펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-03

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	3,522	0	3,522	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	13,945	-13,943	장내
합계			3,523	13,945	-10,422	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	818

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,756

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

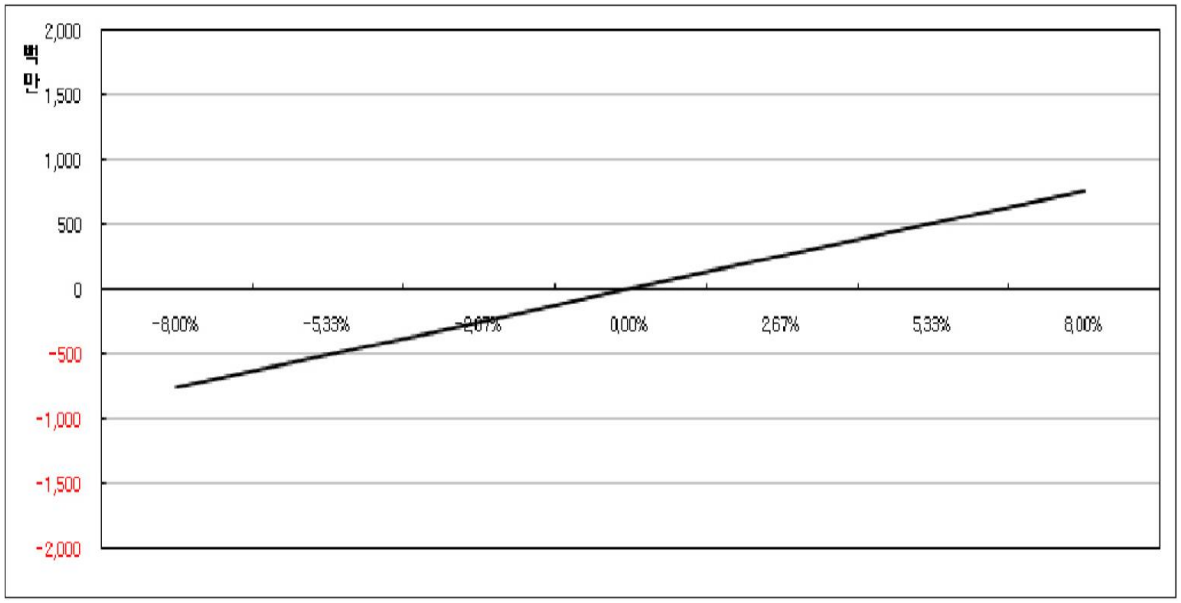
공시일: 2019-04-03

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



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,853

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

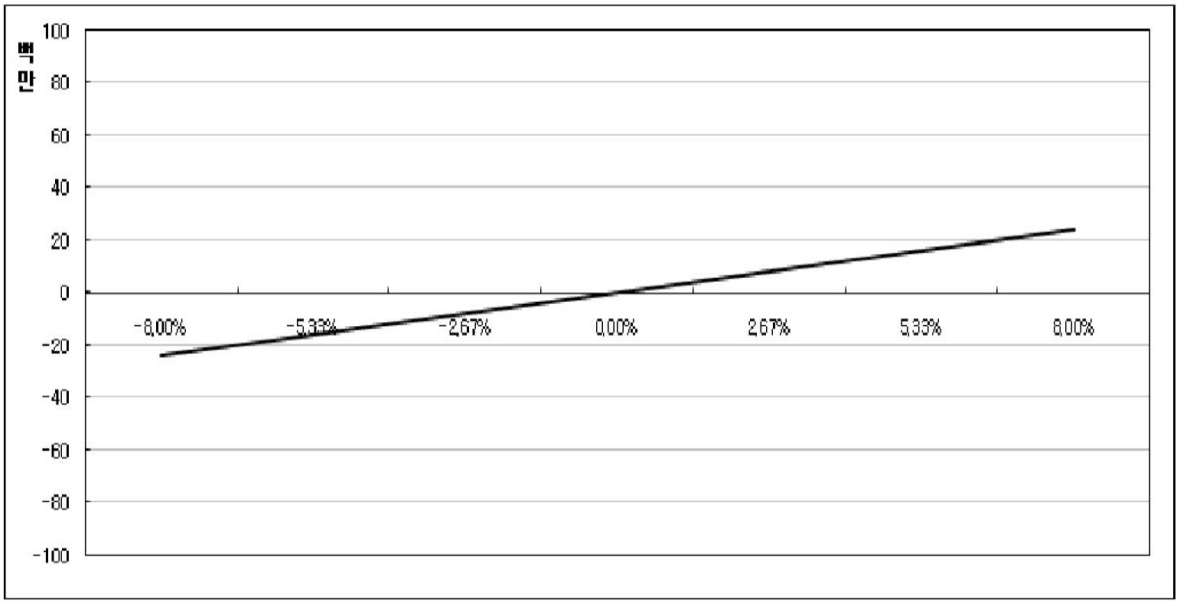
공시일: 2019-04-03

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	845	0	845	장내
합계			845	0	845	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,183

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

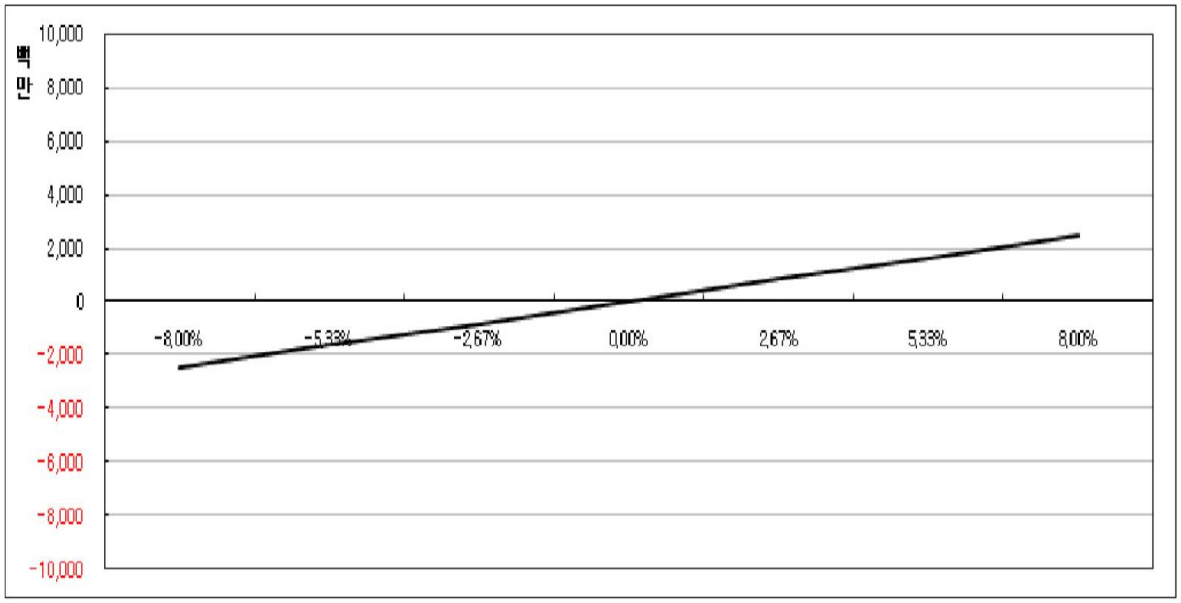
공시일: 2019-04-03

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	4,719	0	4,719	장내
합계			4,719	0	4,719	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

379

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,456

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

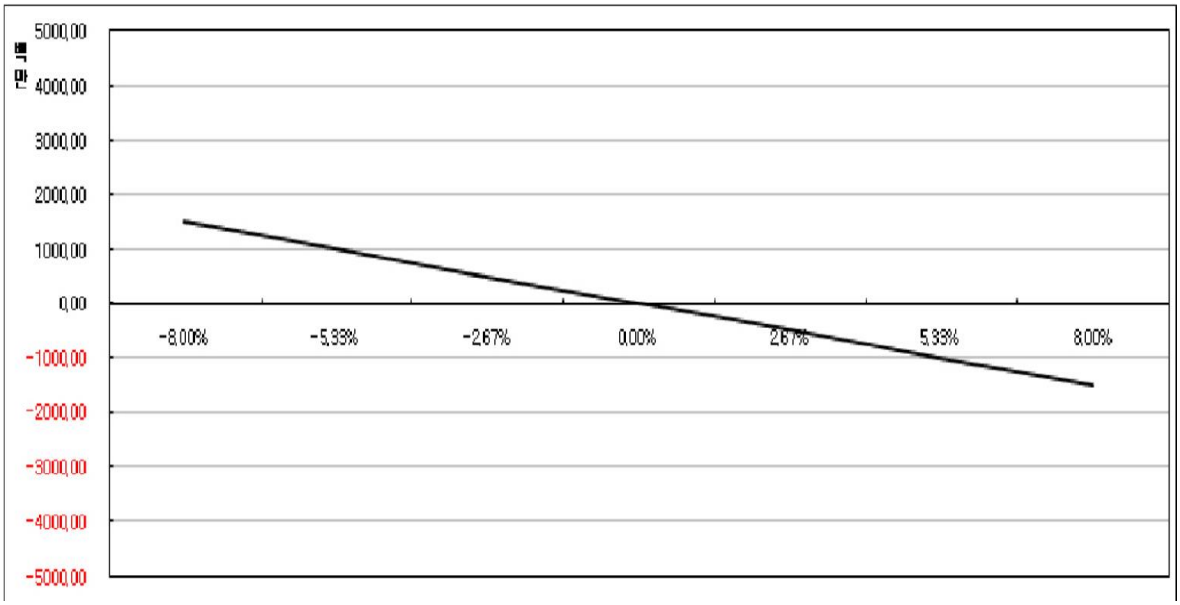
공시일: 2019-04-03

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	2,676	-2,676	장내
합계			0	2,676	-2,676	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

215

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

178

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

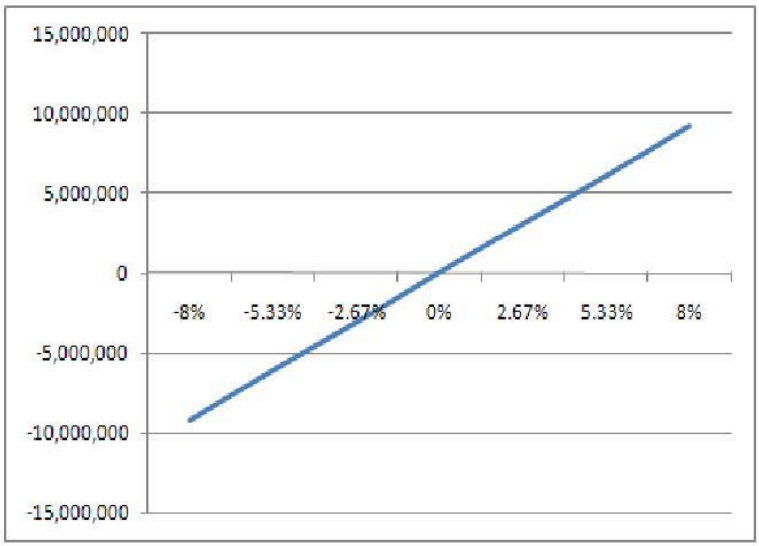
공시일: 2019-04-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	634	-634	장내
누계	주가지수	선물	71,134	0	71,134	장내
합계			71,134	0	71,134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,707

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,174