펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-18

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	3,376	0	3,376	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	14	6,550	-6,536	장내
합계			3,390	6,550	-3,160	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

136

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

427

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

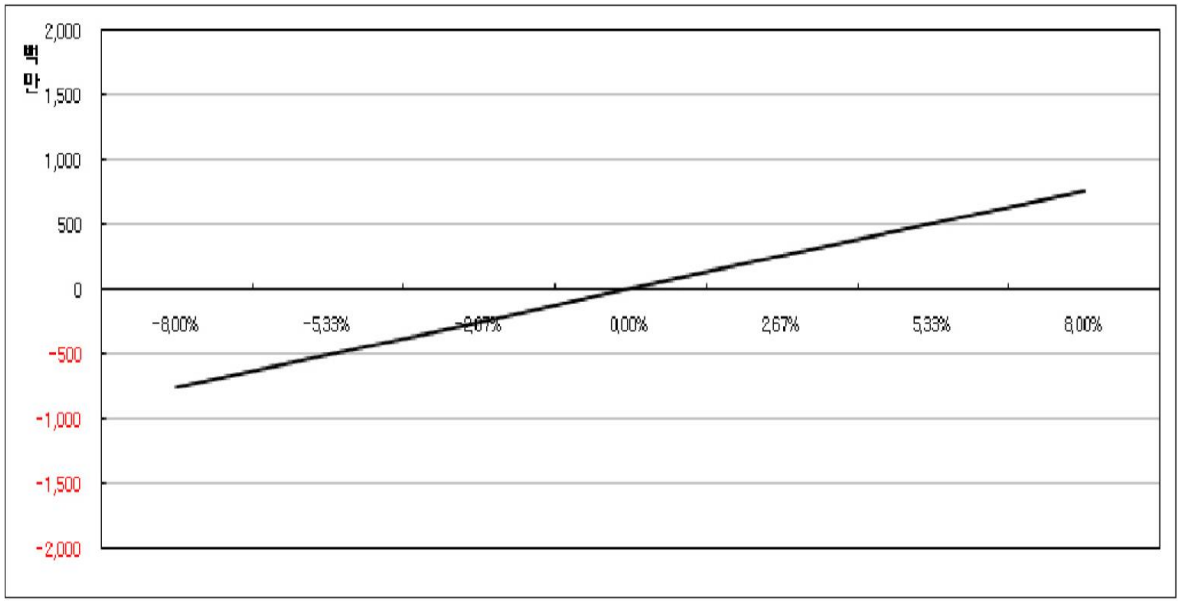
공시일: 2019-06-18

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)	392

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

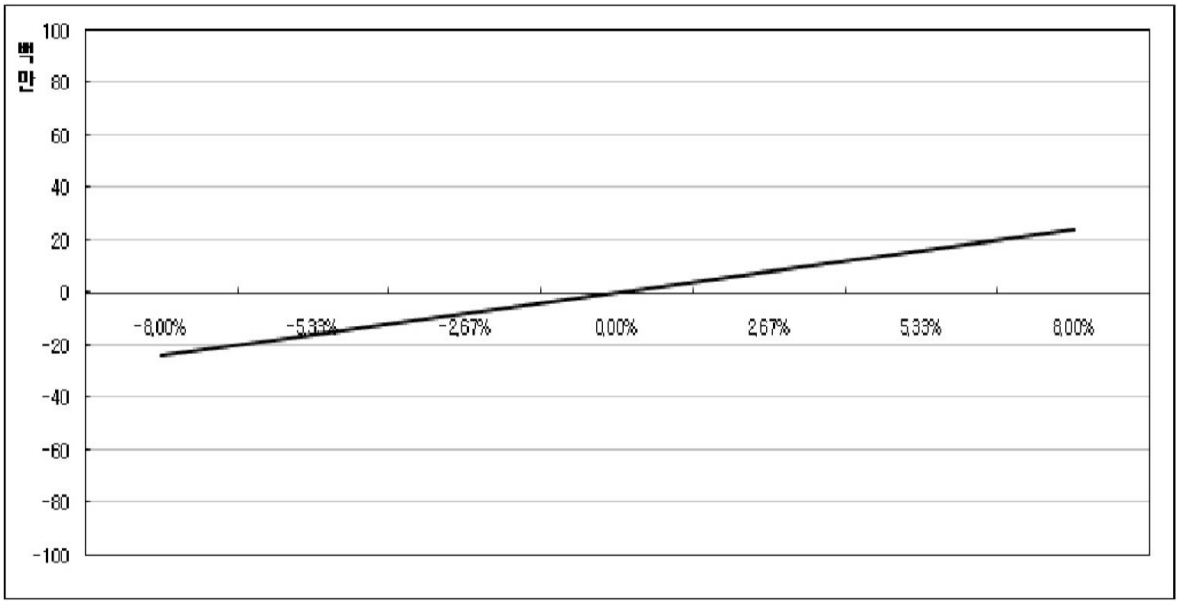
공시일: 2019-06-18

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	810	0	810	장내
합계			810	0	810	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

466

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

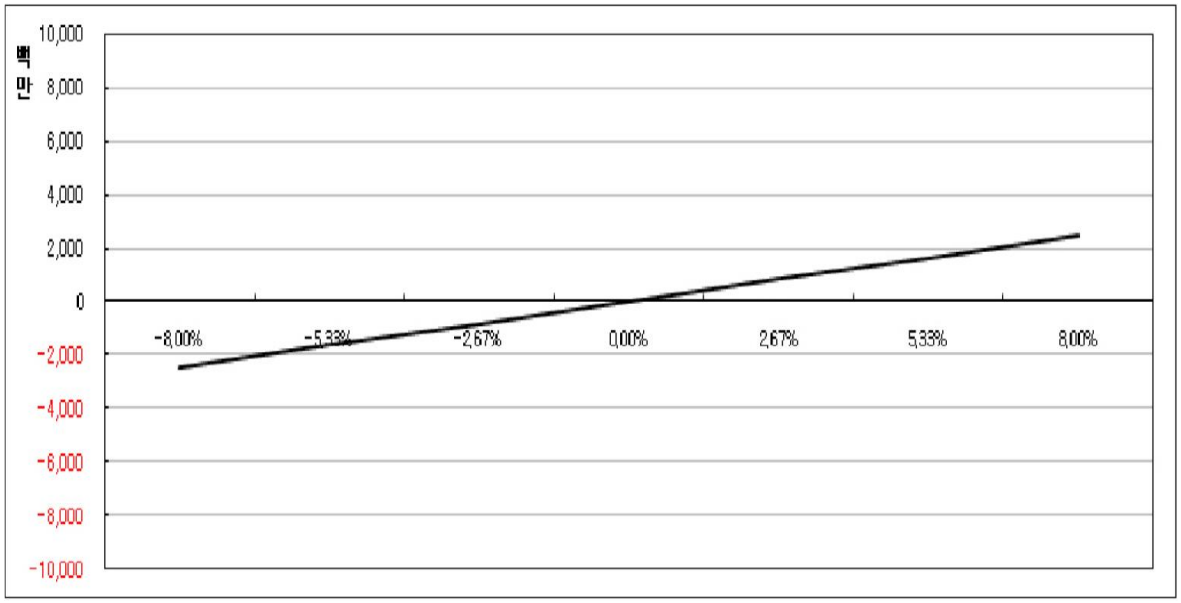
공시일: 2019-06-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	135	0	135	장내
누계	주가지수	선물	4,997	0	4,997	장내
합계			4,997	0	4,997	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

400

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

931

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

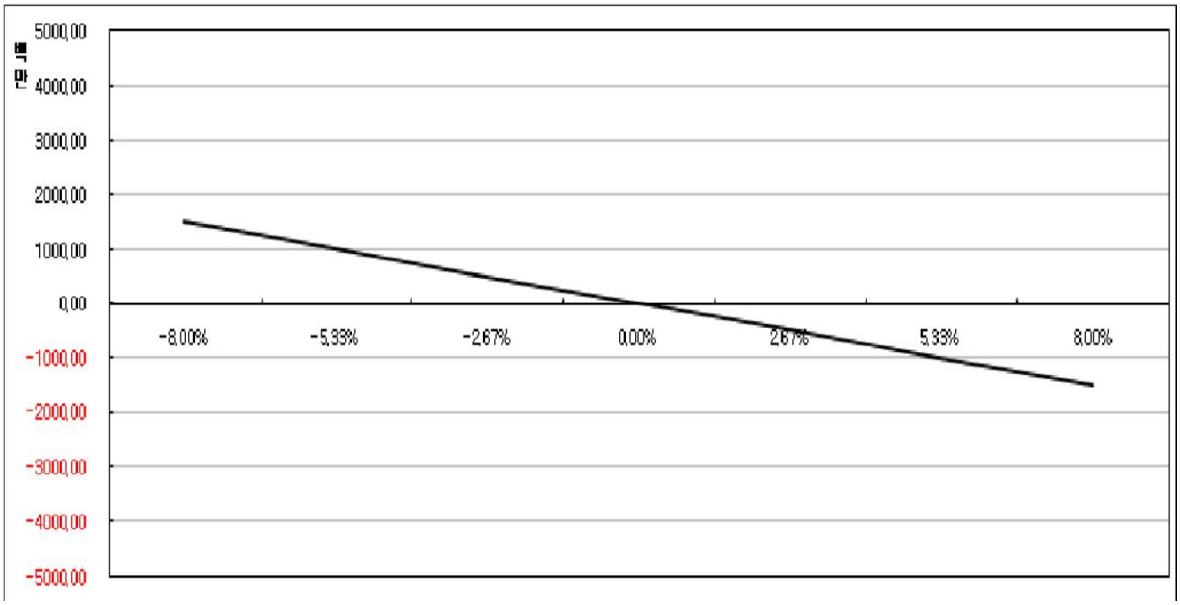
공시일: 2019-06-18

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	2,228	-2,228	장내
합계			0	2,228	-2,228	

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]

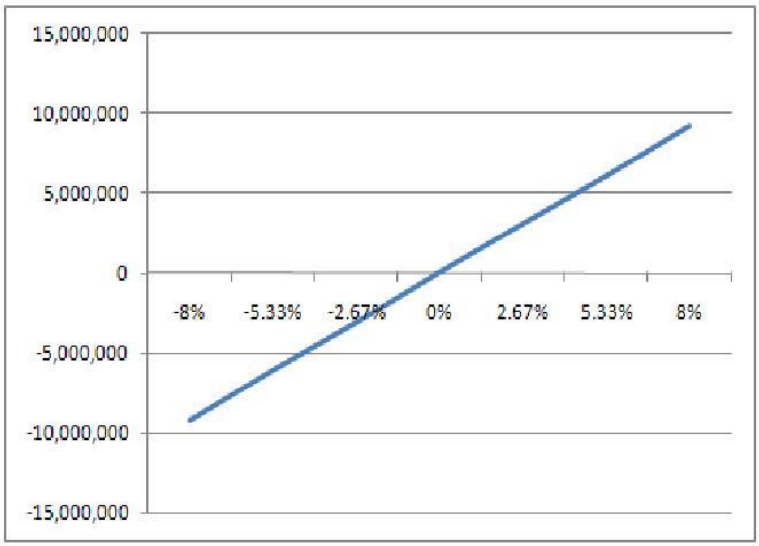
공시일: 2019-06-18

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	71,371	0	71,371	장내
합계			71,371	0	71,371	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,713

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,053