펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-07

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	3,350	0	3,350	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	7	1,608	-1,601	장내
합계			3,357	1,608	1,749	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	181

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	370

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

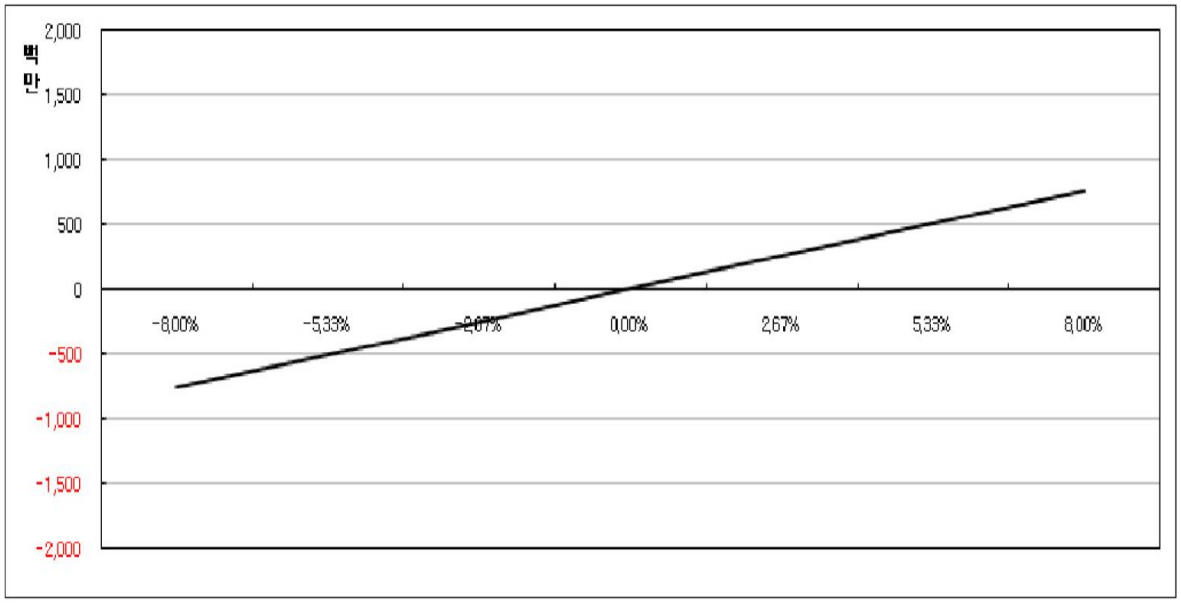
공시일: 2019-06-07

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)	390

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

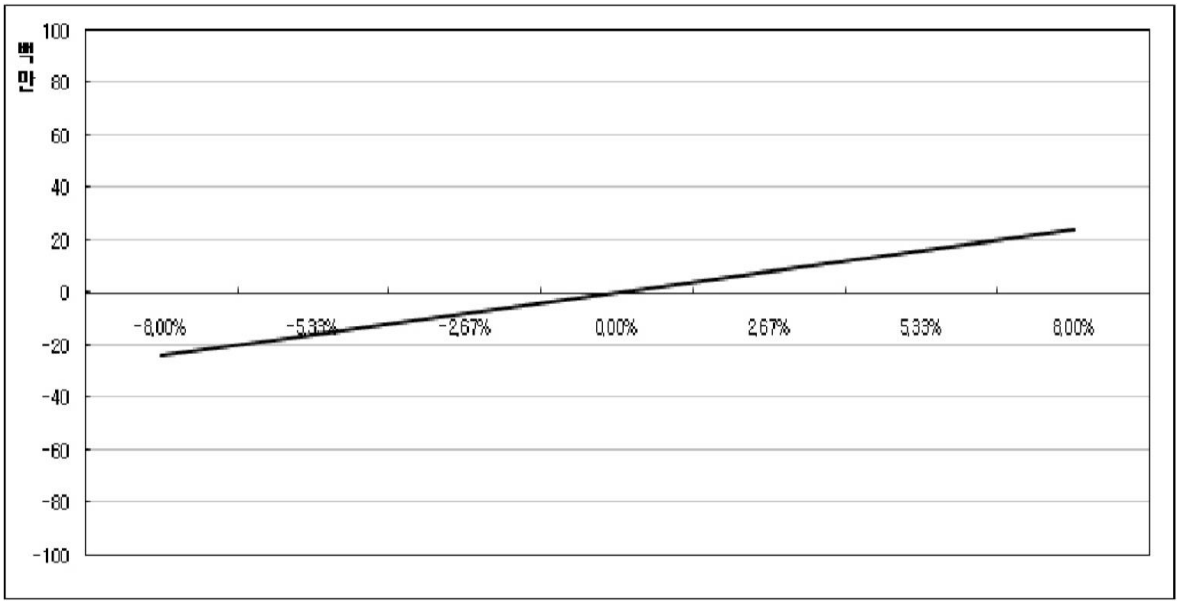
공시일: 2019-06-07

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)

461

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

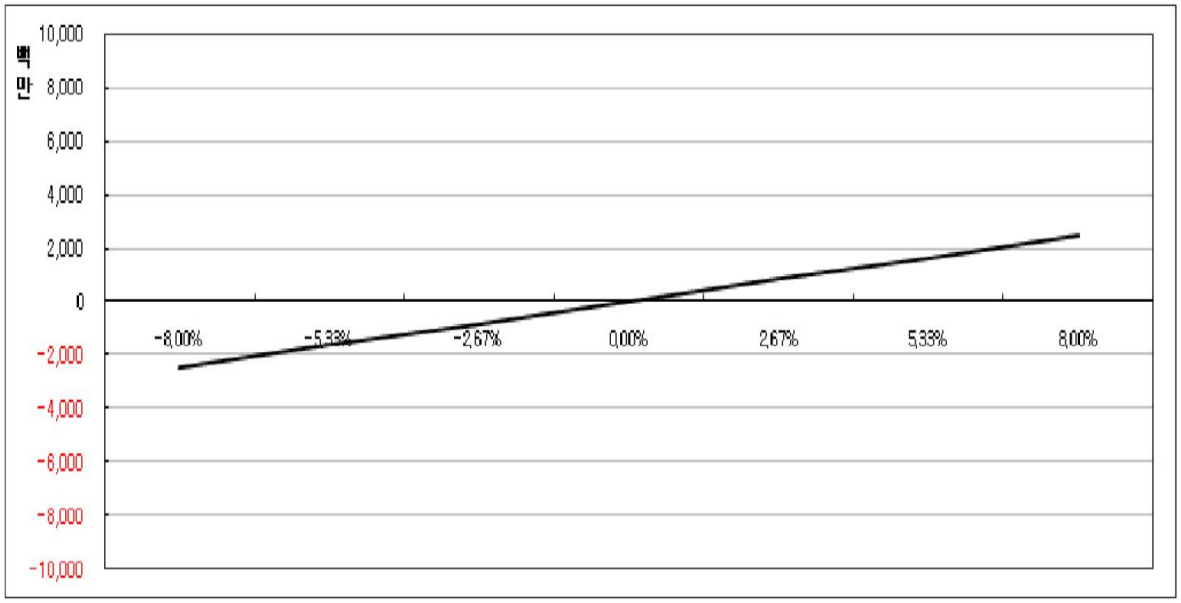
공시일: 2019-06-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	134	-134	장내
누계	주가지수	선물	4,891	0	4,891	장내
합계			4,891	0	4,891	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

391

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

921

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

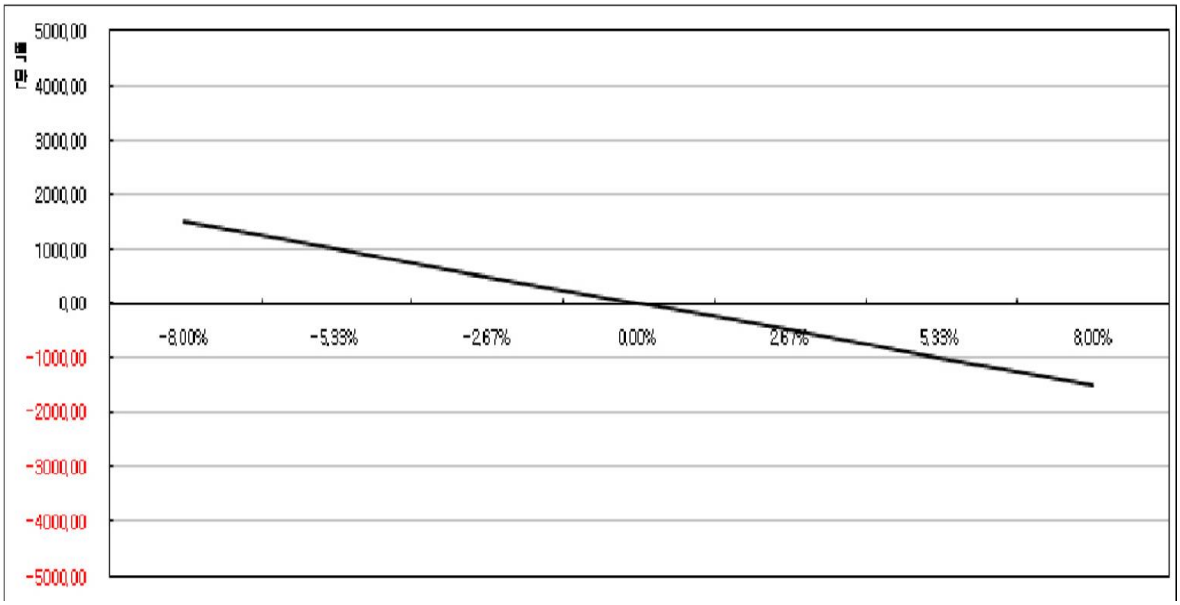
공시일: 2019-06-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	201	-201	장내
누계	주가지수	선물	0	2,211	-2,211	장내
합계			0	2,211	-2,211	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

177

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

150

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

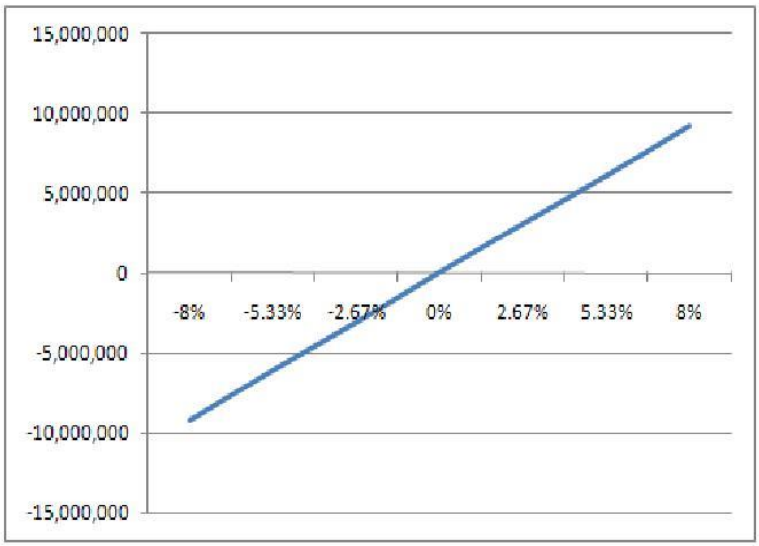
공시일: 2019-06-07

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	71,419	0	71,419	장내
합계			71,419	0	71,419	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,713

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,107