펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-02

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	3,504	0	3,504	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	13,876	-13,873	장내
합계			3,507	13,876	-10,369	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	785

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,669

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

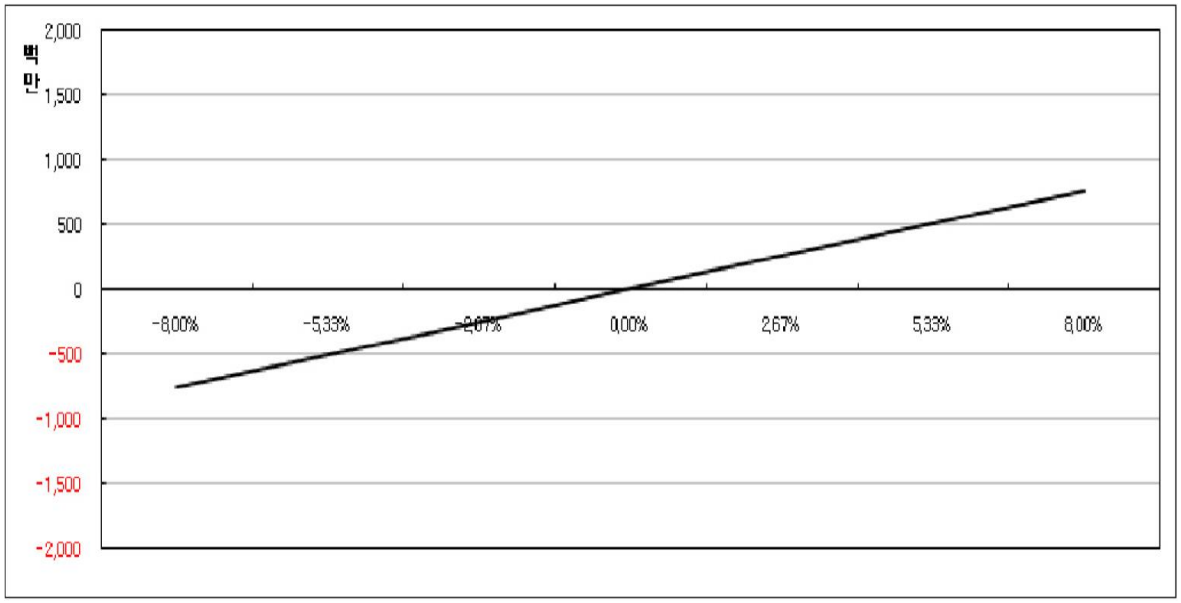
공시일: 2019-04-02

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	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,812

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

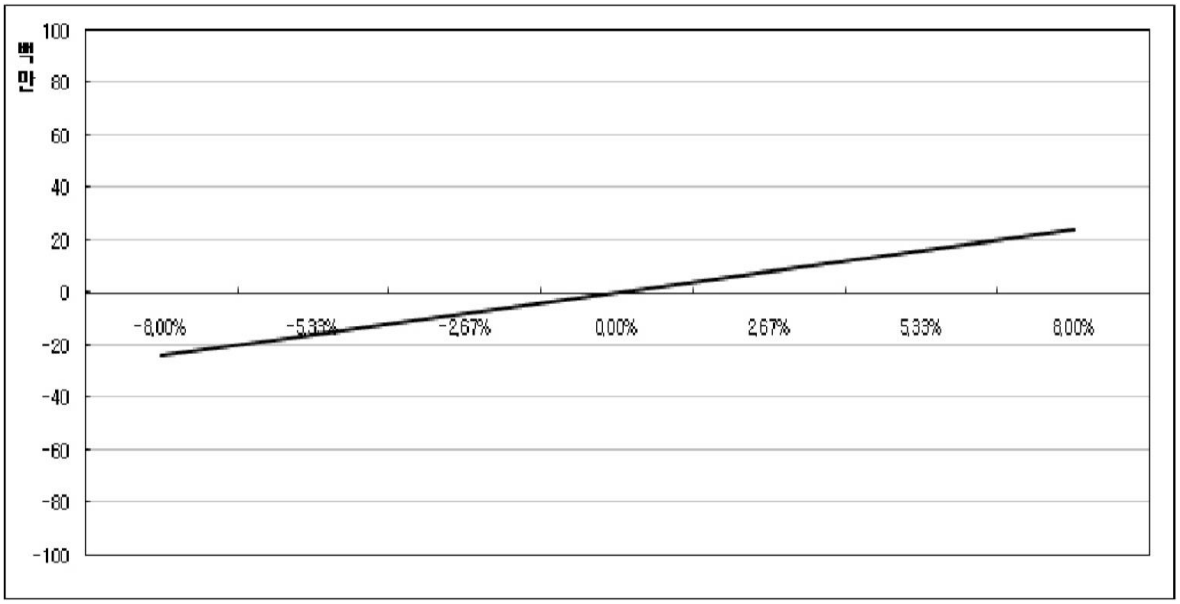
공시일: 2019-04-02

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	841	0	841	장내
합계			841	0	841	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,137

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

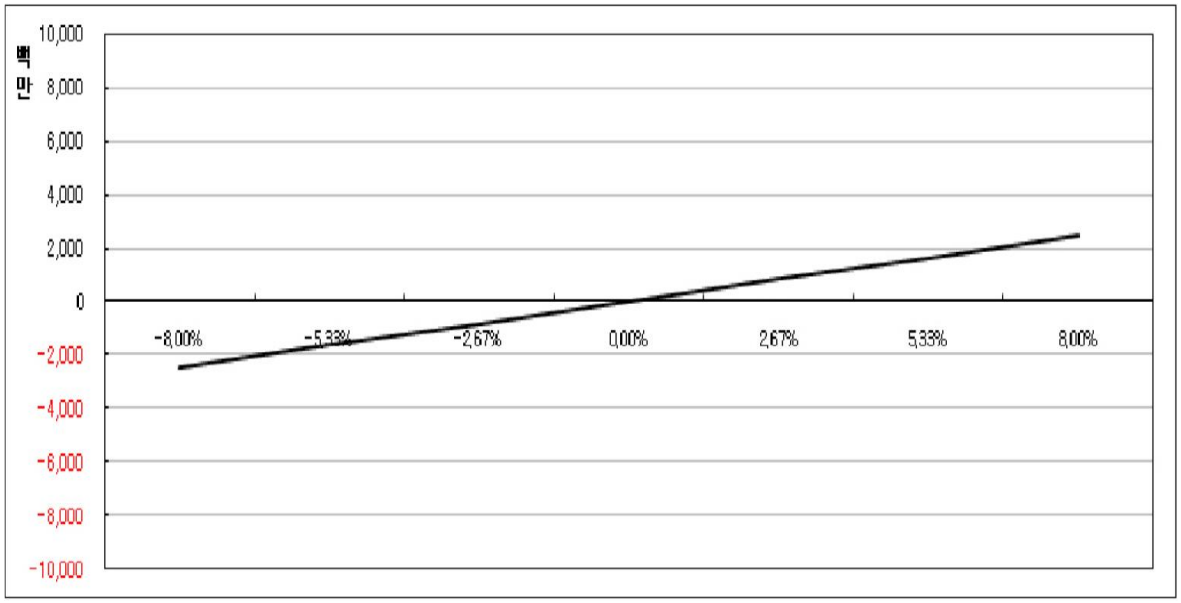
공시일: 2019-04-02

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	4,695	0	4,695	장내
합계			4,695	0	4,695	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

377

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,378

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

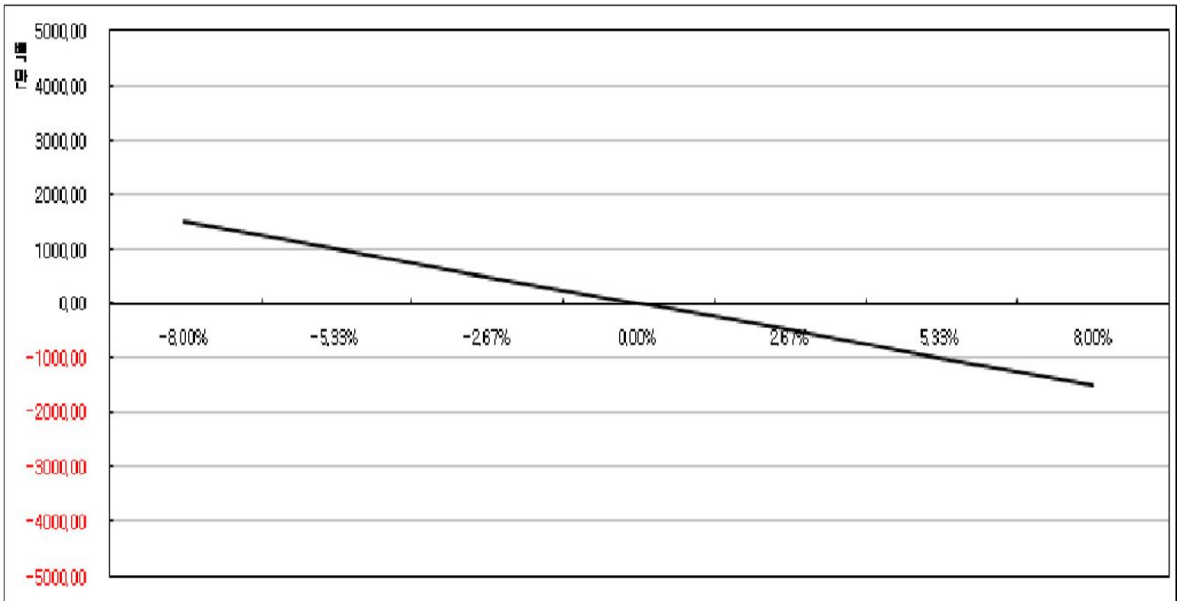
공시일: 2019-04-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	210	210	0	장내
누계	주가지수	선물	0	2,803	-2,803	장내
합계			0	2,803	-2,803	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

225

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

188

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

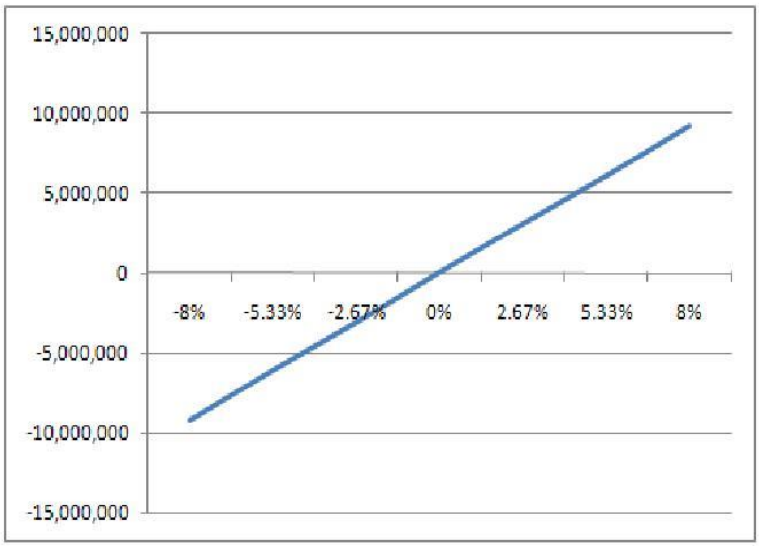
공시일: 2019-04-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	911	0	911	장내
누계	주가지수	선물	71,412	0	71,412	장내
합계			71,412	0	71,412	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,736

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,566