펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-24

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	3,104	0	3,104	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	6,208	-6,205	장내
합계			3,108	6,208	-3,101	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	202

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	476

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

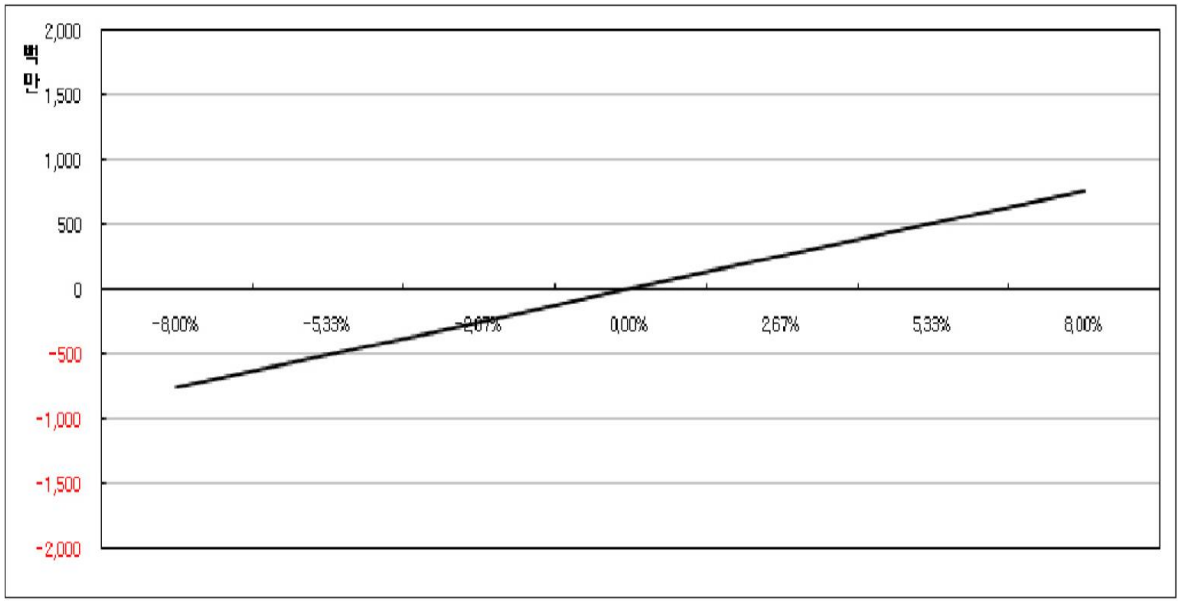
공시일: 2019-07-24

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	138	0	138	장내
합계			138	0	138	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	398

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

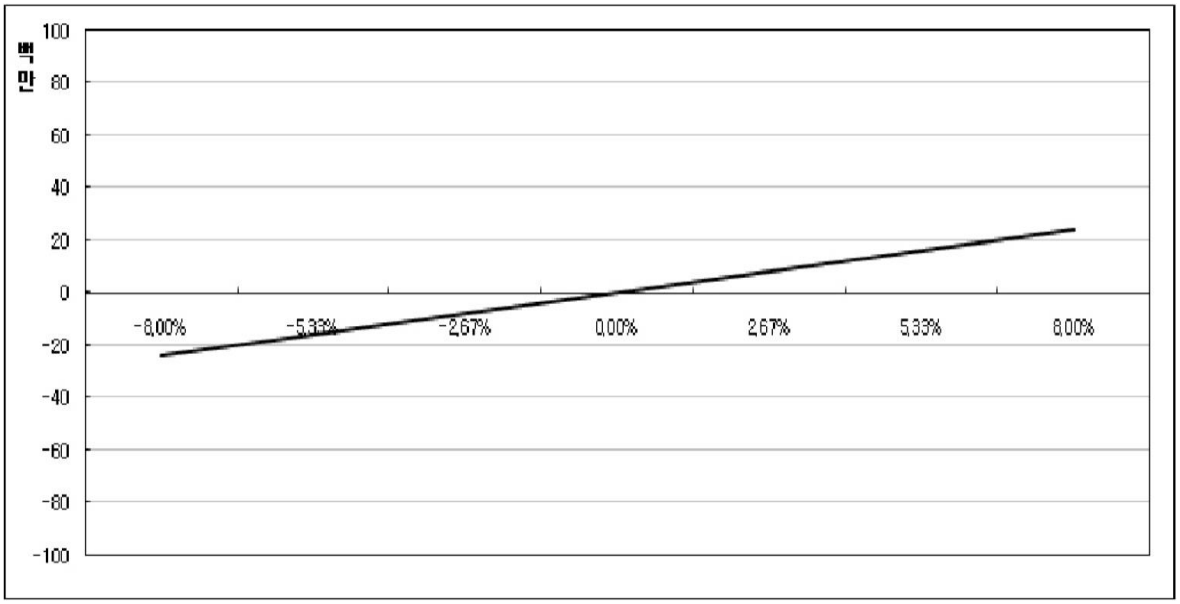
공시일: 2019-07-24

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	897	0	897	장내
합계			897	0	897	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 477

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

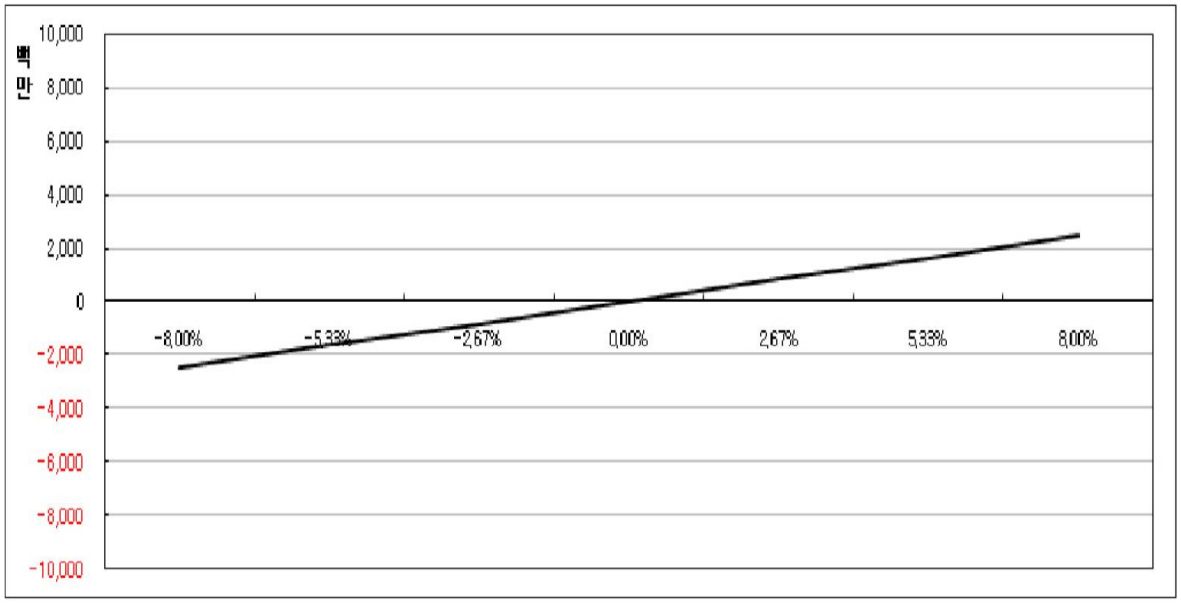
공시일: 2019-07-24

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	4,760	0	4,760	장내
합계			4,760	0	4,760	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

382

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

934

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

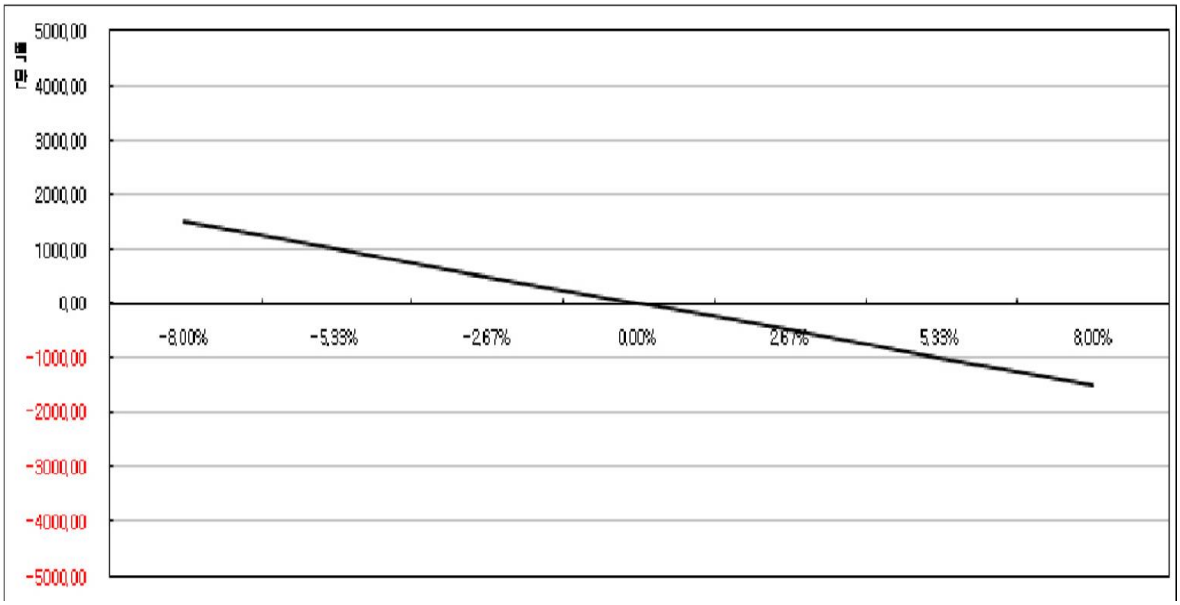
공시일: 2019-07-24

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	2,138	-2,138	장내
합계			0	2,138	-2,138	

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]

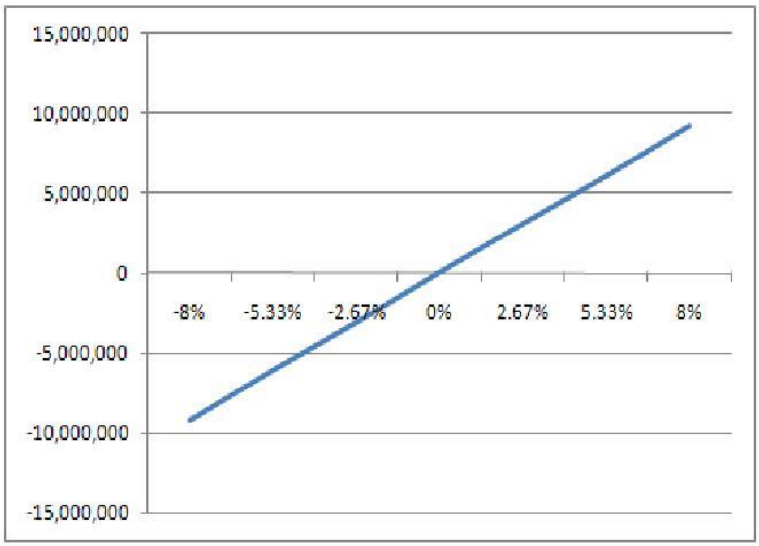
공시일: 2019-07-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	414	-414	장내
누계	주가지수	선물	71,118	0	71,118	장내
합계			71,118	0	71,118	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,700

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,173