펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-28

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	3,466	0	3,466	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	6	6,863	-6,856	장내
합계			3,472	6,863	-3,390	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

211

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,928

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

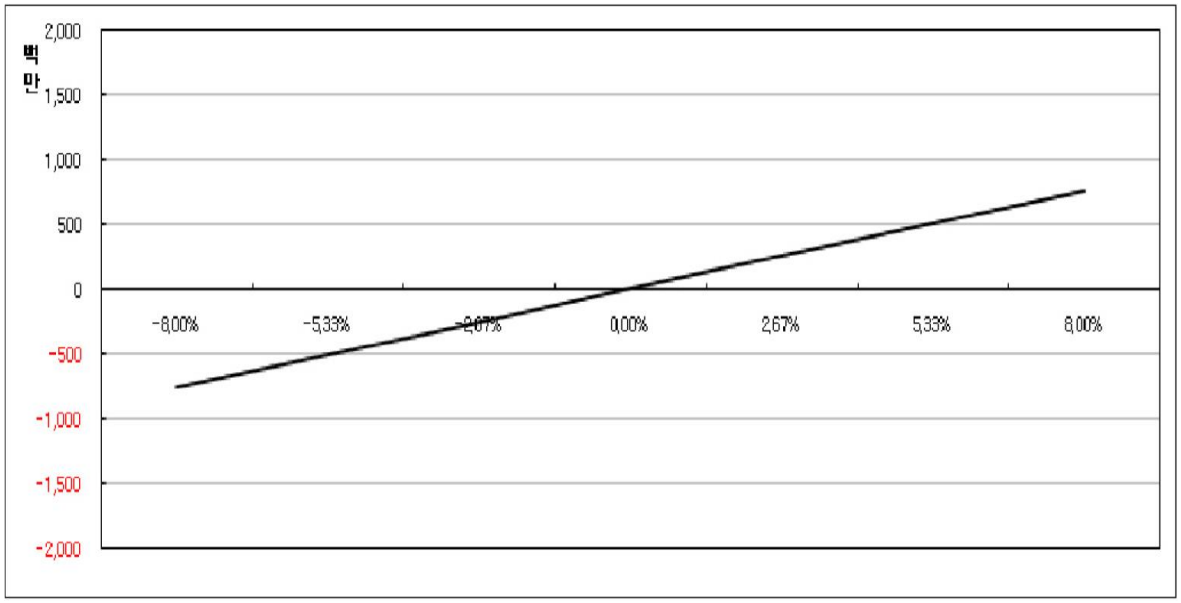
공시일: 2019-03-28

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	277	0	277	장내
합계			277	0	277	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,825

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

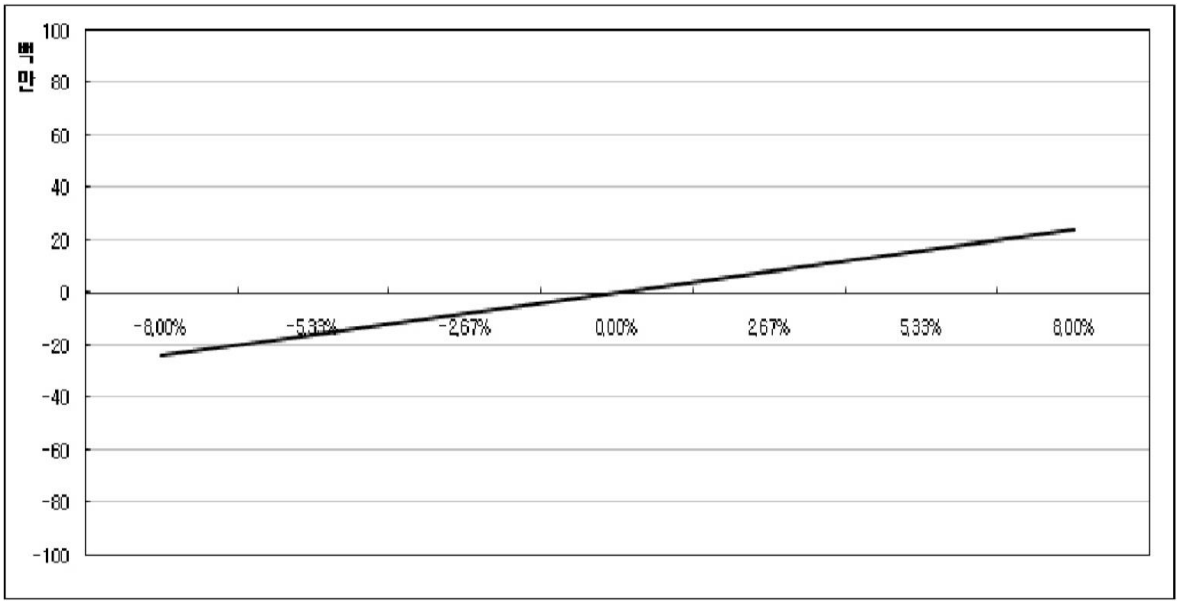
공시일: 2019-03-28

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	832	0	832	장내
합계			832	0	832	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,152

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

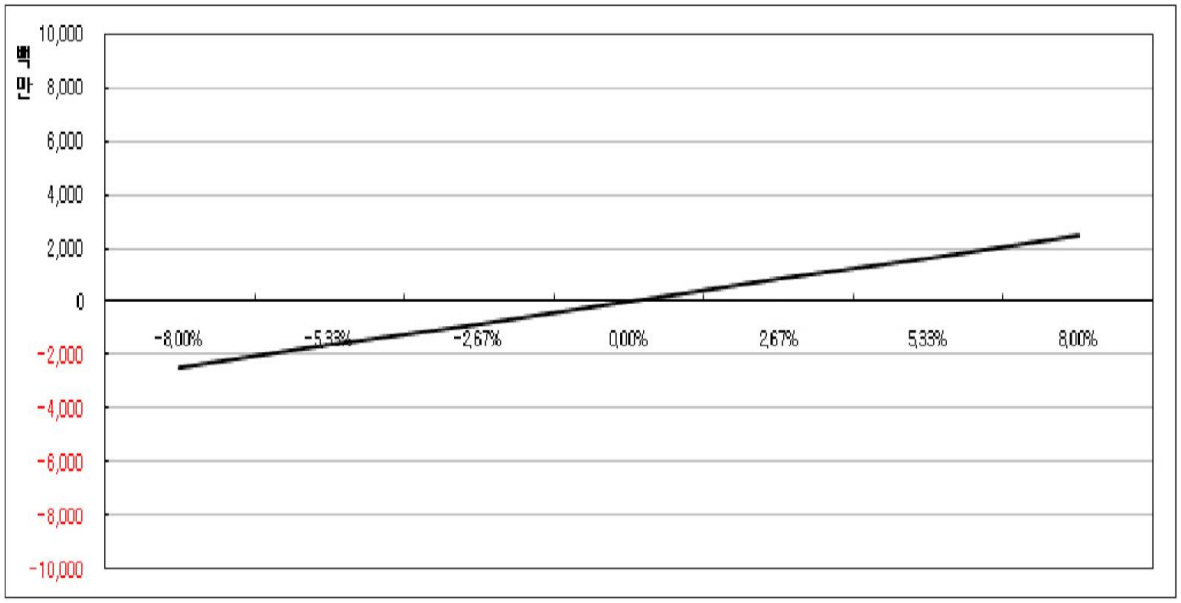
공시일: 2019-03-28

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	4,436	0	4,436	장내
합계			4,436	0	4,436	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

356

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,396

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

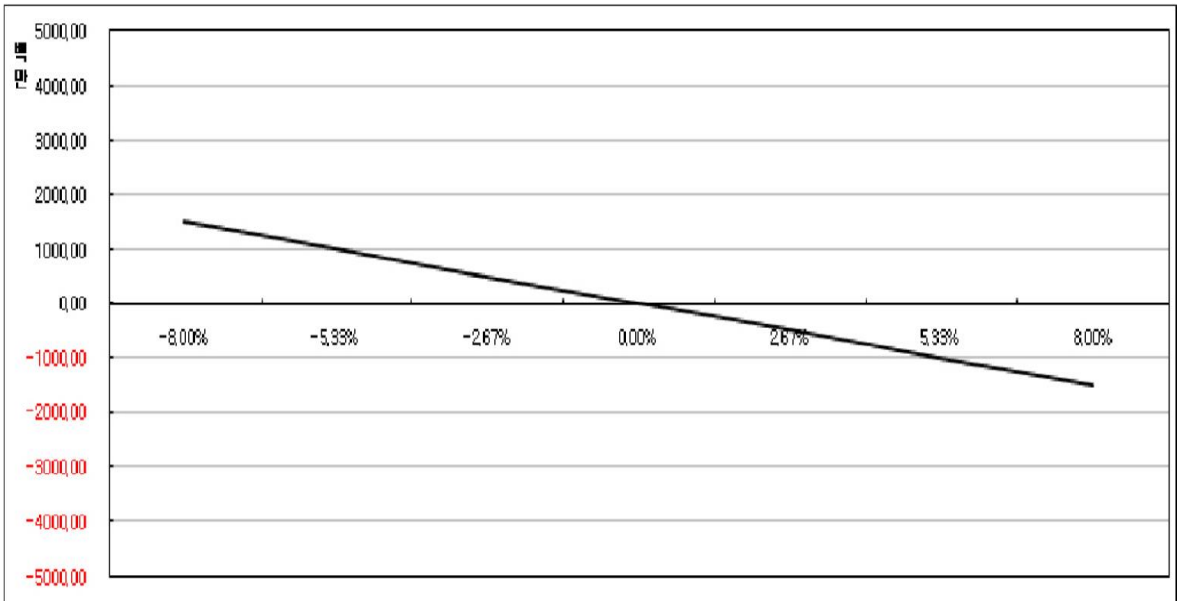
공시일: 2019-03-28

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	0	2,981	-2,981	장내
합계			0	2,981	-2,981	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

239

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

198

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

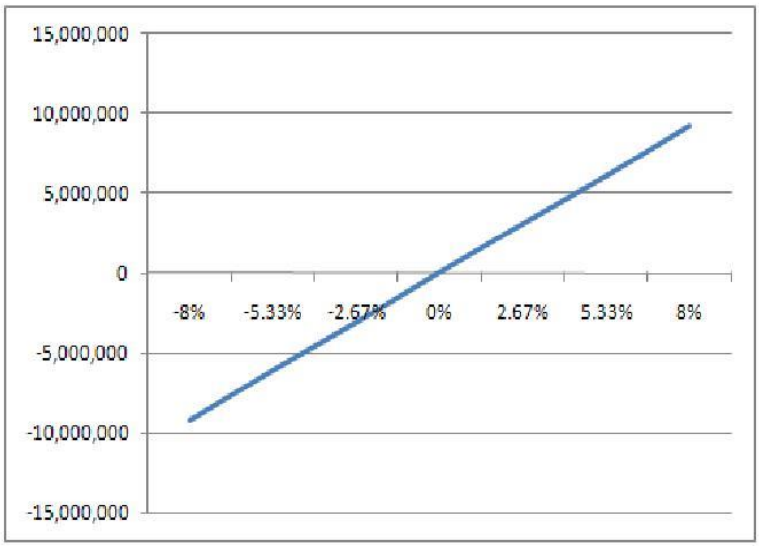
공시일: 2019-03-28

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	68,765	0	68,765	장내
합계			68,765	0	68,765	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,516

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,679