펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-10

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	3,584	0	3,584	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	14,192	-14,192	장내
합계			3,584	14,192	-10,608	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	848

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,051

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

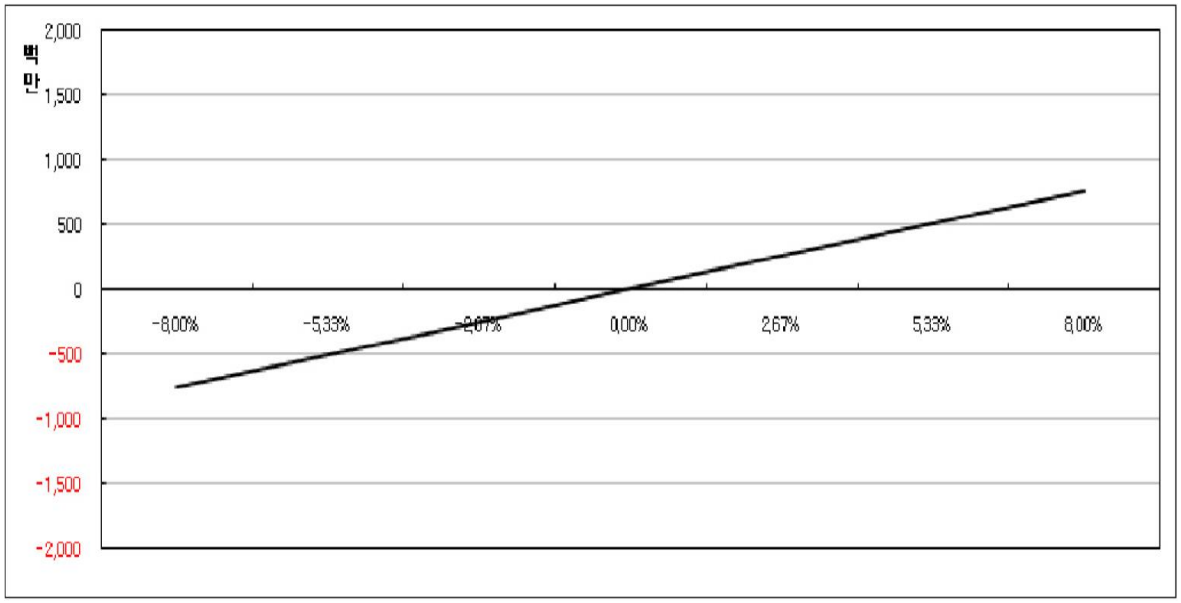
공시일: 2019-04-10

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	287	0	287	장내
합계			287	0	287	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,906

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

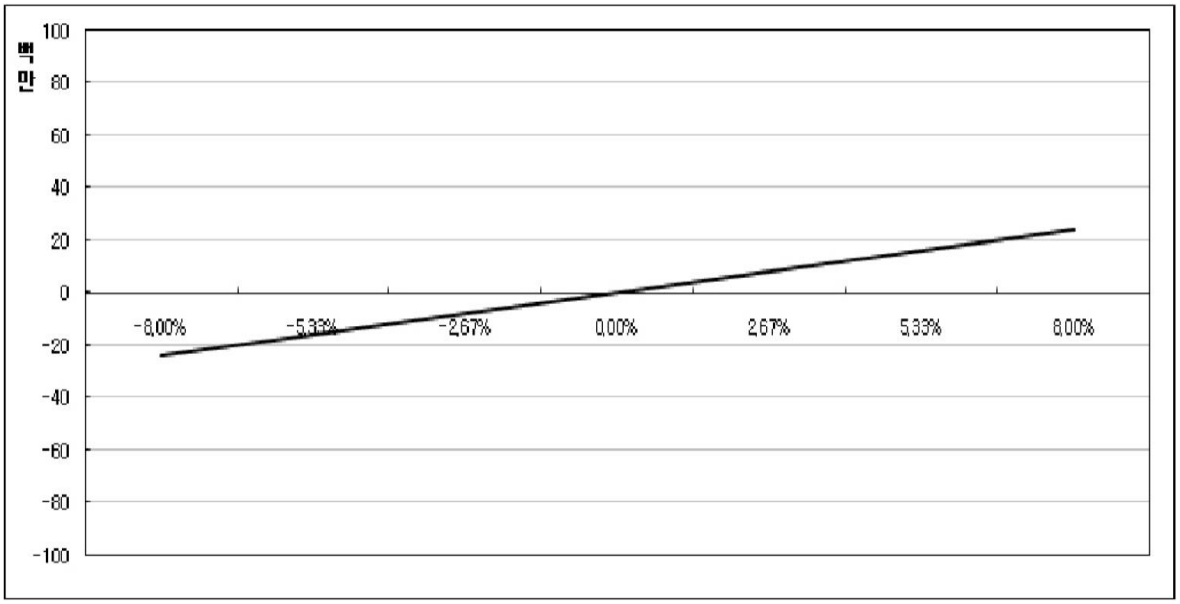
공시일: 2019-04-10

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	860	0	860	장내
합계			860	0	860	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,243

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

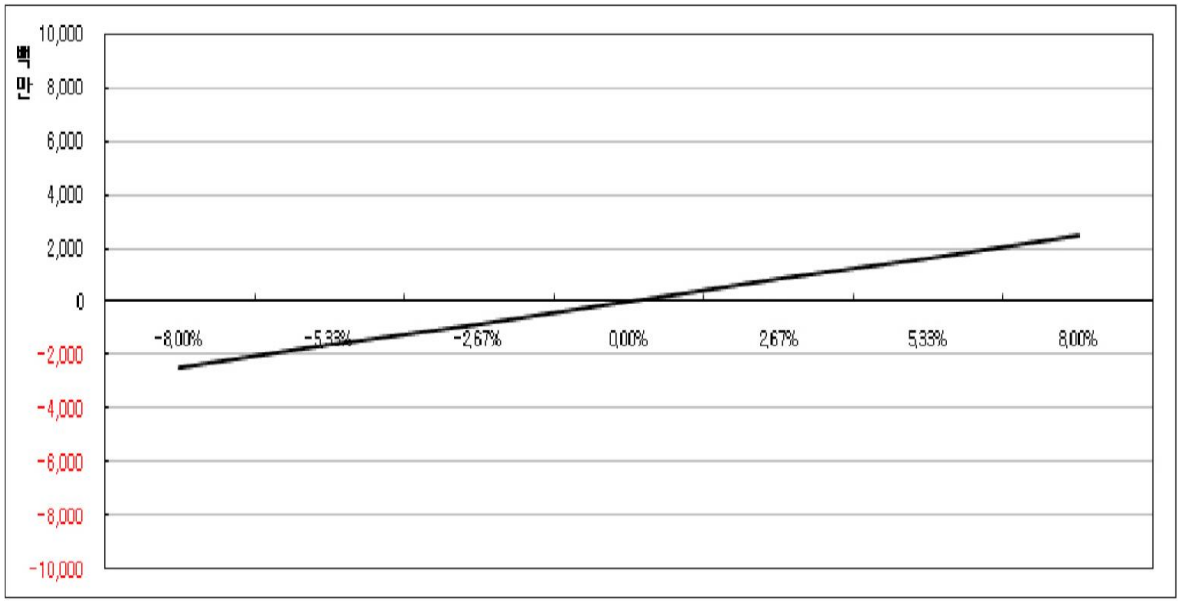
공시일: 2019-04-10

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	4,014	0	4,014	장내
합계			4,014	0	4,014	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

322

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,538

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

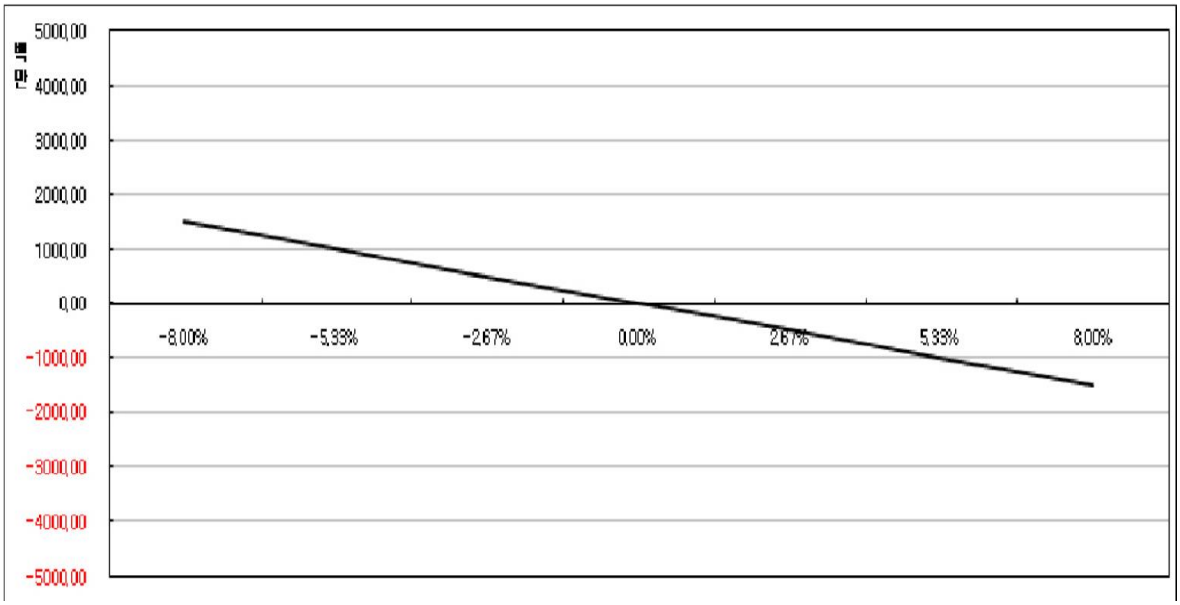
공시일: 2019-04-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	287	-287	장내
누계	주가지수	선물	0	3,225	-3,225	장내
합계			0	3,225	-3,225	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

259

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

215

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

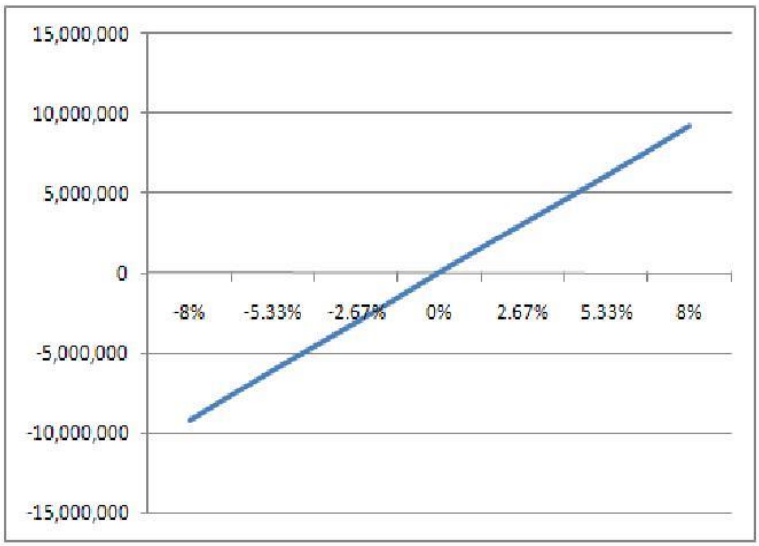
공시일: 2019-04-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	287	-287	장내
누계	주가지수	선물	68,022	0	68,022	장내
합계			68,022	0	68,022	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,461

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,873