펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-05

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	2,761	0	2,761	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	26	0	26	장내
합계			2,787	0	2,787	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

73

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

317

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

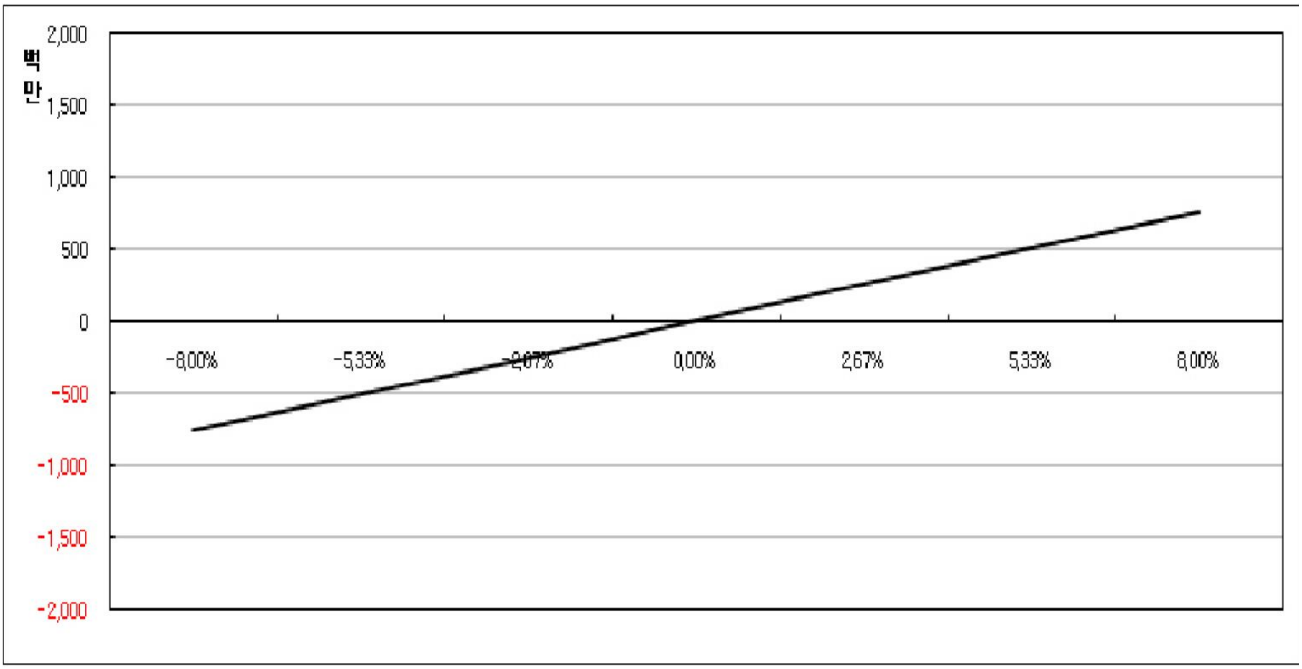
공시일: 2019-08-05

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	131	0	131	장내
합계			131	0	131	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

393

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

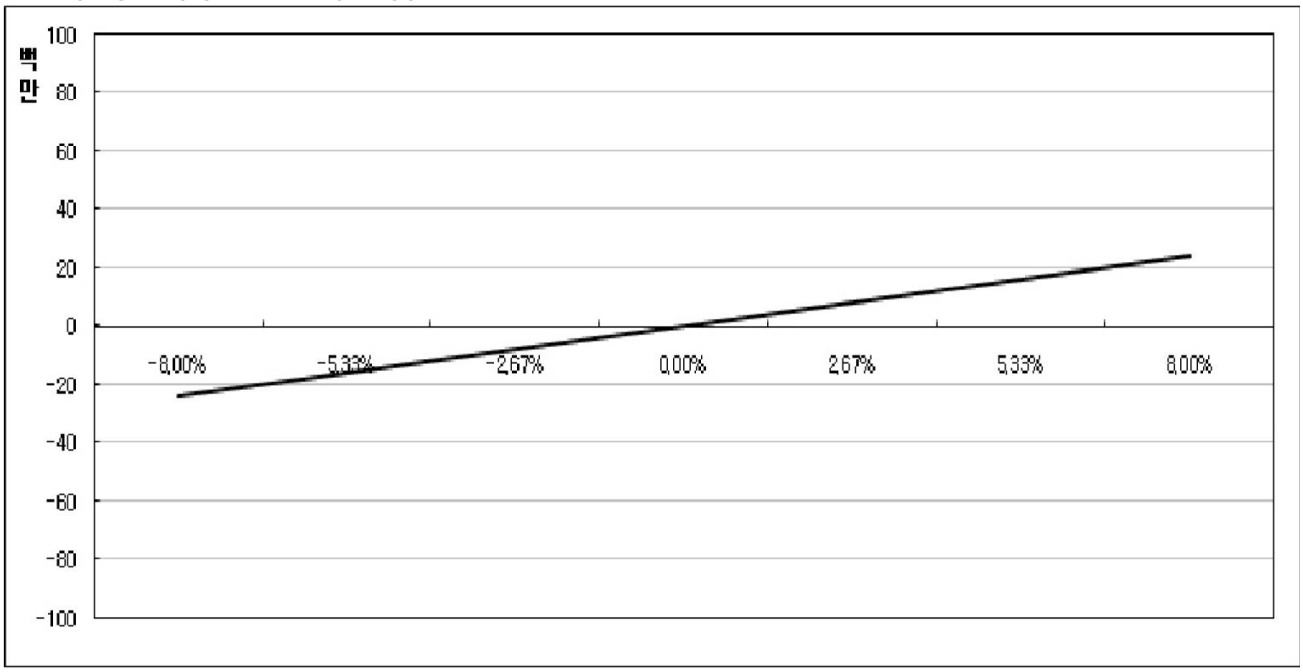
공시일: 2019-08-05

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	986	0	986	장내
합계			986	0	986	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

79

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

475

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

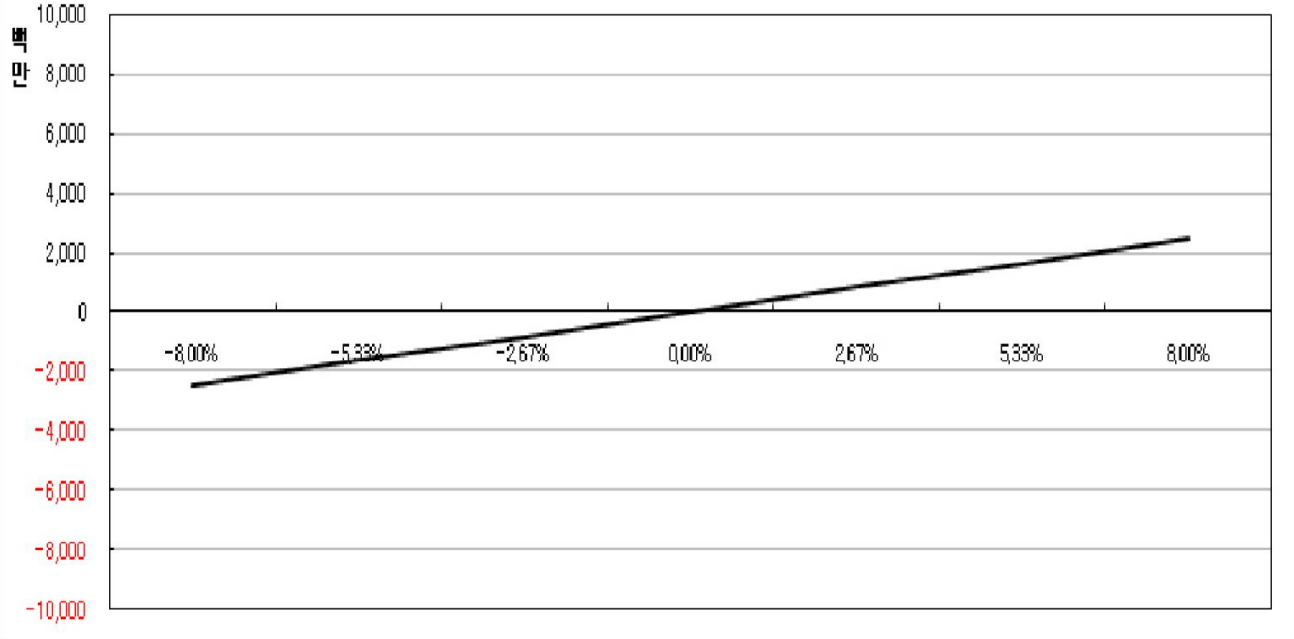
공시일: 2019-08-05

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	4,800	0	4,800	장내
합계			4,800	0	4,800	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

384

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

928

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

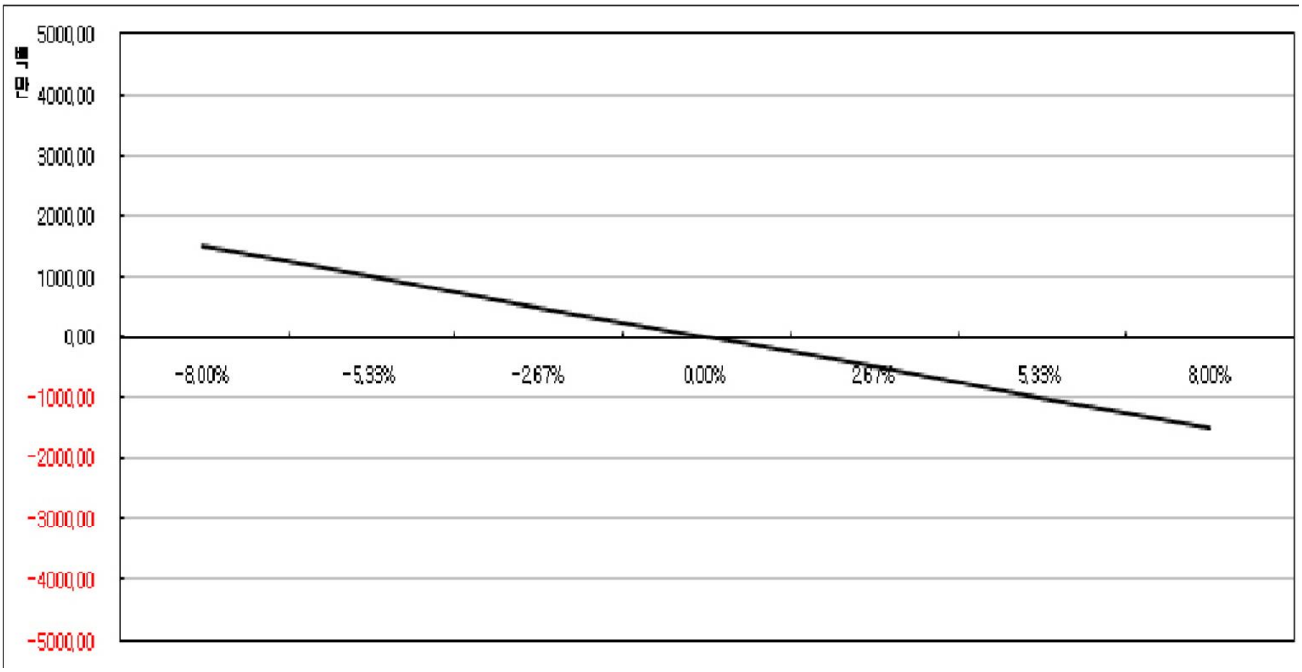
공시일: 2019-08-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	197	0	197	장내
누계	주가지수	선물	0	2,038	-2,038	장내
합계			0	2,038	-2,038	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

163

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

138

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

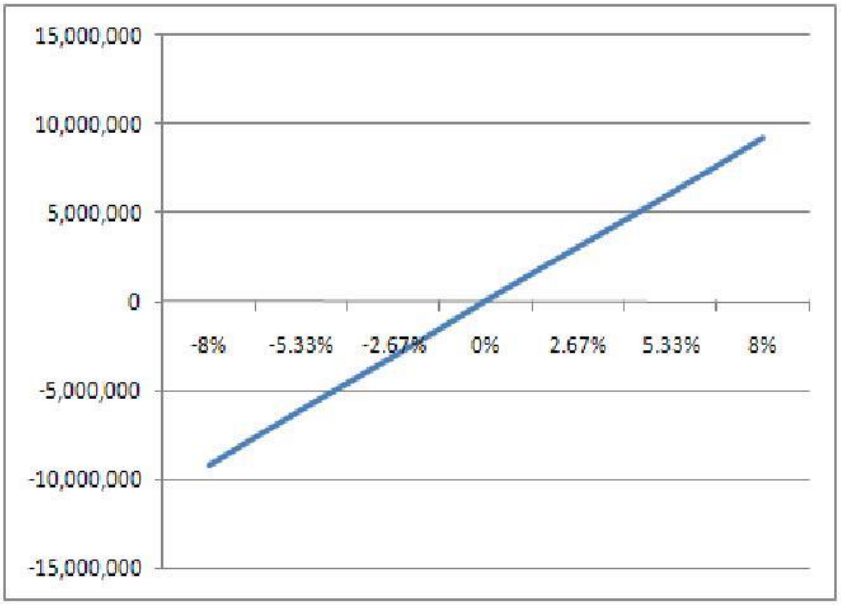
공시일: 2019-08-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	460	0	460	장내
누계	주가지수	선물	68,114	0	68,114	장내
합계			68,114	0	68,114	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,452

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,945