펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-20

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	3,561	0	3,561	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	32	14,388	-14,356	장내
합계			3,594	14,388	-10,794	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	675

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,275

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

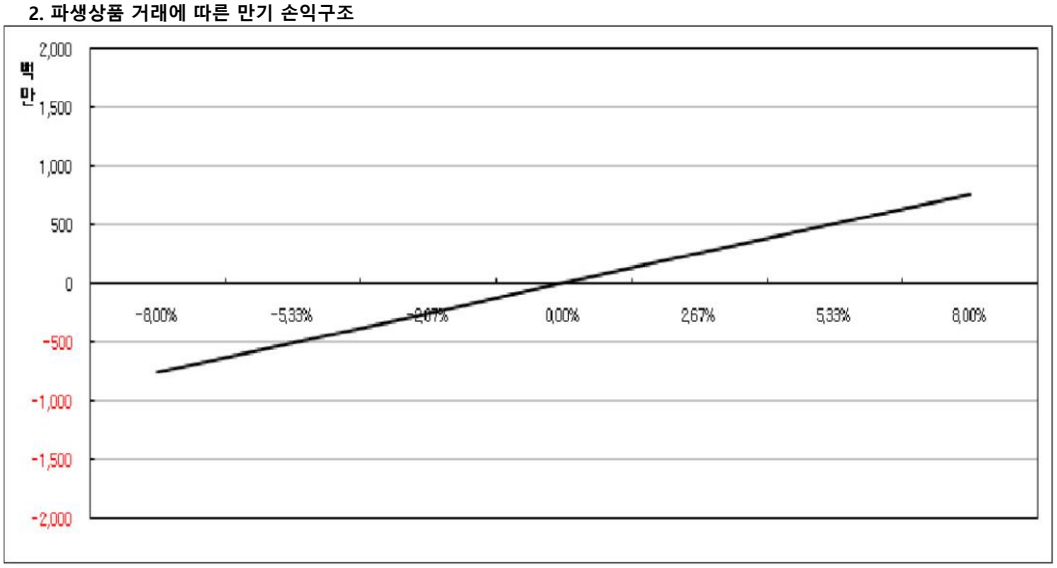
공시일: 2019-02-20

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	285	0	285	장내
합계			285	0	285	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,881

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

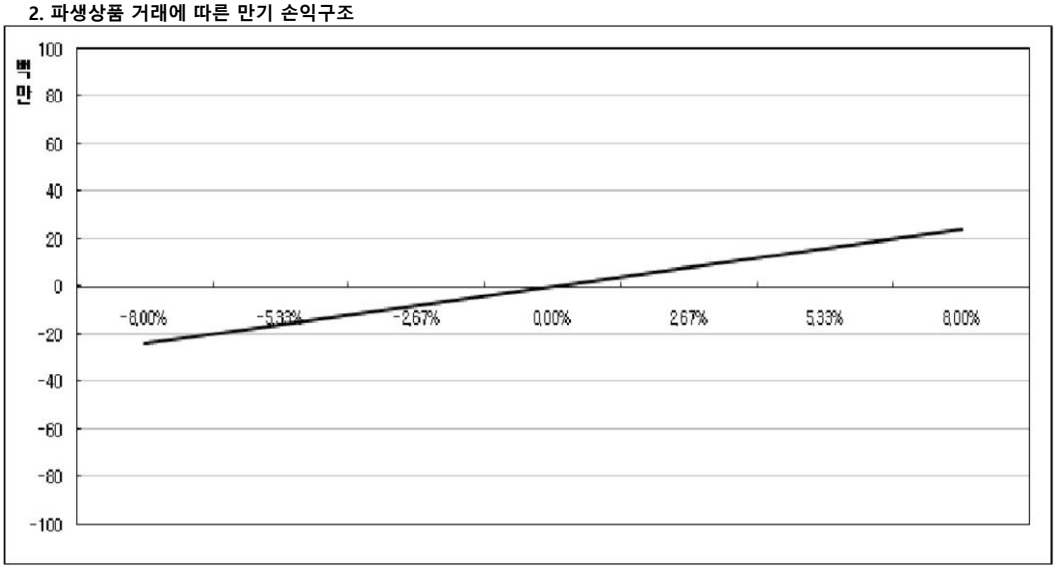
공시일: 2019-02-20

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	855	0	855	장내
합계			855	0	855	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,215

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

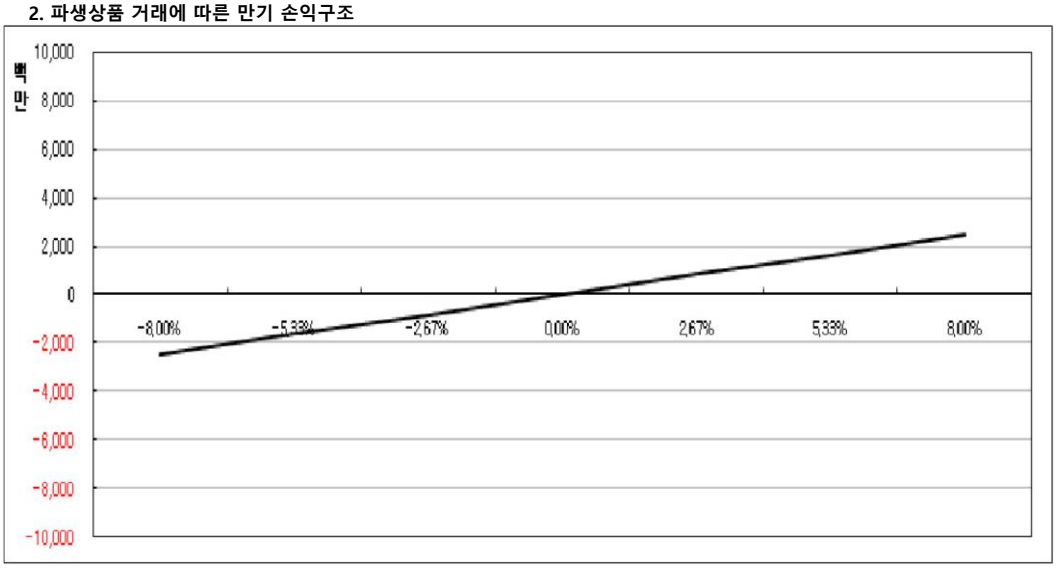
공시일: 2019-02-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	427	499	-71	장내
누계	주가지수	선물	4,487	0	4,487	장내
합계			4,487	0	4,487	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 360

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,504

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

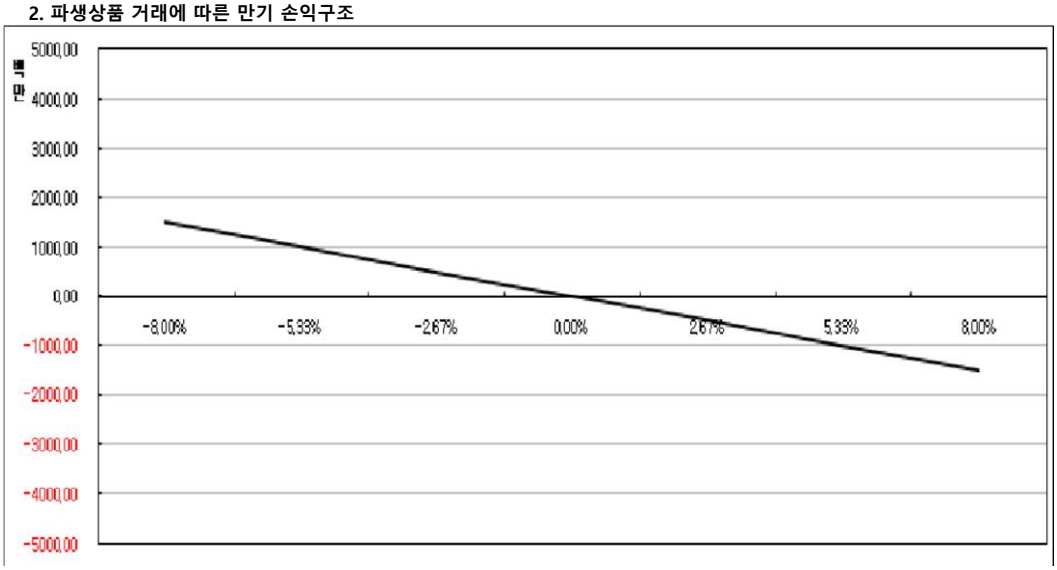
공시일: 2019-02-20

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	0	2,849	-2,849	장내
합계			0	2,849	-2,849	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	229

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	197

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

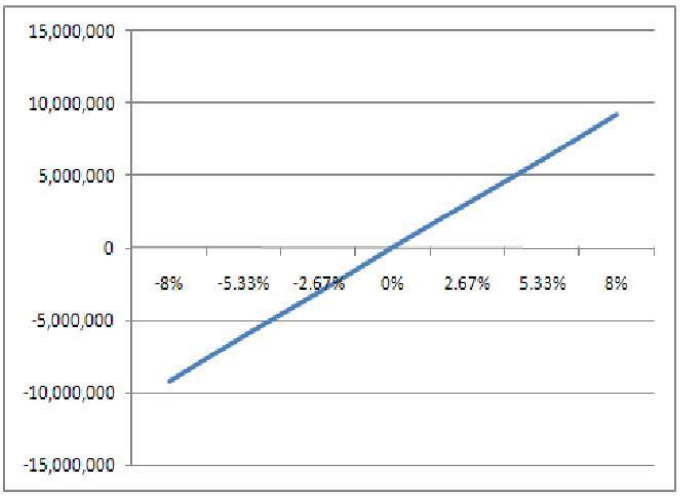
공시일: 2019-02-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	997	-997	장내
누계	주가지수	선물	69,945	0	69,945	장내
합계			69,945	0	69,945	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,610

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	44,621