펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-11

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	3,023	0	3,023	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	3,023	-3,022	장내
합계			3,025	3,023	1	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	335

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

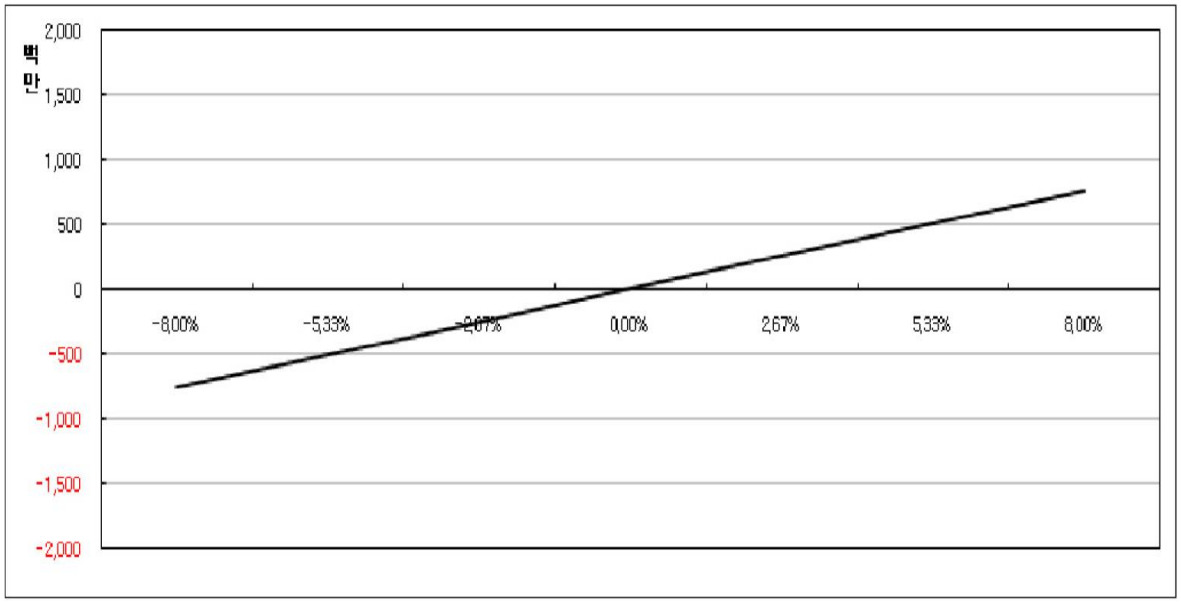
공시일: 2019-07-11

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]

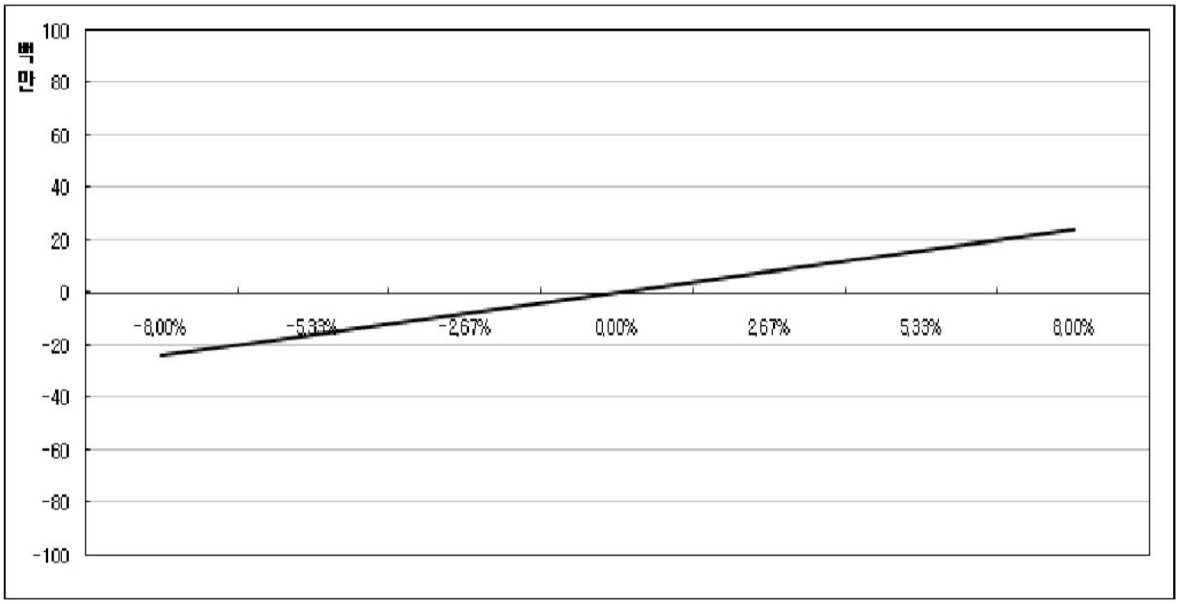
공시일: 2019-07-11

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)

465

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

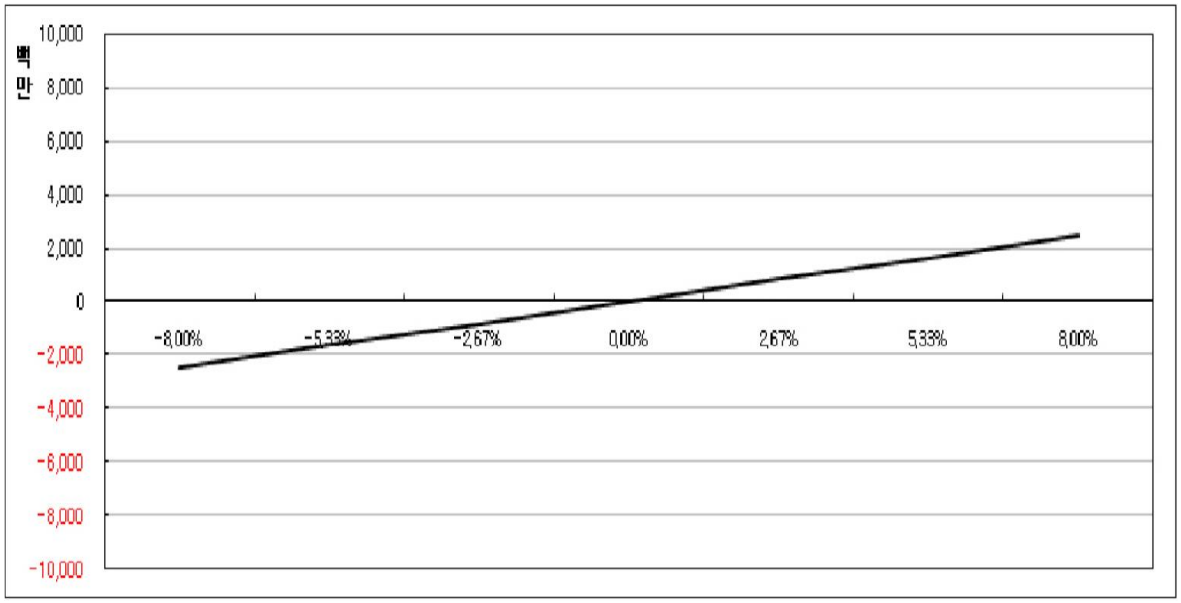
공시일: 2019-07-11

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	4,770	0	4,770	장내
합계			4,770	0	4,770	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

383

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

917

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

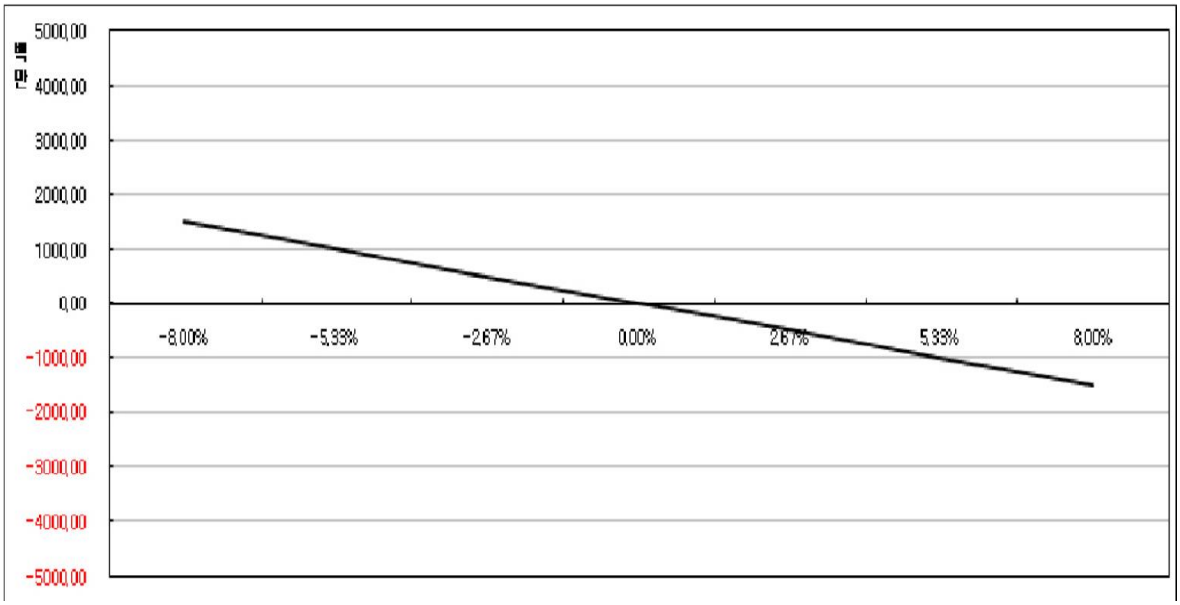
공시일: 2019-07-11

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	2,284	-2,284	장내
합계			0	2,284	-2,284	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	183

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	154

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

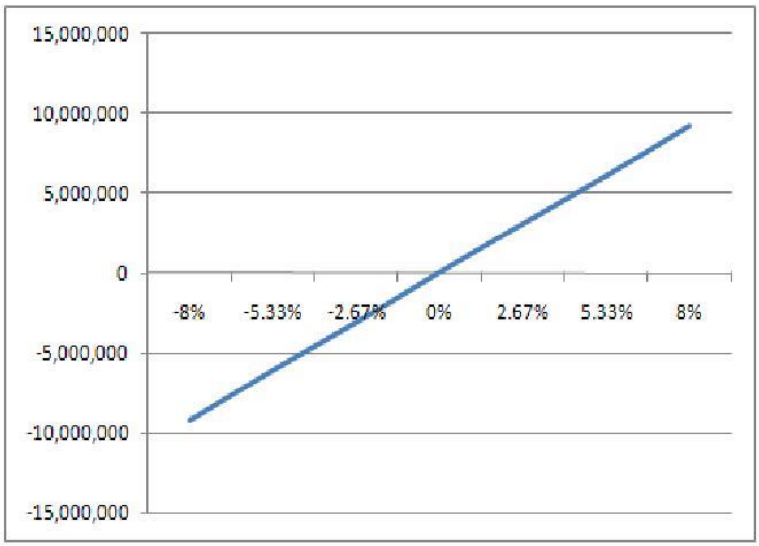
공시일: 2019-07-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	672	0	672	장내
누계	주가지수	선물	69,741	0	69,741	장내
합계			69,741	0	69,741	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,598

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,967