펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-01

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	3,122	0	3,122	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	6,244	-6,242	장내
합계			3,124	6,244	-3,120	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	218

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	642

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

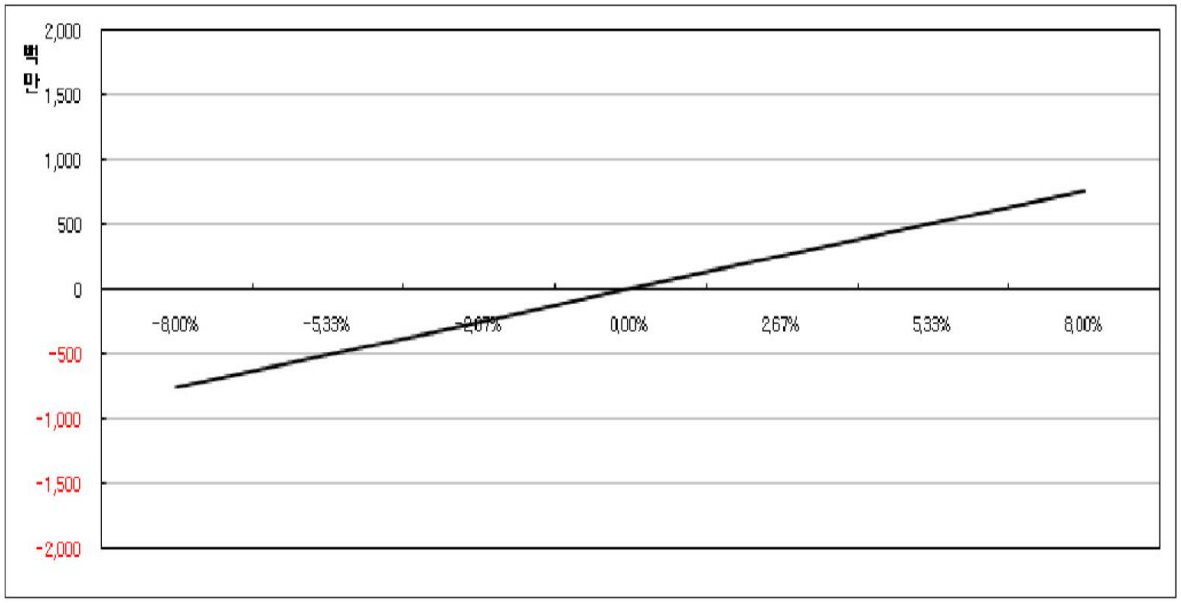
공시일: 2019-07-01

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	139	0	139	장내
합계			139	0	139	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	401

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

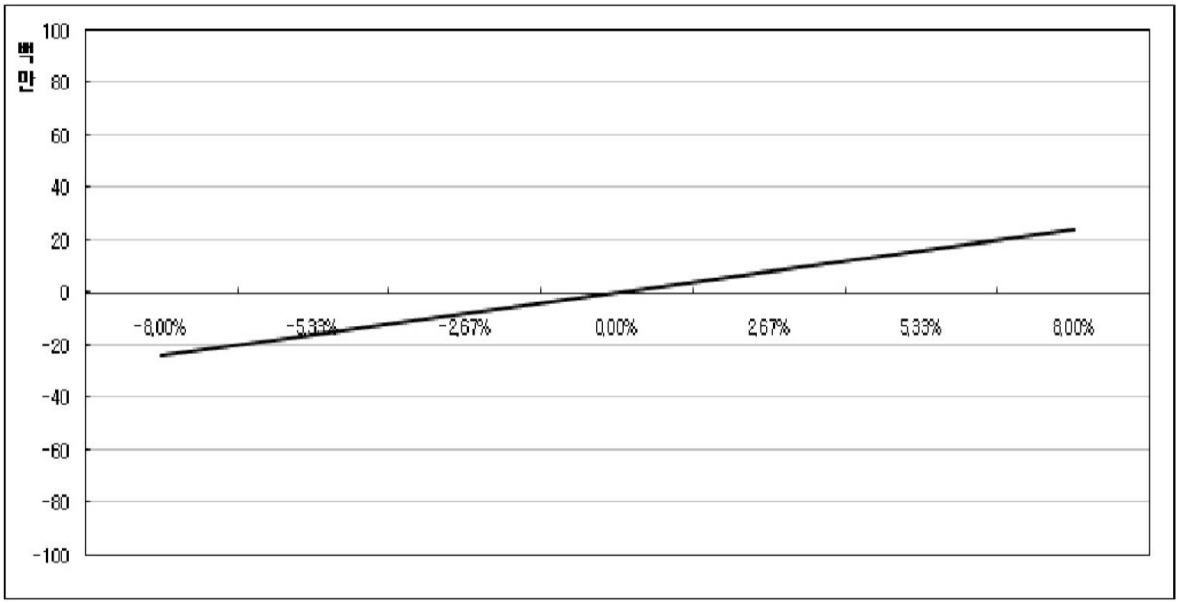
공시일: 2019-07-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	69	0	69	장내
누계	주가지수	선물	902	0	902	장내
합계			902	0	902	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

479

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

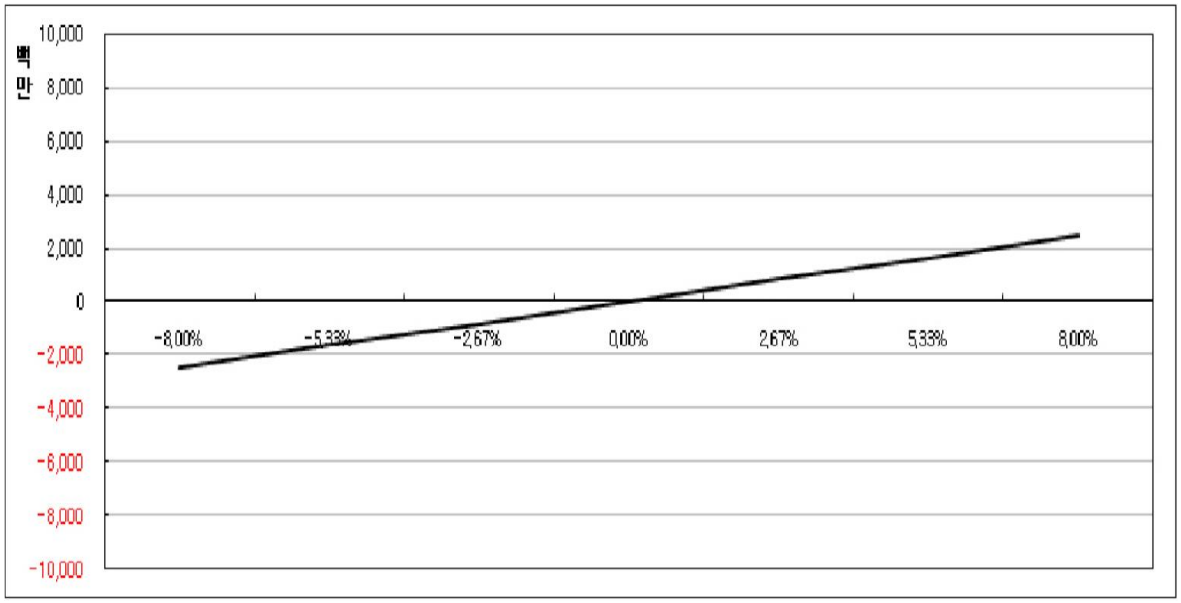
공시일: 2019-07-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	278	0	278	장내
누계	주가지수	선물	4,995	0	4,995	장내
합계			4,995	0	4,995	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

401

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

945

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

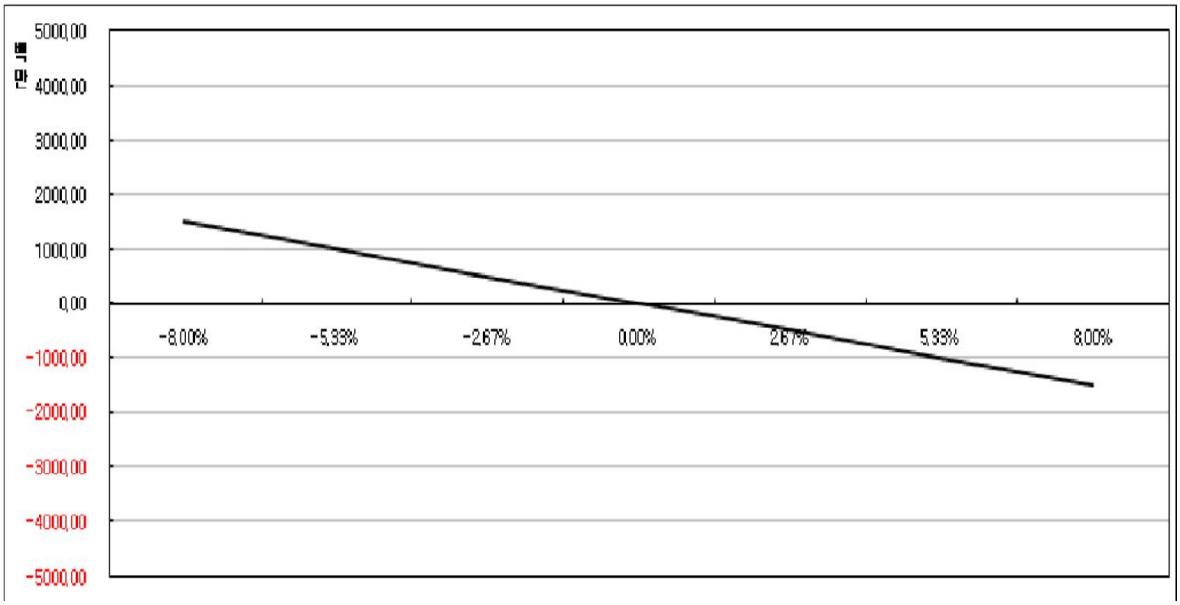
공시일: 2019-07-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	139	69	69	장내
누계	주가지수	선물	0	2,012	-2,012	장내
합계			0	2,012	-2,012	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

161

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

134

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

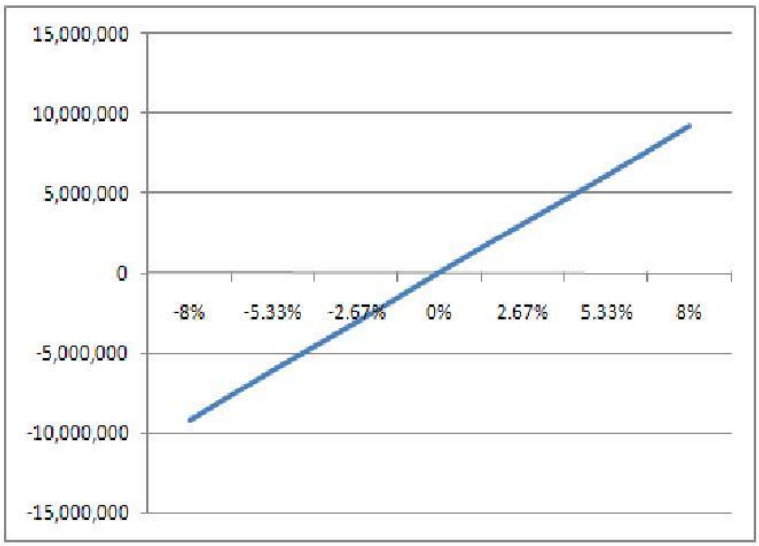
공시일: 2019-07-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	763	-763	장내
누계	주가지수	선물	72,844	0	72,844	장내
합계			72,844	0	72,844	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,846

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,223