펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-10

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	3,012	0	3,012	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	3,012	-3,008	장내
합계			3,015	3,012	4	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	97

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	341

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

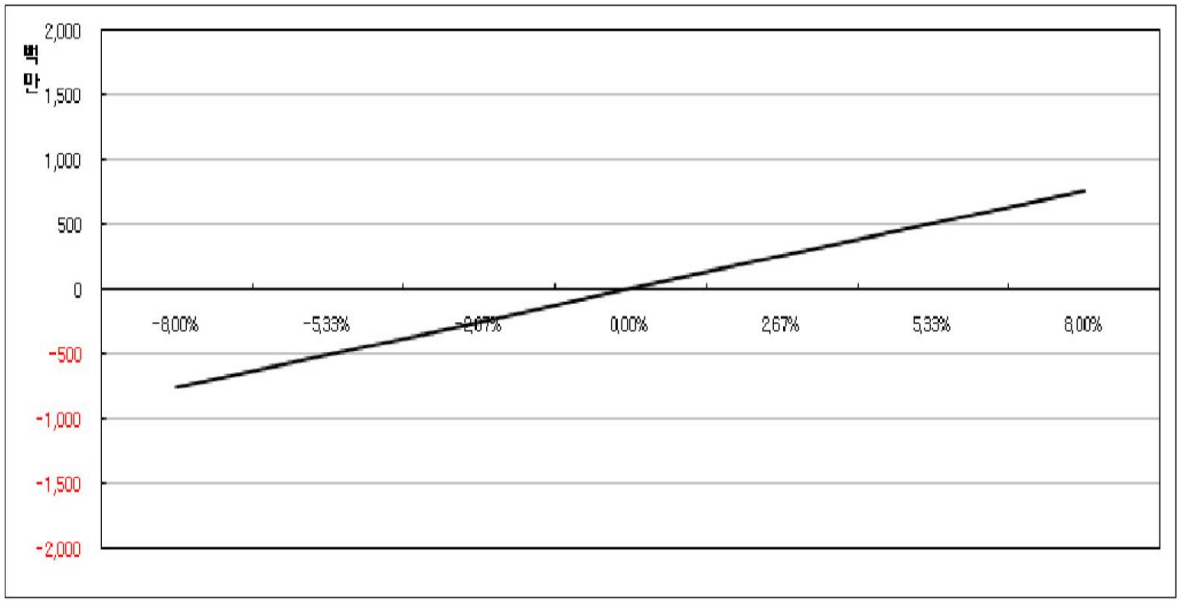
공시일: 2019-07-10

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	134	0	134	장내
합계			134	0	134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

387

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

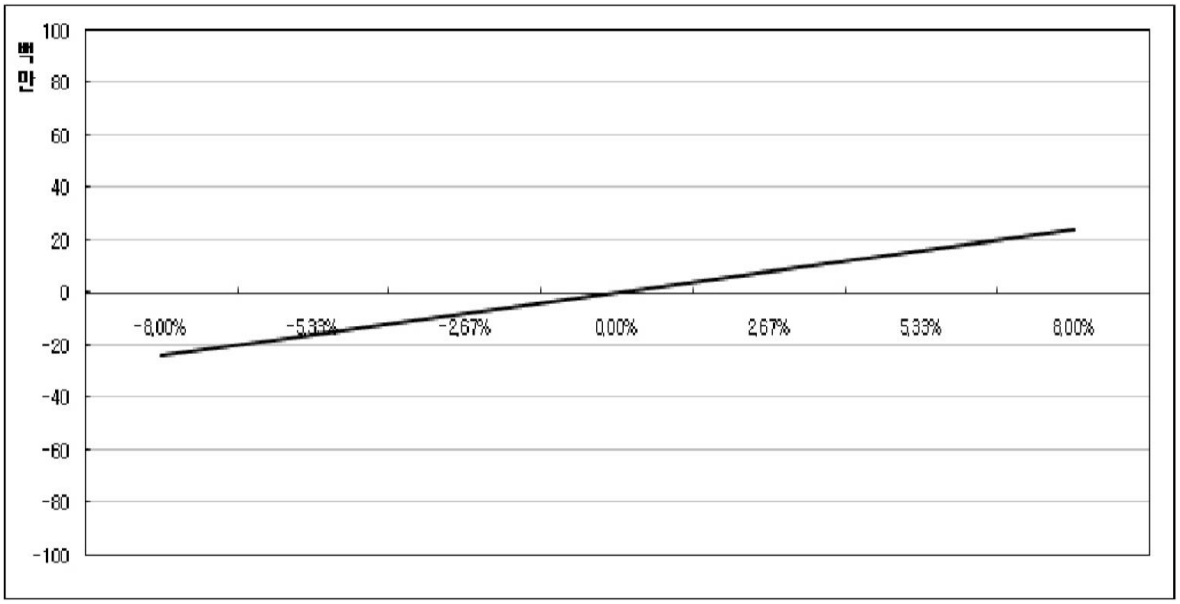
공시일: 2019-07-10

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	870	0	870	장내
합계			870	0	870	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 70

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 463

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

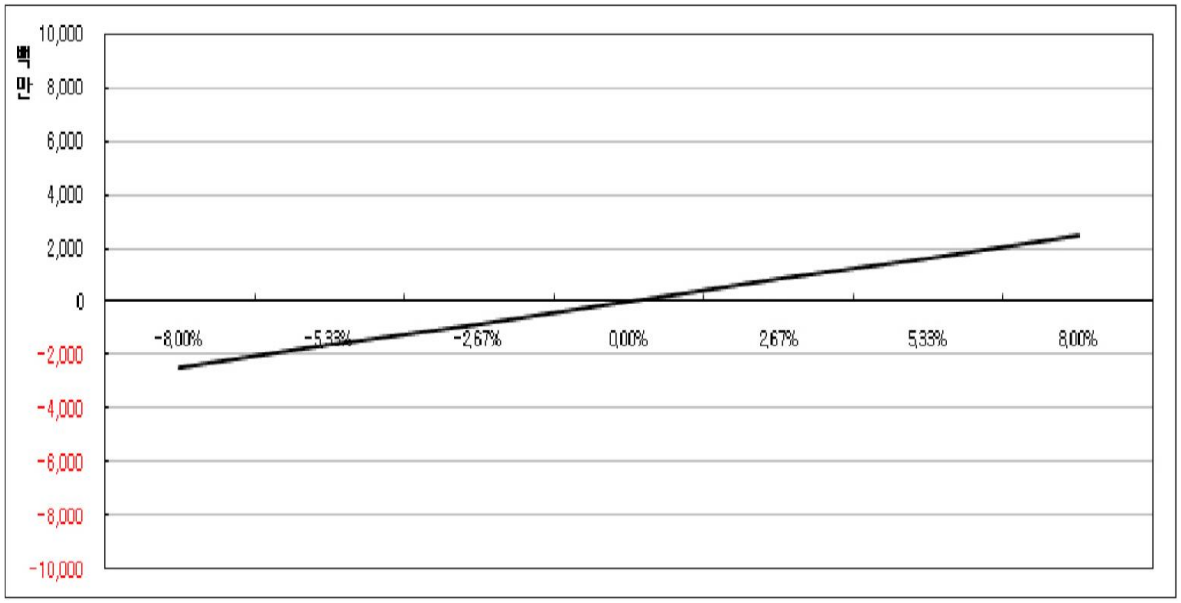
공시일: 2019-07-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	67	-67	장내
누계	주가지수	선물	4,752	0	4,752	장내
합계			4,752	0	4,752	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

381

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

913

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

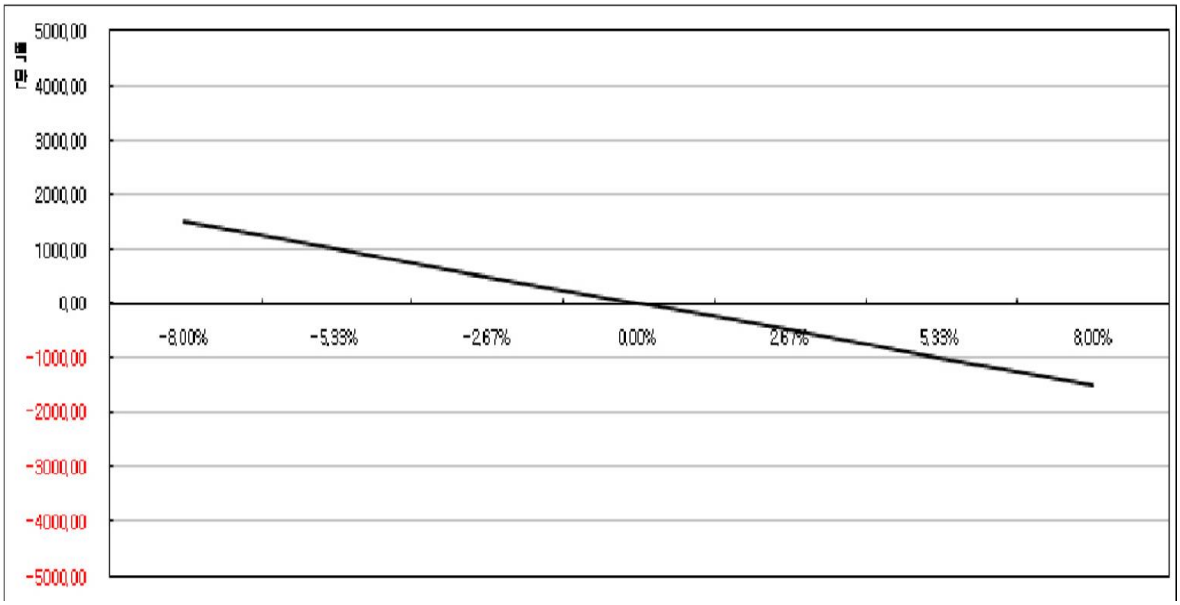
공시일: 2019-07-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	67	268	-201	장내
누계	주가지수	선물	0	2,276	-2,276	장내
합계			0	2,276	-2,276	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	182

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	153

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

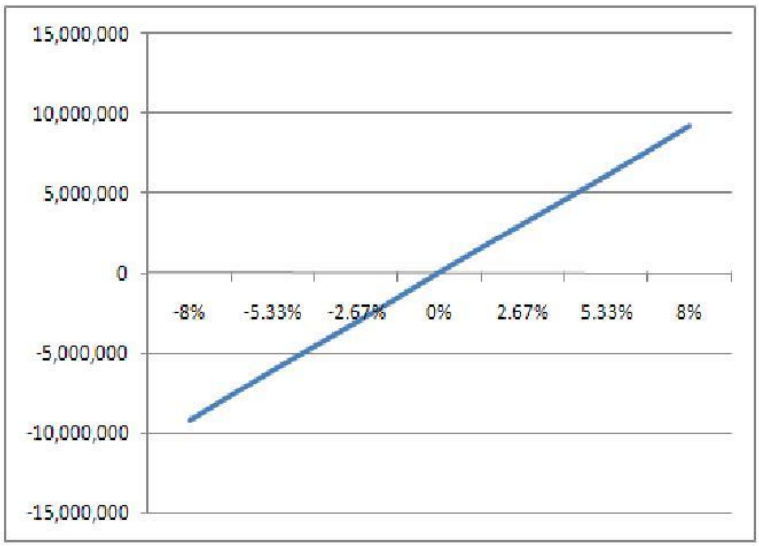
공시일: 2019-07-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	268	0	268	장내
누계	주가지수	선물	68,804	0	68,804	장내
합계			68,804	0	68,804	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,510

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,886