펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-15

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	3,068	0	3,068	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	6,135	-6,126	장내
합계			3,077	6,135	-3,058	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	157

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	536

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

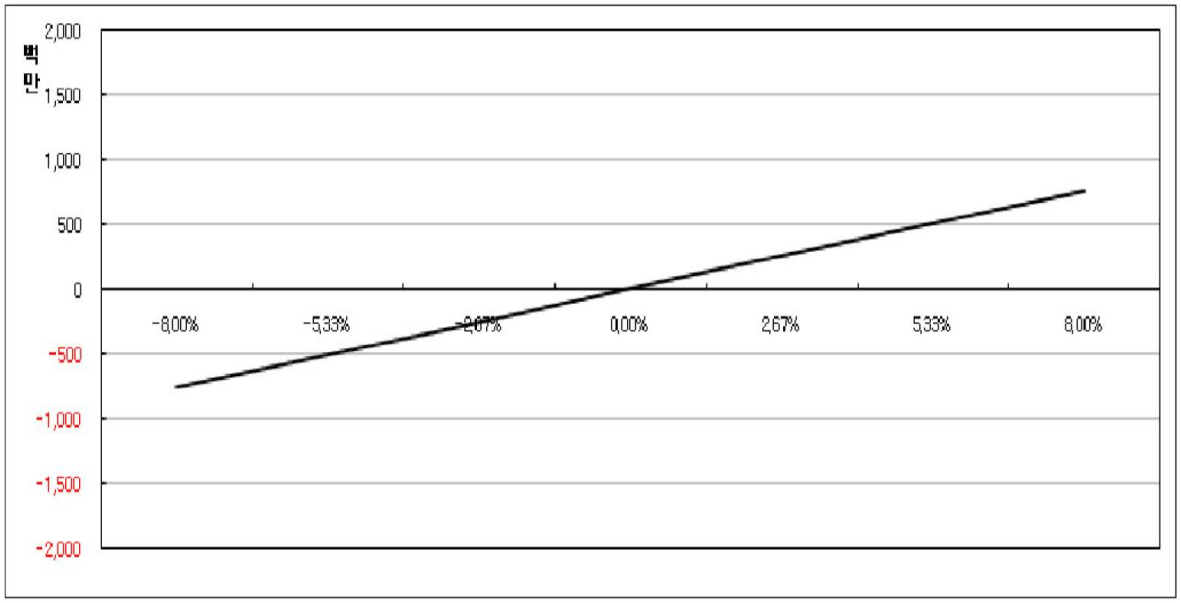
공시일: 2019-07-15

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)	393

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

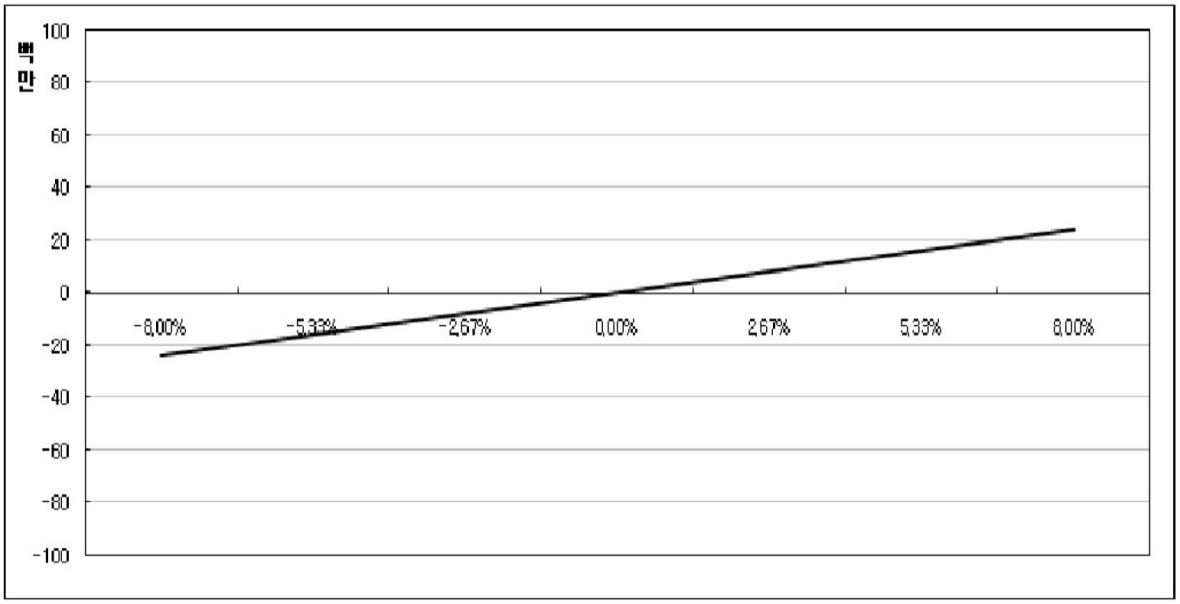
공시일: 2019-07-15

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	886	0	886	장내
합계			886	0	886	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

71

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

471

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

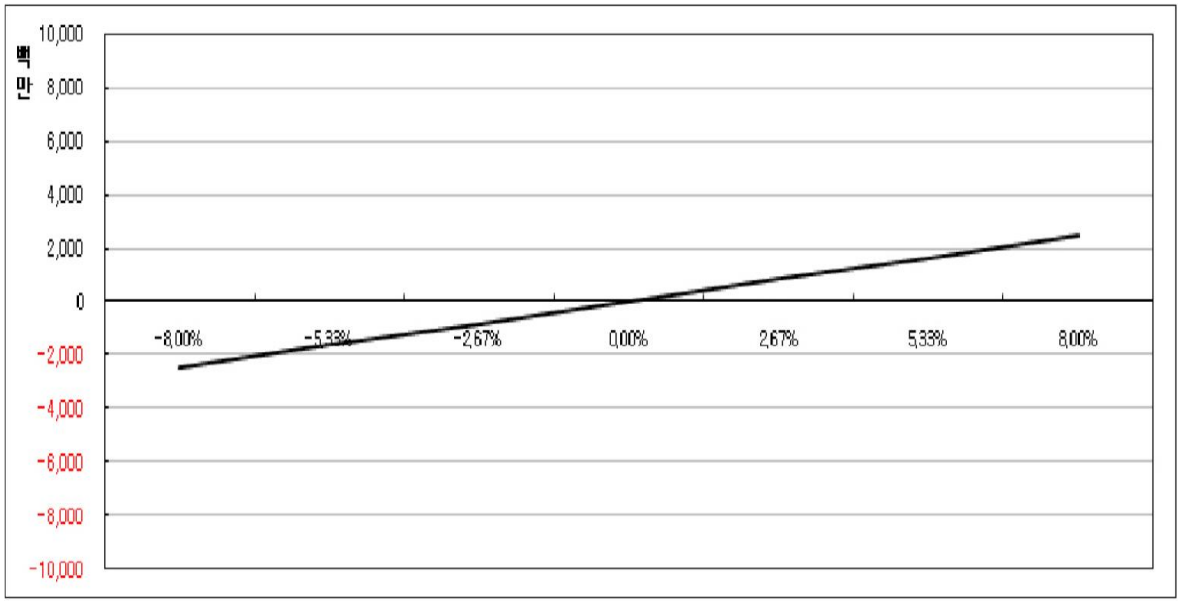
공시일: 2019-07-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	205	0	205	장내
누계	주가지수	선물	5,045	0	5,045	장내
합계			5,045	0	5,045	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

405

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

938

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

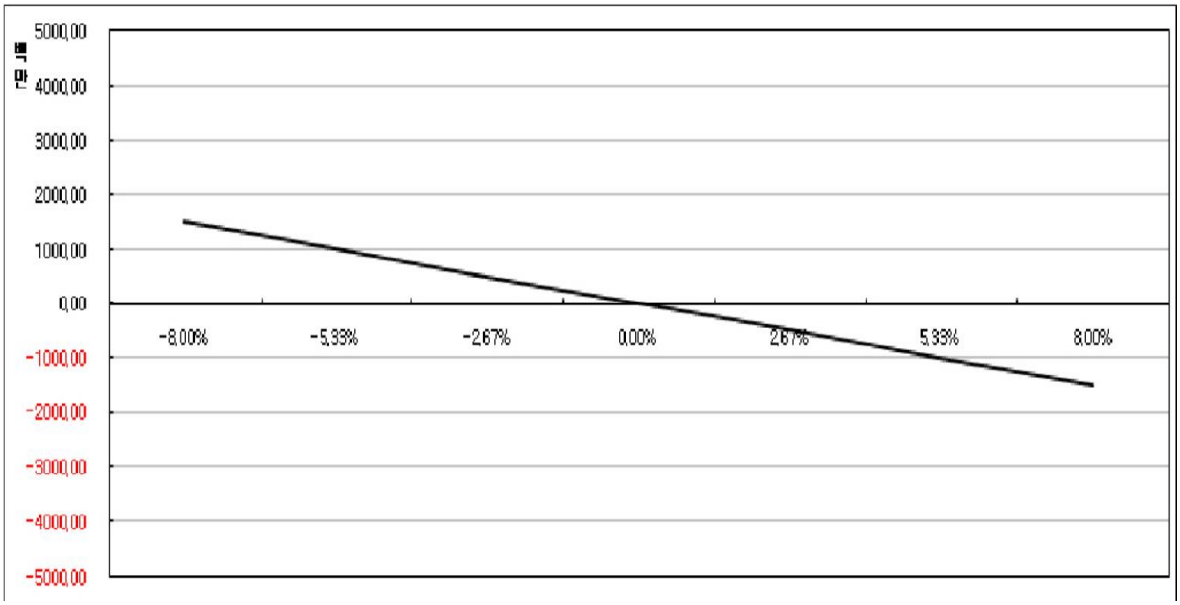
공시일: 2019-07-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	136	0	136	장내
누계	주가지수	선물	0	1,977	-1,977	장내
합계			0	1,977	-1,977	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

159

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

133

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

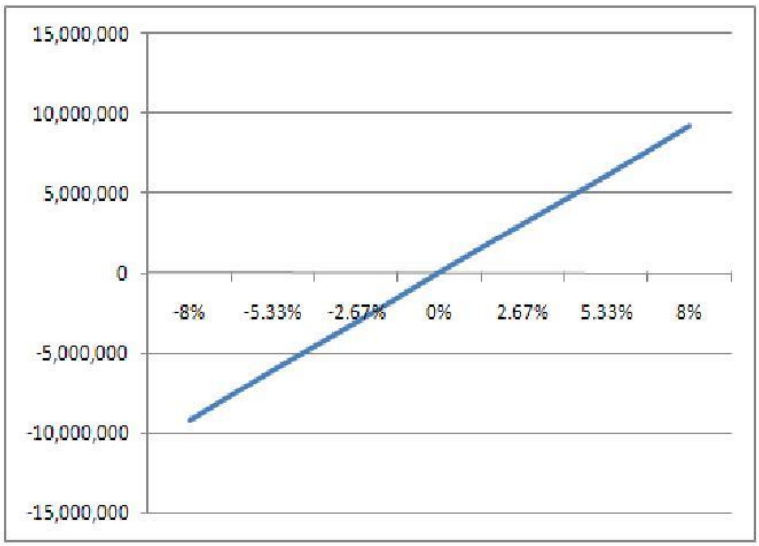
공시일: 2019-07-15

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	71,442	0	71,442	장내
합계			71,442	0	71,442	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,732

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,114