펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-22

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	3,530	0	3,530	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	7	13,978	-13,971	장내
합계			3,536	13,978	-10,441	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	790

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,772

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

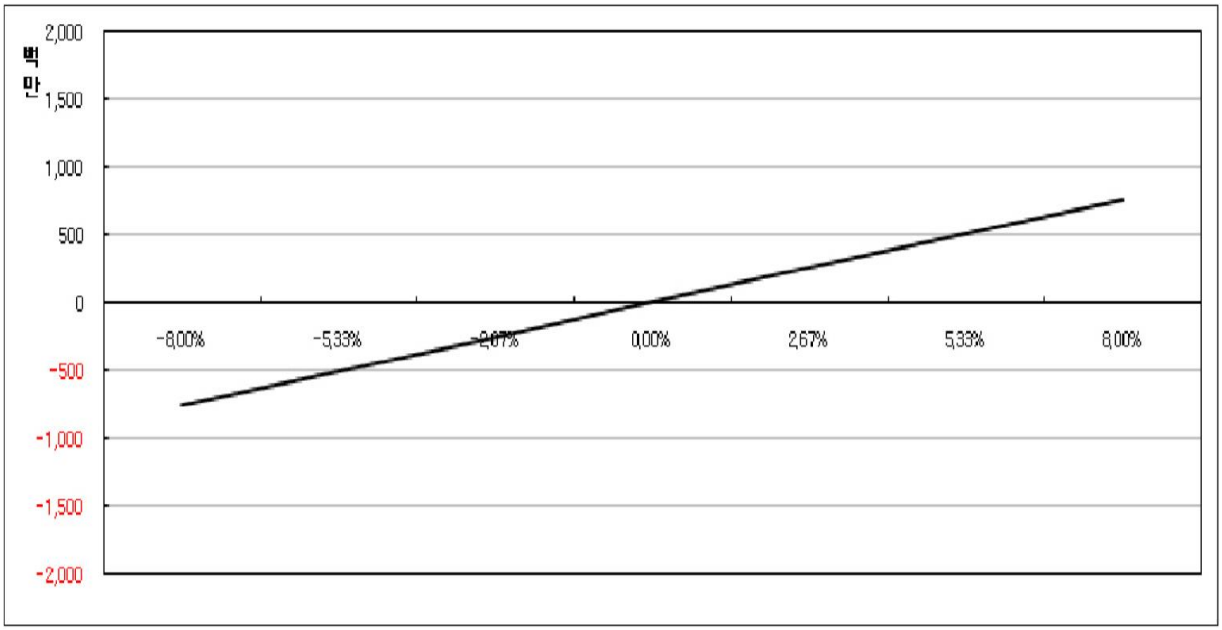
공시일: 2019-03-22

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	282	0	282	장내
합계			282	0	282	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

23

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,865

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

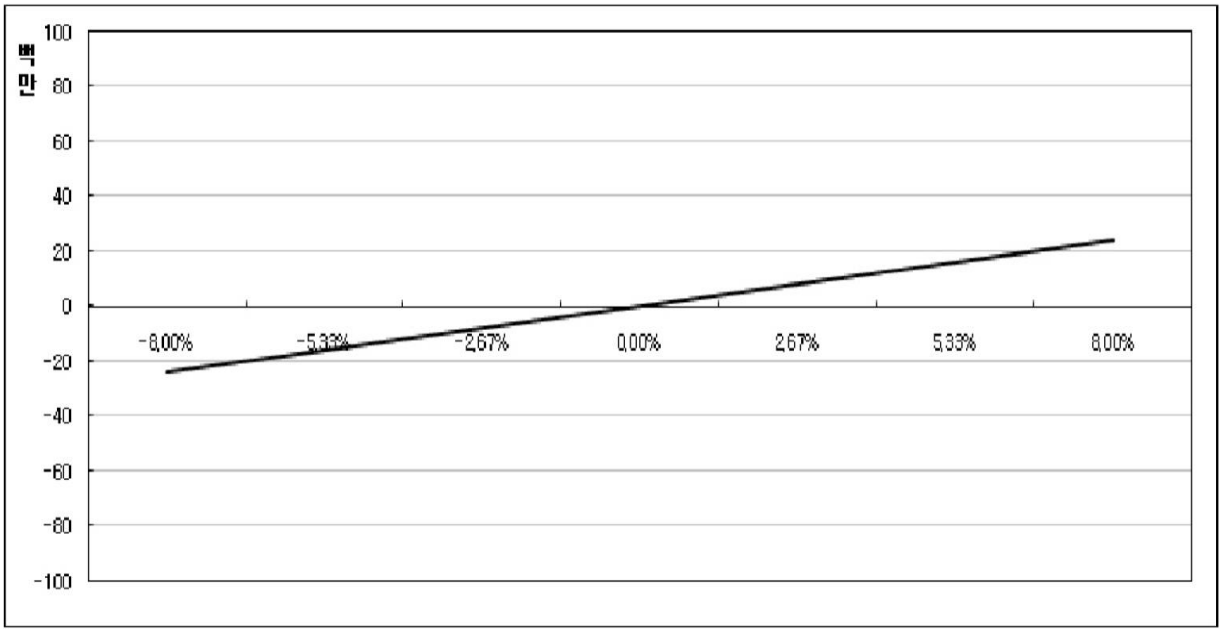
공시일: 2019-03-22

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	847	0	847	장내
합계			847	0	847	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,197

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

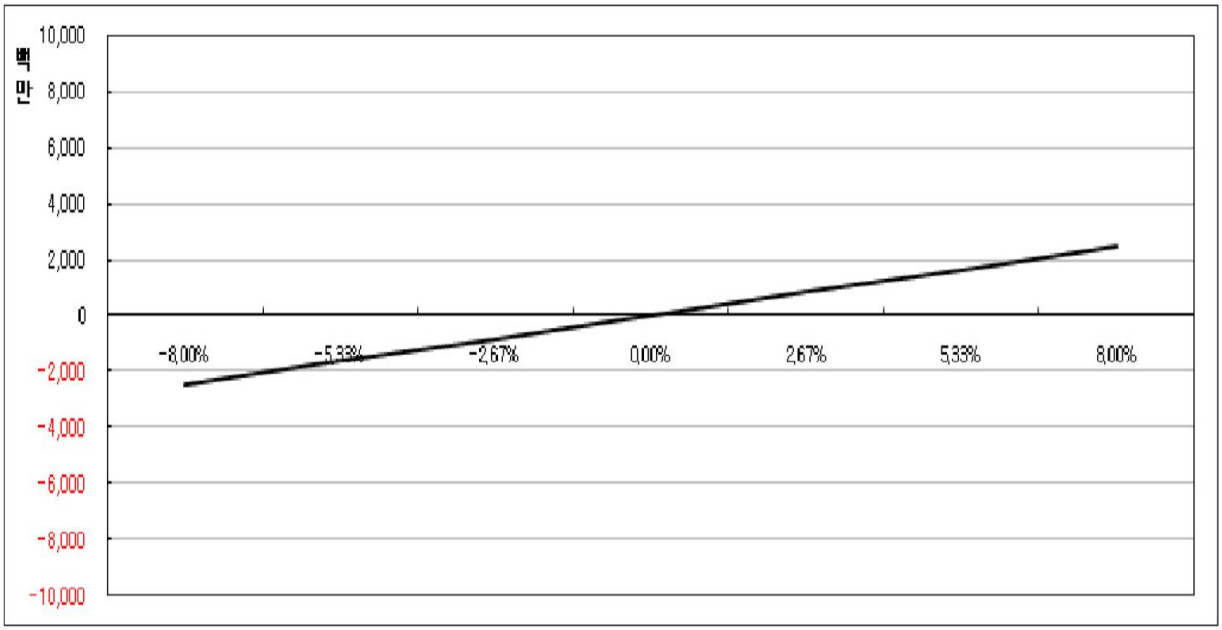
공시일: 2019-03-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	141	-141	장내
누계	주가지수	선물	4,518	0	4,518	장내
합계			4,518	0	4,518	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

362

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,478

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

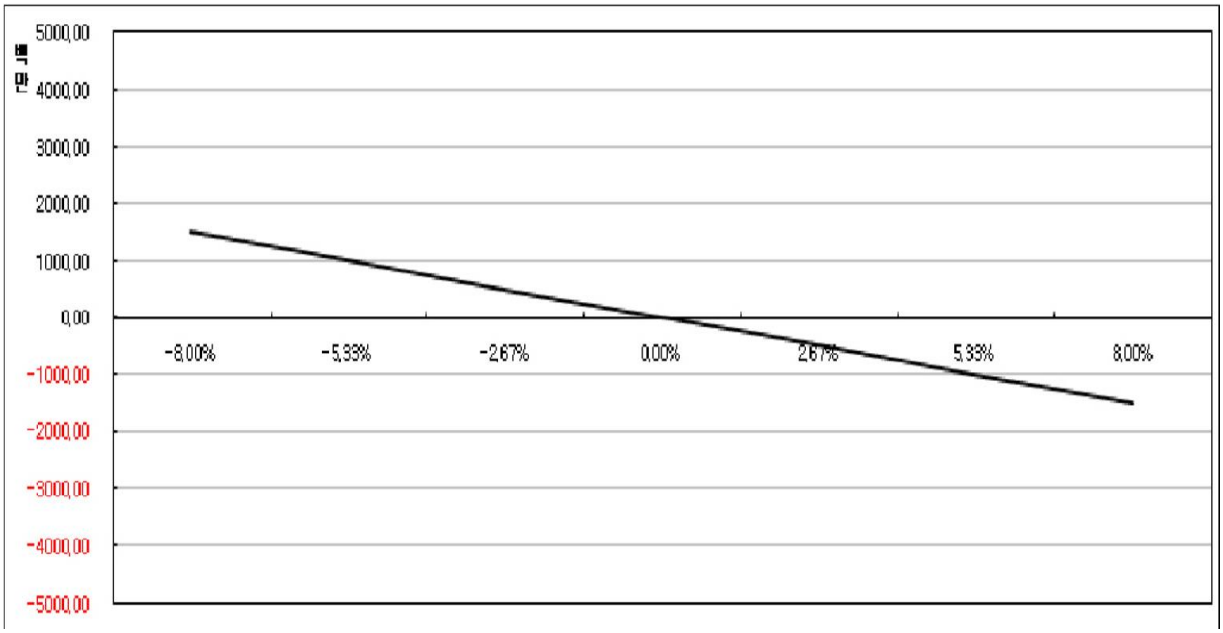
공시일: 2019-03-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	141	0	141	장내
누계	주가지수	선물	0	2,894	-2,894	장내
합계			0	2,894	-2,894	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

232

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

197

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

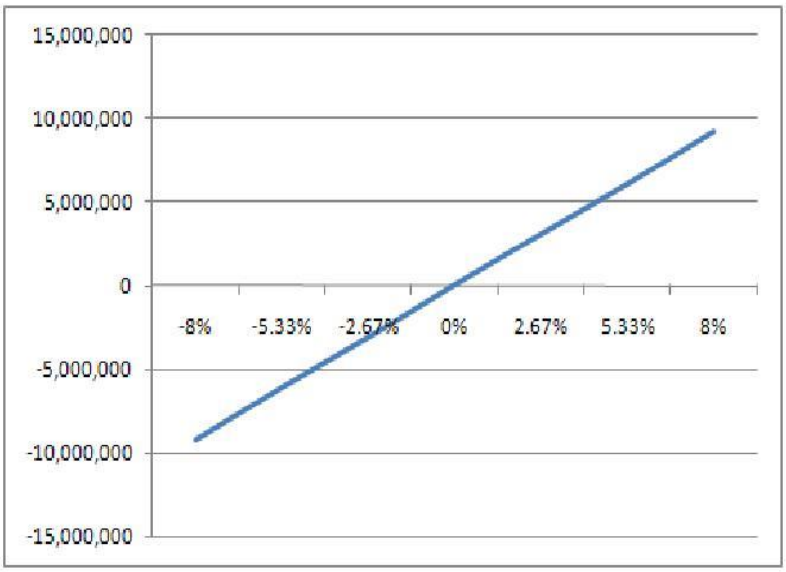
공시일: 2019-03-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	706	-706	장내
누계	주가지수	선물	70,383	0	70,383	장내
합계			70,383	0	70,383	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,639

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,424