펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-03

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	3,577	0	3,577	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	3,505	-3,501	장내
합계			3,580	3,505	75	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

322

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

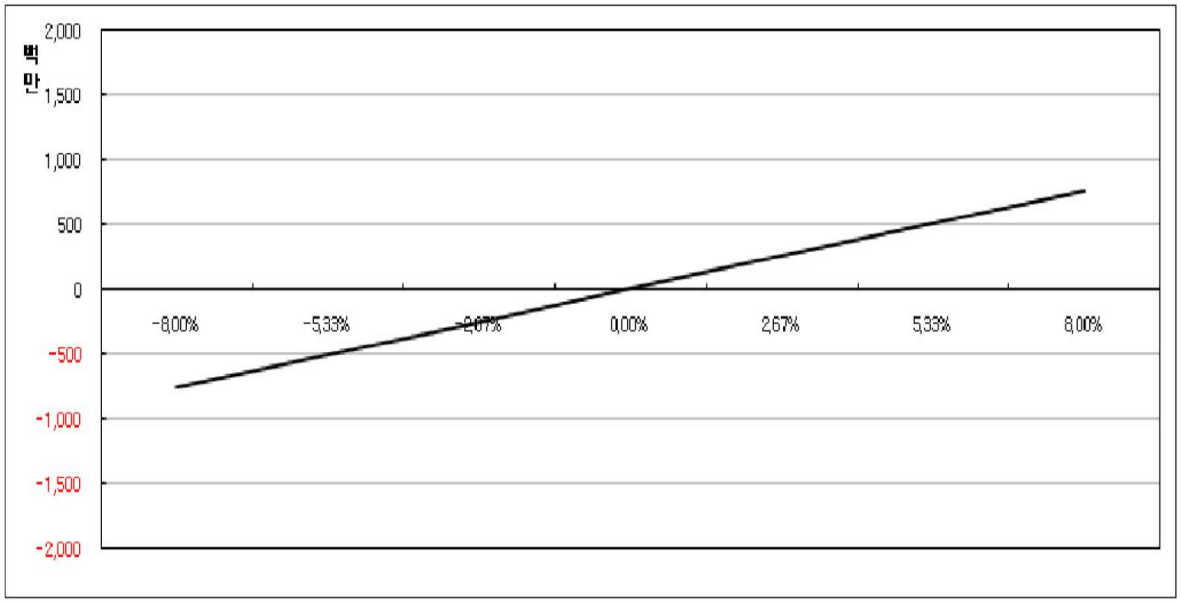
공시일: 2019-05-03

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	215	0	215	장내
합계			215	0	215	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	418

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

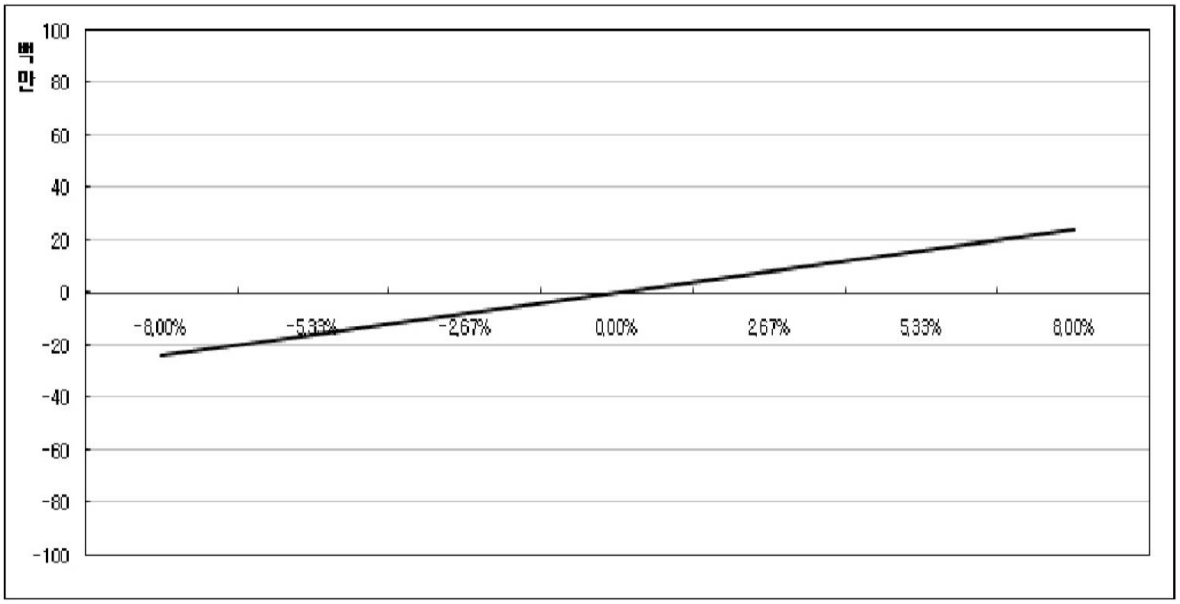
공시일: 2019-05-03

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	858	0	858	장내
합계			858	0	858	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

491

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

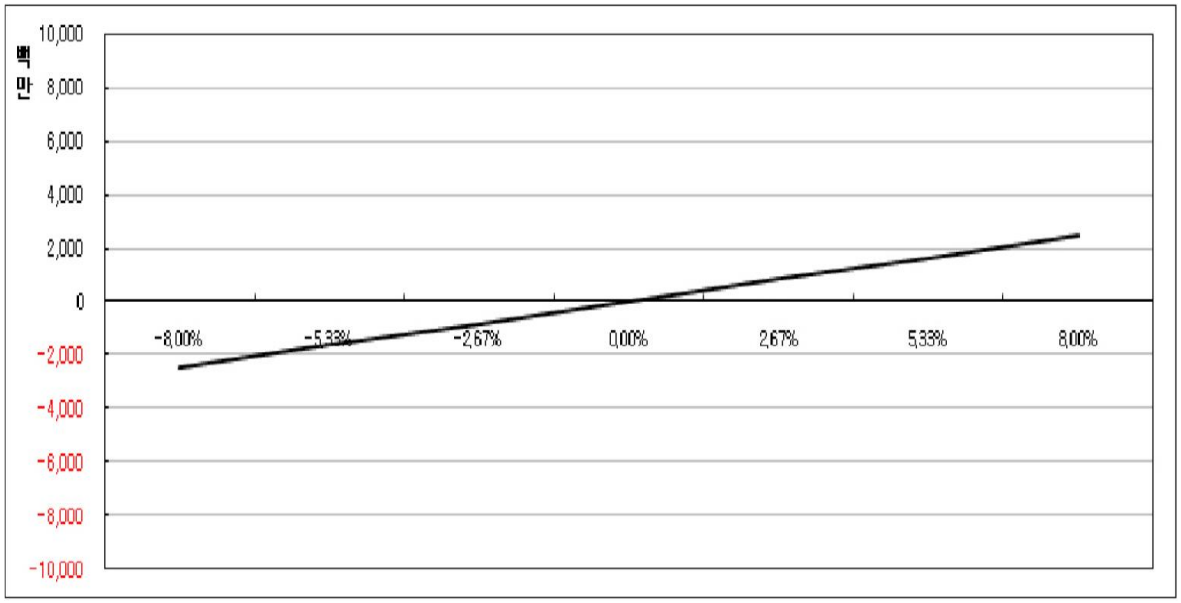
공시일: 2019-05-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	215	-215	장내
누계	주가지수	선물	3,791	0	3,791	장내
합계			3,791	0	3,791	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

304

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

912

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

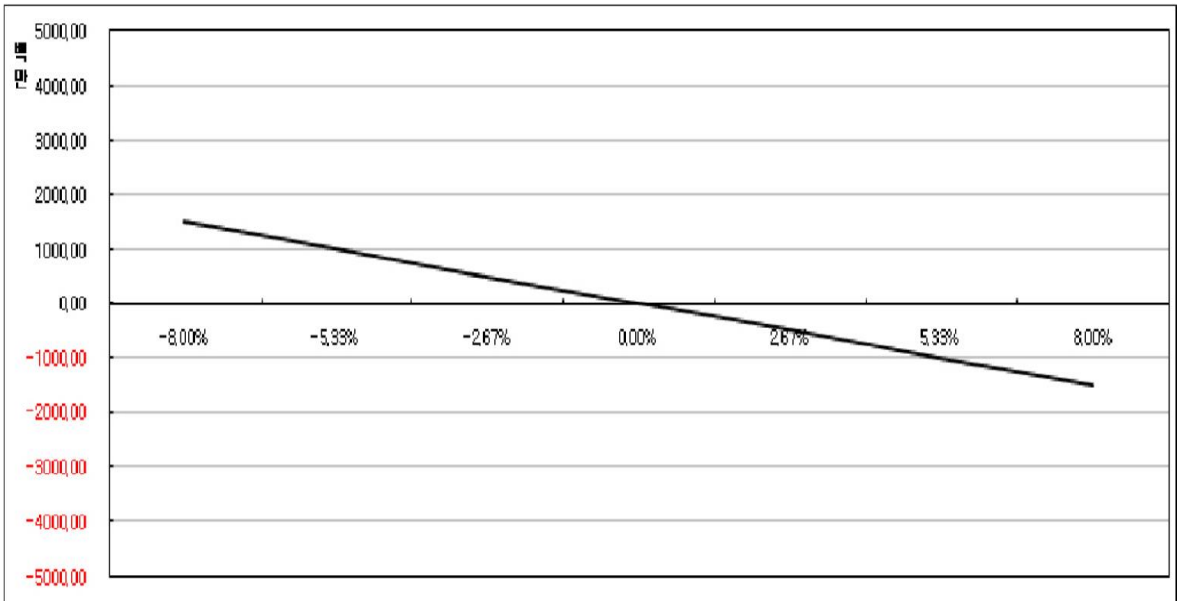
공시일: 2019-05-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	143	-143	장내
누계	주가지수	선물	0	3,219	-3,219	장내
합계			0	3,219	-3,219	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

258

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

214

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

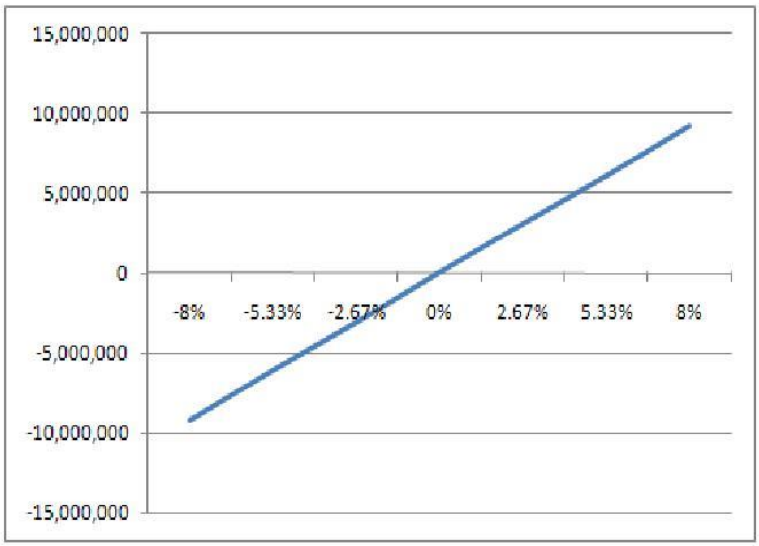
공시일: 2019-05-03

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	69,670	0	69,670	장내
합계			69,670	0	69,670	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,588

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,247