펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-18

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	3,054	0	3,054	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	6,108	-6,098	장내
합계			3,065	6,108	-3,044	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	148

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	314

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

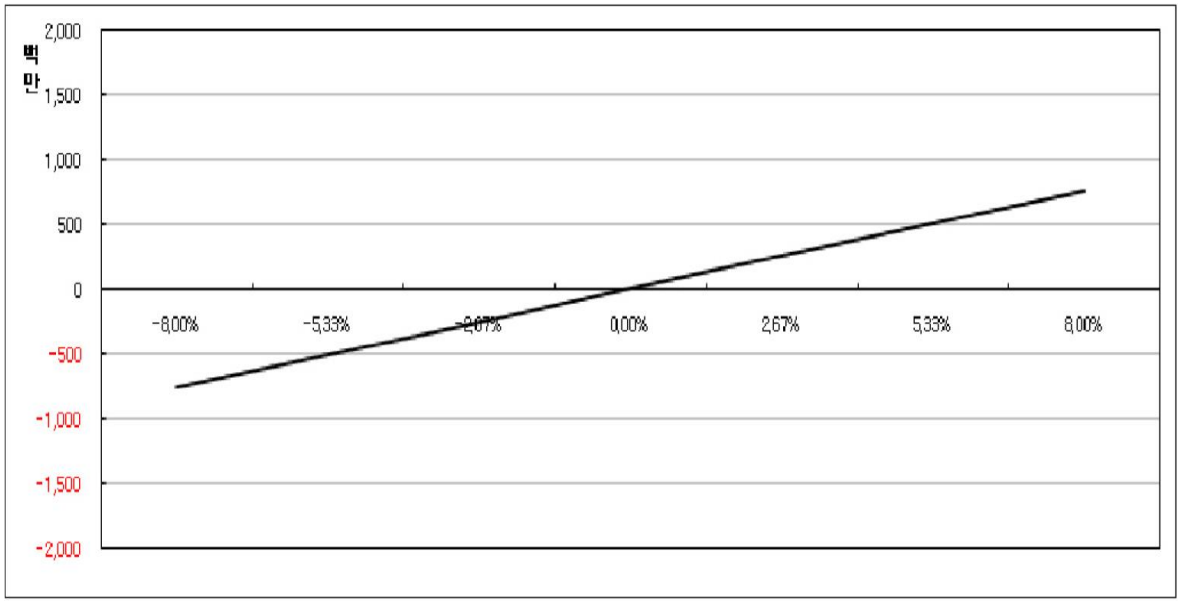
공시일: 2019-07-18

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)

391

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

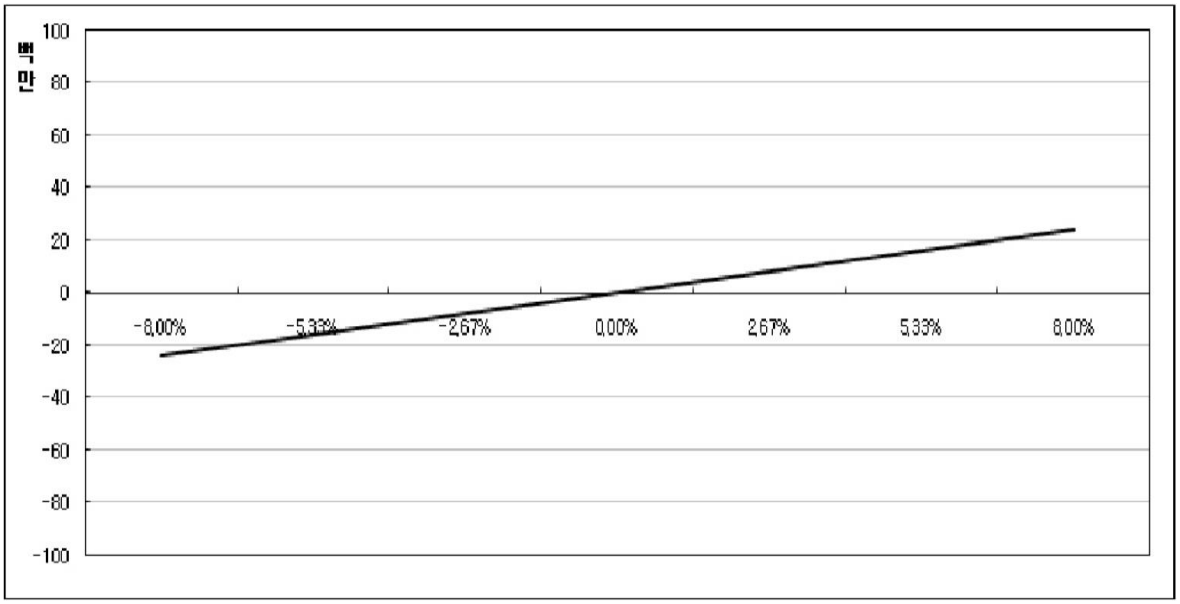
공시일: 2019-07-18

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	882	0	882	장내
합계			882	0	882	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 71

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 468

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

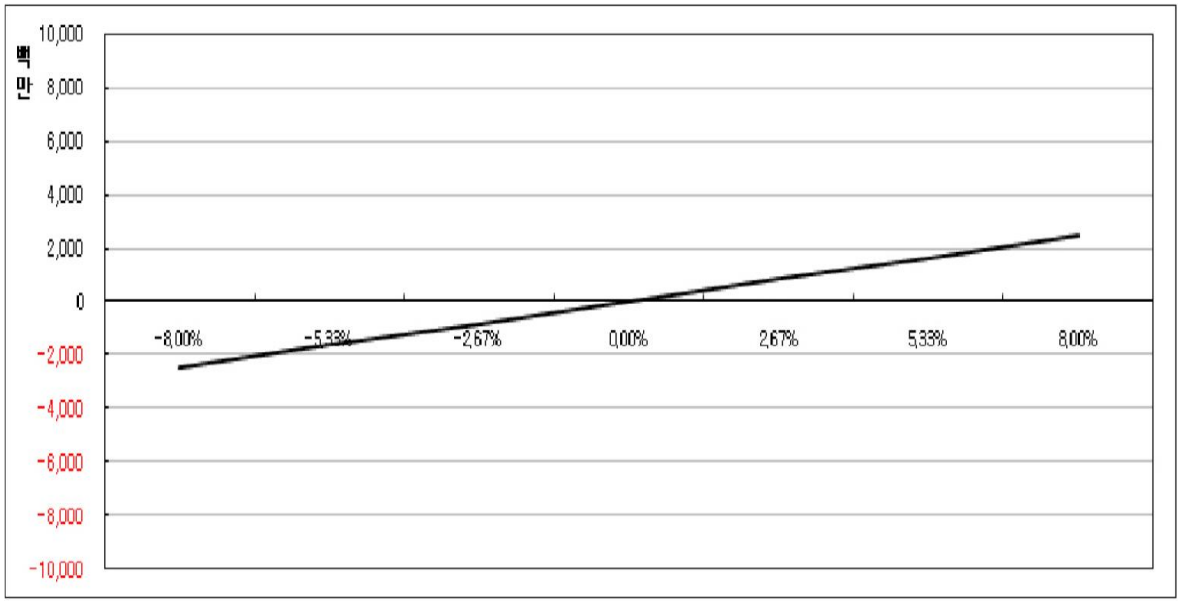
공시일: 2019-07-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	271	204	68	장내
누계	주가지수	선물	4,683	0	4,683	장내
합계			4,683	0	4,683	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

375

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

916

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

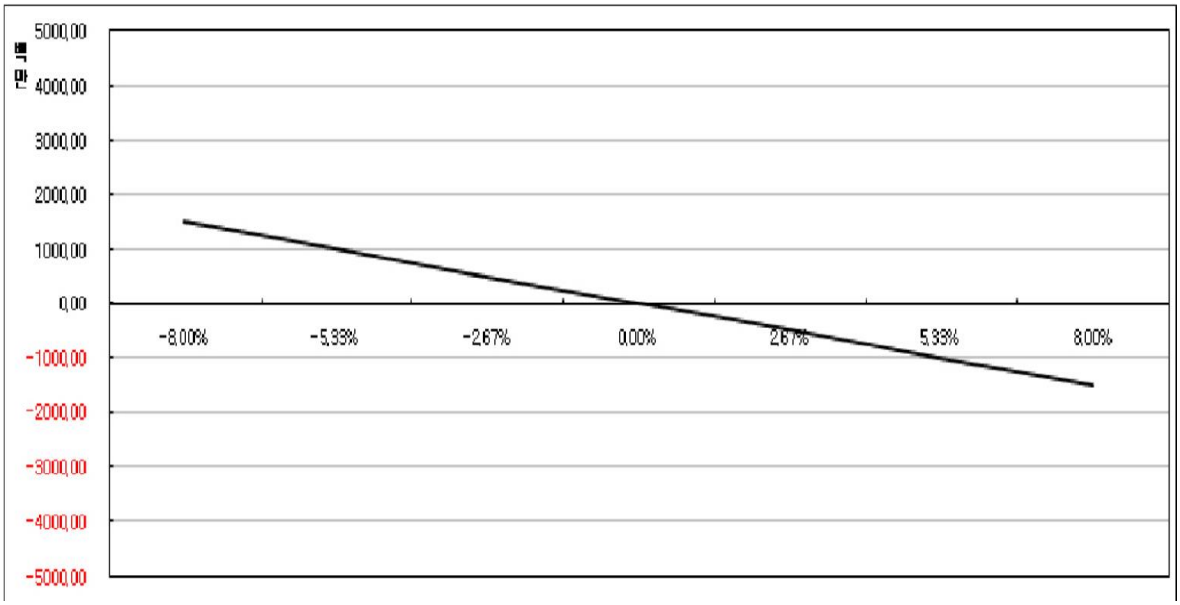
공시일: 2019-07-18

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	2,104	-2,104	장내
합계			0	2,104	-2,104	

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]

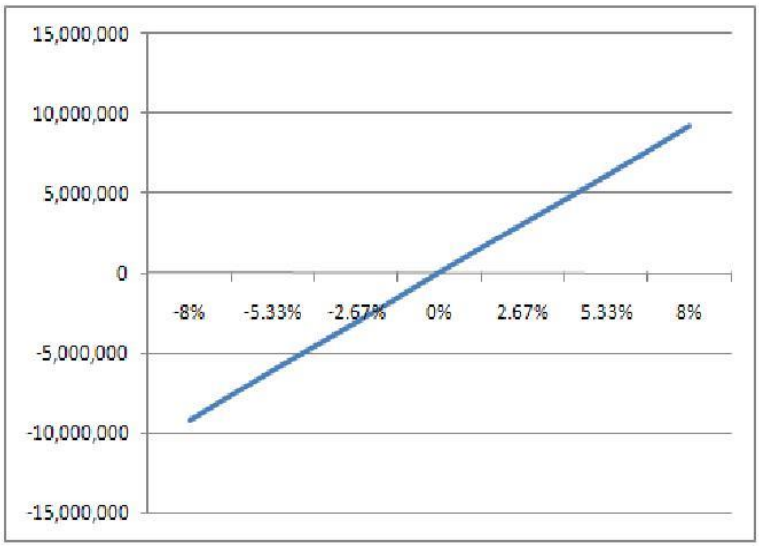
공시일: 2019-07-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	475	-475	장내
누계	주가지수	선물	70,381	0	70,381	장내
합계			70,381	0	70,381	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,638

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,016