펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,346	3,346	0	장내
누계	주가지수	선물	3,346	0	3,346	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	1,606	-1,596	장내
합계			3,356	1,606	1,750	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

181

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

367

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

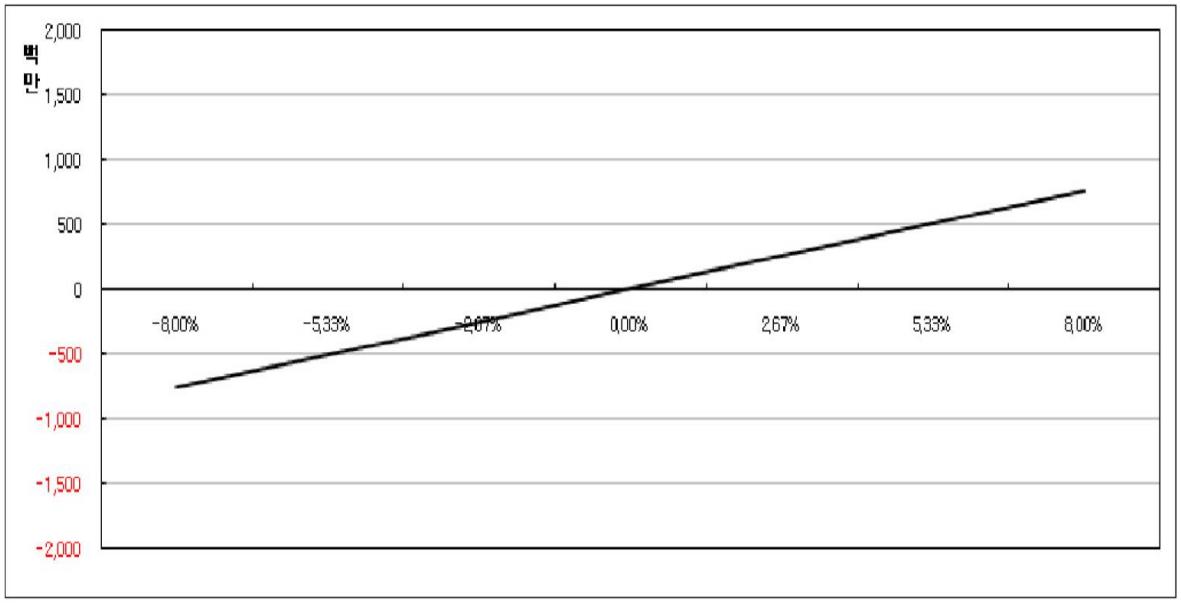
공시일: 2019-06-05

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)	391

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

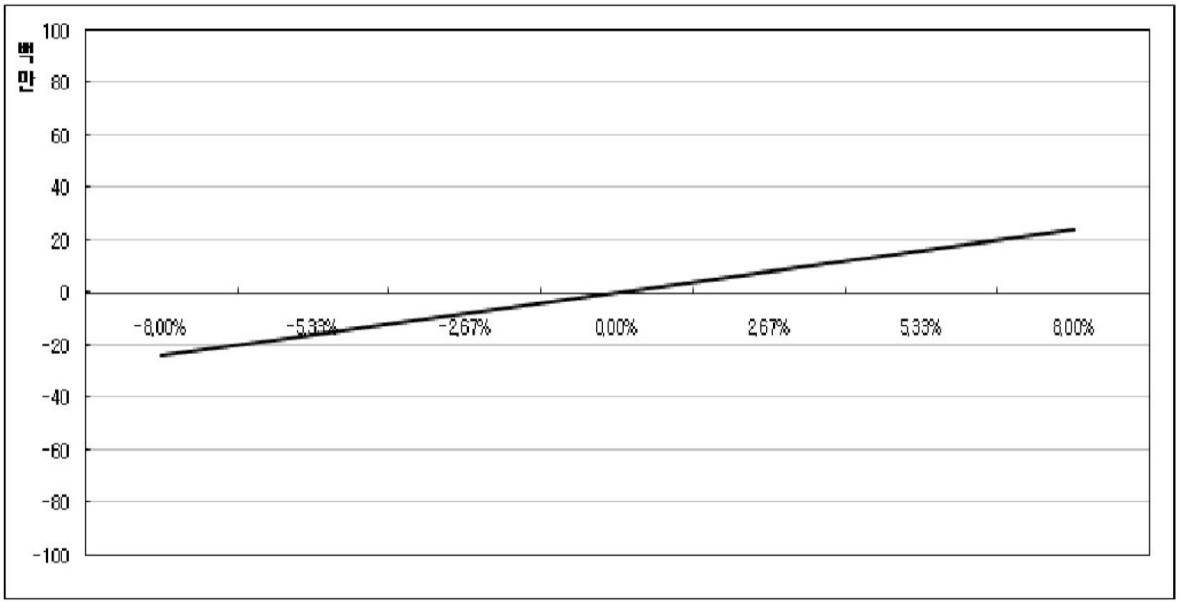
공시일: 2019-06-05

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	803	0	803	장내
합계			803	0	803	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

462

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

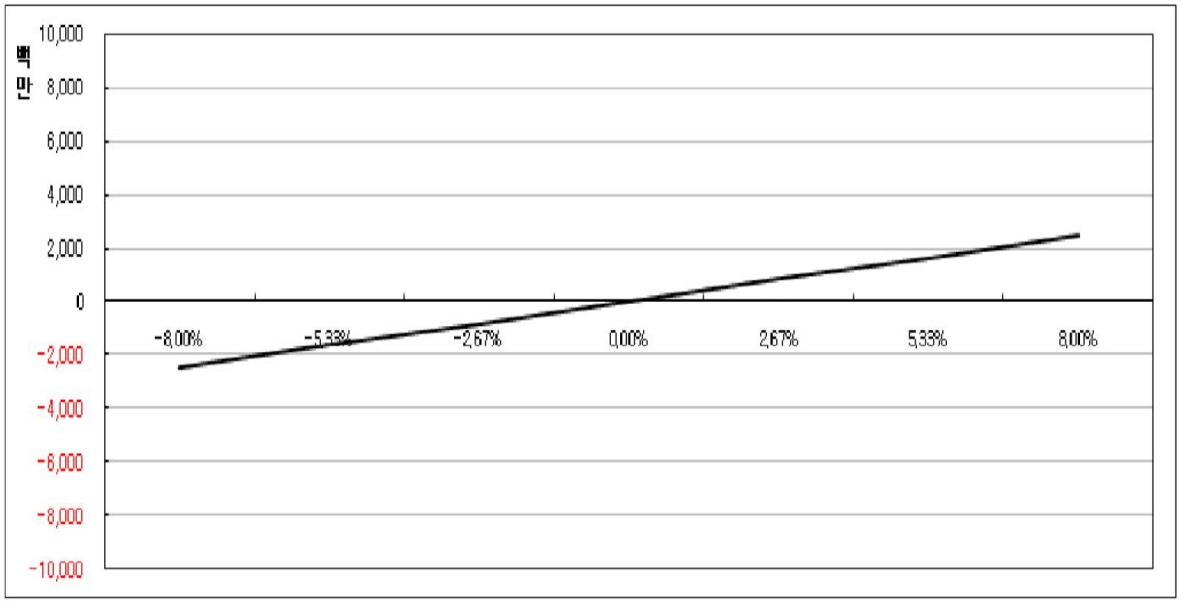
공시일: 2019-06-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	268	-134	장내
누계	주가지수	선물	5,019	0	5,019	장내
합계			5,019	0	5,019	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

401

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

928

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

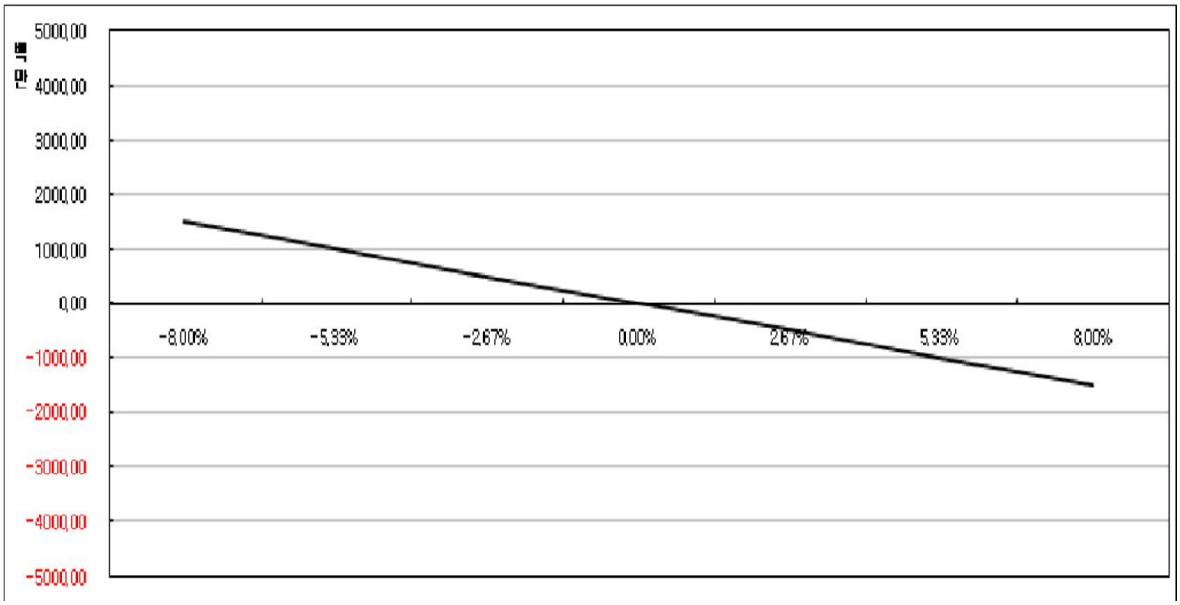
공시일: 2019-06-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	0	134	장내
누계	주가지수	선물	0	2,007	-2,007	장내
합계			0	2,007	-2,007	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

160

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

136

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

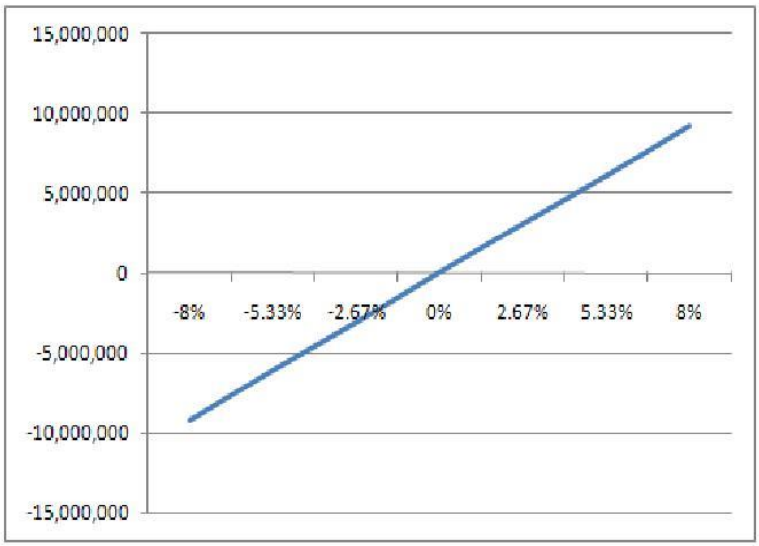
공시일: 2019-06-05

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	71,331	0	71,331	장내
합계			71,331	0	71,331	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,694

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,110