펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-03

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	3,105	0	3,105	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	6,209	-6,209	장내
합계			3,105	6,209	-3,104	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	218

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	339

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

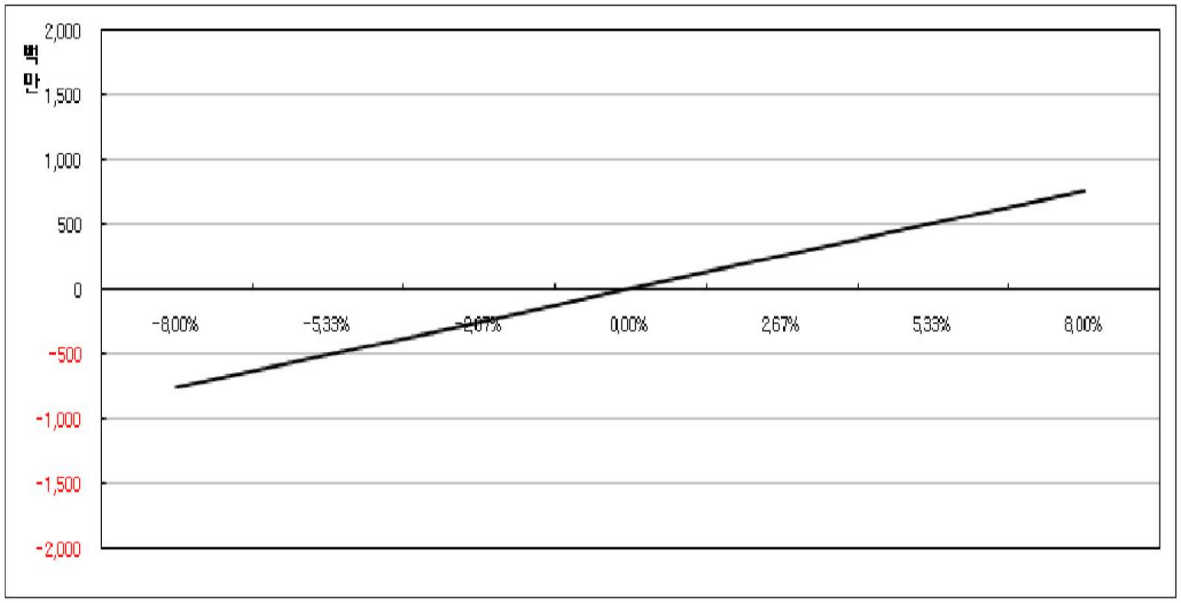
공시일: 2019-07-03

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	138	0	138	장내
합계			138	0	138	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

394

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

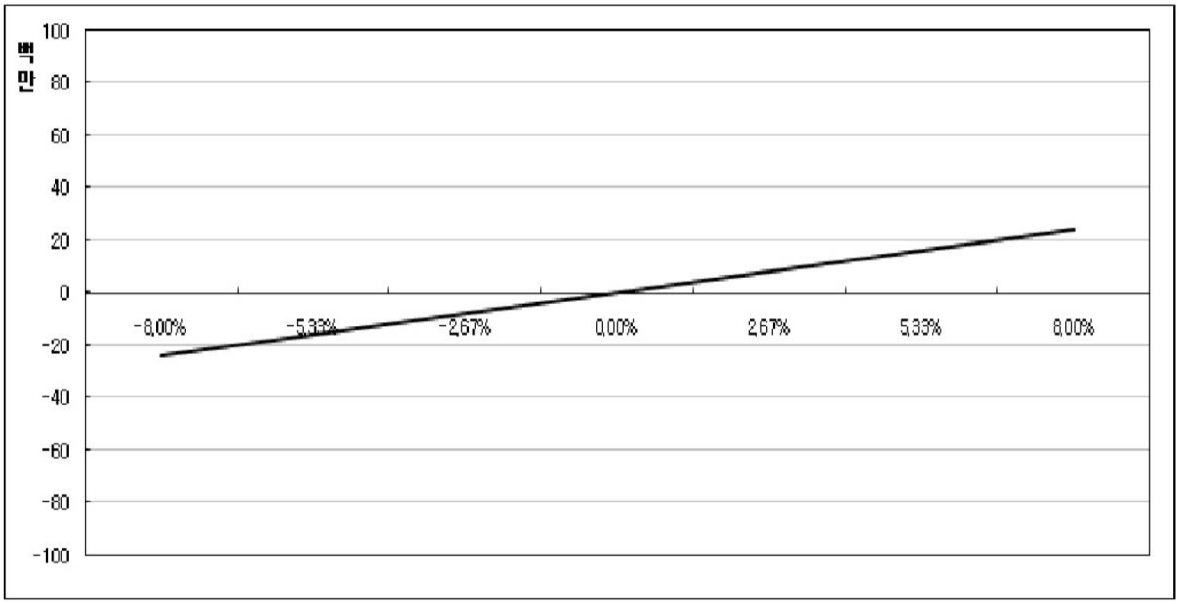
공시일: 2019-07-03

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	897	0	897	장내
합계			897	0	897	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 472

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

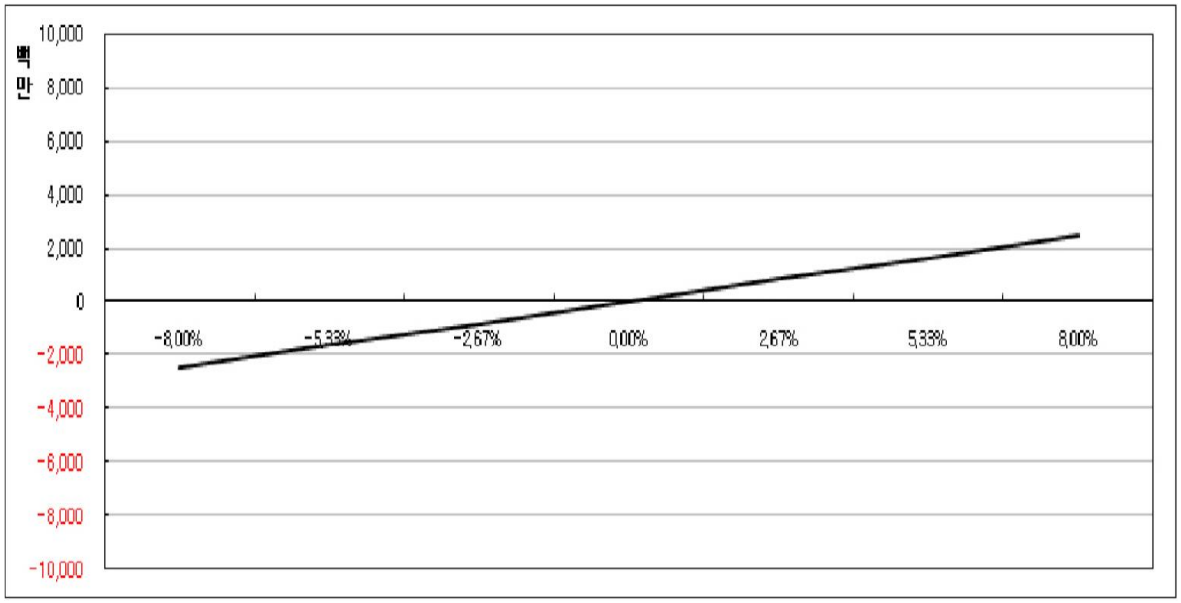
공시일: 2019-07-03

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	4,967	0	4,967	장내
합계			4,967	0	4,967	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

399

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

932

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

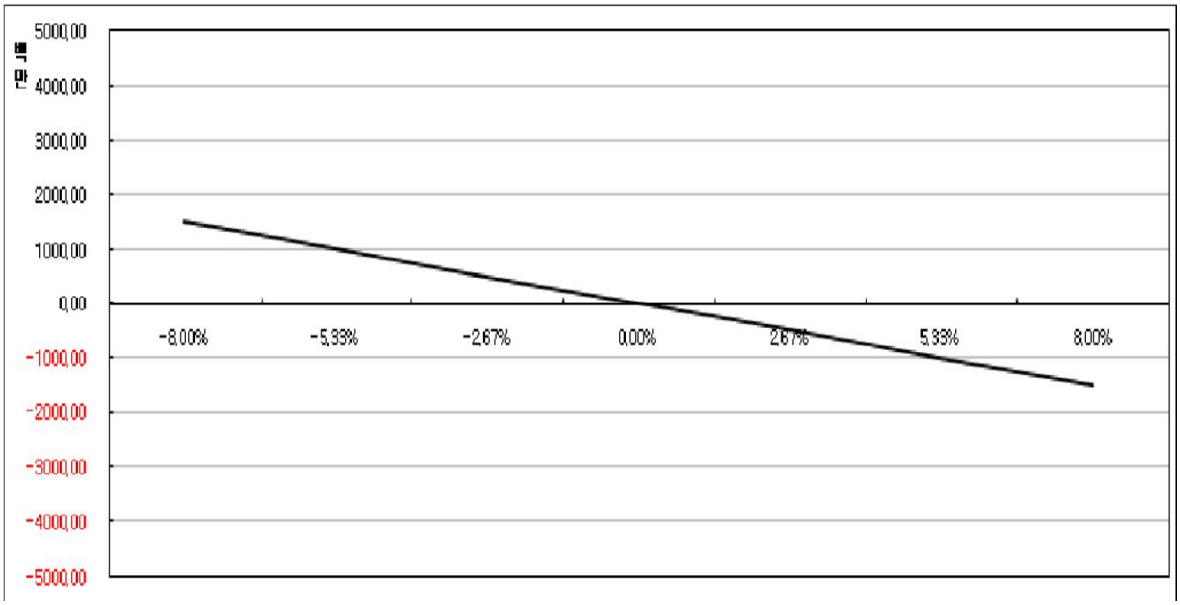
공시일: 2019-07-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	207	-207	장내
누계	주가지수	선물	0	2,070	-2,070	장내
합계			0	2,070	-2,070	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

166

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

137

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

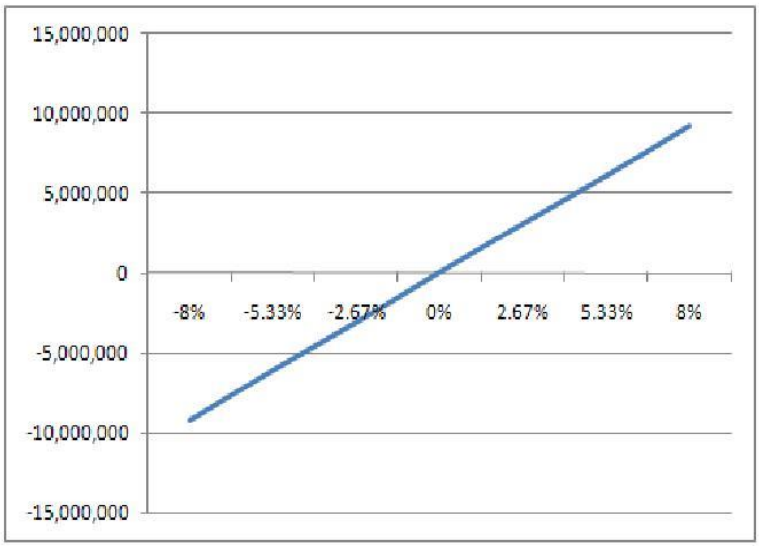
공시일: 2019-07-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	345	-345	장내
누계	주가지수	선물	72,097	0	72,097	장내
합계			72,097	0	72,097	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,789

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,103