펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-31

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	3,299	0	3,299	장내
신규	주가지수	옵션	2	0	2	장내
누계	주가지수	옵션	18	1,584	-1,566	장내
합계			3,317	1,584	1,734	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	170

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	367

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

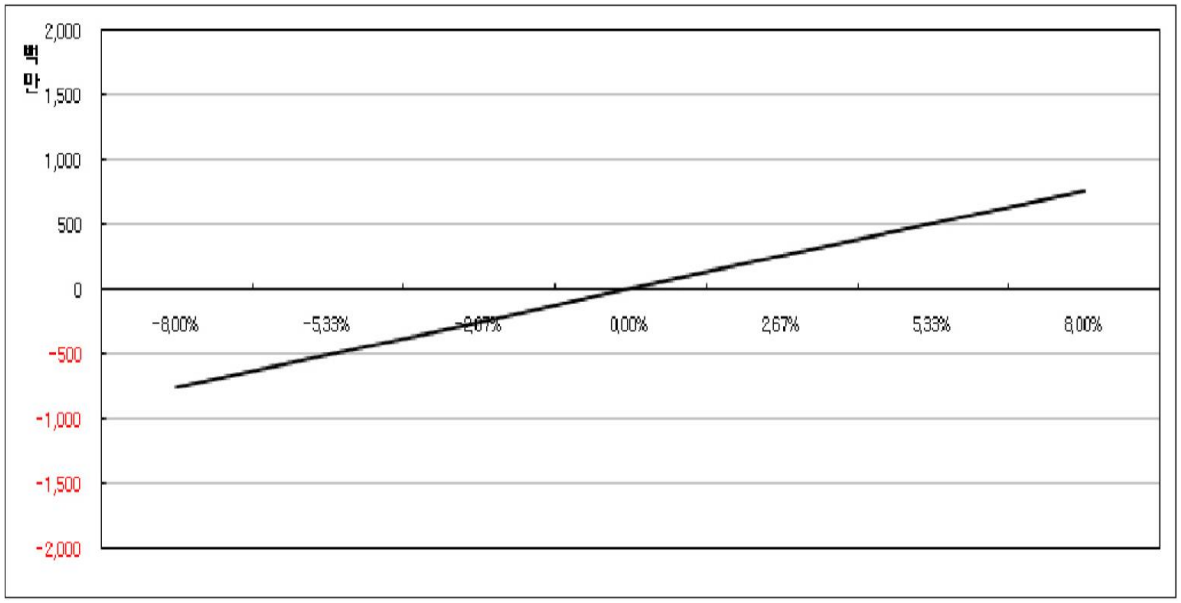
공시일: 2019-05-31

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	198	0	198	장내
합계			198	0	198	

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]

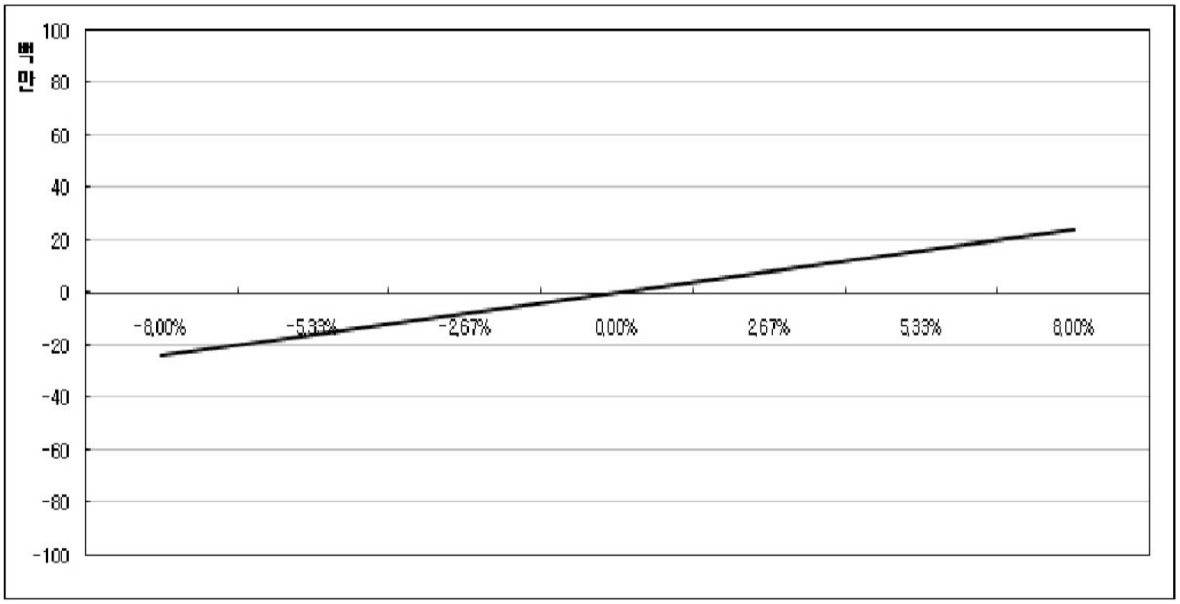
공시일: 2019-05-31

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	792	0	792	장내
합계			792	0	792	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

63

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

455

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

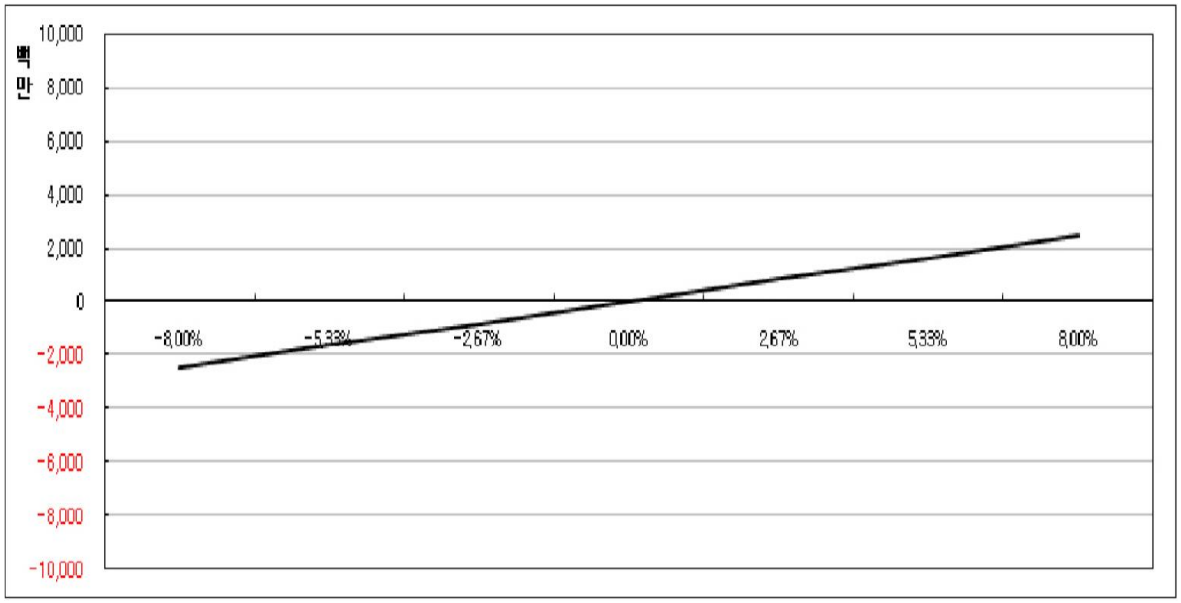
공시일: 2019-05-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	198	0	198	장내
누계	주가지수	선물	5,081	0	5,081	장내
합계			5,081	0	5,081	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

407

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

922

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

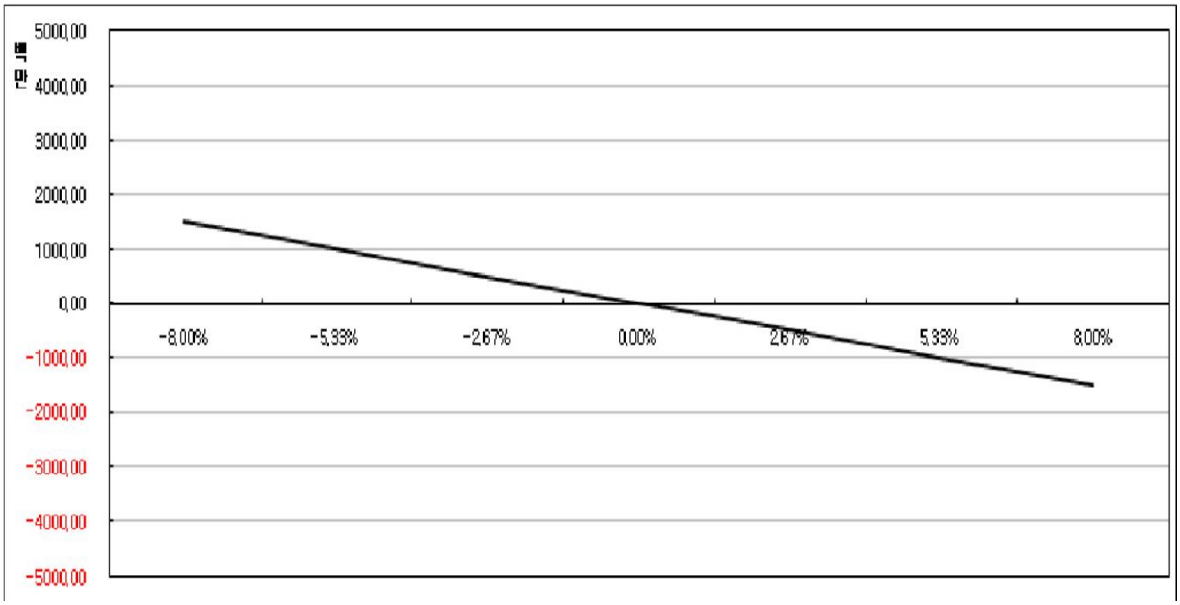
공시일: 2019-05-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	198	0	198	장내
누계	주가지수	선물	0	2,111	-2,111	장내
합계			0	2,111	-2,111	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

143

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

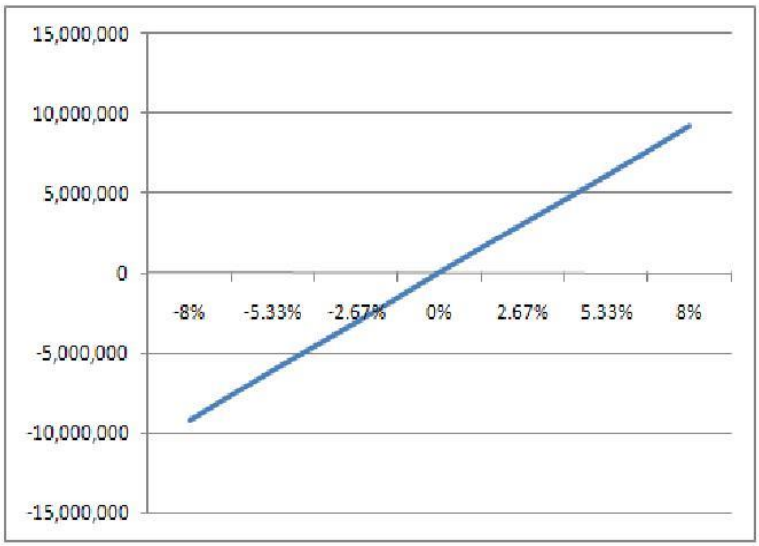
공시일: 2019-05-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	990	0	990	장내
누계	주가지수	선물	68,688	0	68,688	장내
합계			68,688	0	68,688	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,503

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,889