펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-26

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	3,613	0	3,613	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	14,595	-14,585	장내
합계			3,622	14,595	-10,972	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	777

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,859

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

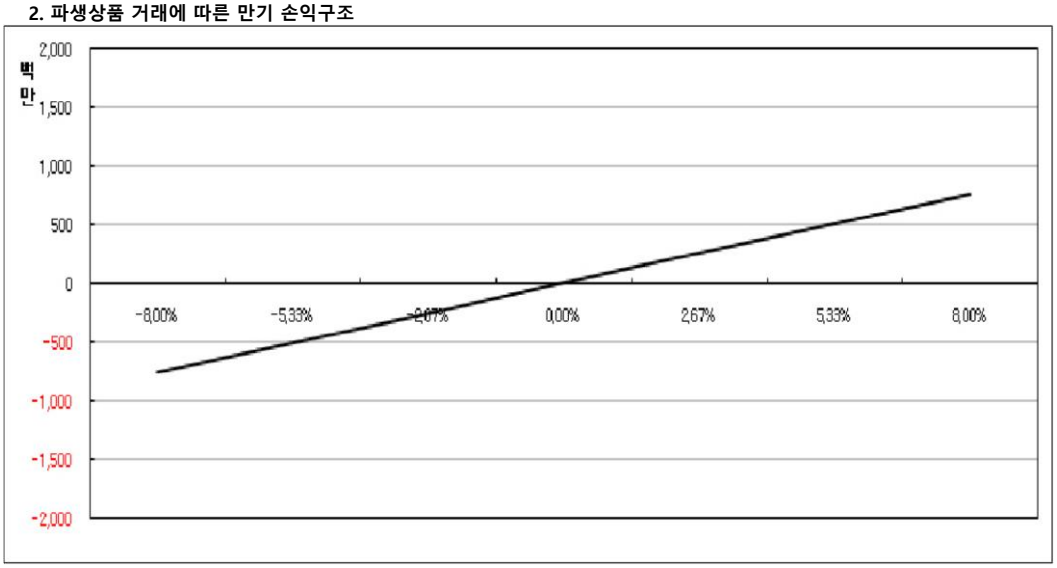
공시일: 2019-02-26

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)	2,963

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

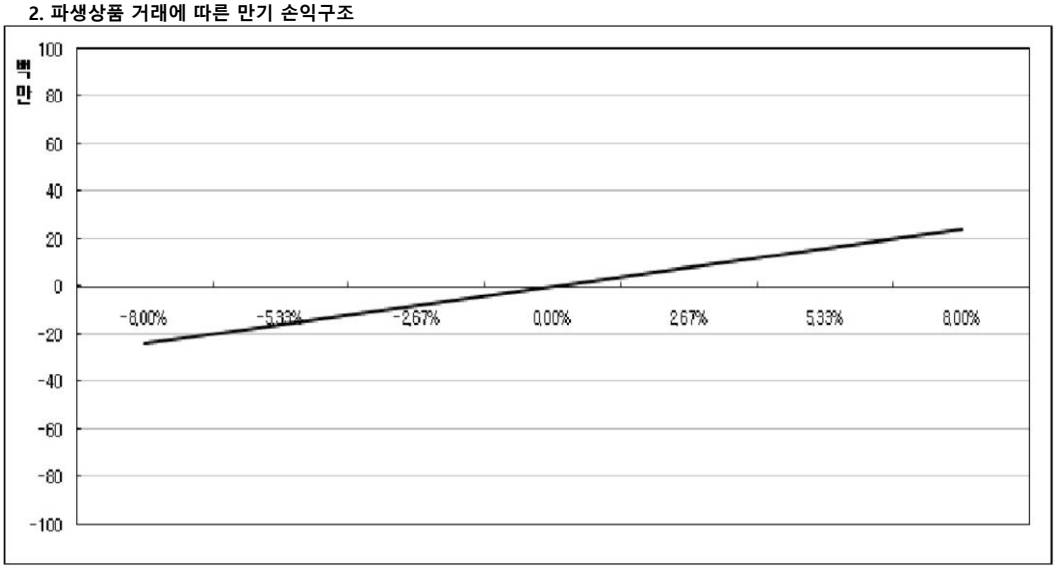
공시일: 2019-02-26

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	867	0	867	장내
합계			867	0	867	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,307

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

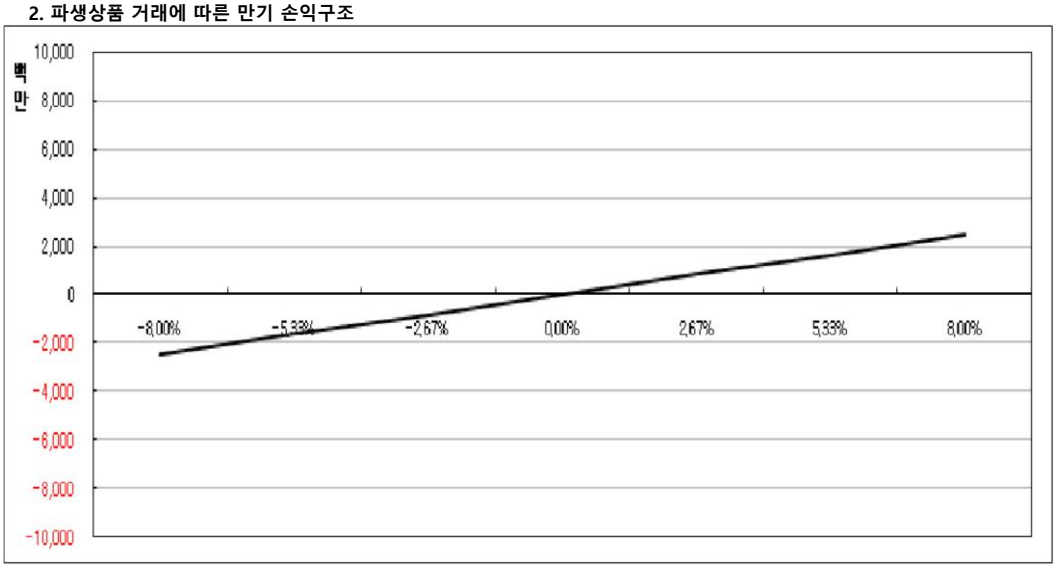
공시일: 2019-02-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	217	-217	장내
누계	주가지수	선물	4,552	0	4,552	장내
합계			4,552	0	4,552	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

365

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,662

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

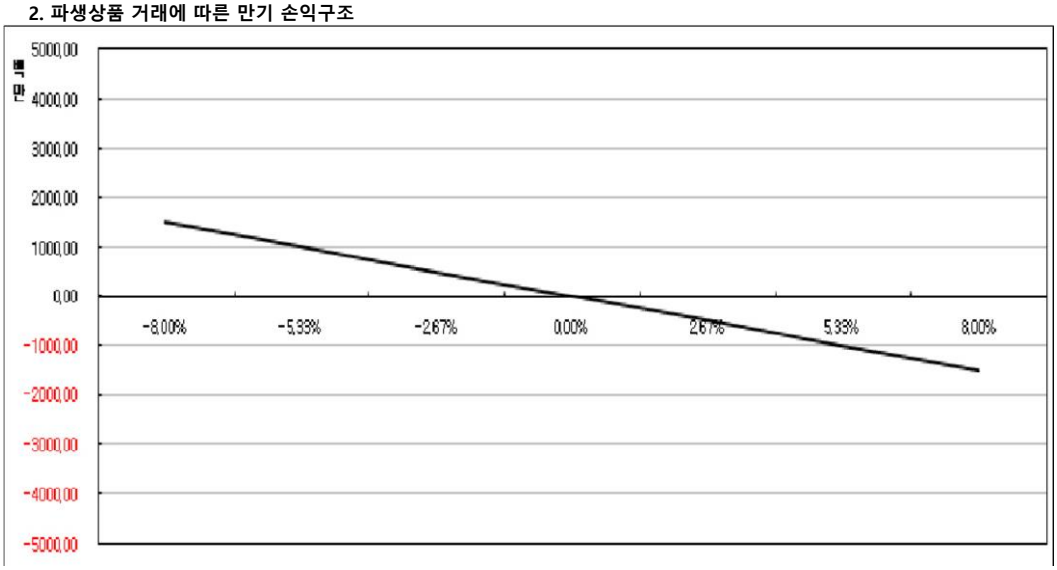
공시일: 2019-02-26

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	2,890	-2,890	장내
합계			0	2,890	-2,890	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	232

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	199

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

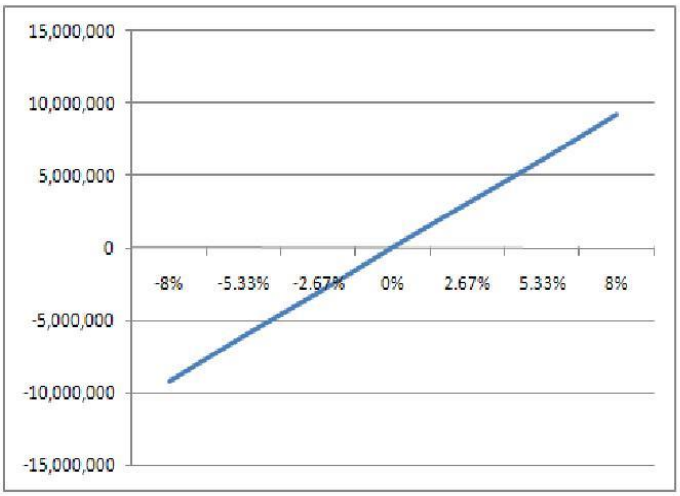
공시일: 2019-02-26

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	71,744	0	71,744	장내
합계			71,744	0	71,744	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,750

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	45,918