펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-13

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	2,681	0	2,681	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	8	5,362	-5,354	장내
합계			2,689	5,362	-2,673	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

139

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

834

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

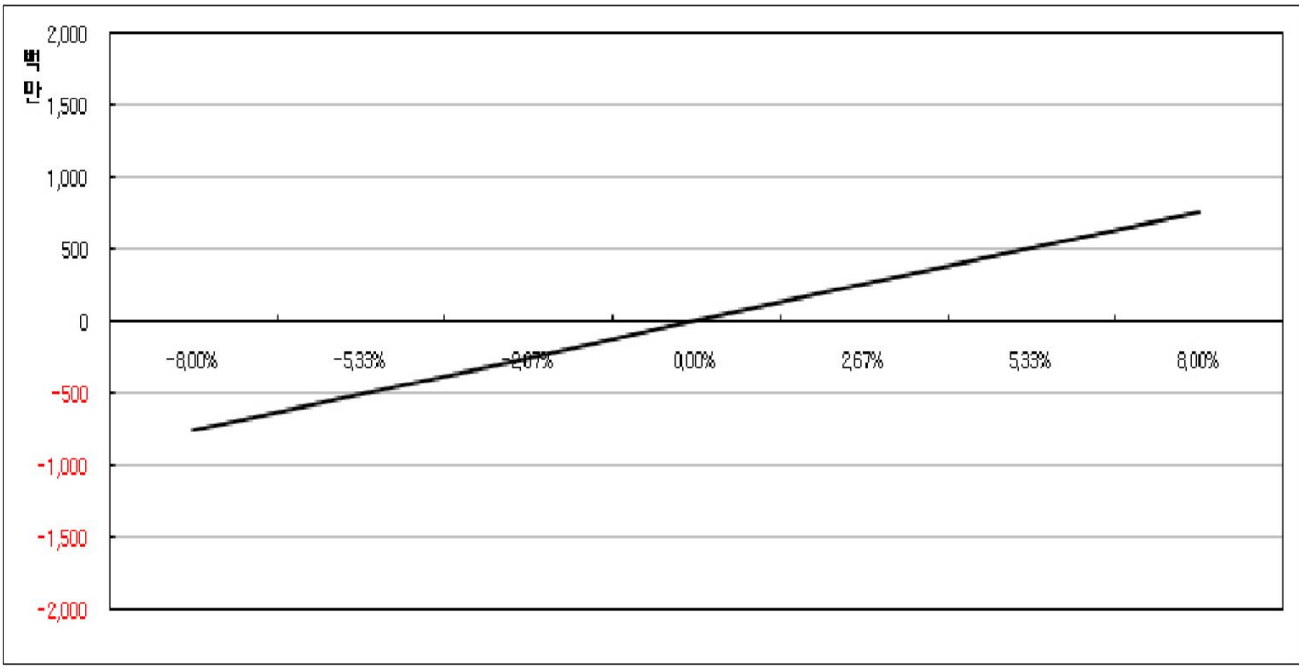
공시일: 2019-08-13

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	128	0	128	장내
합계			128	0	128	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

391

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

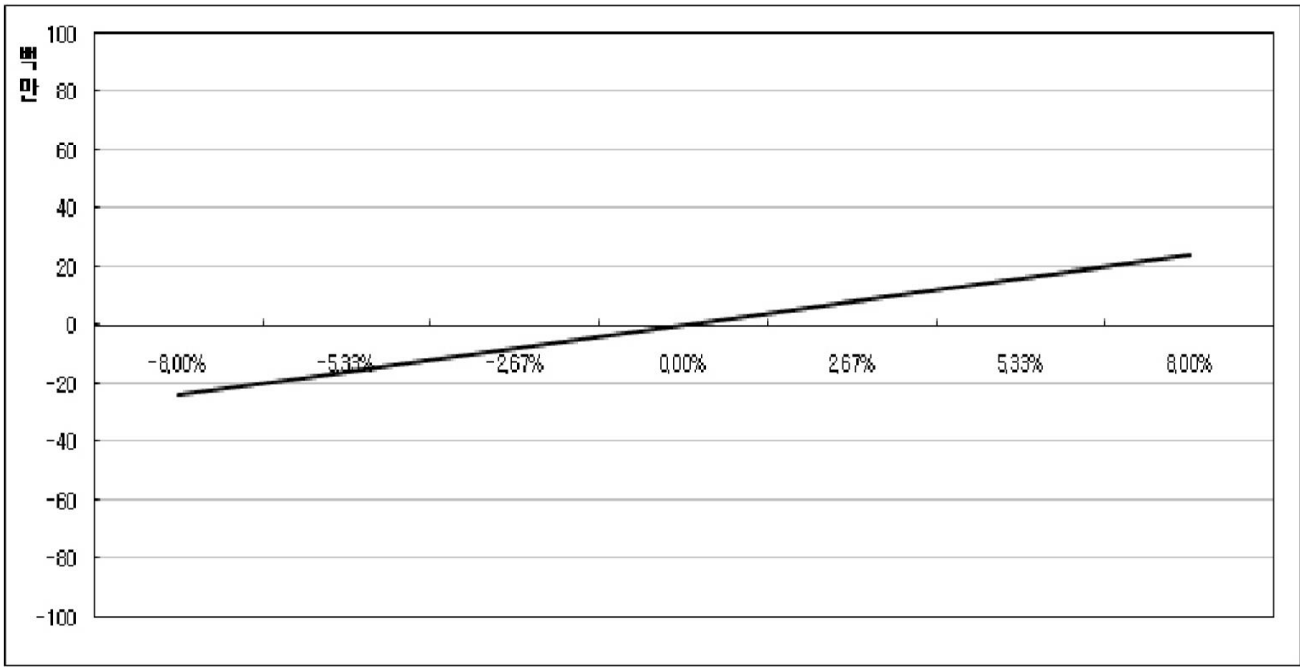
공시일: 2019-08-13

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	958	0	958	장내
합계			958	0	958	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

473

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

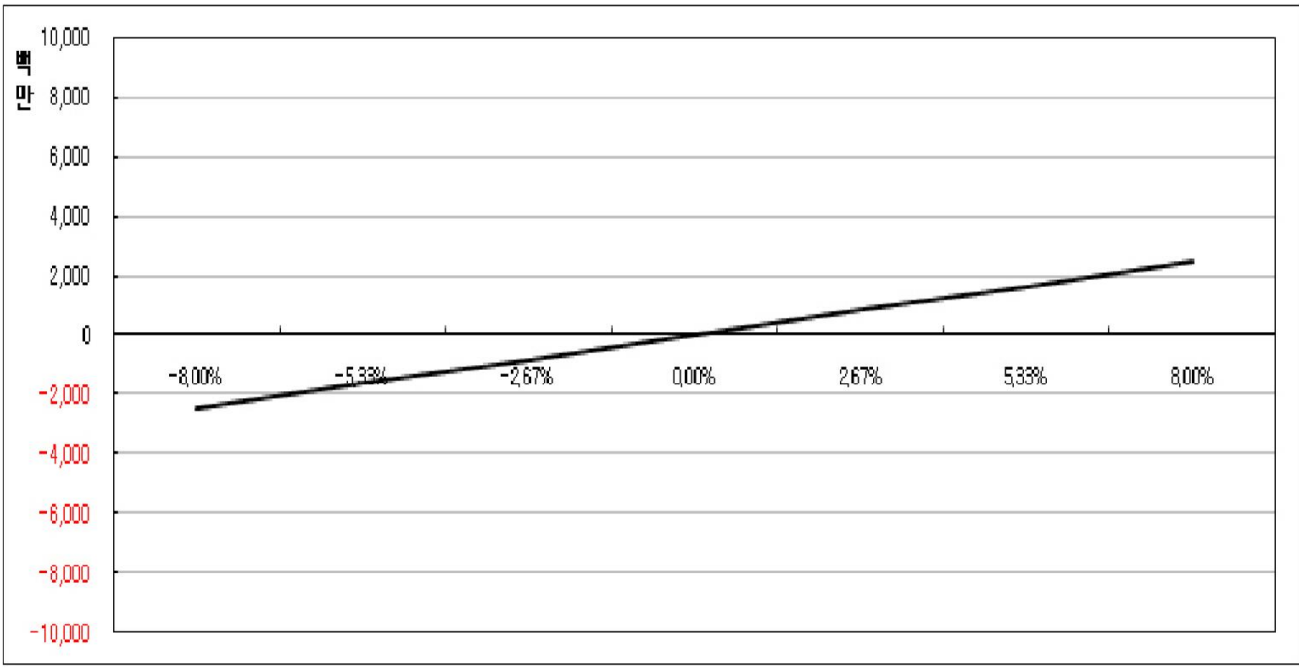
공시일: 2019-08-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	64	0	64	장내
누계	주가지수	선물	4,788	0	4,788	장내
합계			4,788	0	4,788	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

383

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

933

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

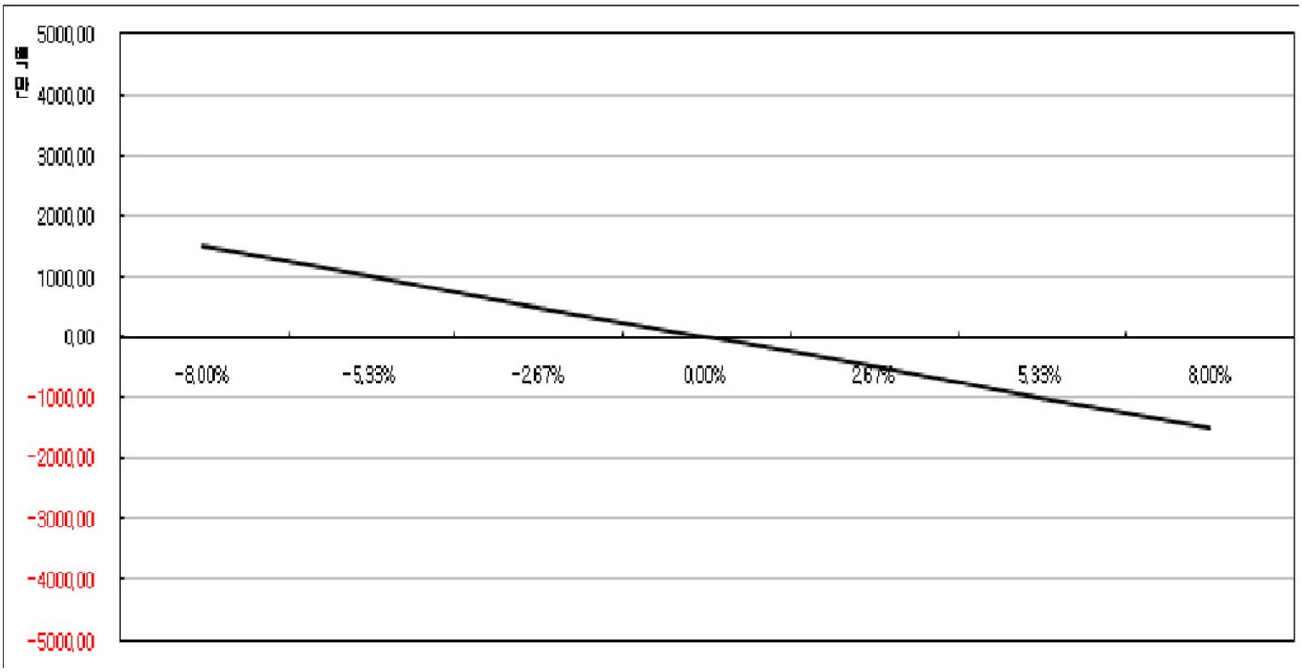
공시일: 2019-08-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	319	-319	장내
누계	주가지수	선물	0	1,979	-1,979	장내
합계			0	1,979	-1,979	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

158

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

135

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

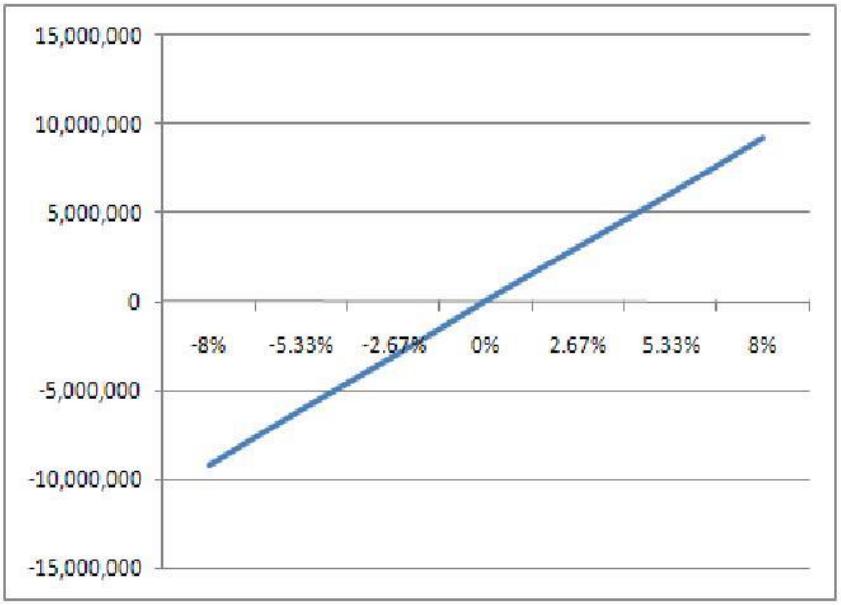
공시일: 2019-08-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	319	0	319	장내
누계	주가지수	선물	67,412	0	67,412	장내
합계			67,412	0	67,412	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,395

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,991