펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-08

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	3,516	0	3,516	장내
신규	주가지수	옵션	1	0	1	장내
누계	주가지수	옵션	7	352	-345	장내
합계			3,523	352	3,172	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	46

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	407

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

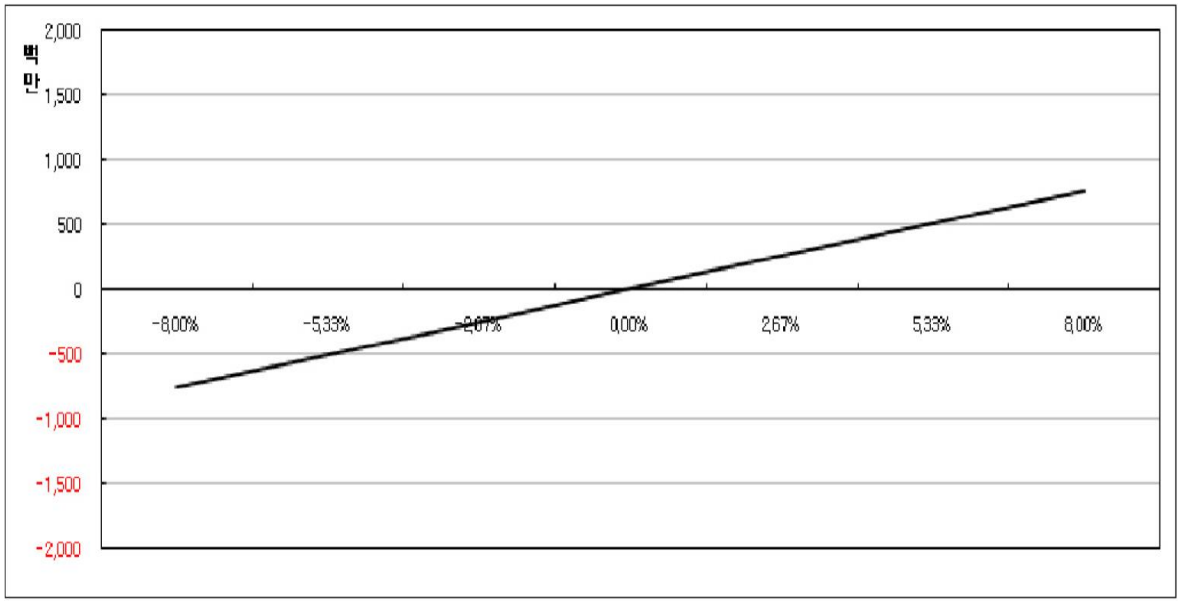
공시일: 2019-05-08

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	211	0	211	장내
합계			211	0	211	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	412

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

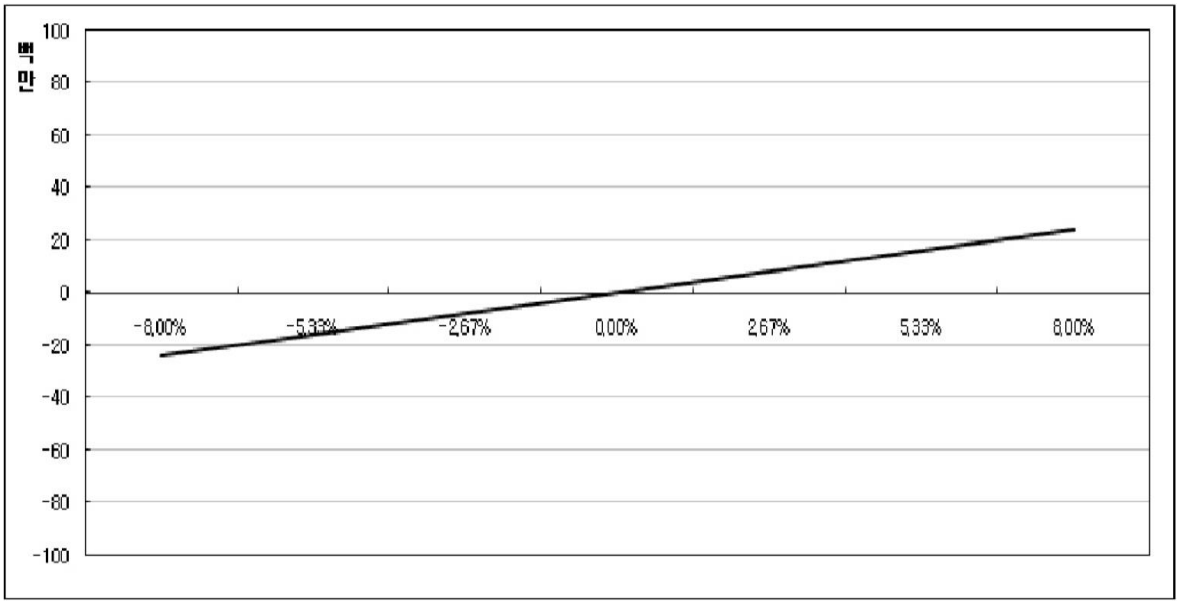
공시일: 2019-05-08

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	844	0	844	장내
합계			844	0	844	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

484

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

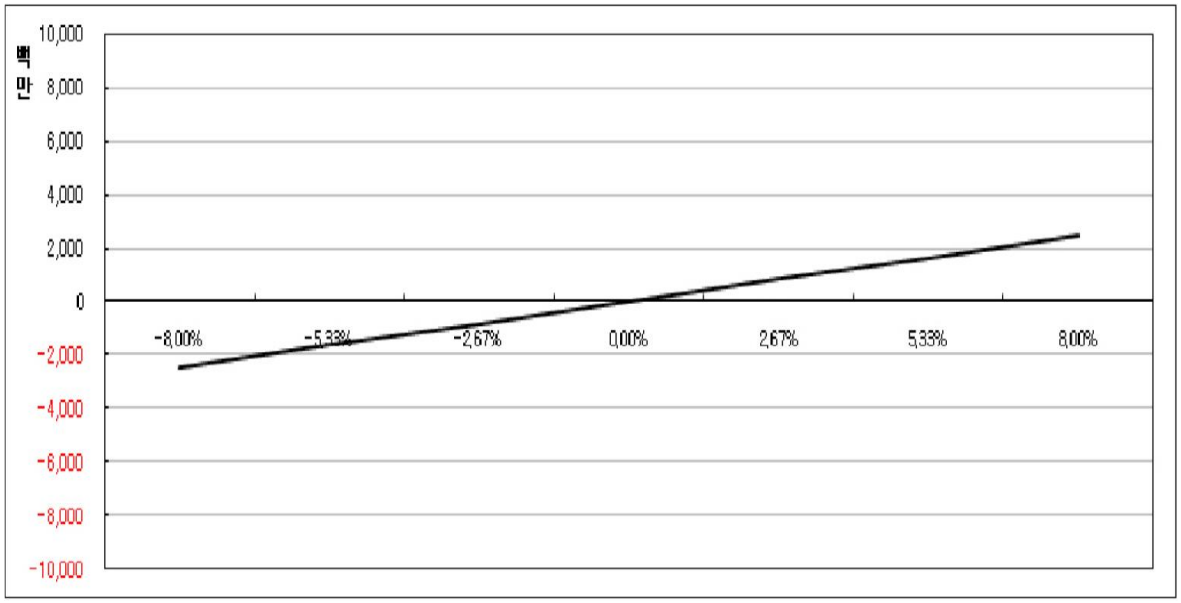
공시일: 2019-05-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	141	0	141	장내
누계	주가지수	선물	4,079	0	4,079	장내
합계			4,079	0	4,079	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

327

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

913

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

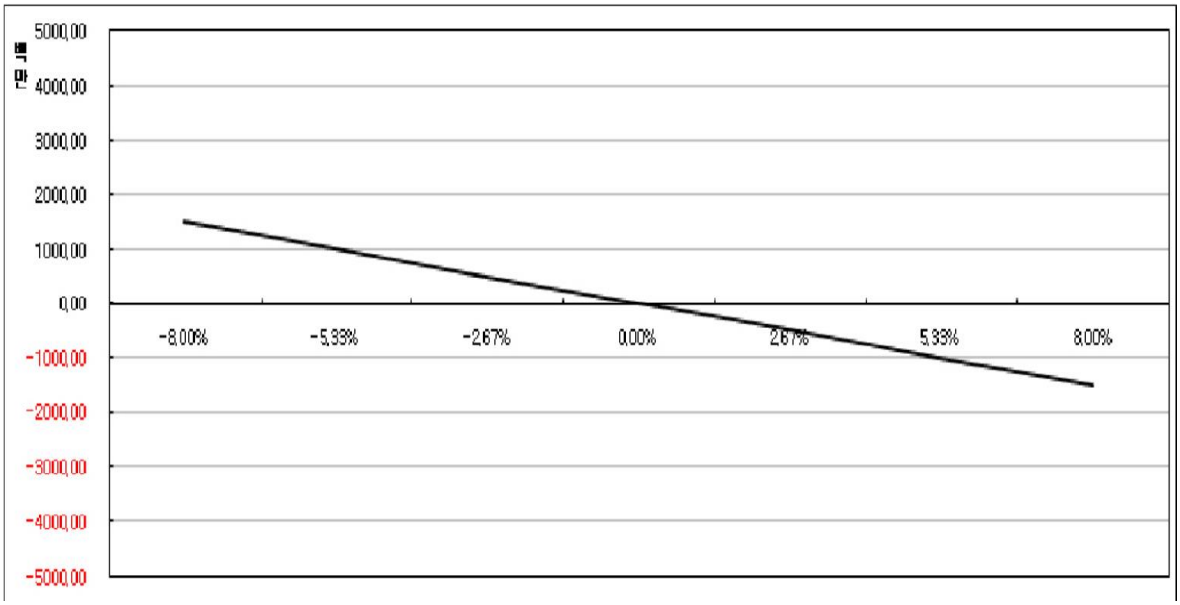
공시일: 2019-05-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	211	0	211	장내
누계	주가지수	선물	0	2,743	-2,743	장내
합계			0	2,743	-2,743	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

220

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

183

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

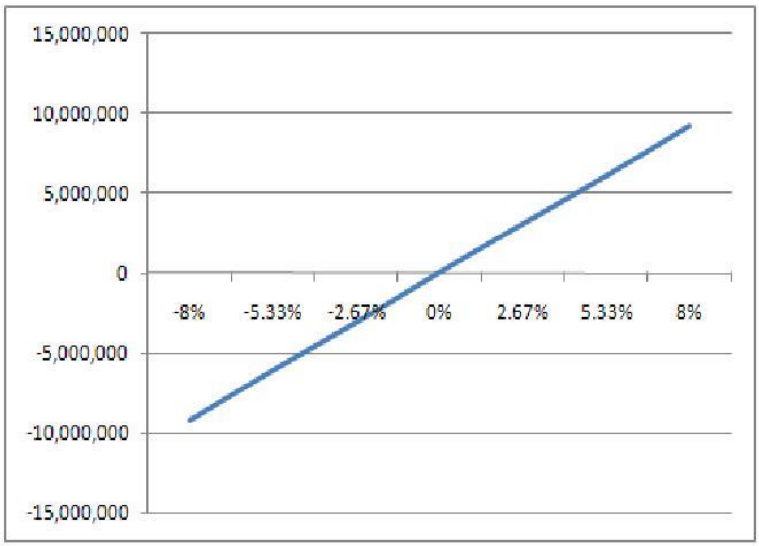
공시일: 2019-05-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	633	0	633	장내
누계	주가지수	선물	68,569	0	68,569	장내
합계			68,569	0	68,569	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,495

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,105