펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-31

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	3,026	0	3,026	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	11	6,051	-6,040	장내
합계			3,037	6,051	-3,015	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	283

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

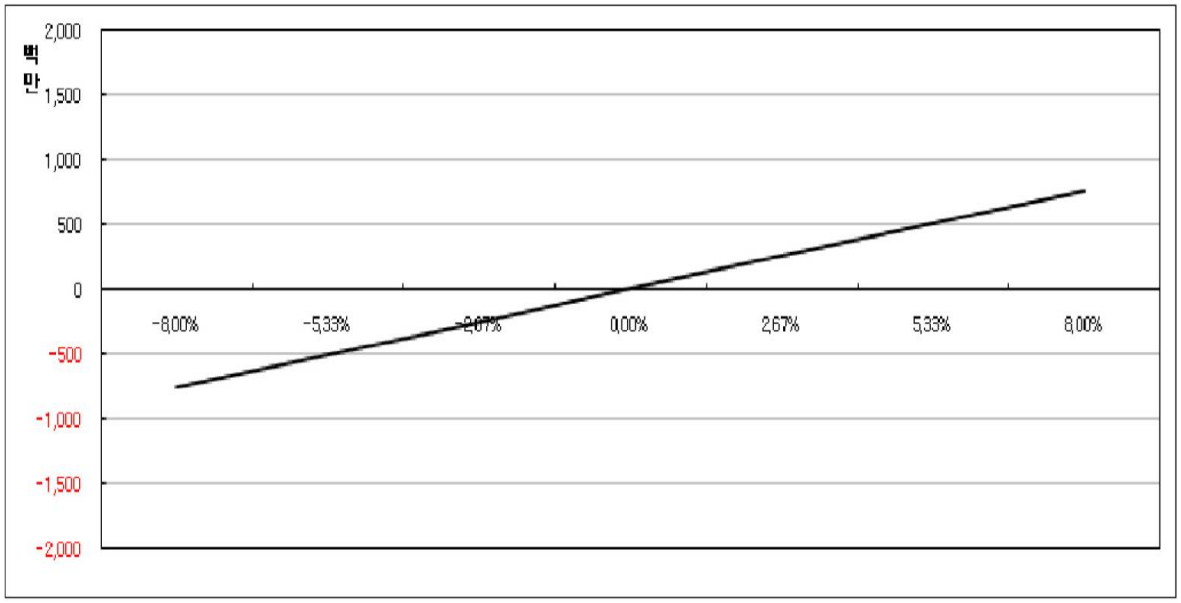
공시일: 2019-07-31

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	134	0	134	장내
합계			134	0	134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

401

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

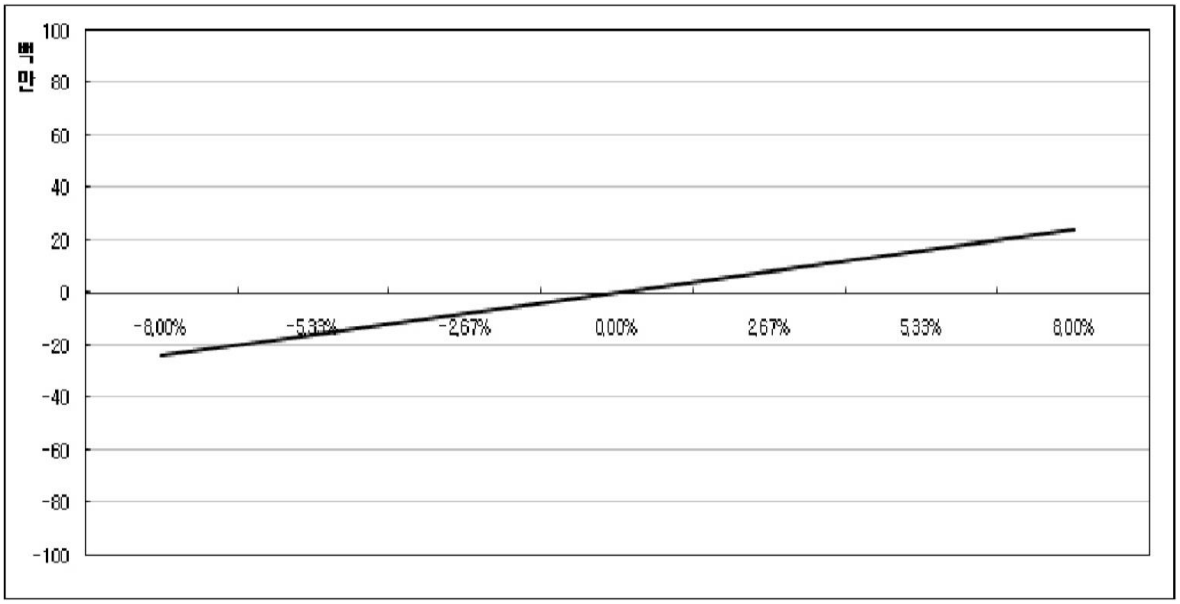
공시일: 2019-07-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	67	67	장내
누계	주가지수	선물	1,009	0	1,009	장내
합계			1,009	0	1,009	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

485

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

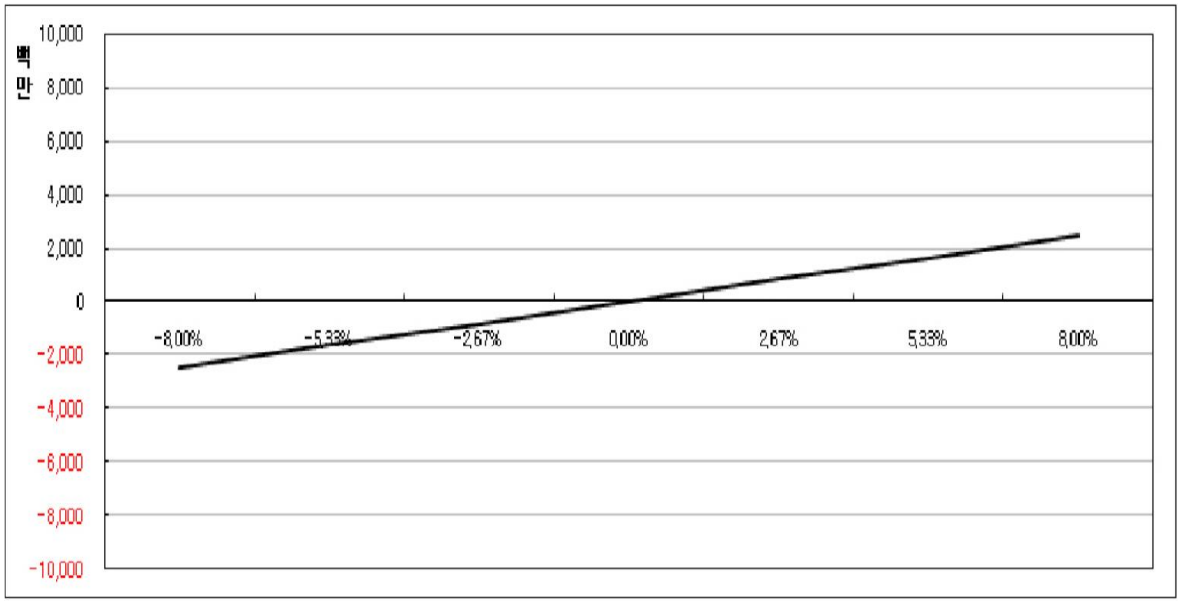
공시일: 2019-07-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	202	67	134	장내
누계	주가지수	선물	4,774	0	4,774	장내
합계			4,774	0	4,774	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

383

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

942

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

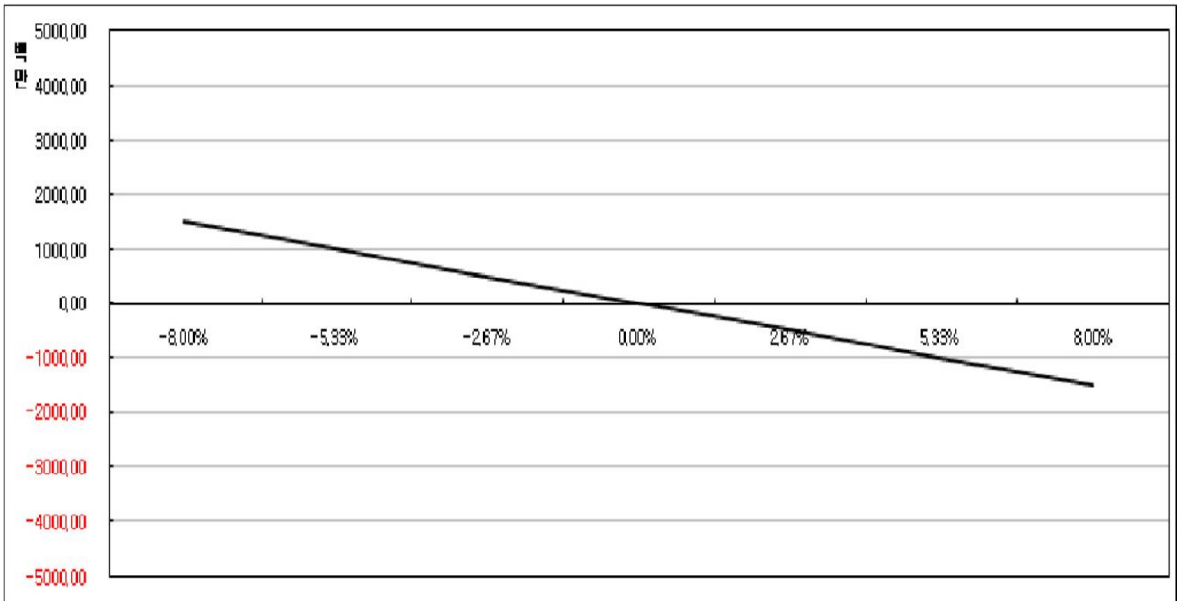
공시일: 2019-07-31

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	2,286	-2,286	장내
합계			0	2,286	-2,286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	183

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	156

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

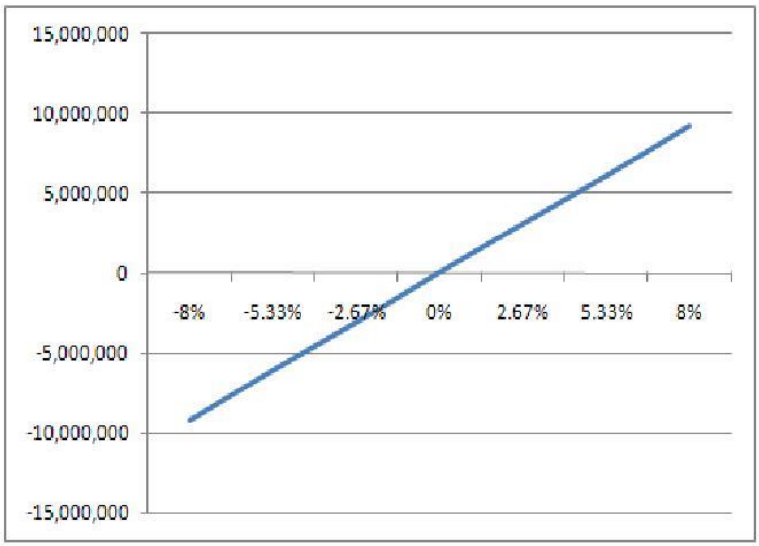
공시일: 2019-07-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	336	0	336	장내
누계	주가지수	선물	69,793	0	69,793	장내
합계			69,793	0	69,793	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,593

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,160