펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	645	0	645	장내
누계	주가지수	선물	3,355	0	3,355	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	5,419	-5,415	장내
합계			3,359	5,419	-2,061	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	126

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	789

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

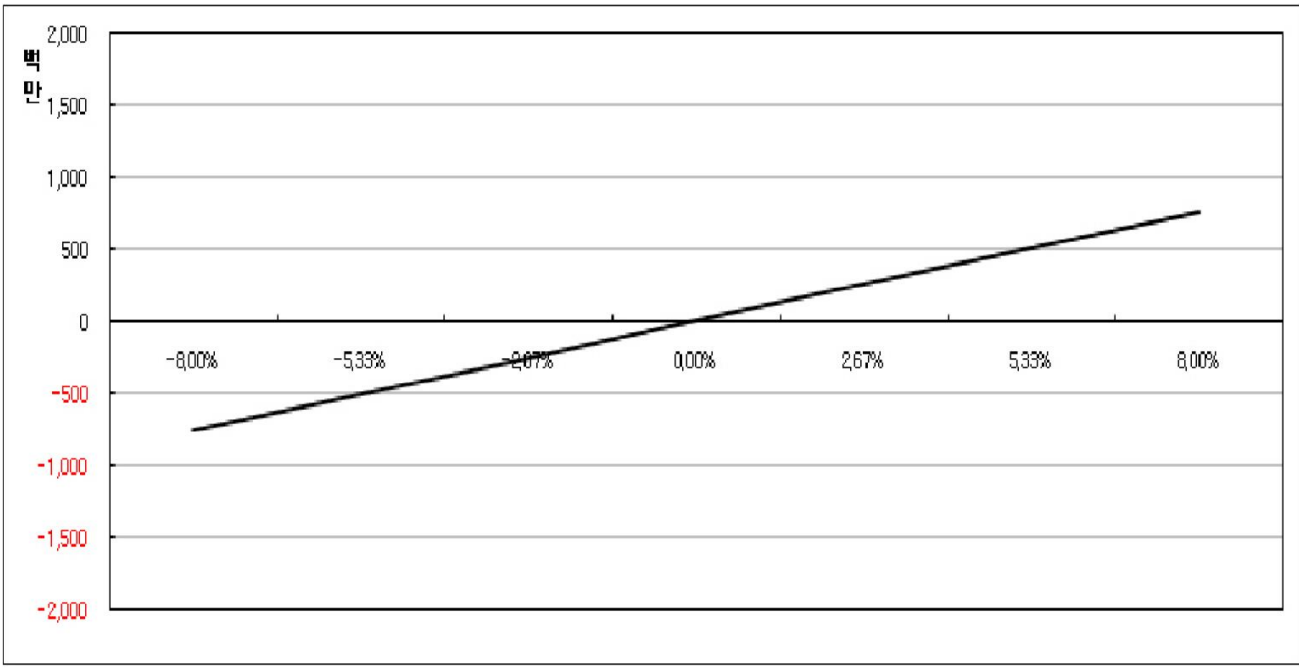
공시일: 2019-08-21

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	129	0	129	장내
합계			129	0	129	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

399

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

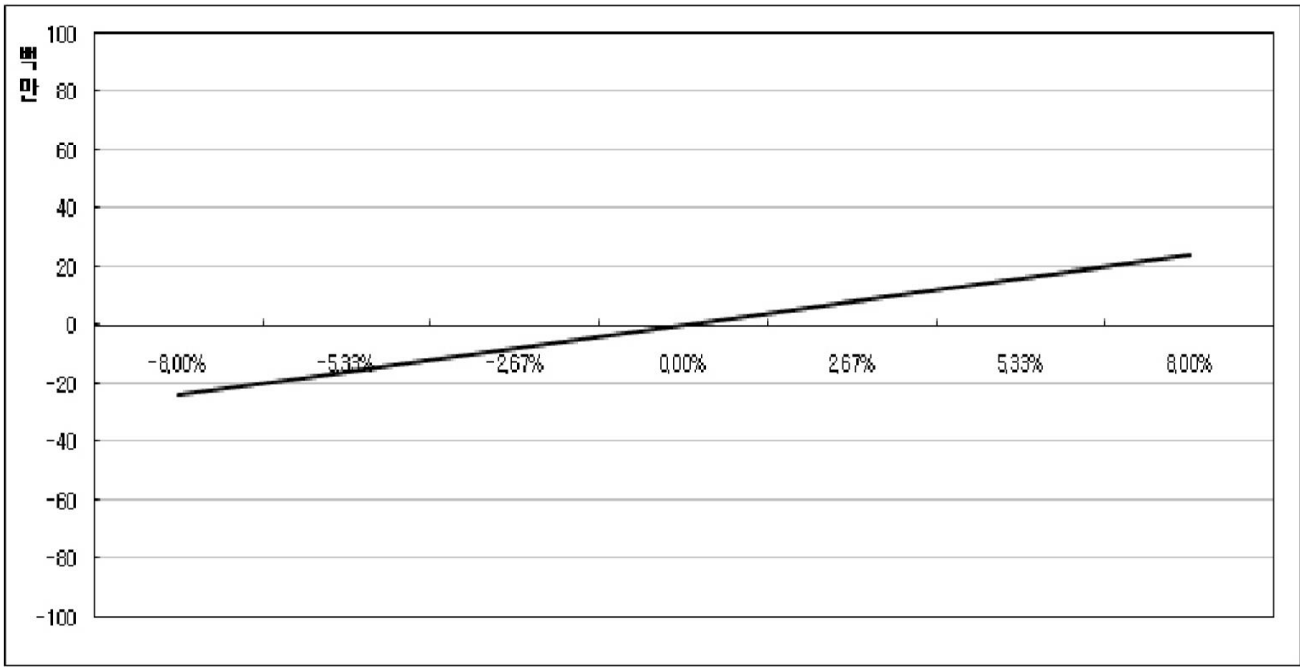
공시일: 2019-08-21

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	968	0	968	장내
합계			968	0	968	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

482

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

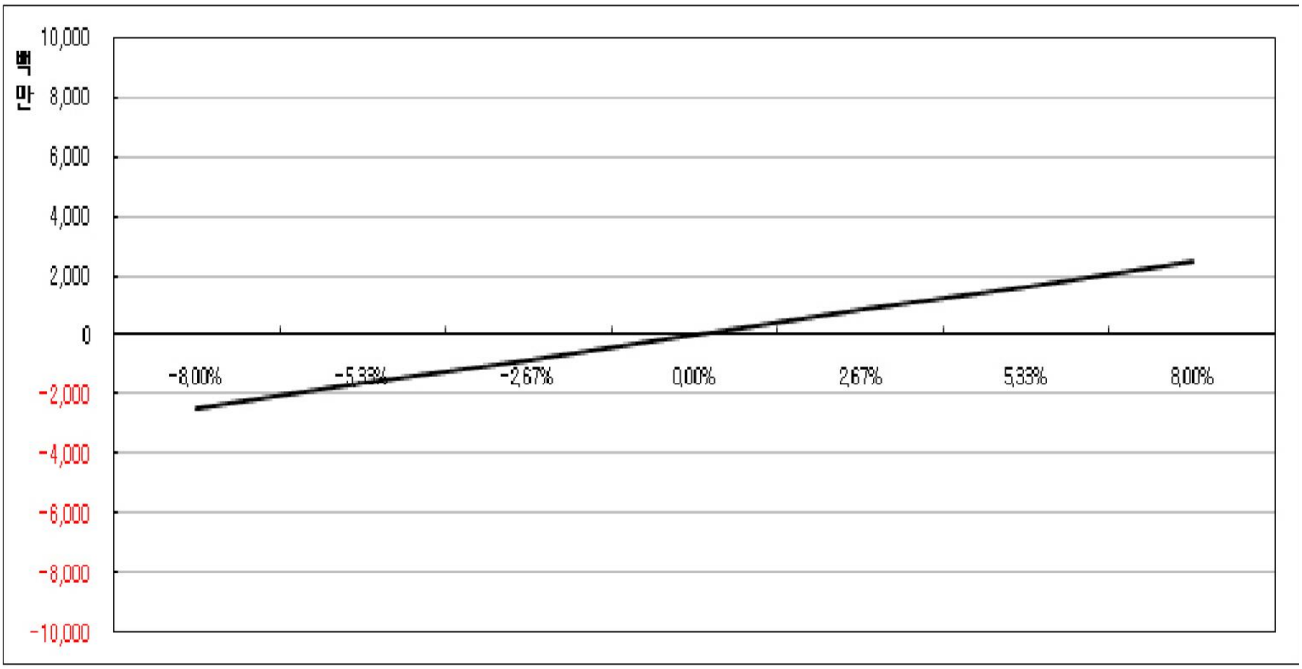
공시일: 2019-08-21

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	5,226	0	5,226	장내
합계			5,226	0	5,226	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

418

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

971

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

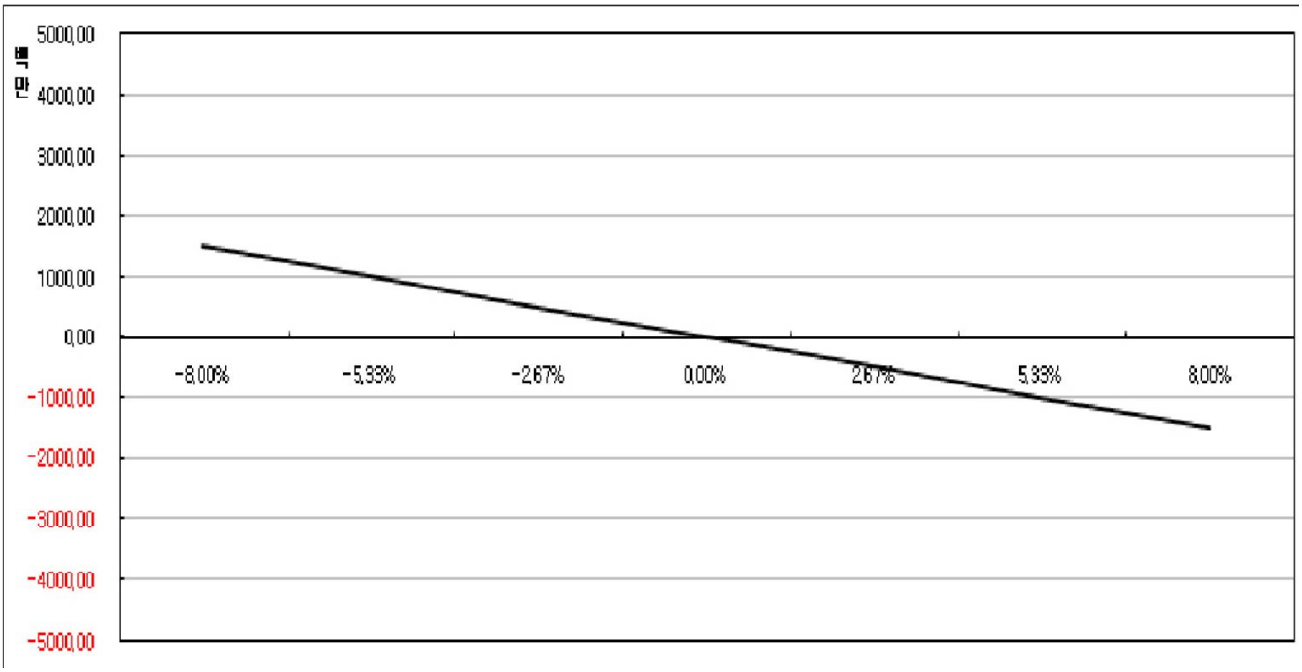
공시일: 2019-08-21

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	1,677	-1,677	장내
합계			0	1,677	-1,677	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

134

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

115

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

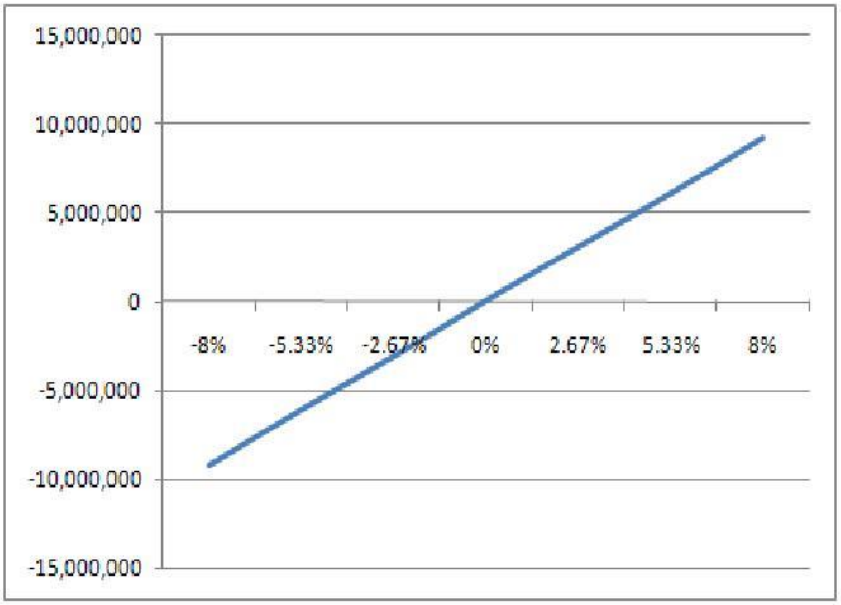
공시일: 2019-08-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	968	0	968	장내
누계	주가지수	선물	69,415	0	69,415	장내
합계			69,415	0	69,415	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,552

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,231