펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-14

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	3,359	0	3,359	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	19	6,449	-6,430	장내
합계			3,378	6,449	-3,071	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	147

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	482

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

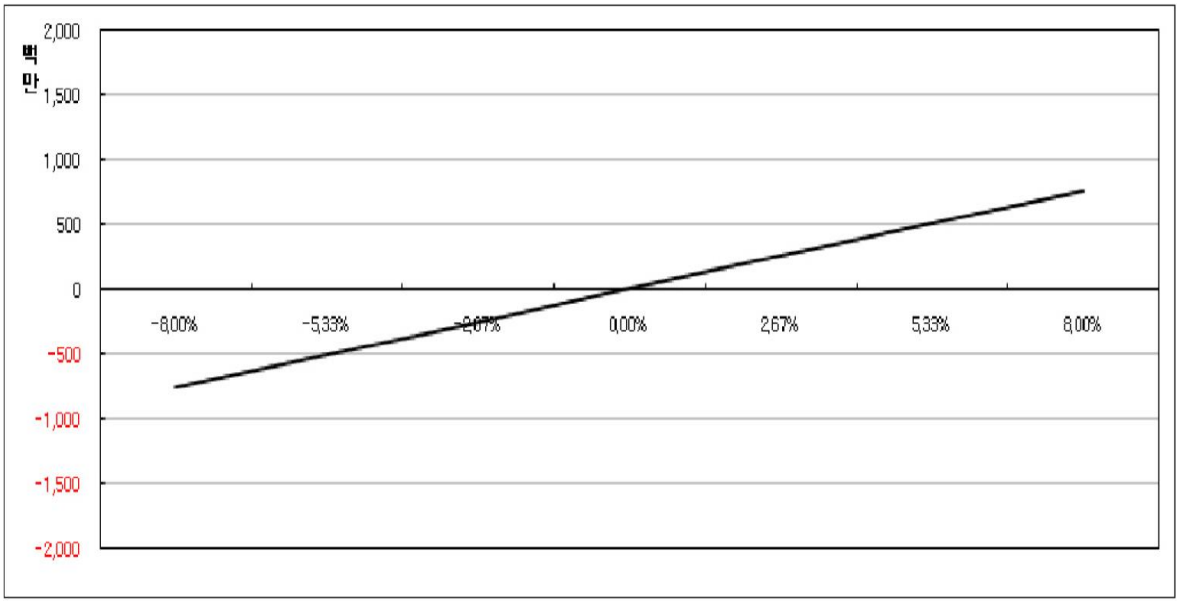
공시일: 2019-05-14

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	202	0	202	장내
합계			202	0	202	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	398

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

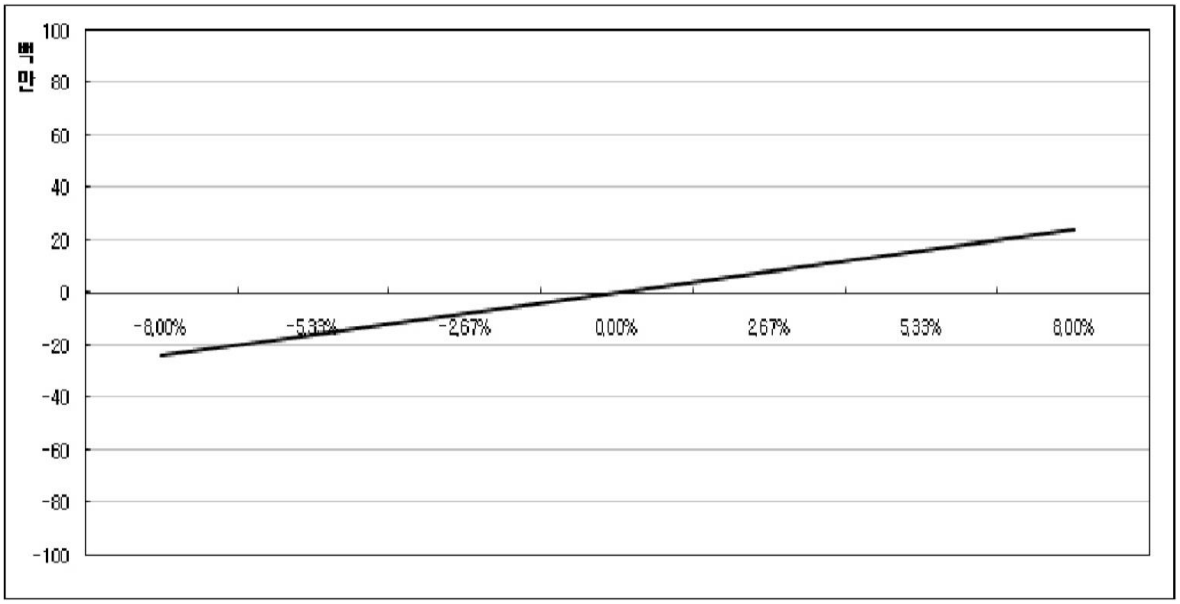
공시일: 2019-05-14

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	806	0	806	장내
합계			806	0	806	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 469

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

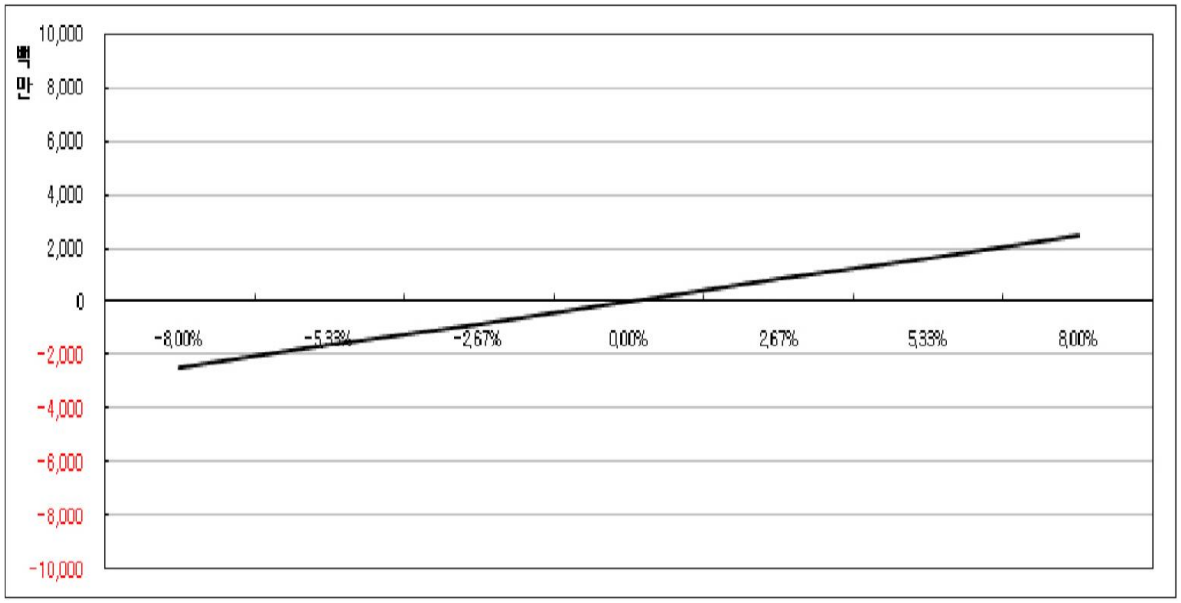
공시일: 2019-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	806	403	403	장내
누계	주가지수	선물	4,568	0	4,568	장내
합계			4,568	0	4,568	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

366

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

916

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

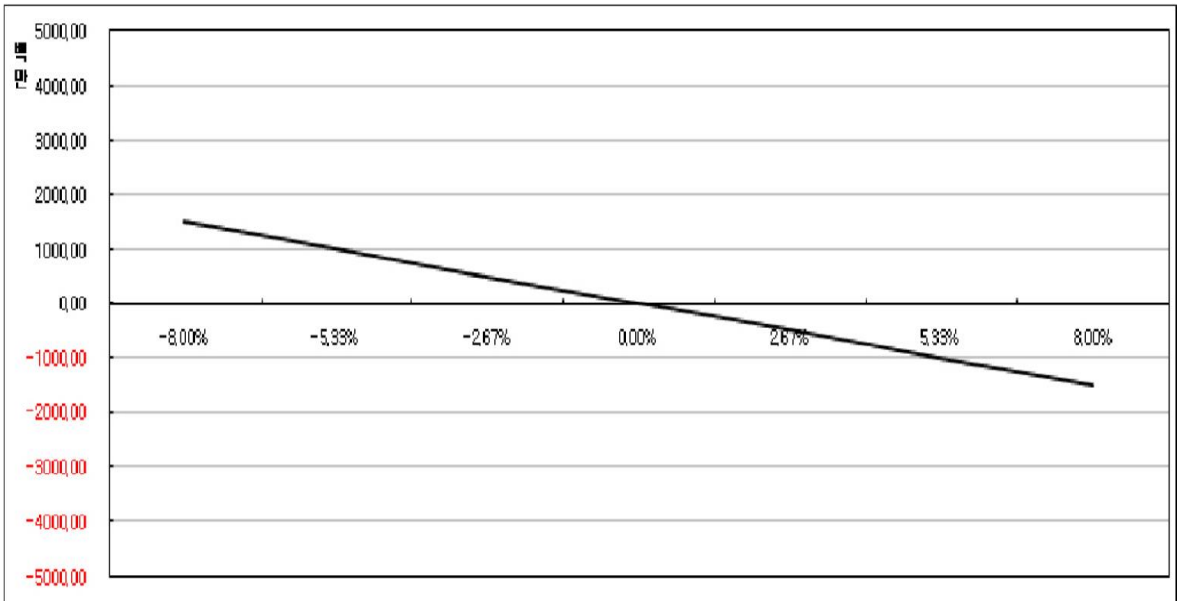
공시일: 2019-05-14

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	2,150	-2,150	장내
합계			0	2,150	-2,150	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

172

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

147

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

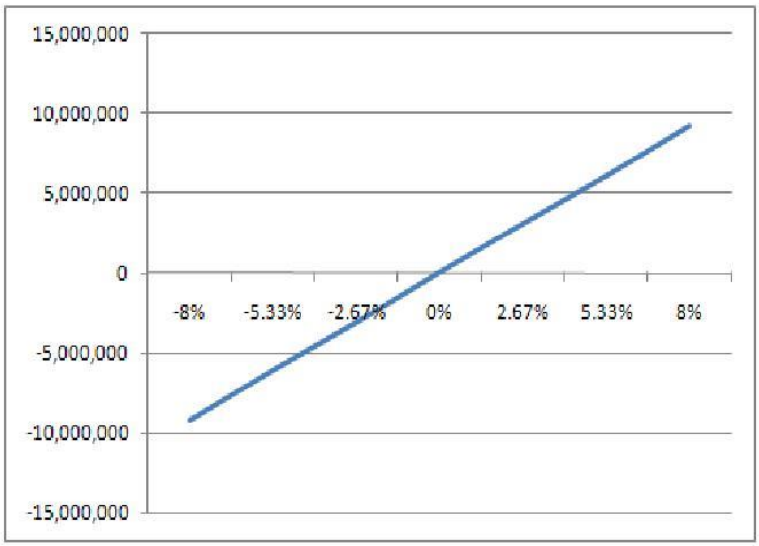
공시일: 2019-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	672	0	672	장내
누계	주가지수	선물	66,172	0	66,172	장내
합계			66,172	0	66,172	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,300

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,871