펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-07

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	3,546	0	3,546	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	3,475	-3,471	장내
합계			3,550	3,475	75	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	355

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

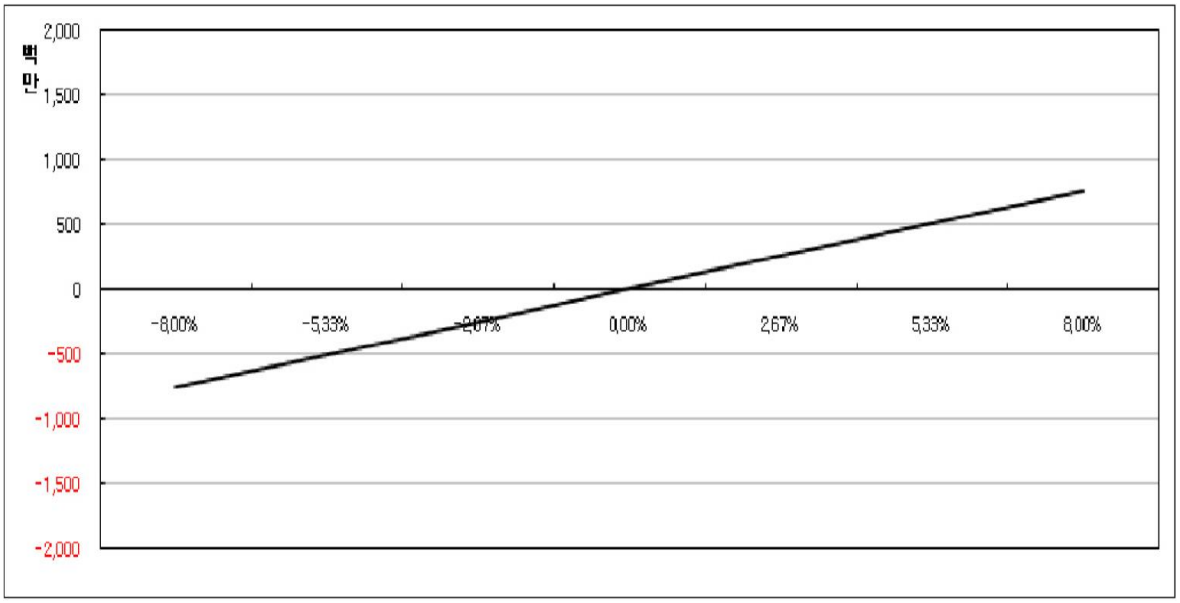
공시일: 2019-05-07

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	213	0	213	장내
합계			213	0	213	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

416

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

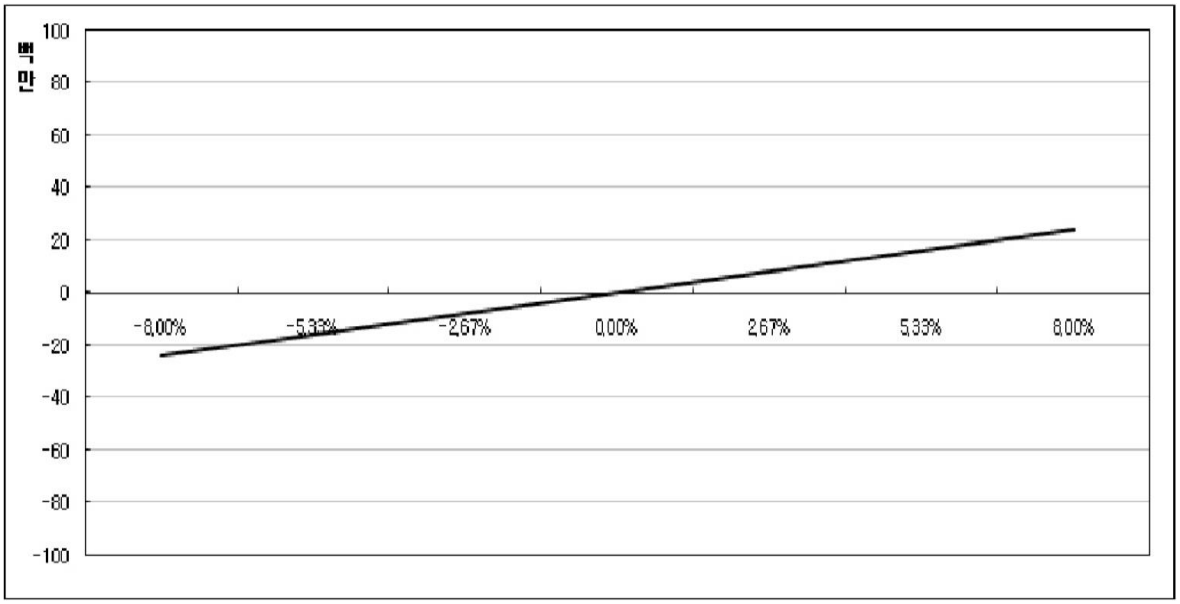
공시일: 2019-05-07

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	851	0	851	장내
합계			851	0	851	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

488

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

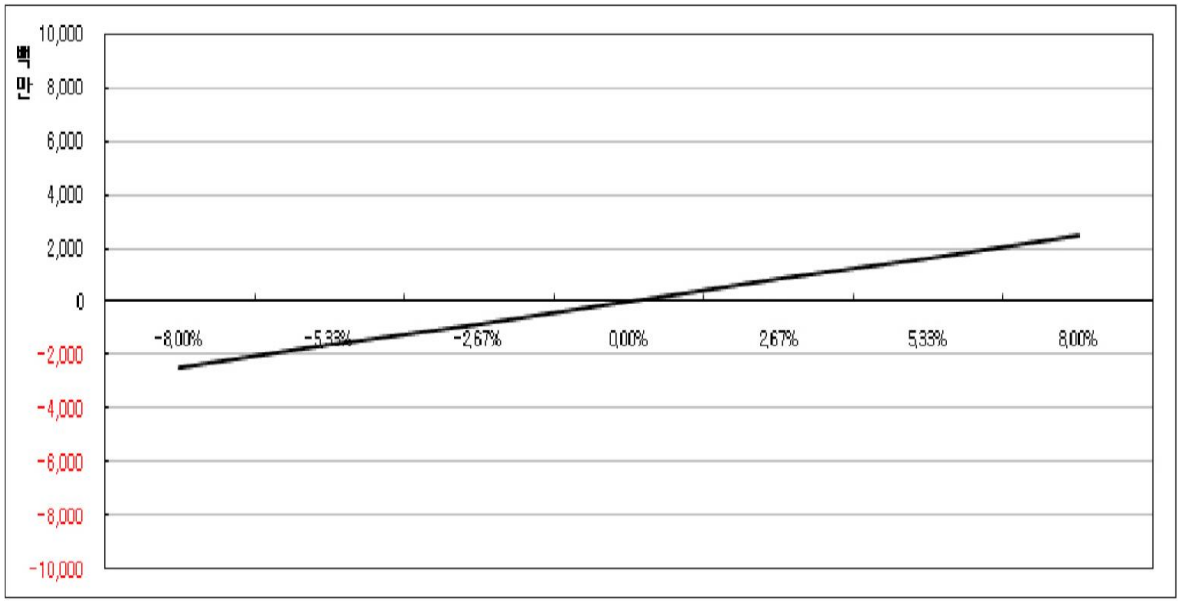
공시일: 2019-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	496	284	213	장내
누계	주가지수	선물	3,971	0	3,971	장내
합계			3,971	0	3,971	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

318

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

916

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

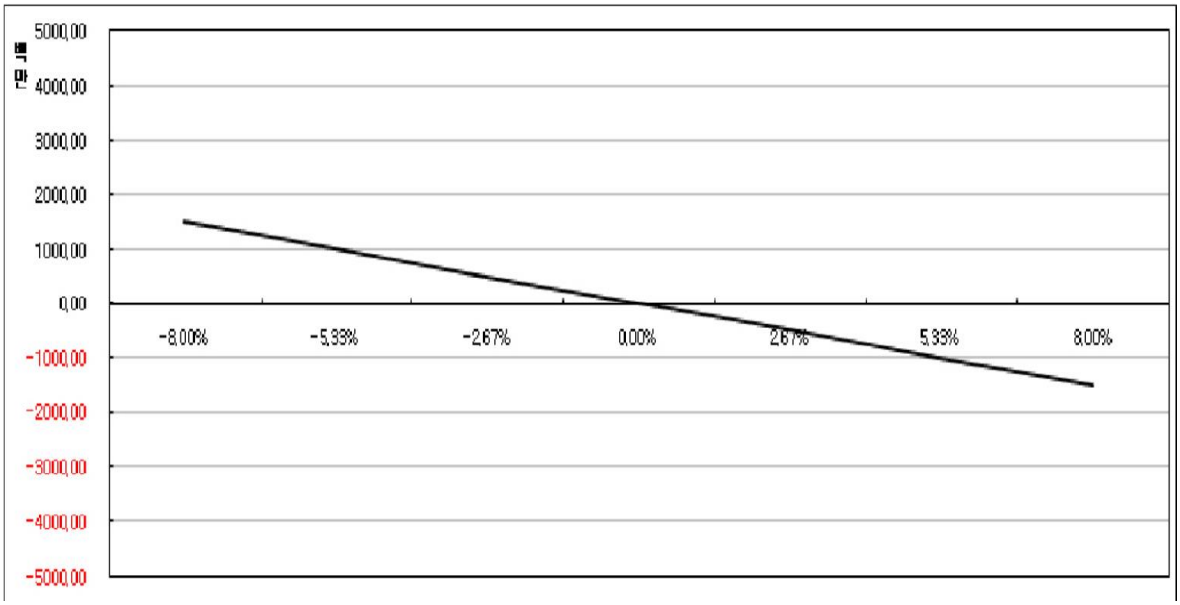
공시일: 2019-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	213	0	213	장내
누계	주가지수	선물	0	2,979	-2,979	장내
합계			0	2,979	-2,979	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

239

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

198

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

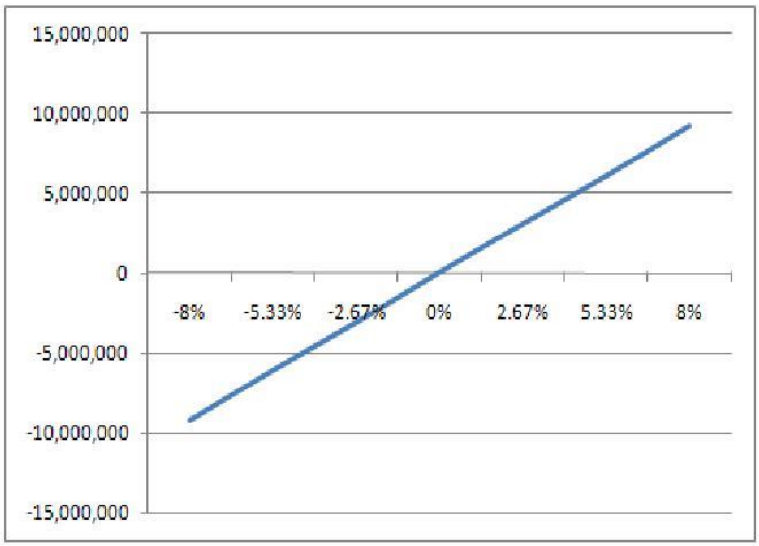
공시일: 2019-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	567	-567	장내
누계	주가지수	선물	68,506	0	68,506	장내
합계			68,506	0	68,506	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,486

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,155