펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-19

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	3,574	0	3,574	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	24	14,438	-14,414	장내
합계			3,598	14,438	-10,840	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	697

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,823

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

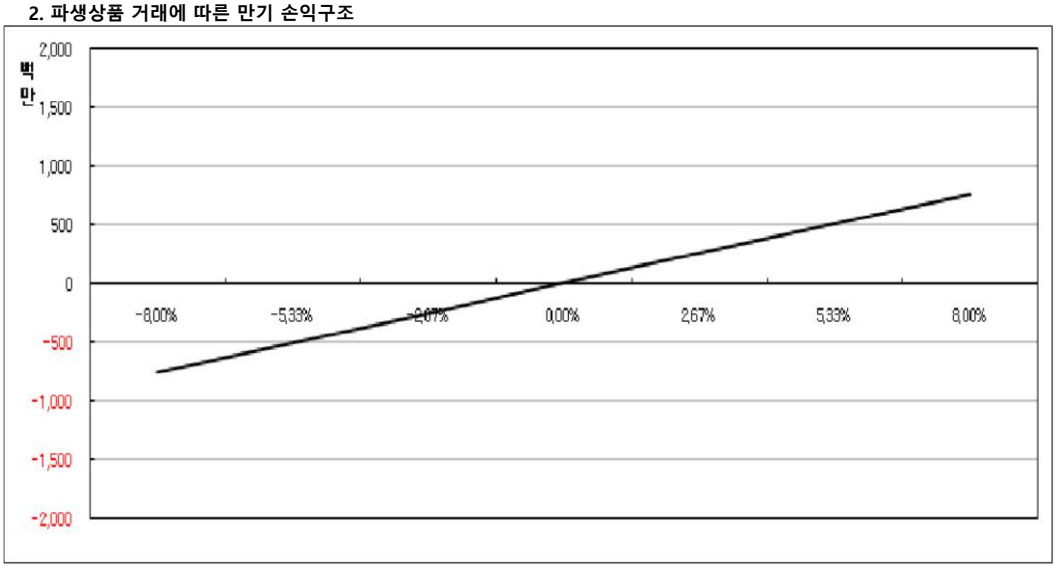
공시일: 2019-02-19

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	286	0	286	장내
합계			286	0	286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,897

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

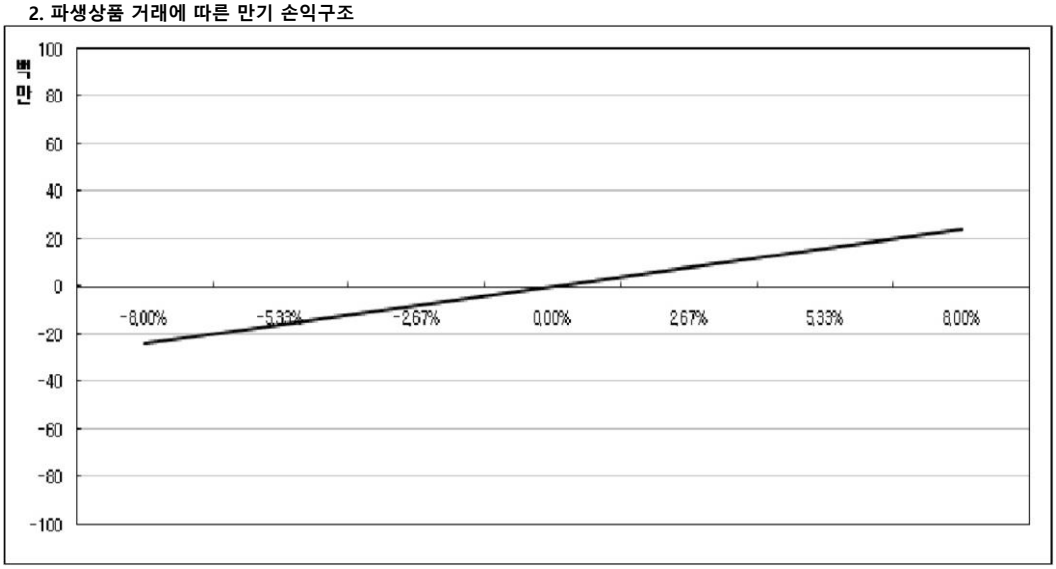
공시일: 2019-02-19

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	858	0	858	장내
합계			858	0	858	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,233

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

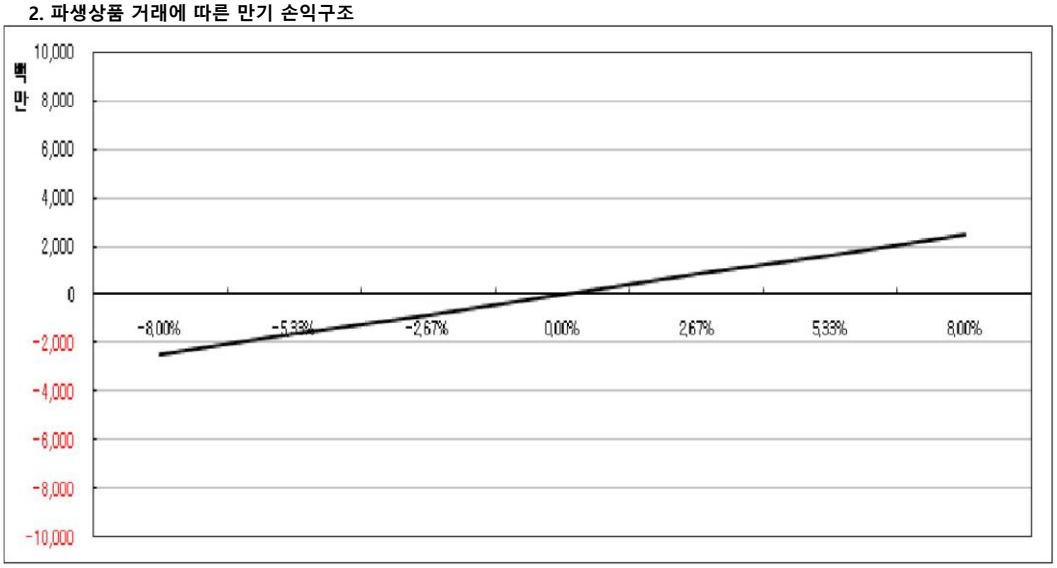
공시일: 2019-02-19

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	4,574	0	4,574	장내
합계			4,574	0	4,574	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

367

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,538

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

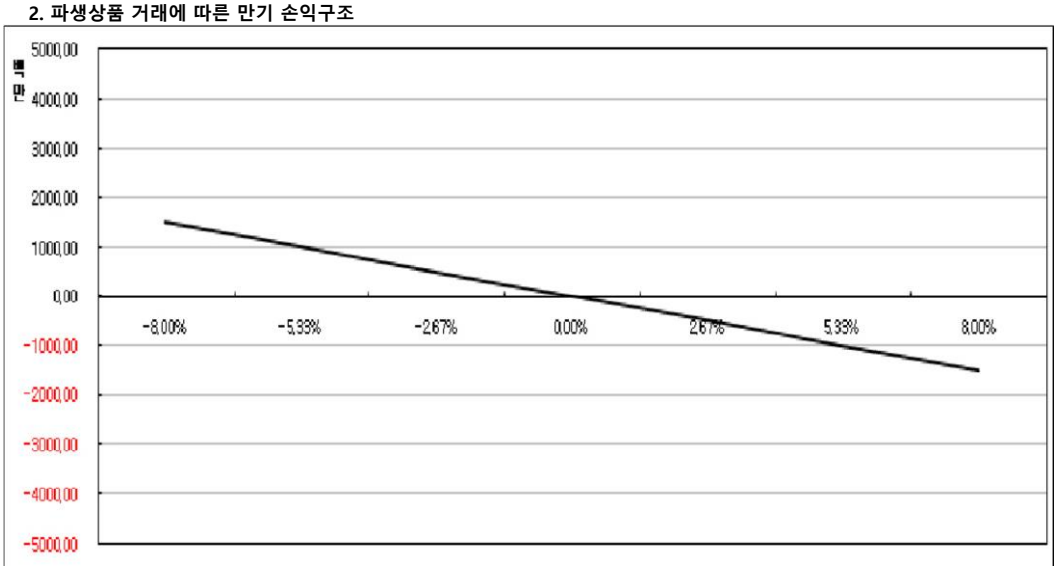
공시일: 2019-02-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	214	286	-71	장내
누계	주가지수	선물	0	2,859	-2,859	장내
합계			0	2,859	-2,859	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 229

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 198

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

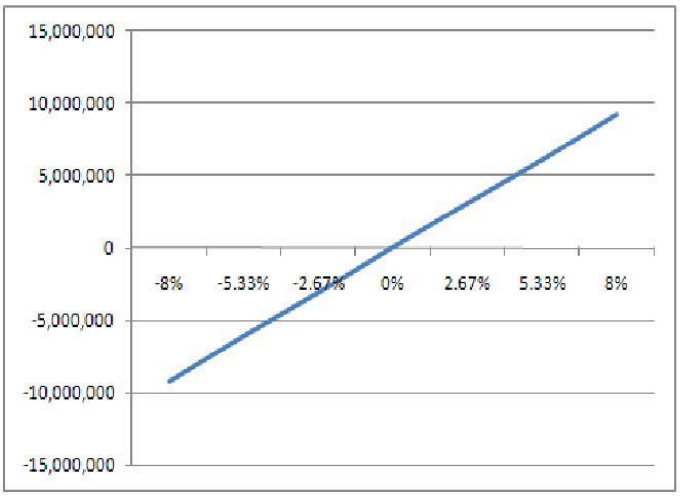
공시일: 2019-02-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	357	0	357	장내
누계	주가지수	선물	71,189	0	71,189	장내
합계			71,189	0	71,189	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,712

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	44,921