펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-29

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	3,309	0	3,309	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	19	6,353	-6,334	장내
합계			3,327	6,353	-3,026	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	166

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	317

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

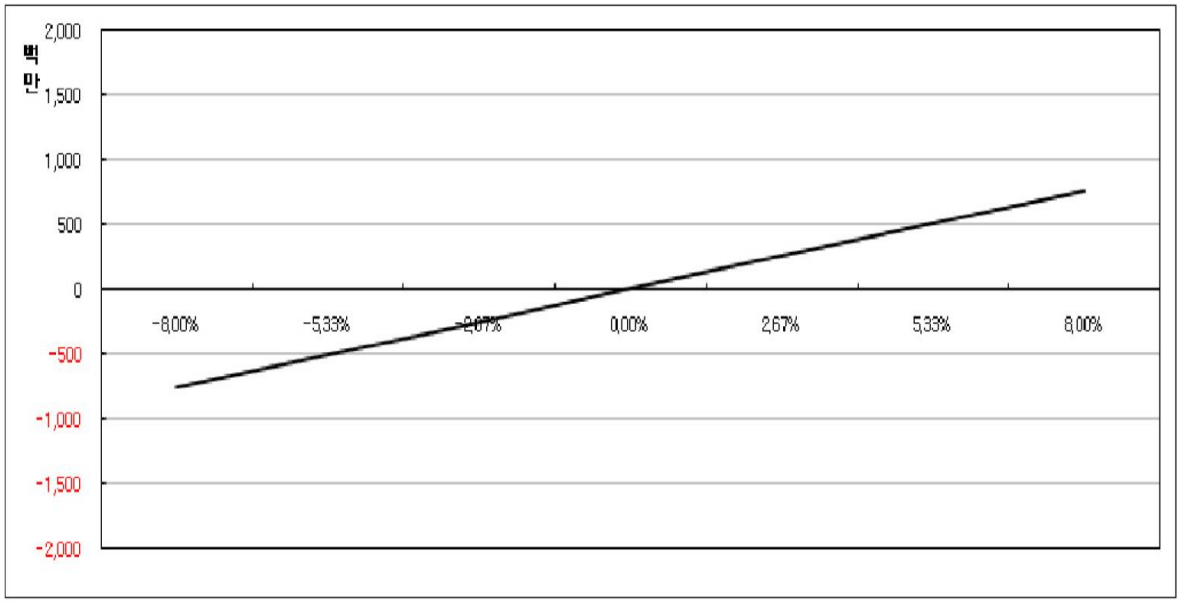
공시일: 2019-05-29

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	199	0	199	장내
합계			199	0	199	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	386

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

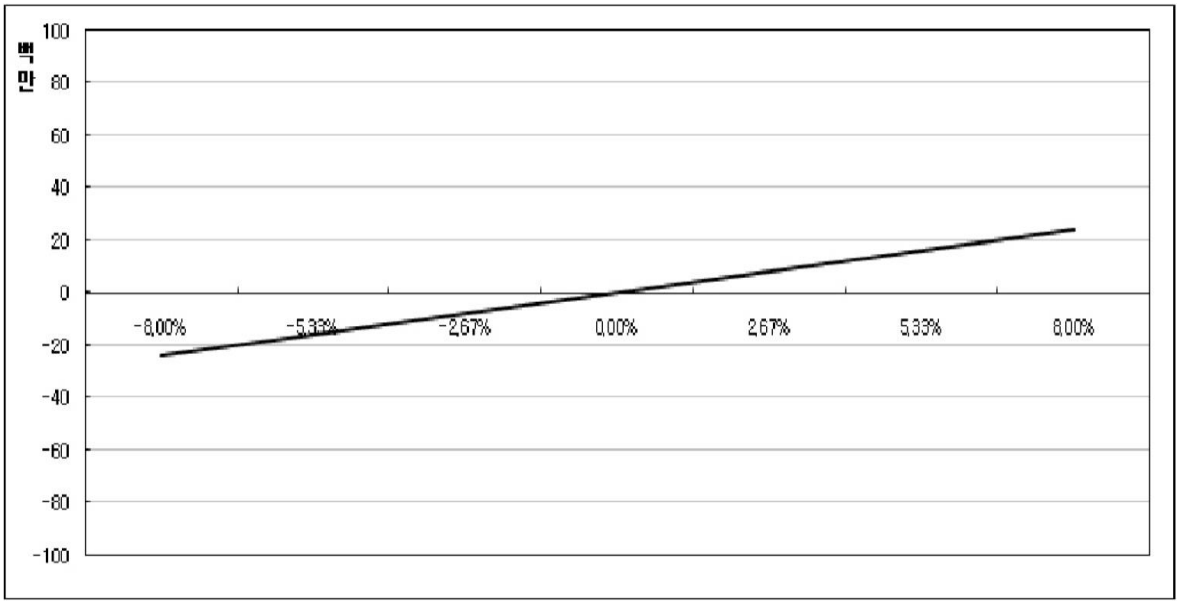
공시일: 2019-05-29

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	794	0	794	장내
합계			794	0	794	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

454

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

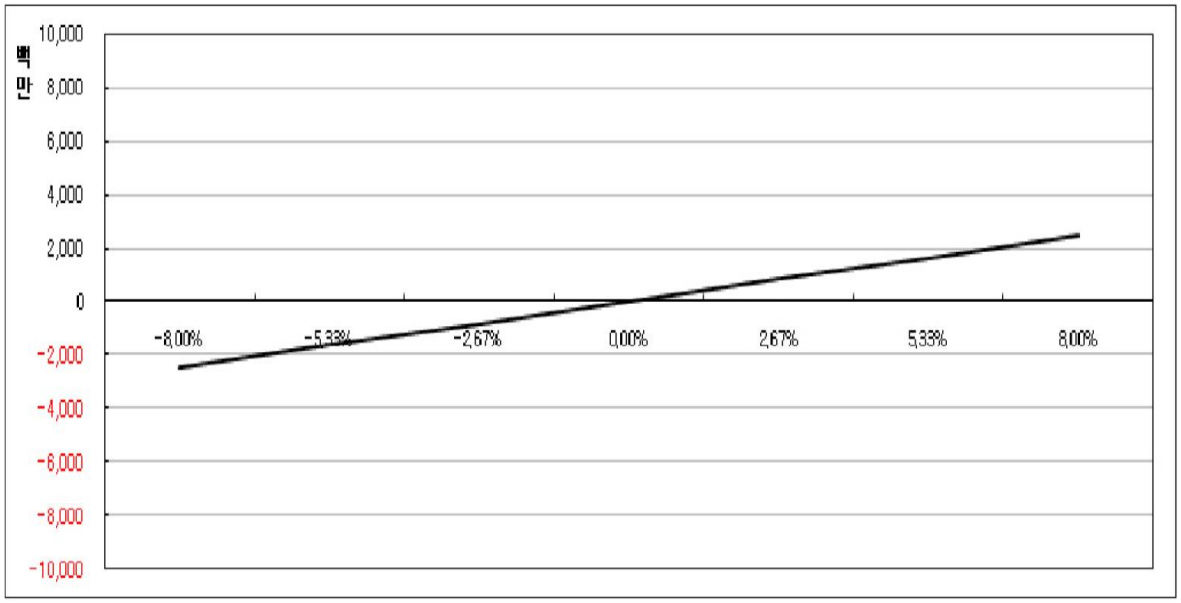
공시일: 2019-05-29

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	4,897	0	4,897	장내
합계			4,897	0	4,897	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

392

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

907

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

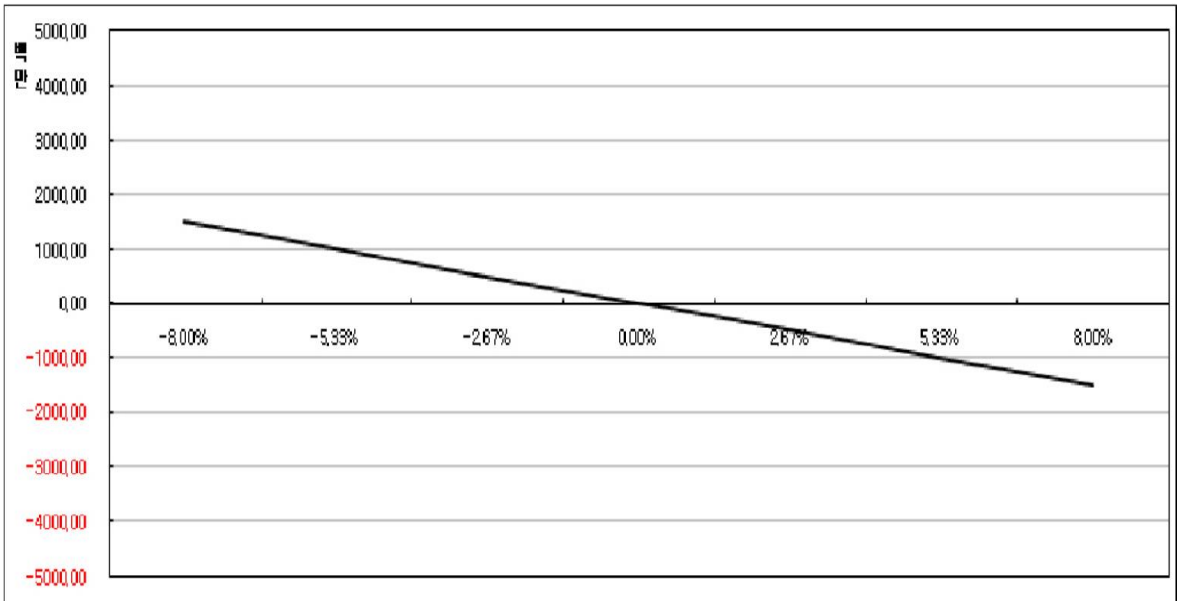
공시일: 2019-05-29

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	2,515	-2,515	장내
합계			0	2,515	-2,515	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	201

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	170

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

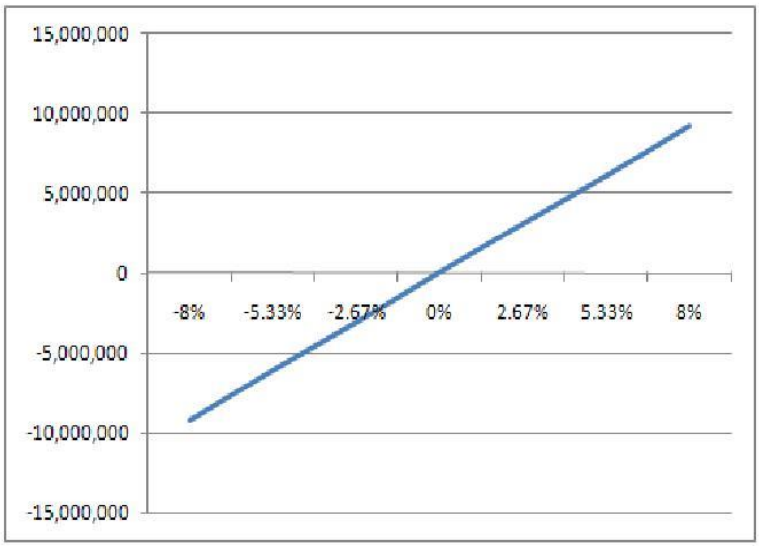
공시일: 2019-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	463	0	463	장내
누계	주가지수	선물	68,226	0	68,226	장내
합계			68,226	0	68,226	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,462

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,782