펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-10-01

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	1,505	0	1,505	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	2,736	-2,734	장내
합계			1,506	2,736	-1,229	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

85

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

155

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

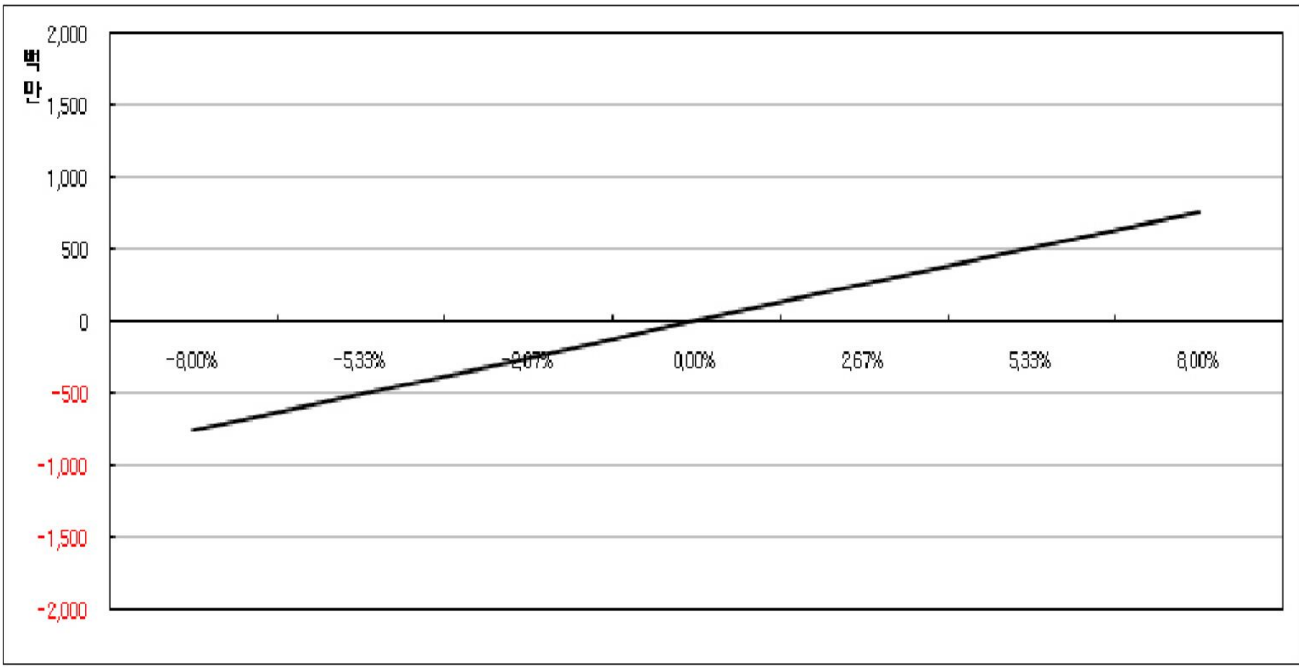
공시일: 2019-10-01

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)

429

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

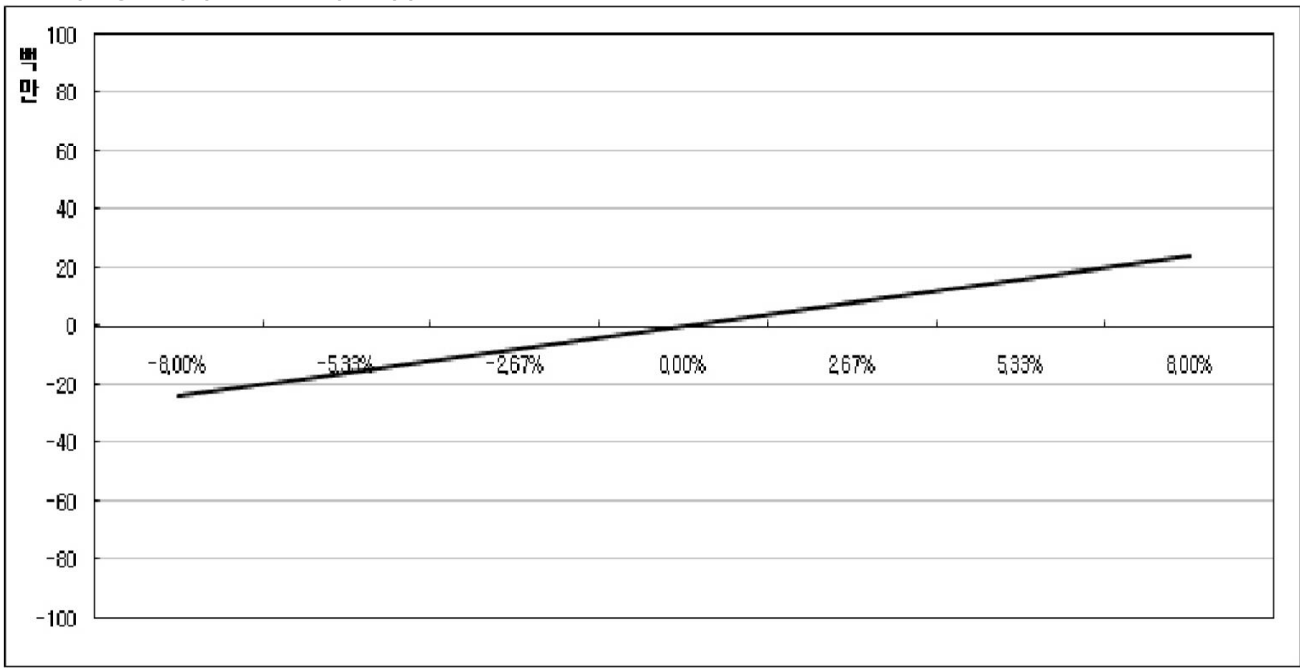
공시일: 2019-10-01

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	1,094	0	1,094	장내
합계			1,094	0	1,094	

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]

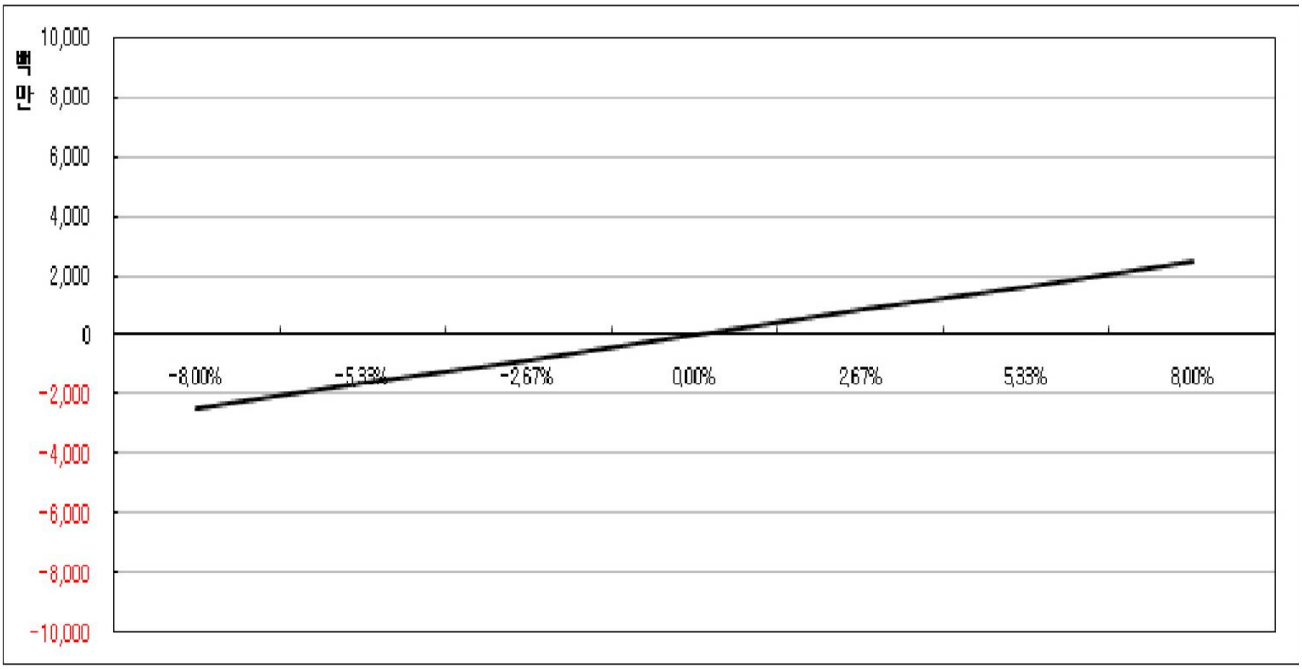
공시일: 2019-10-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	68	0	68	장내
누계	주가지수	선물	4,924	0	4,924	장내
합계			4,924	0	4,924	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

395

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,017

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

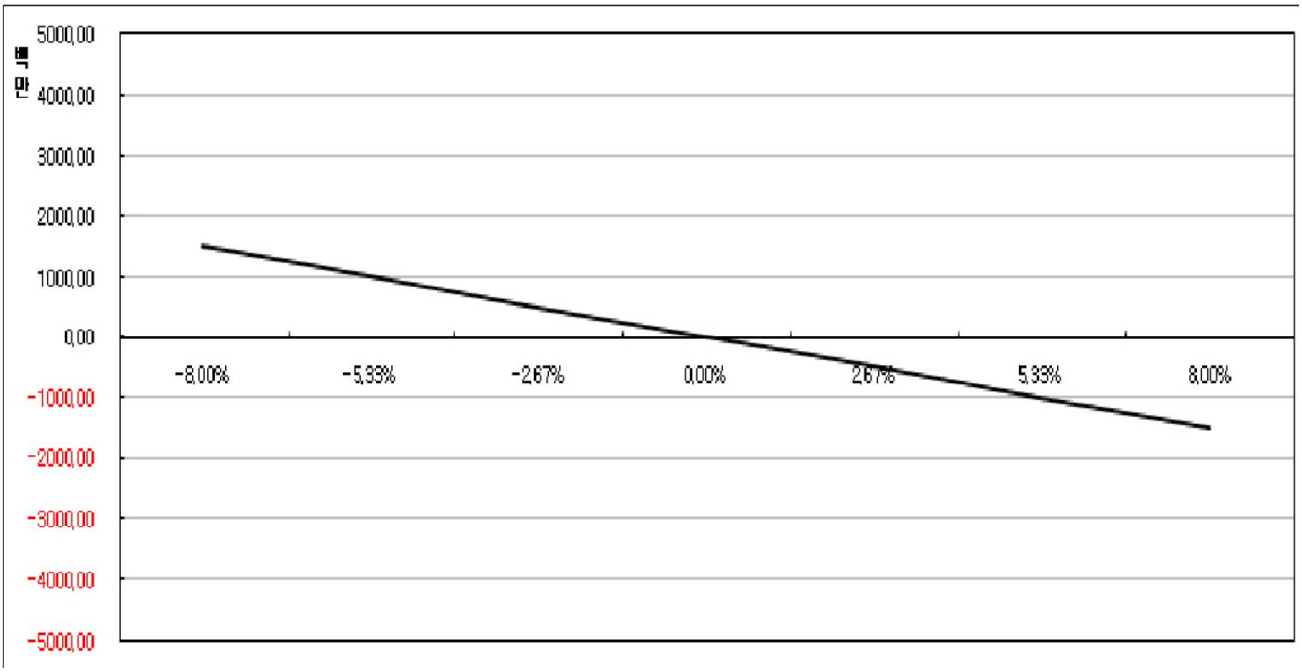
공시일: 2019-10-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	137	0	137	장내
누계	주가지수	선물	0	1,846	-1,846	장내
합계			0	1,846	-1,846	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

148

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

129

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

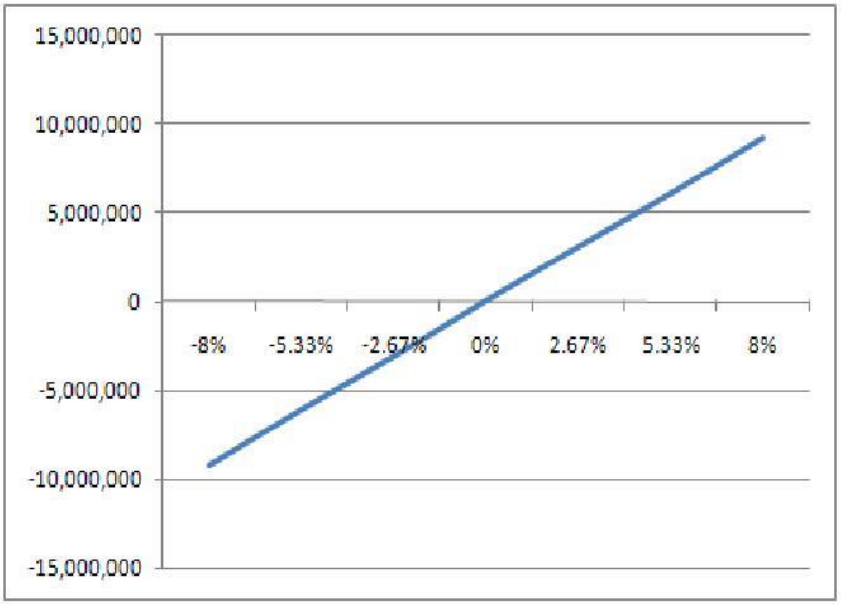
공시일: 2019-10-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,778	0	1,778	장내
누계	주가지수	선물	65,994	0	65,994	장내
합계			65,994	0	65,994	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,291

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,587