펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-04

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	3,352	0	3,352	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	1,609	-1,599	장내
합계			3,362	1,609	1,753	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	183

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	366

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

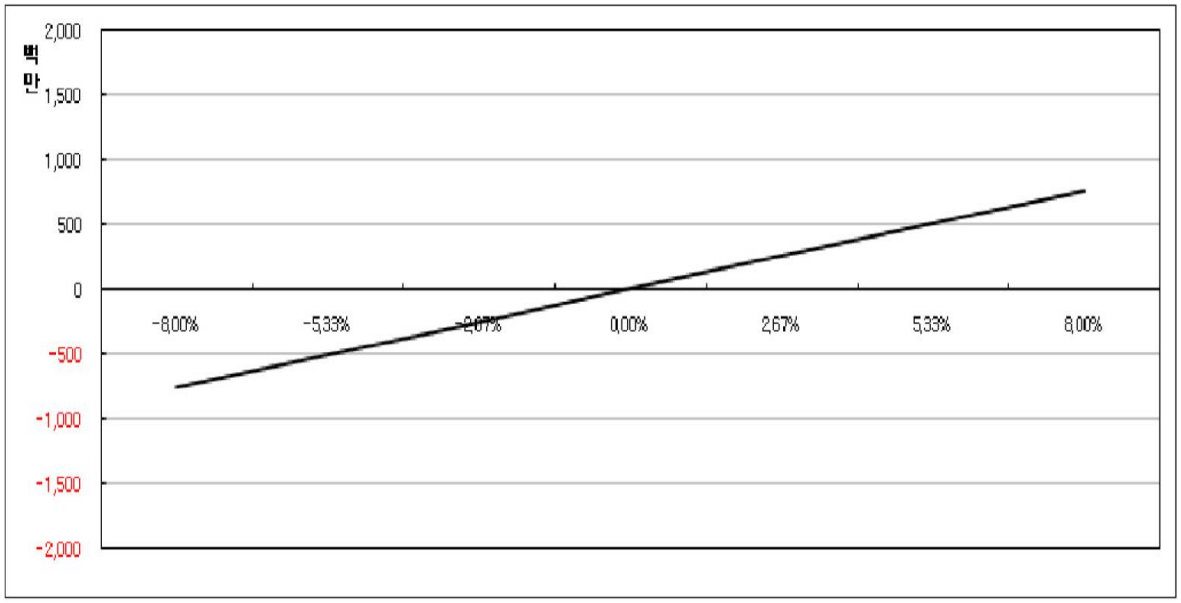
공시일: 2019-06-04

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	201	0	201	장내
합계			201	0	201	

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]

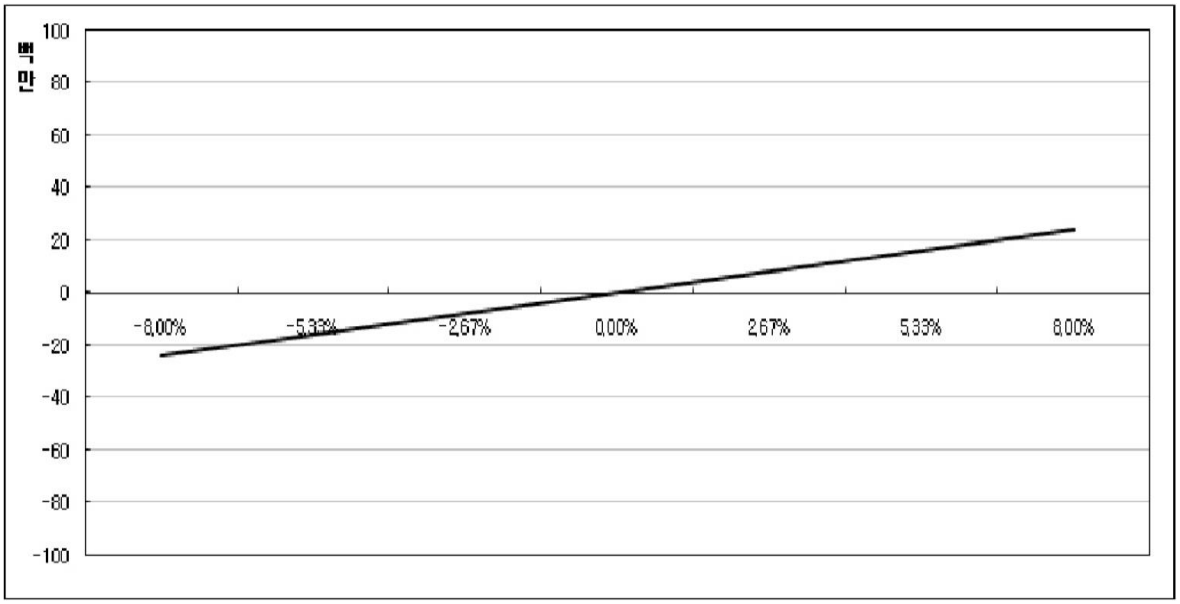
공시일: 2019-06-04

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	804	0	804	장내
합계			804	0	804	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

465

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

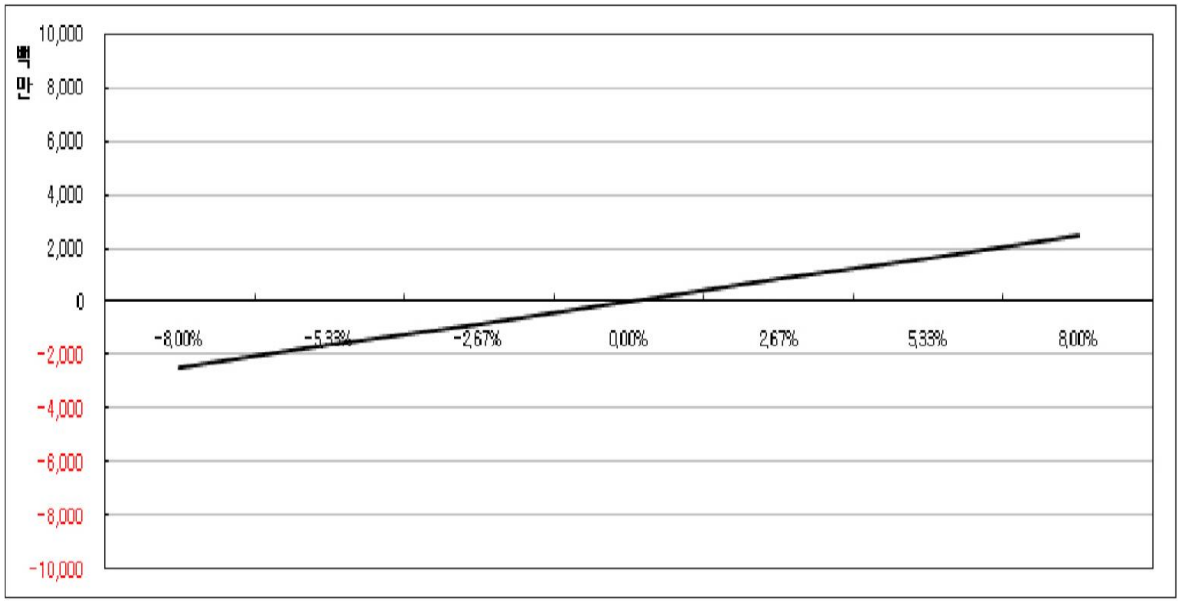
공시일: 2019-06-04

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	5,162	0	5,162	장내
합계			5,162	0	5,162	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

413

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

941

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

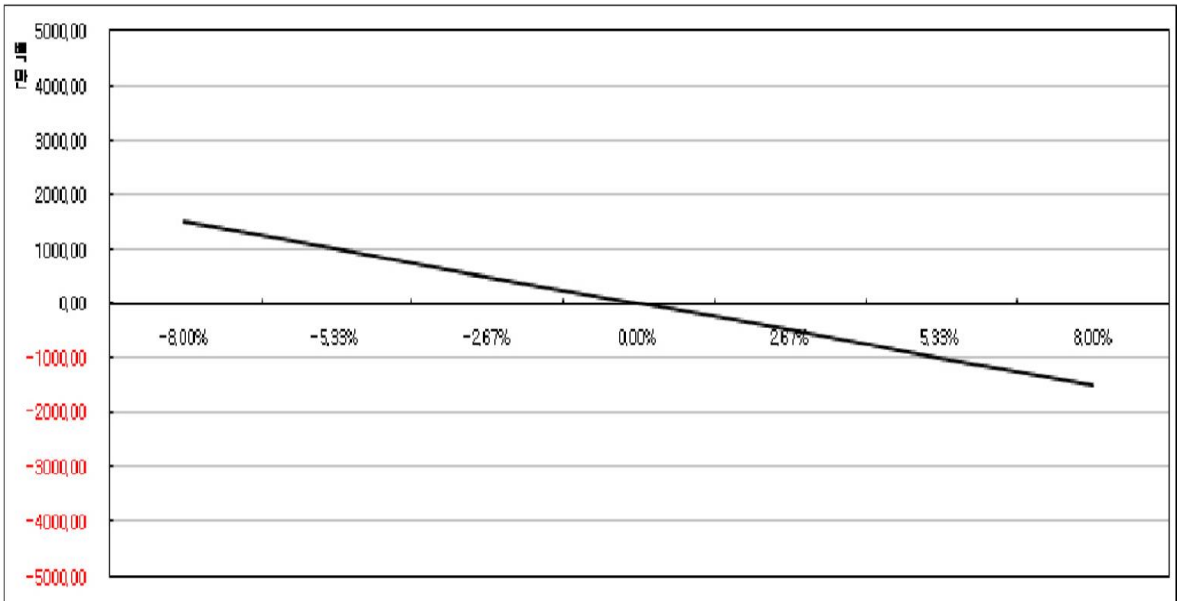
공시일: 2019-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	201	201	0	장내
누계	주가지수	선물	0	2,145	-2,145	장내
합계			0	2,145	-2,145	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

172

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

146

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

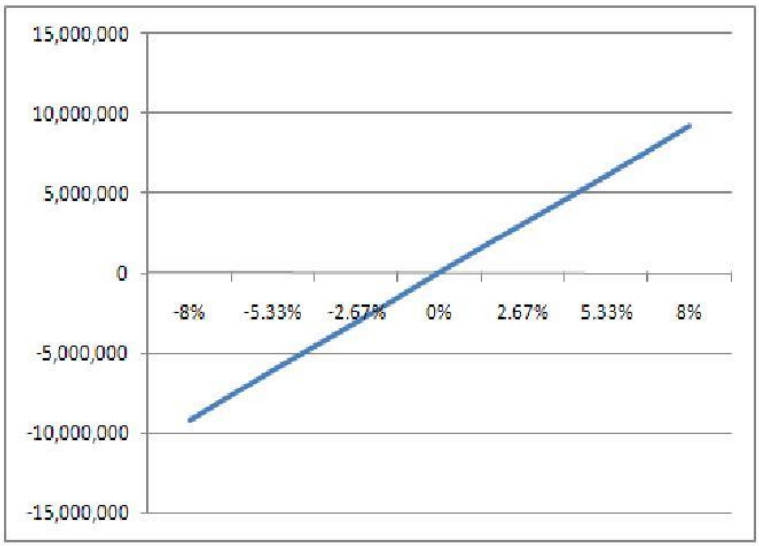
공시일: 2019-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,341	0	1,341	장내
누계	주가지수	선물	71,465	0	71,465	장내
합계			71,465	0	71,465	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,715

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,165