펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-10-11

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	1,478	0	1,478	장내
신규	주가지수	옵션	1	1,344	-1,343	장내
누계	주가지수	옵션	0	0	0	장내
합계			1,478	0	1,478	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

119

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

160

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

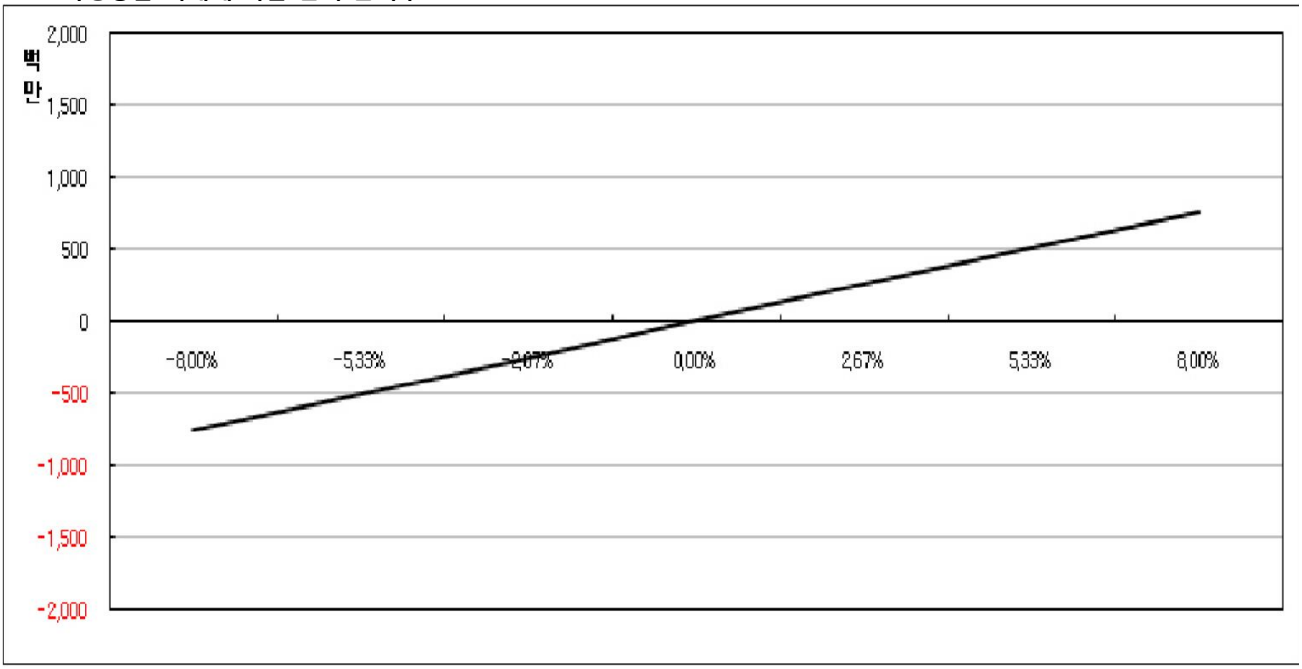
공시일: 2019-10-11

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)

362

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

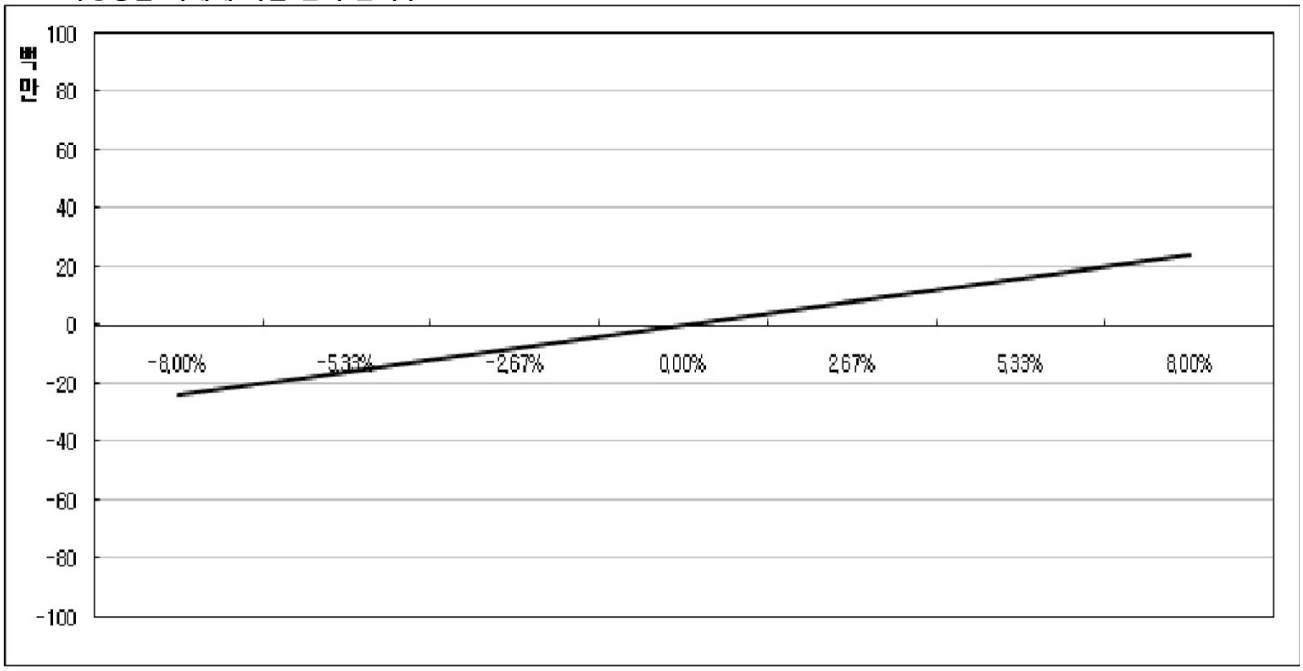
공시일: 2019-10-11

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	1,075	0	1,075	장내
합계			1,075	0	1,075	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

87

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

451

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

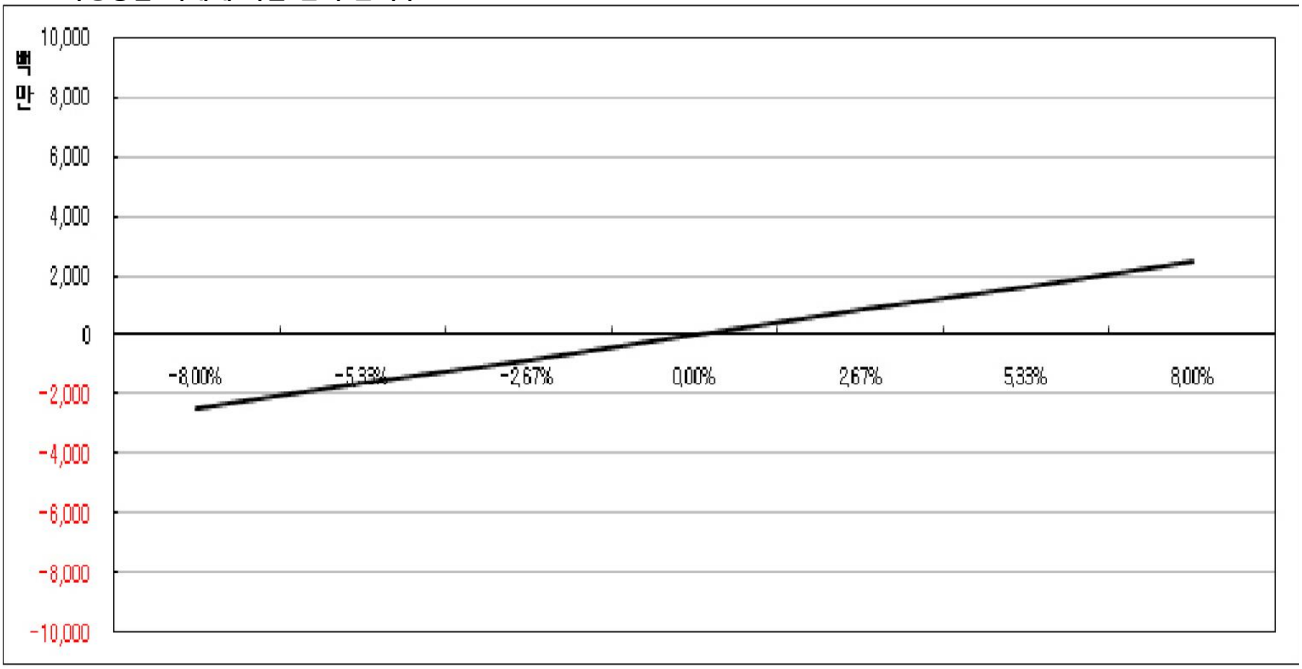
공시일: 2019-10-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	202	-67	장내
누계	주가지수	선물	5,107	0	5,107	장내
합계			5,107	0	5,107	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

411

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

899

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

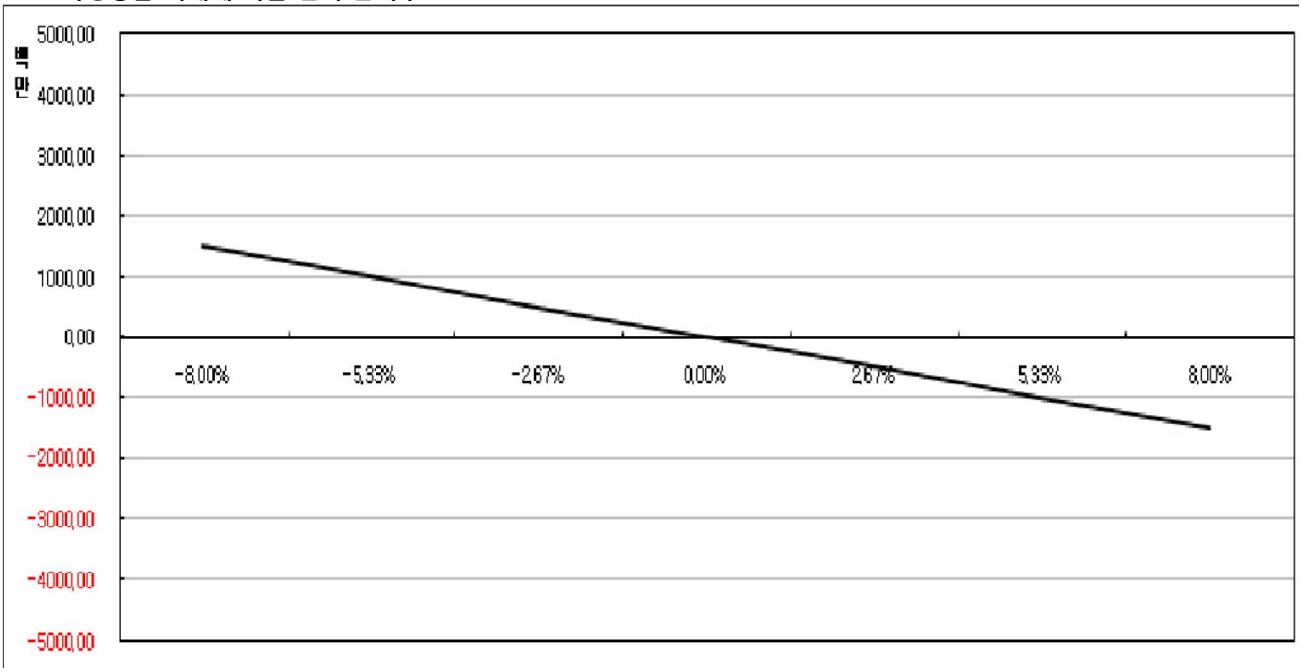
공시일: 2019-10-11

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	0	1,747	-1,747	장내
합계			0	1,747	-1,747	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

141

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

117

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

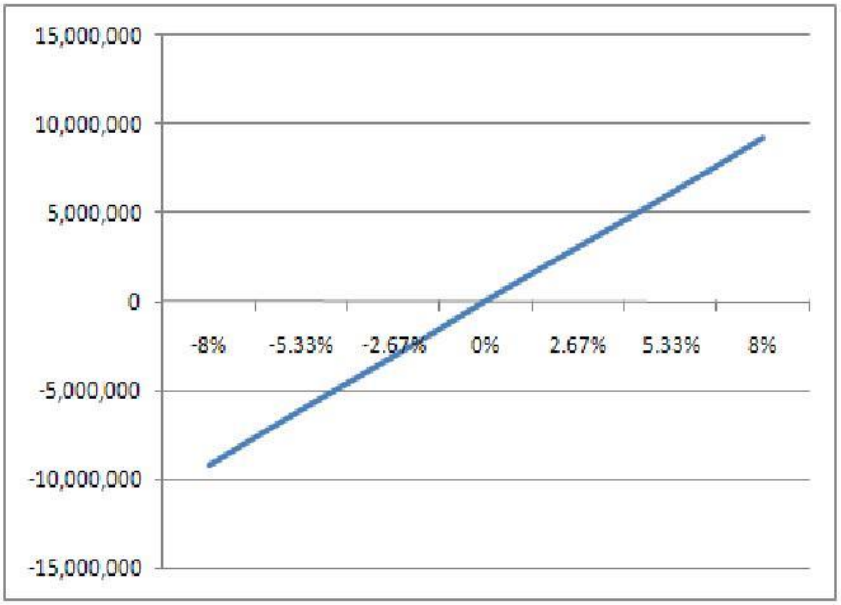
공시일: 2019-10-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	269	-269	장내
누계	주가지수	선물	66,394	0	66,394	장내
합계			66,394	0	66,394	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,342

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,563