펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-01

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	3,456	0	3,456	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	6,843	-6,838	장내
합계			3,461	6,843	-3,382	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	215

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,859

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

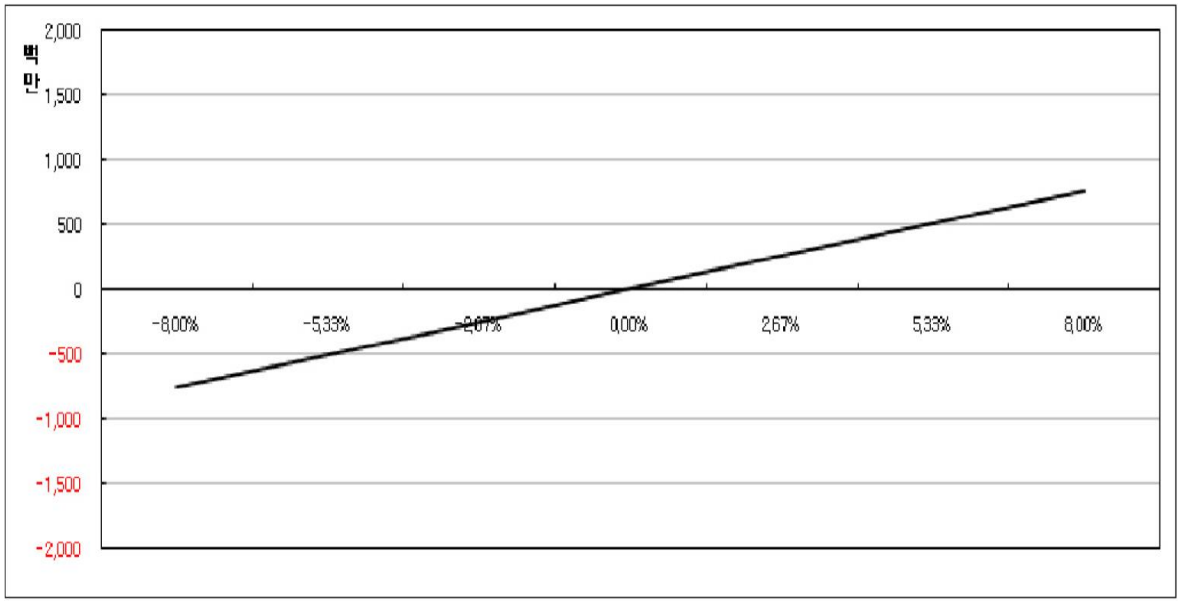
공시일: 2019-04-01

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	276	0	276	장내
합계			276	0	276	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,785

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

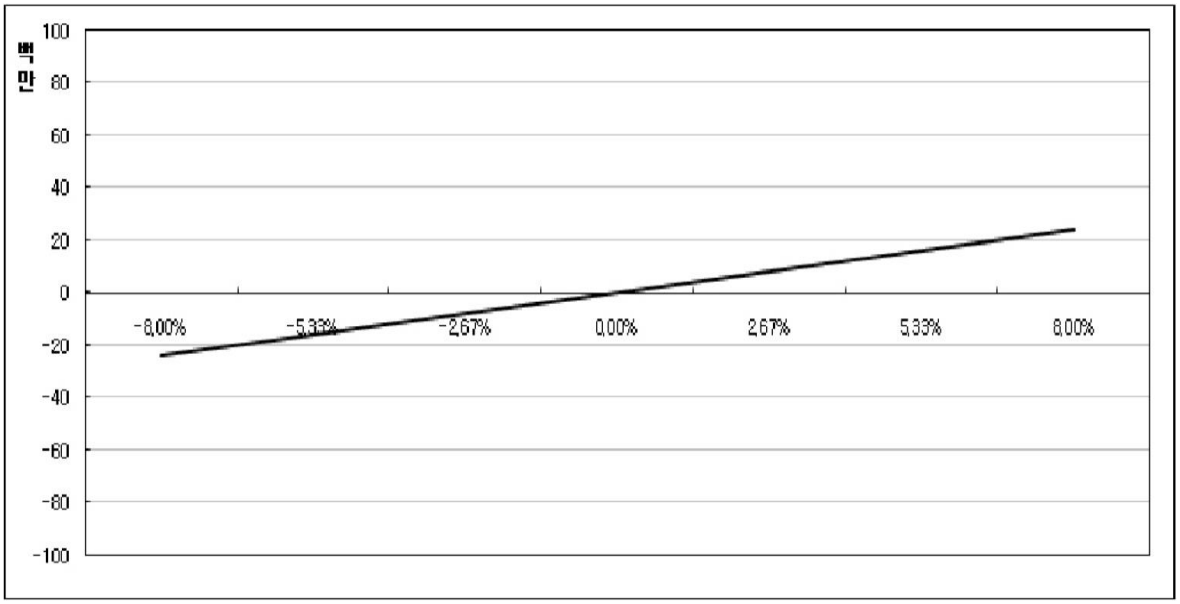
공시일: 2019-04-01

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	829	0	829	장내
합계			829	0	829	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,107

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

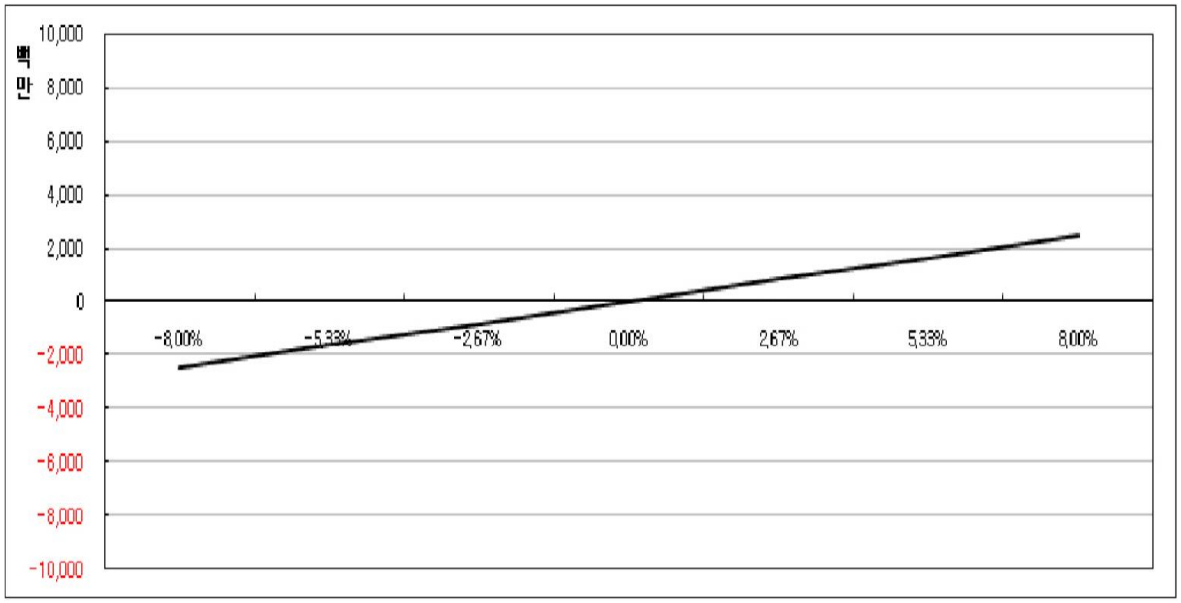
공시일: 2019-04-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	484	276	207	장내
누계	주가지수	선물	4,631	0	4,631	장내
합계			4,631	0	4,631	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

371

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,325

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

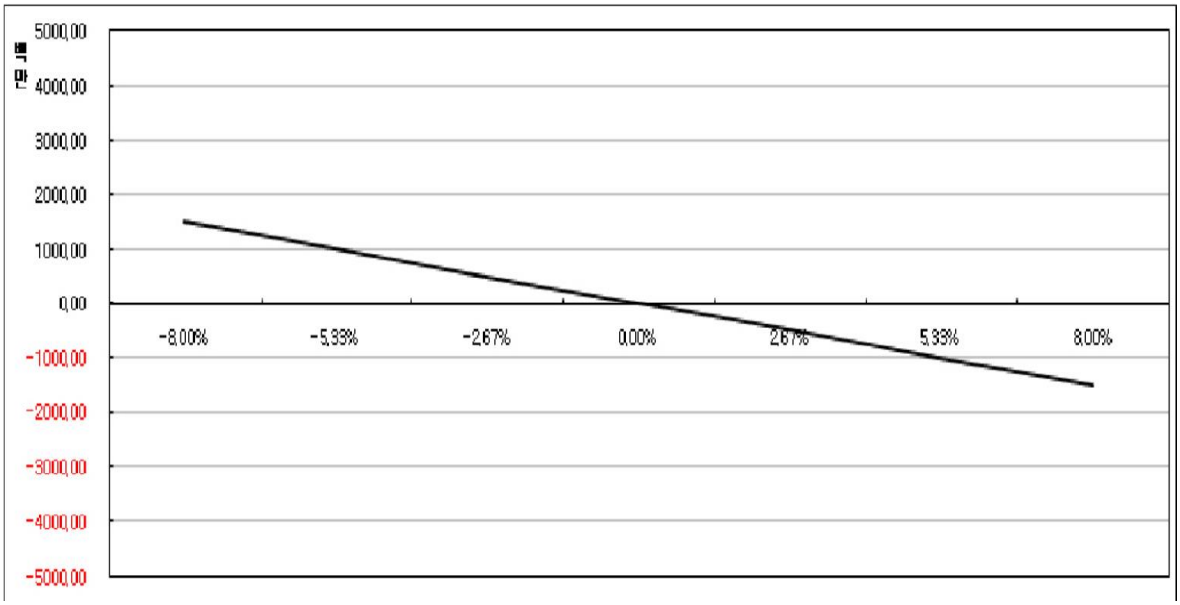
공시일: 2019-04-01

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	2,765	-2,765	장내
합계			0	2,765	-2,765	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

222

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

184

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

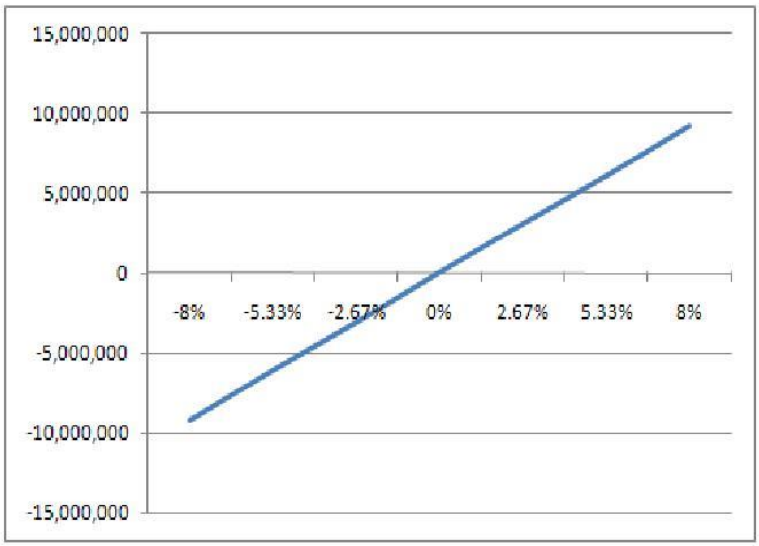
공시일: 2019-04-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	968	0	968	장내
누계	주가지수	선물	69,535	0	69,535	장내
합계			69,535	0	69,535	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,577

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,098