펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,472	3,472	0	장내
누계	주가지수	선물	3,472	0	3,472	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	15	694	-680	장내
합계			3,486	694	2,792	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,988

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

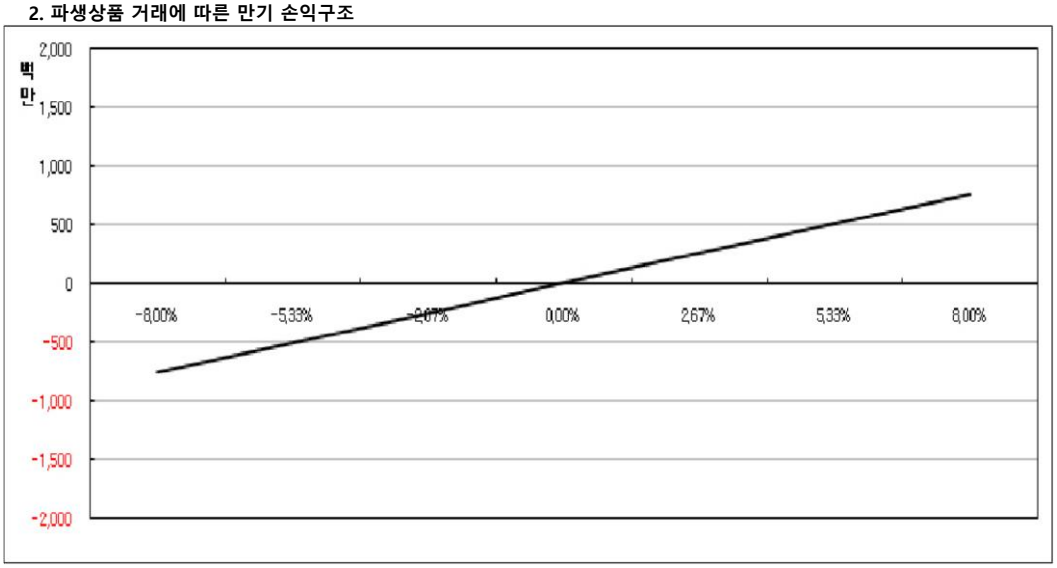
공시일: 2019-03-13

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	278	0	278	장내
합계			278	0	278	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,791

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

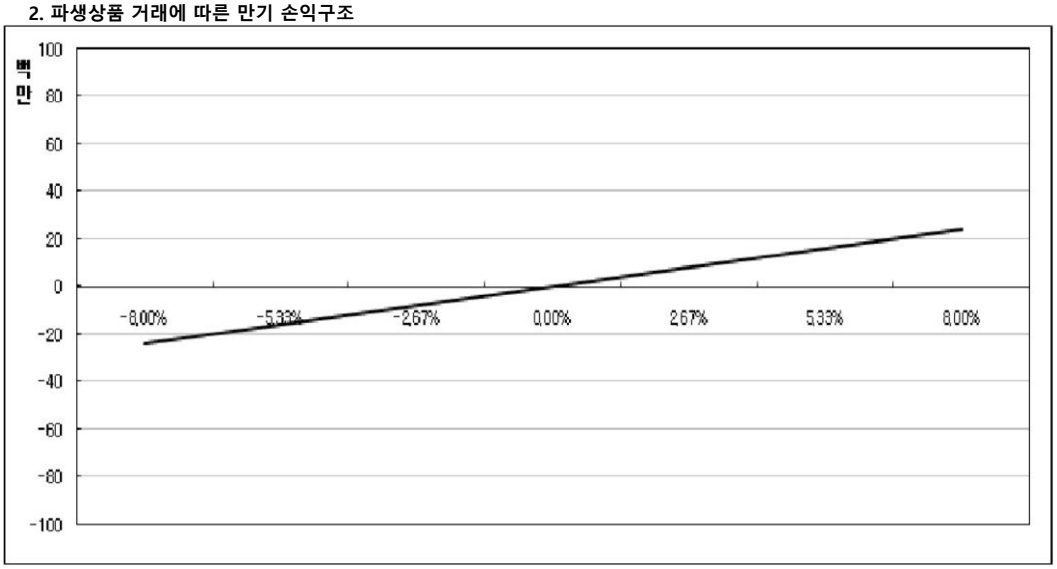
공시일: 2019-03-13

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	833	0	833	장내
합계			833	0	833	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,115

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

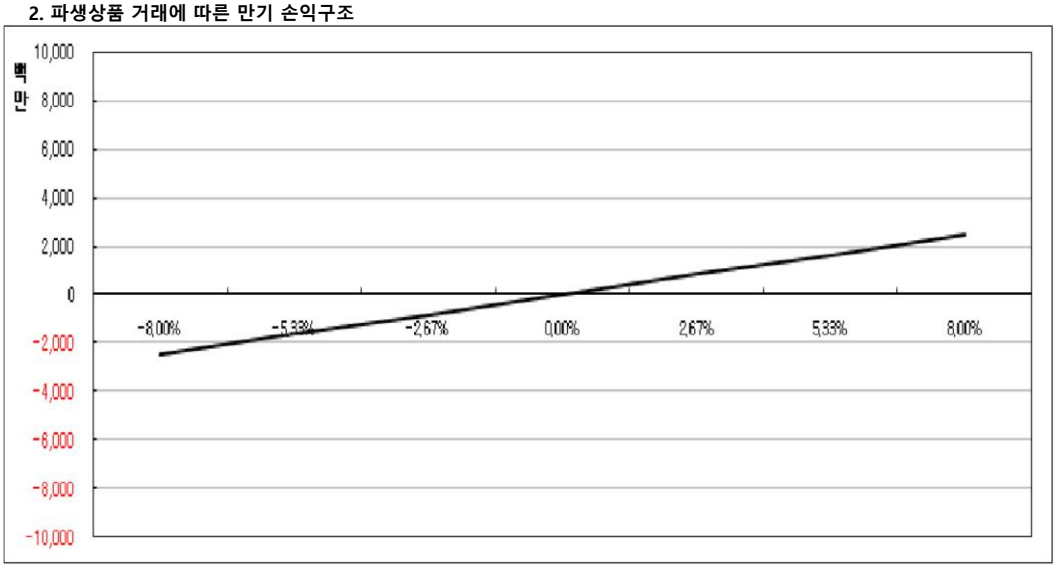
공시일: 2019-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	139	0	139	장내
누계	주가지수	선물	4,721	0	4,721	장내
합계			4,721	0	4,721	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 378

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,345

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

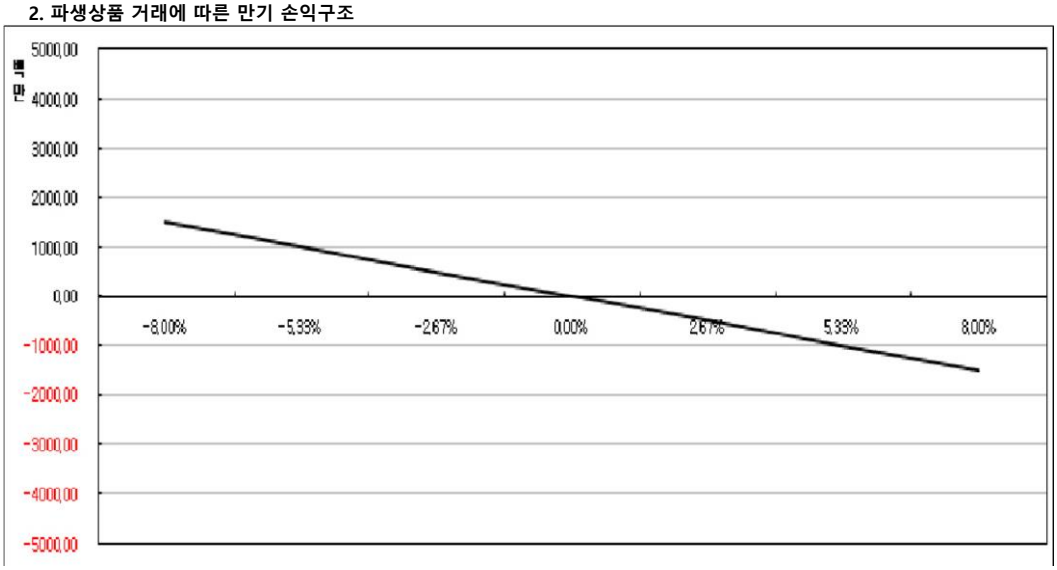
공시일: 2019-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	208	0	208	장내
누계	주가지수	선물	0	2,847	-2,847	장내
합계			0	2,847	-2,847	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 228

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 193

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

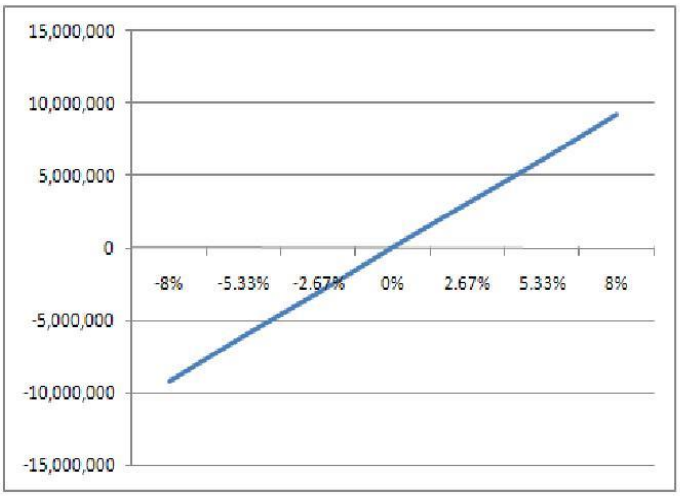
공시일: 2019-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	22,635	21,594	1,041	장내
누계	주가지수	선물	69,155	0	69,155	장내
합계			69,155	0	69,155	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,542

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	43,310