펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-25

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	3,074	0	3,074	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	6,147	-6,142	장내
합계			3,079	6,147	-3,068	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	168

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	324

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

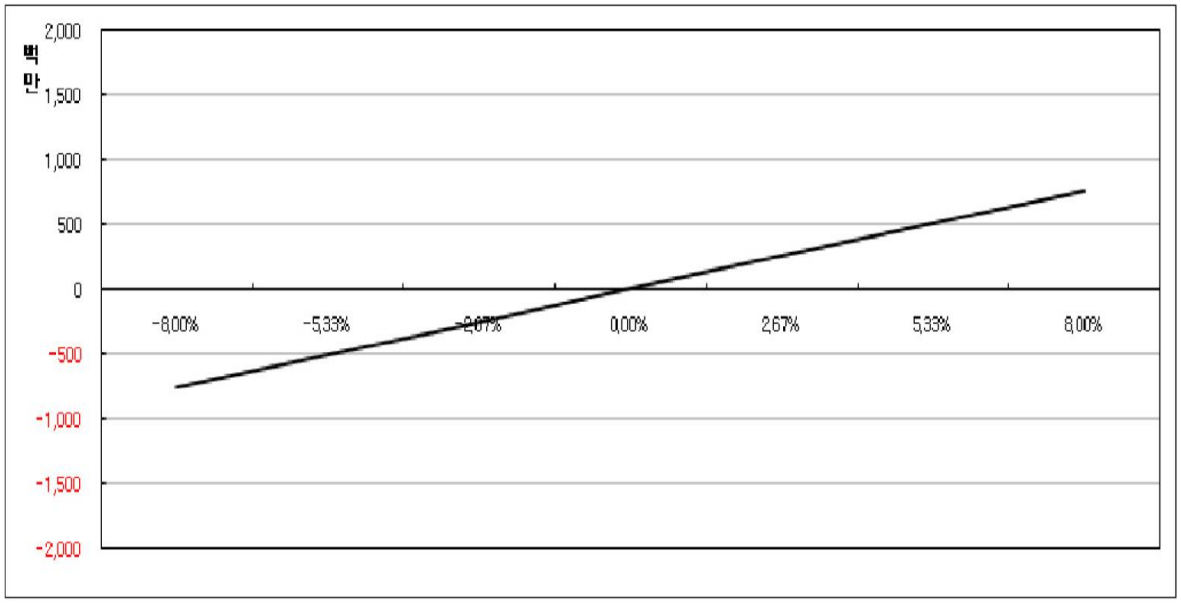
공시일: 2019-07-25

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)	395

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

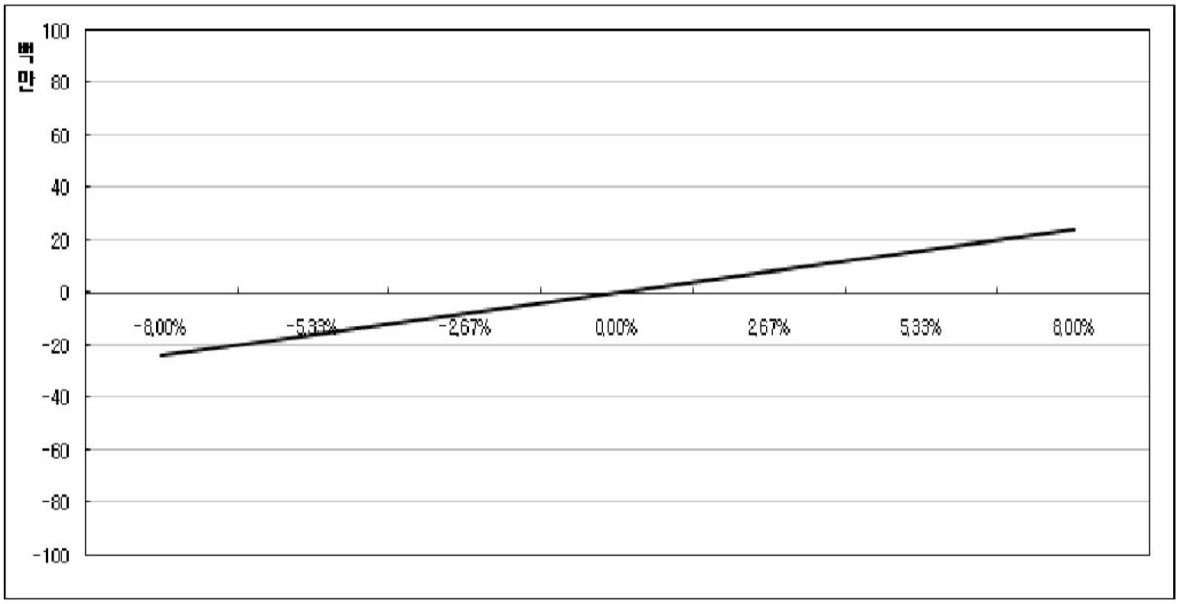
공시일: 2019-07-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	68	0	68	장내
누계	주가지수	선물	956	0	956	장내
합계			956	0	956	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

475

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

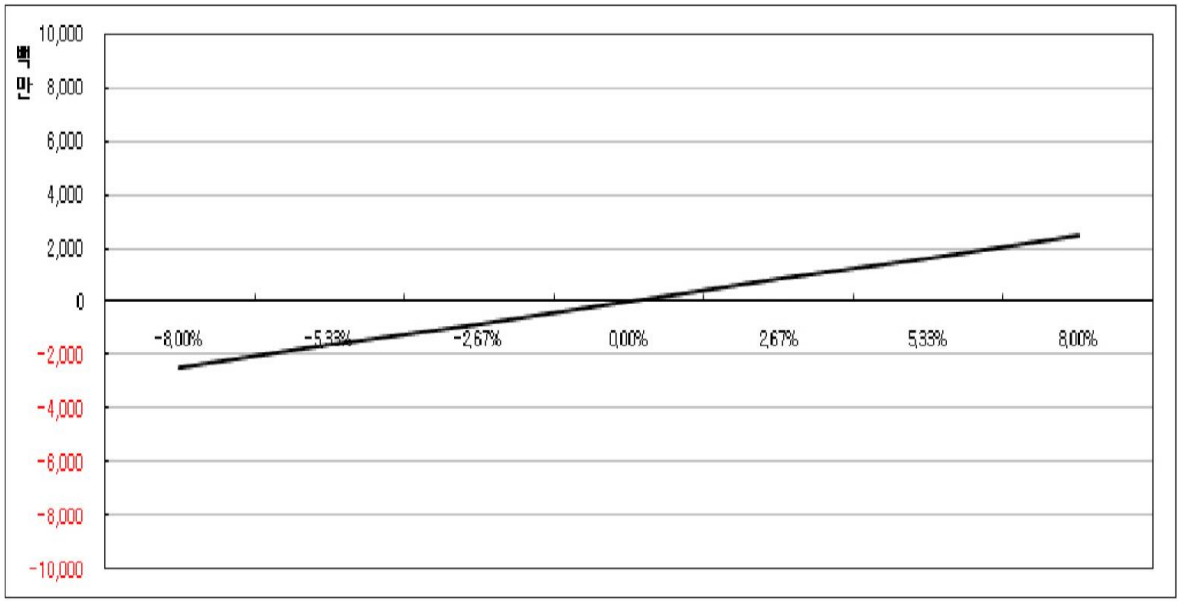
공시일: 2019-07-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	205	0	205	장내
누계	주가지수	선물	4,918	0	4,918	장내
합계			4,918	0	4,918	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

395

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

936

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

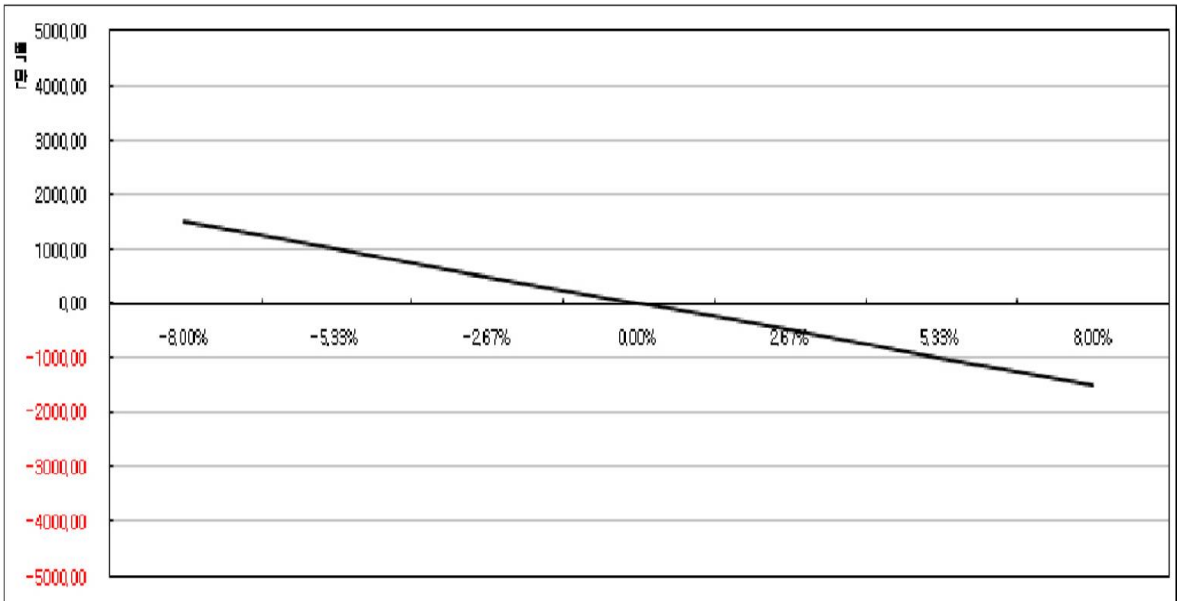
공시일: 2019-07-25

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	2,117	-2,117	장내
합계			0	2,117	-2,117	

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]

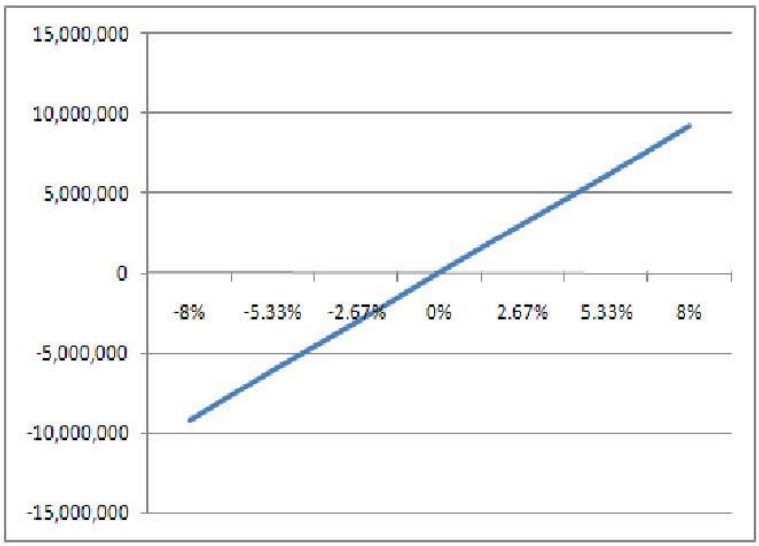
공시일: 2019-07-25

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	70,422	0	70,422	장내
합계			70,422	0	70,422	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,651

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,098