펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-05

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	3,577	0	3,577	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	14,164	-14,164	장내
합계			3,577	14,164	-10,587	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

836

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,427

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

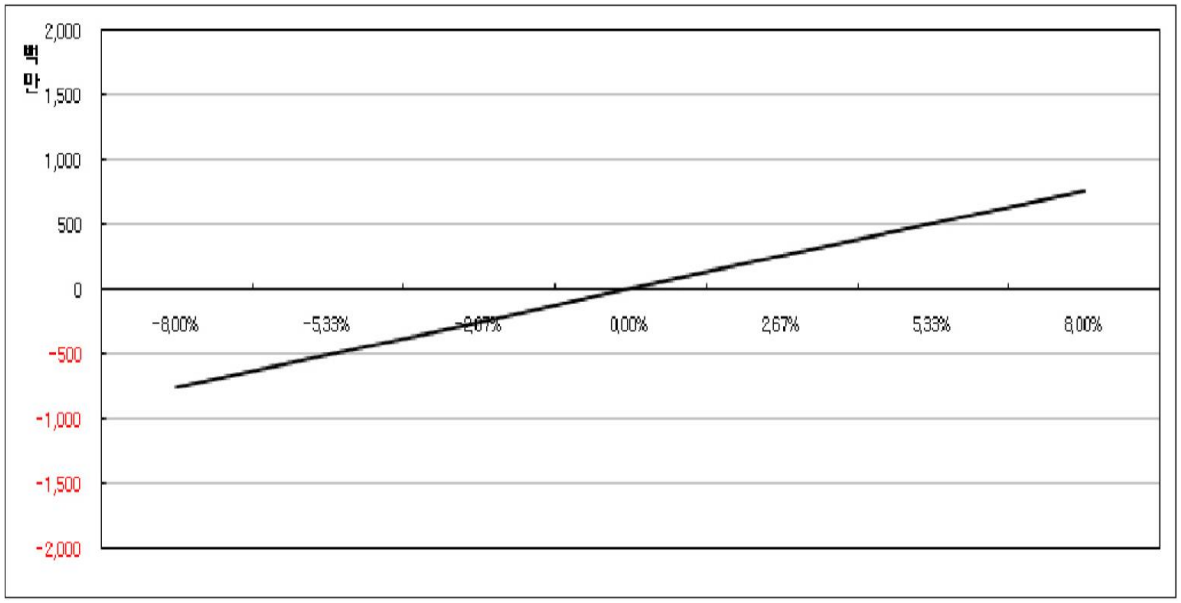
공시일: 2019-04-05

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)	2,922

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

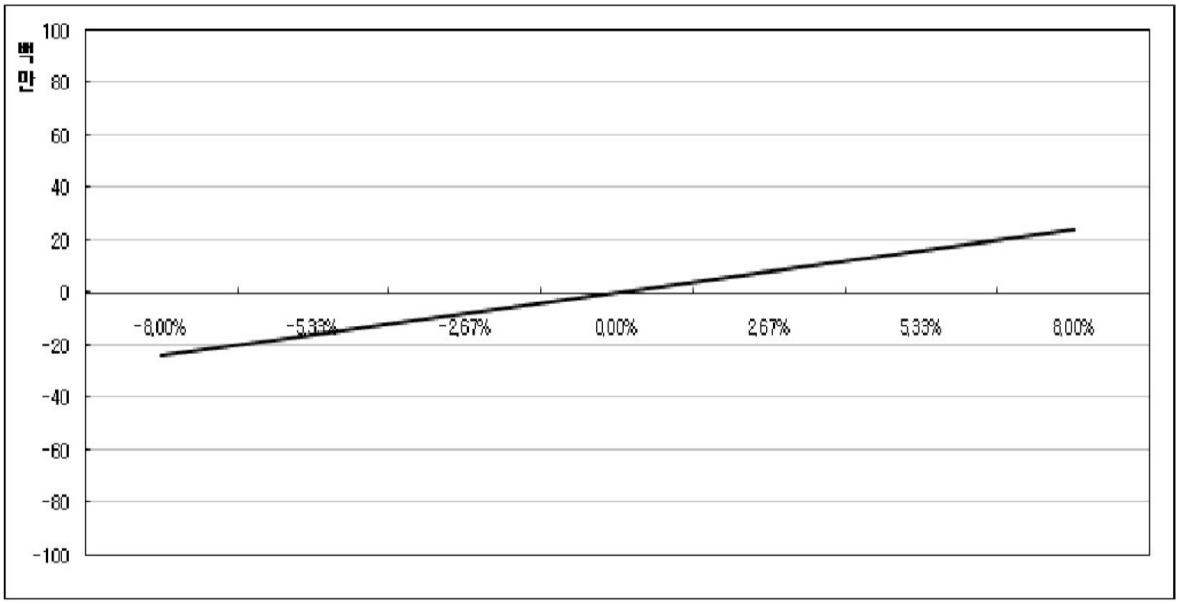
공시일: 2019-04-05

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	858	0	858	장내
합계			858	0	858	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,260

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

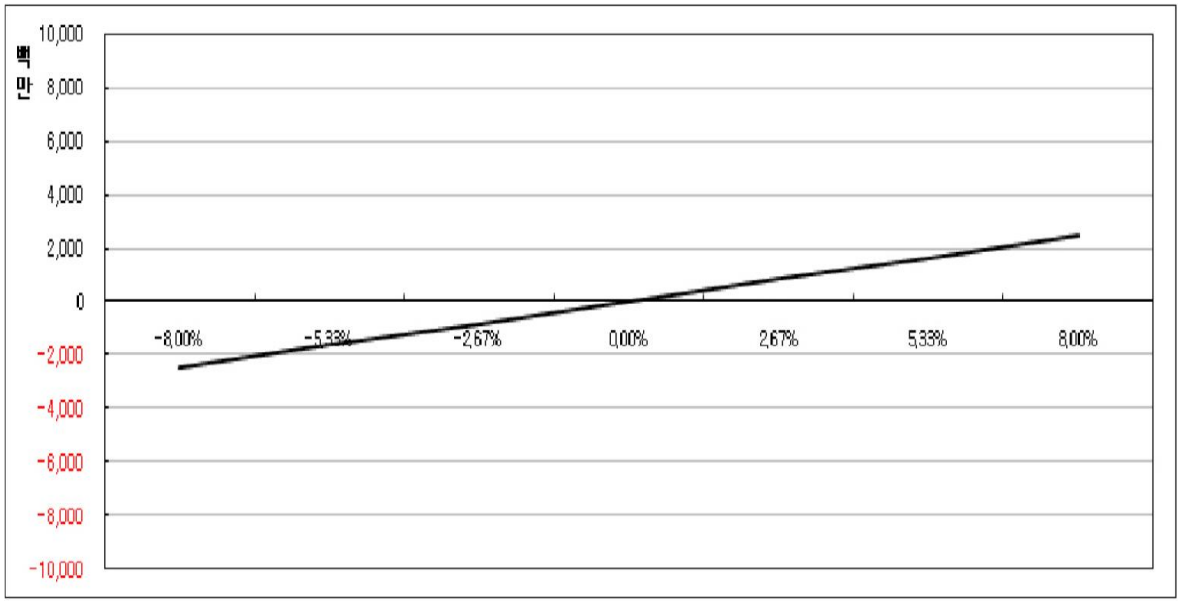
공시일: 2019-04-05

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	4,507	0	4,507	장내
합계			4,507	0	4,507	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

362

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,579

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

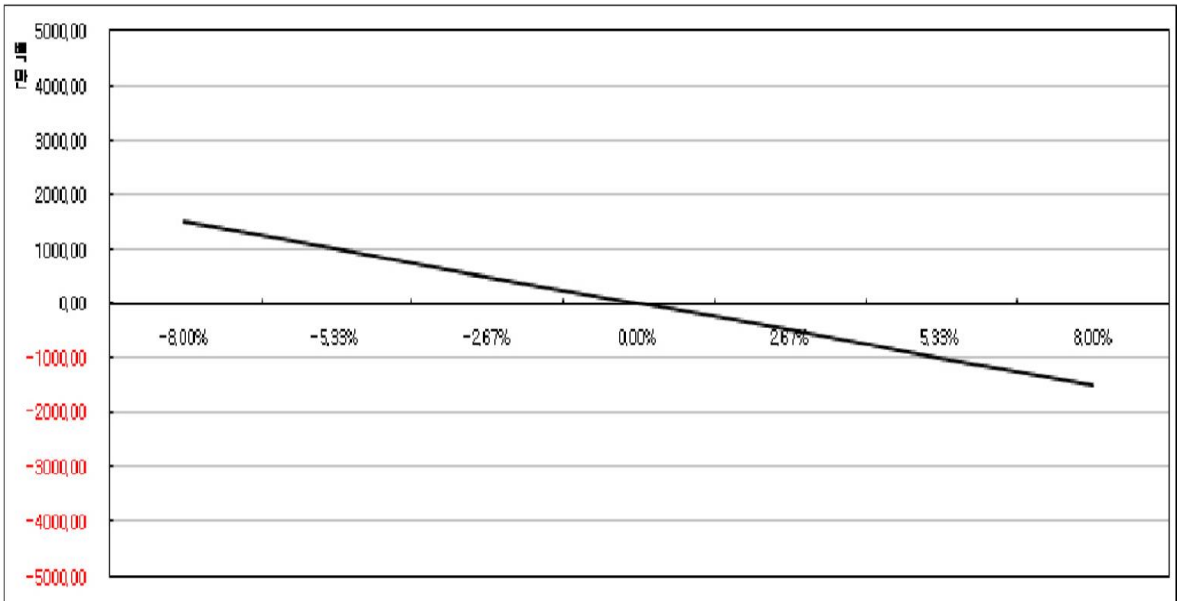
공시일: 2019-04-05

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	2,718	-2,718	장내
합계			0	2,718	-2,718	

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]

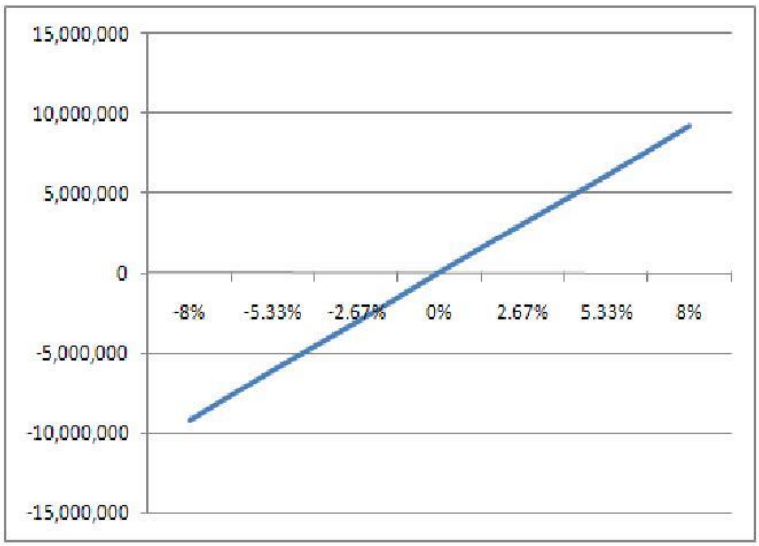
공시일: 2019-04-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	2,862	-2,862	장내
누계	주가지수	선물	69,606	0	69,606	장내
합계			69,606	0	69,606	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,591

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

45,139