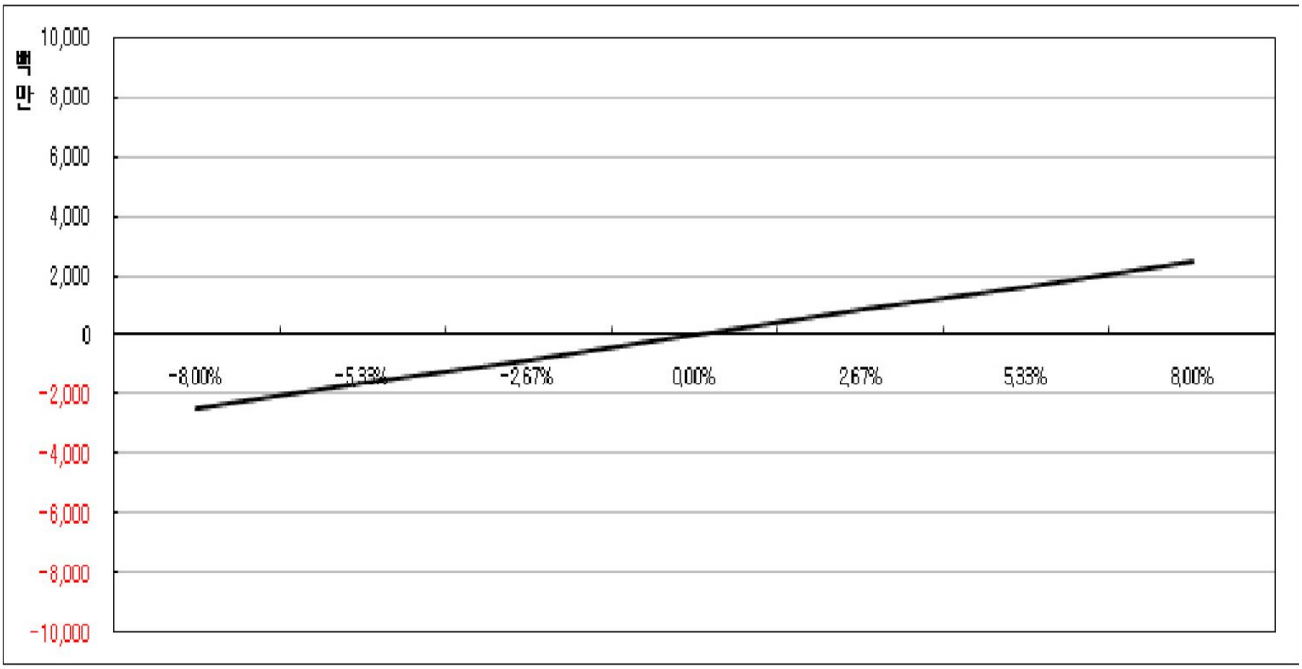
공시일: 2019-09-18

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	4,754	0	4,754	장내
합계			4,754	0	4,754	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

380

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

999

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

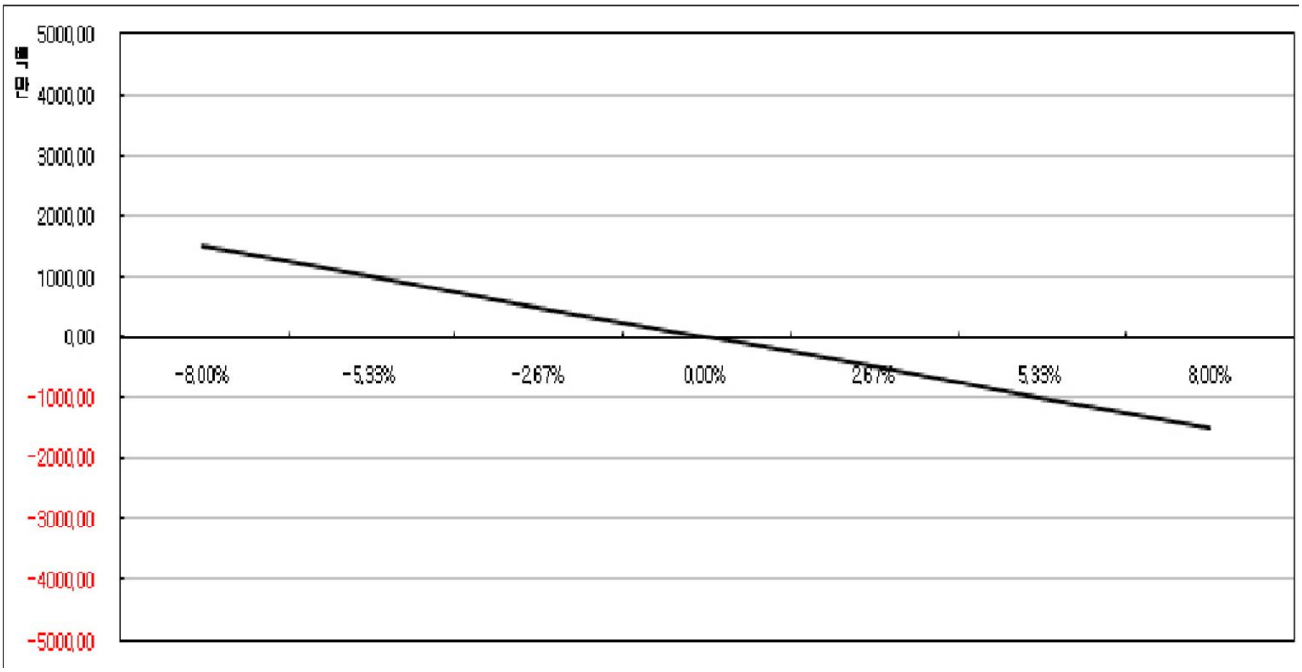
공시일: 2019-09-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	136	-136	장내
누계	주가지수	선물	0	2,038	-2,038	장내
합계			0	2,038	-2,038	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

163

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

142

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

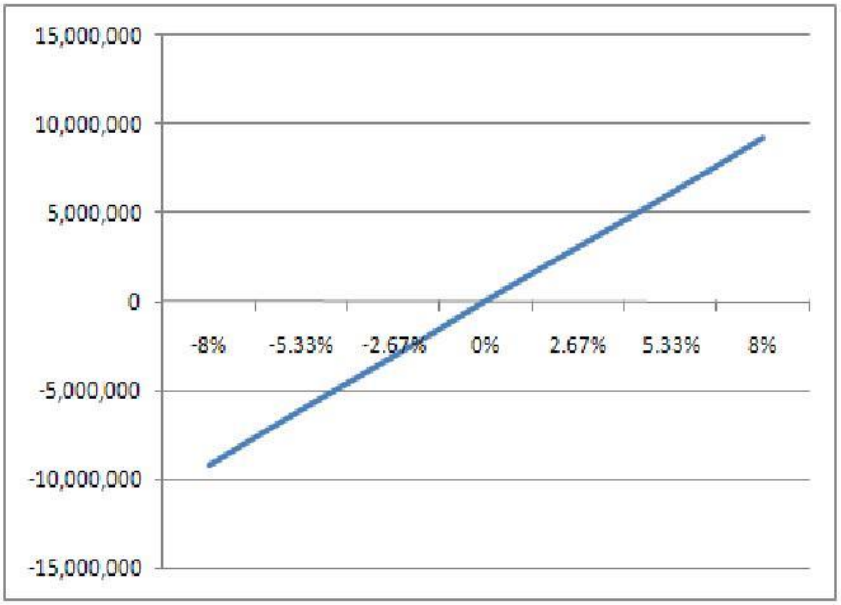
공시일: 2019-09-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	679	-679	장내
누계	주가지수	선물	67,648	0	67,648	장내
합계			67,648	0	67,648	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,413

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,601