펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-20

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	3,441	0	3,441	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	6,676	-6,671	장내
합계			3,447	6,676	-3,229	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	206

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	780

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

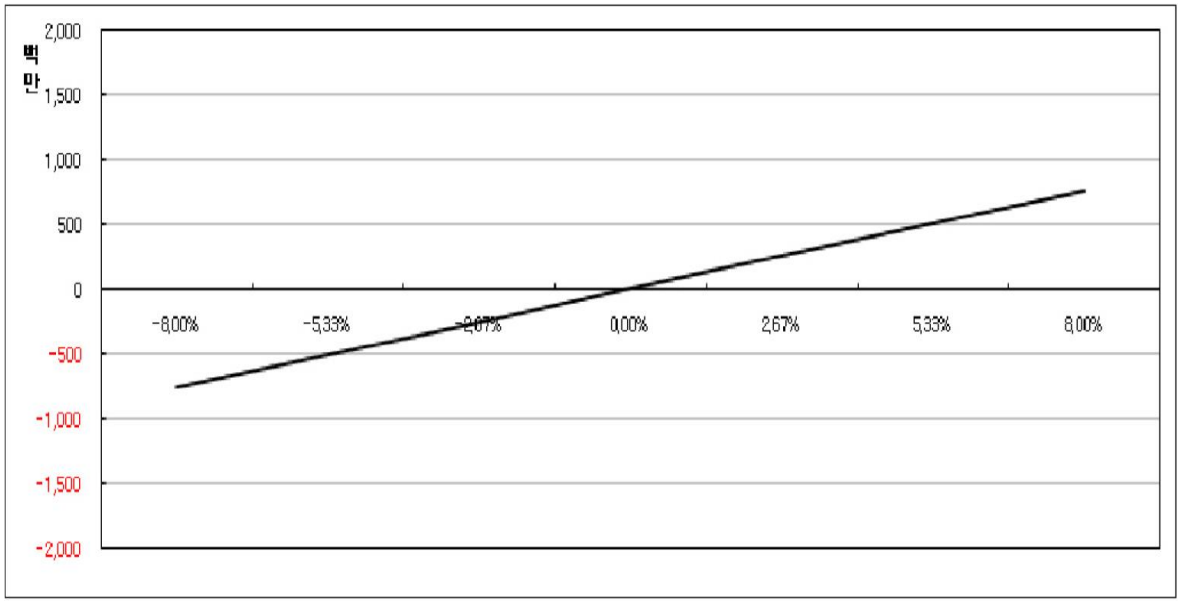
공시일: 2019-06-20

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	138	0	138	장내
합계			138	0	138	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	399

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

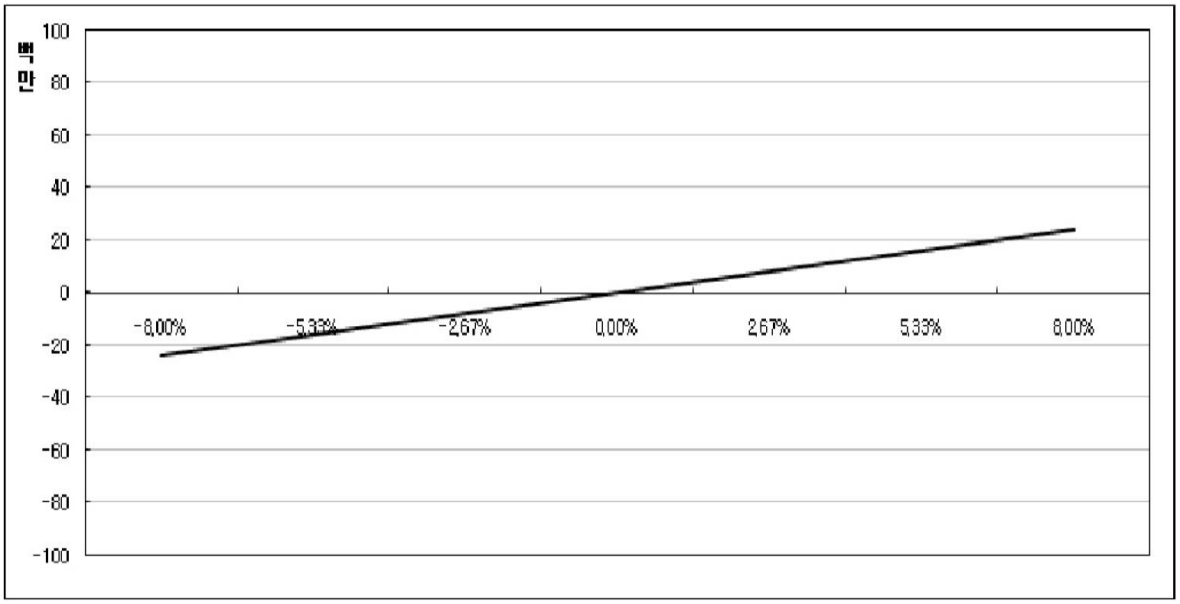
공시일: 2019-06-20

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	826	0	826	장내
합계			826	0	826	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

474

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

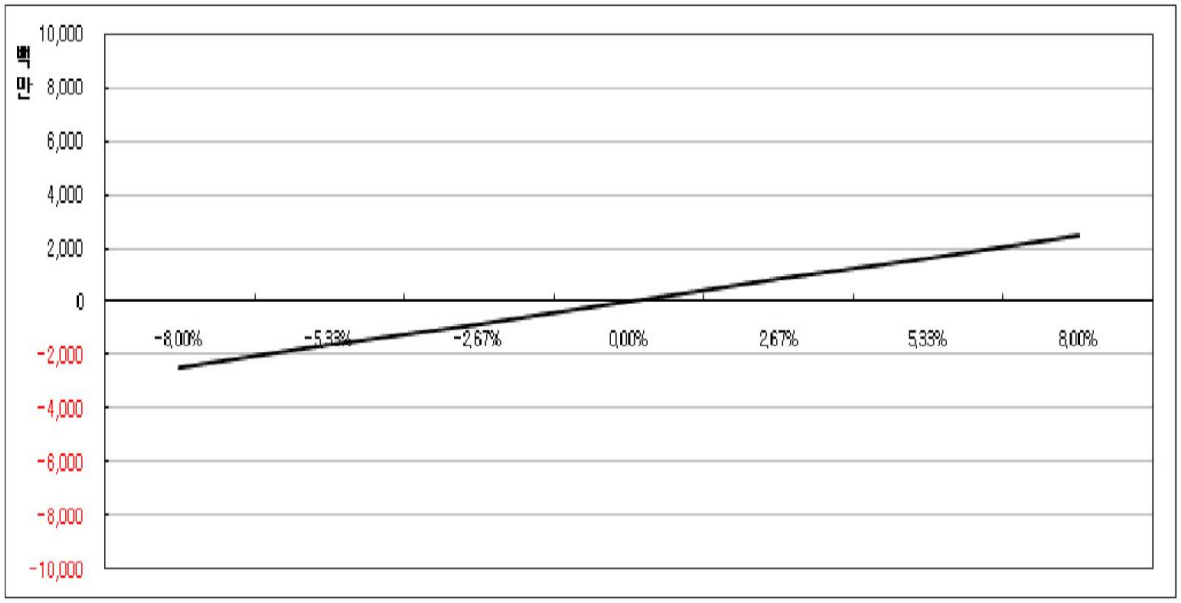
공시일: 2019-06-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	206	0	206	장내
누계	주가지수	선물	5,300	0	5,300	장내
합계			5,300	0	5,300	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

423

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

957

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

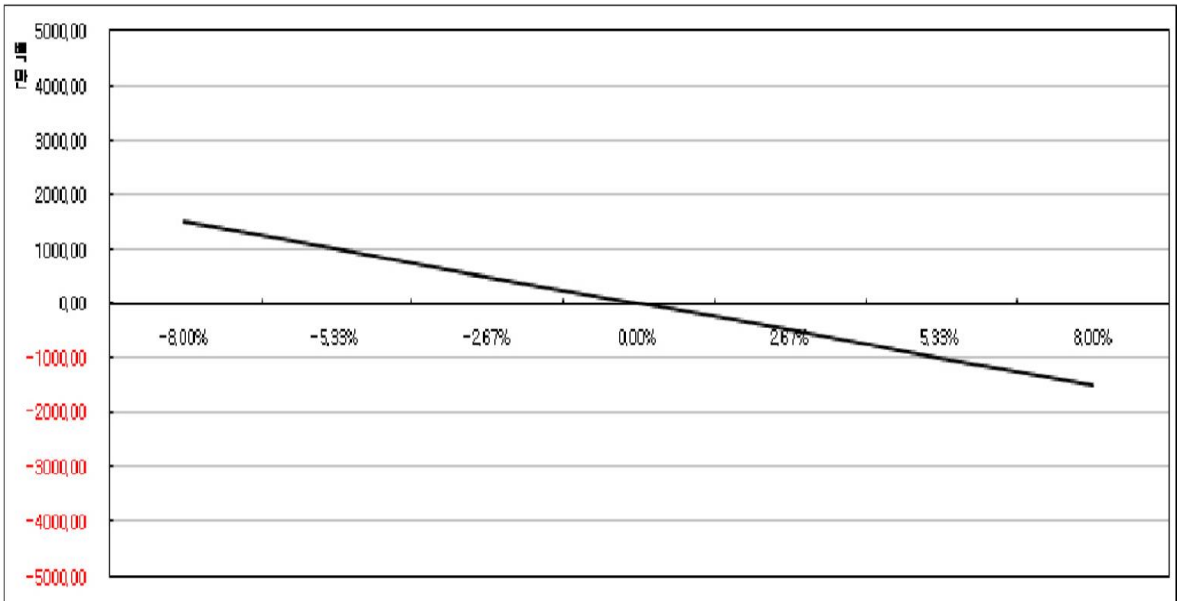
공시일: 2019-06-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	206	0	206	장내
누계	주가지수	선물	0	2,065	-2,065	장내
합계			0	2,065	-2,065	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

165

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

139

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

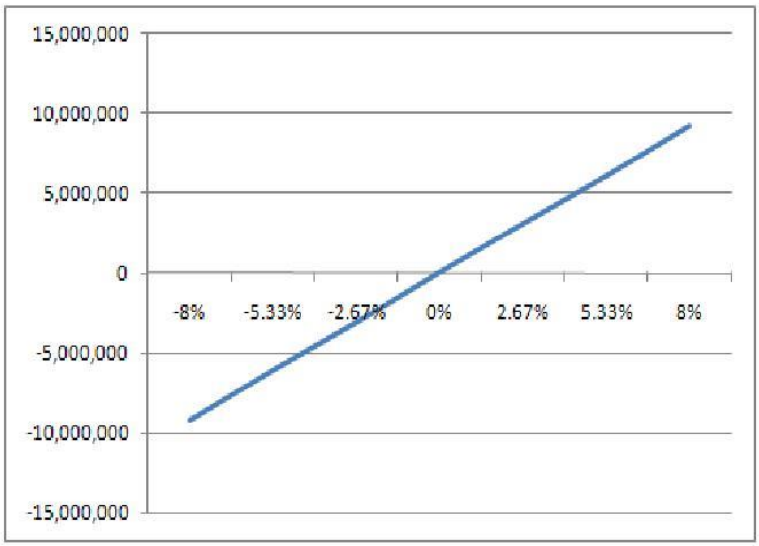
공시일: 2019-06-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	413	0	413	장내
누계	주가지수	선물	73,370	0	73,370	장내
합계			73,370	0	73,370	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,860

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,238