펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-12

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	3,415	0	3,415	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	0	0	장내
합계			3,415	0	3,415	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	206

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	412

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

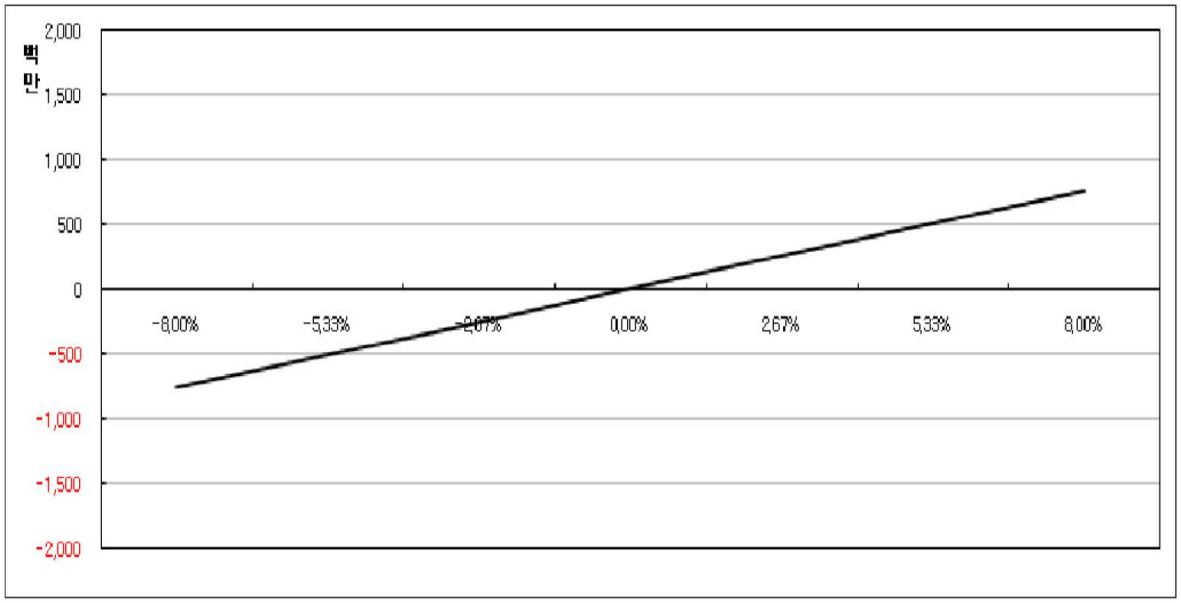
공시일: 2019-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	68	137	-68	장내
누계	주가지수	선물	137	0	137	장내
합계			137	0	137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

396

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

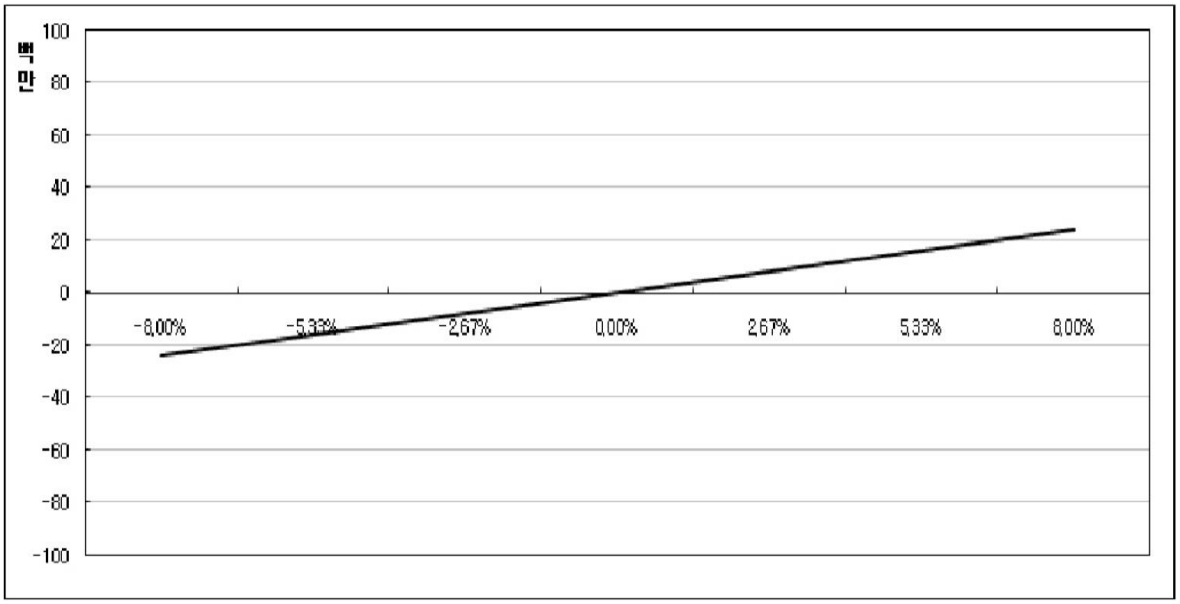
공시일: 2019-06-12

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	820	0	820	장내
합계			820	0	820	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 471

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

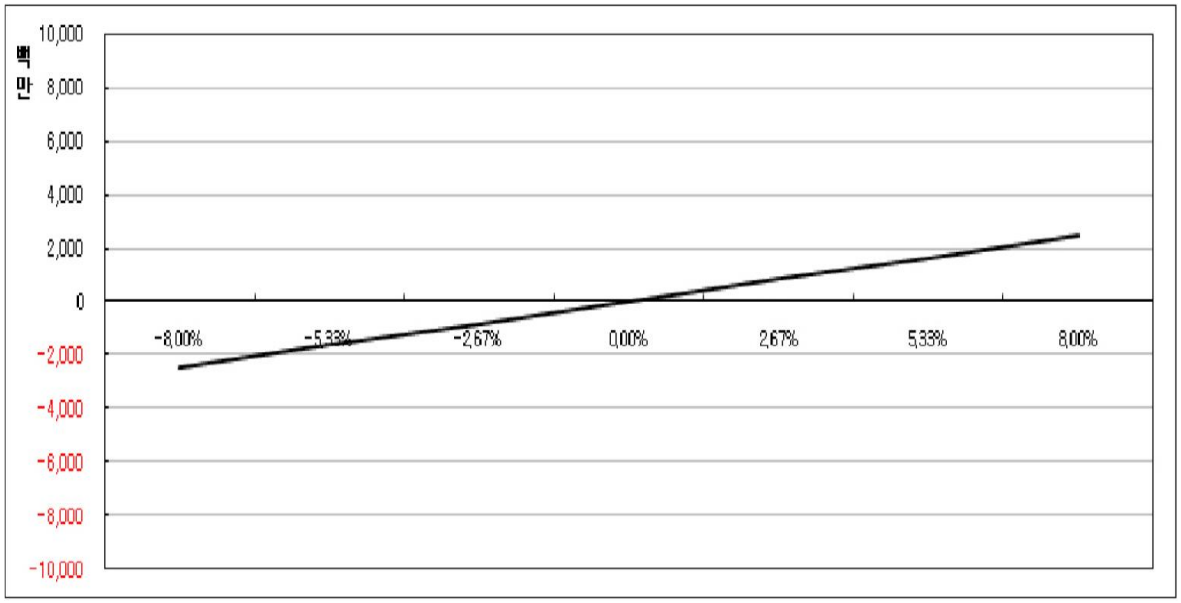
공시일: 2019-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	342	0	342	장내
누계	주가지수	선물	5,191	0	5,191	장내
합계			5,191	0	5,191	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

415

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

950

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

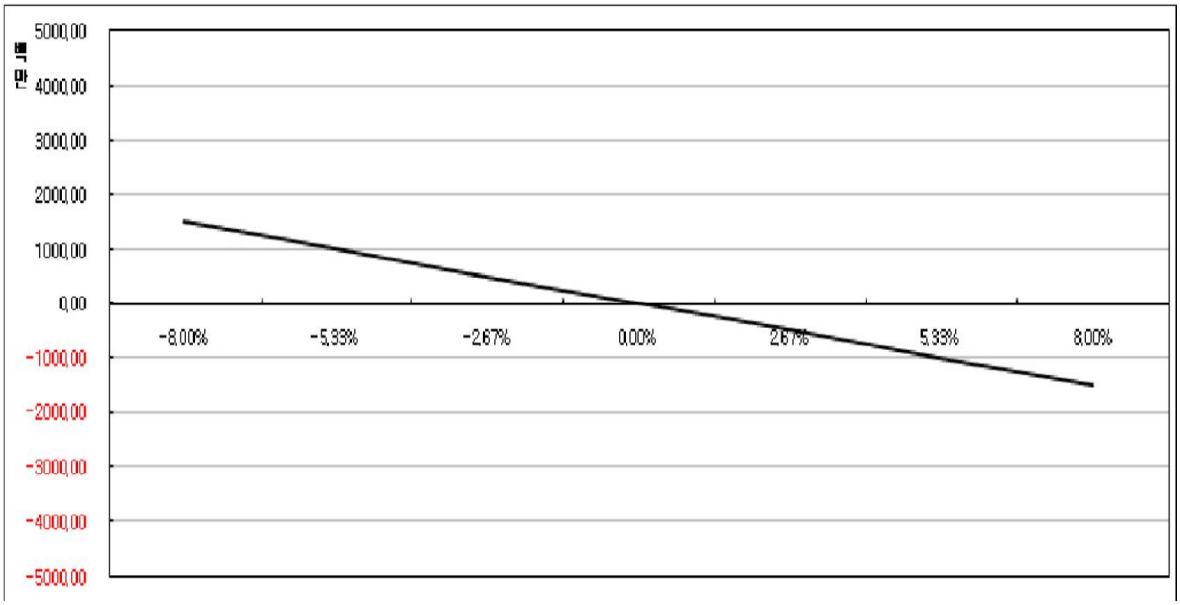
공시일: 2019-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	137	0	137	장내
누계	주가지수	선물	0	1,981	-1,981	장내
합계			0	1,981	-1,981	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

158

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

134

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

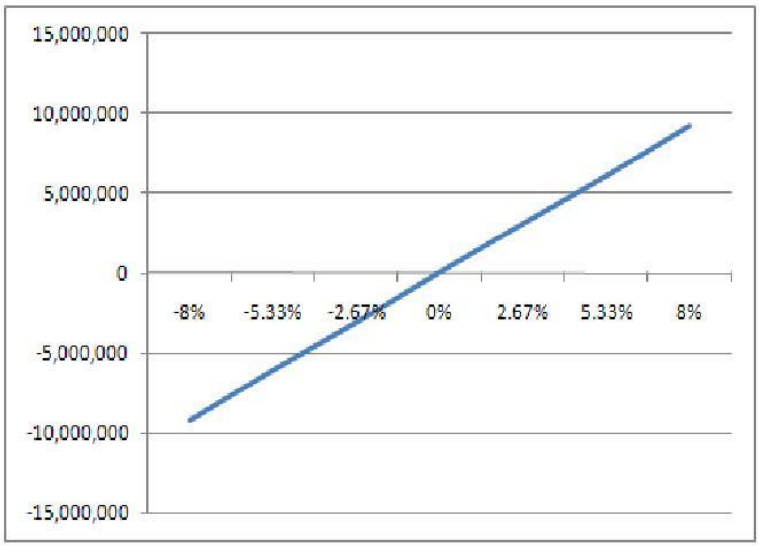
공시일: 2019-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	13,729	14,480	-751	장내
누계	주가지수	선물	72,674	0	72,674	장내
합계			72,674	0	72,674	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,814

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,283