펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-15

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	3,357	0	3,357	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	19	6,446	-6,427	장내
합계			3,376	6,446	-3,070	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	152

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	419

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

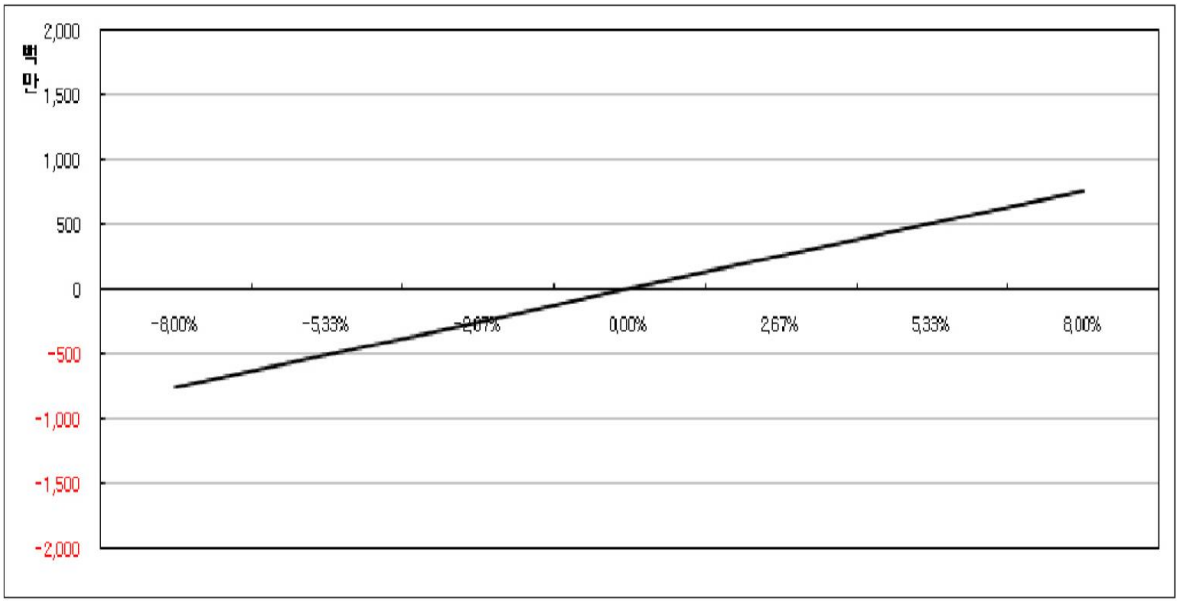
공시일: 2019-05-15

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	201	0	201	장내
합계			201	0	201	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	398

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

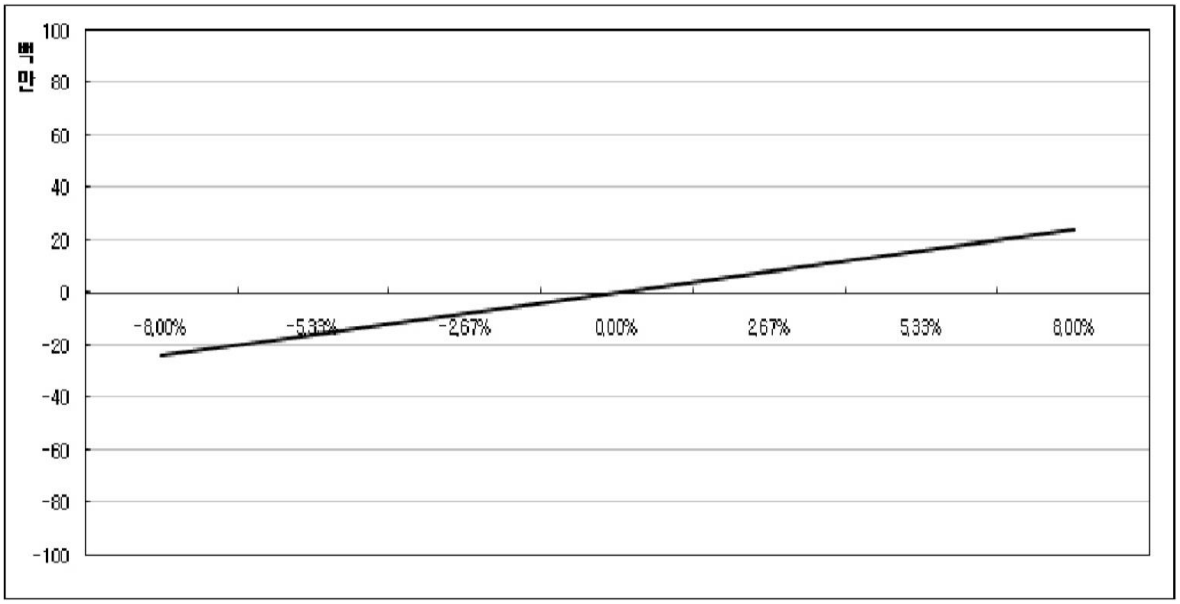
공시일: 2019-05-15

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	806	0	806	장내
합계			806	0	806	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

468

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

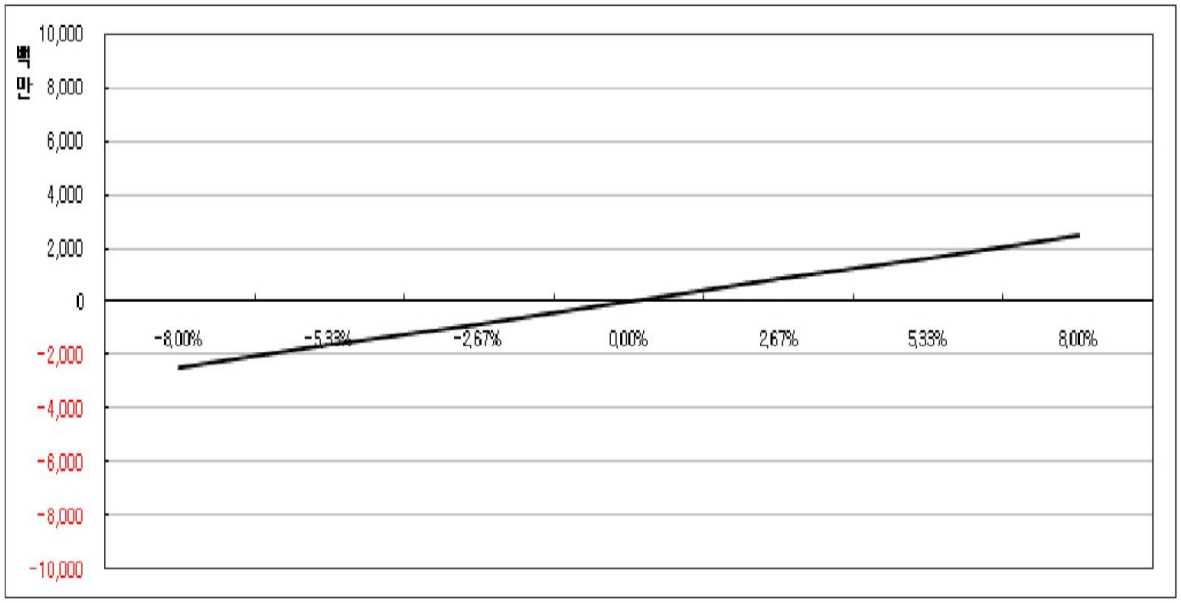
공시일: 2019-05-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	0	134	장내
누계	주가지수	선물	4,700	0	4,700	장내
합계			4,700	0	4,700	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

376

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

921

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

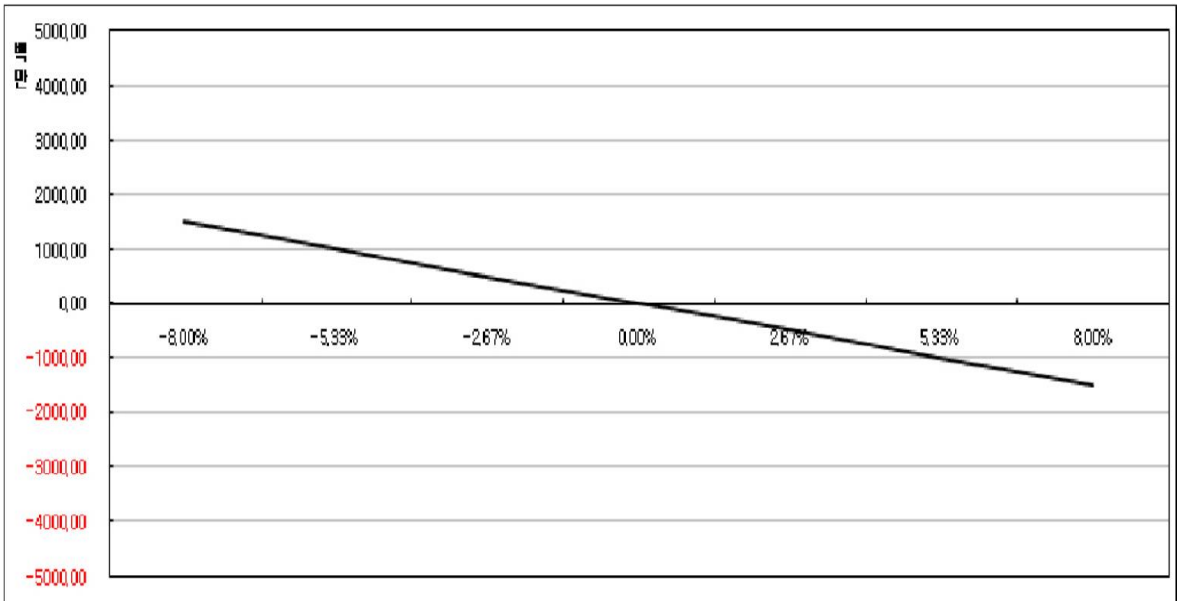
공시일: 2019-05-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	336	403	-67	장내
누계	주가지수	선물	0	2,216	-2,216	장내
합계			0	2,216	-2,216	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

177

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

151

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

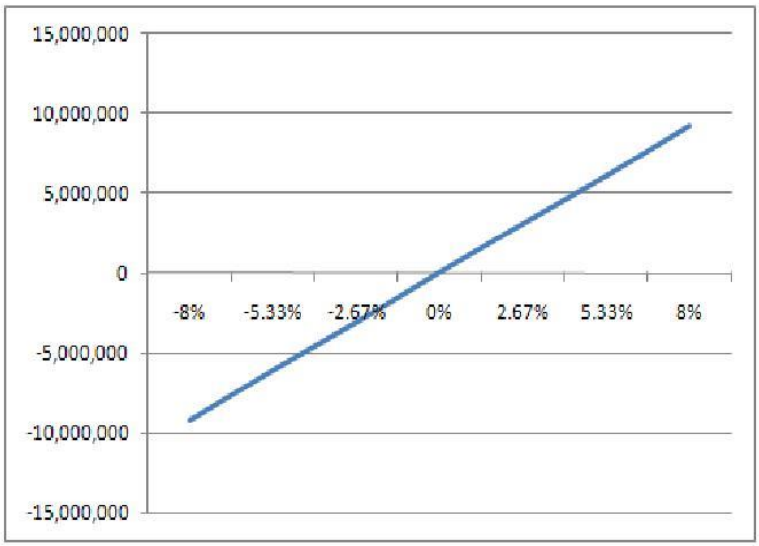
공시일: 2019-05-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	873	0	873	장내
누계	주가지수	선물	67,008	0	67,008	장내
합계			67,008	0	67,008	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,362

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,905