펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-04

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	3,064	0	3,064	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	6,128	-6,127	장내
합계			3,066	6,128	-3,062	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	187

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	223

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

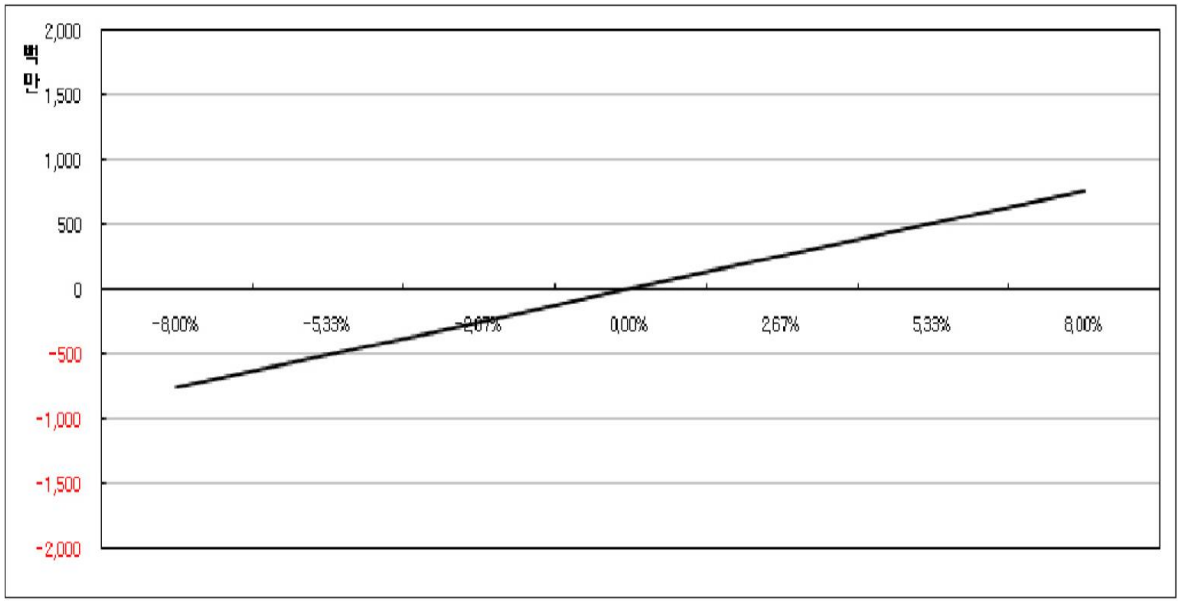
공시일: 2019-07-04

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	136	0	136	장내
합계			136	0	136	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	391

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

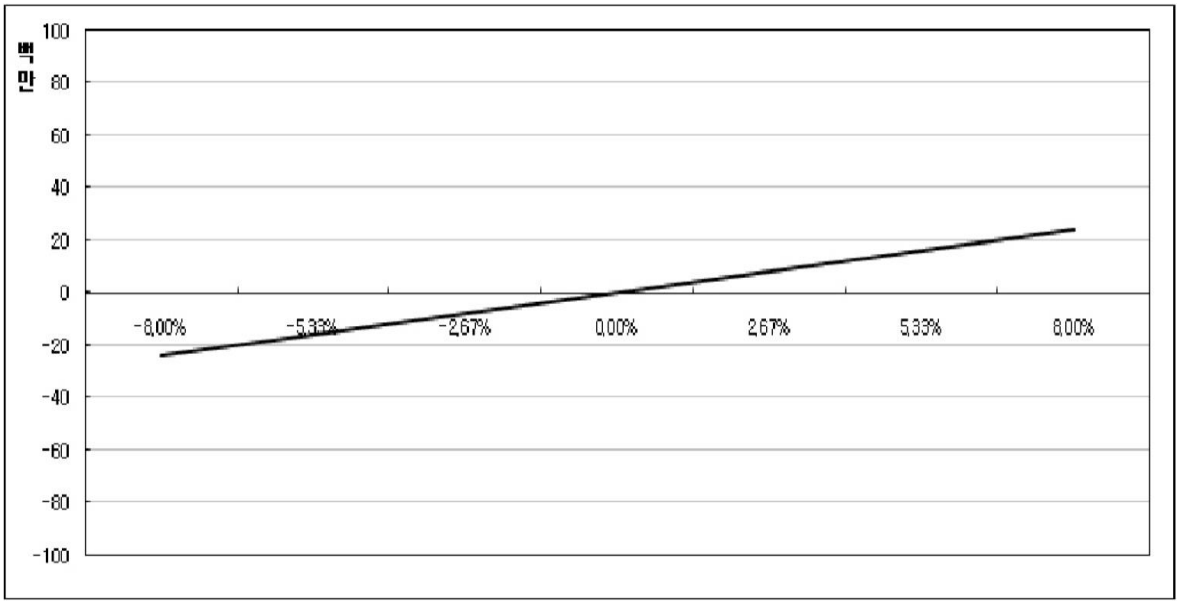
공시일: 2019-07-04

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	885	0	885	장내
합계			885	0	885	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

71

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

468

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

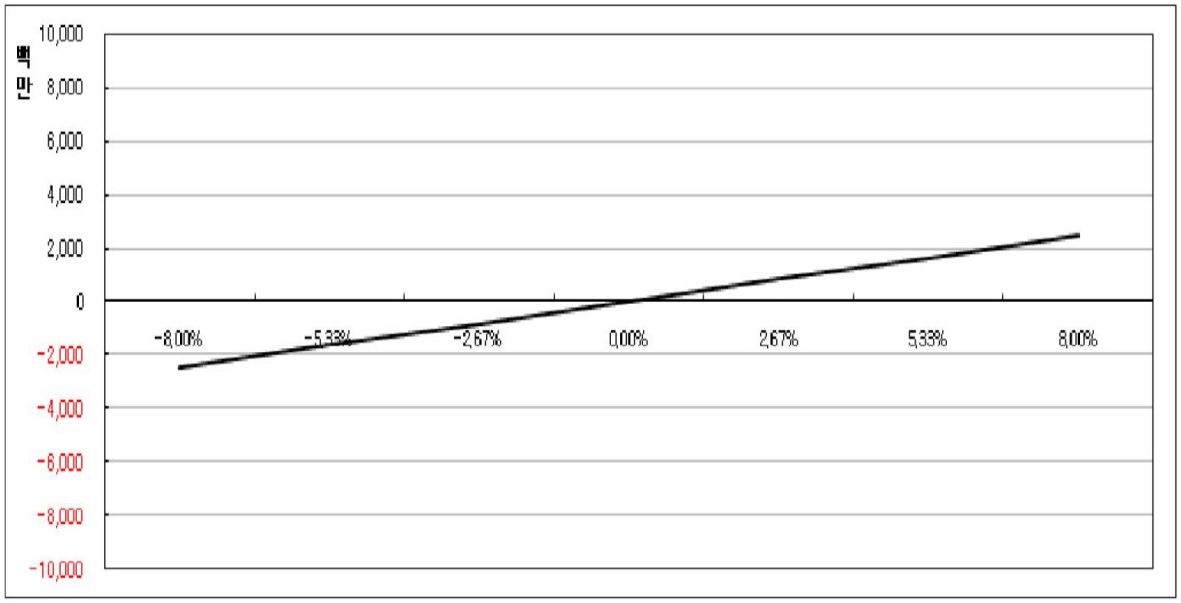
공시일: 2019-07-04

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	4,903	0	4,903	장내
합계			4,903	0	4,903	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

393

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

923

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

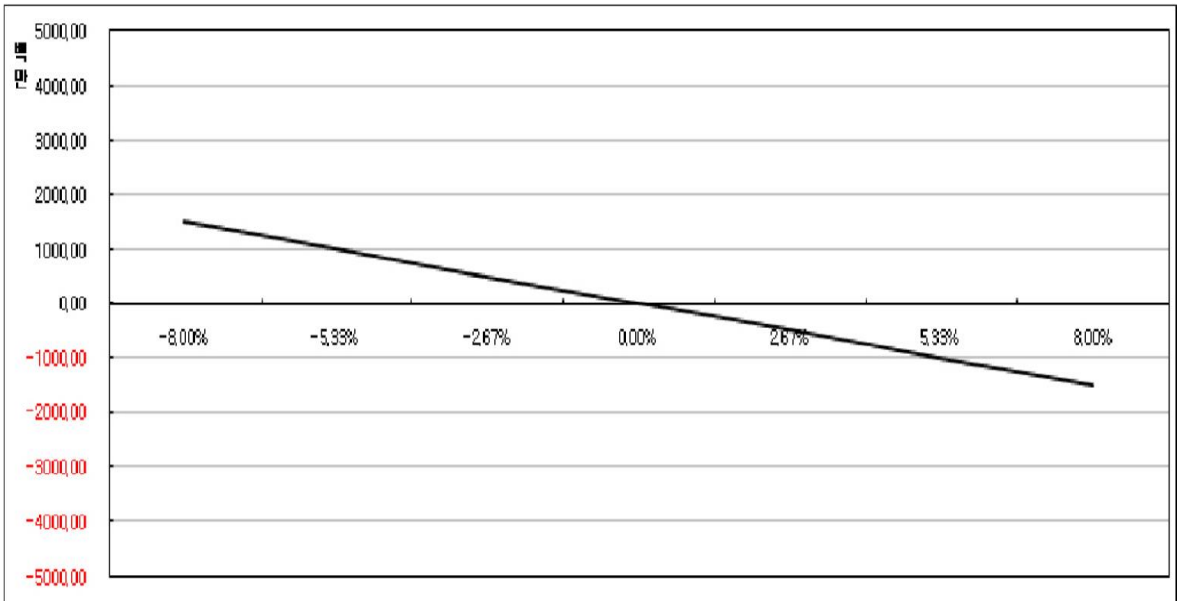
공시일: 2019-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	136	-136	장내
누계	주가지수	선물	0	2,179	-2,179	장내
합계			0	2,179	-2,179	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

175

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

145

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

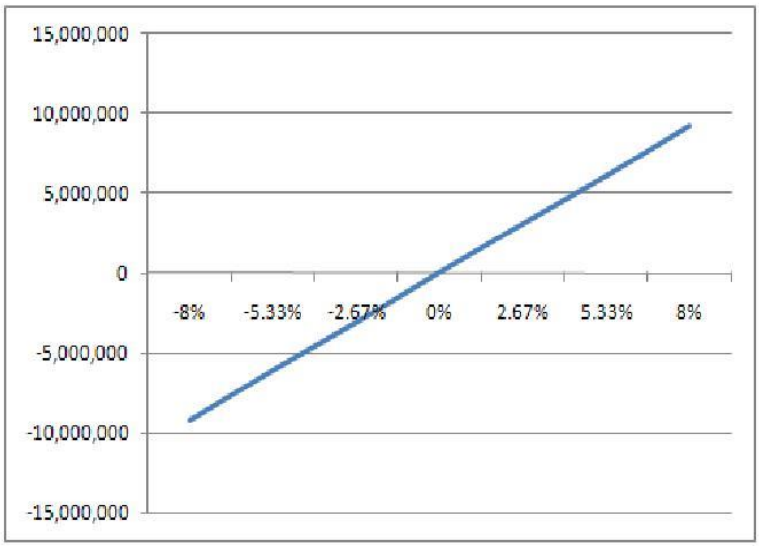
공시일: 2019-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,021	-1,021	장내
누계	주가지수	선물	70,135	0	70,135	장내
합계			70,135	0	70,135	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,624

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,951