펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-20

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	11	13,851	-13,841	장내
합계			3,508	13,851	-10,343	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	736

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,010

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

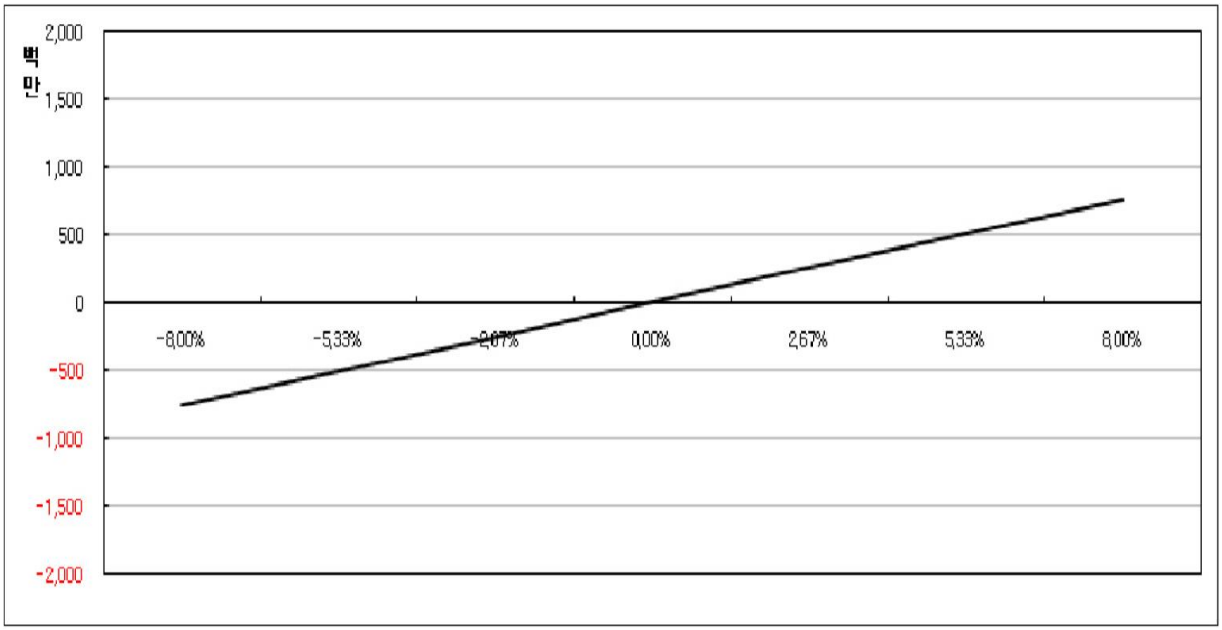
공시일: 2019-03-20

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)

2,752

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

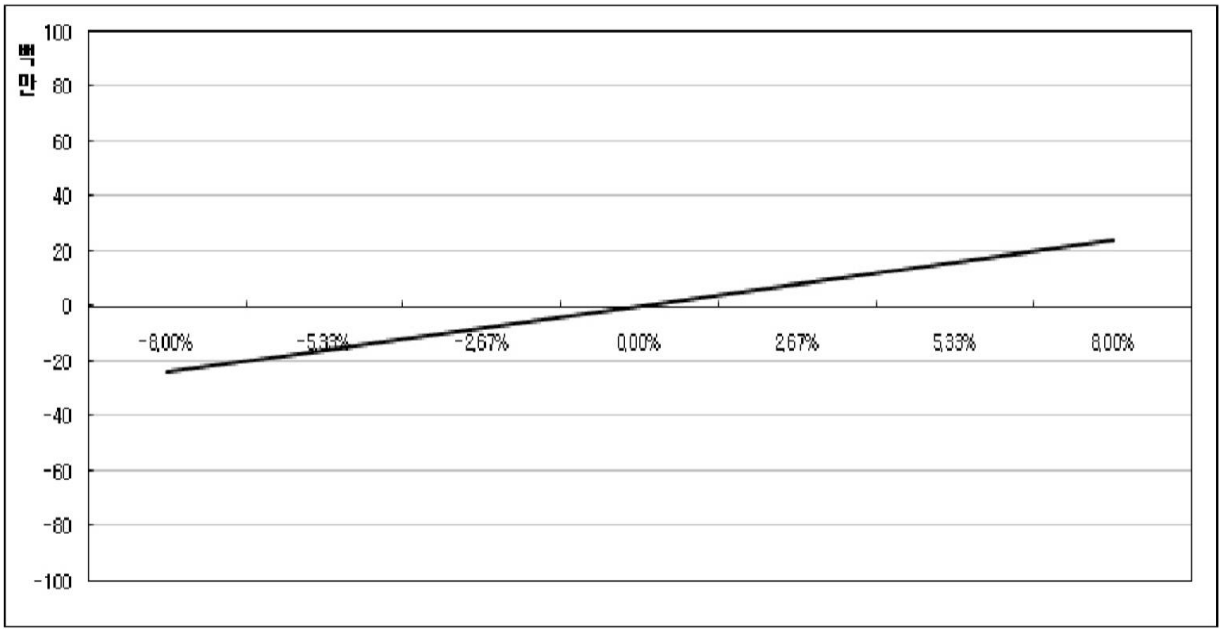
공시일: 2019-03-20

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	839	0	839	장내
합계			839	0	839	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,071

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

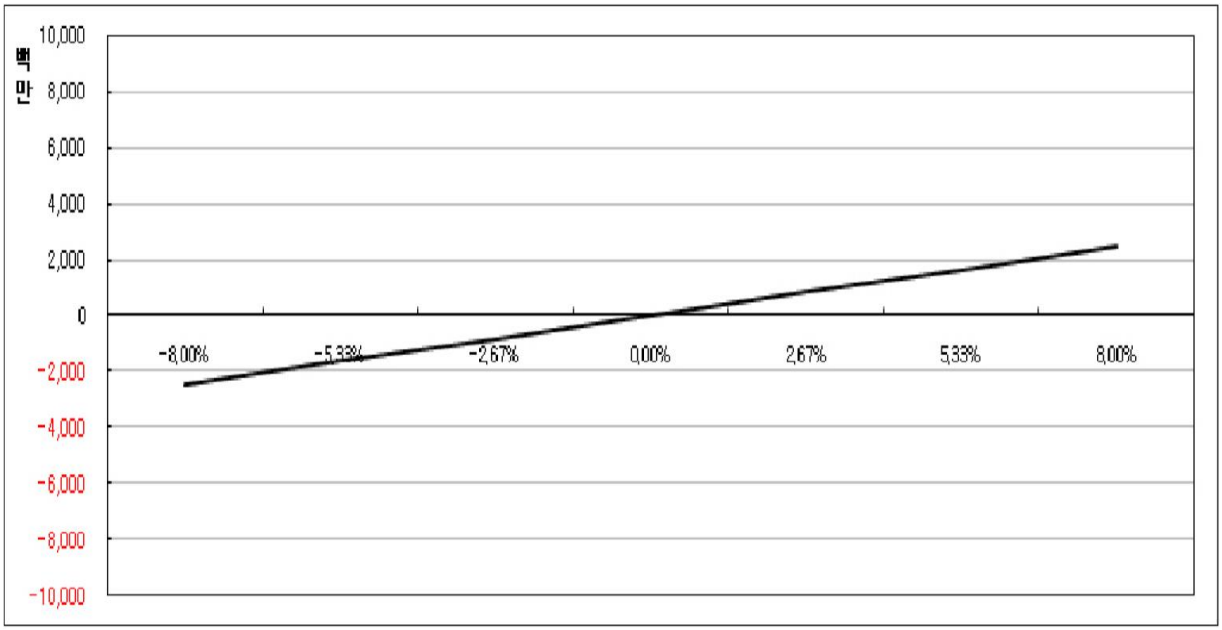
공시일: 2019-03-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	210	-210	장내
누계	주가지수	선물	4,617	0	4,617	장내
합계			4,617	0	4,617	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

370

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,269

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

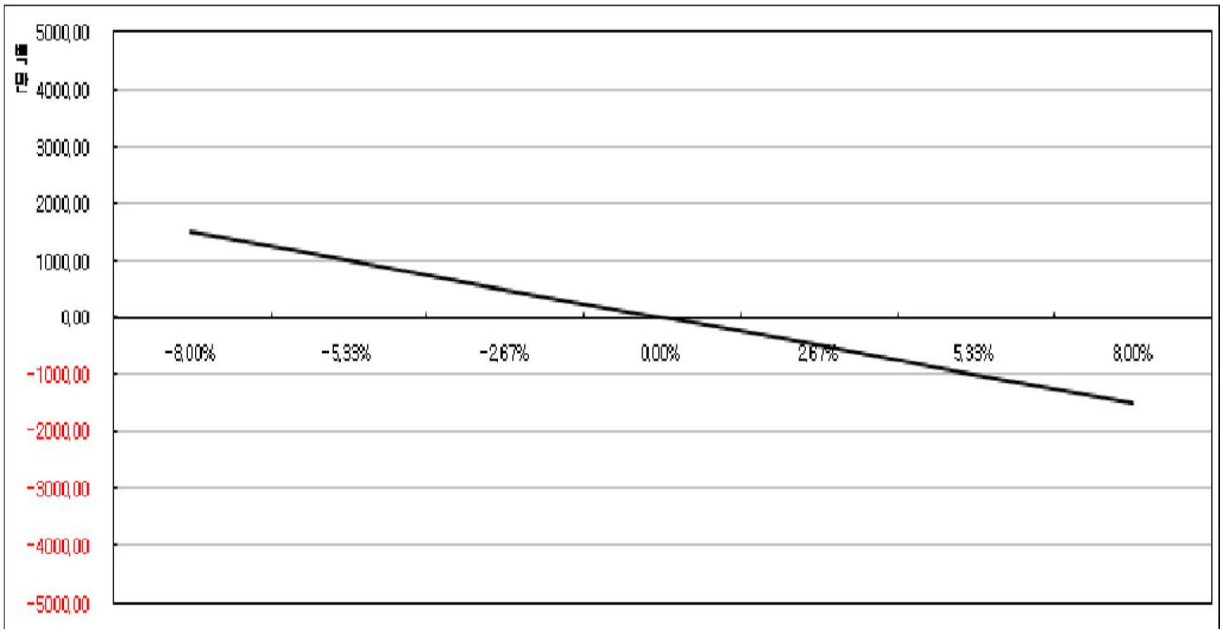
공시일: 2019-03-20

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	2,798	-2,798	장내
합계			0	2,798	-2,798	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

224

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

191

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

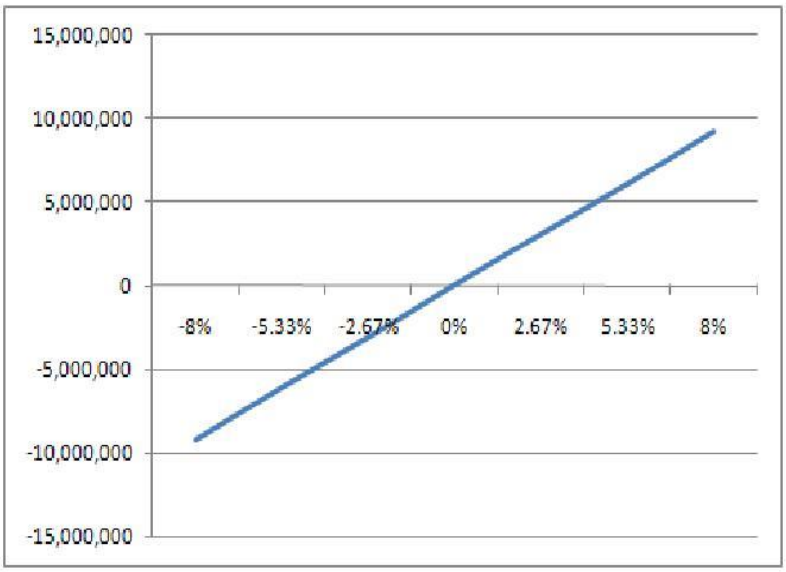
공시일: 2019-03-20

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	70,235	0	70,235	장내
합계			70,235	0	70,235	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,633

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

42,759