펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-17

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	3,083	0	3,083	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	6,166	-6,160	장내
합계			3,089	6,166	-3,077	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	177

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	526

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

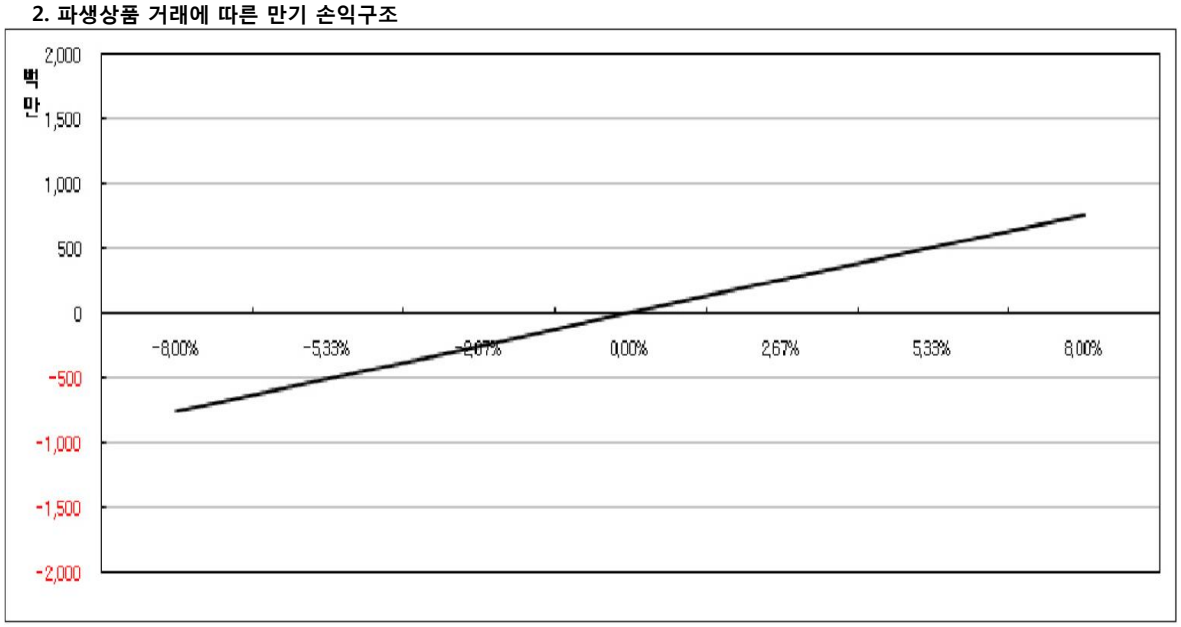
공시일: 2019-07-17

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	137	0	137	장내
합계			137	0	137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	396

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

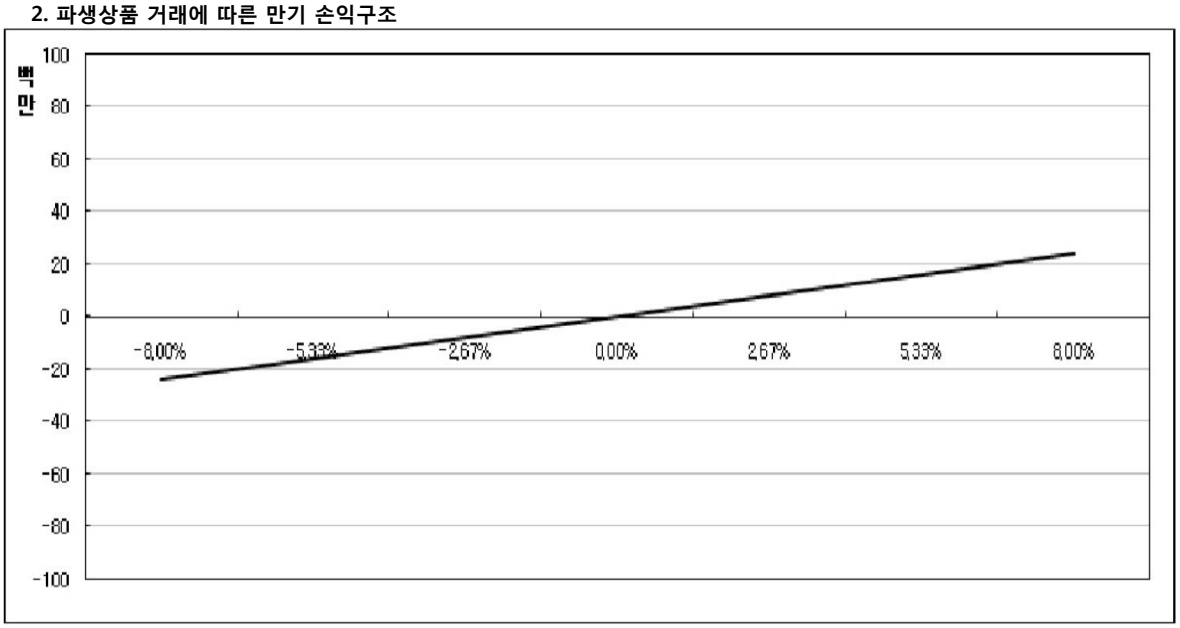
공시일: 2019-07-17

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	891	0	891	장내
합계			891	0	891	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

71

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

474

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

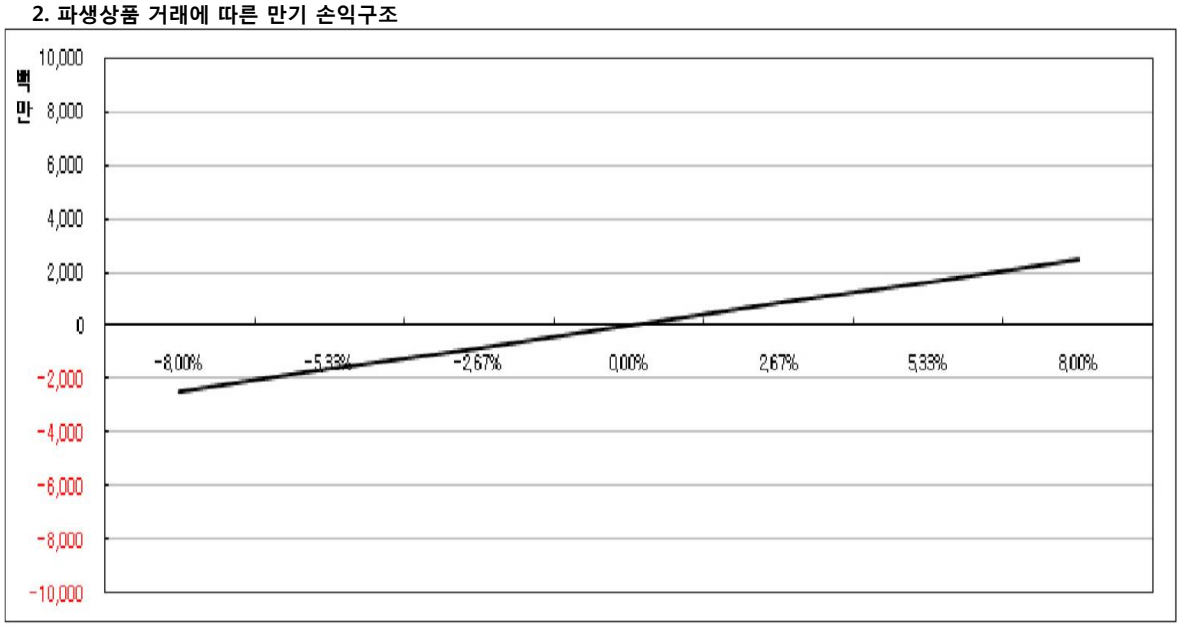
공시일: 2019-07-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	137	-137	장내
누계	주가지수	선물	4,659	0	4,659	장내
합계			4,659	0	4,659	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

374

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

924

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

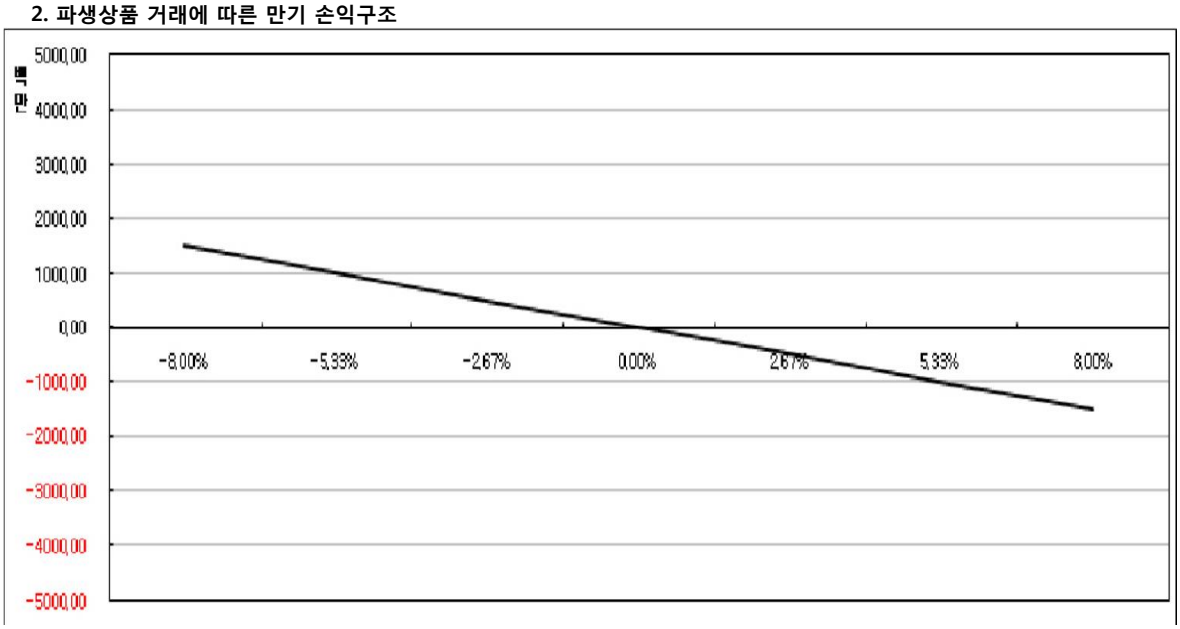
공시일: 2019-07-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	206	343	-137	장내
누계	주가지수	선물	0	2,124	-2,124	장내
합계			0	2,124	-2,124	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

170

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

143

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

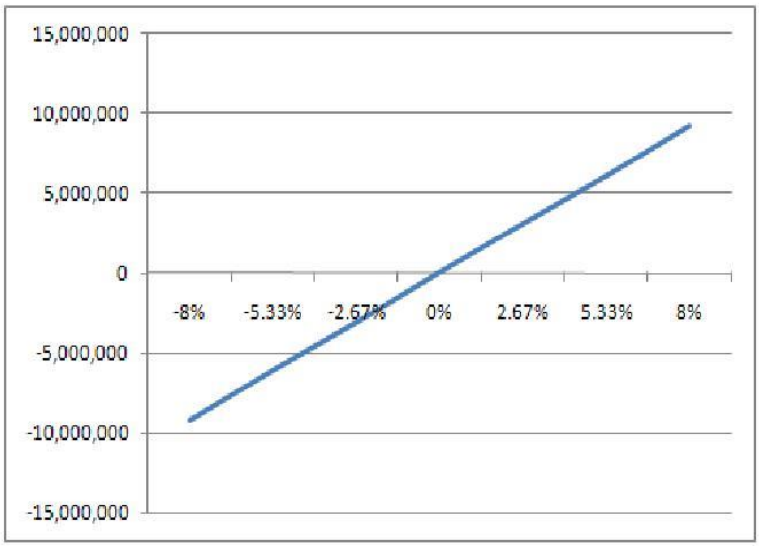
공시일: 2019-07-17

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	71,527	0	71,527	장내
합계			71,527	0	71,527	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,736

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,148