펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-10-04

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	1,477	0	1,477	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	2,686	-2,682	장내
합계			1,481	2,686	-1,205	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

97

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

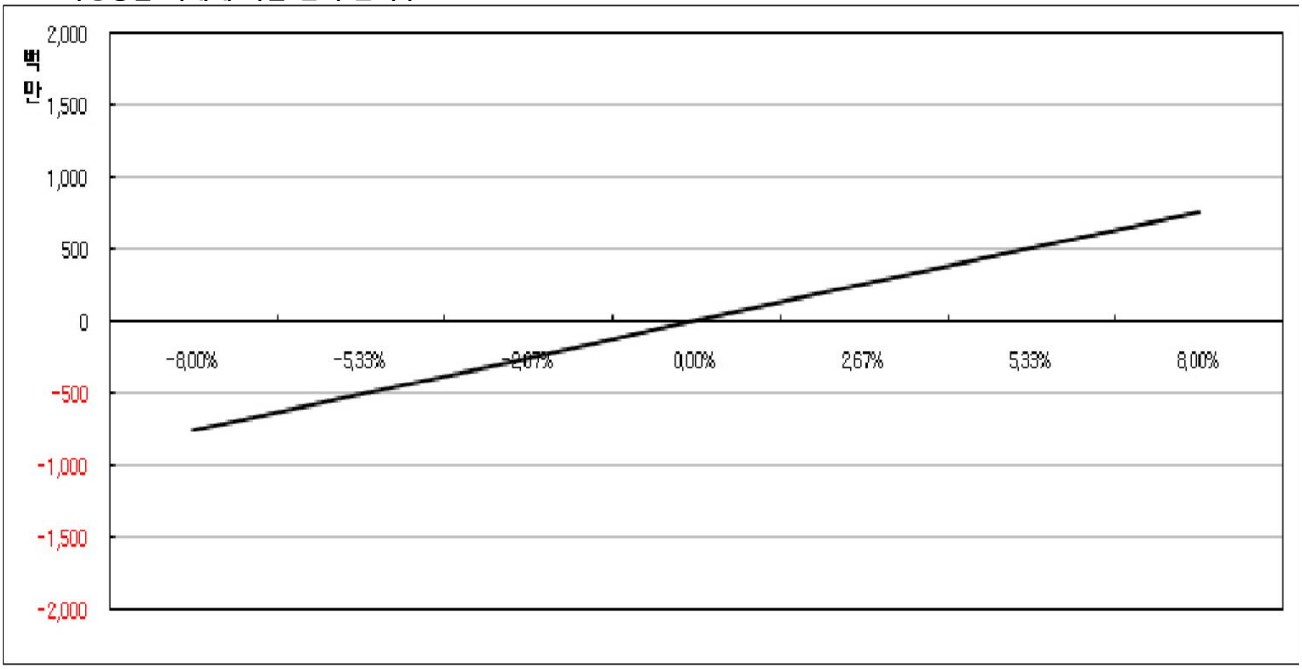
공시일: 2019-10-04

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	134	0	134	장내
합계			134	0	134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

422

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

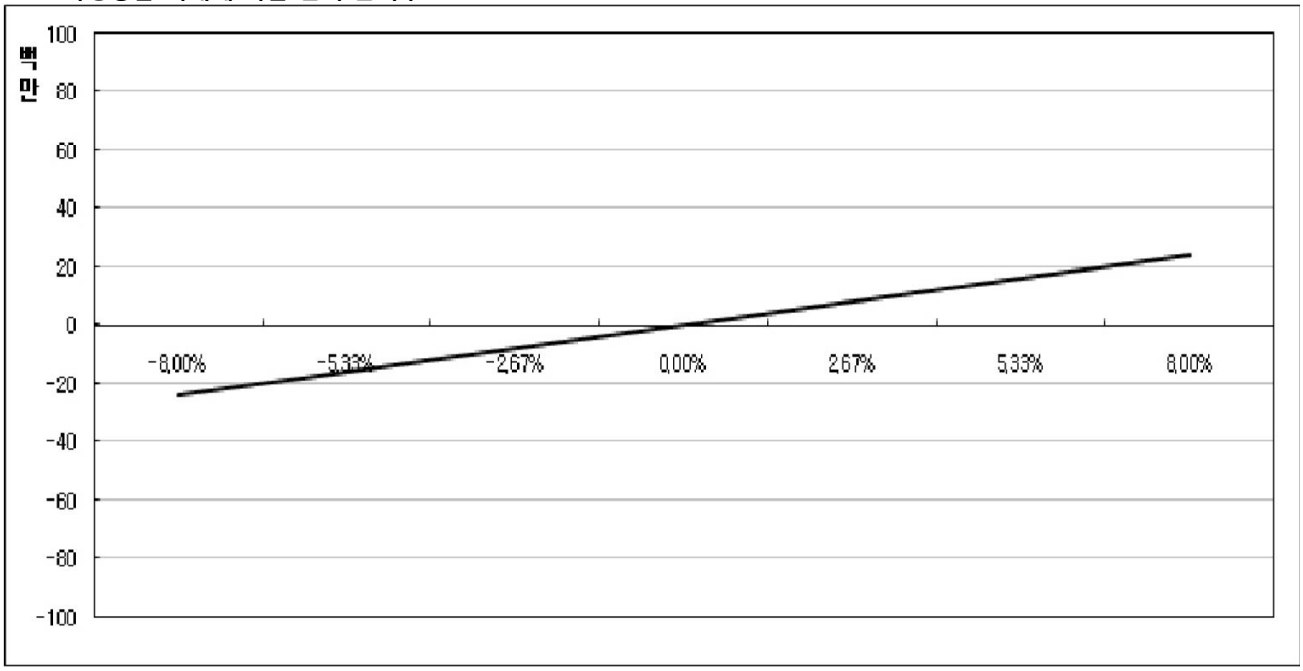
공시일: 2019-10-04

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	1,074	0	1,074	장내
합계			1,074	0	1,074	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

86

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

517

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

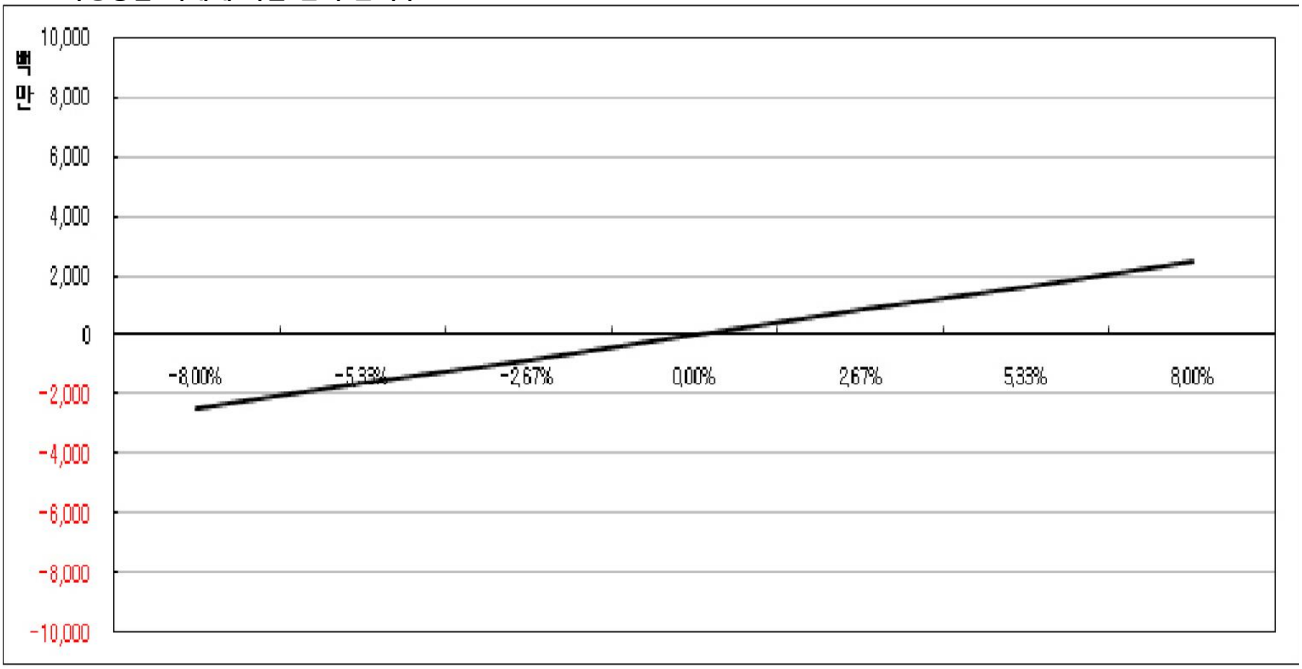
공시일: 2019-10-04

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	5,035	0	5,035	장내
합계			5,035	0	5,035	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

403

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,013

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

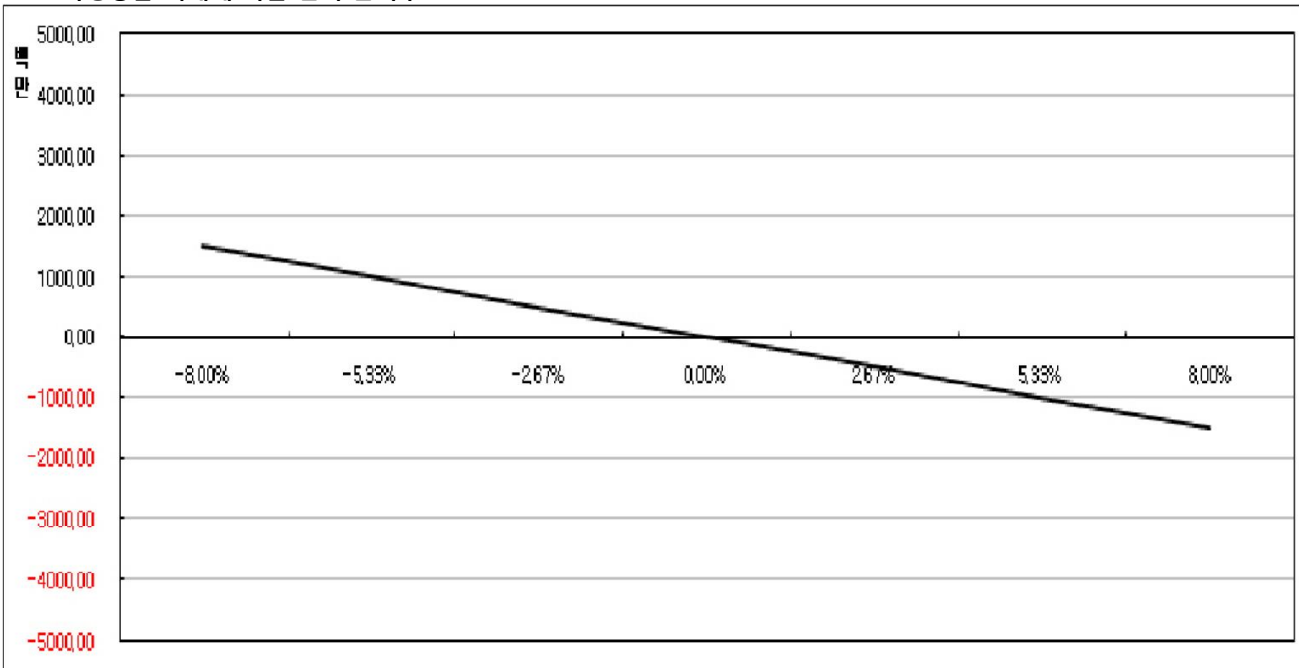
공시일: 2019-10-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	67	-67	장내
누계	주가지수	선물	0	1,678	-1,678	장내
합계			0	1,678	-1,678	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

134

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

117

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

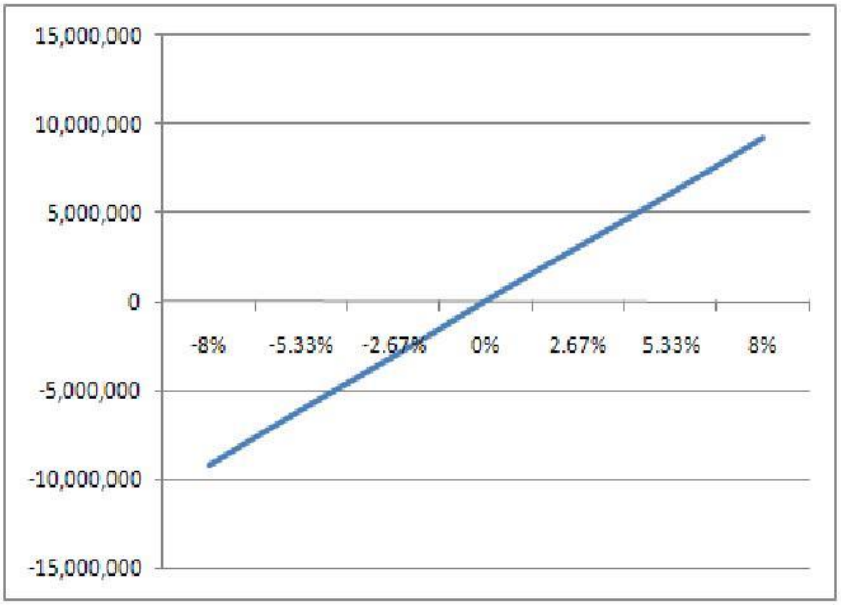
공시일: 2019-10-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	336	-336	장내
누계	주가지수	선물	64,586	0	64,586	장내
합계			64,586	0	64,586	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,439