펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	194	0	194	장내
누계	주가지수	선물	3,553	0	3,553	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	5,426	-5,423	장내
합계			3,556	5,426	-1,870	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

138

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

808

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

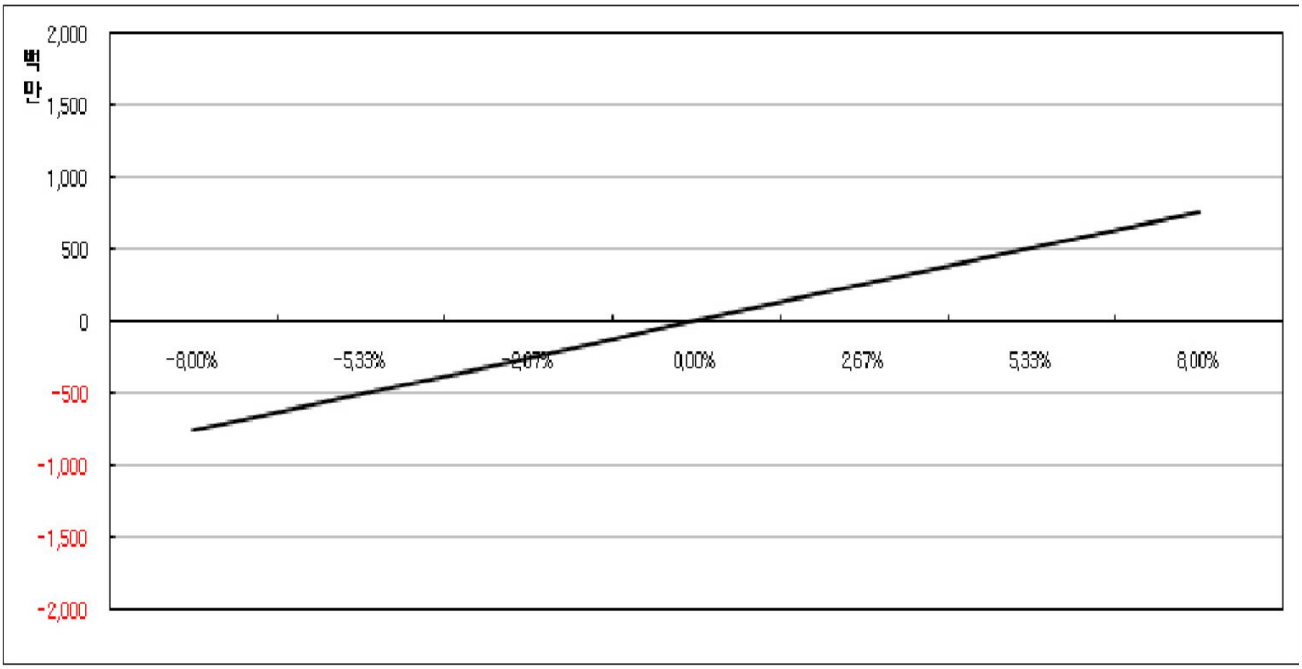
공시일: 2019-08-22

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]

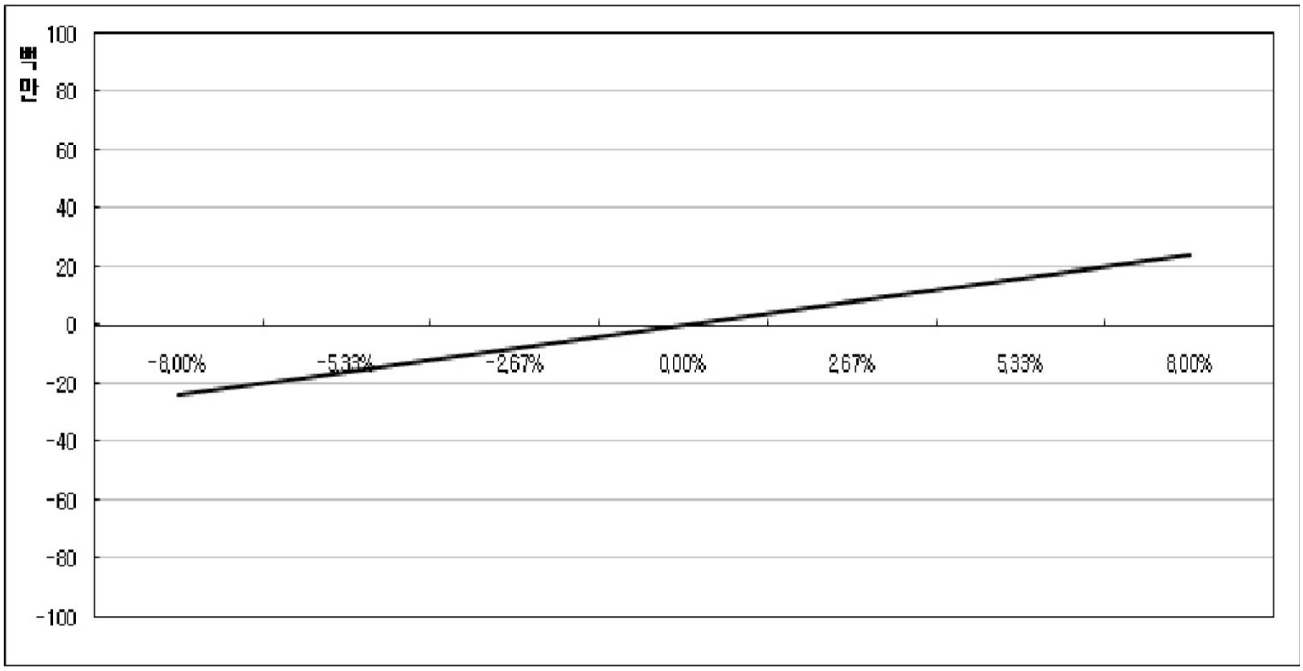
공시일: 2019-08-22

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	969	0	969	장내
합계			969	0	969	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

78

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

483

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

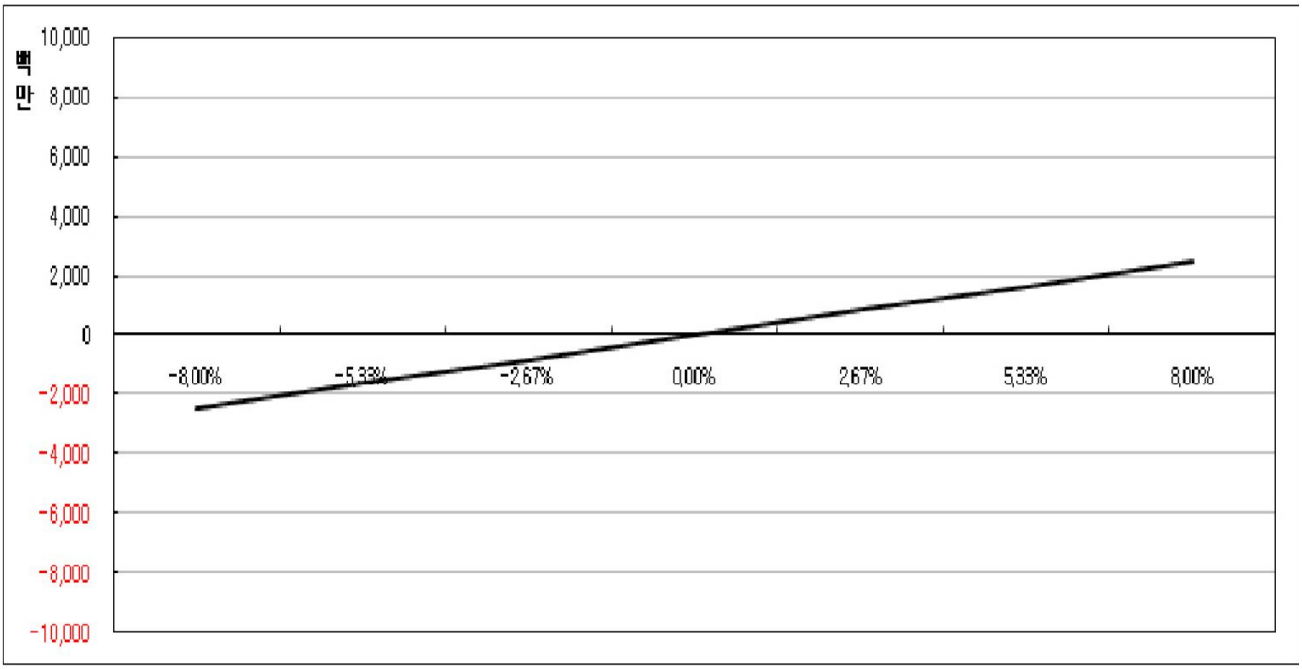
공시일: 2019-08-22

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	5,232	0	5,232	장내
합계			5,232	0	5,232	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

419

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

972

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

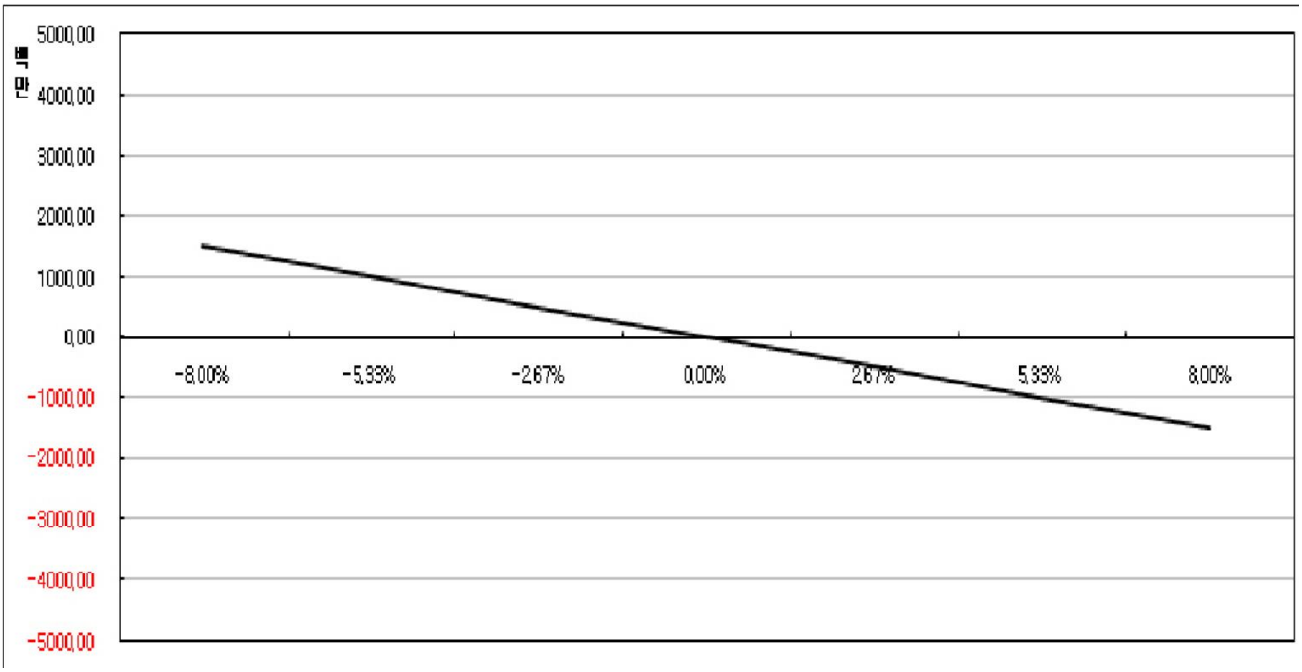
공시일: 2019-08-22

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	1,679	-1,679	장내
합계			0	1,679	-1,679	

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]

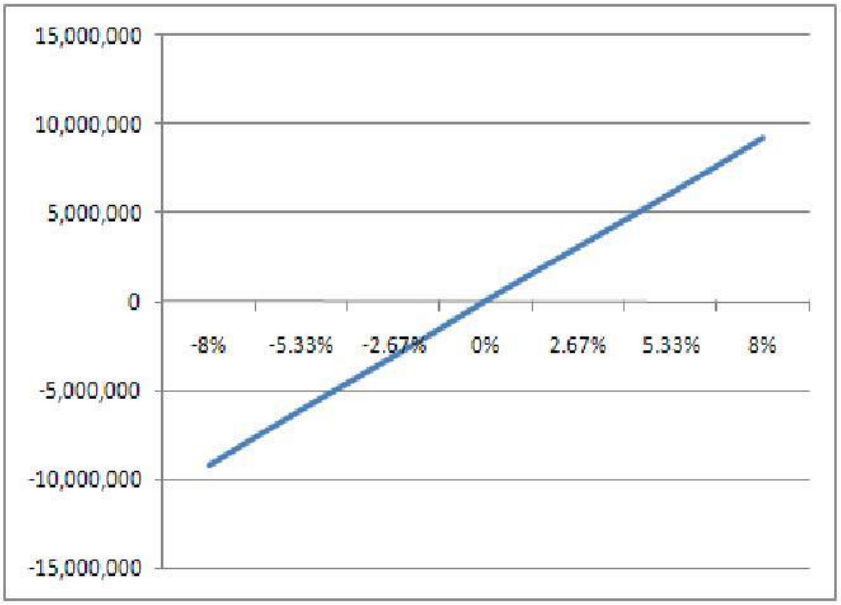
공시일: 2019-08-22

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	69,504	0	69,504	장내
합계			69,504	0	69,504	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,561

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,241