펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-08

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	2,646	0	2,646	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	92	0	92	장내
합계			2,738	0	2,738	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

262

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

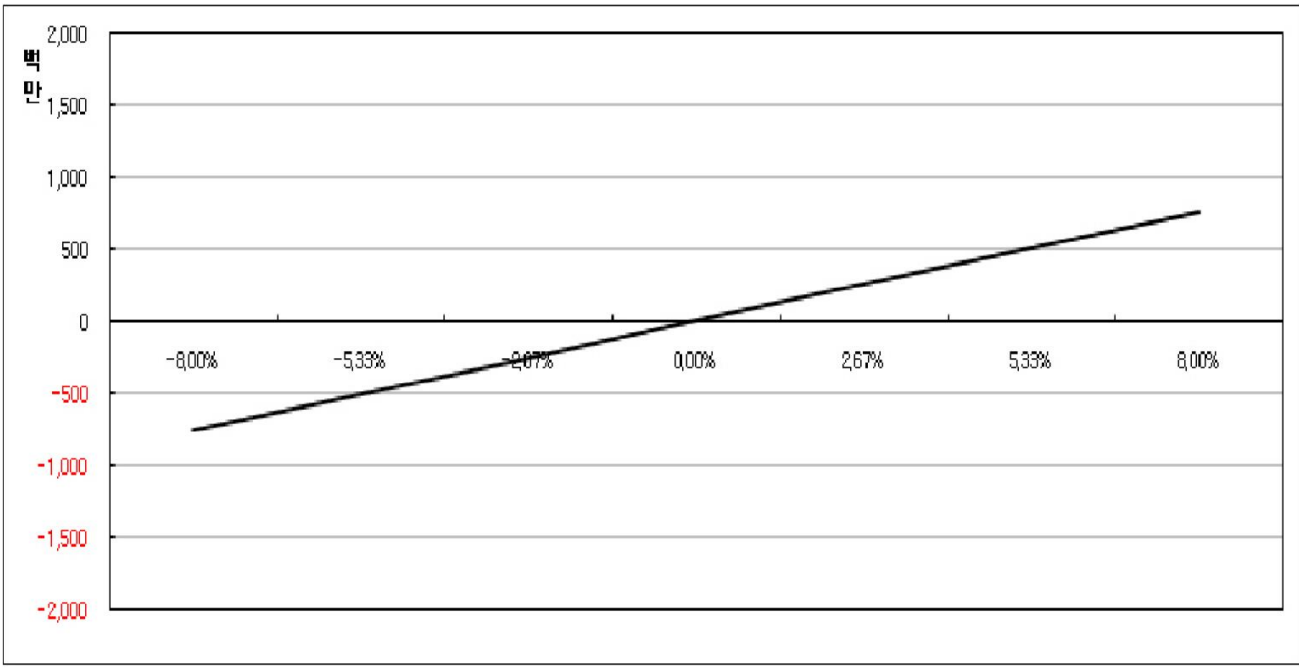
공시일: 2019-08-08

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	126	0	126	장내
합계			126	0	126	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

384

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

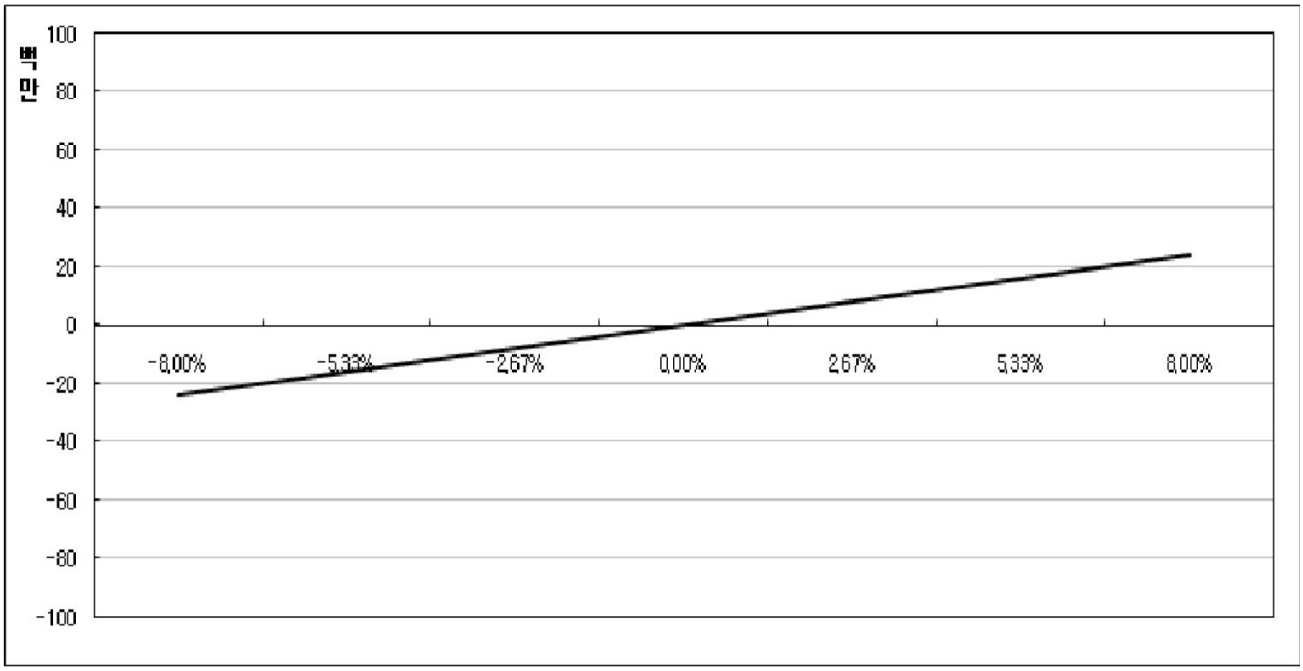
공시일: 2019-08-08

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	945	0	945	장내
합계			945	0	945	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

466

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

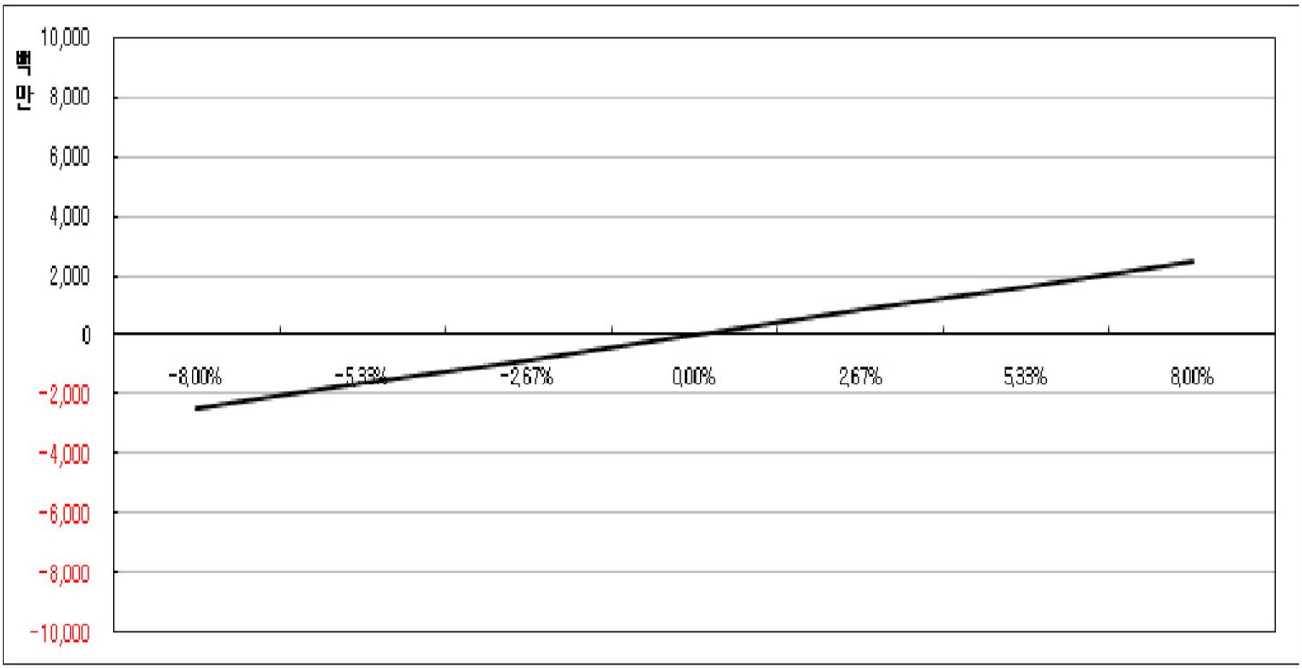
공시일: 2019-08-08

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	4,662	0	4,662	장내
합계			4,662	0	4,662	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

374

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

917

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

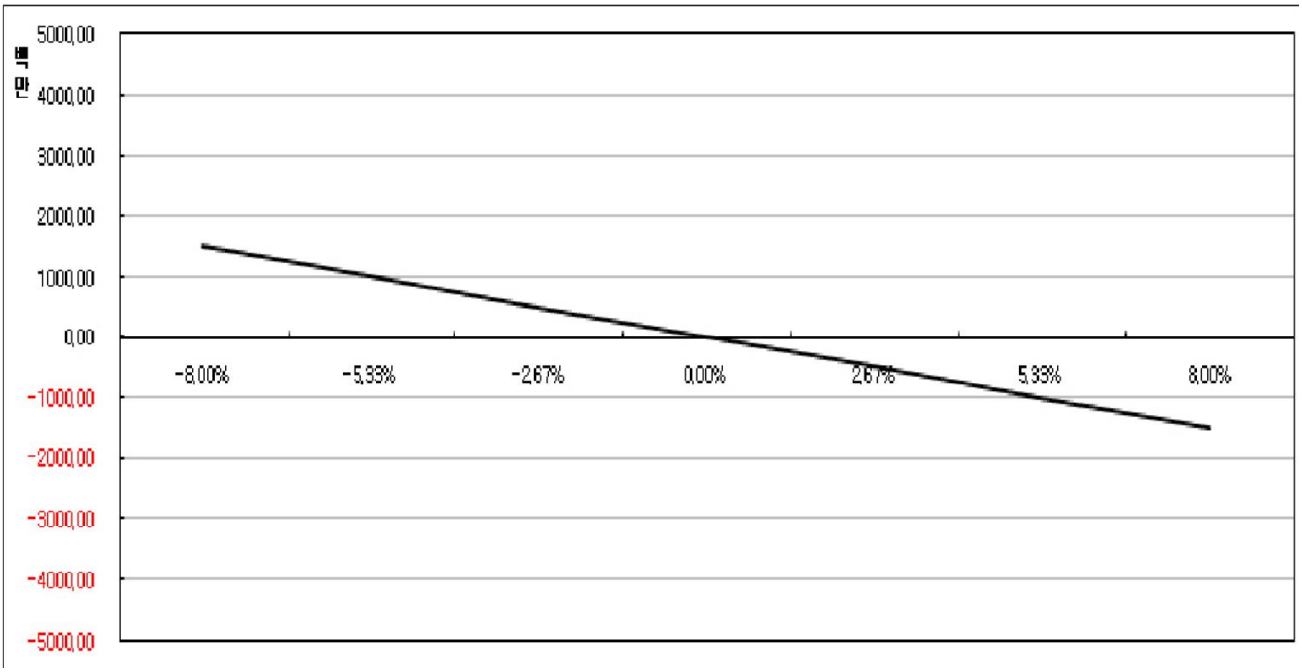
공시일: 2019-08-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	126	0	126	장내
누계	주가지수	선물	0	1,764	-1,764	장내
합계			0	1,764	-1,764	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

142

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

122

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

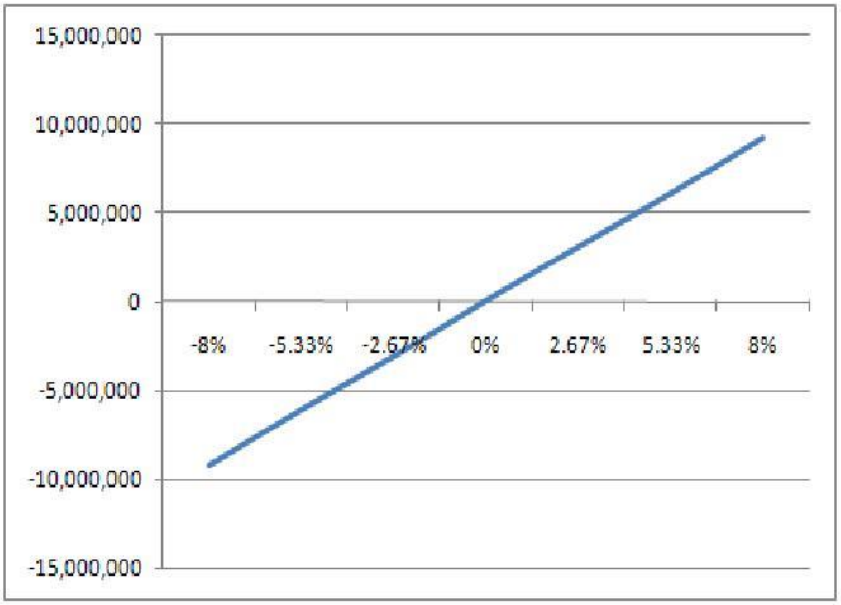
공시일: 2019-08-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	252	0	252	장내
누계	주가지수	선물	64,638	0	64,638	장내
합계			64,638	0	64,638	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,192

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,783