펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-22

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	3,327	0	3,327	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	16	6,387	-6,371	장내
합계			3,343	6,387	-3,044	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	166

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	305

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

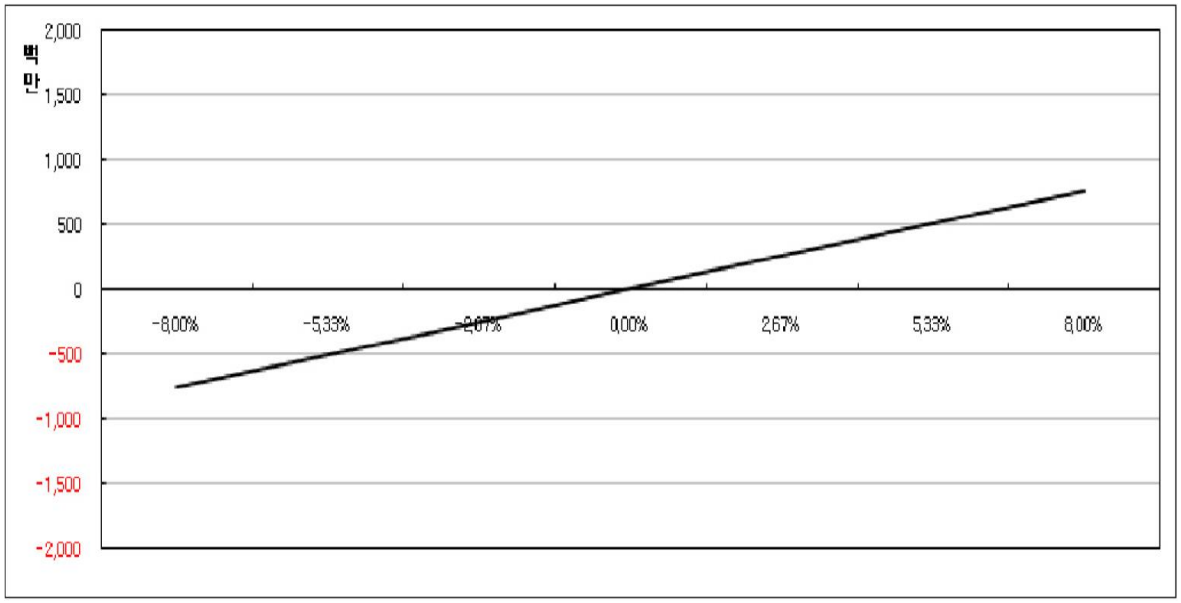
공시일: 2019-05-22

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	200	0	200	장내
합계			200	0	200	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

393

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

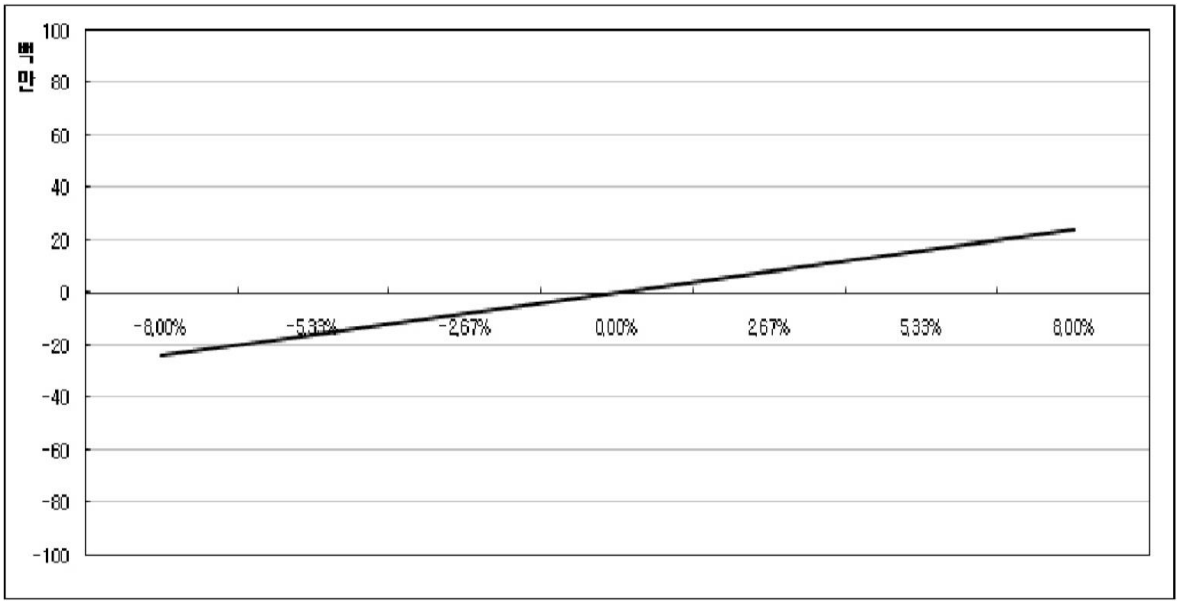
공시일: 2019-05-22

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	798	0	798	장내
합계			798	0	798	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

463

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

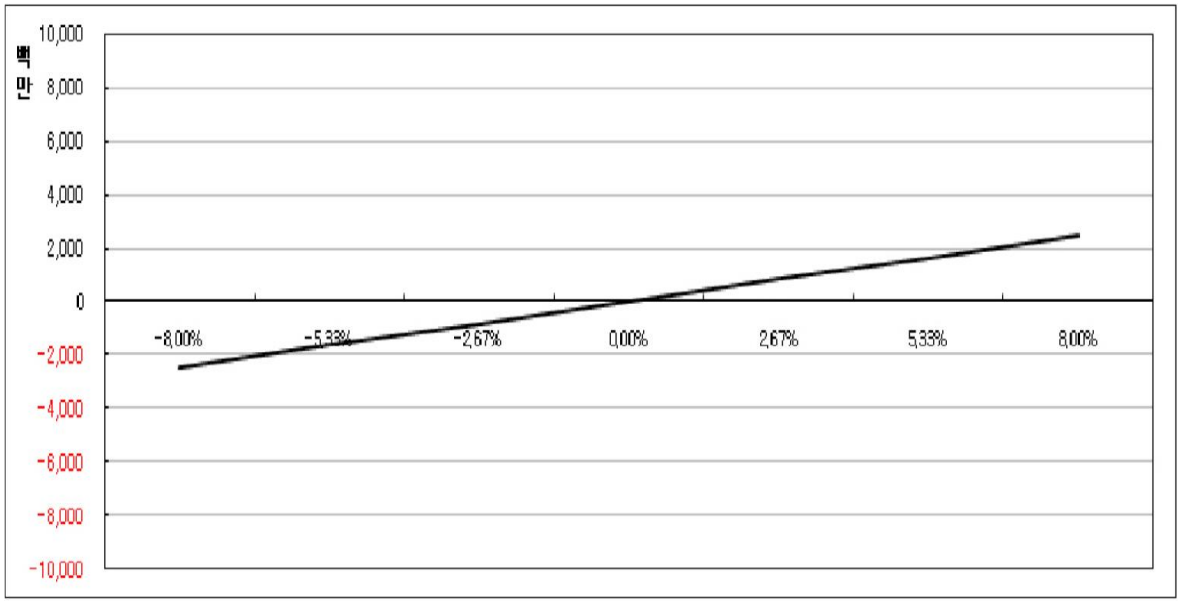
공시일: 2019-05-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	266	0	266	장내
누계	주가지수	선물	5,189	0	5,189	장내
합계			5,189	0	5,189	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

416

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

939

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

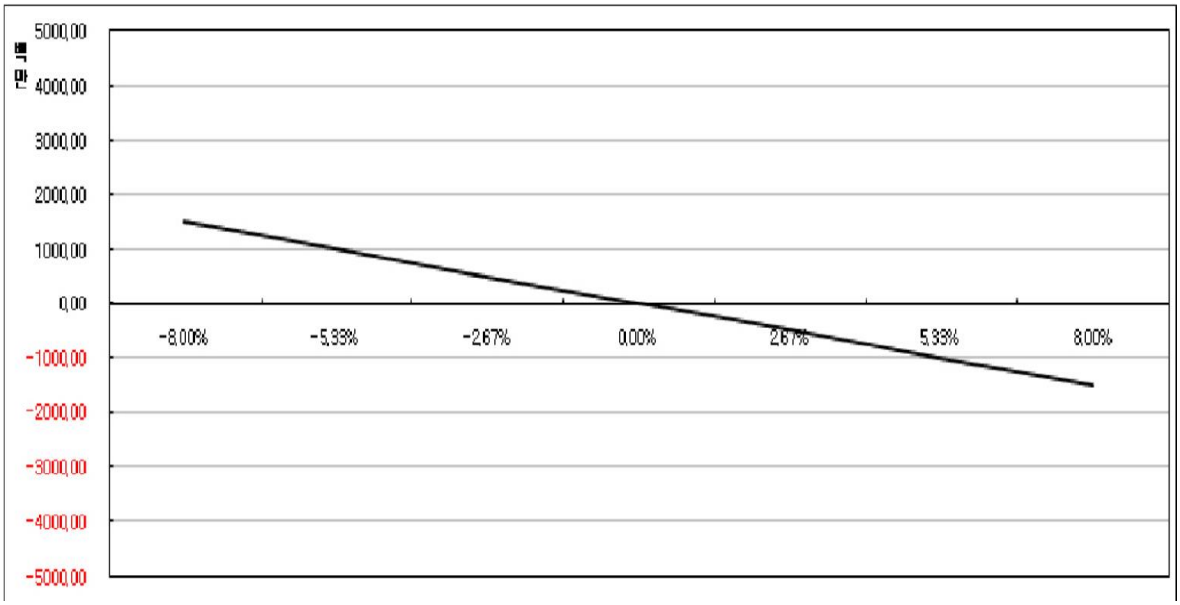
공시일: 2019-05-22

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	2,329	-2,329	장내
합계			0	2,329	-2,329	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

187

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

160

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

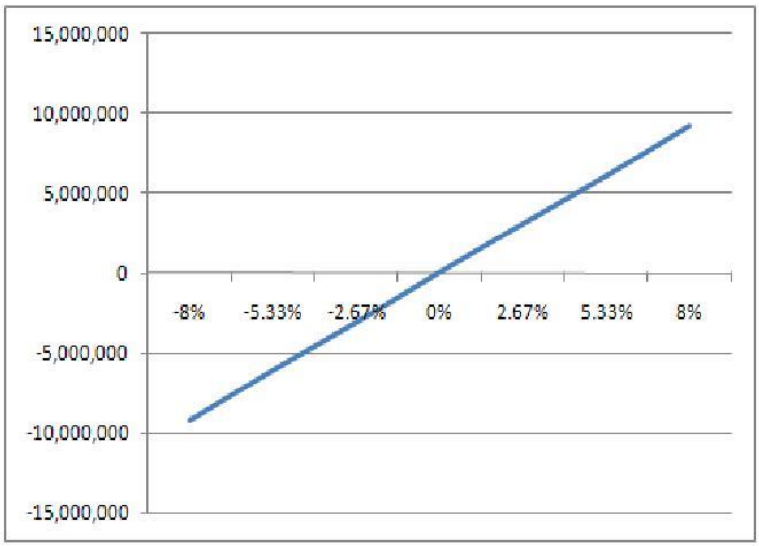
공시일: 2019-05-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	466	0	466	장내
누계	주가지수	선물	67,794	0	67,794	장내
합계			67,794	0	67,794	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,434

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,925