펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-03

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	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	20	1,583	-1,563	장내
합계			3,319	1,583	1,736	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	172

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	371

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

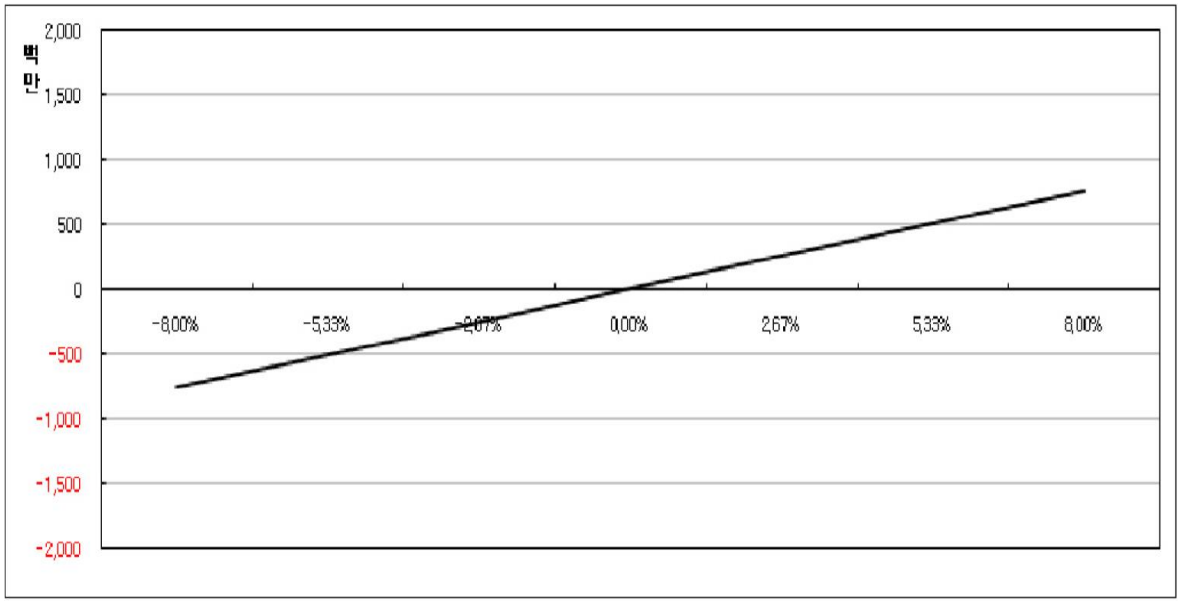
공시일: 2019-06-03

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)

385

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

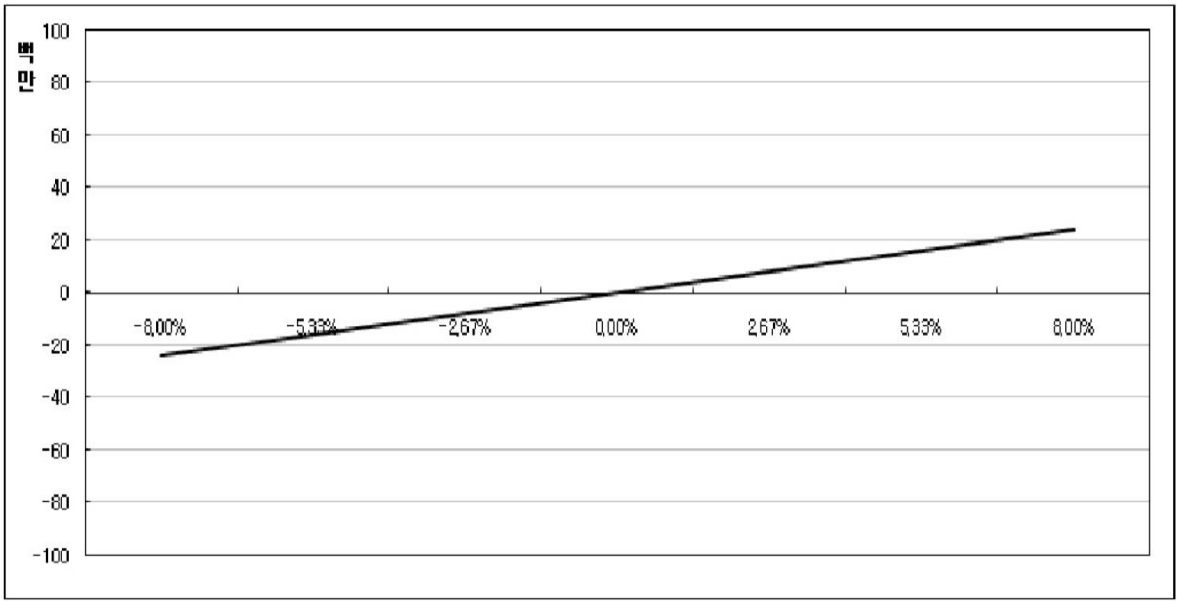
공시일: 2019-06-03

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]

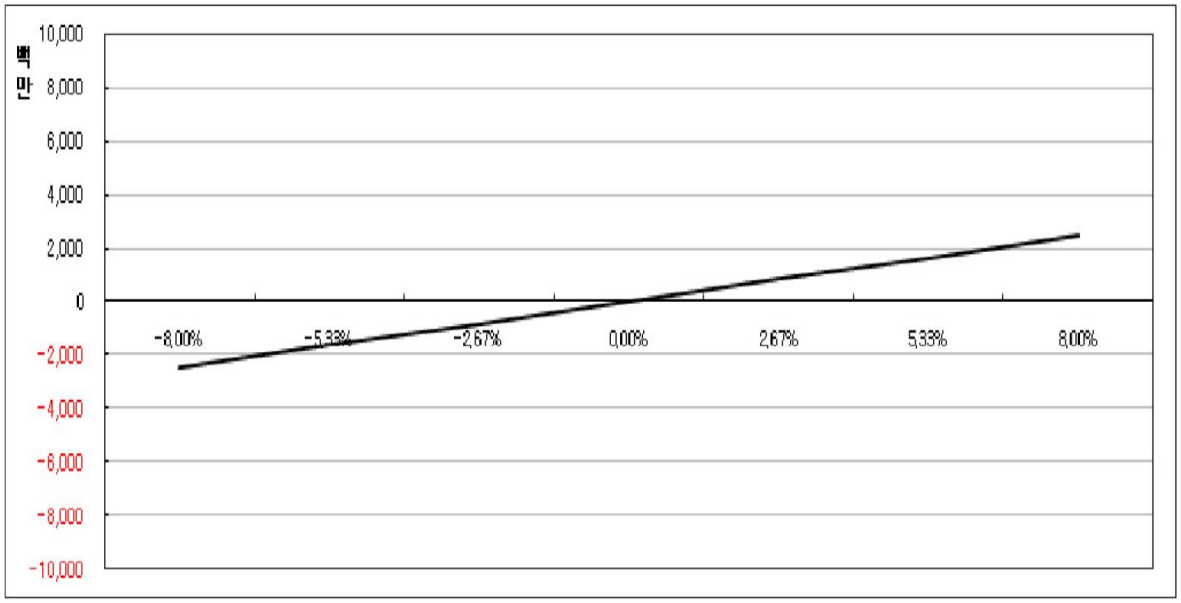
공시일: 2019-06-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	264	264	0	장내
누계	주가지수	선물	5,080	0	5,080	장내
합계			5,080	0	5,080	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

406

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

921

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

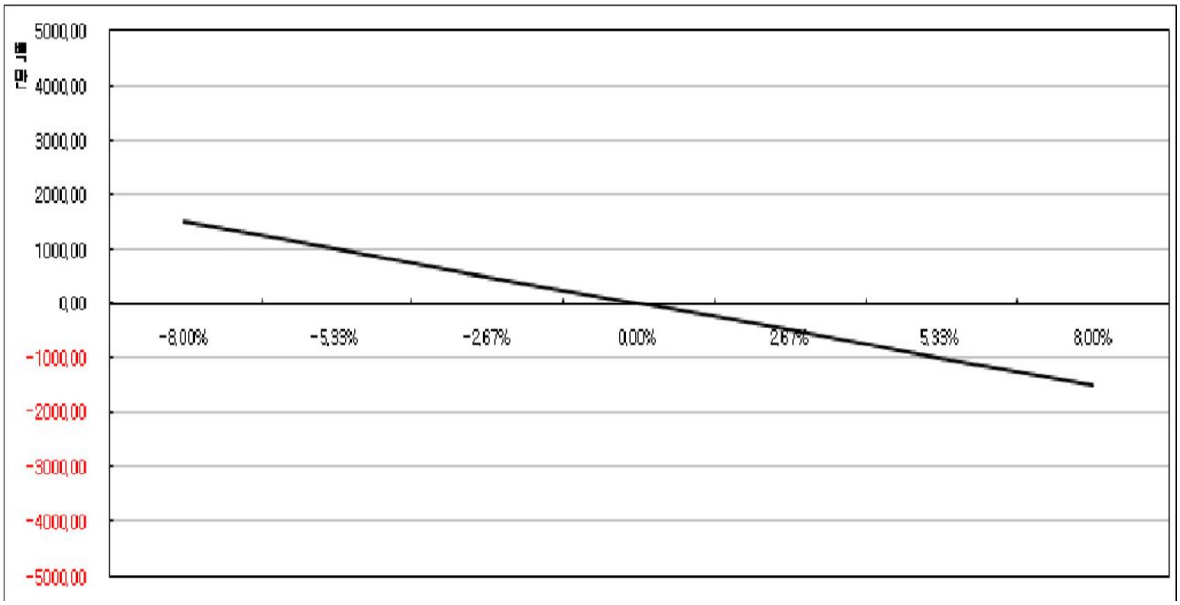
공시일: 2019-06-03

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	2,111	-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]

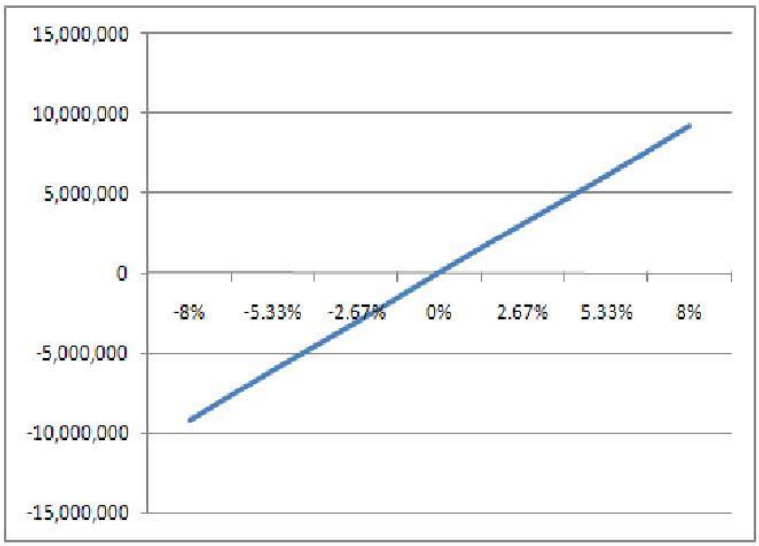
공시일: 2019-06-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	330	0	330	장내
누계	주가지수	선물	69,007	0	69,007	장내
합계			69,007	0	69,007	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,512

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,892