펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-27

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	3,599	0	3,599	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	12	14,538	-14,526	장내
합계			3,611	14,538	-10,928	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	778

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,022

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

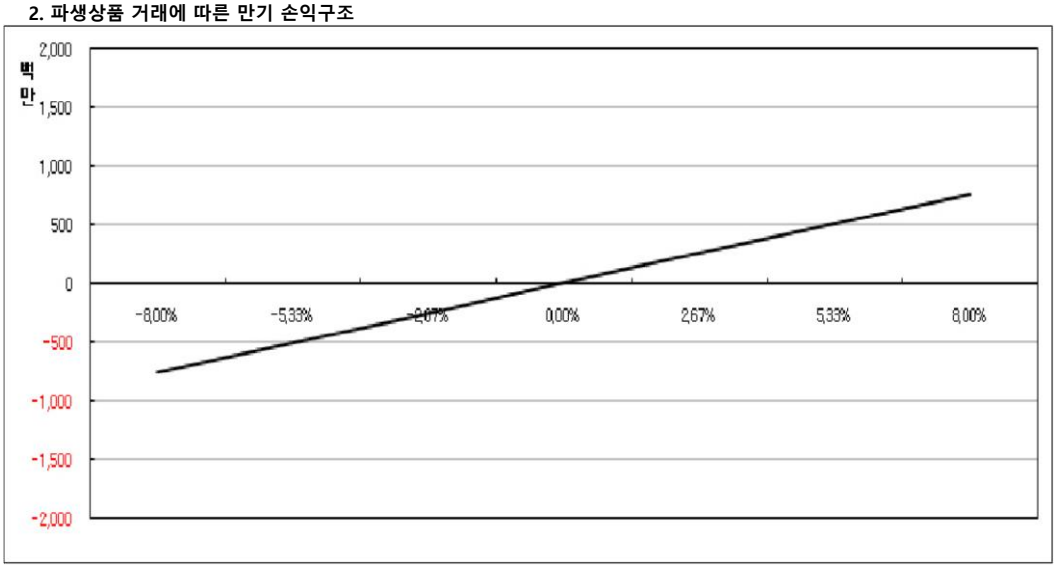
공시일: 2019-02-27

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)	2,929

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

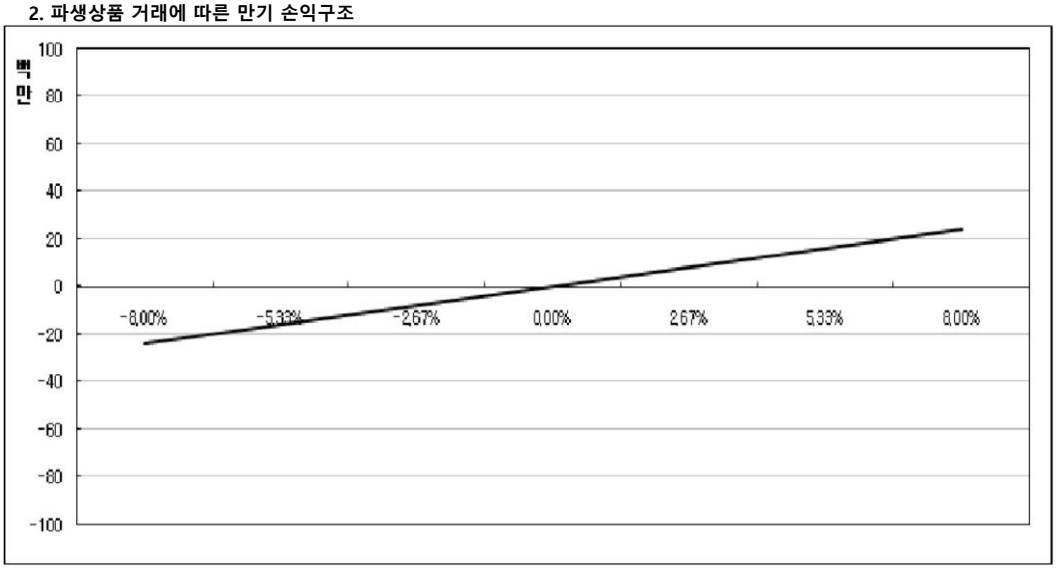
공시일: 2019-02-27

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	864	0	864	장내
합계			864	0	864	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,269

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

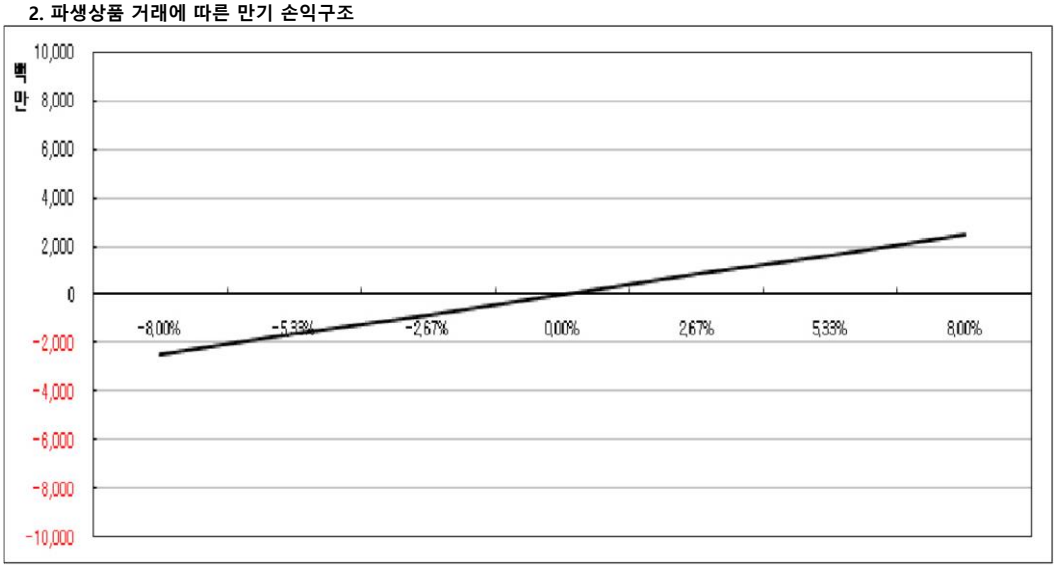
공시일: 2019-02-27

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	4,534	0	4,534	장내
합계			4,534	0	4,534	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

363

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,598

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

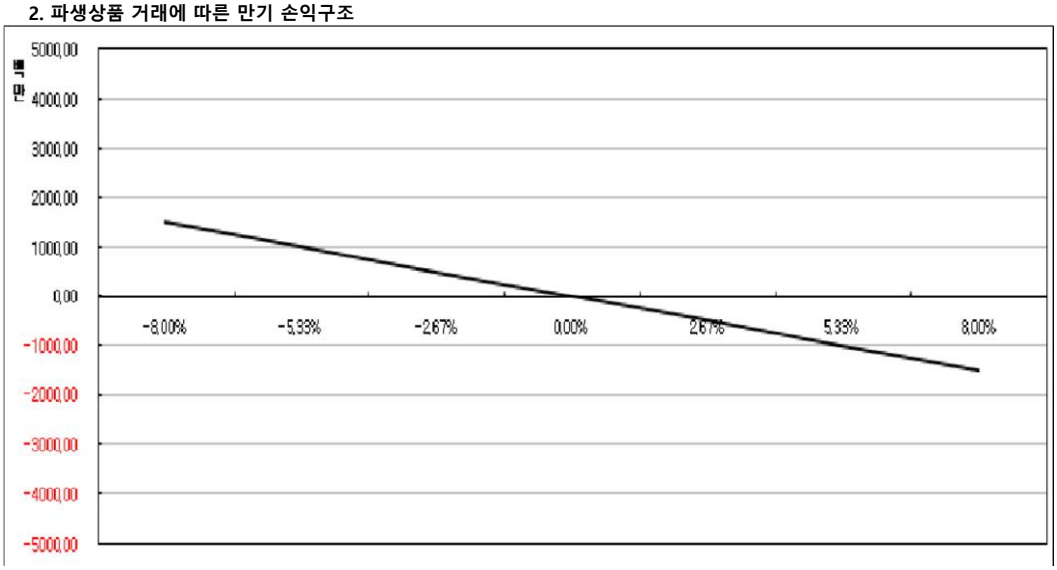
공시일: 2019-02-27

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	2,879	-2,879	장내
합계			0	2,879	-2,879	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 230

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 198

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

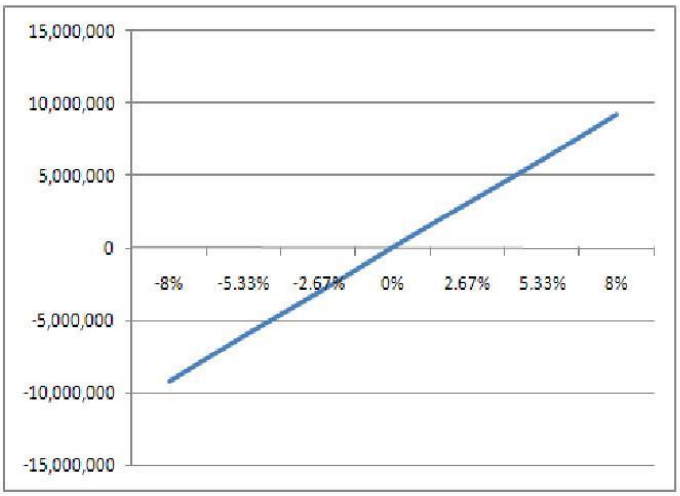
공시일: 2019-02-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	360	-360	장내
누계	주가지수	선물	71,109	0	71,109	장내
합계			71,109	0	71,109	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,686

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	45,393