펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-09-30

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	1,492	0	1,492	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	2,713	-2,711	장내
합계			1,495	2,713	-1,218	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	134

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

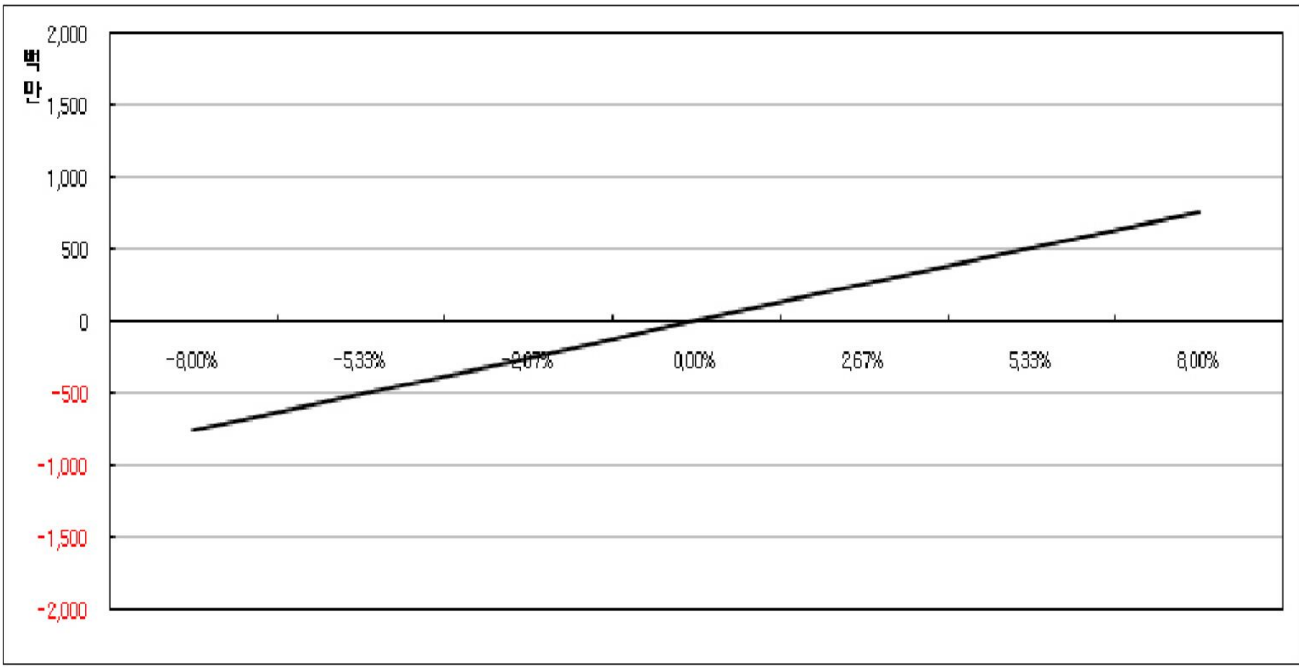
공시일: 2019-09-30

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)

425

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

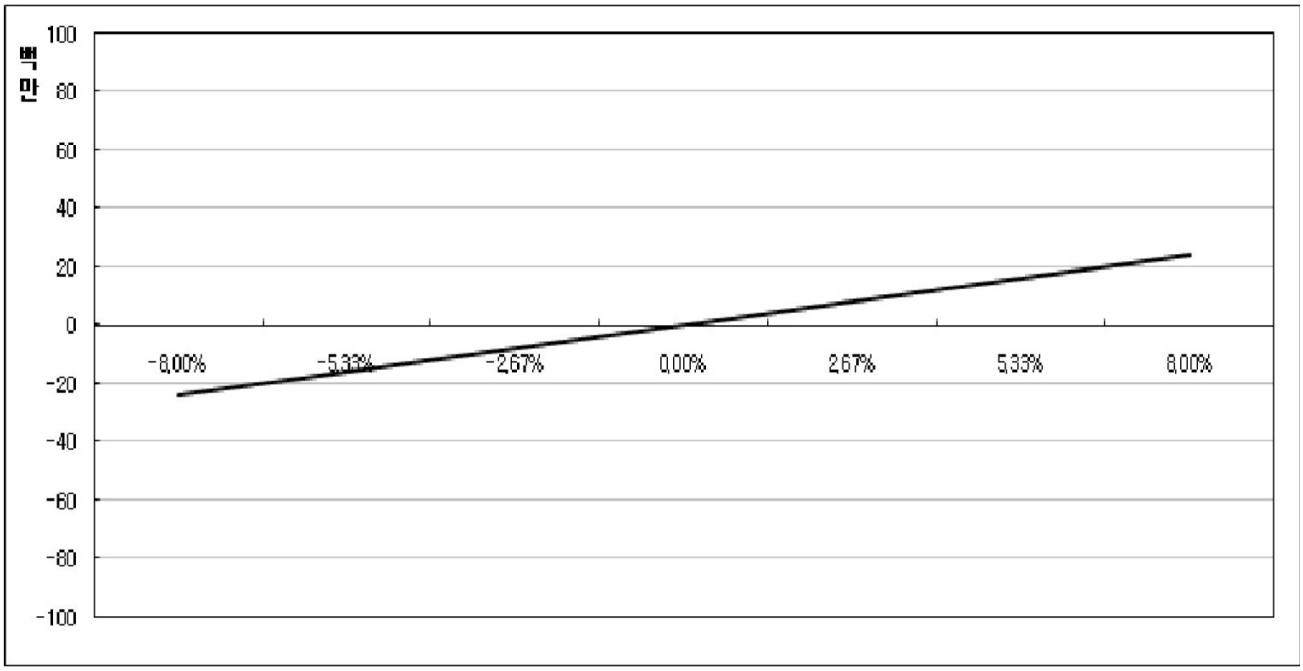
공시일: 2019-09-30

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	1,085	0	1,085	장내
합계			1,085	0	1,085	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

87

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

521

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

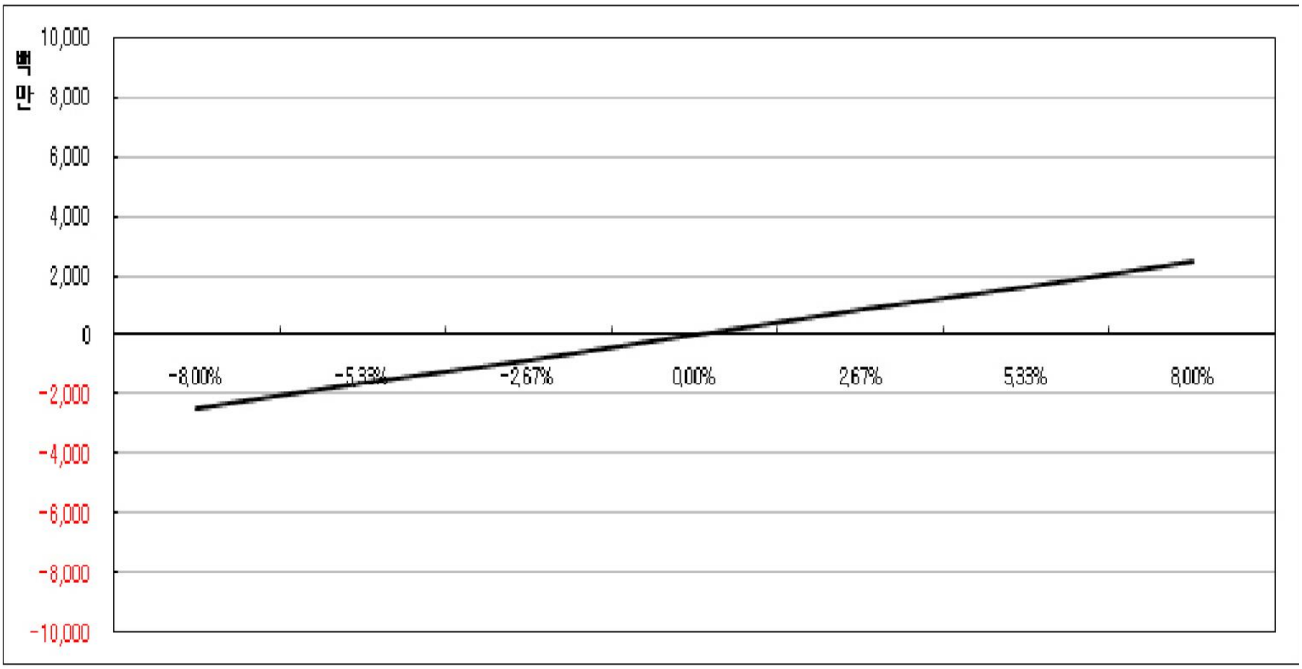
공시일: 2019-09-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	271	203	68	장내
누계	주가지수	선물	4,816	0	4,816	장내
합계			4,816	0	4,816	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

386

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,006

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

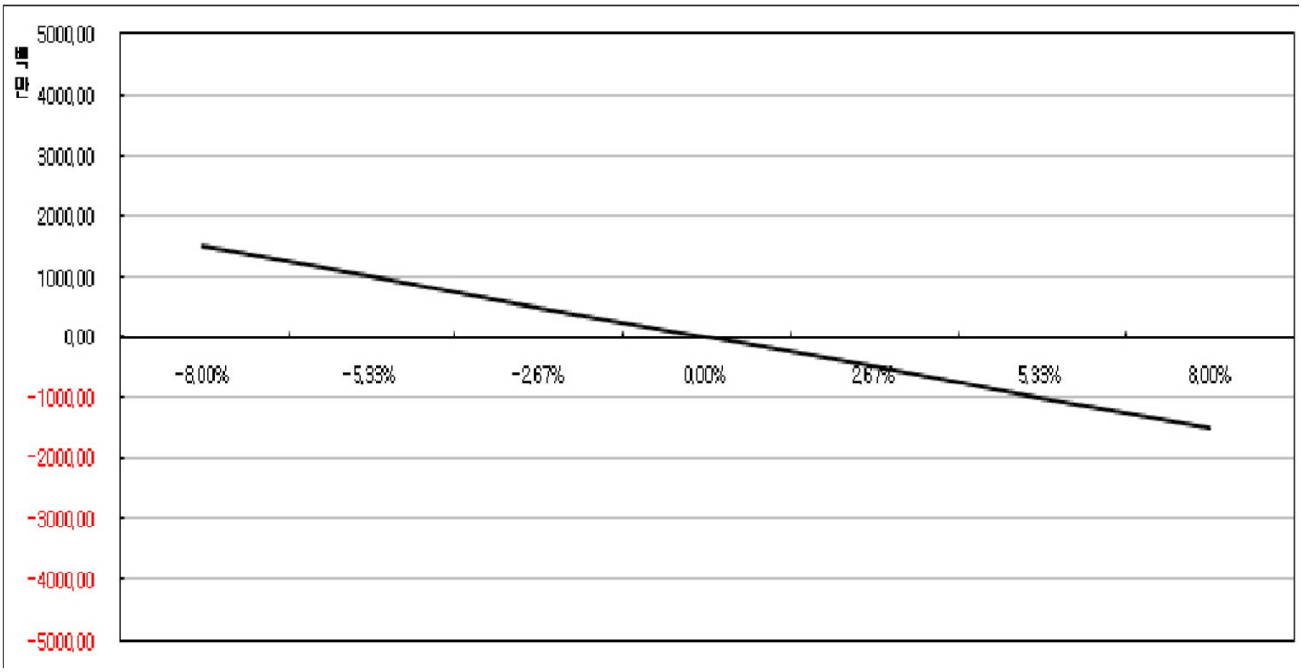
공시일: 2019-09-30

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	0	1,967	-1,967	장내
합계			0	1,967	-1,967	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

158

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

137

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

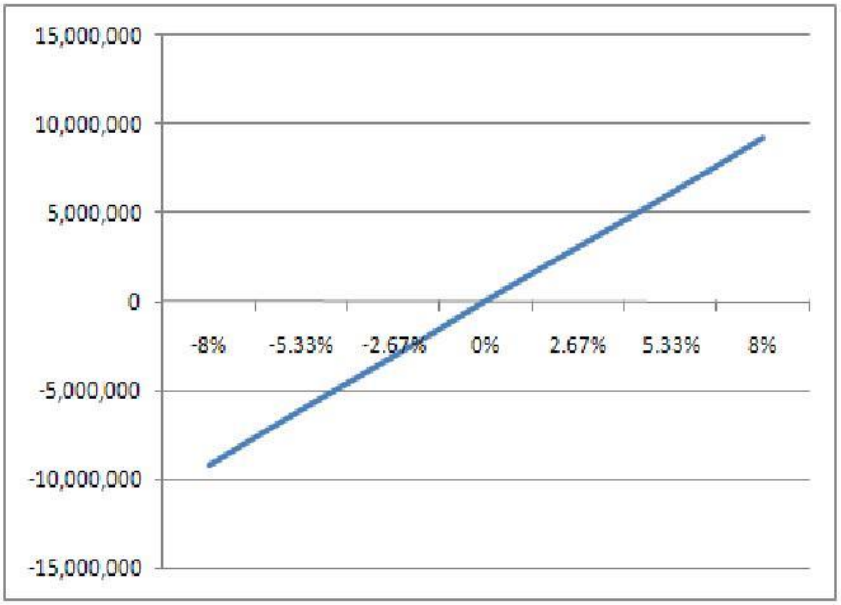
공시일: 2019-09-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,017	-1,017	장내
누계	주가지수	선물	63,695	0	63,695	장내
합계			63,695	0	63,695	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,103

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,421