펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-02

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	3,119	0	3,119	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	6,239	-6,238	장내
합계			3,120	6,239	-3,118	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

225

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

458

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

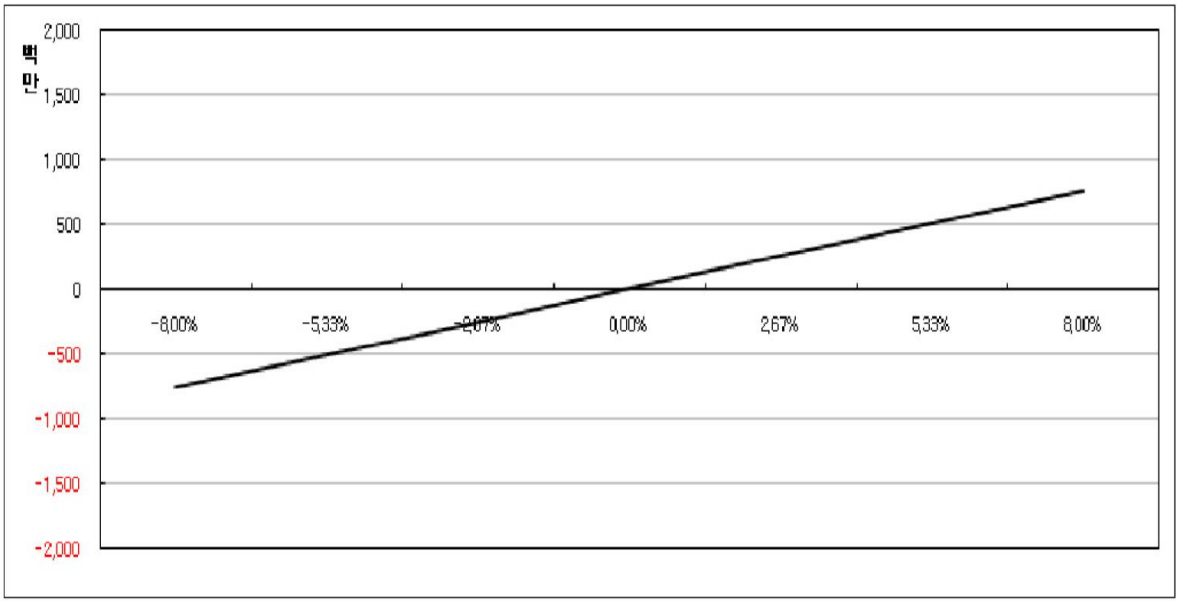
공시일: 2019-07-02

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	139	0	139	장내
합계			139	0	139	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

396

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

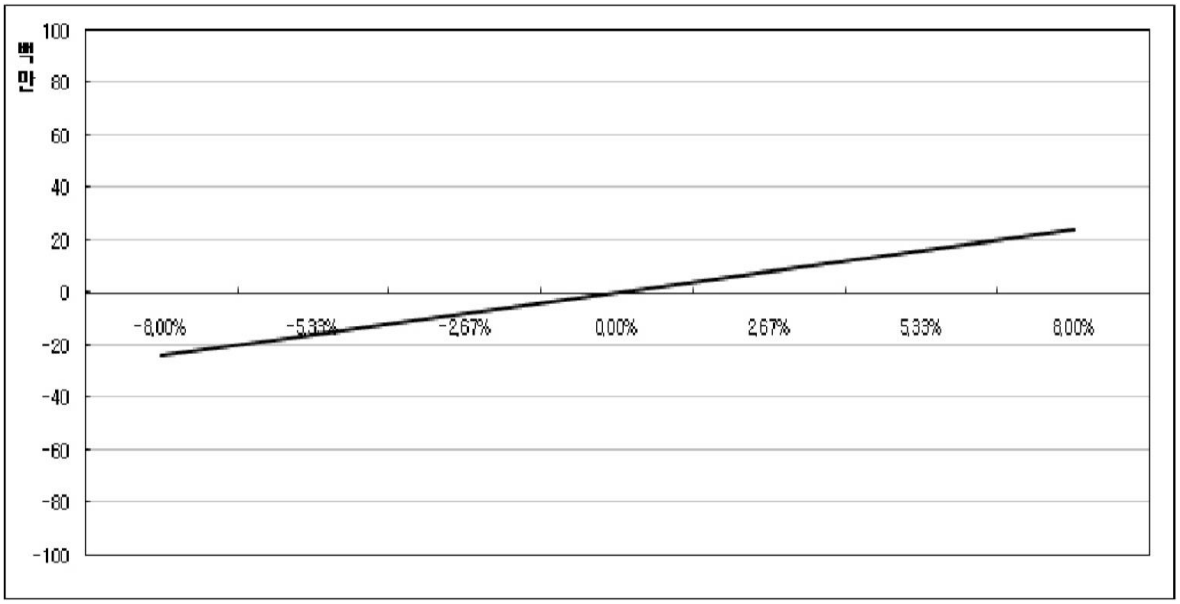
공시일: 2019-07-02

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	901	0	901	장내
합계			901	0	901	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

474

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

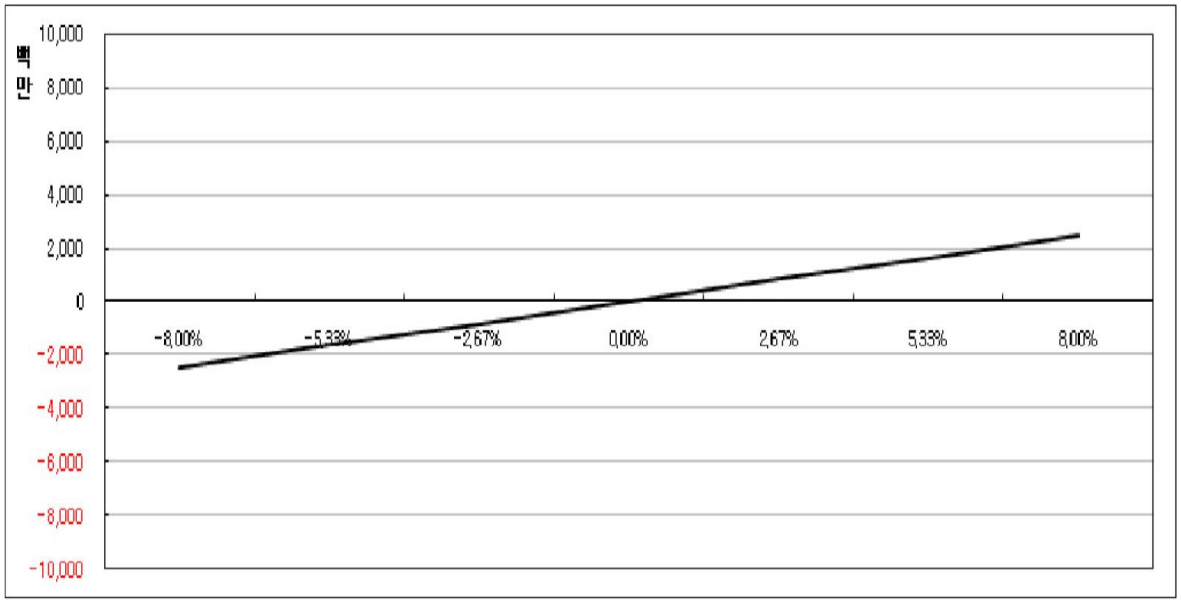
공시일: 2019-07-02

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	4,991	0	4,991	장내
합계			4,991	0	4,991	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

400

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

936

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

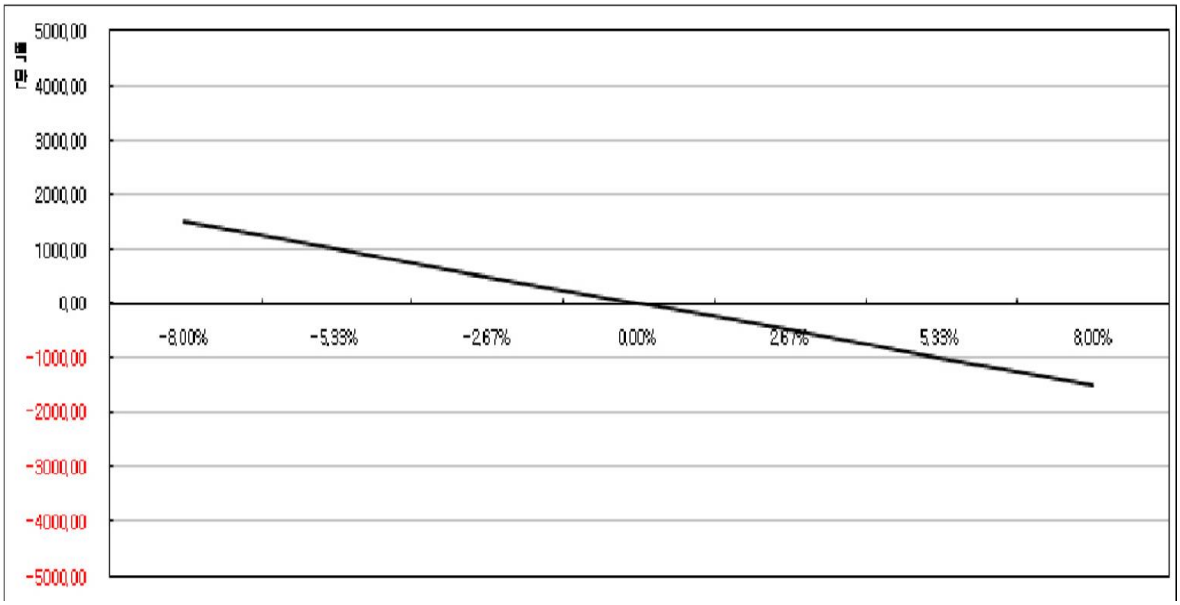
공시일: 2019-07-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	139	0	139	장내
누계	주가지수	선물	0	1,872	-1,872	장내
합계			0	1,872	-1,872	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

150

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

124

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

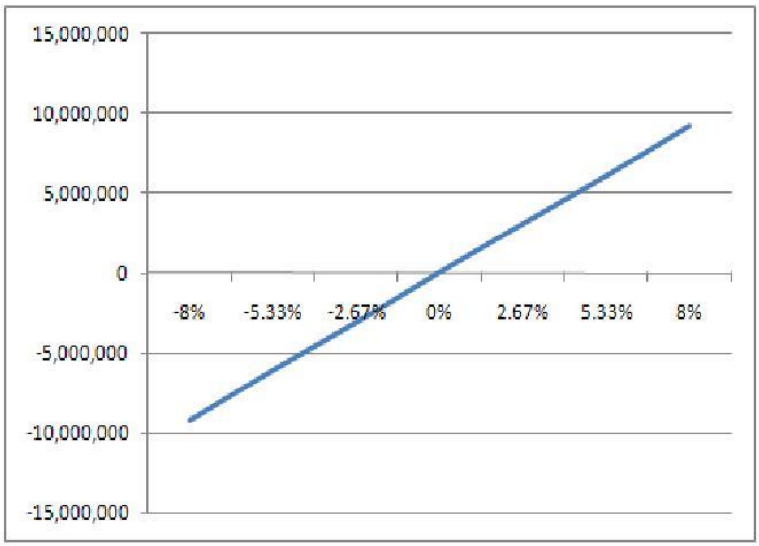
공시일: 2019-07-02

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	72,783	0	72,783	장내
합계			72,783	0	72,783	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,840

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,158