펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-07

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	2,661	0	2,661	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	87	0	87	장내
합계			2,748	0	2,748	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

276

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

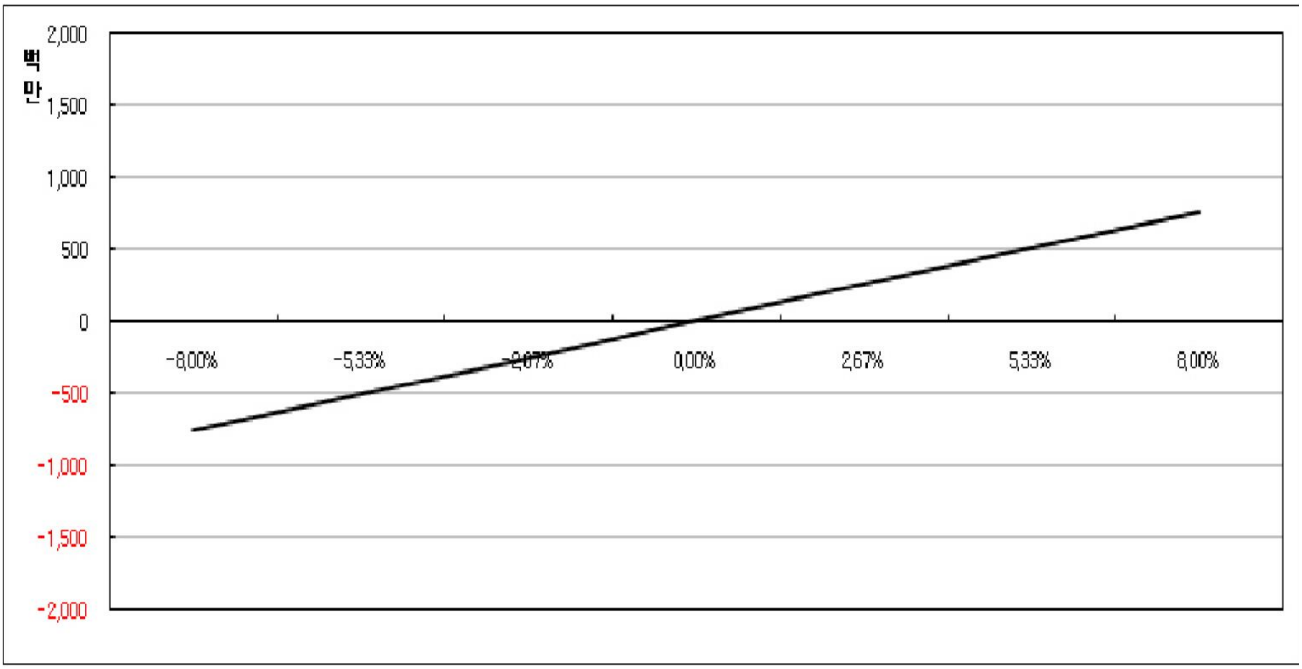
공시일: 2019-08-07

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	127	0	127	장내
합계			127	0	127	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

386

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

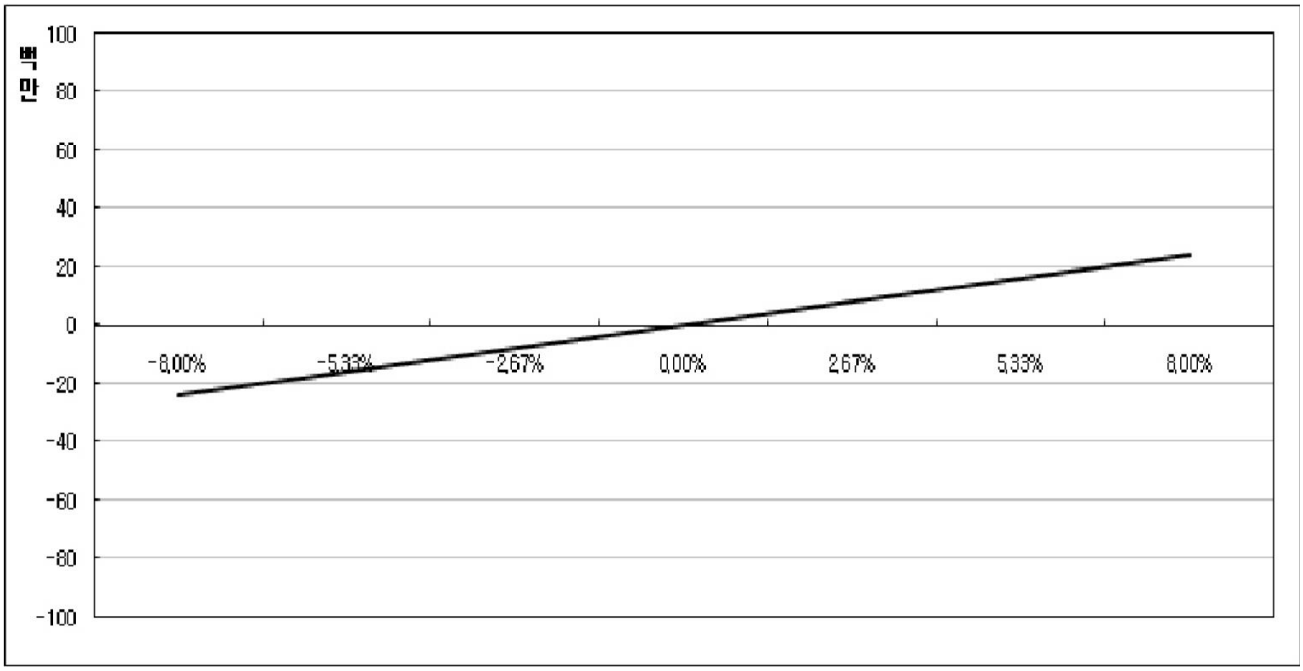
공시일: 2019-08-07

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	950	0	950	장내
합계			950	0	950	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

467

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

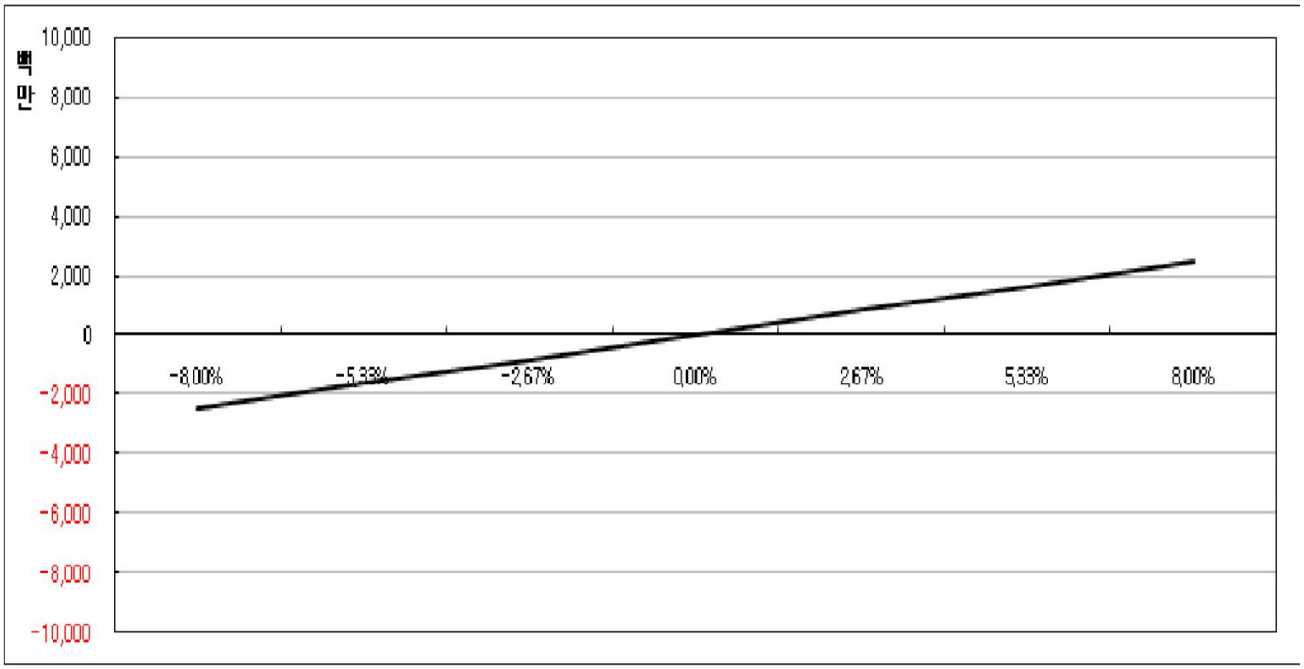
공시일: 2019-08-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	63	-63	장내
누계	주가지수	선물	4,688	0	4,688	장내
합계			4,688	0	4,688	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

375

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

918

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

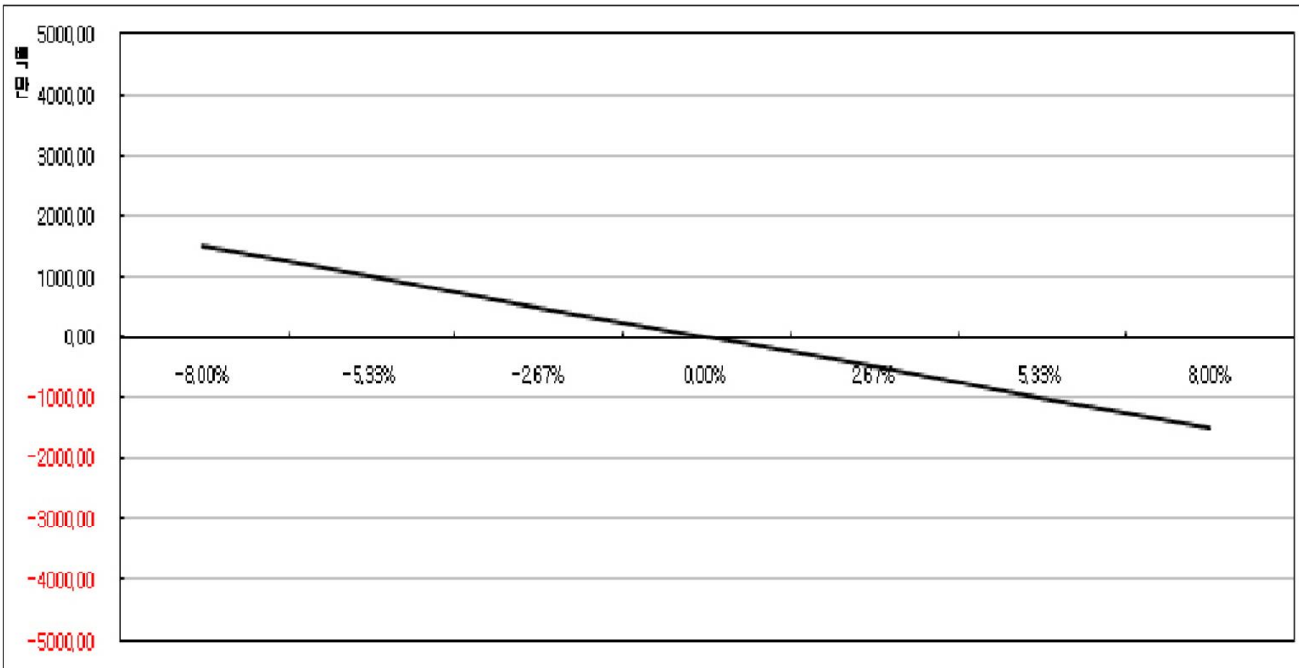
공시일: 2019-08-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	190	0	190	장내
누계	주가지수	선물	0	1,901	-1,901	장내
합계			0	1,901	-1,901	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

152

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

131

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

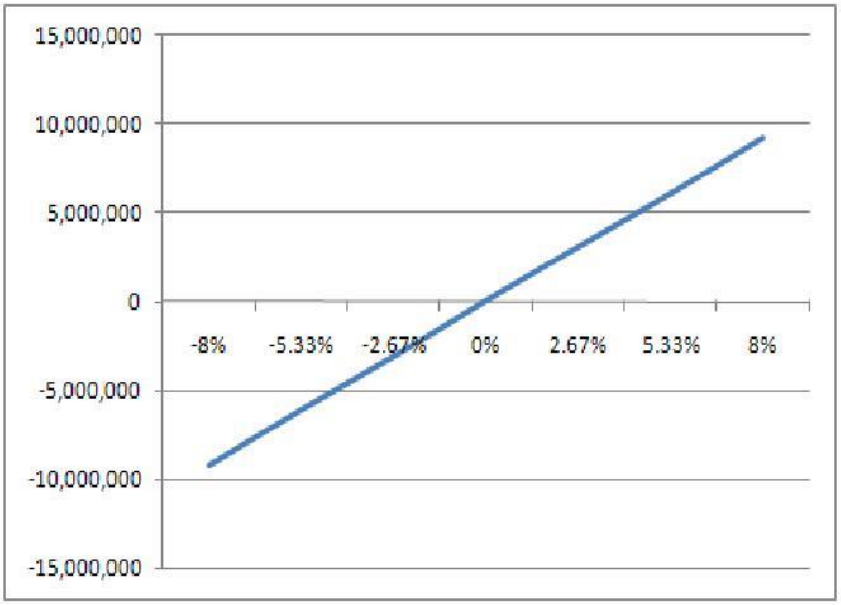
공시일: 2019-08-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	127	0	127	장내
누계	주가지수	선물	64,746	0	64,746	장내
합계			64,746	0	64,746	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,185

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,769