펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-27

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	3,100	0	3,100	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	6,199	-6,197	장내
합계			3,103	6,199	-3,097	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	201

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	517

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

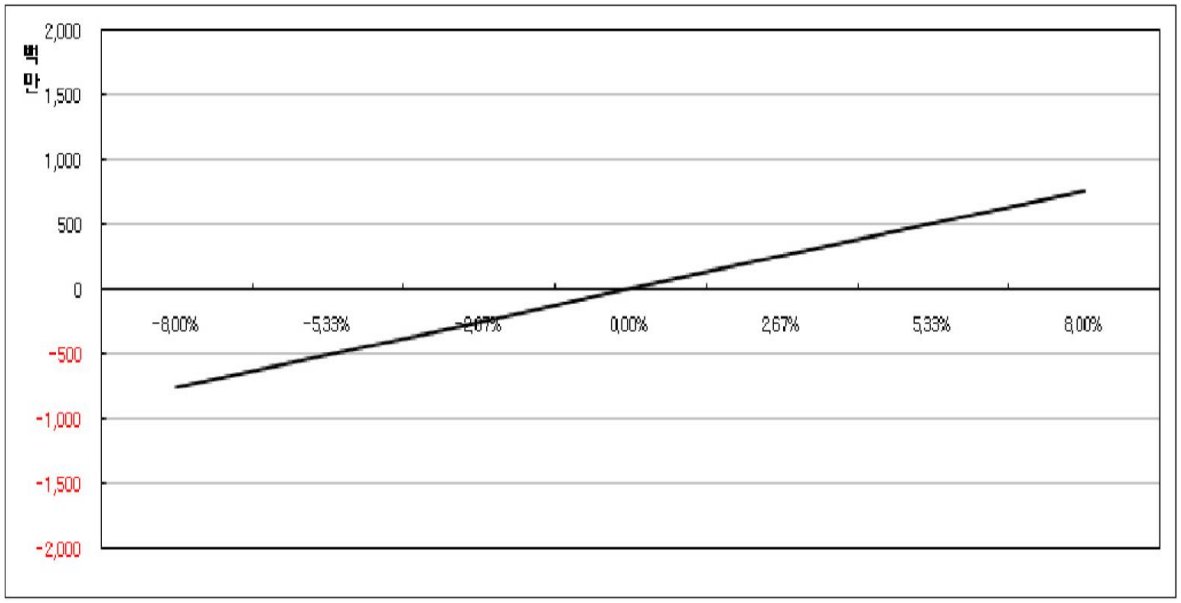
공시일: 2019-06-27

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)	397

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

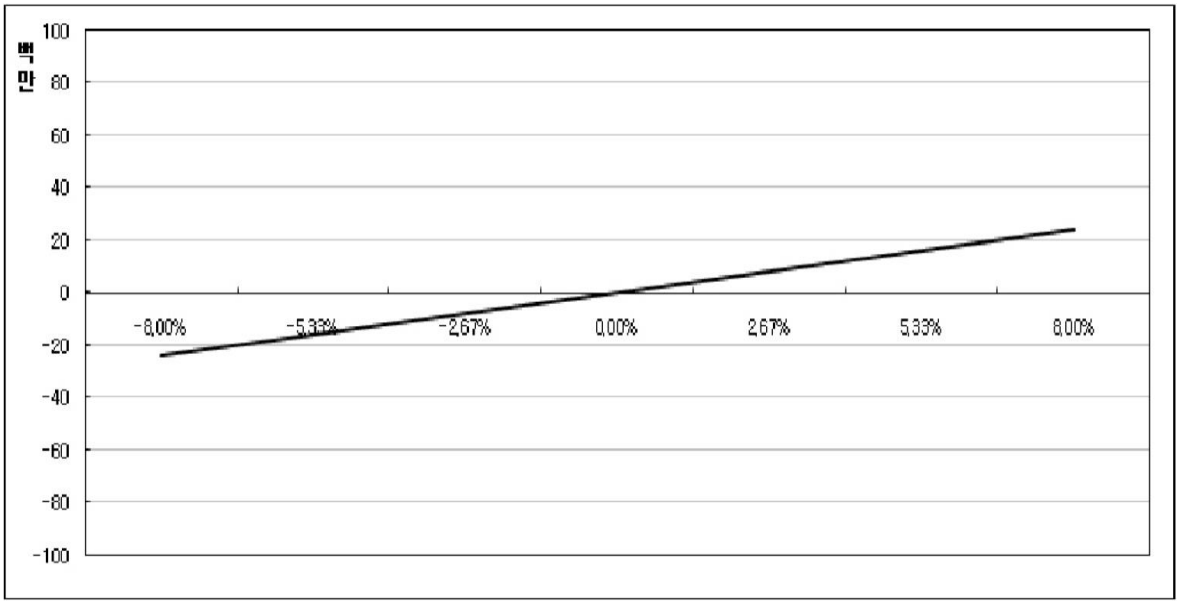
공시일: 2019-06-27

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	827	0	827	장내
합계			827	0	827	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 473

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

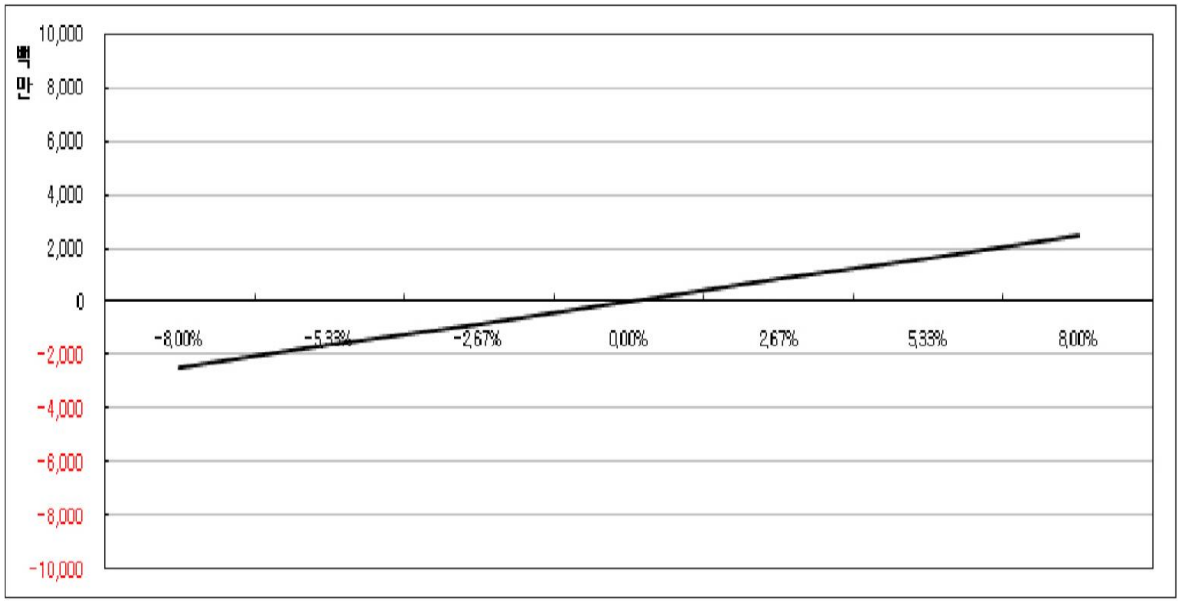
공시일: 2019-06-27

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	4,684	0	4,684	장내
합계			4,684	0	4,684	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

375

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

925

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

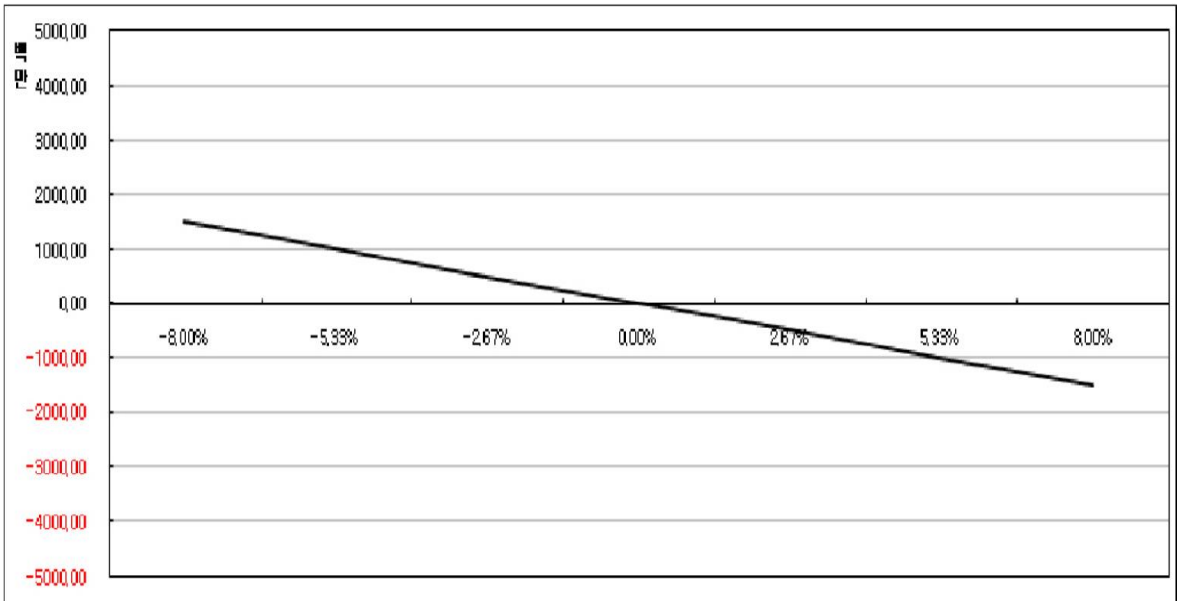
공시일: 2019-06-27

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	2,273	-2,273	장내
합계			0	2,273	-2,273	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	182

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	152

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

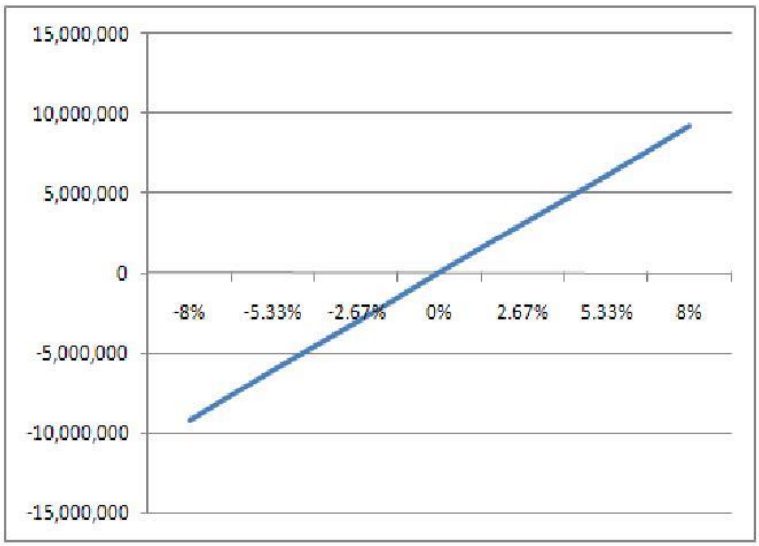
공시일: 2019-06-27

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	73,084	0	73,084	장내
합계			73,084	0	73,084	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,851

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,217