펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-17

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	3,381	0	3,381	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	15	6,559	-6,544	장내
합계			3,396	6,559	-3,163	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	146

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	443

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

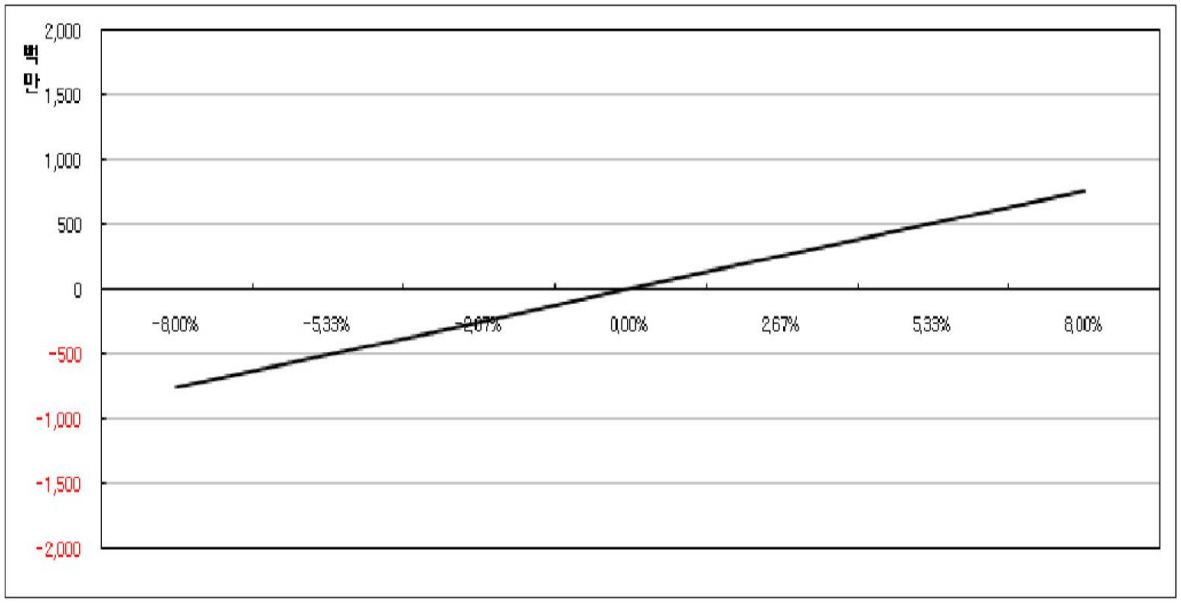
공시일: 2019-06-17

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	135	0	135	장내
합계			135	0	135	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

394

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

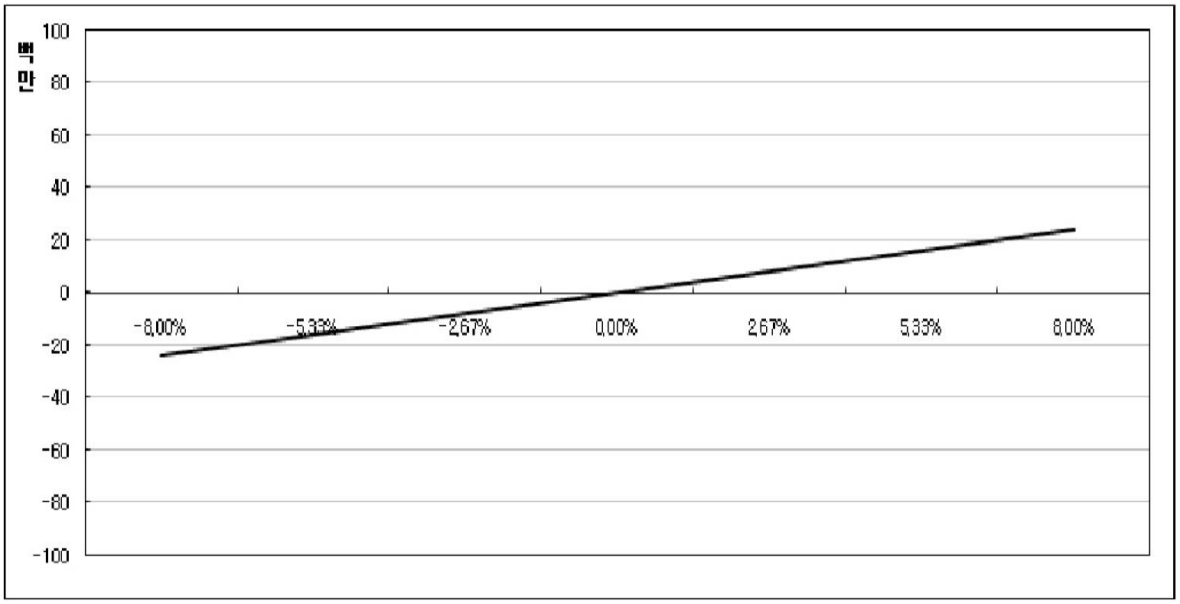
공시일: 2019-06-17

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	811	0	811	장내
합계			811	0	811	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

469

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

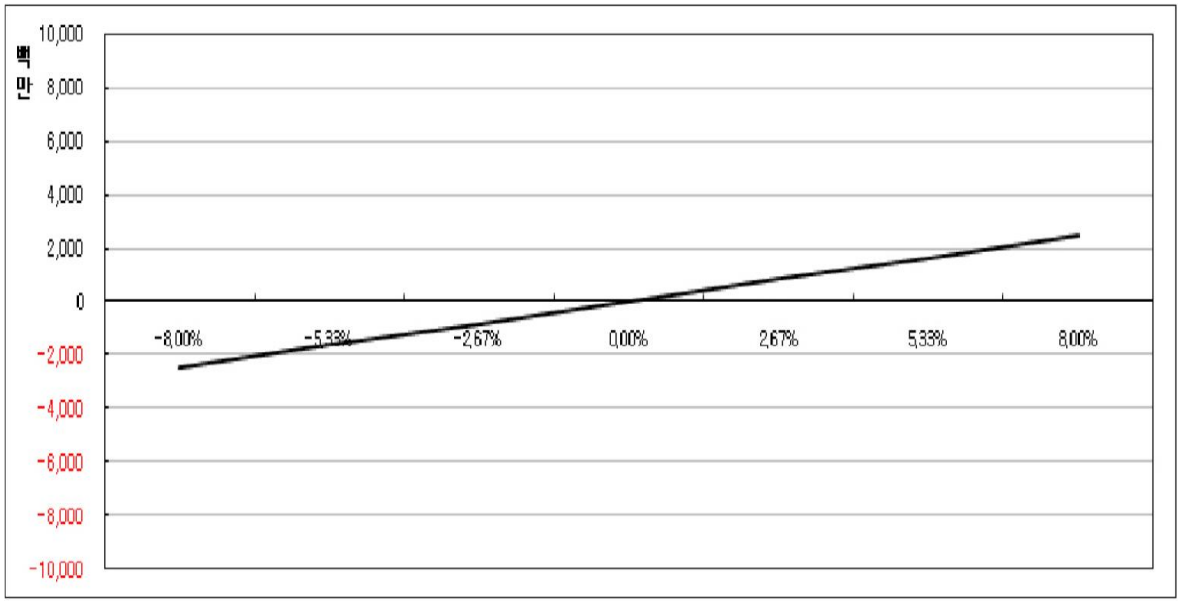
공시일: 2019-06-17

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	4,869	0	4,869	장내
합계			4,869	0	4,869	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

389

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

931

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

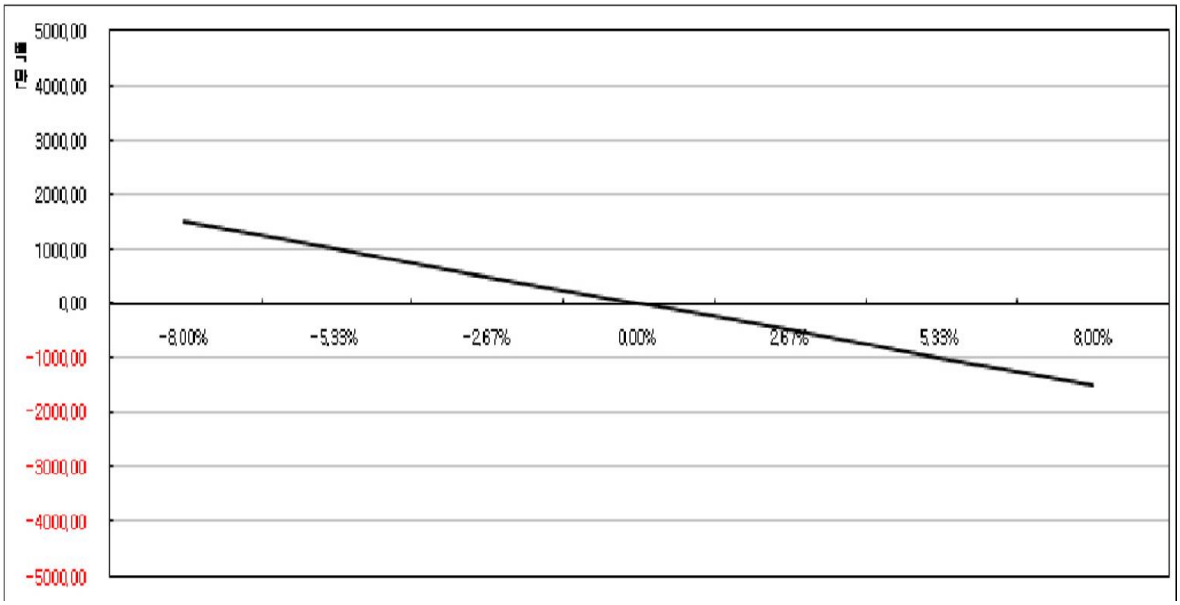
공시일: 2019-06-17

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	2,231	-2,231	장내
합계			0	2,231	-2,231	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	178

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	150

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

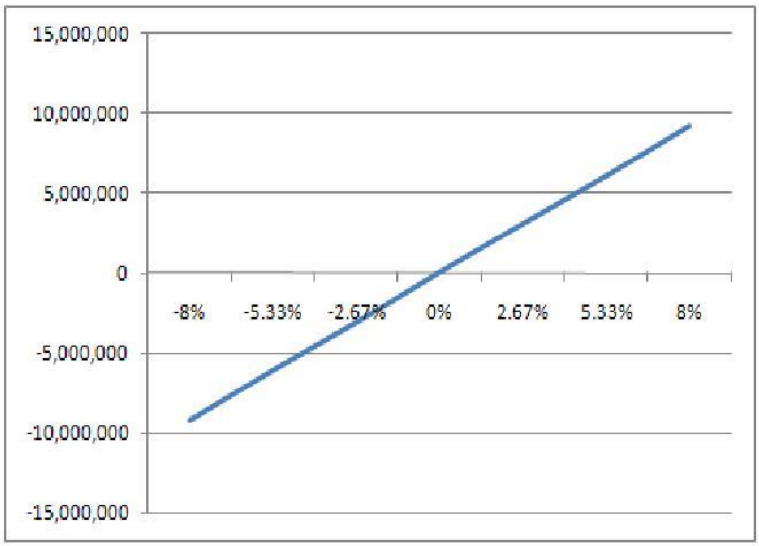
공시일: 2019-06-17

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	71,474	0	71,474	장내
합계			71,474	0	71,474	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,707

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,115