펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-12

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	3,058	0	3,058	장내
신규	주가지수	옵션	16	8,562	-8,545	장내
누계	주가지수	옵션	13	6,116	-6,103	장내
합계			3,071	6,116	-3,045	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

145

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

489

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

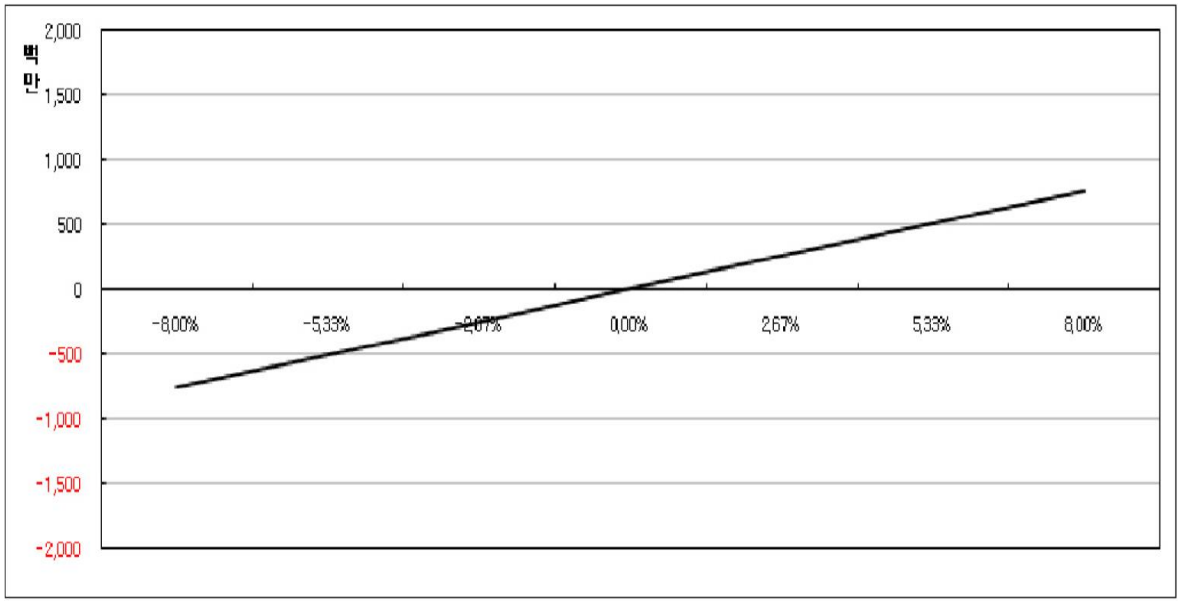
공시일: 2019-07-12

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)

392

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

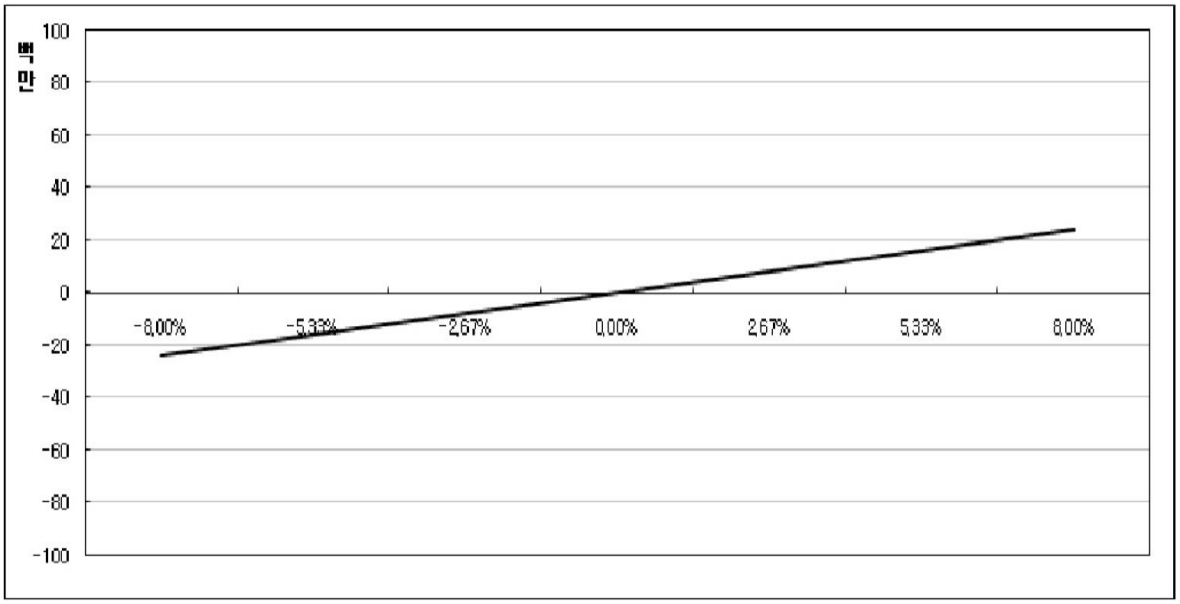
공시일: 2019-07-12

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	883	0	883	장내
합계			883	0	883	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 71

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 470

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

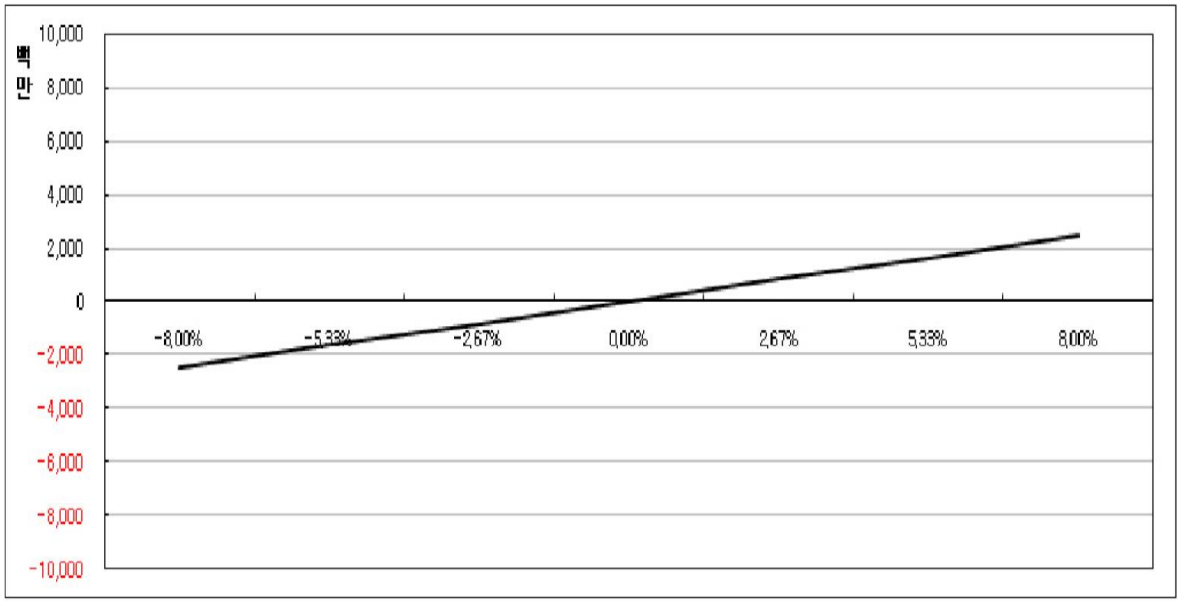
공시일: 2019-07-12

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	4,824	0	4,824	장내
합계			4,824	0	4,824	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

388

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

928

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

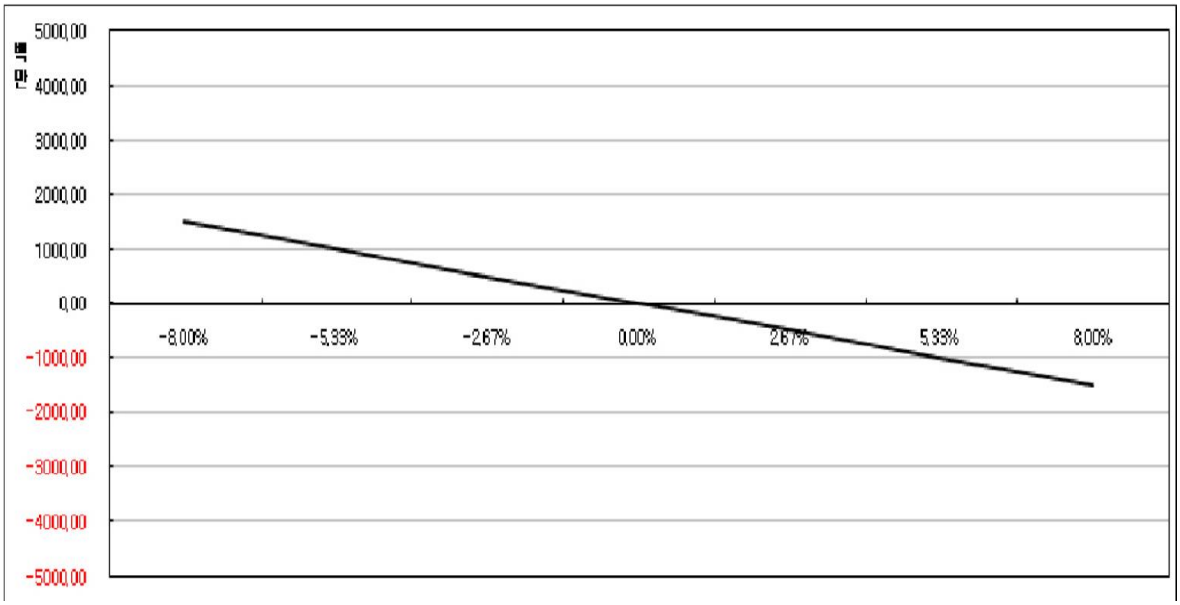
공시일: 2019-07-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	204	0	204	장내
누계	주가지수	선물	0	2,106	-2,106	장내
합계			0	2,106	-2,106	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

142

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

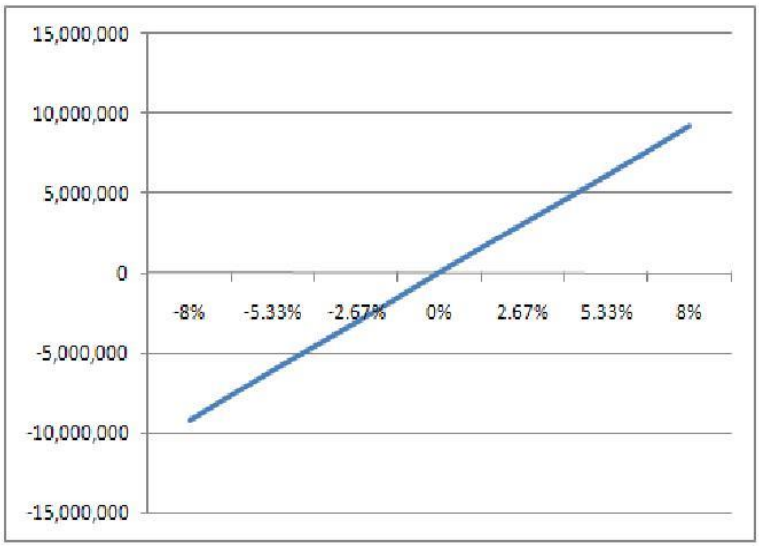
공시일: 2019-07-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	679	0	679	장내
누계	주가지수	선물	71,206	0	71,206	장내
합계			71,206	0	71,206	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,722

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,109