펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-06

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	2,700	0	2,700	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	63	0	63	장내
합계			2,764	0	2,764	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

296

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

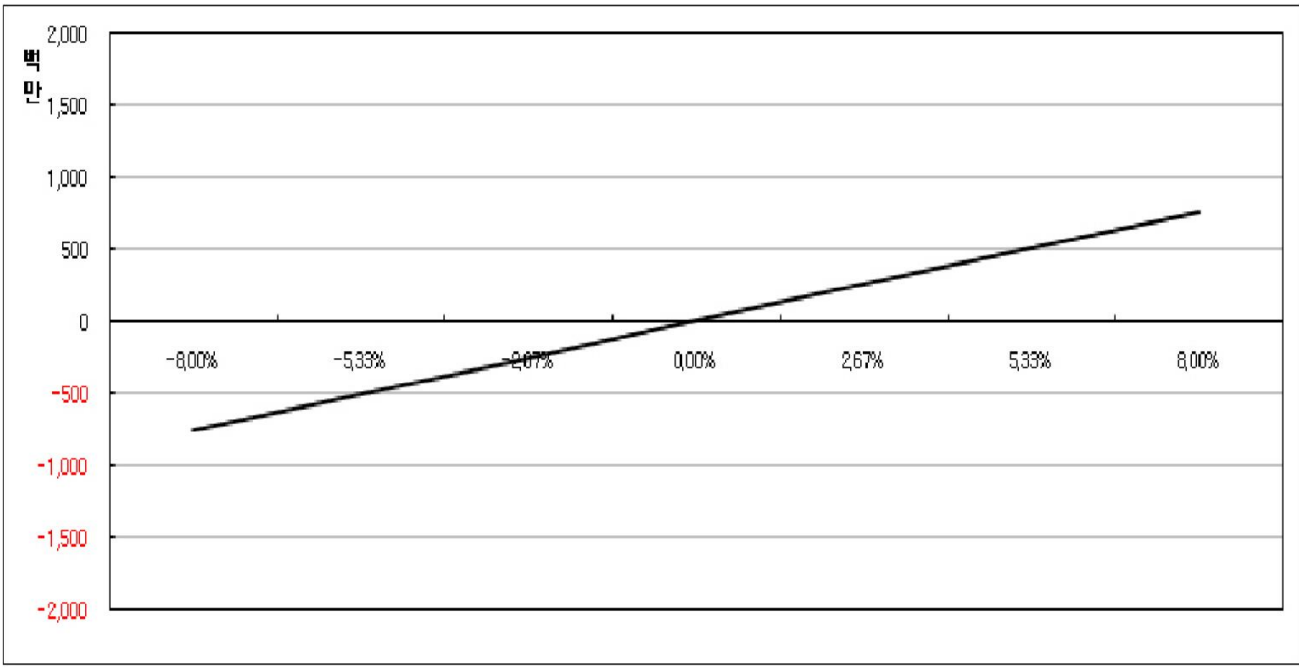
공시일: 2019-08-06

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	129	0	129	장내
합계			129	0	129	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

389

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

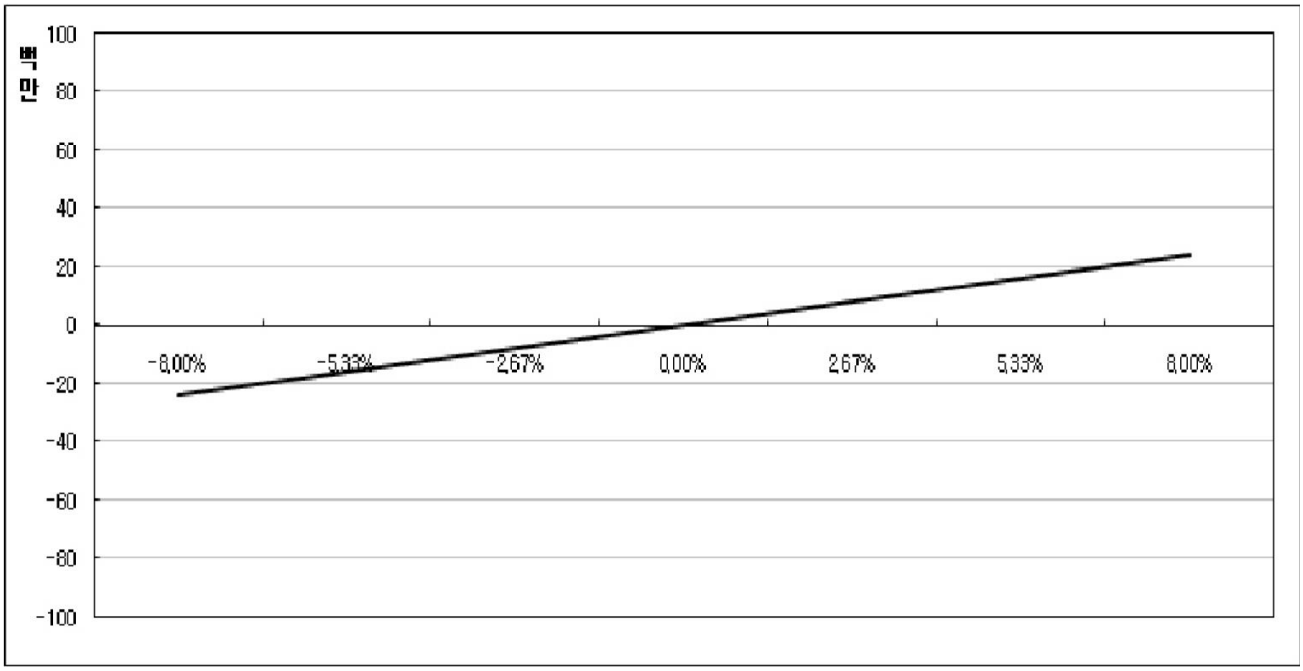
공시일: 2019-08-06

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	964	0	964	장내
합계			964	0	964	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

471

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

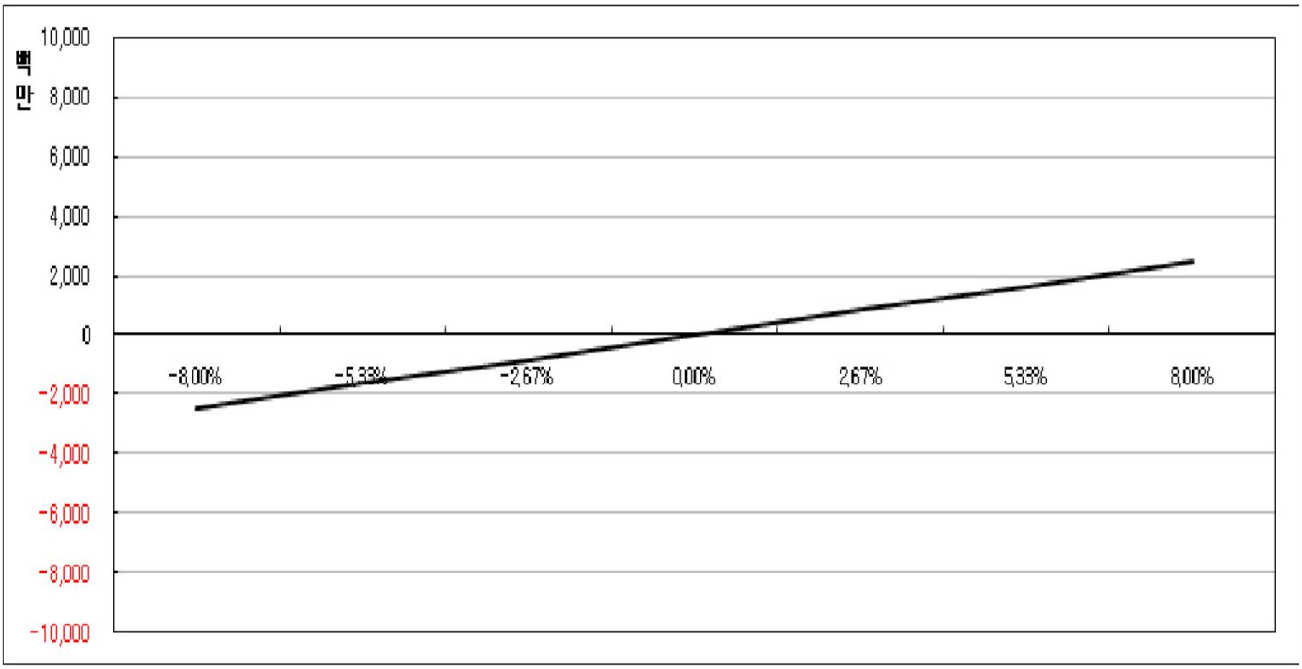
공시일: 2019-08-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	129	0	129	장내
누계	주가지수	선물	4,822	0	4,822	장내
합계			4,822	0	4,822	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

385

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

929

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

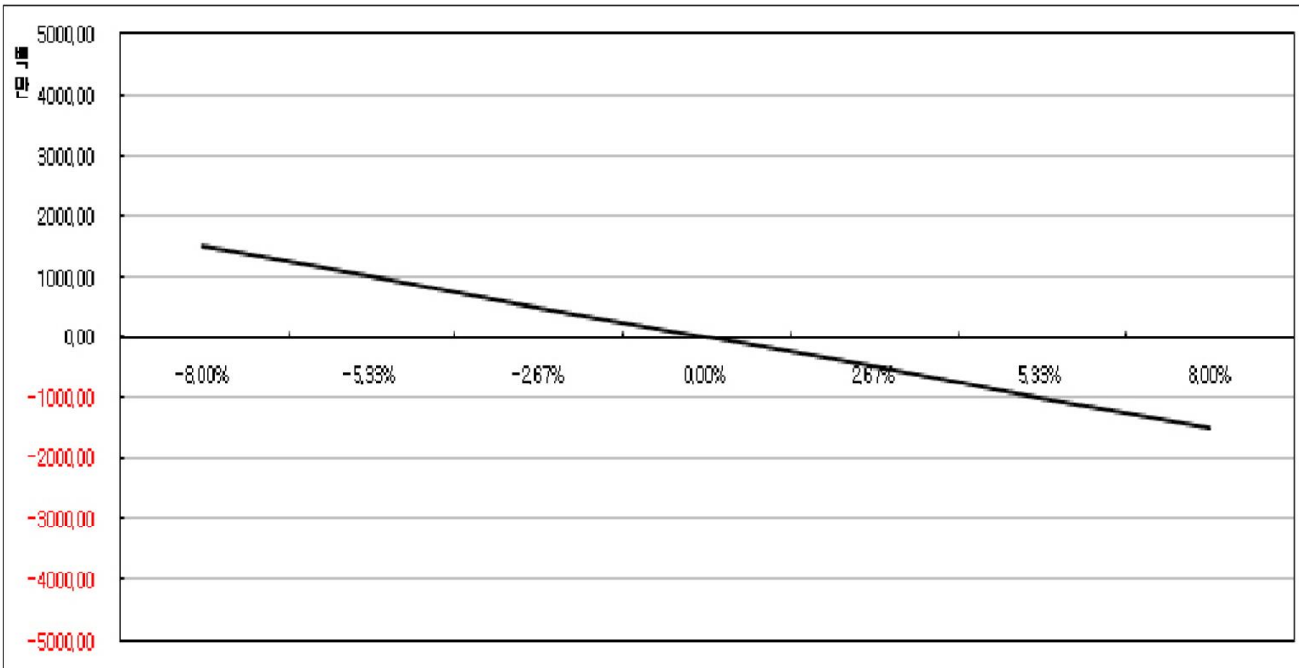
공시일: 2019-08-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	129	-129	장내
누계	주가지수	선물	0	2,122	-2,122	장내
합계			0	2,122	-2,122	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

170

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

145

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

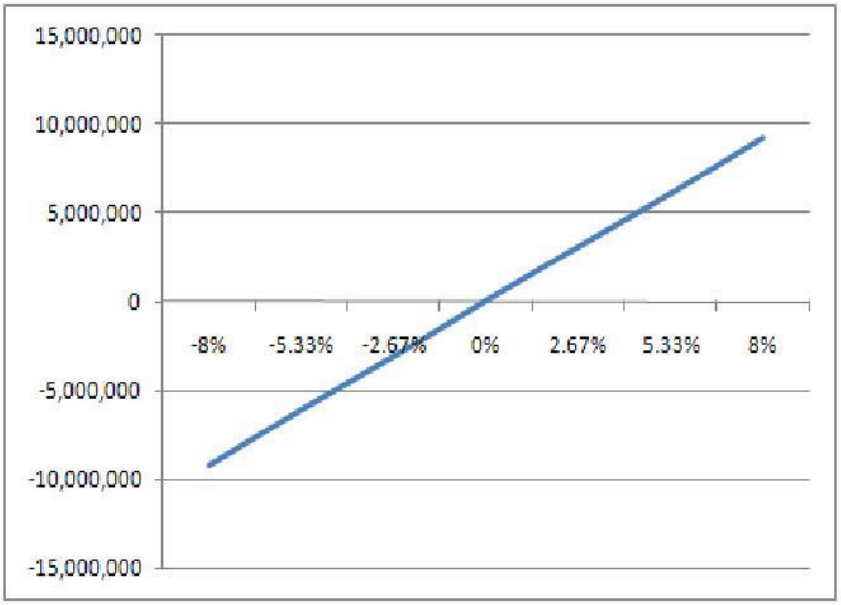
공시일: 2019-08-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,029	-1,029	장내
누계	주가지수	선물	65,583	0	65,583	장내
합계			65,583	0	65,583	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,242

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,833