펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-11

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	3,436	0	3,436	장내
신규	주가지수	옵션	1	0	1	장내
누계	주가지수	옵션	59	687	-628	장내
합계			3,495	687	2,808	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	13

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,918

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

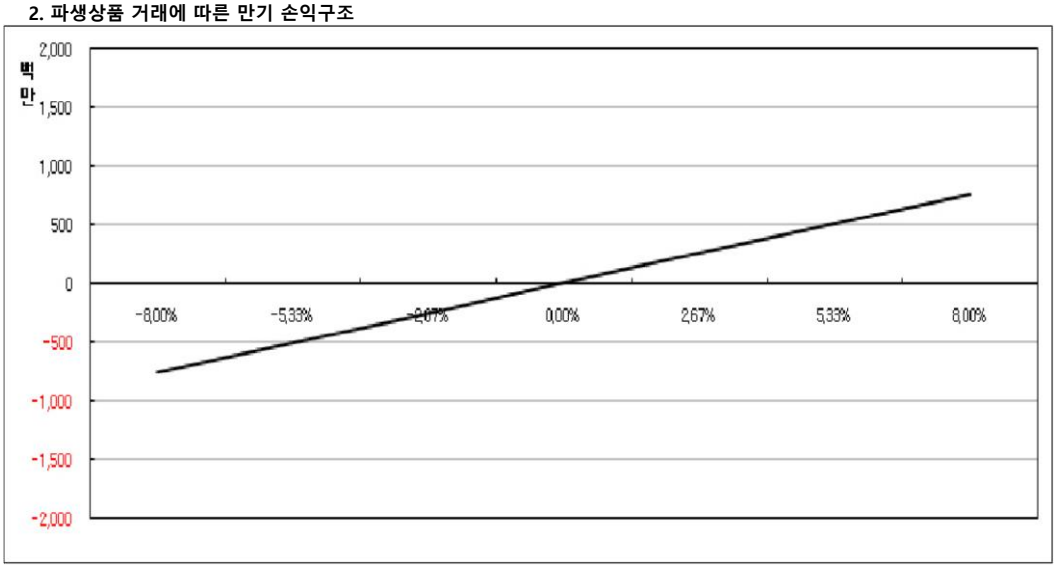
공시일: 2019-03-11

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	275	0	275	장내
합계			275	0	275	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,742

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

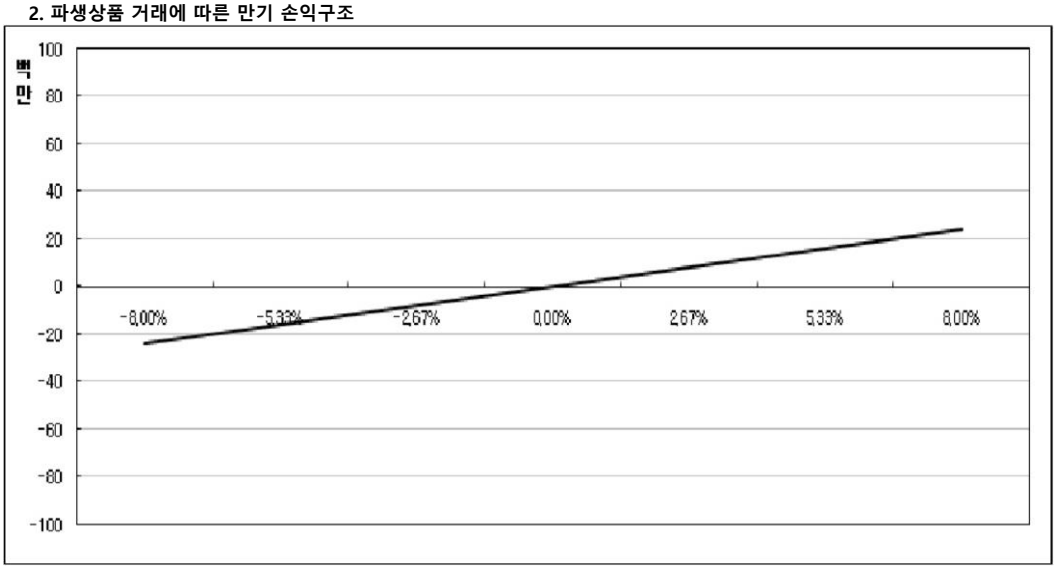
공시일: 2019-03-11

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	825	0	825	장내
합계			825	0	825	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,060

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

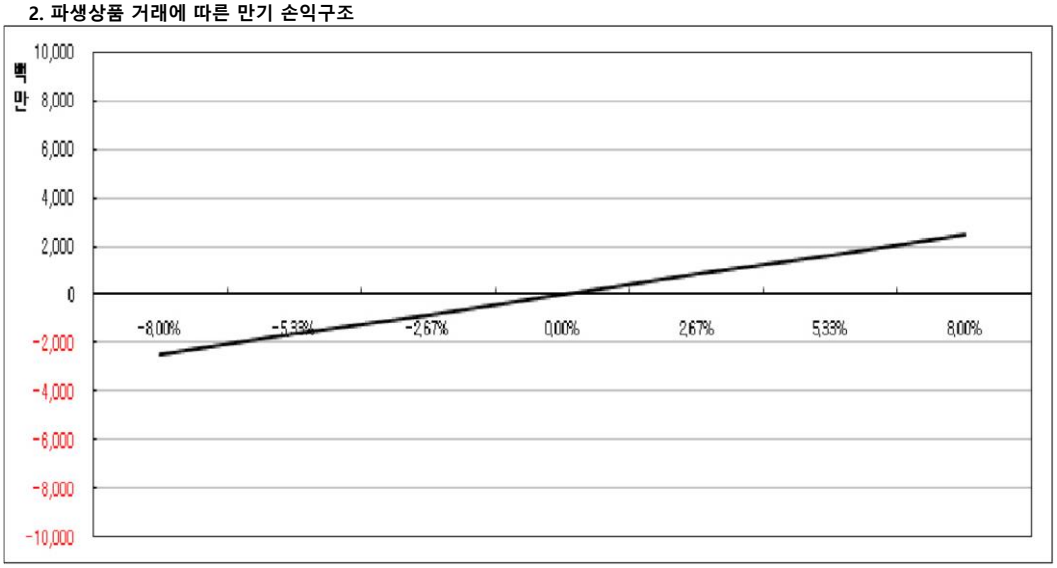
공시일: 2019-03-11

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	4,535	0	4,535	장내
합계			4,535	0	4,535	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

363

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,248

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

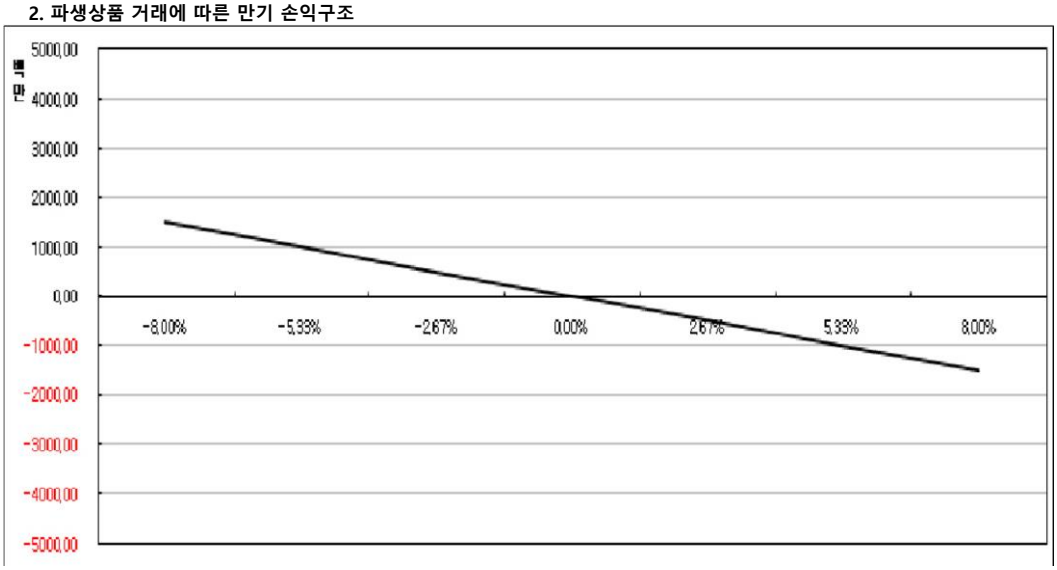
공시일: 2019-03-11

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	3,023	-3,023	장내
합계			0	3,023	-3,023	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 242

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 205

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

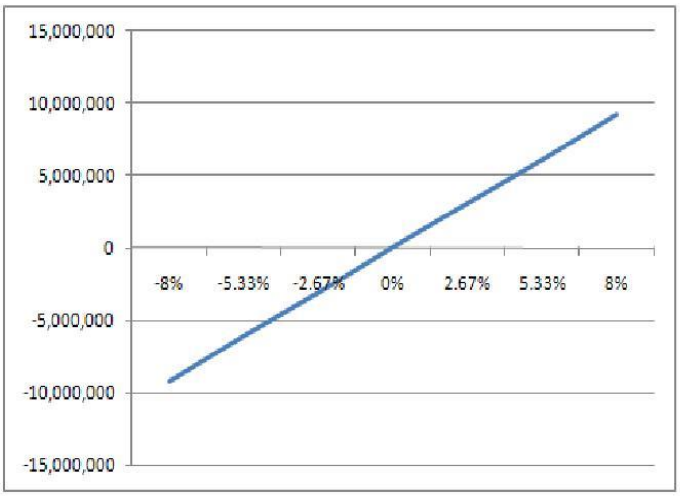
공시일: 2019-03-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	275	0	275	장내
누계	주가지수	선물	67,198	0	67,198	장내
합계			67,198	0	67,198	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,380

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 42,526