펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-05

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	3,531	0	3,531	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	28	14,267	-14,239	장내
합계			3,559	14,267	-10,708	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	644

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,808

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

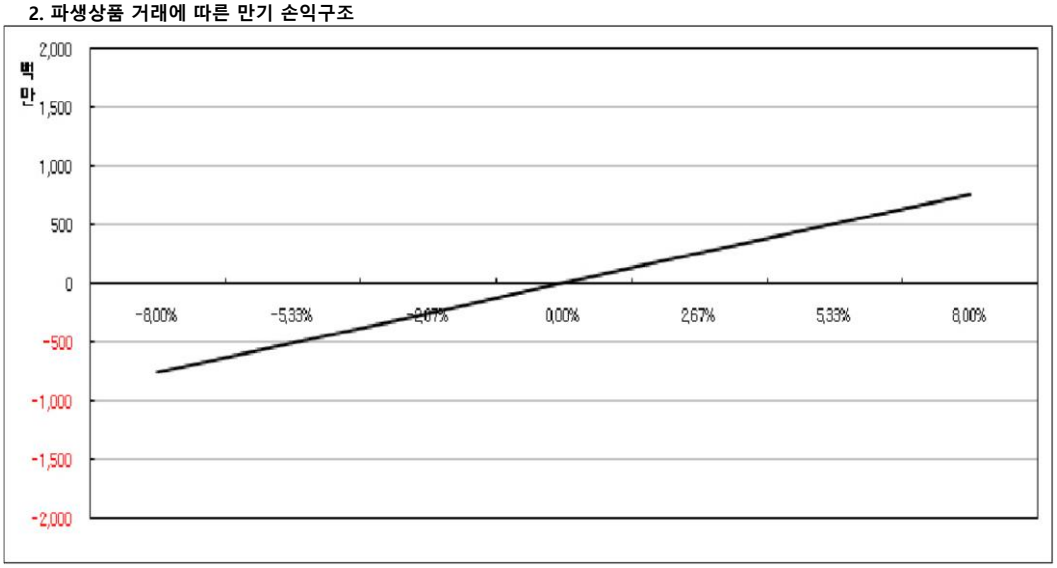
공시일: 2019-03-05

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	283	0	283	장내
합계			283	0	283	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,816

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

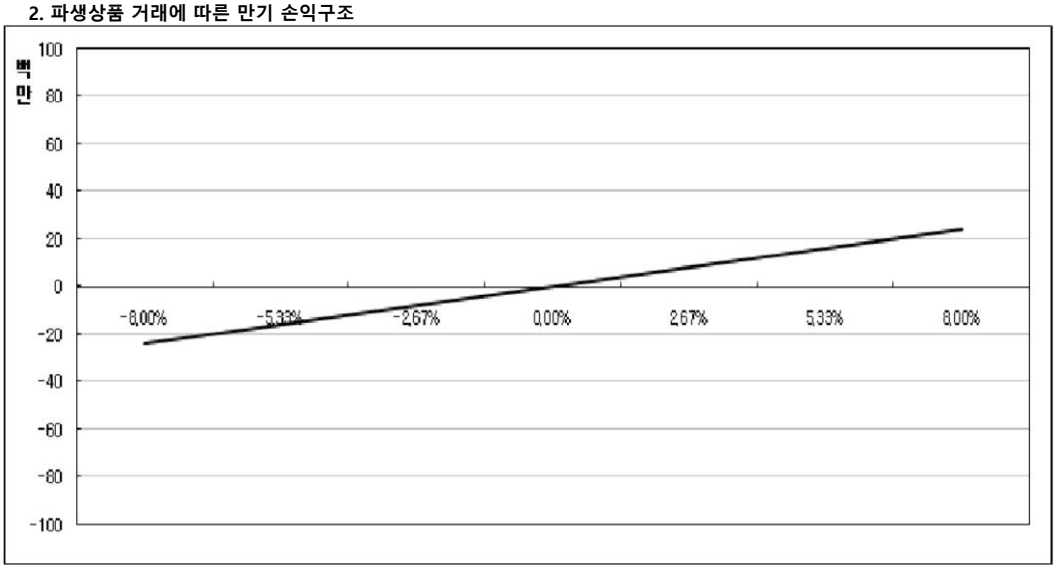
공시일: 2019-03-05

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	848	0	848	장내
합계			848	0	848	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,143

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

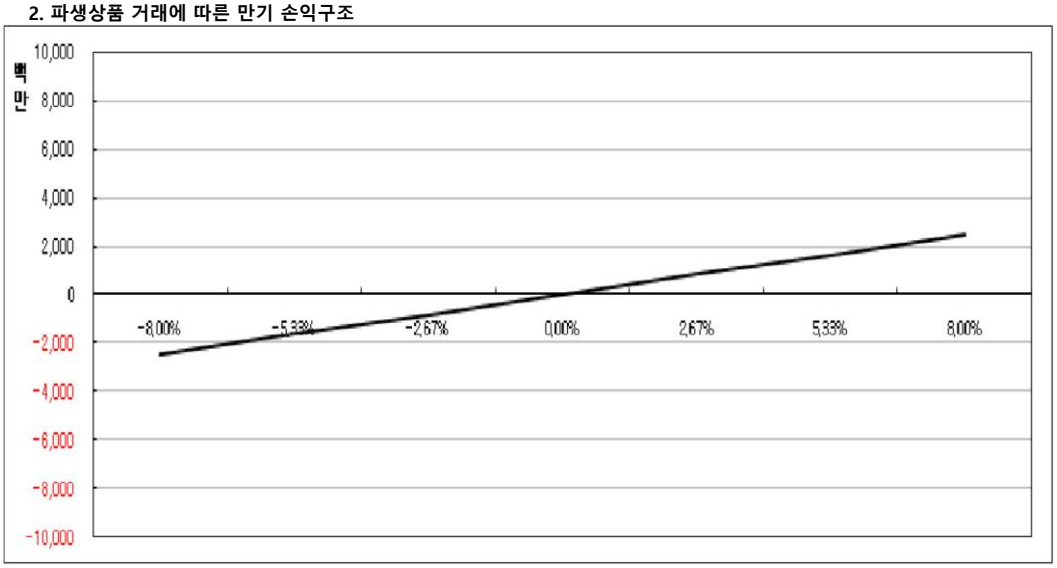
공시일: 2019-03-05

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	4,450	0	4,450	장내
합계			4,450	0	4,450	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

356

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,385

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

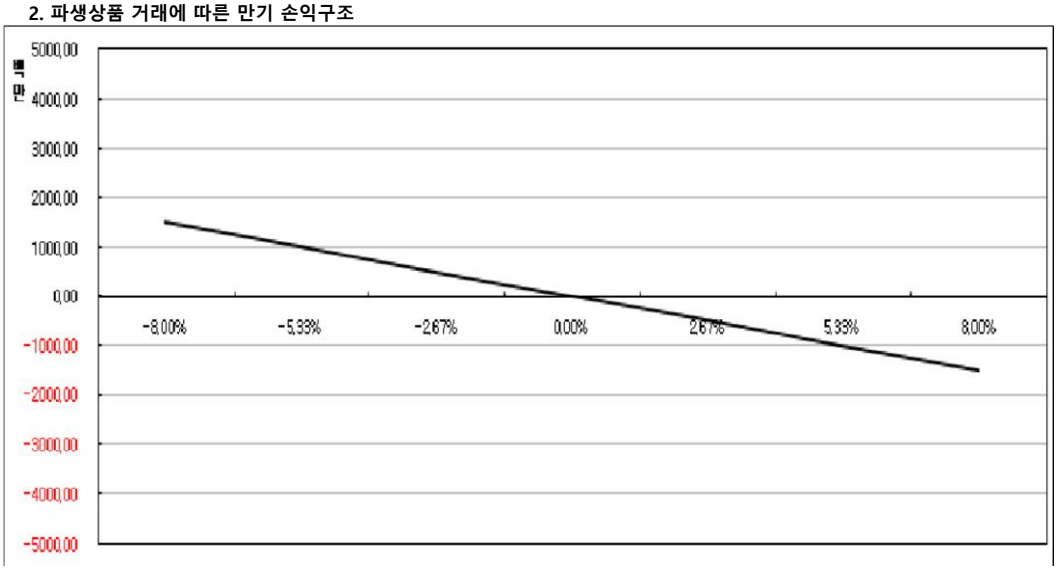
공시일: 2019-03-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	141	-141	장내
누계	주가지수	선물	0	3,108	-3,108	장내
합계			0	3,108	-3,108	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 249

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 213

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

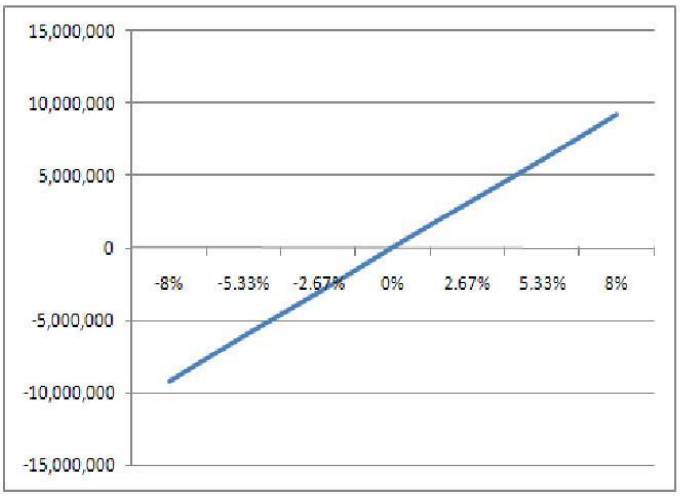
공시일: 2019-03-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	283	-283	장내
누계	주가지수	선물	69,003	0	69,003	장내
합계			69,003	0	69,003	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,522

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	43,686