펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-08-27

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	1,702	0	1,702	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	11	3,278	-3,268	장내
합계			1,713	3,278	-1,565	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

151

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

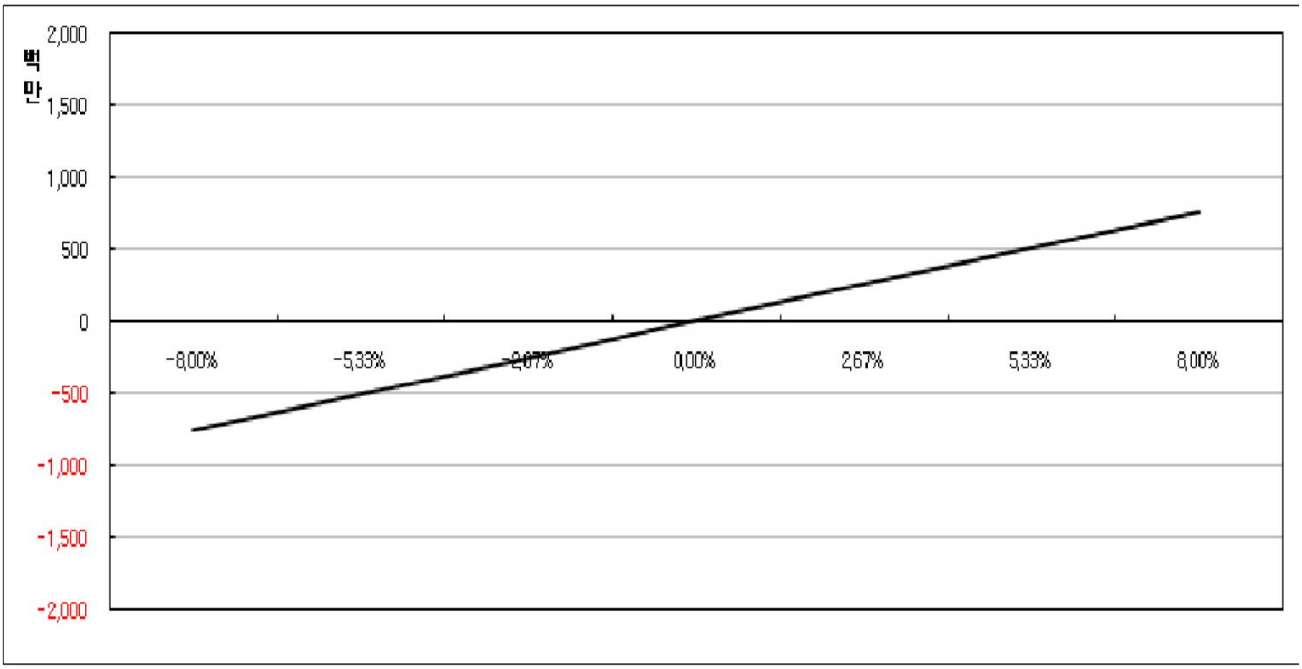
공시일: 2019-08-27

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	126	0	126	장내
합계			126	0	126	

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]

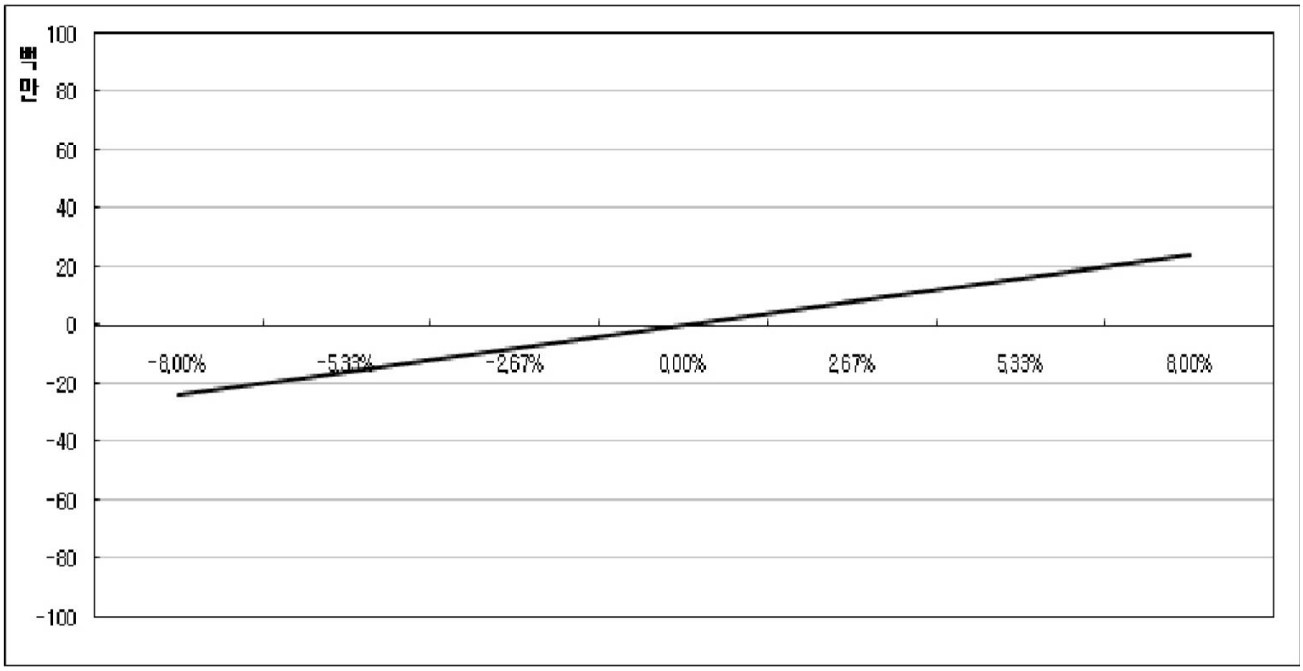
공시일: 2019-08-27

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	946	0	946	장내
합계			946	0	946	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

473

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

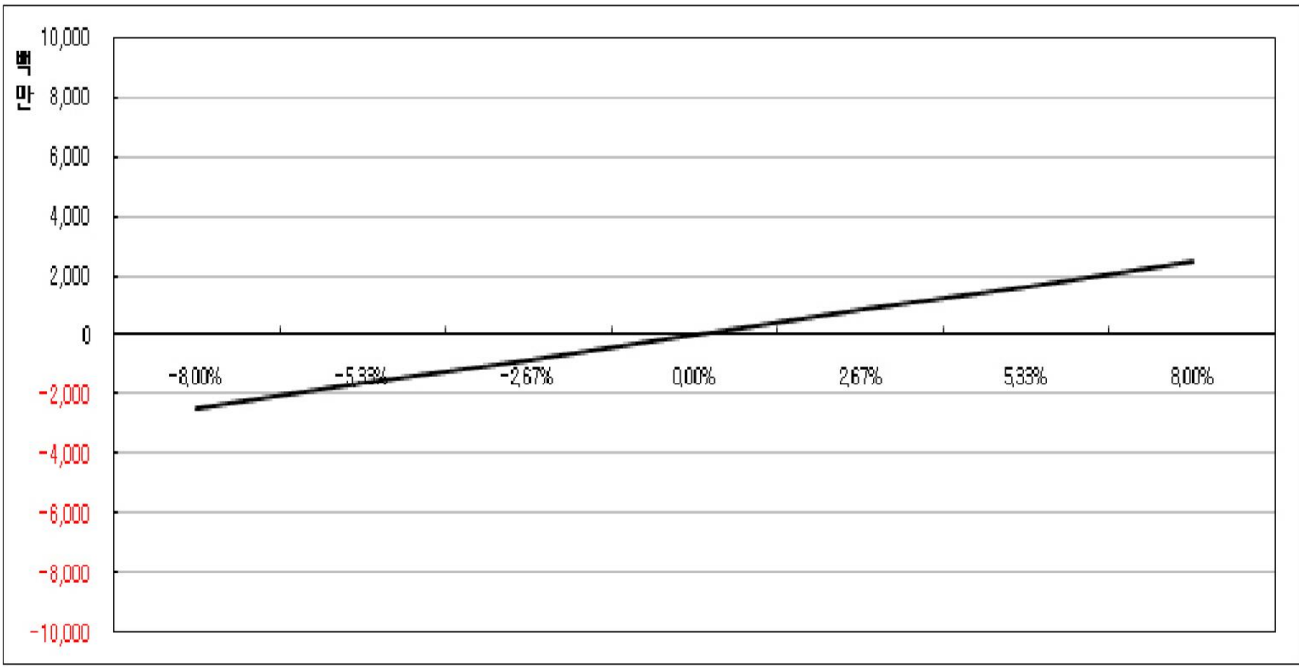
공시일: 2019-08-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	189	315	-126	장내
누계	주가지수	선물	4,792	0	4,792	장내
합계			4,792	0	4,792	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

384

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

938

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

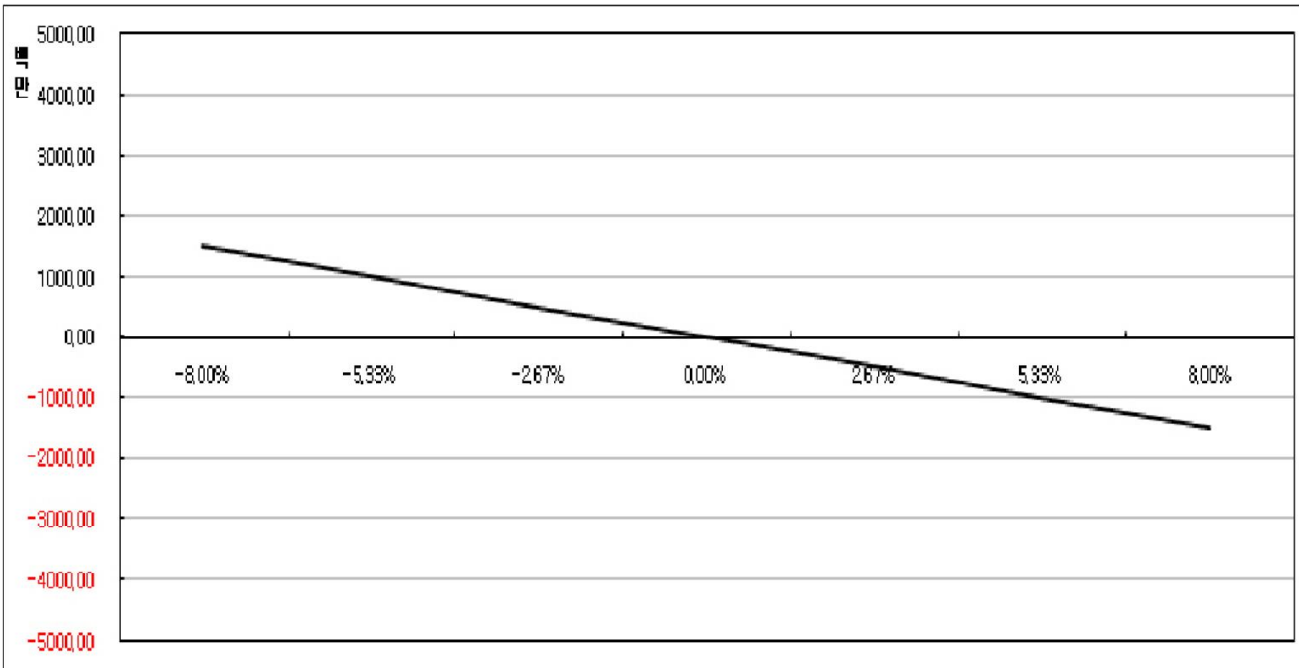
공시일: 2019-08-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	126	-126	장내
누계	주가지수	선물	0	1,765	-1,765	장내
합계			0	1,765	-1,765	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

141

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

122

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

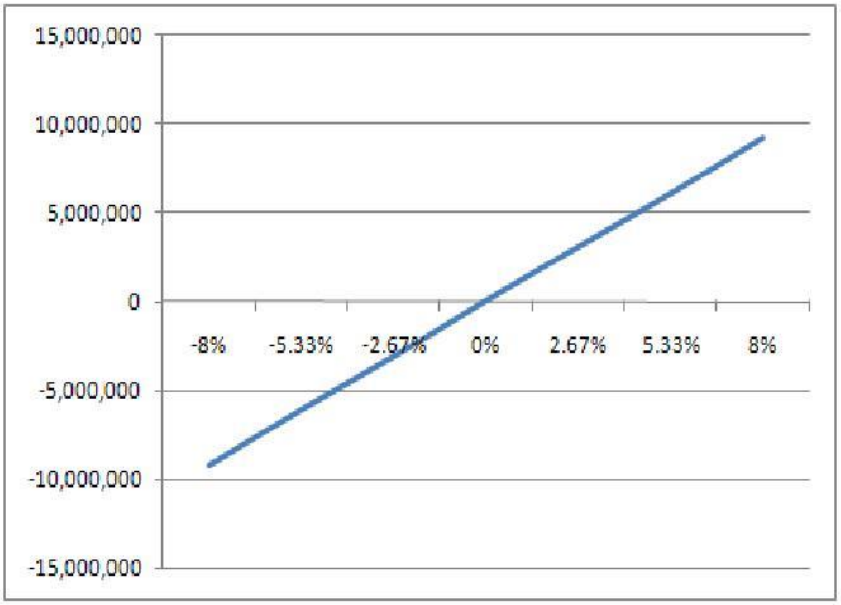
공시일: 2019-08-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	630	-630	장내
누계	주가지수	선물	66,893	0	66,893	장내
합계			66,893	0	66,893	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,360

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,034