펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-13

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	3,401	0	3,401	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	16	6,529	-6,514	장내
합계			3,416	6,529	-3,113	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	130

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	907

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

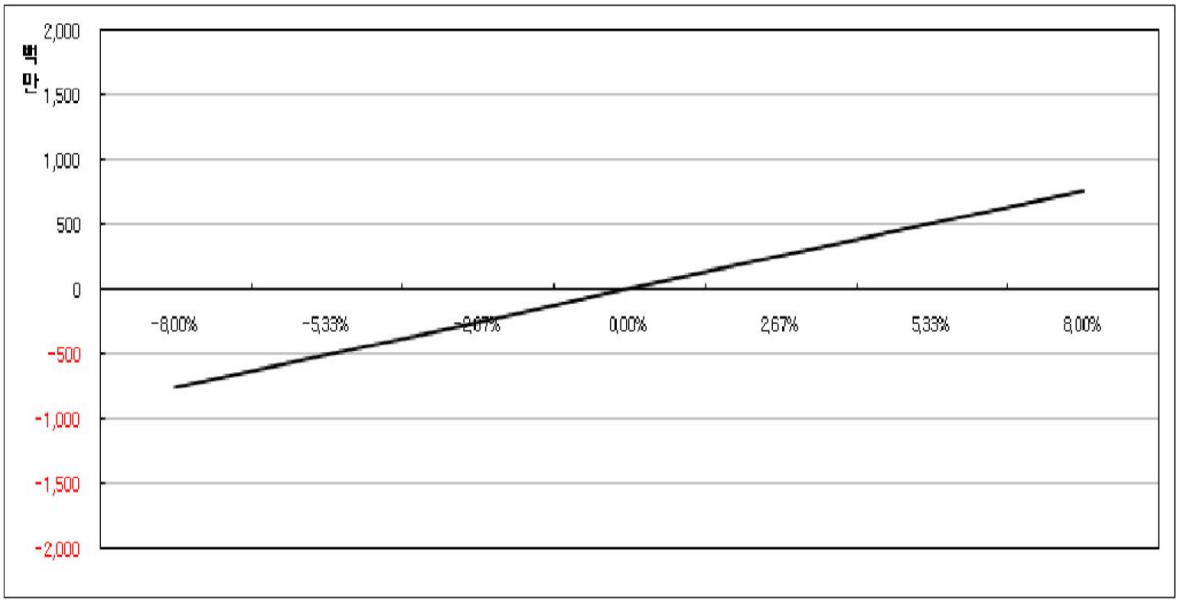
공시일: 2019-05-13

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	204	0	204	장내
합계			204	0	204	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

402

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

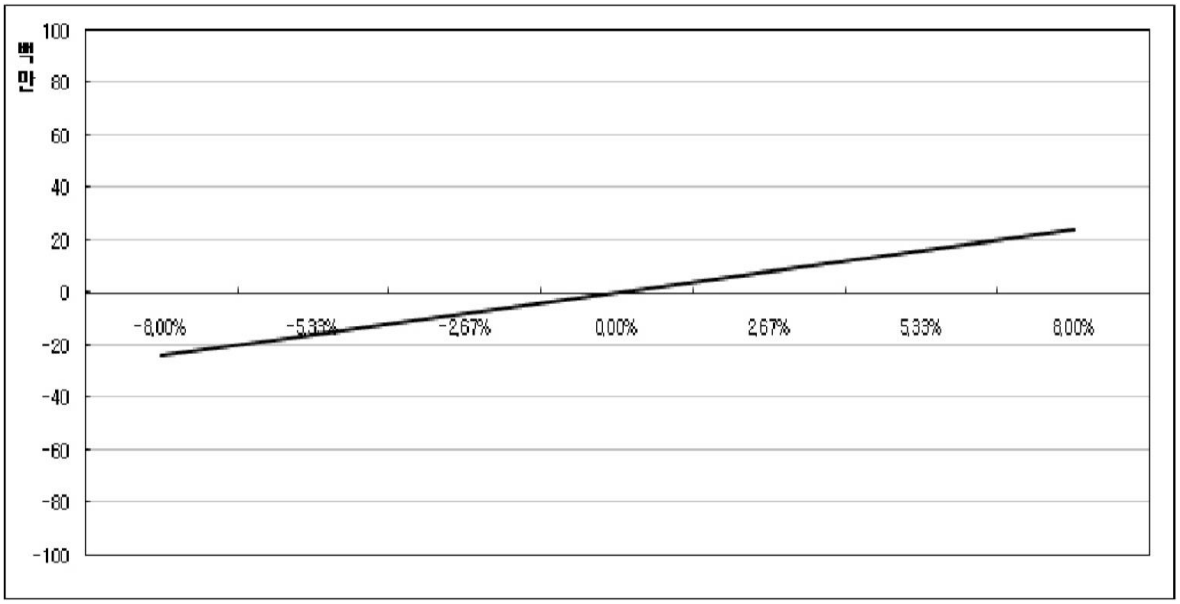
공시일: 2019-05-13

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	816	0	816	장내
합계			816	0	816	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

472

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

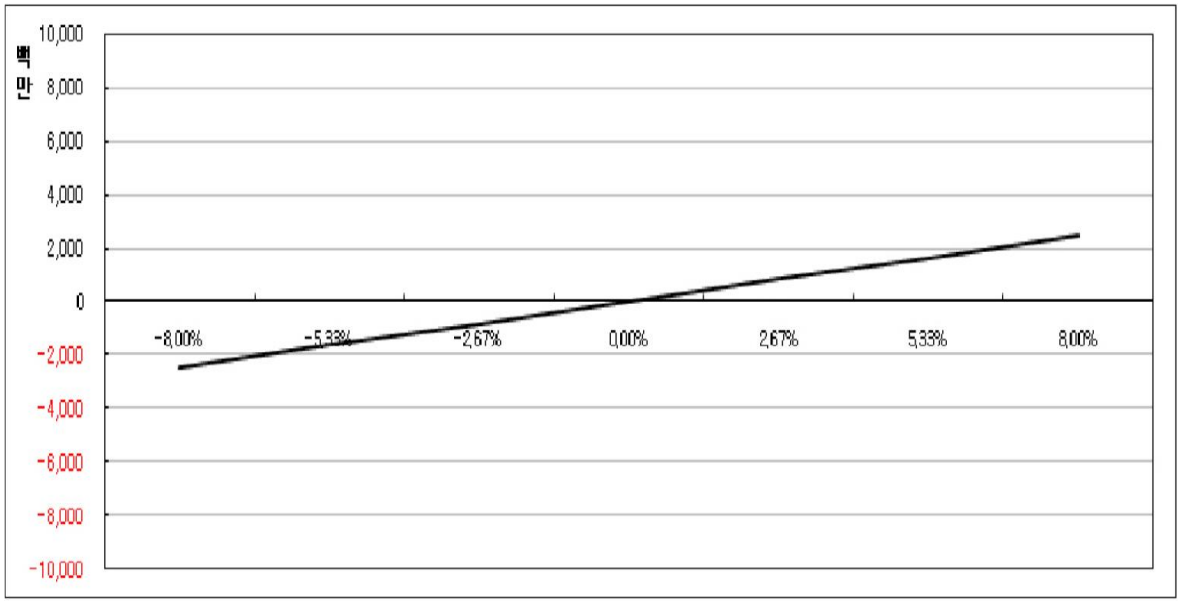
공시일: 2019-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	340	0	340	장내
누계	주가지수	선물	4,217	0	4,217	장내
합계			4,217	0	4,217	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

337

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

905

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

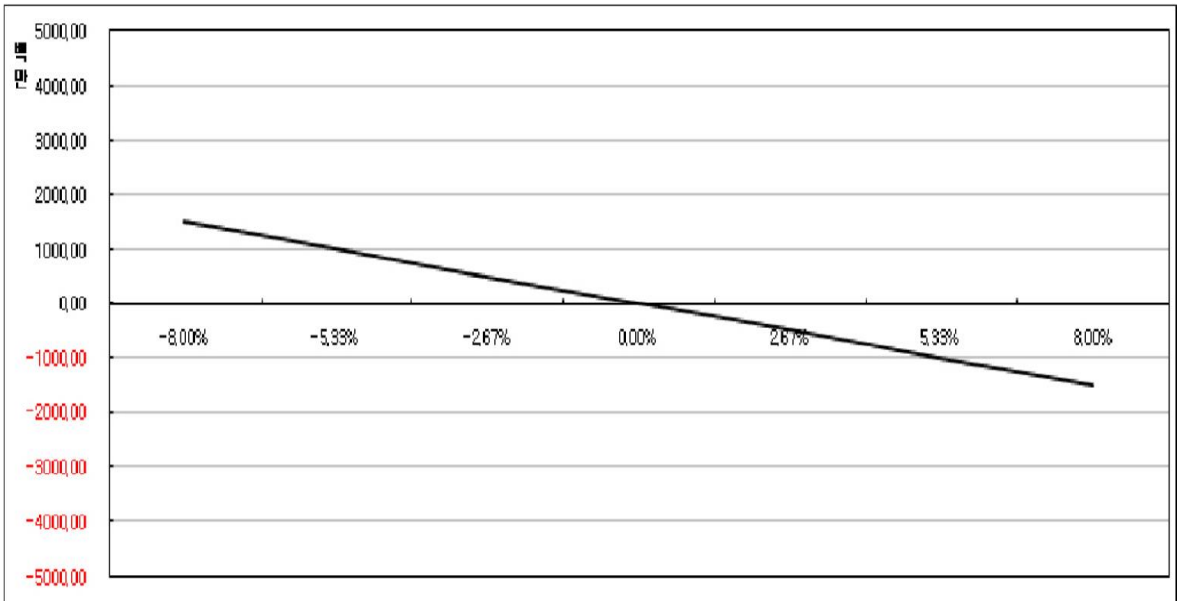
공시일: 2019-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	748	0	748	장내
누계	주가지수	선물	0	2,176	-2,176	장내
합계			0	2,176	-2,176	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

148

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

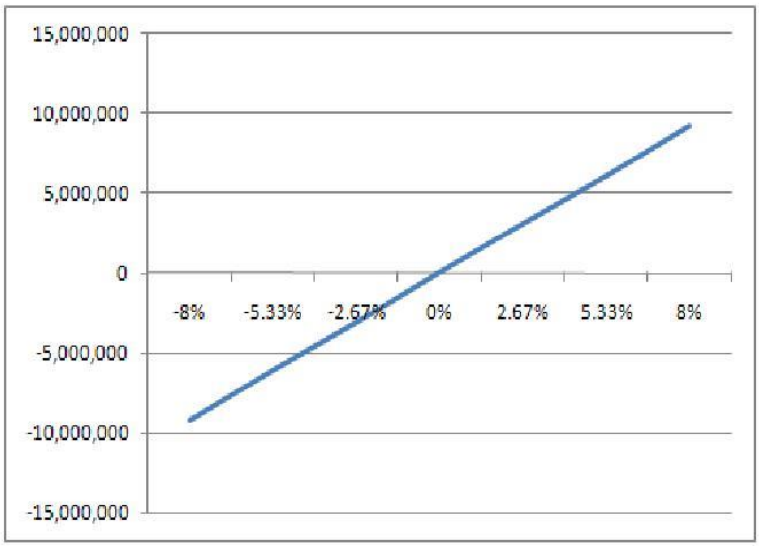
공시일: 2019-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	816	0	816	장내
누계	주가지수	선물	66,315	0	66,315	장내
합계			66,315	0	66,315	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,303

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,915