펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-25

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	3,609	0	3,609	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	12	14,581	-14,569	장내
합계			3,622	14,581	-10,960	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	783

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	4,111

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

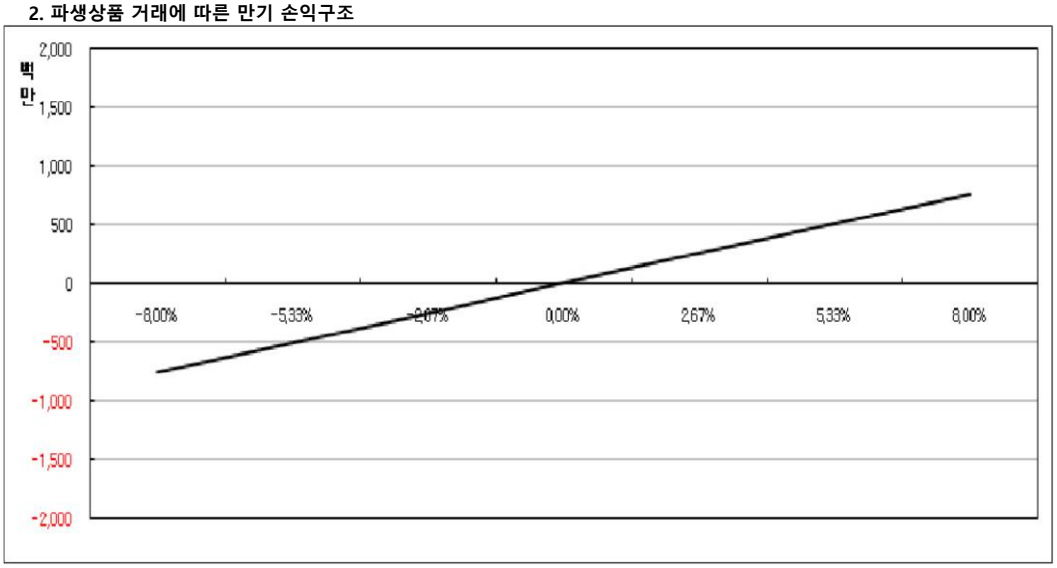
공시일: 2019-02-25

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	289	0	289	장내
합계			289	0	289	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,951

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

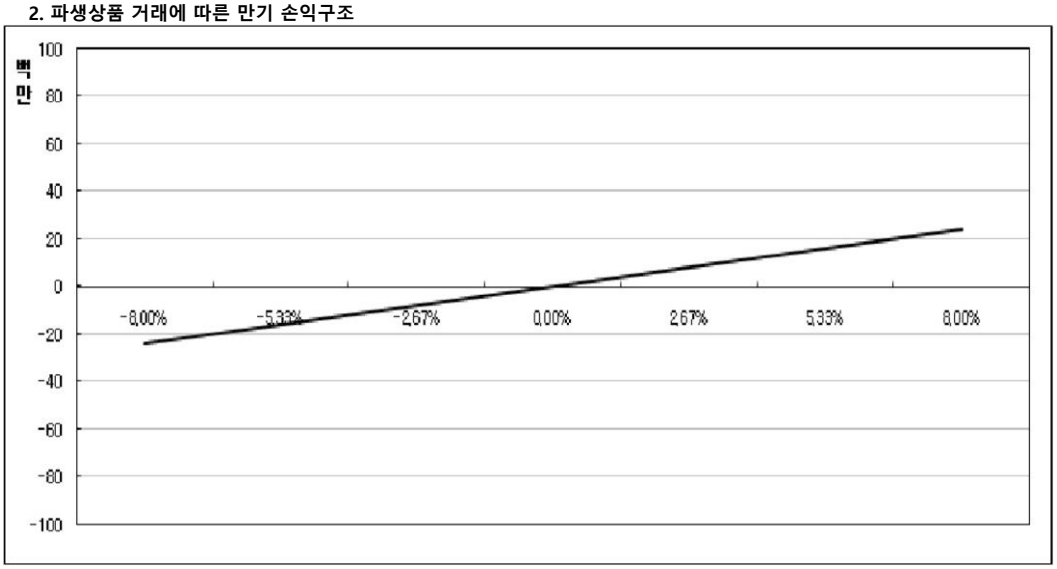
공시일: 2019-02-25

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	866	0	866	장내
합계			866	0	866	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,294

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

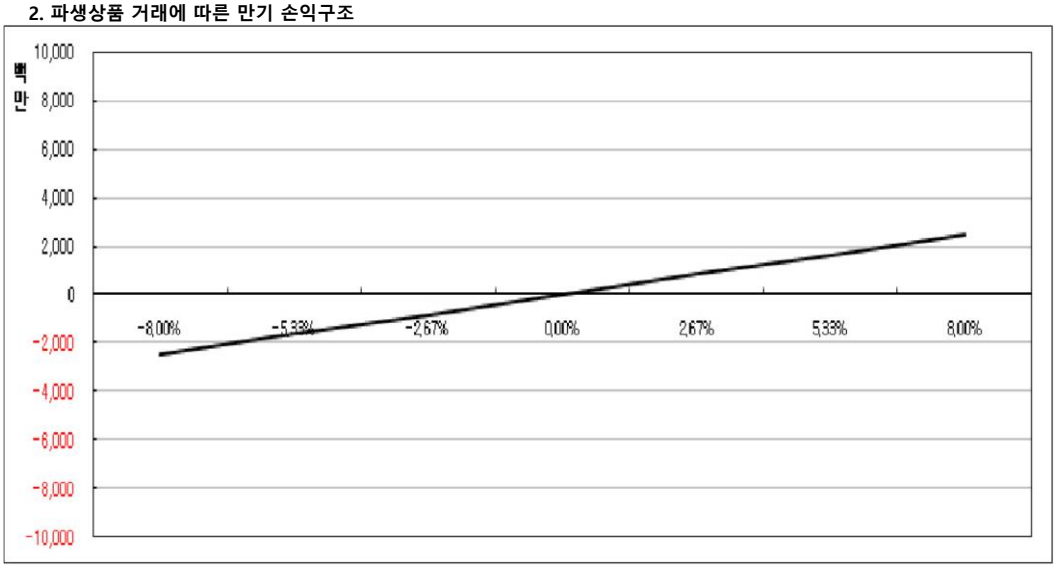
공시일: 2019-02-25

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	4,764	0	4,764	장내
합계			4,764	0	4,764	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

381

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,644

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

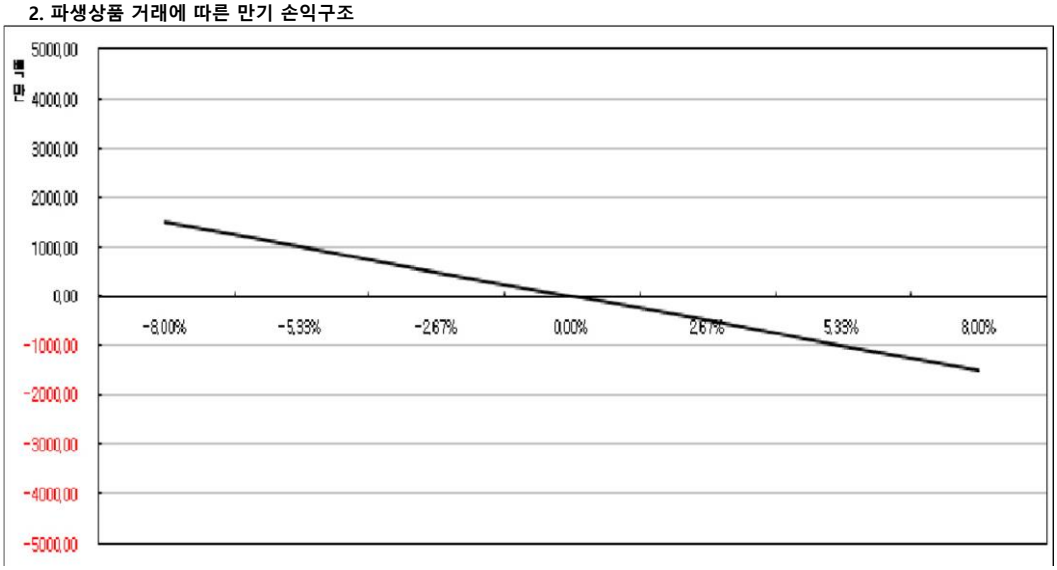
공시일: 2019-02-25

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	2,887	-2,887	장내
합계			0	2,887	-2,887	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	231

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	198

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

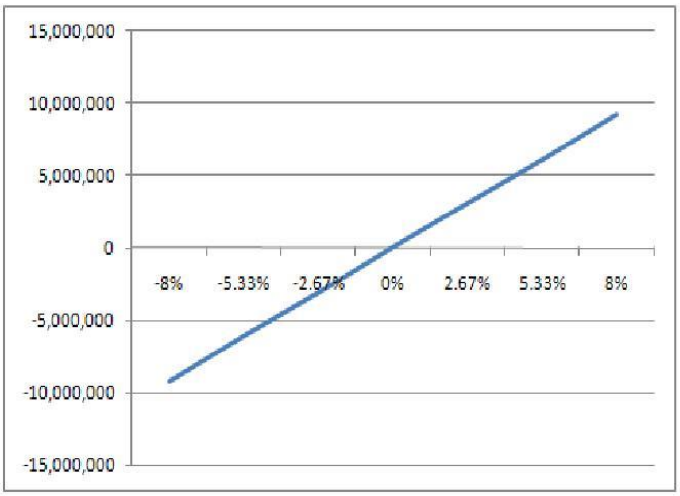
공시일: 2019-02-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	433	0	433	장내
누계	주가지수	선물	71,680	0	71,680	장내
합계			71,680	0	71,680	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,735

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 45,724