펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-27

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	1,512	0	1,512	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,749	-2,747	장내
합계			1,514	2,749	-1,235	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	84

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	261

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

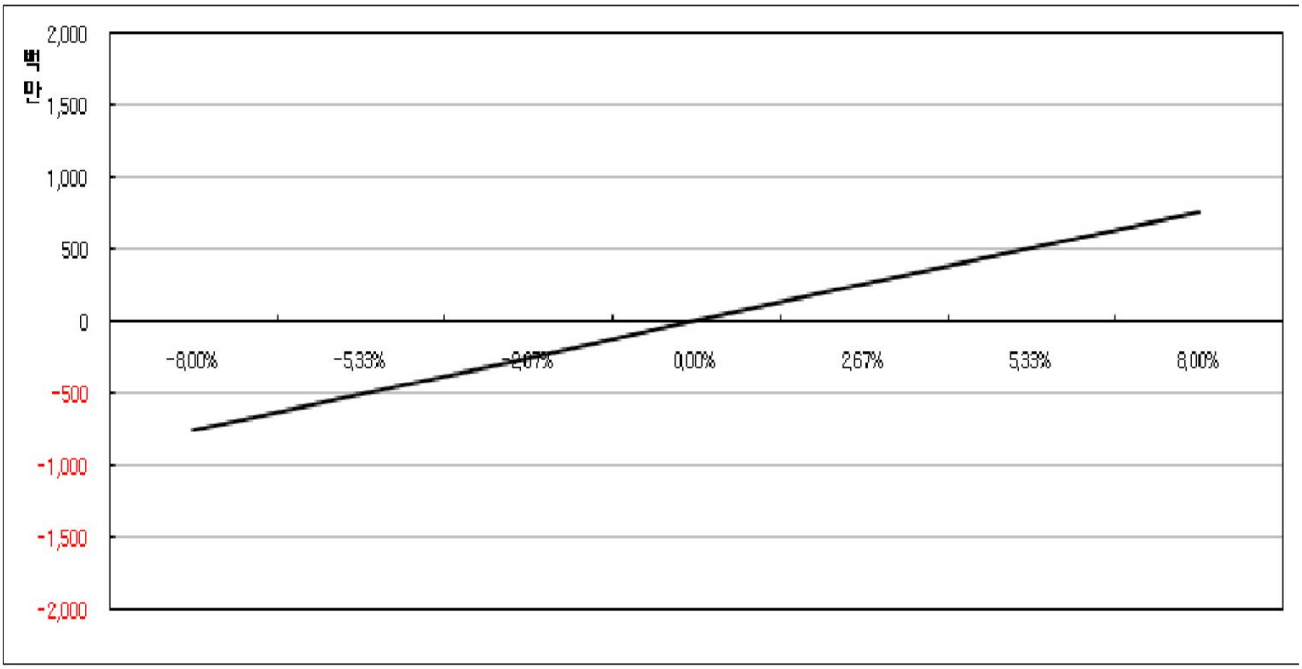
공시일: 2019-09-27

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	137	0	137	장내
합계			137	0	137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

430

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

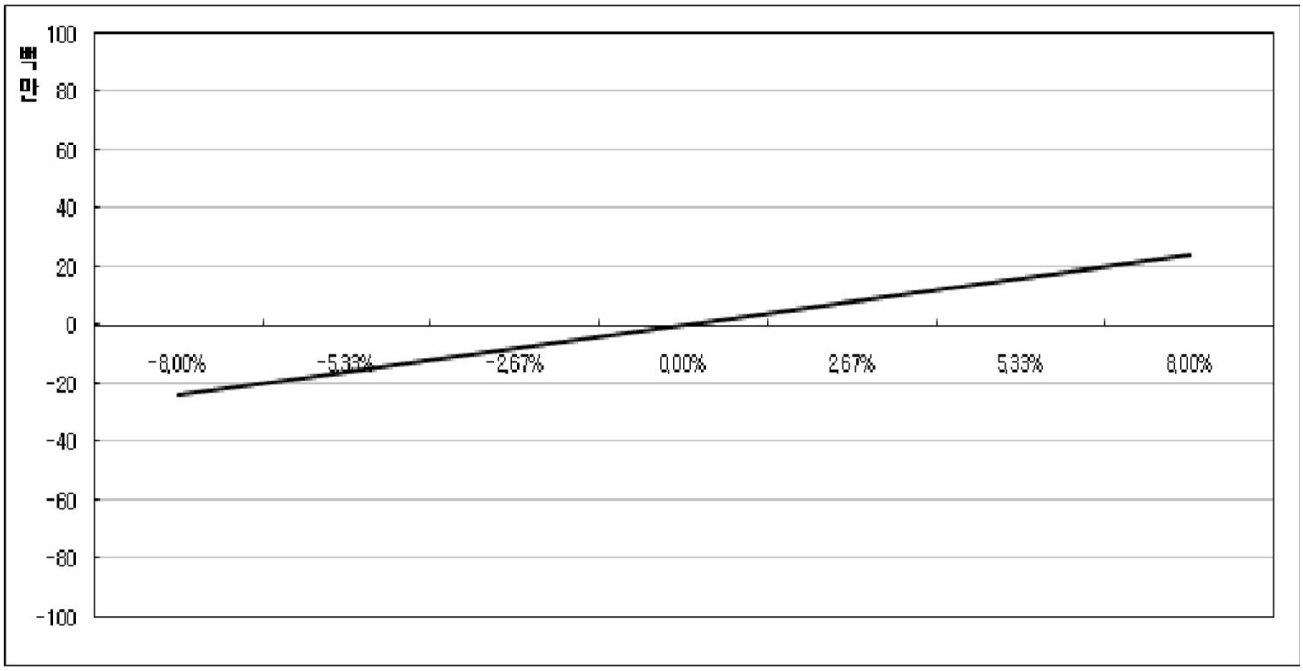
공시일: 2019-09-27

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	1,100	0	1,100	장내
합계			1,100	0	1,100	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

525

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

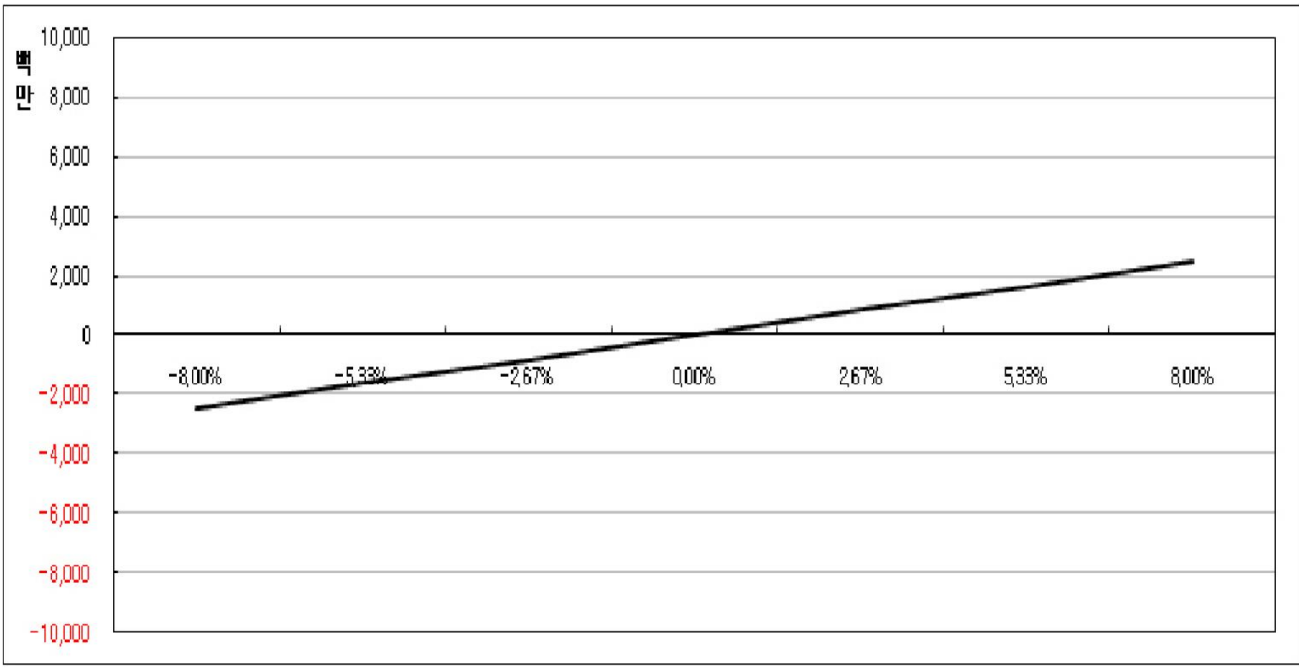
공시일: 2019-09-27

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	4,811	0	4,811	장내
합계			4,811	0	4,811	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

385

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,012

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

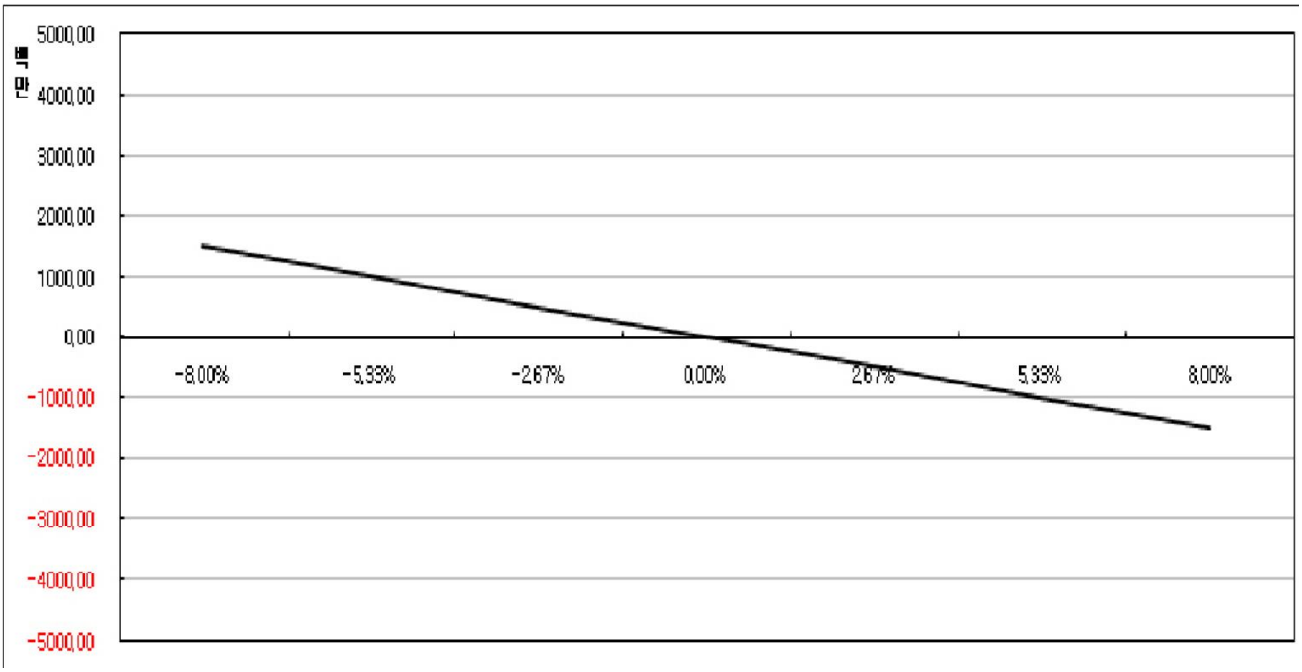
공시일: 2019-09-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	206	0	206	장내
누계	주가지수	선물	0	1,924	-1,924	장내
합계			0	1,924	-1,924	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

154

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

134

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

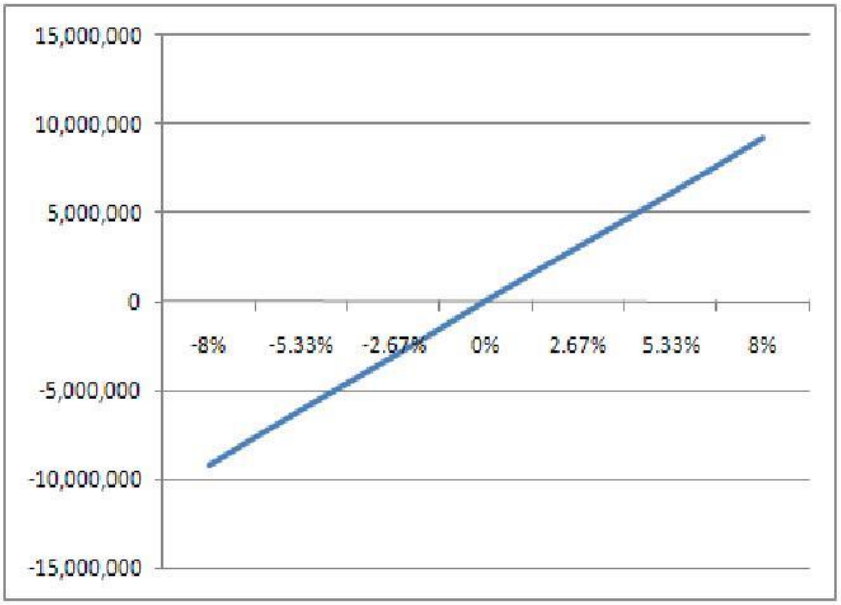
공시일: 2019-09-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	687	-687	장내
누계	주가지수	선물	65,561	0	65,561	장내
합계			65,561	0	65,561	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,249

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,549