펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-07-26

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	3,072	0	3,072	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	6,143	-6,137	장내
합계			3,078	6,143	-3,065	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	165

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	309

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

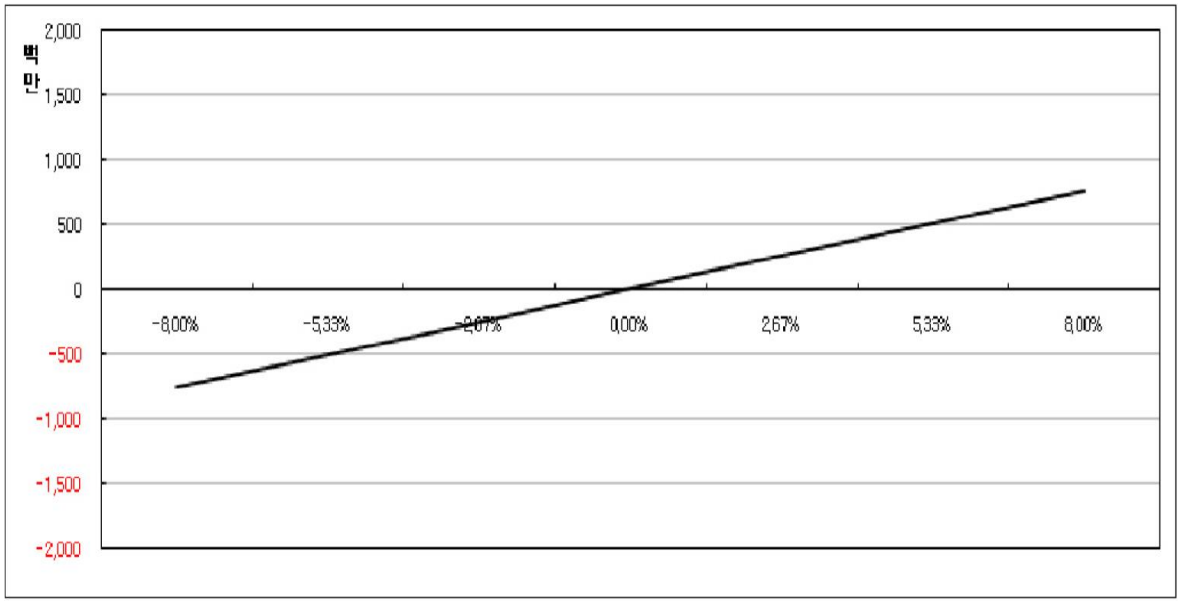
공시일: 2019-07-26

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)	400

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

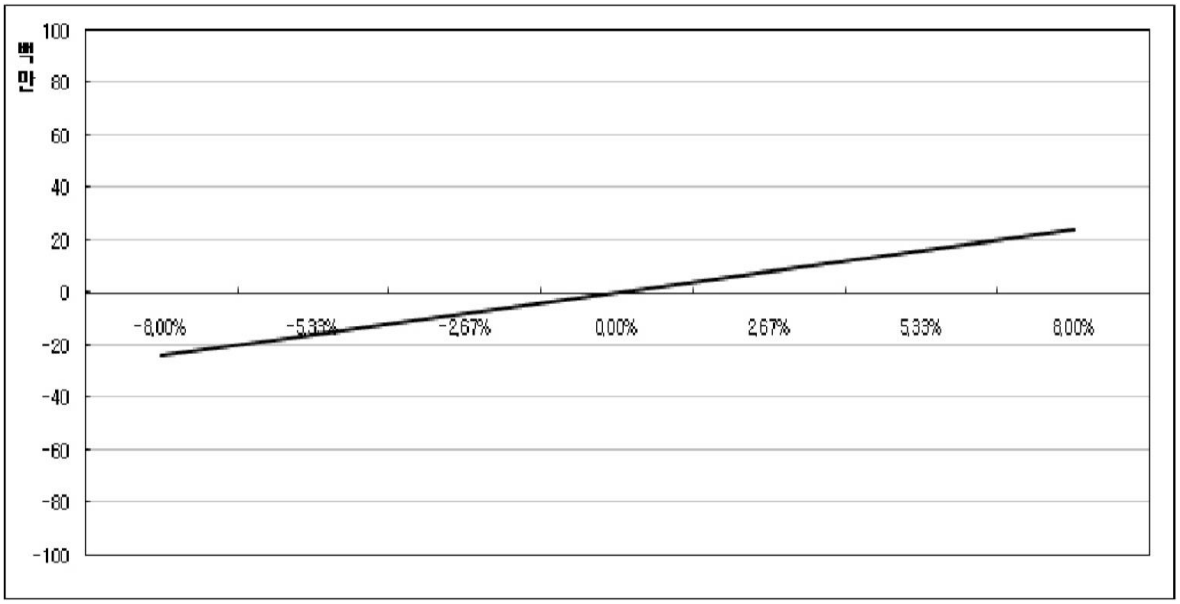
공시일: 2019-07-26

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	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) 481

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

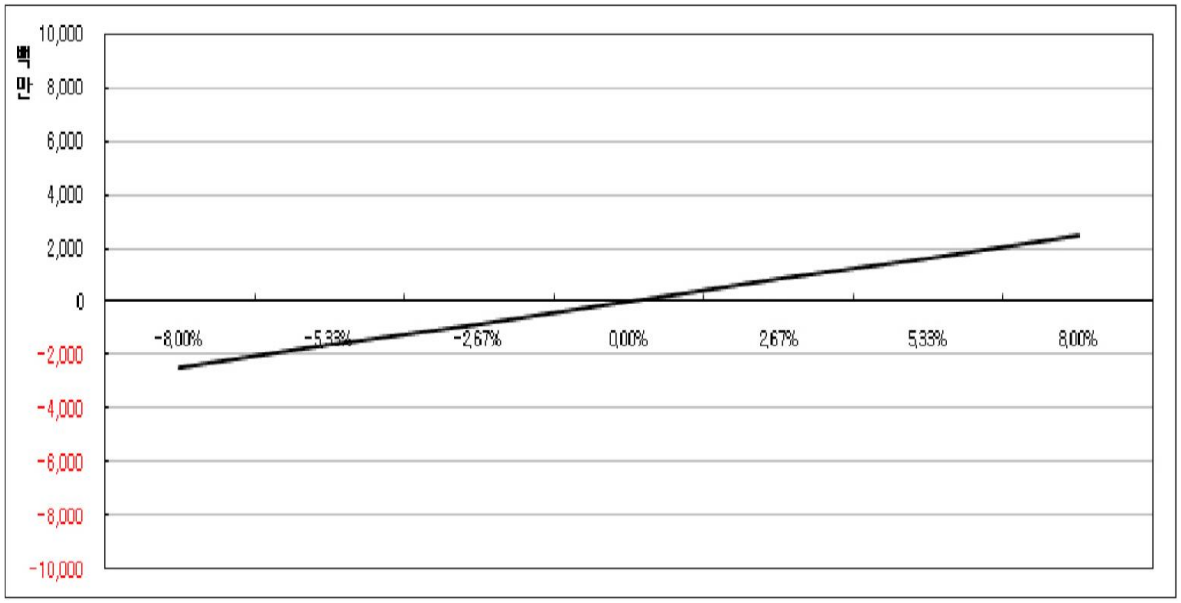
공시일: 2019-07-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	205	-205	장내
누계	주가지수	선물	4,710	0	4,710	장내
합계			4,710	0	4,710	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

378

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

934

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

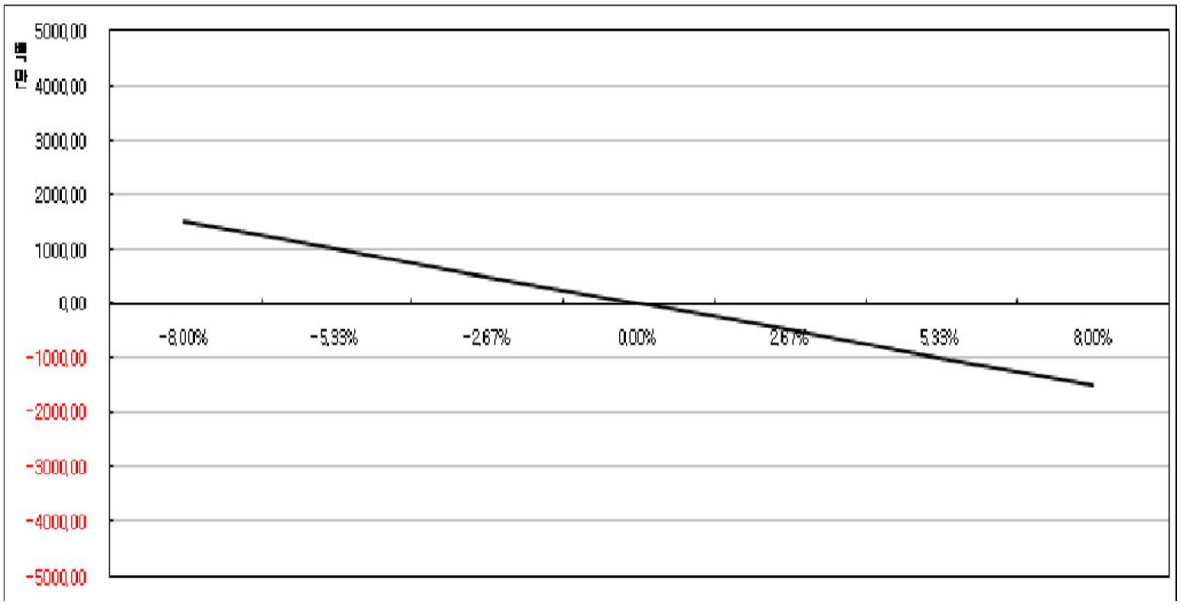
공시일: 2019-07-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	205	-205	장내
누계	주가지수	선물	0	2,321	-2,321	장내
합계			0	2,321	-2,321	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

186

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

157

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

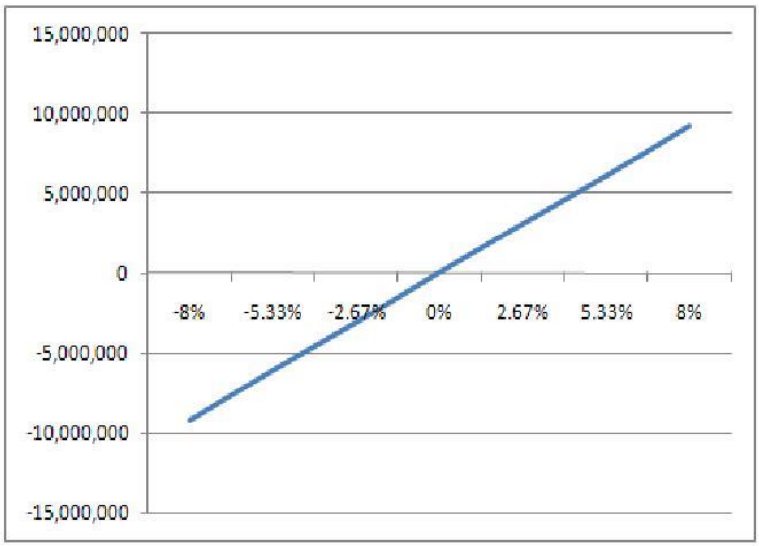
공시일: 2019-07-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	819	683	137	장내
누계	주가지수	선물	70,513	0	70,513	장내
합계			70,513	0	70,513	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,657

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,149