펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-09

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	3,502	0	3,502	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	8	350	-342	장내
합계			3,510	350	3,160	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

31

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

405

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

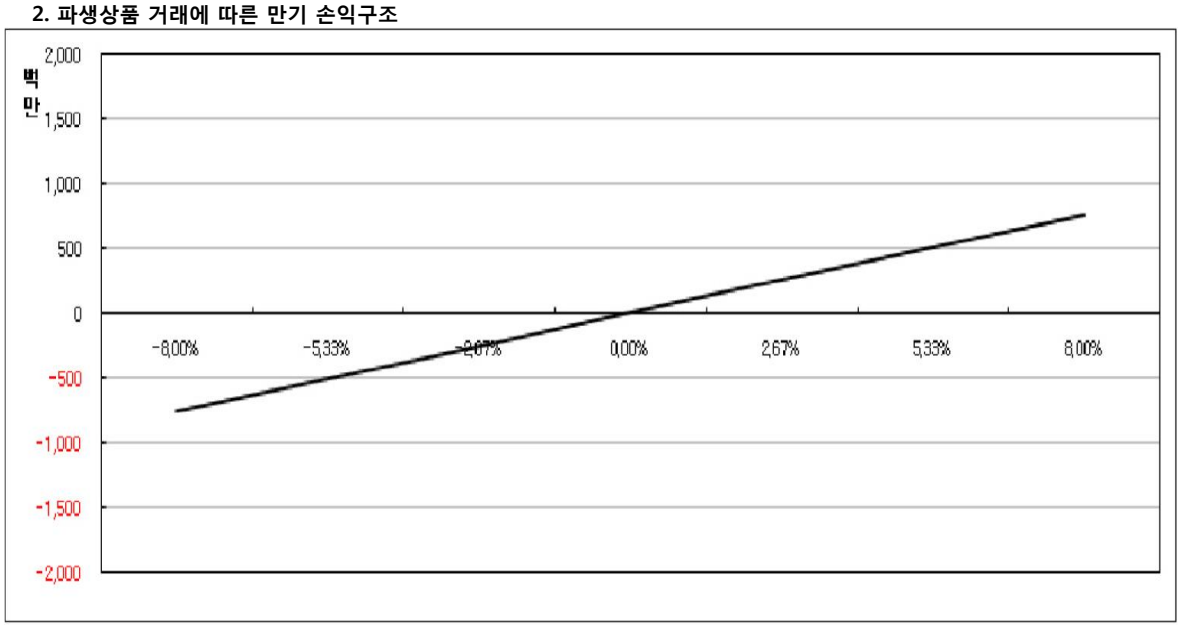
공시일: 2019-05-09

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	210	0	210	장내
합계			210	0	210	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

409

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

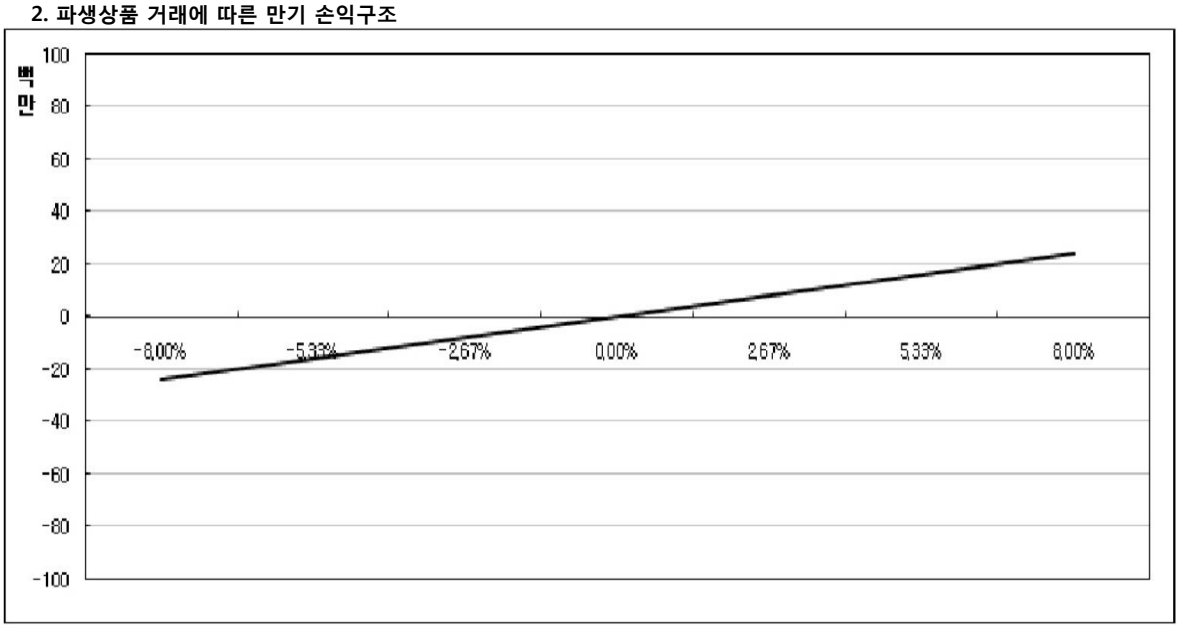
공시일: 2019-05-09

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	840	0	840	장내
합계			840	0	840	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

481

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

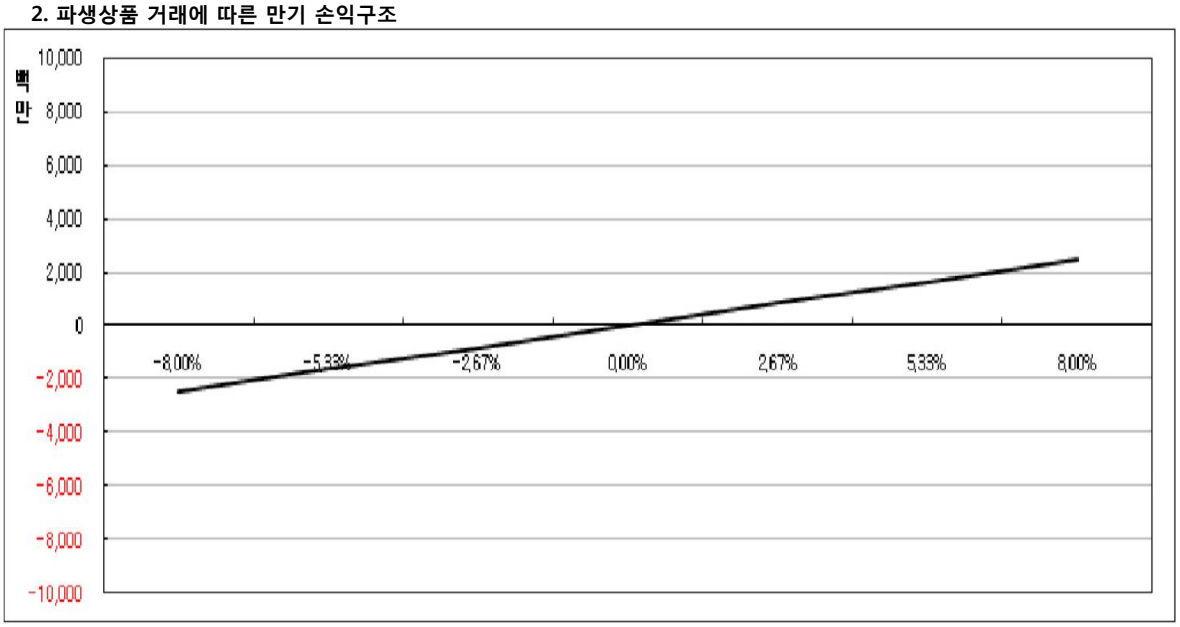
공시일: 2019-05-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	210	280	-70	장내
누계	주가지수	선물	3,992	0	3,992	장내
합계			3,992	0	3,992	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

319

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

904

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

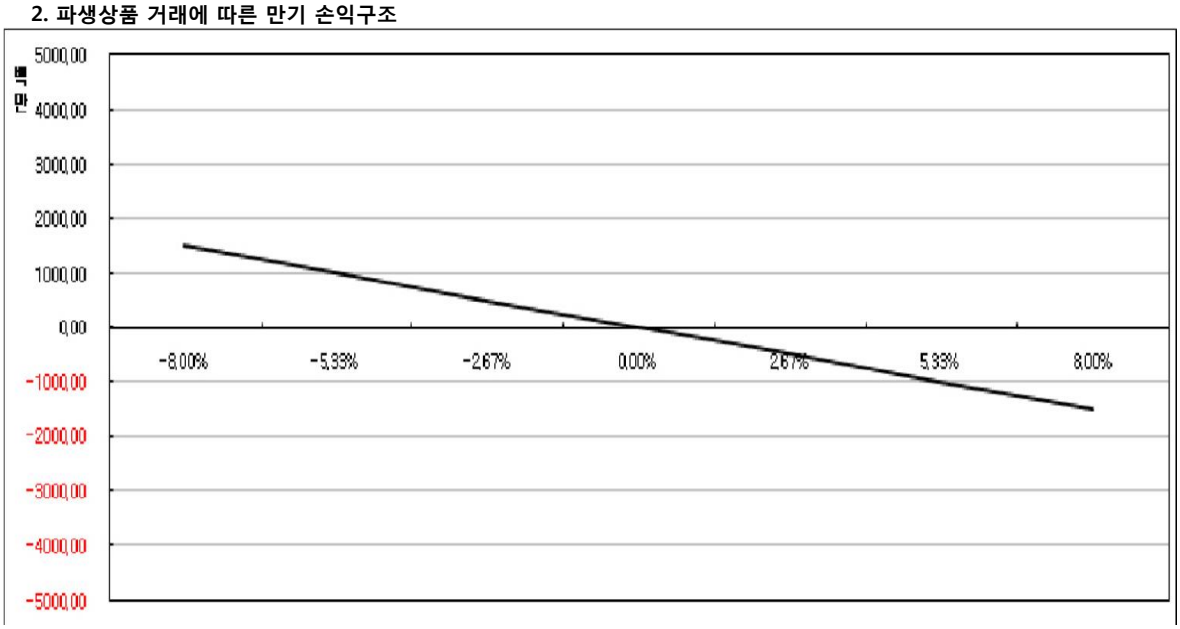
공시일: 2019-05-09

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	2,731	-2,731	장내
합계			0	2,731	-2,731	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

219

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

181

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

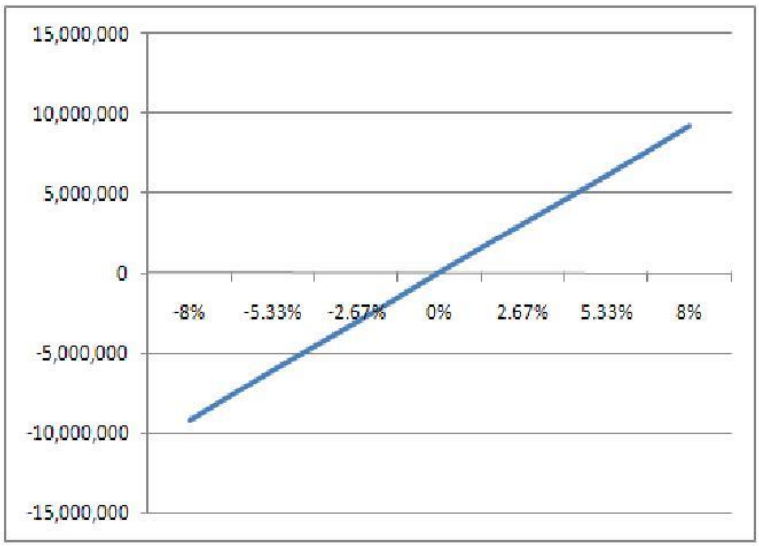
공시일: 2019-05-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	350	0	350	장내
누계	주가지수	선물	68,637	0	68,637	장내
합계			68,637	0	68,637	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,491

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,064