펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-06-28

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	3,125	0	3,125	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	6,249	-6,248	장내
합계			3,126	6,249	-3,123	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	213

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	752

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

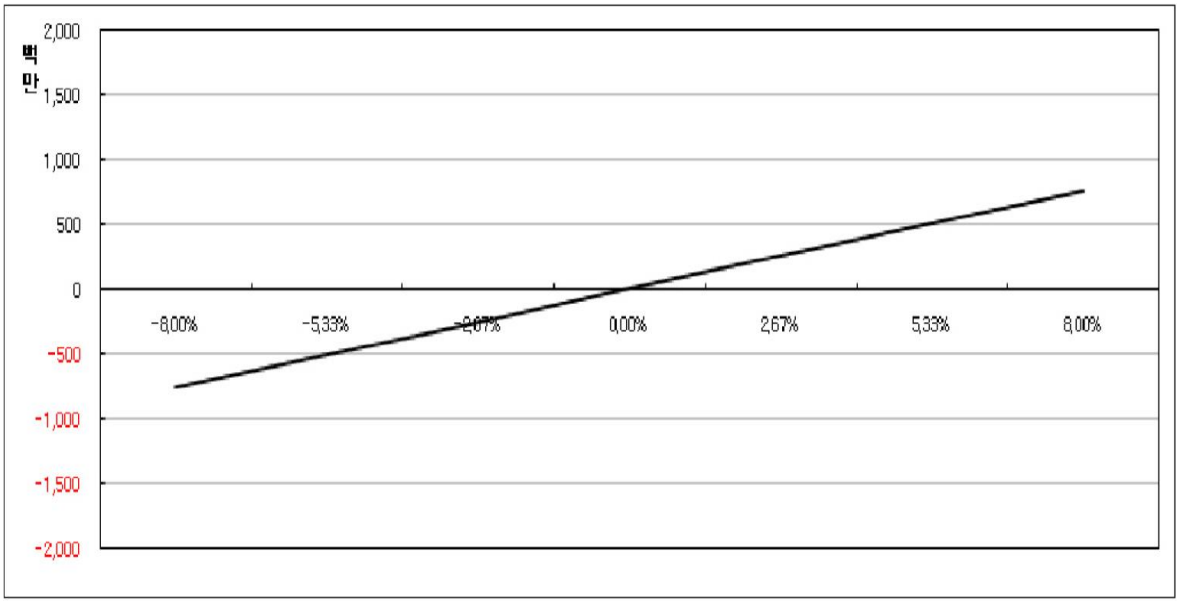
공시일: 2019-06-28

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	139	0	139	장내
합계			139	0	139	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	402

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

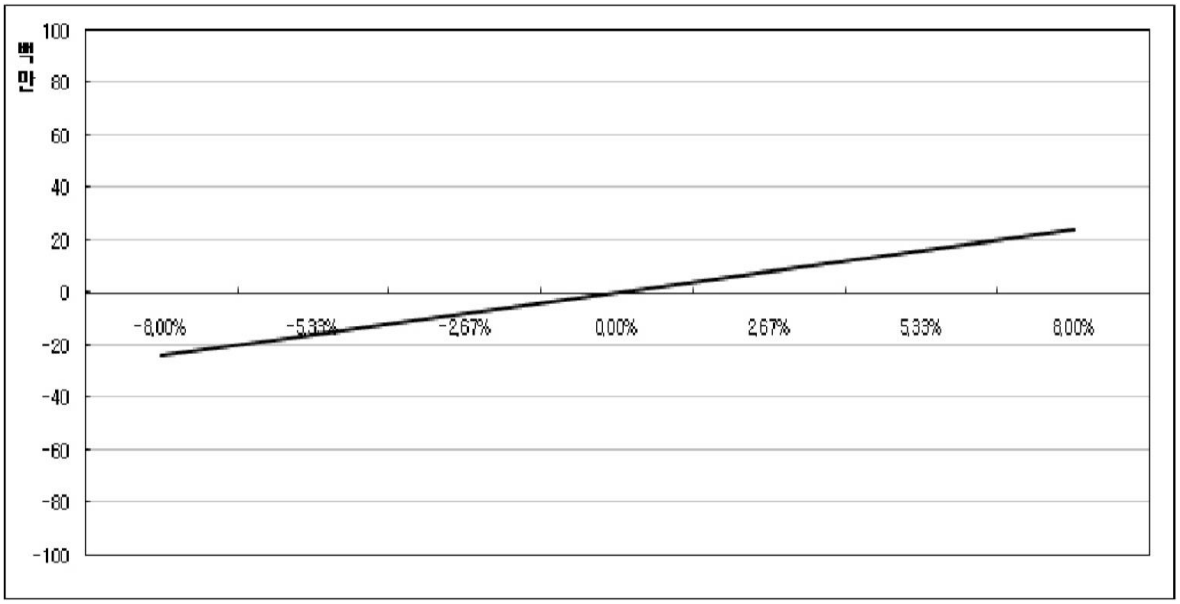
공시일: 2019-06-28

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	833	0	833	장내
합계			833	0	833	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

478

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

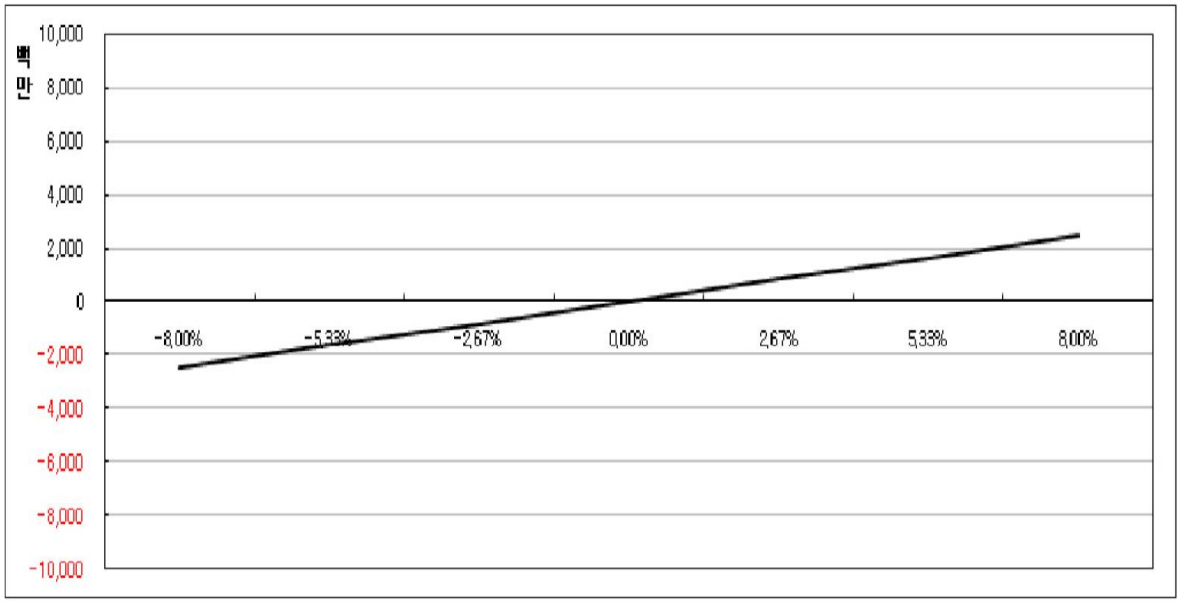
공시일: 2019-06-28

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	4,722	0	4,722	장내
합계			4,722	0	4,722	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

380

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

937

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

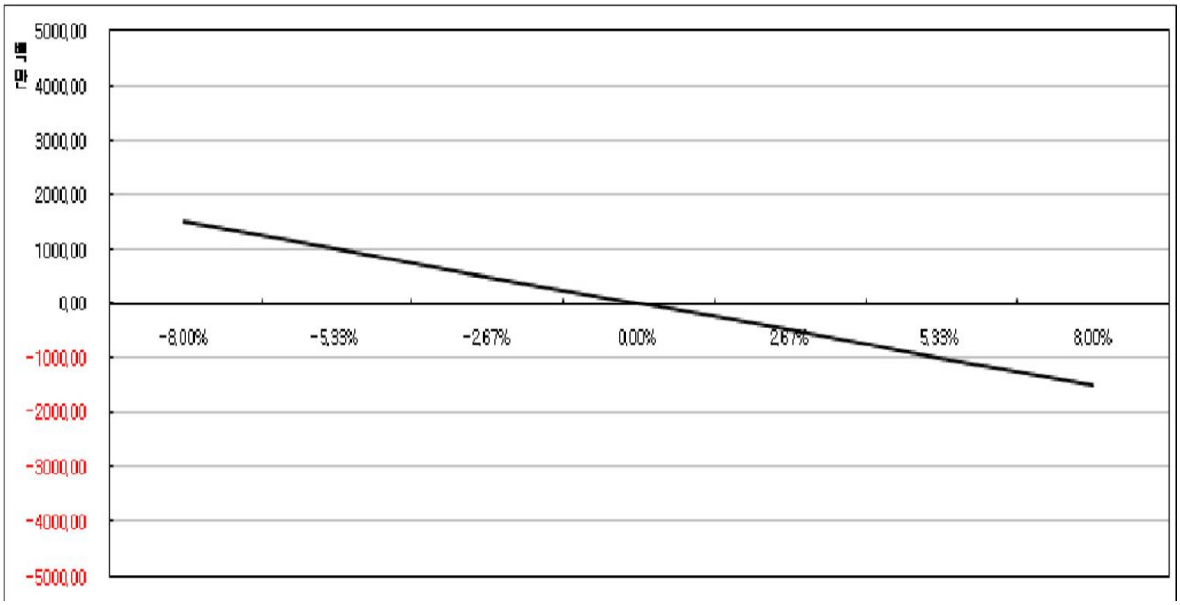
공시일: 2019-06-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	208	0	208	장내
누계	주가지수	선물	0	2,083	-2,083	장내
합계			0	2,083	-2,083	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

168

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

140

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

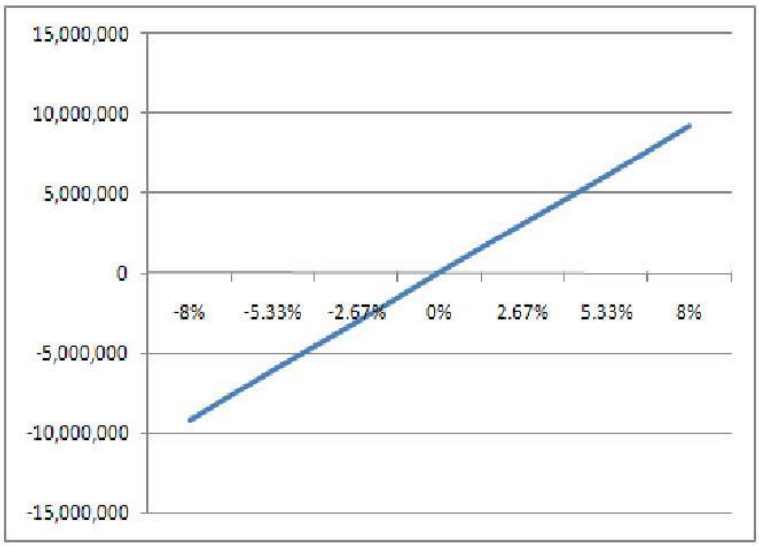
공시일: 2019-06-28

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	73,673	0	73,673	장내
합계			73,673	0	73,673	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,925

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,343