펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	345	-345	장내
누계	주가지수	선물	3,105	0	3,105	장내
신규	주가지수	옵션	8	0	8	장내
누계	주가지수	옵션	4	6,210	-6,207	장내
합계			3,109	6,210	-3,102	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	203

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	782

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

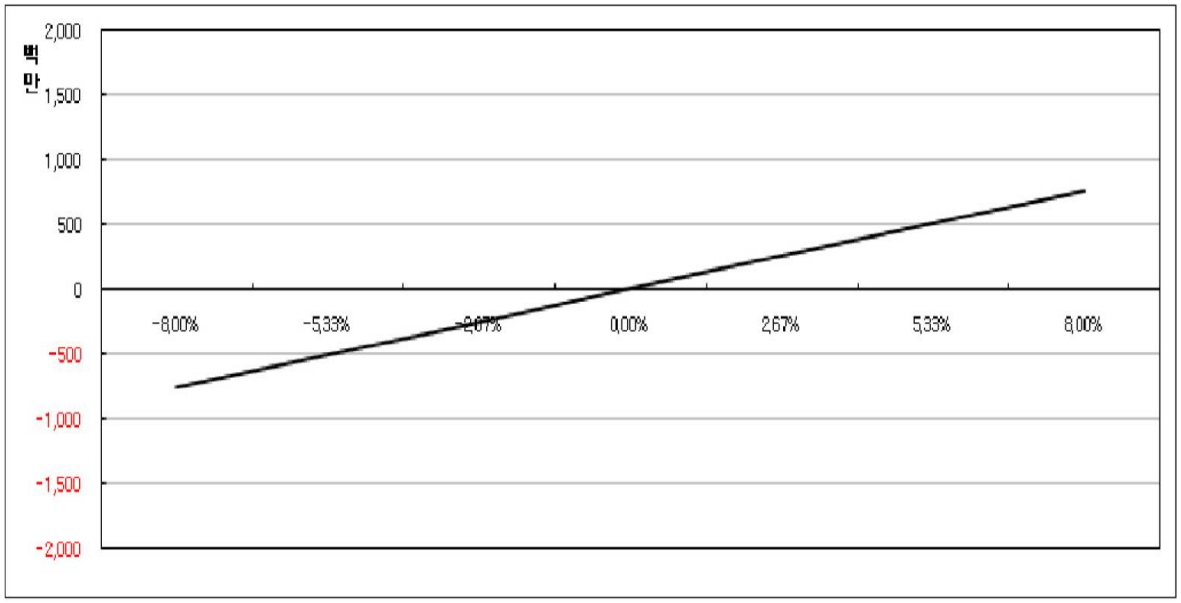
공시일: 2019-06-21

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)	400

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

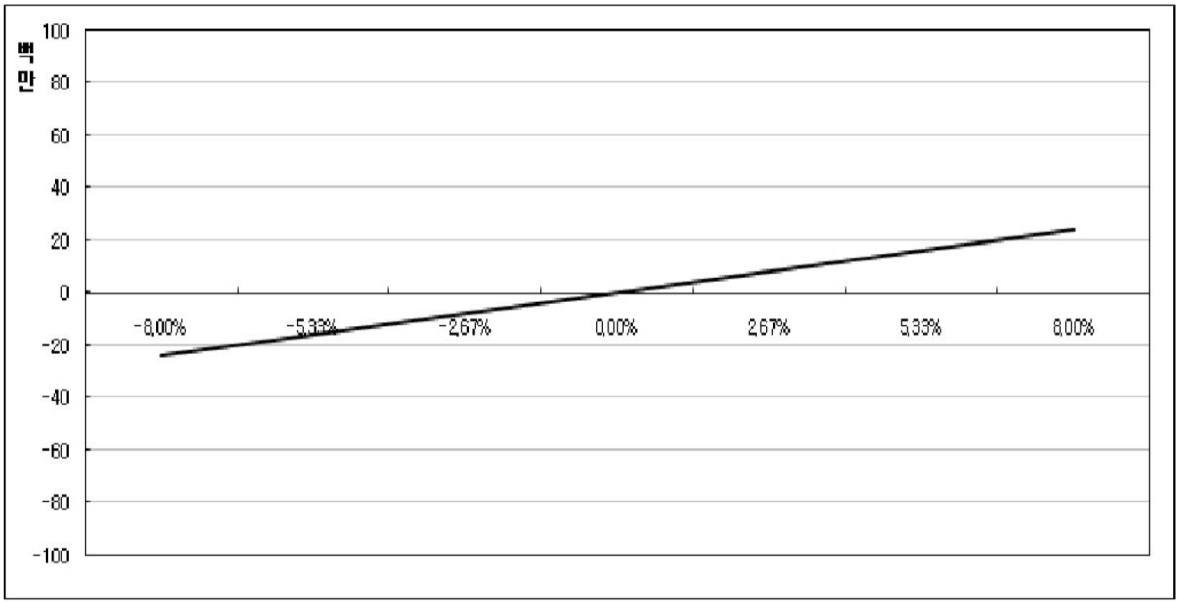
공시일: 2019-06-21

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	828	0	828	장내
합계			828	0	828	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

475

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

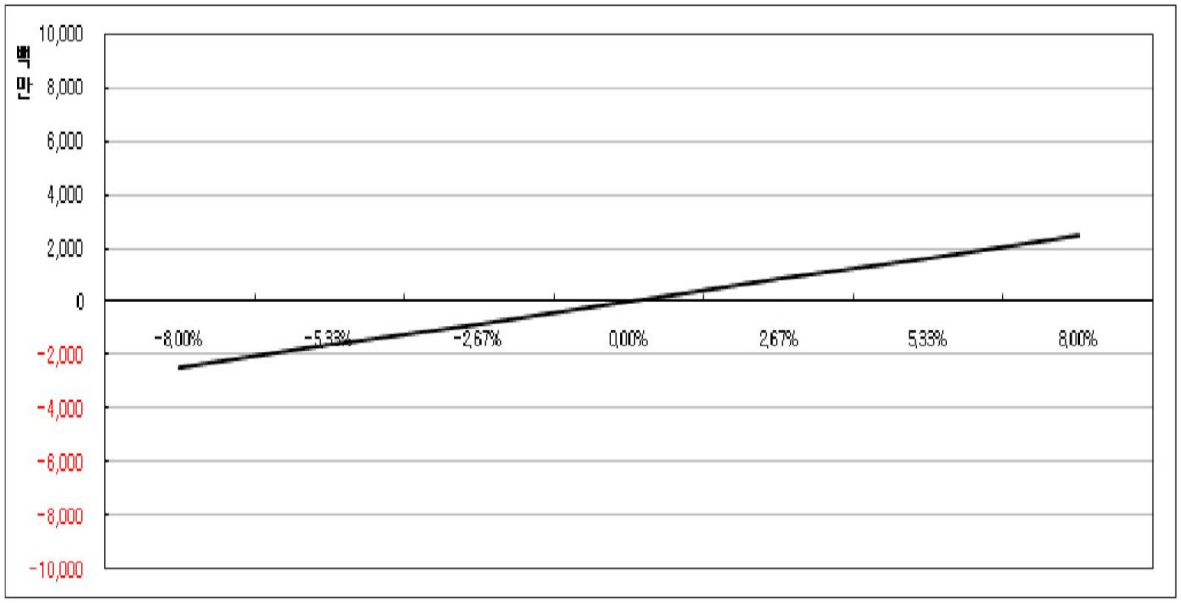
공시일: 2019-06-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	276	-276	장내
누계	주가지수	선물	5,037	0	5,037	장내
합계			5,037	0	5,037	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

403

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

945

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

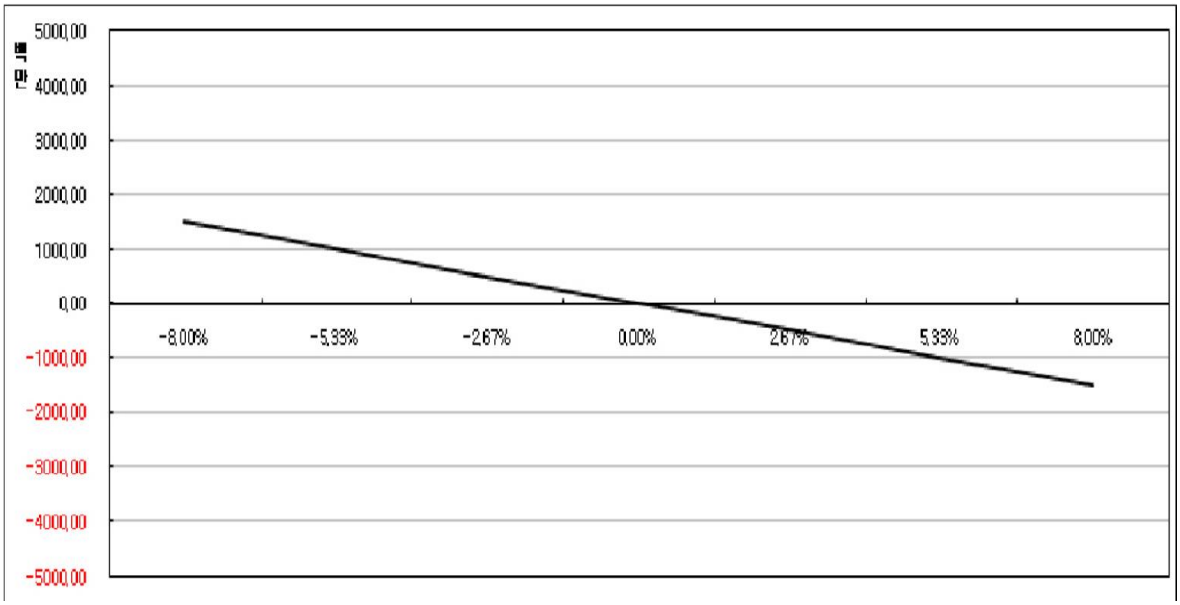
공시일: 2019-06-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	69	0	69	장내
누계	주가지수	선물	0	2,001	-2,001	장내
합계			0	2,001	-2,001	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

160

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

135

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

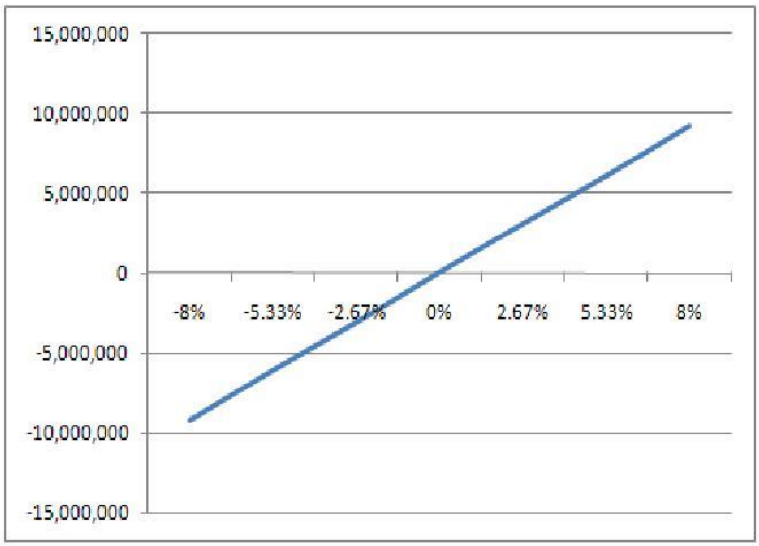
공시일: 2019-06-21

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	73,557	0	73,557	장내
합계			73,557	0	73,557	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,886

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,257