펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-22

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	3,605	0	3,605	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	16	14,565	-14,549	장내
합계			3,621	14,565	-10,944	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	770

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	4,209

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

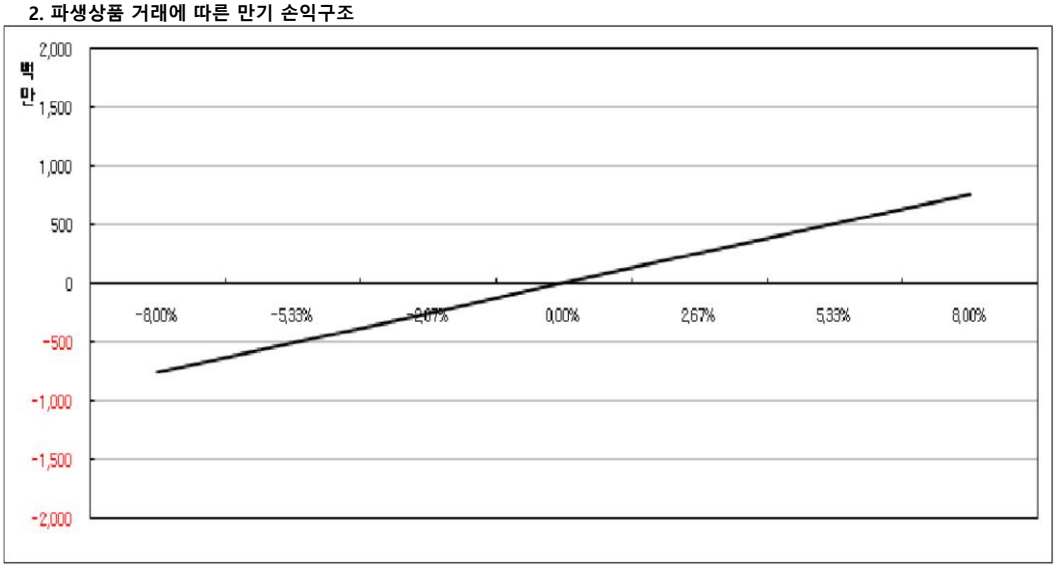
공시일: 2019-02-22

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	288	0	288	장내
합계			288	0	288	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,941

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

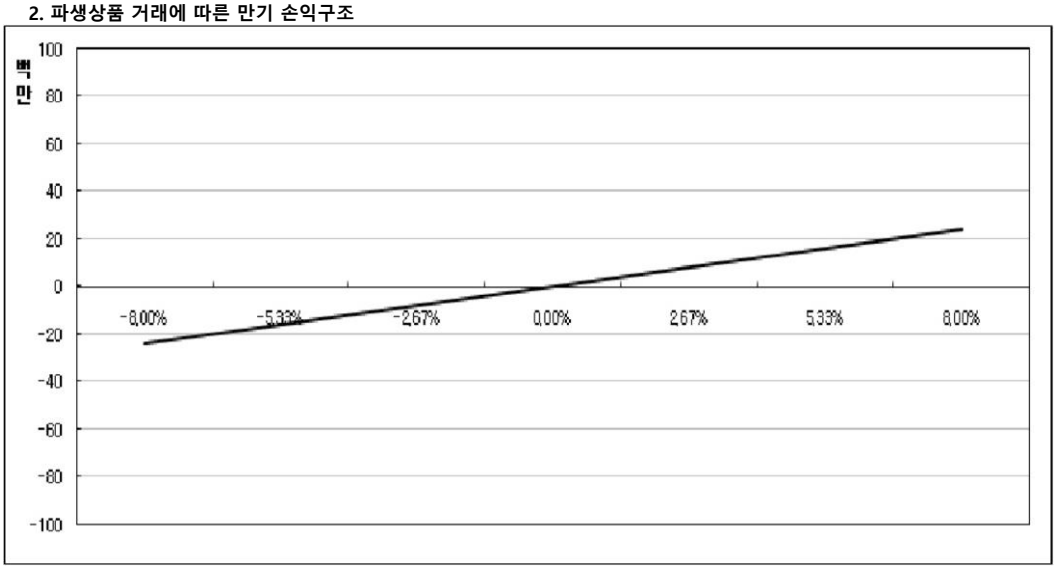
공시일: 2019-02-22

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	865	0	865	장내
합계			865	0	865	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,282

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

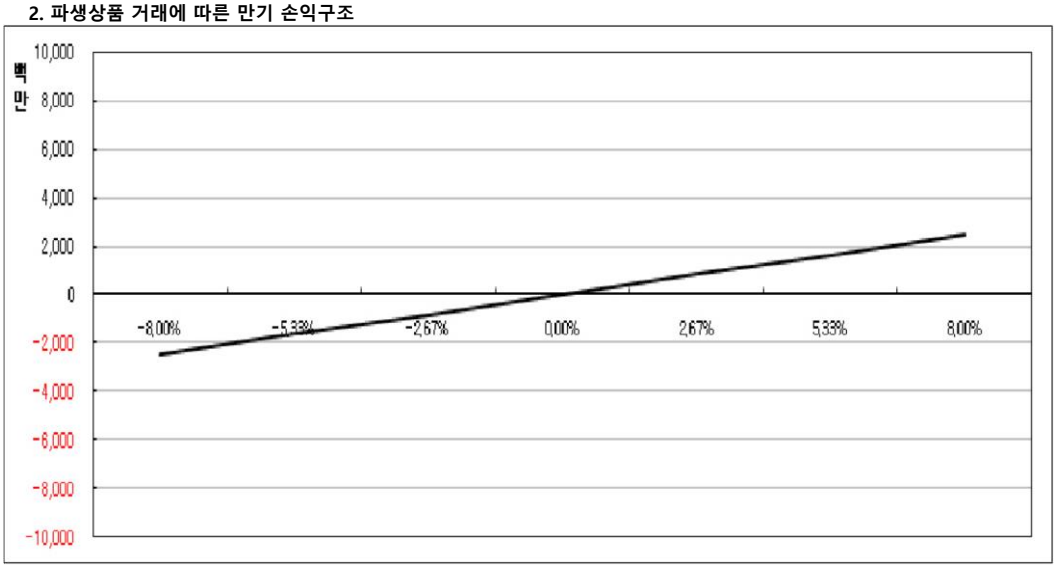
공시일: 2019-02-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	216	0	216	장내
누계	주가지수	선물	4,759	0	4,759	장내
합계			4,759	0	4,759	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

381

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,624

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

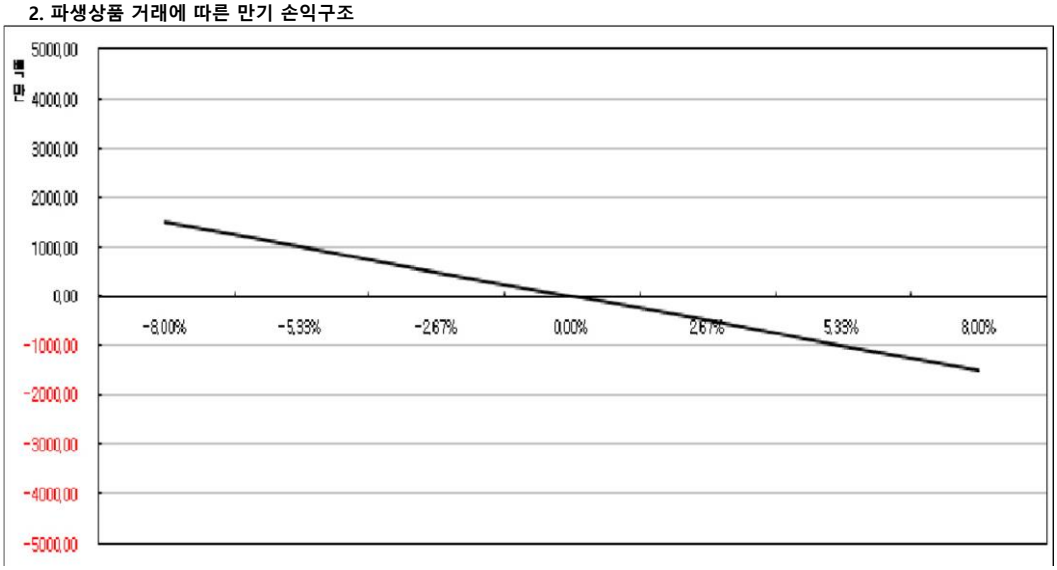
공시일: 2019-02-22

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	2,884	-2,884	장내
합계			0	2,884	-2,884	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	231

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	199

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

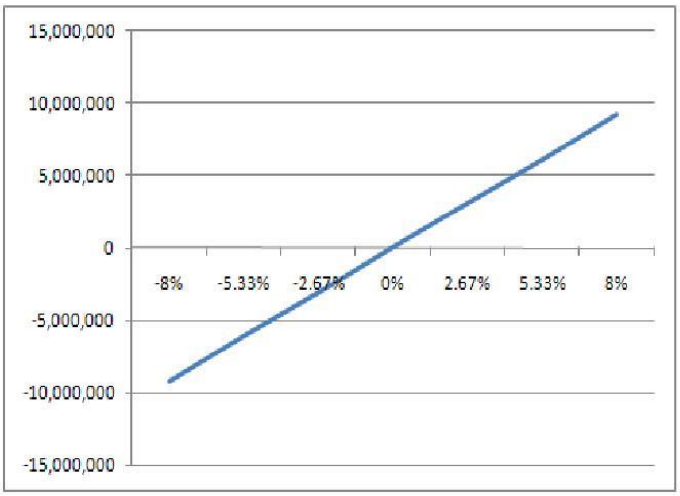
공시일: 2019-02-22

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	71,165	0	71,165	장내
합계			71,165	0	71,165	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,697

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	45,550