펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-19

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	3,392	0	3,392	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	6,580	-6,570	장내
합계			3,402	6,580	-3,178	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	152

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	501

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

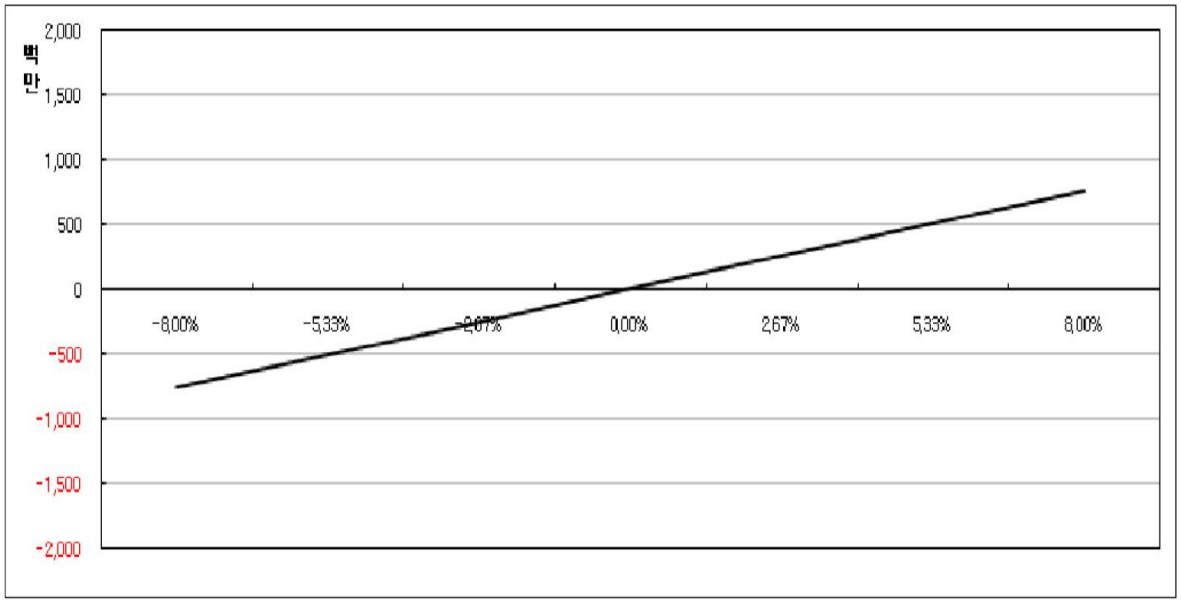
공시일: 2019-06-19

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	136	0	136	장내
합계			136	0	136	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	391

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

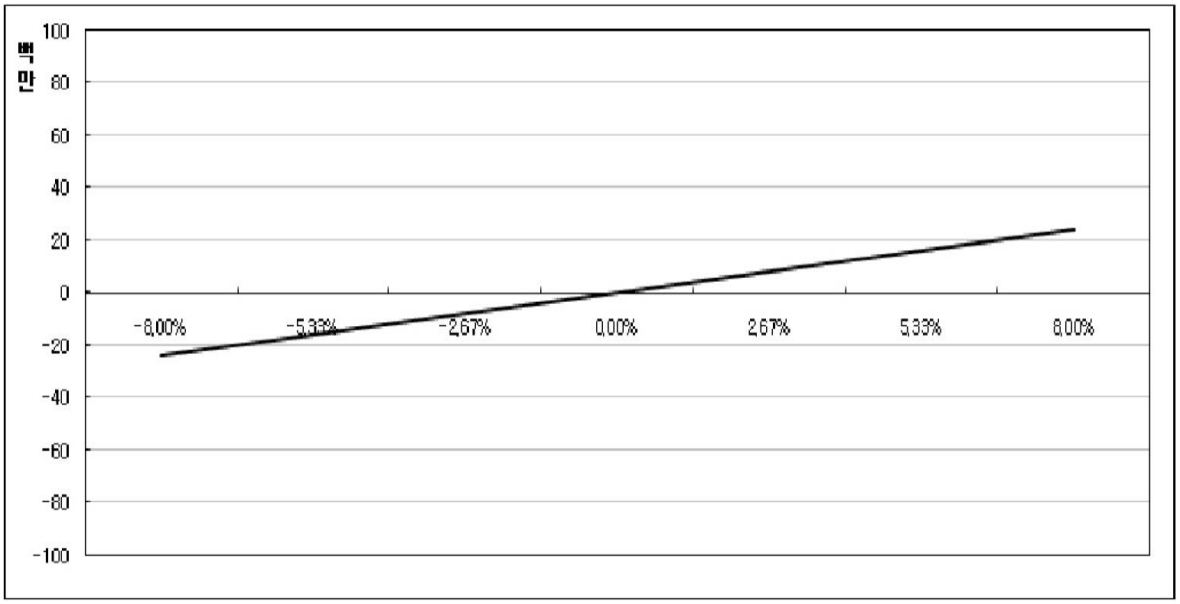
공시일: 2019-06-19

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	814	0	814	장내
합계			814	0	814	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

465

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

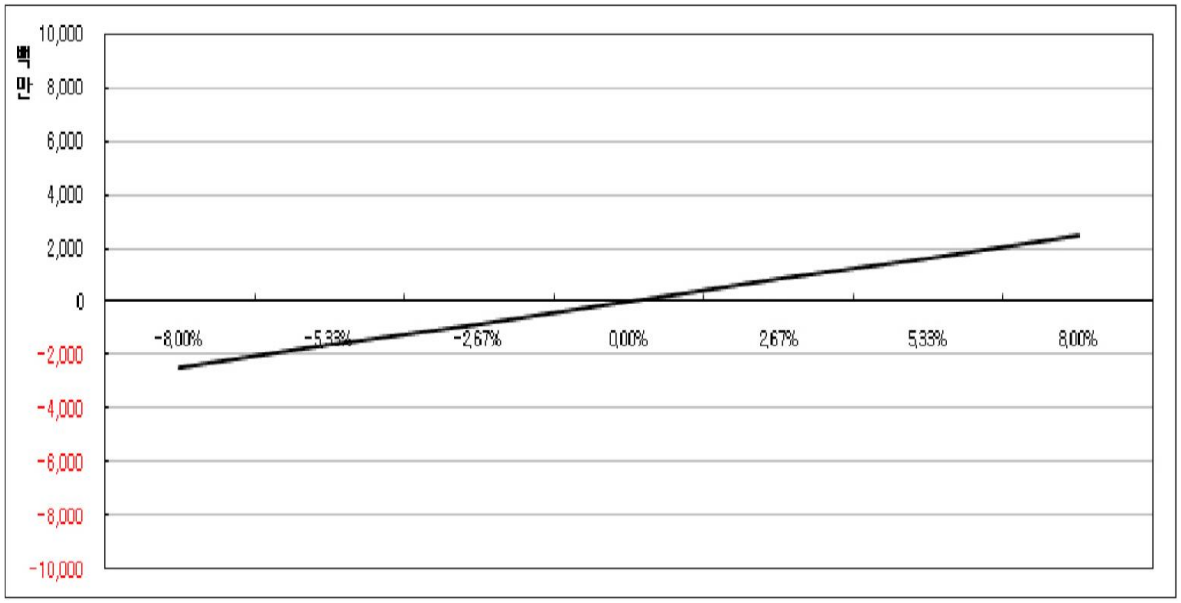
공시일: 2019-06-19

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	5,020	0	5,020	장내
합계			5,020	0	5,020	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

402

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

929

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

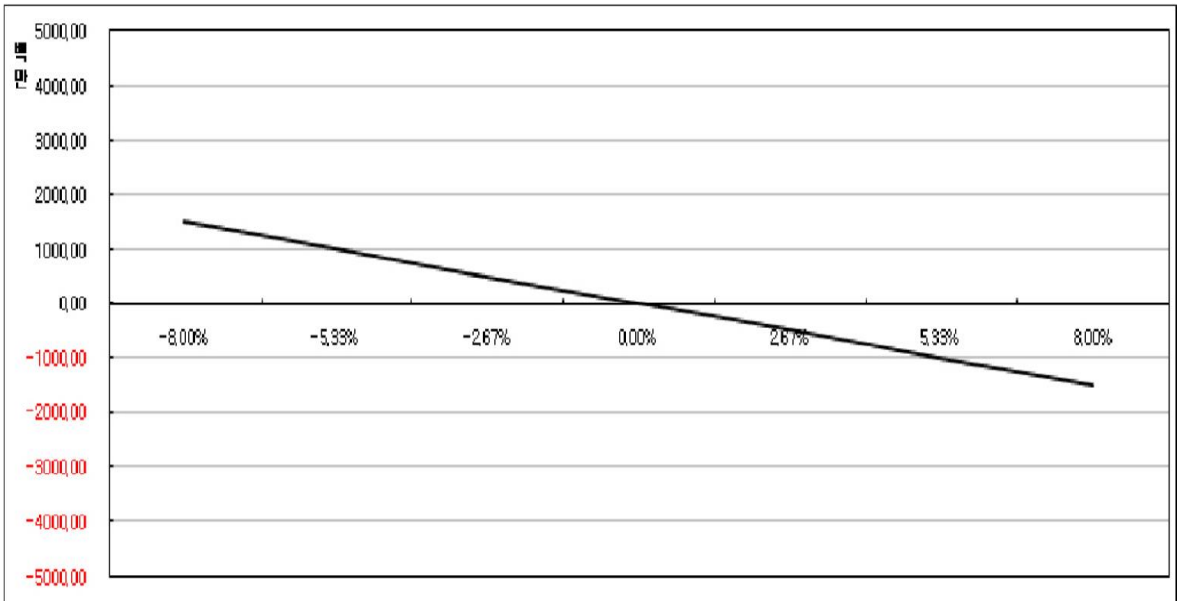
공시일: 2019-06-19

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	2,239	-2,239	장내
합계			0	2,239	-2,239	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

179

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

150

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

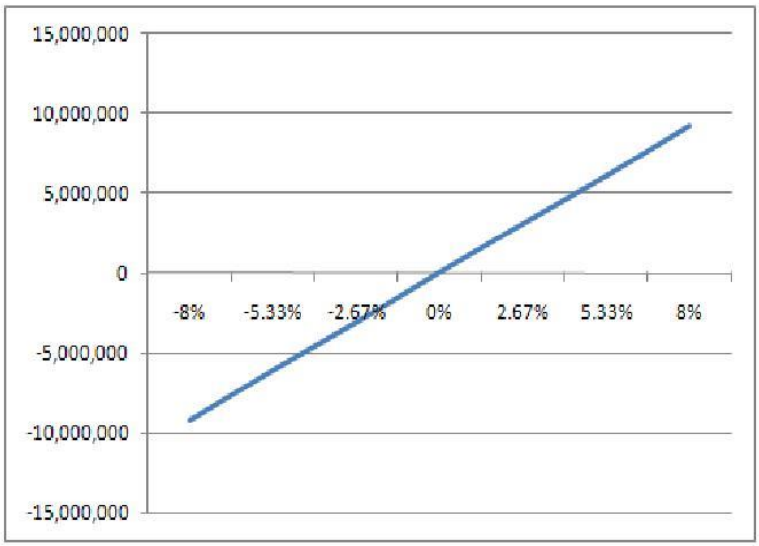
공시일: 2019-06-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	204	0	204	장내
누계	주가지수	선물	71,910	0	71,910	장내
합계			71,910	0	71,910	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,759

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,050