펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-18

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	3,498	0	3,498	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	14	13,854	-13,840	장내
합계			3,512	13,854	-10,342	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	726

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	6,117

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

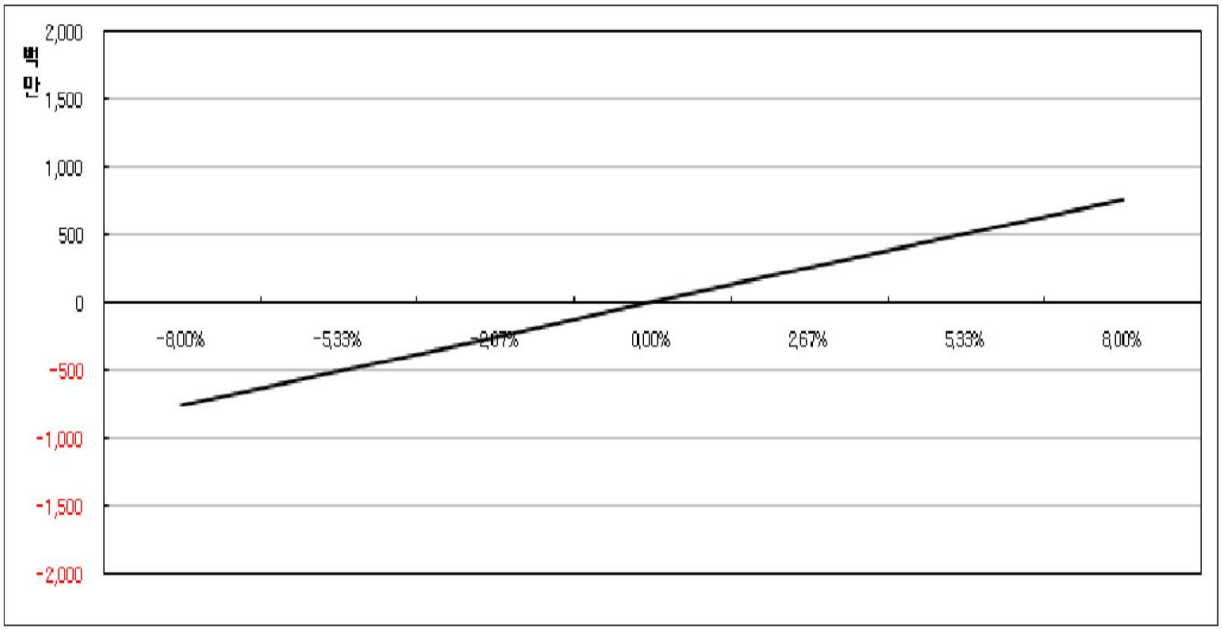
공시일: 2019-03-18

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)

2,770

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

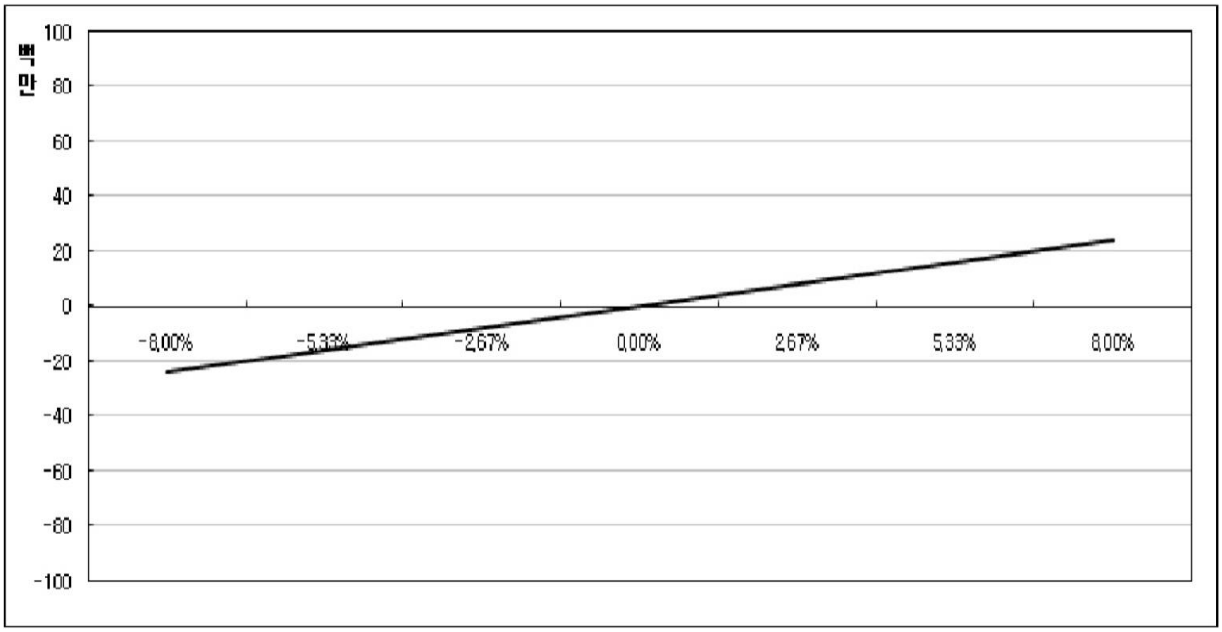
공시일: 2019-03-18

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	840	0	840	장내
합계			840	0	840	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,092

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

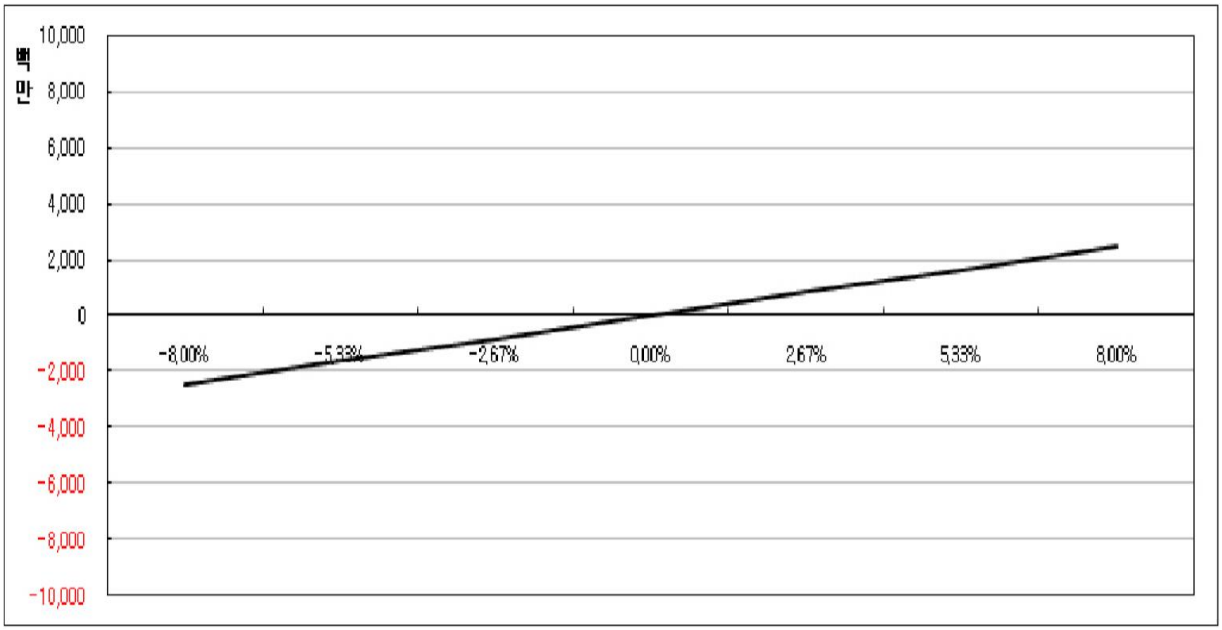
공시일: 2019-03-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	210	140	70	장내
누계	주가지수	선물	4,828	0	4,828	장내
합계			4,828	0	4,828	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

387

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,308

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

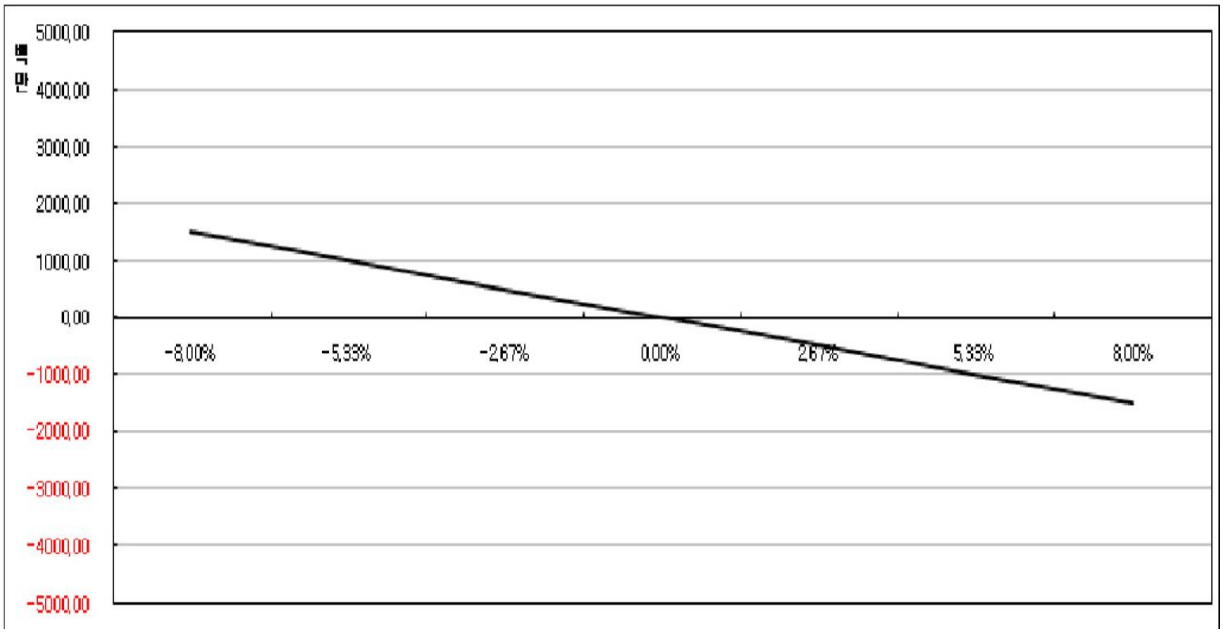
공시일: 2019-03-18

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	2,799	-2,799	장내
합계			0	2,799	-2,799	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

225

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

191

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

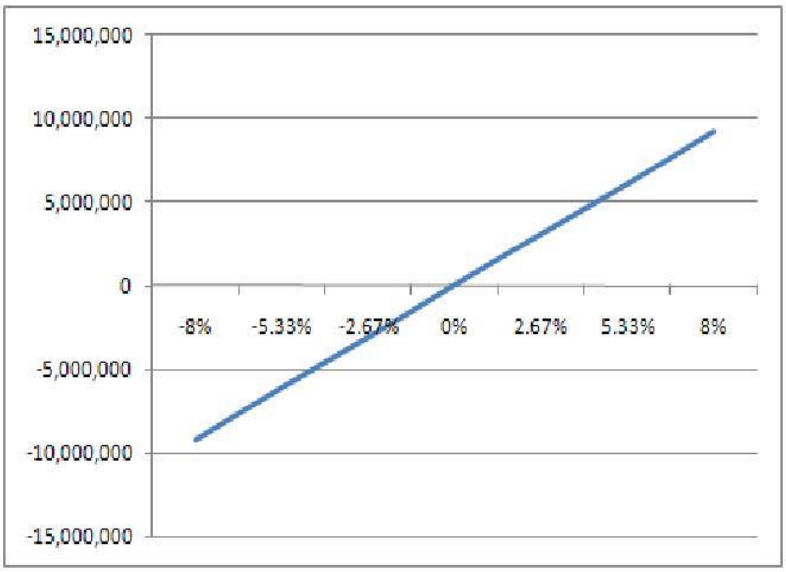
공시일: 2019-03-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	840	0	840	장내
누계	주가지수	선물	70,527	0	70,527	장내
합계			70,527	0	70,527	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,660

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,044