펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-04

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	3,571	0	3,571	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	14,140	-14,139	장내
합계			3,572	14,140	-10,568	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	830

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,639

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

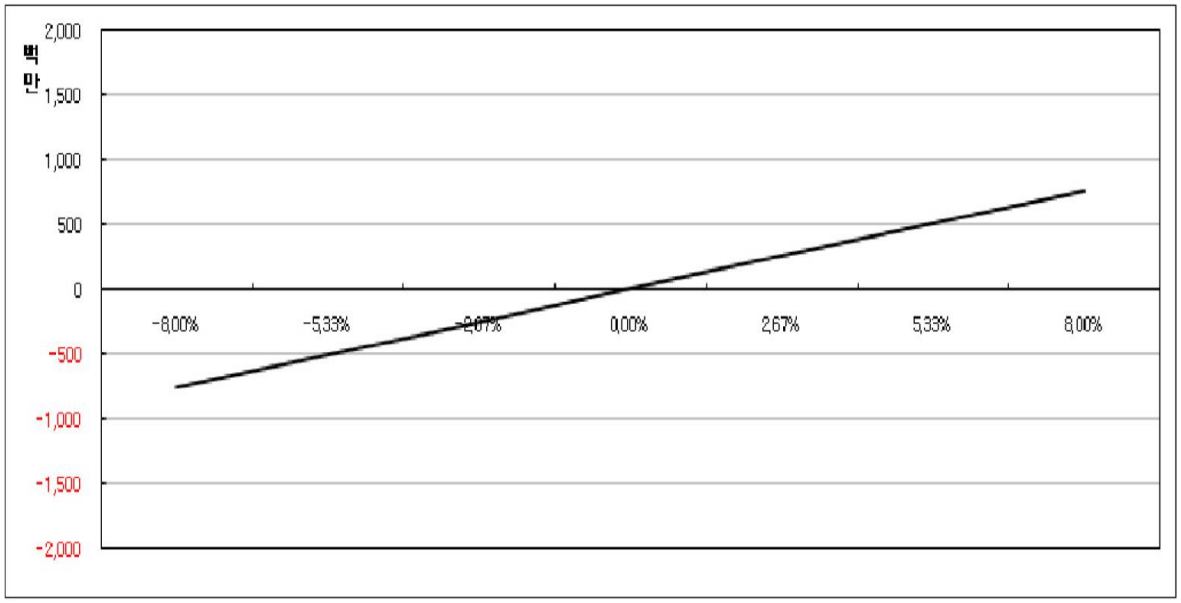
공시일: 2019-04-04

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	286	0	286	장내
합계			286	0	286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,902

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

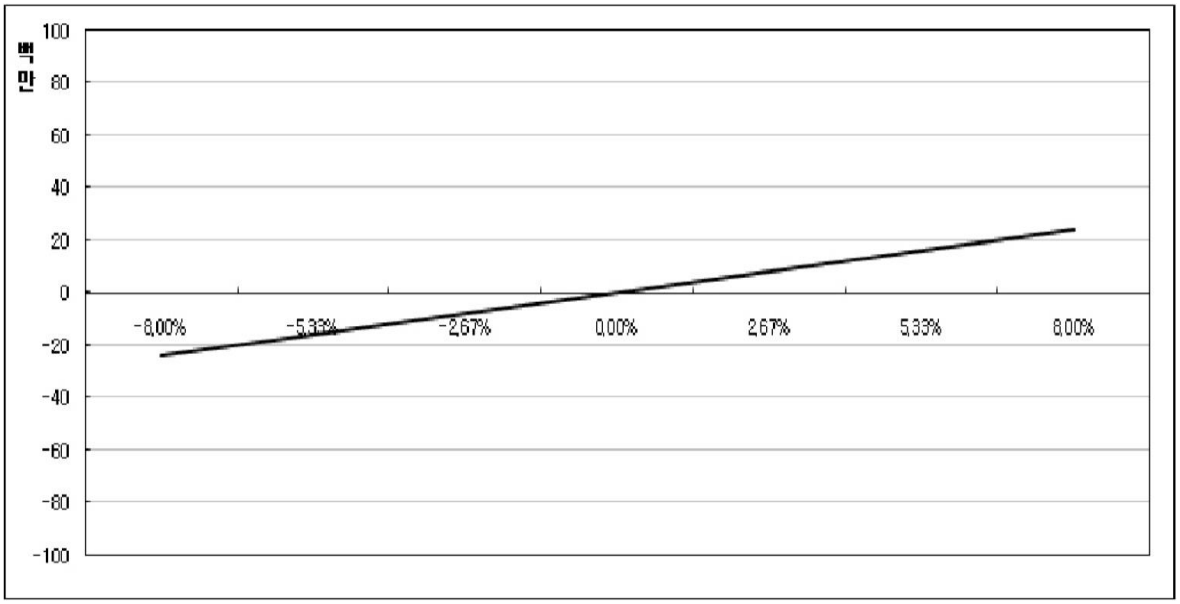
공시일: 2019-04-04

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	857	0	857	장내
합계			857	0	857	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,238

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

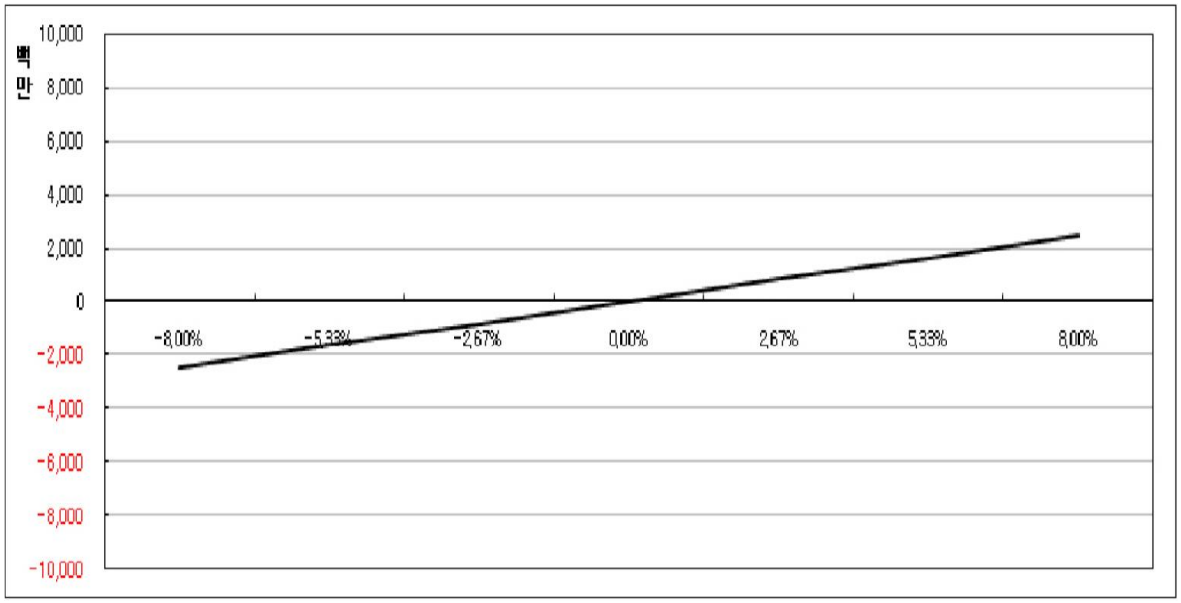
공시일: 2019-04-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	286	-286	장내
누계	주가지수	선물	4,499	0	4,499	장내
합계			4,499	0	4,499	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

361

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,542

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

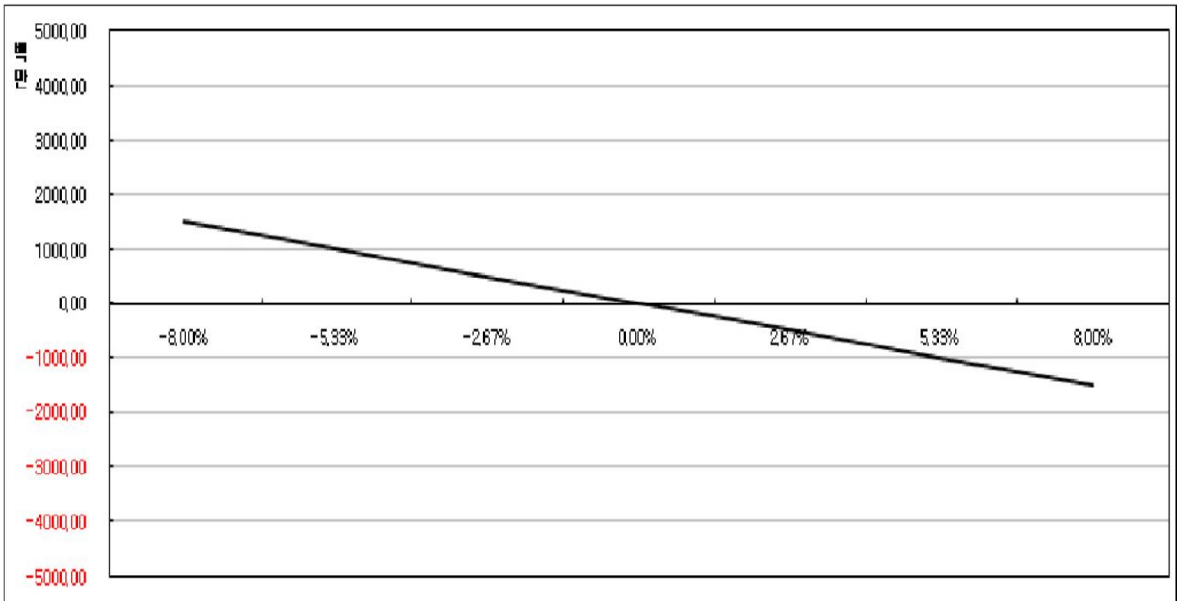
공시일: 2019-04-04

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	2,714	-2,714	장내
합계			0	2,714	-2,714	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

218

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

181

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

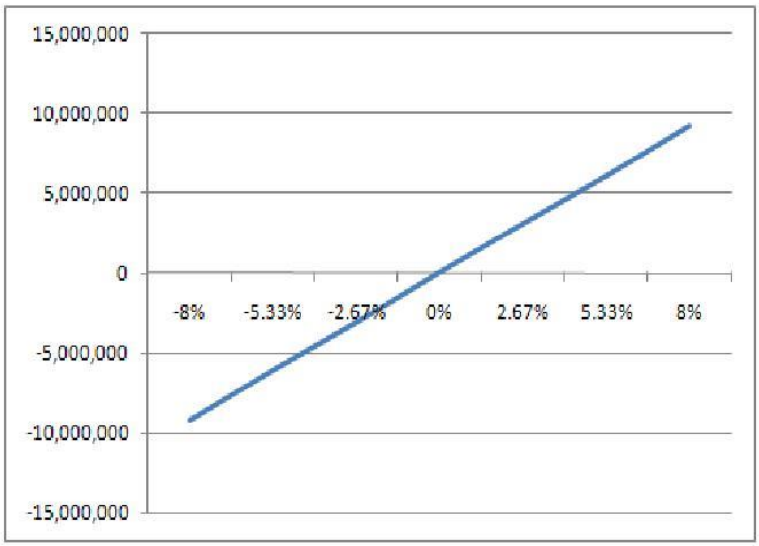
공시일: 2019-04-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	214	0	214	장내
누계	주가지수	선물	72,341	0	72,341	장내
합계			72,341	0	72,341	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,812

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,918