펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-23

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	3,333	0	3,333	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	16	6,400	-6,384	장내
합계			3,349	6,400	-3,051	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	163

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	303

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

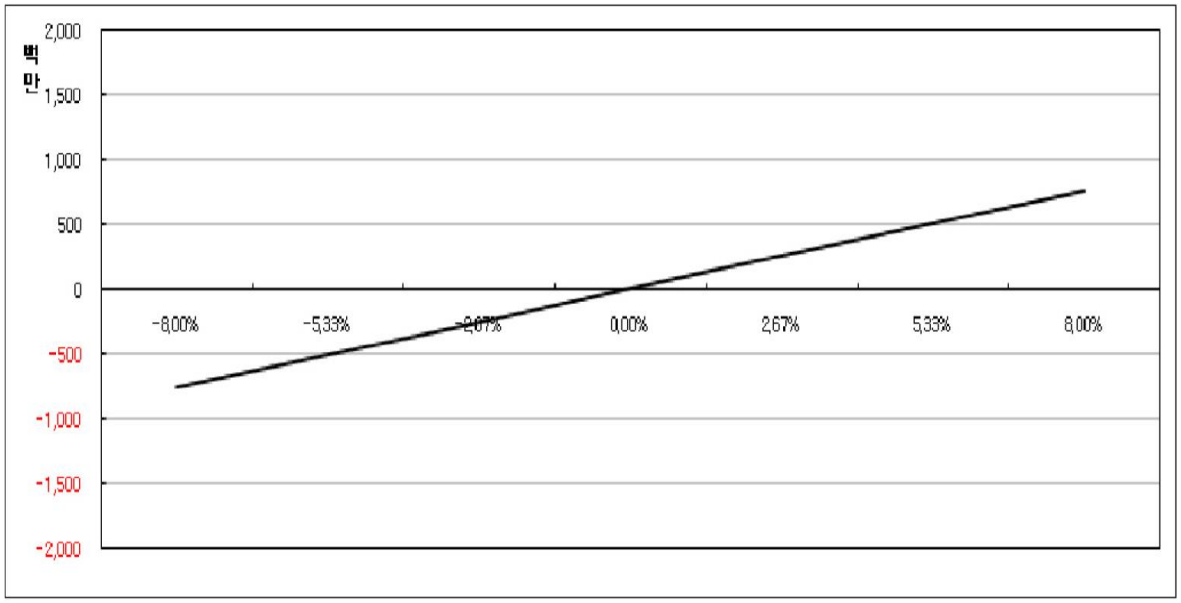
공시일: 2019-05-23

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	200	0	200	장내
합계			200	0	200	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

393

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

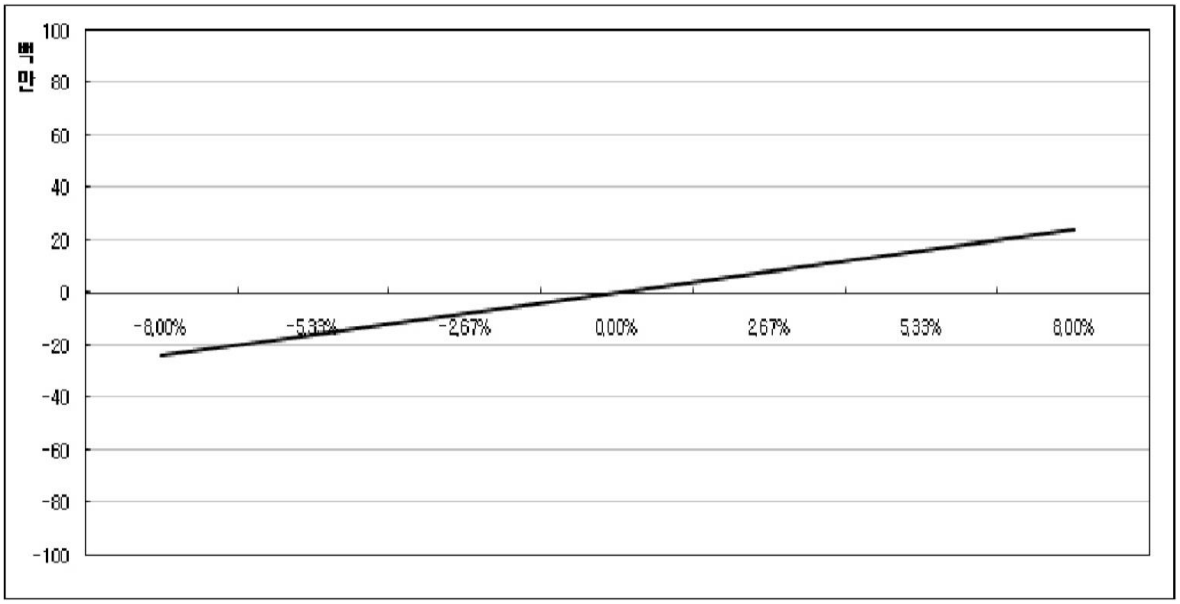
공시일: 2019-05-23

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	800	0	800	장내
합계			800	0	800	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 463

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

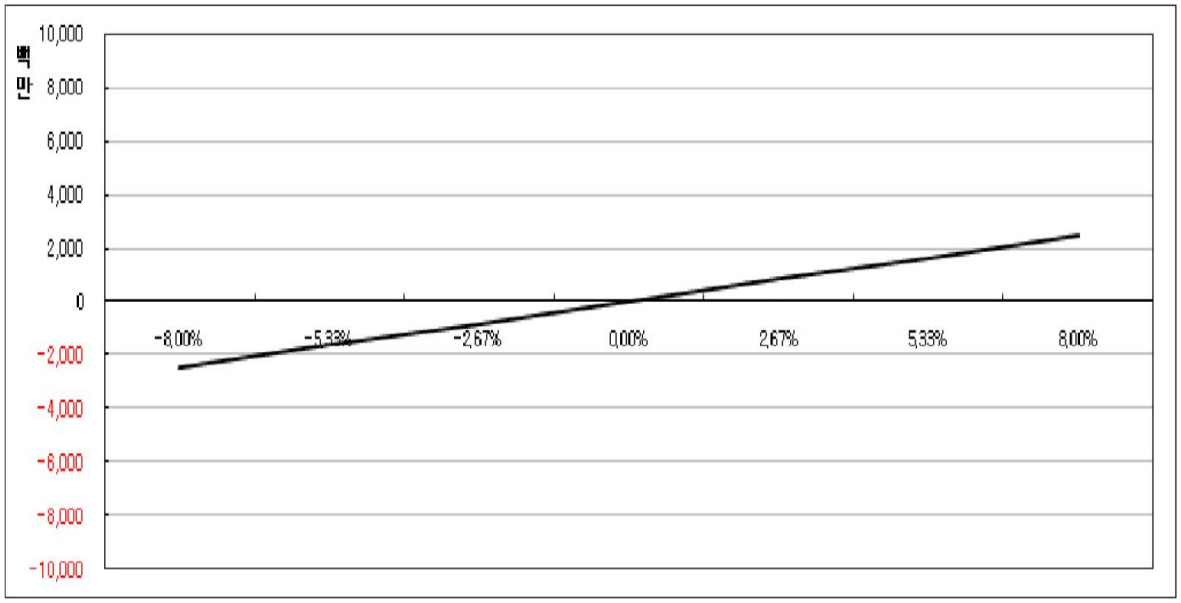
공시일: 2019-05-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	267	-267	장내
누계	주가지수	선물	4,933	0	4,933	장내
합계			4,933	0	4,933	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

395

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

927

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

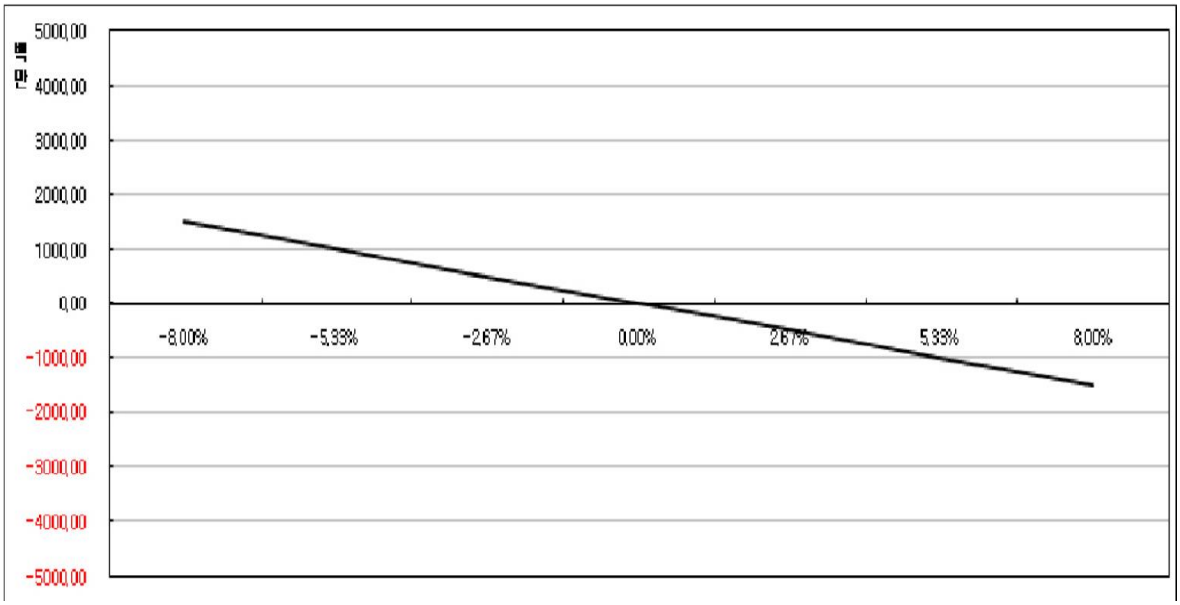
공시일: 2019-05-23

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	2,333	-2,333	장내
합계			0	2,333	-2,333	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

187

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

160

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

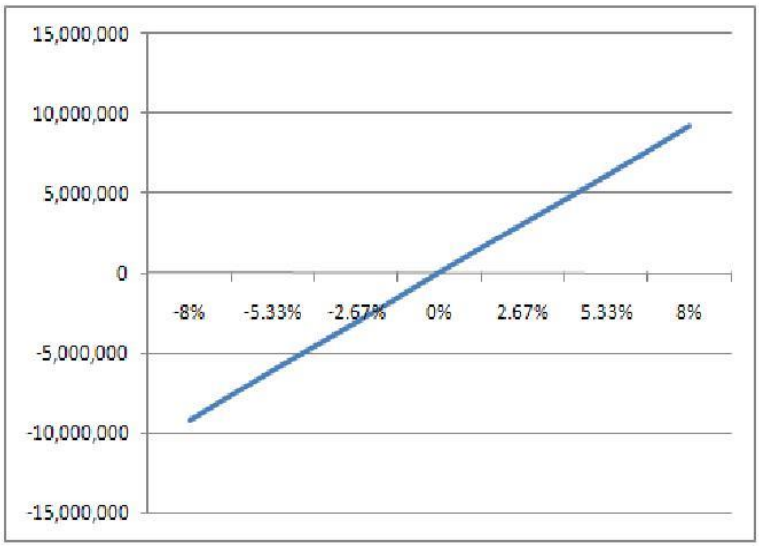
공시일: 2019-05-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	333	0	333	장내
누계	주가지수	선물	68,262	0	68,262	장내
합계			68,262	0	68,262	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,472

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,948