펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-19

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	2,666	0	2,666	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	5,332	-5,321	장내
합계			2,676	5,332	-2,656	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	123

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	598

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

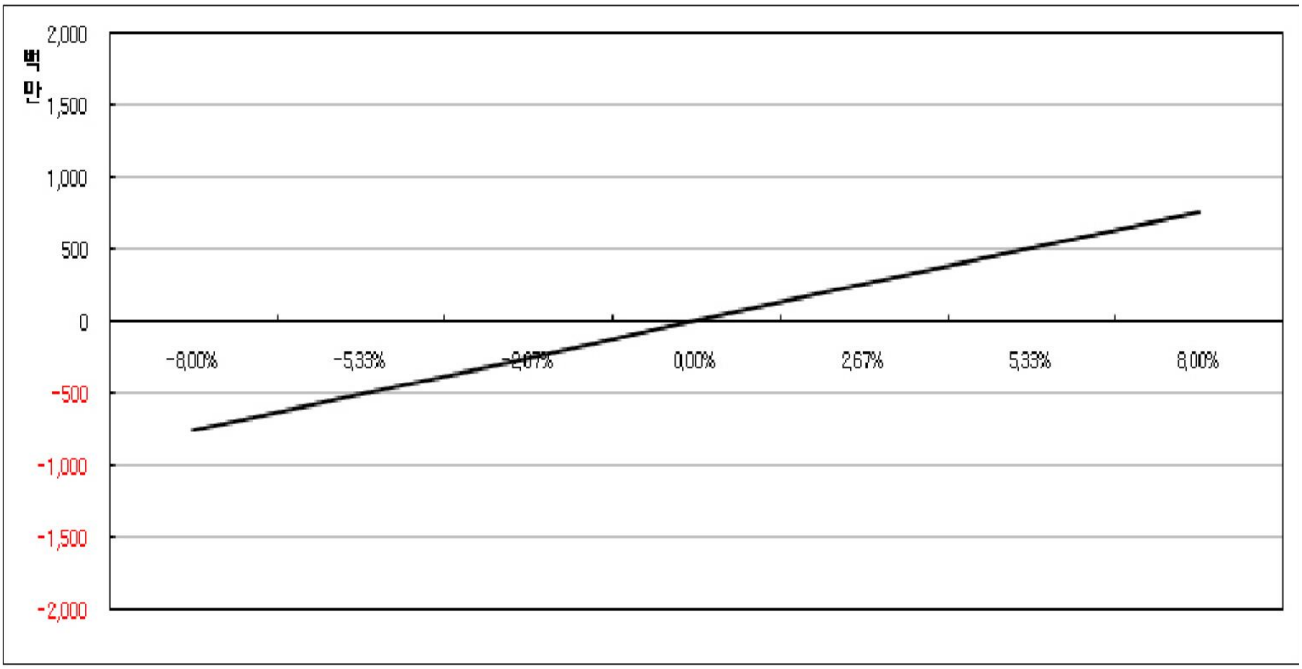
공시일: 2019-08-19

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)

390

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

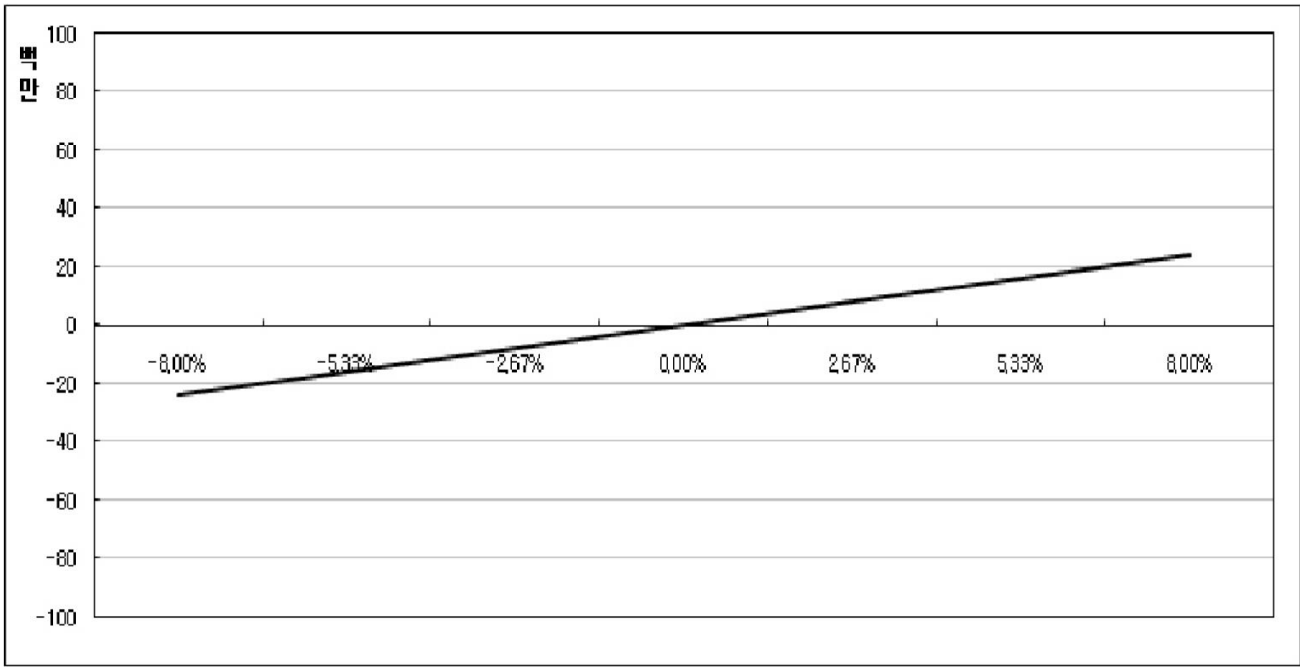
공시일: 2019-08-19

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	952	0	952	장내
합계			952	0	952	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

472

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

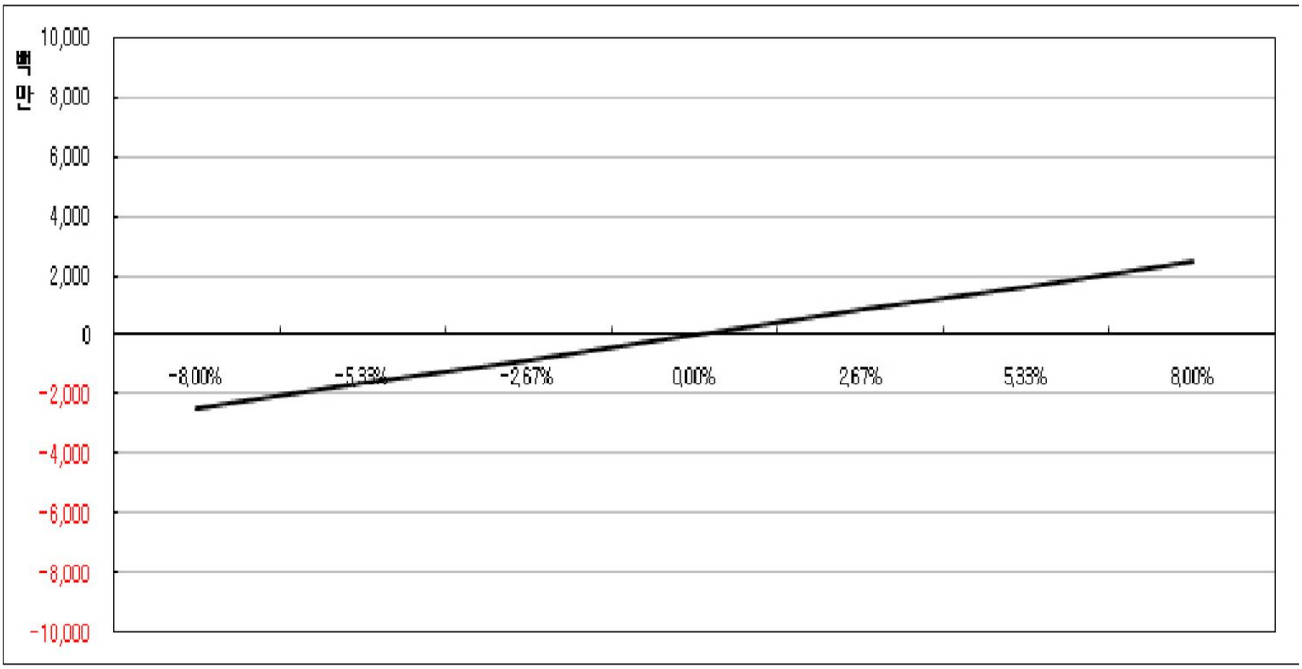
공시일: 2019-08-19

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	4,761	0	4,761	장내
합계			4,761	0	4,761	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

381

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

930

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

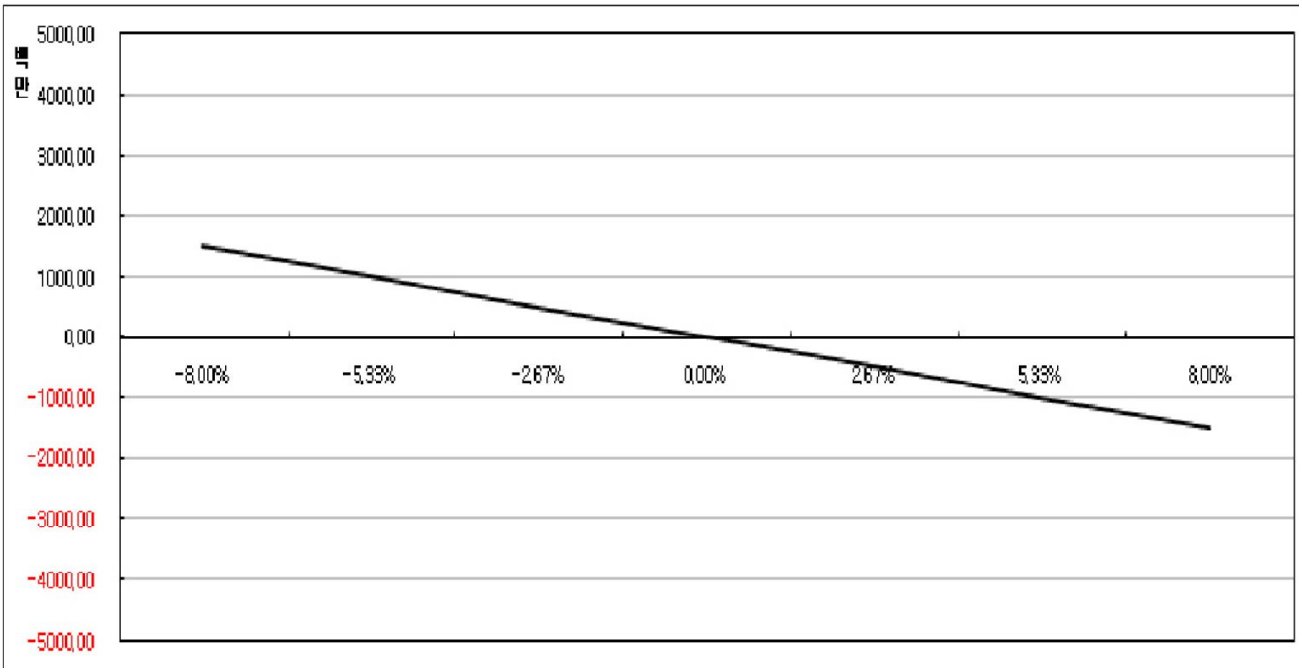
공시일: 2019-08-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	317	0	317	장내
누계	주가지수	선물	0	1,650	-1,650	장내
합계			0	1,650	-1,650	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

132

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

113

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

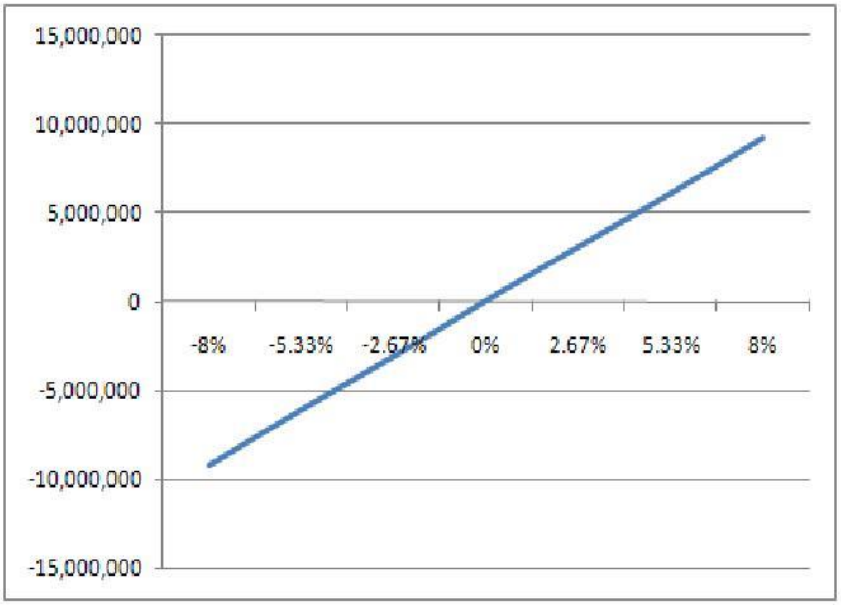
공시일: 2019-08-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	317	0	317	장내
누계	주가지수	선물	66,839	0	66,839	장내
합계			66,839	0	66,839	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,350

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,954