펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-23

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	3,089	0	3,089	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	6,177	-6,172	장내
합계			3,094	6,177	-3,083	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	183

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	439

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

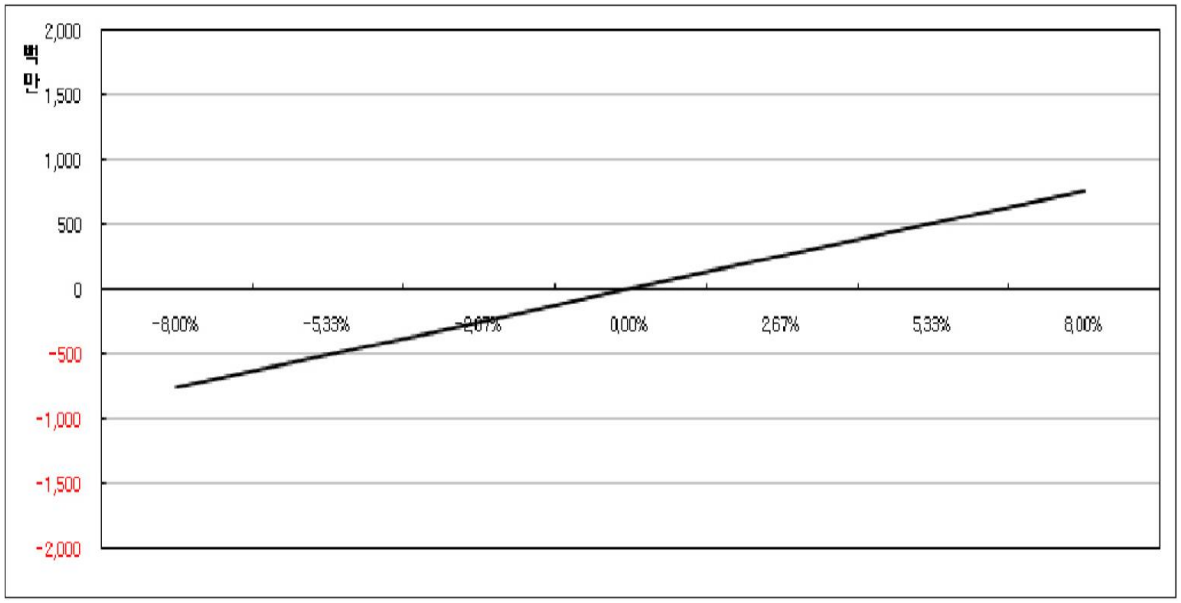
공시일: 2019-07-23

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	137	0	137	장내
합계			137	0	137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	397

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

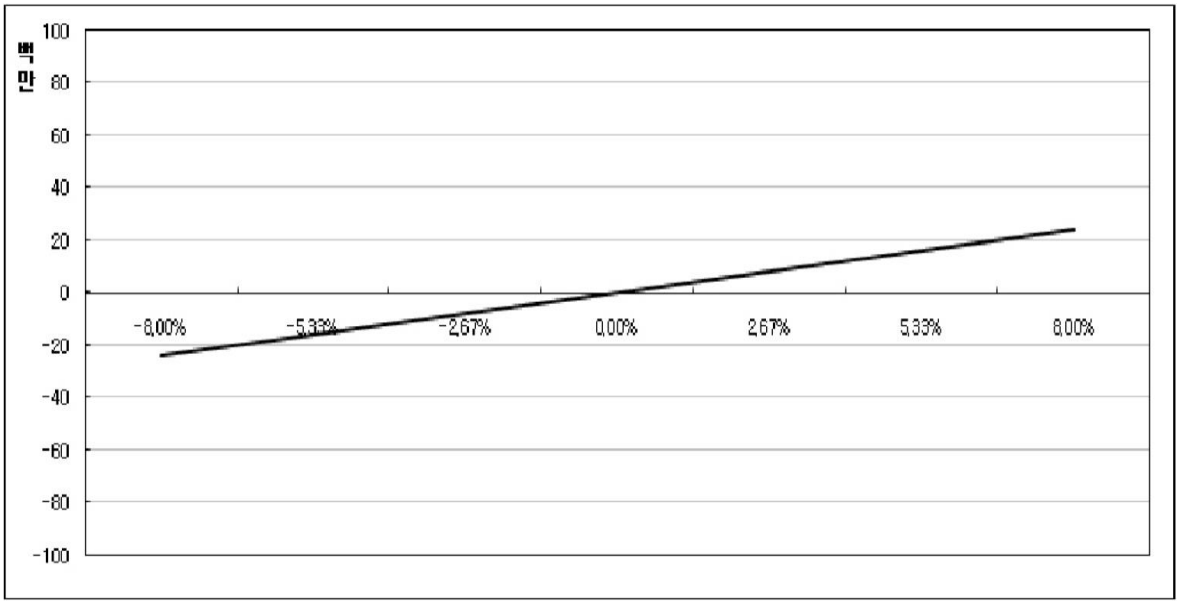
공시일: 2019-07-23

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	892	0	892	장내
합계			892	0	892	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 476

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

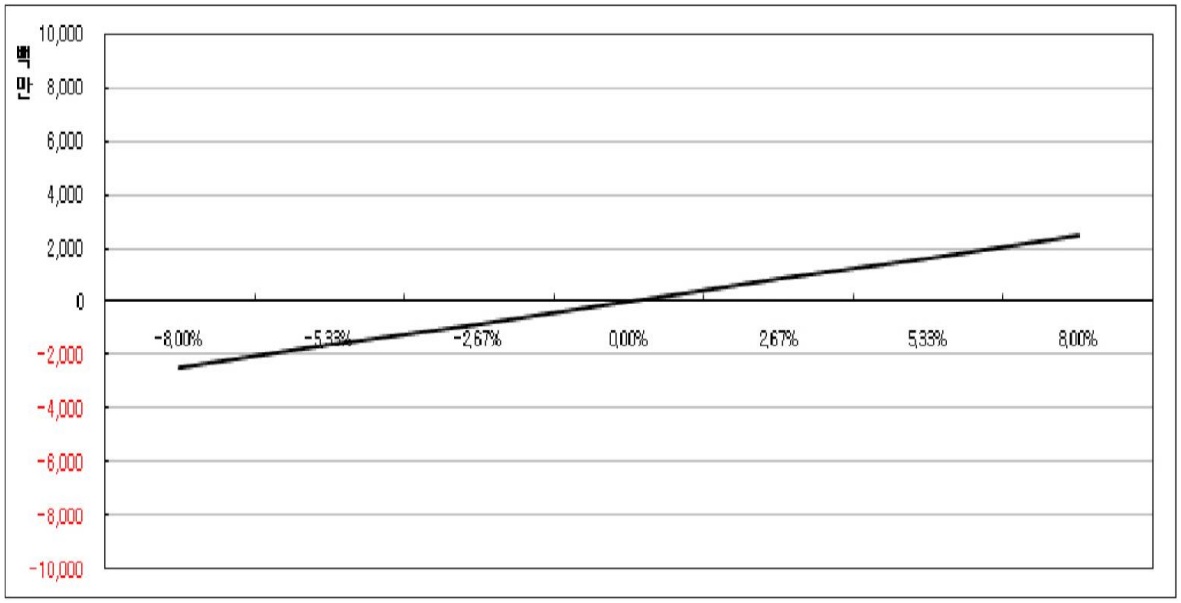
공시일: 2019-07-23

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	4,736	0	4,736	장내
합계			4,736	0	4,736	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

380

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

932

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

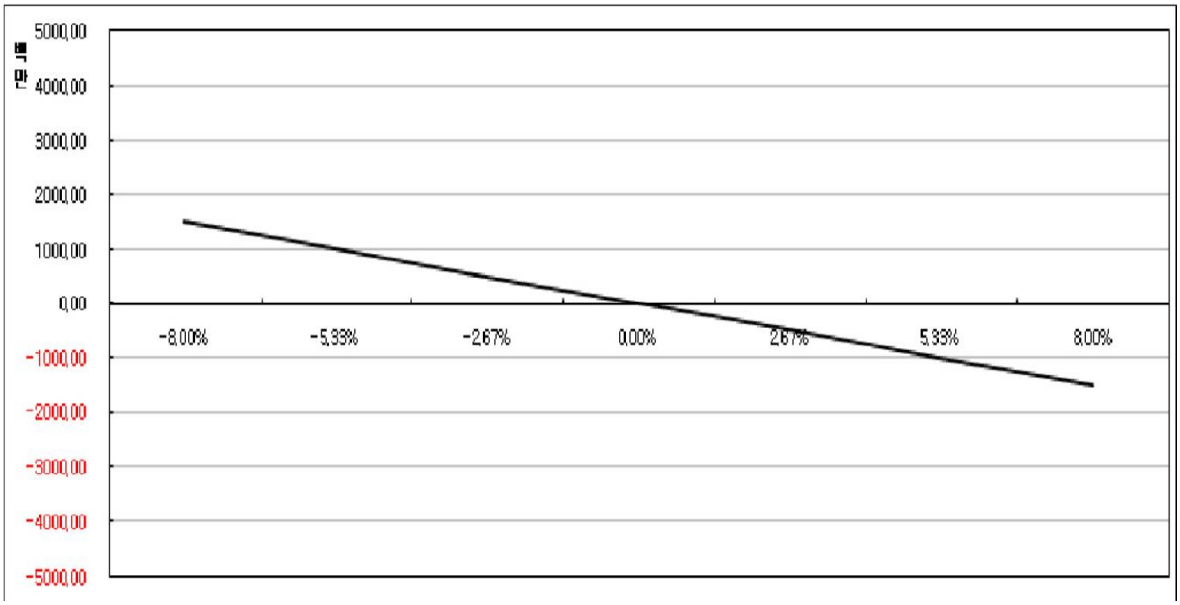
공시일: 2019-07-23

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	2,128	-2,128	장내
합계			0	2,128	-2,128	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

171

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

144

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

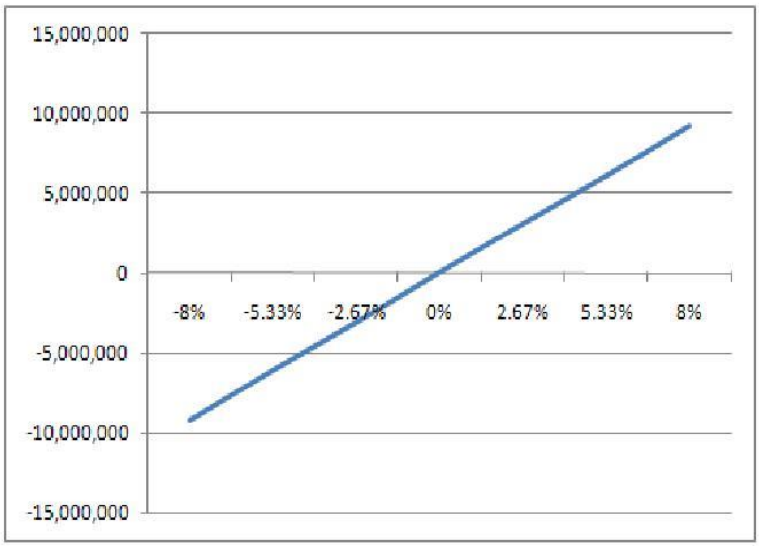
공시일: 2019-07-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	686	-686	장내
누계	주가지수	선물	71,177	0	71,177	장내
합계			71,177	0	71,177	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,707

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,171