펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-27

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	3,305	0	3,305	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	20	6,346	-6,326	장내
합계			3,325	6,346	-3,021	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

164

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

316

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

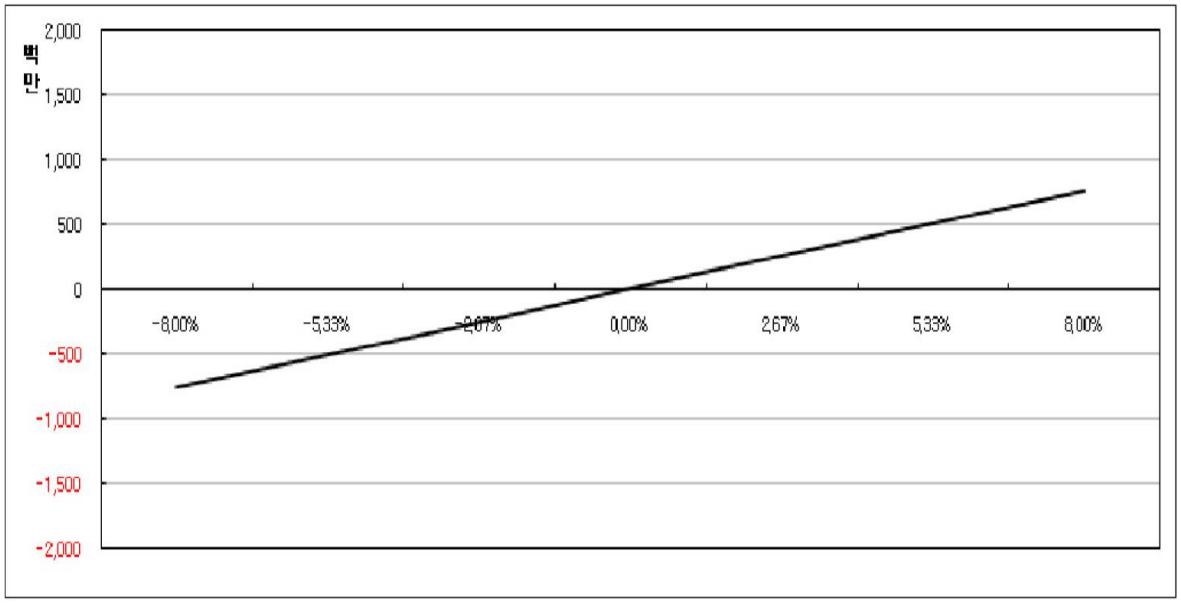
공시일: 2019-05-27

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	198	0	198	장내
합계			198	0	198	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

388

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

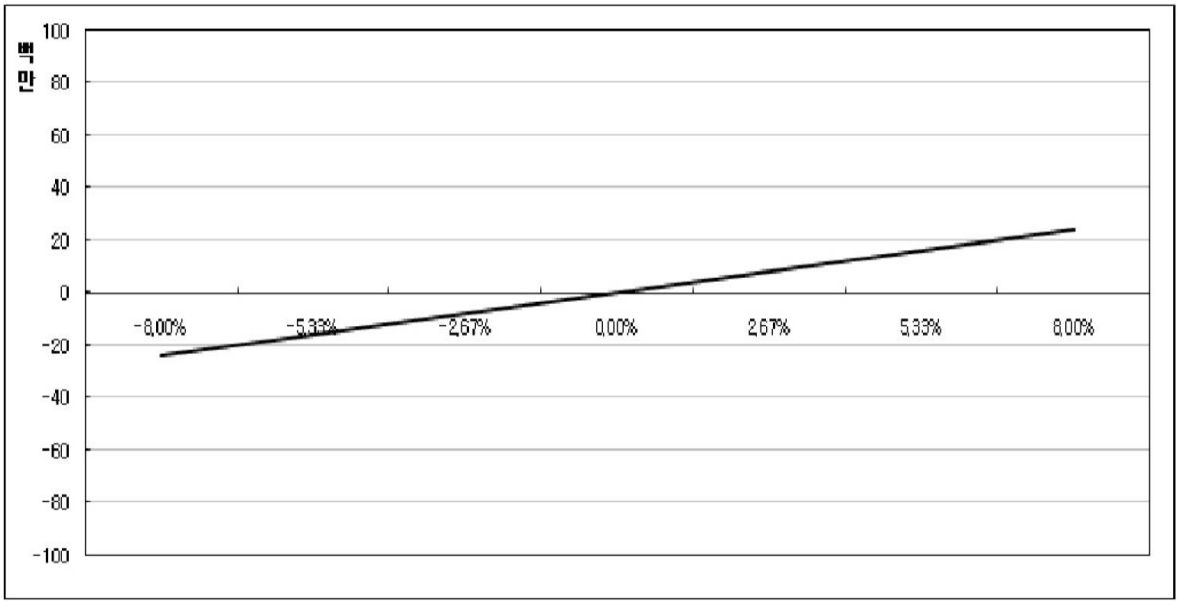
공시일: 2019-05-27

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	793	0	793	장내
합계			793	0	793	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 458

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

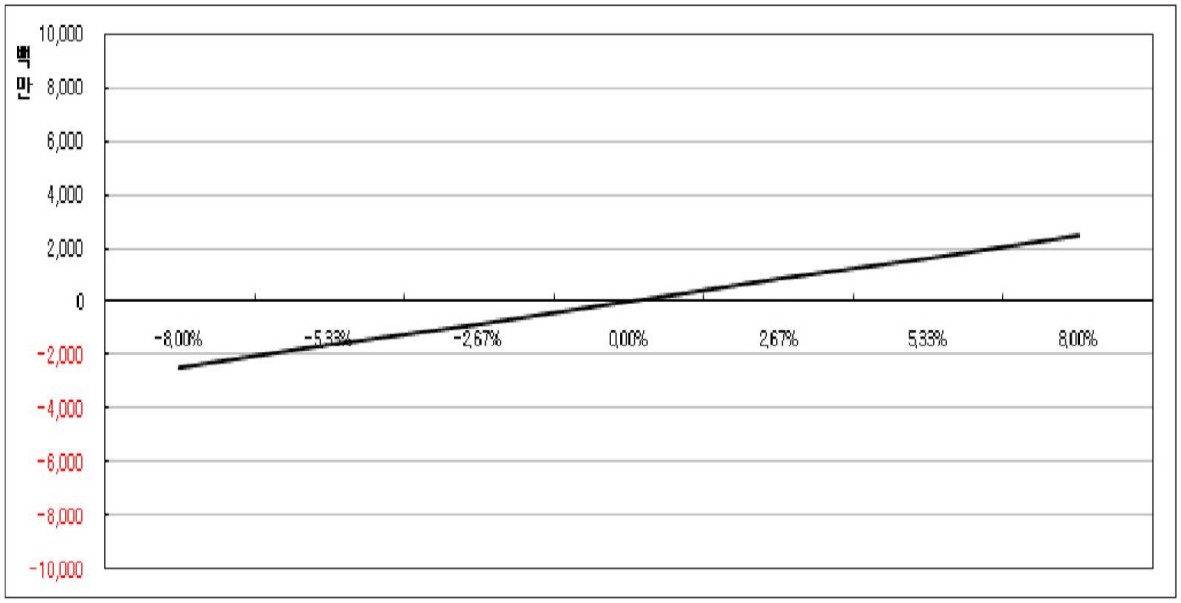
공시일: 2019-05-27

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	4,892	0	4,892	장내
합계			4,892	0	4,892	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

392

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

915

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

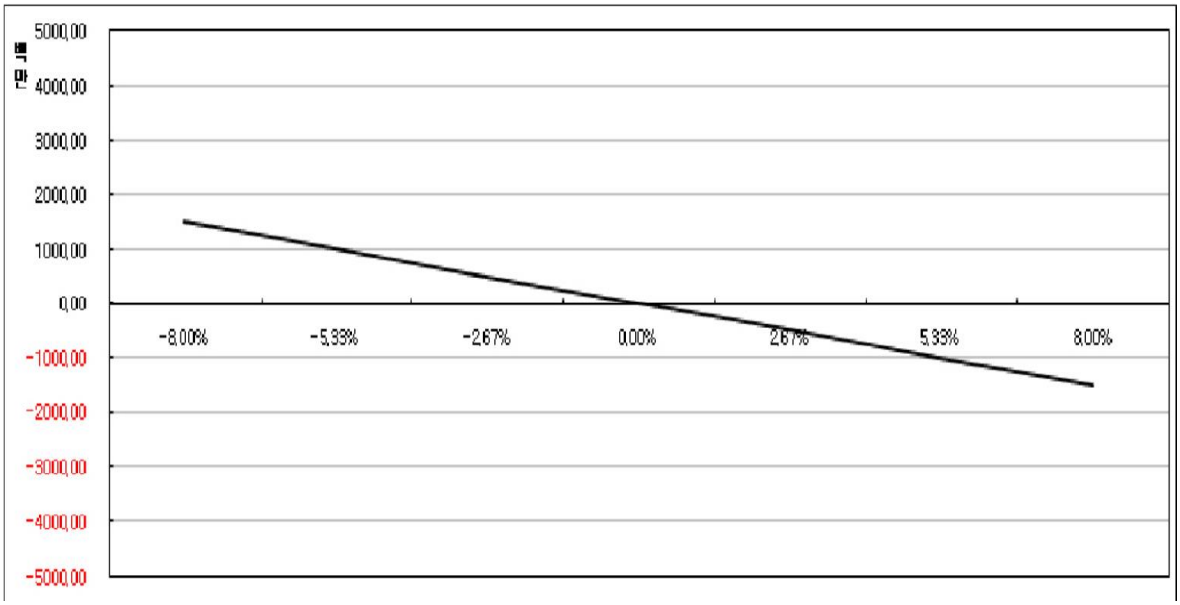
공시일: 2019-05-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	132	331	-198	장내
누계	주가지수	선물	0	2,512	-2,512	장내
합계			0	2,512	-2,512	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

201

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

172

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

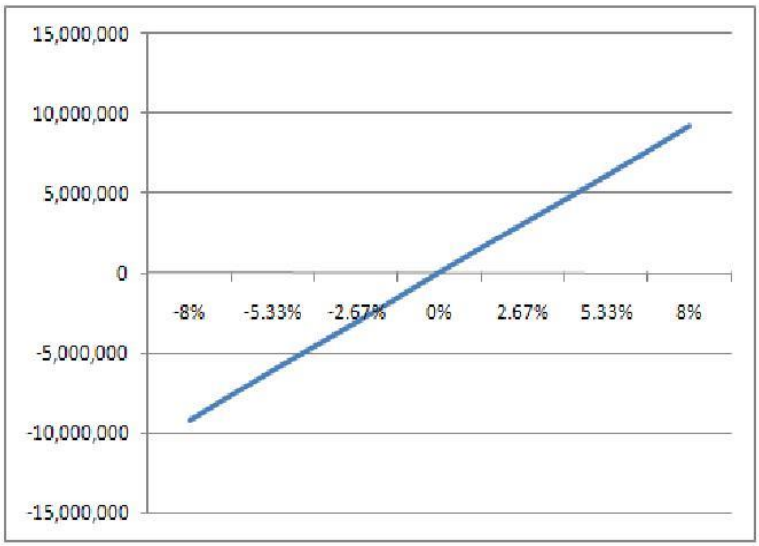
공시일: 2019-05-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	397	-397	장내
누계	주가지수	선물	67,493	0	67,493	장내
합계			67,493	0	67,493	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,410

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,838