펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-05

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	3,089	0	3,089	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	6,177	-6,177	장내
합계			3,089	6,177	-3,088	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	211

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	231

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

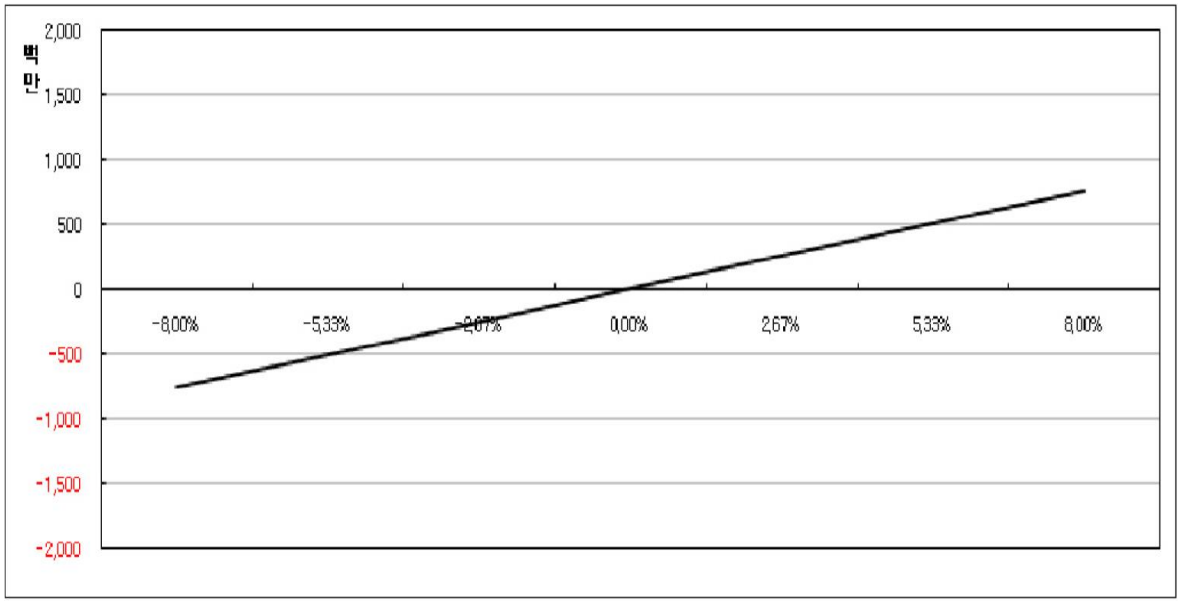
공시일: 2019-07-05

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	137	0	137	장내
합계			137	0	137	

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]

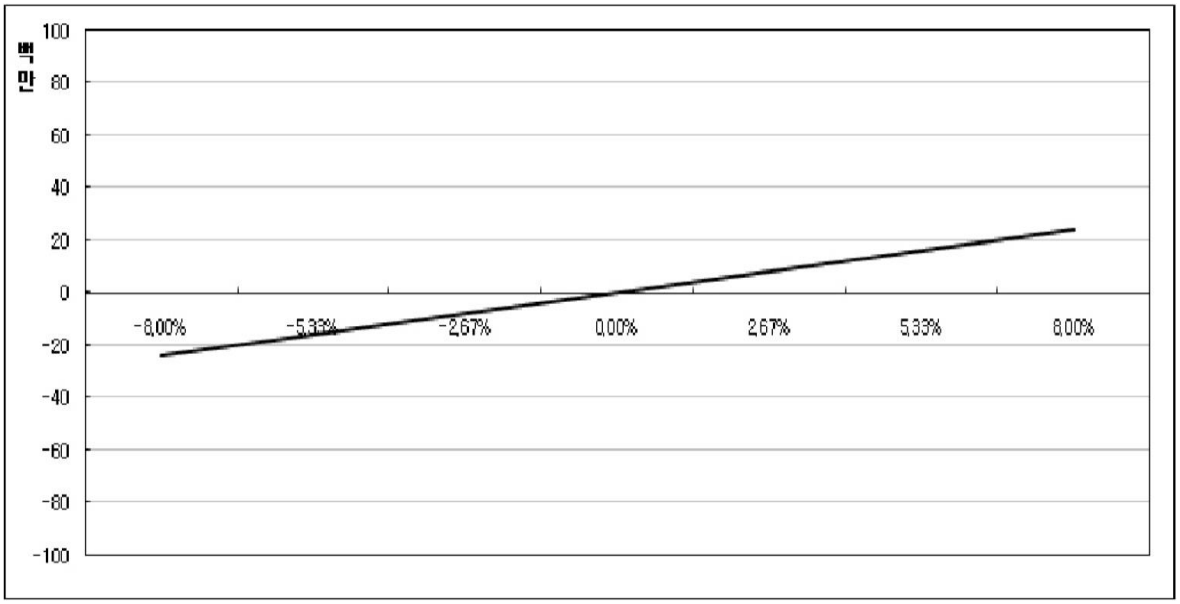
공시일: 2019-07-05

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	892	0	892	장내
합계			892	0	892	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

471

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

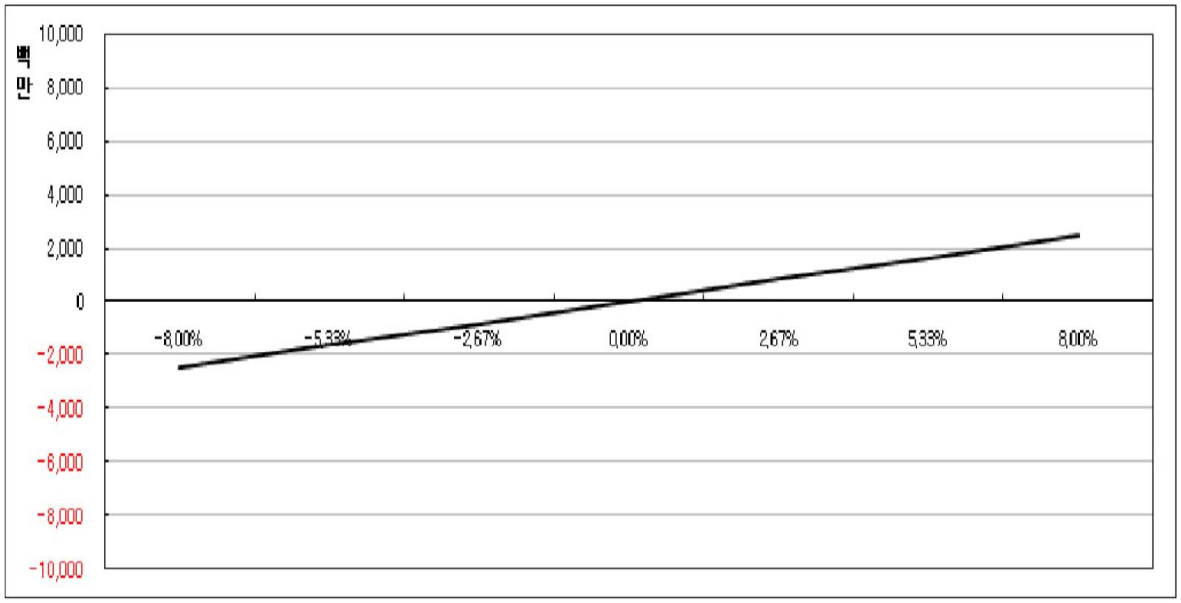
공시일: 2019-07-05

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	4,942	0	4,942	장내
합계			4,942	0	4,942	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

397

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

931

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

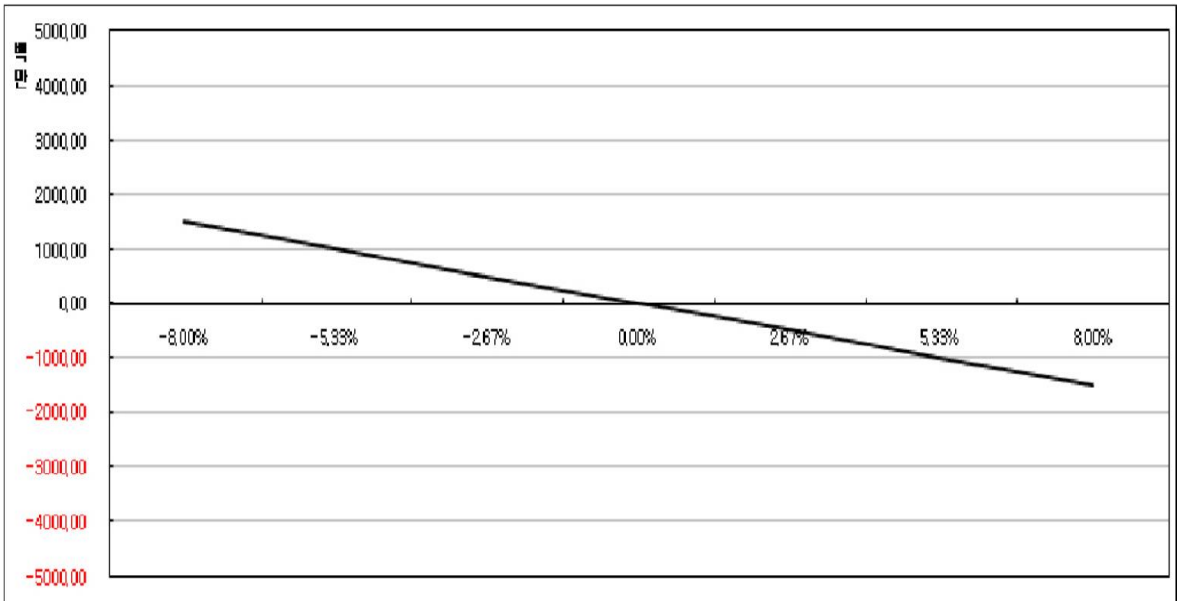
공시일: 2019-07-05

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	2,196	-2,196	장내
합계			0	2,196	-2,196	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	176

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	147

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

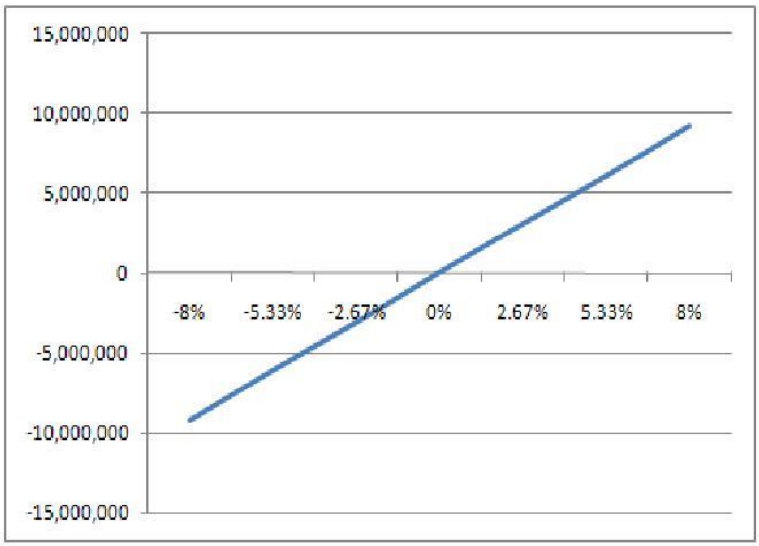
공시일: 2019-07-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	549	0	549	장내
누계	주가지수	선물	71,243	0	71,243	장내
합계			71,243	0	71,243	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,720

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,060