펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-09

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	3,021	0	3,021	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	6,042	-6,039	장내
합계			3,025	6,042	-3,018	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	123

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	297

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

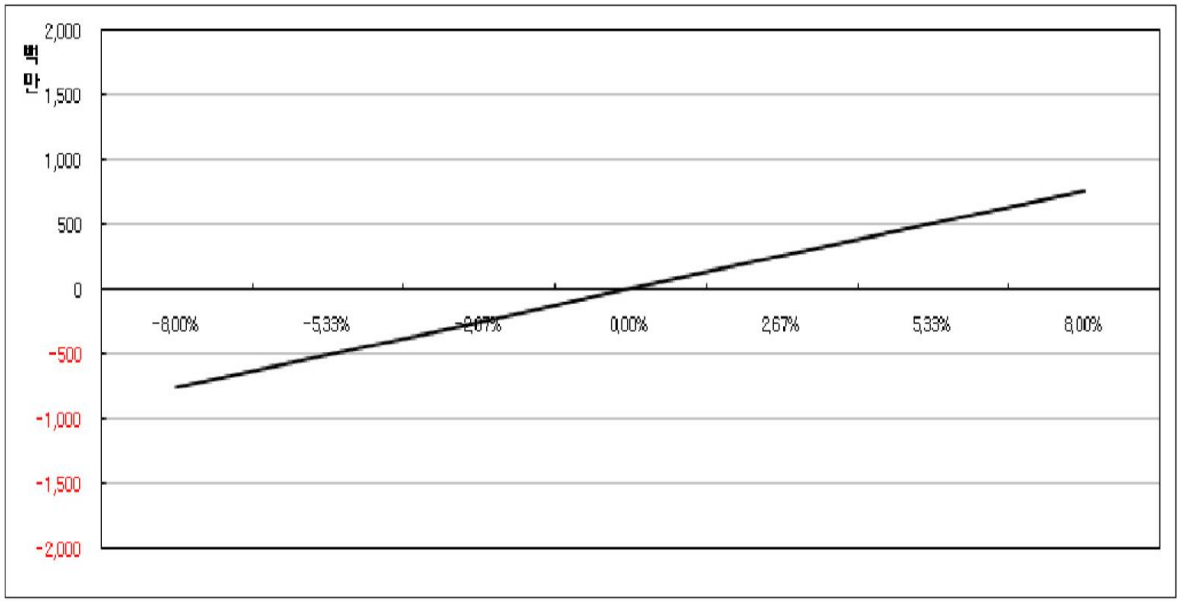
공시일: 2019-07-09

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	134	0	134	장내
합계			134	0	134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

388

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

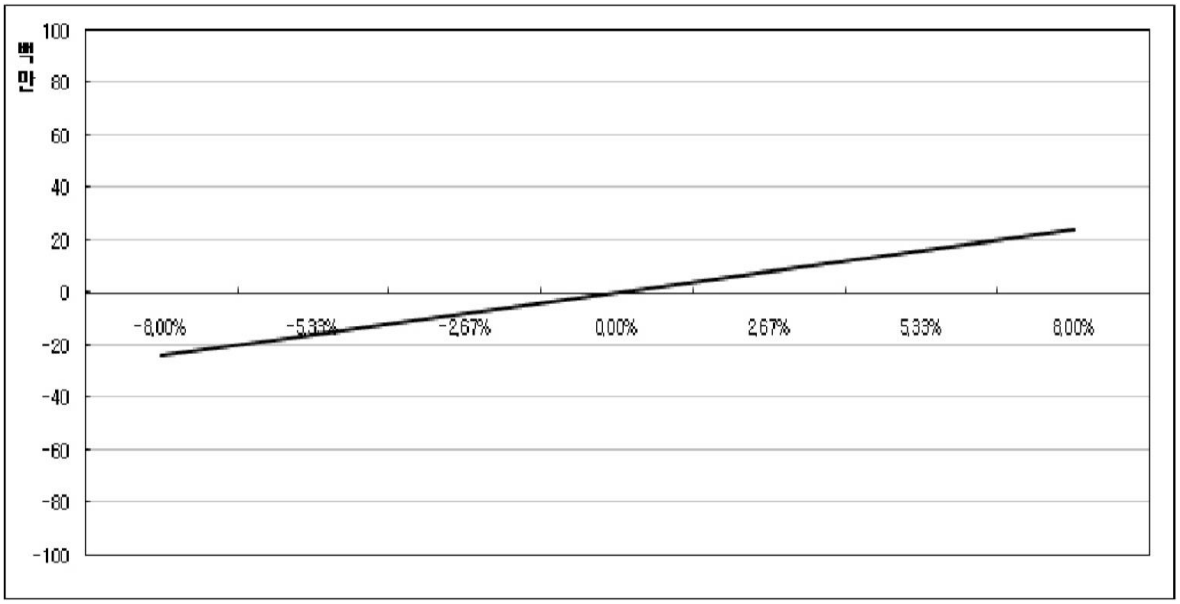
공시일: 2019-07-09

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	873	0	873	장내
합계			873	0	873	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

70

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

464

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

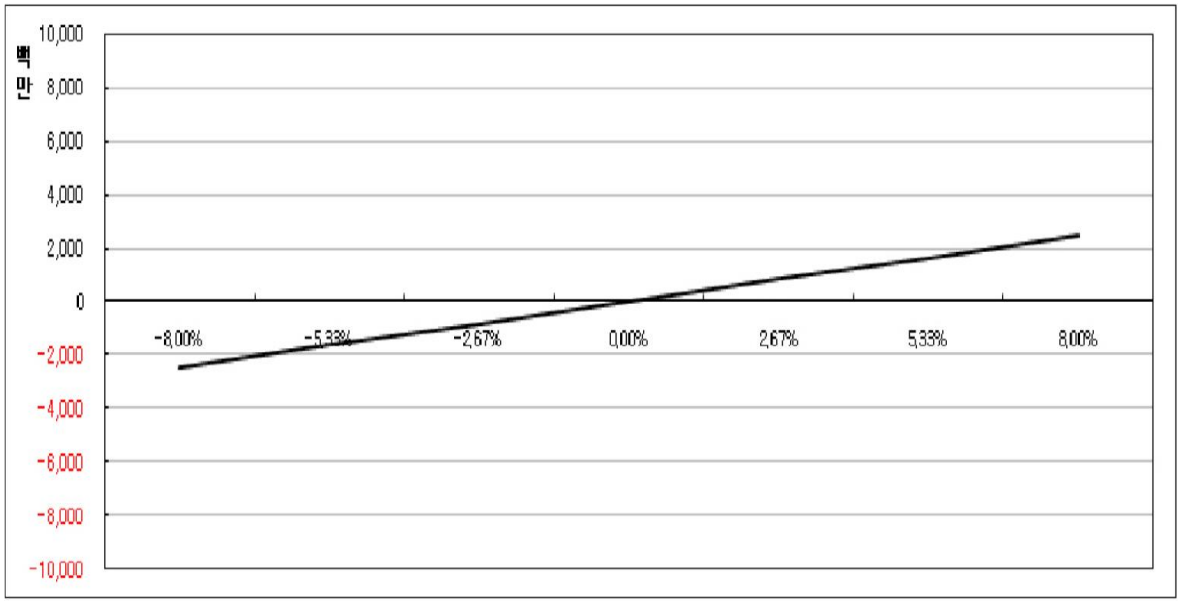
공시일: 2019-07-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	201	201	0	장내
누계	주가지수	선물	4,834	0	4,834	장내
합계			4,834	0	4,834	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

388

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

918

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

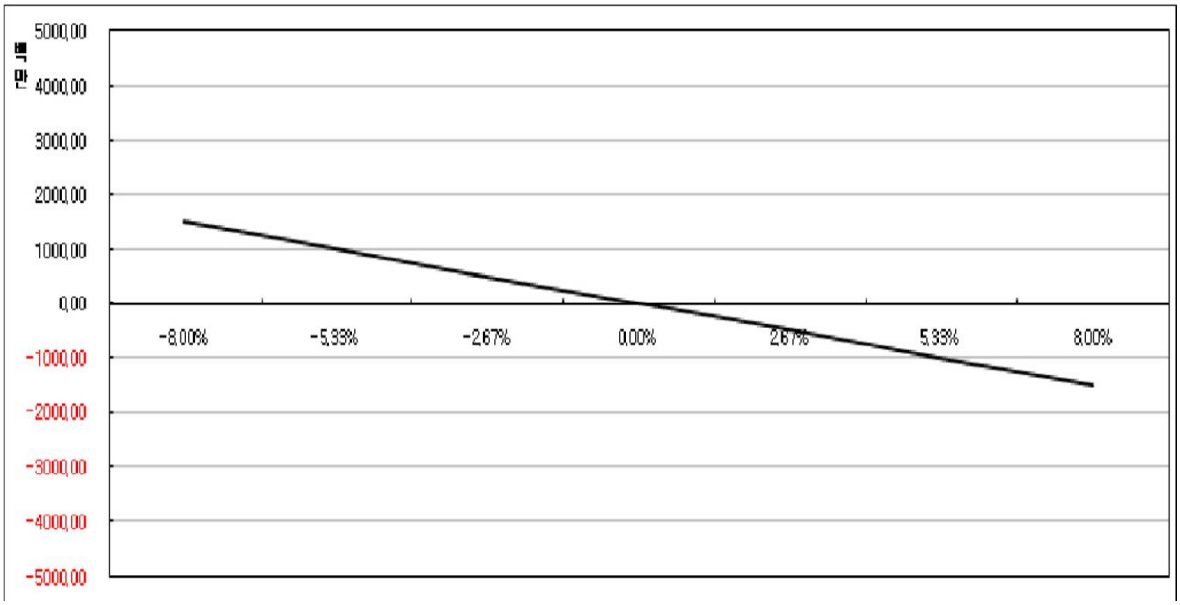
공시일: 2019-07-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	134	-134	장내
누계	주가지수	선물	0	2,081	-2,081	장내
합계			0	2,081	-2,081	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

167

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

140

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

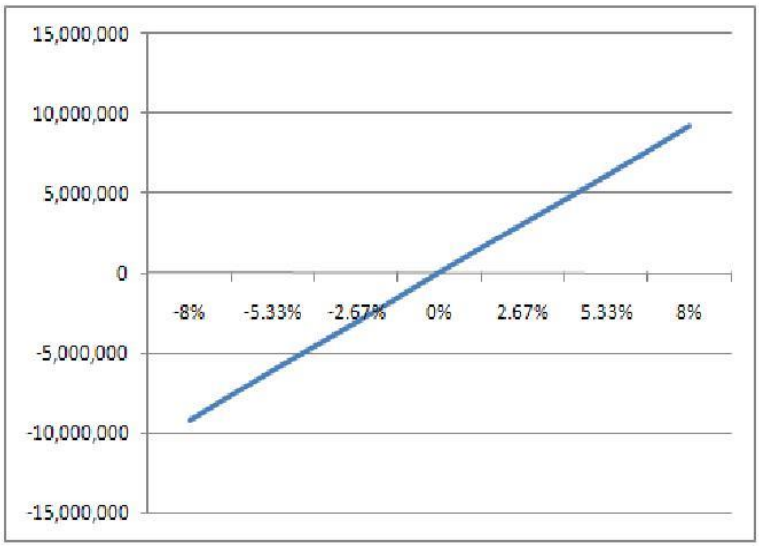
공시일: 2019-07-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	940	-940	장내
누계	주가지수	선물	68,749	0	68,749	장내
합계			68,749	0	68,749	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,513

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,885