펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-20

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	2,679	0	2,679	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	7	5,357	-5,350	장내
합계			2,686	5,357	-2,671	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

643

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

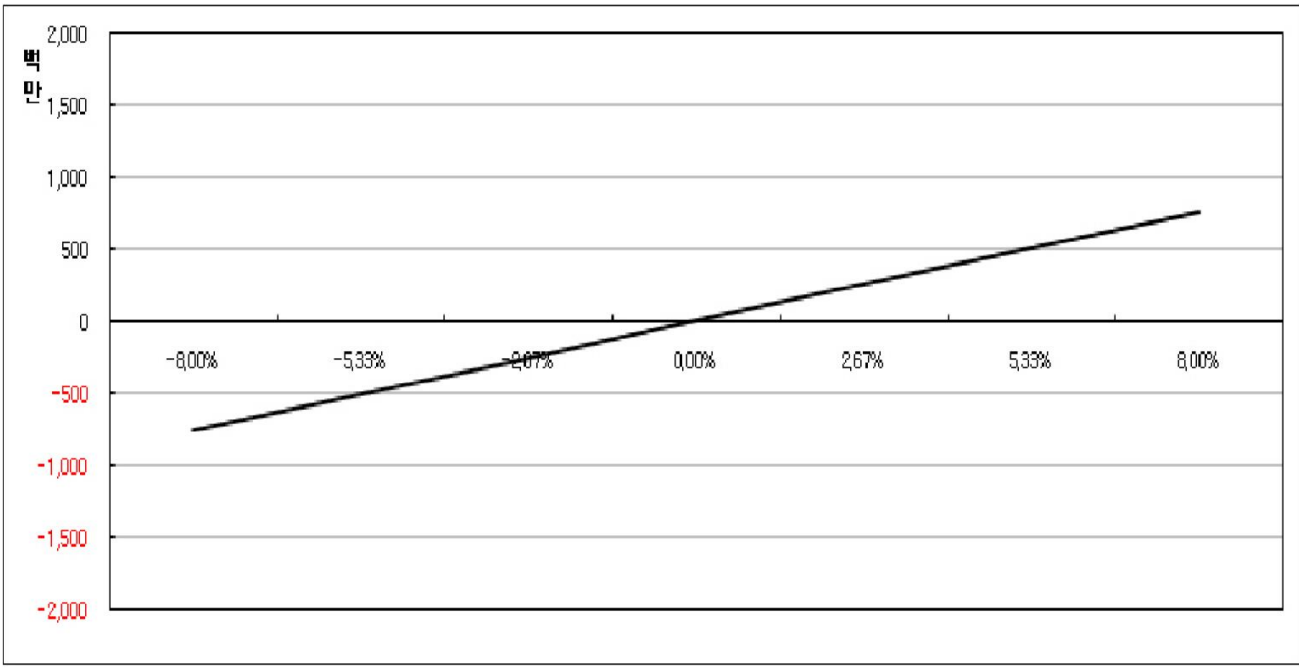
공시일: 2019-08-20

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)

392

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

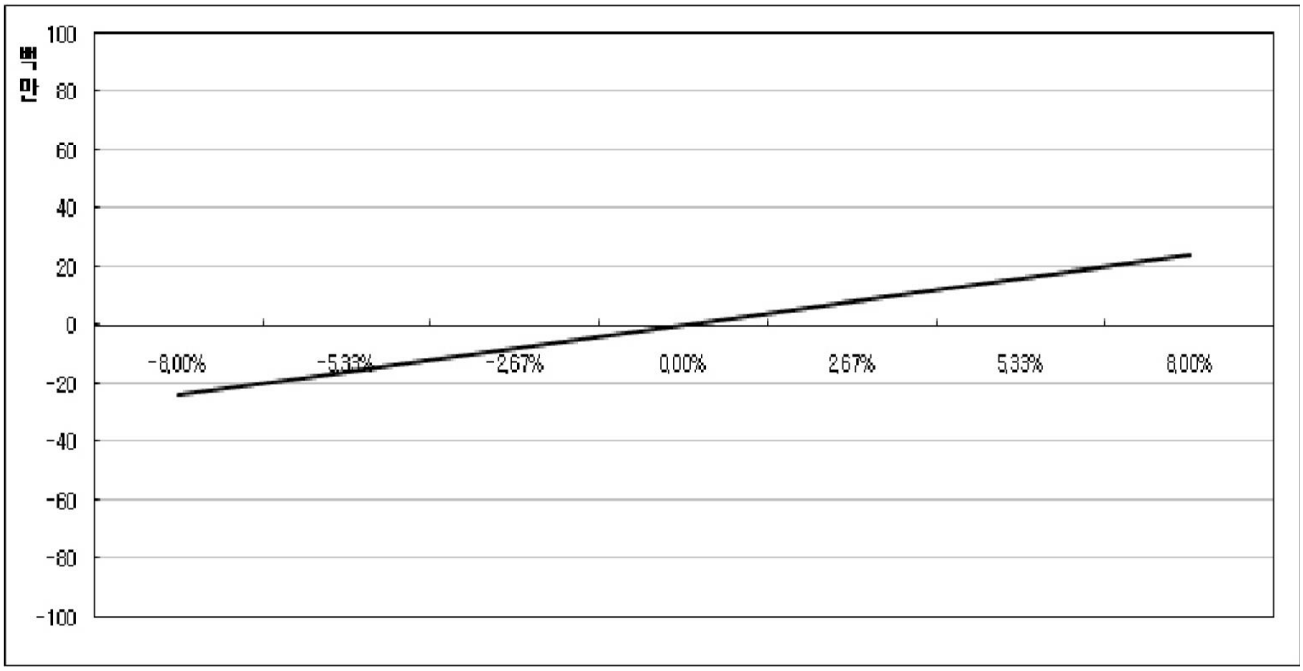
공시일: 2019-08-20

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	957	0	957	장내
합계			957	0	957	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

474

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

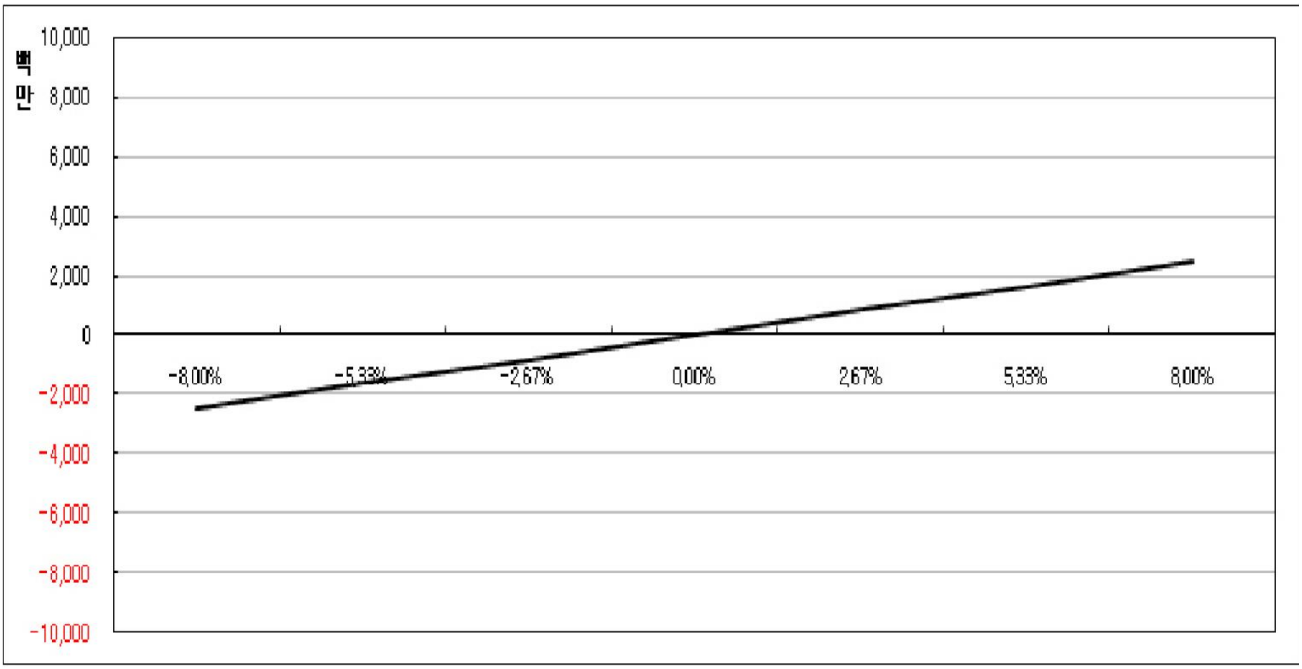
공시일: 2019-08-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	383	0	383	장내
누계	주가지수	선물	5,166	0	5,166	장내
합계			5,166	0	5,166	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

414

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

955

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

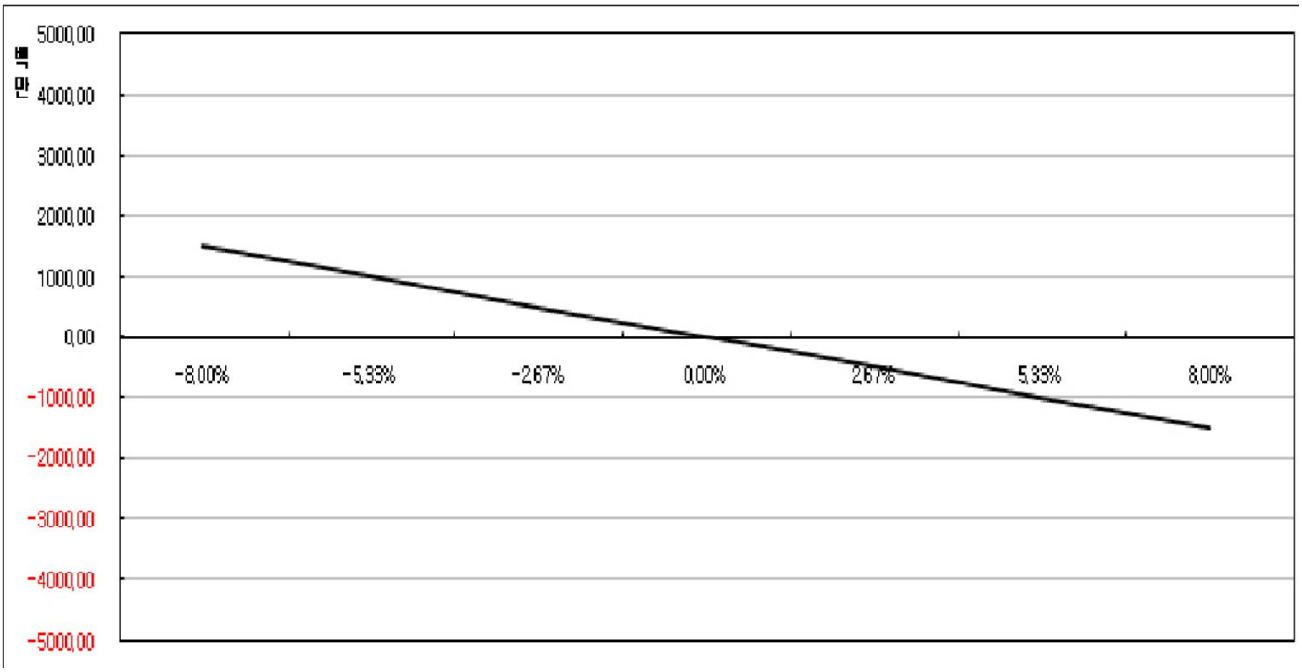
공시일: 2019-08-20

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	0	1,658	-1,658	장내
합계			0	1,658	-1,658	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

114

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

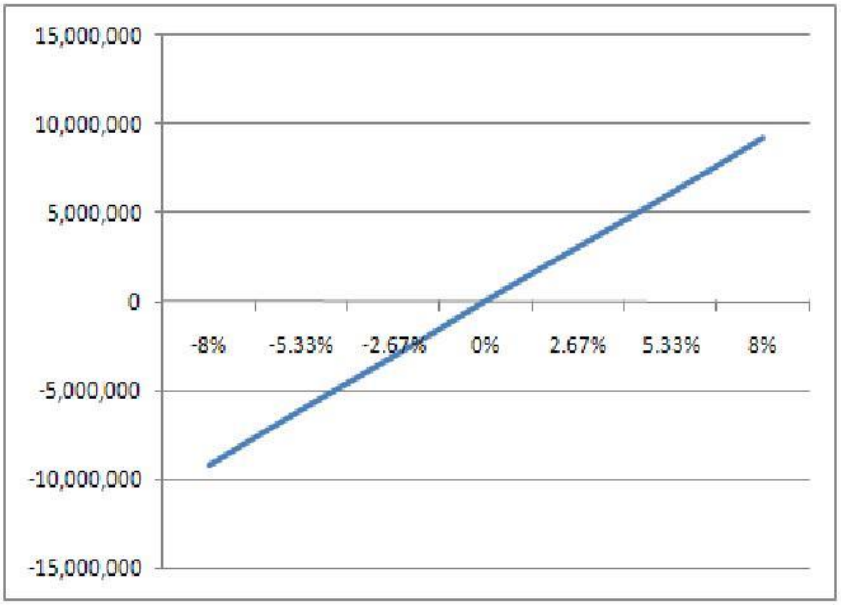
공시일: 2019-08-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	510	0	510	장내
누계	주가지수	선물	67,668	0	67,668	장내
합계			67,668	0	67,668	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,427

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,032