펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-06

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	3,506	0	3,506	장내
신규	주가지수	옵션	5	0	5	장내
누계	주가지수	옵션	25	10,657	-10,632	장내
합계			3,531	10,657	-7,126	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	374

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,832

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

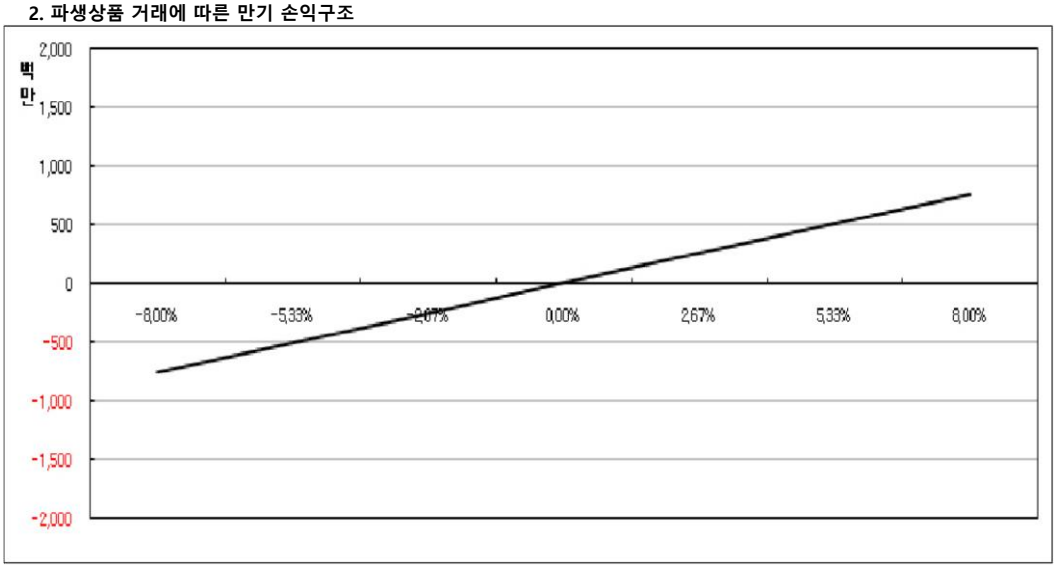
공시일: 2019-03-06

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	280	0	280	장내
합계			280	0	280	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,777

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

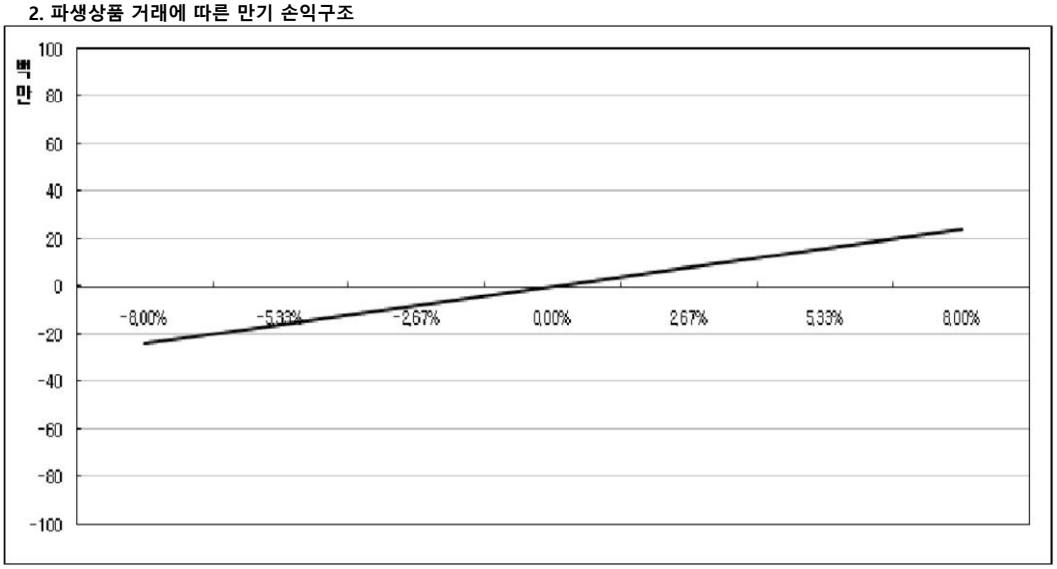
공시일: 2019-03-06

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	841	0	841	장내
합계			841	0	841	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,100

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

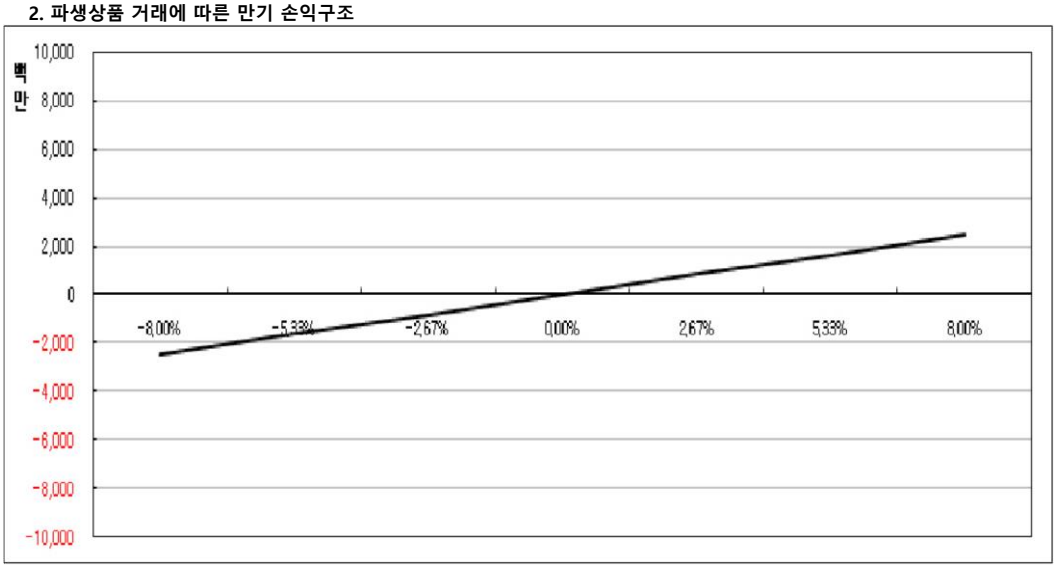
공시일: 2019-03-06

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	4,417	0	4,417	장내
합계			4,417	0	4,417	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

354

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,313

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

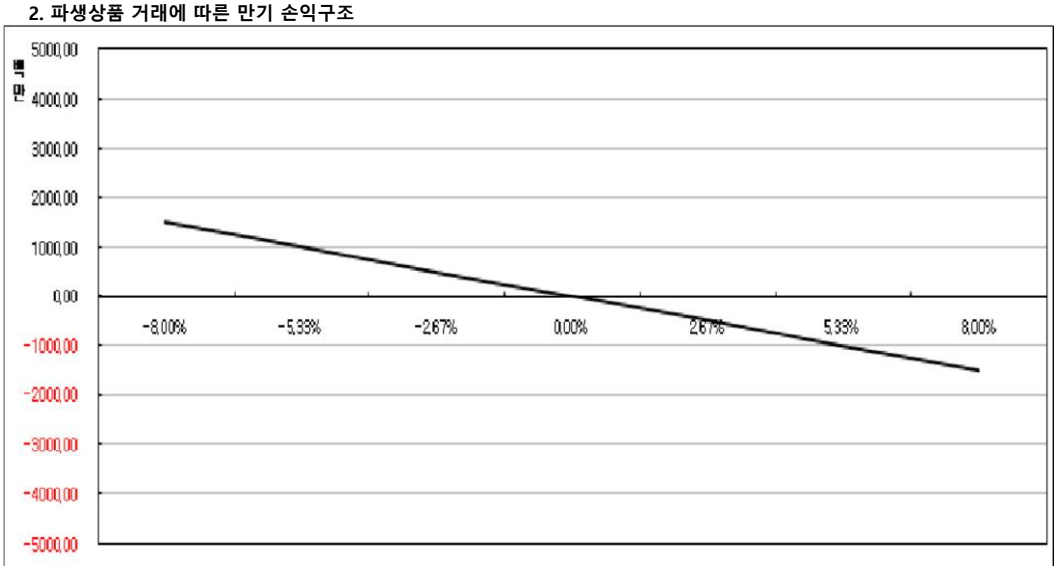
공시일: 2019-03-06

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	3,085	-3,085	장내
합계			0	3,085	-3,085	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 247

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 210

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

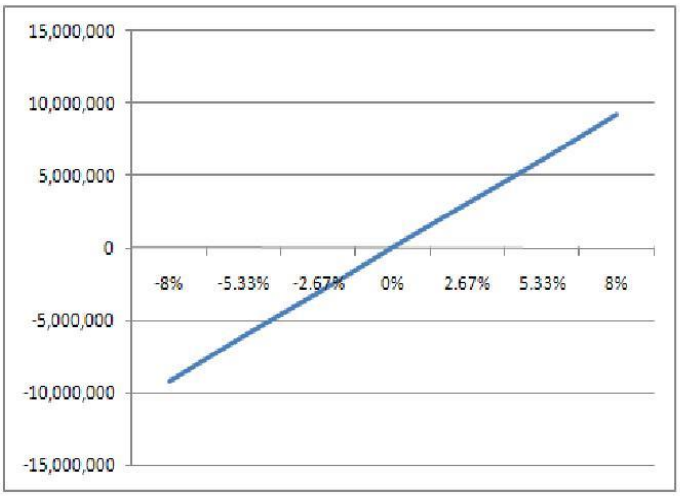
공시일: 2019-03-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	561	-561	장내
누계	주가지수	선물	67,939	0	67,939	장내
합계			67,939	0	67,939	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,440

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	43,094