펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-11

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	3,599	0	3,599	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	14,252	-14,252	장내
합계			3,599	14,252	-10,653	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

850

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,898

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

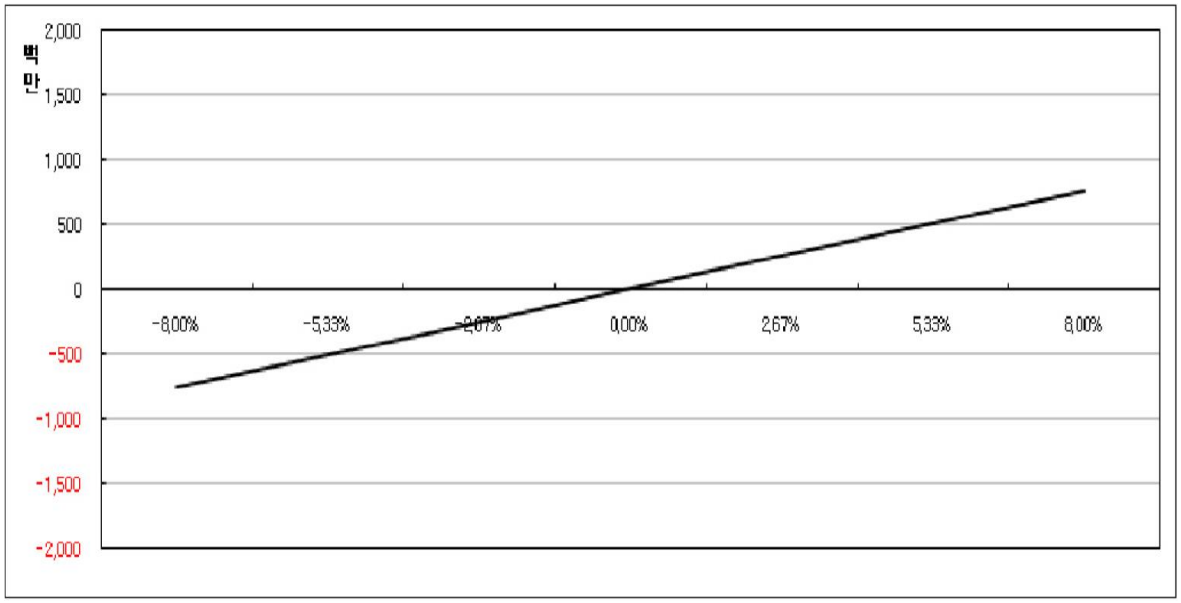
공시일: 2019-04-11

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	288	0	288	장내
합계			288	0	288	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,910

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

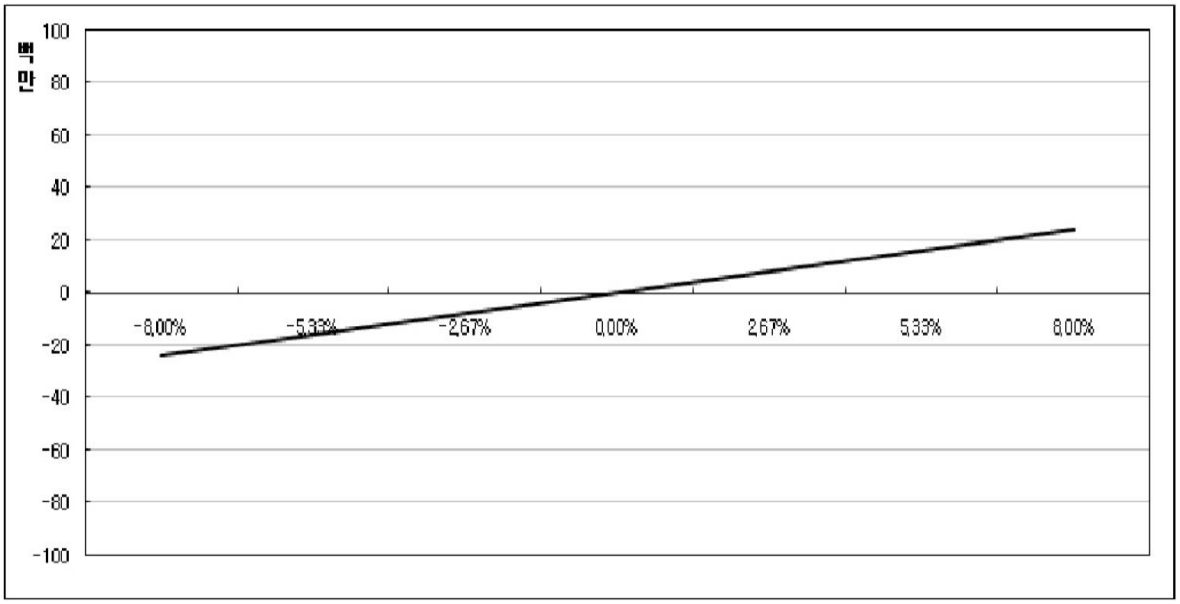
공시일: 2019-04-11

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	864	0	864	장내
합계			864	0	864	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,247

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

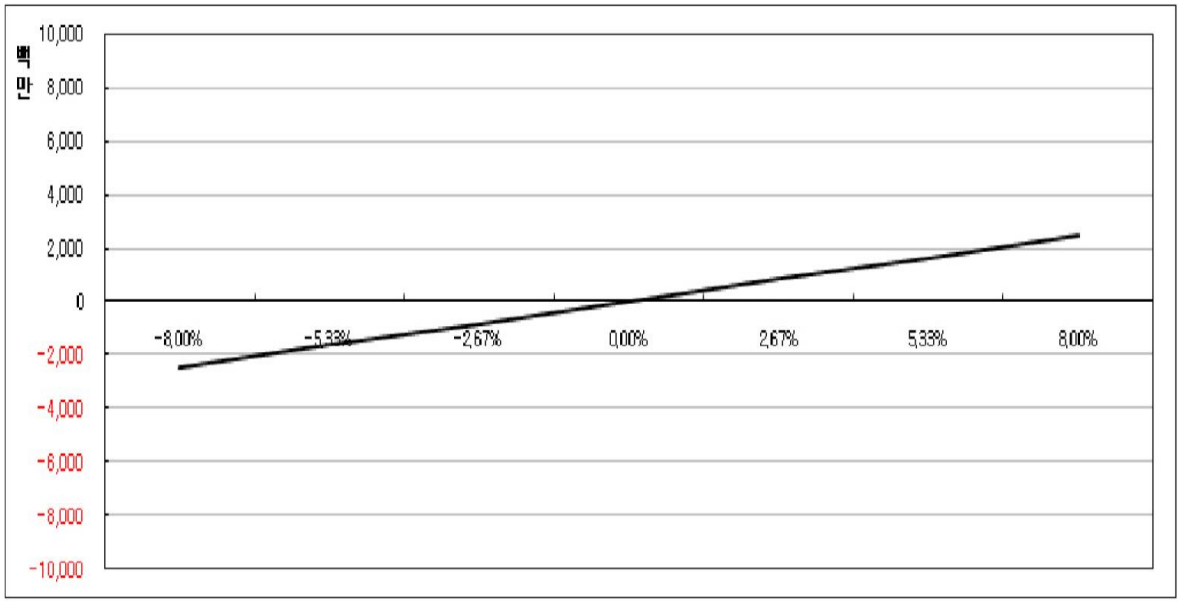
공시일: 2019-04-11

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	4,031	0	4,031	장내
합계			4,031	0	4,031	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

324

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,547

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

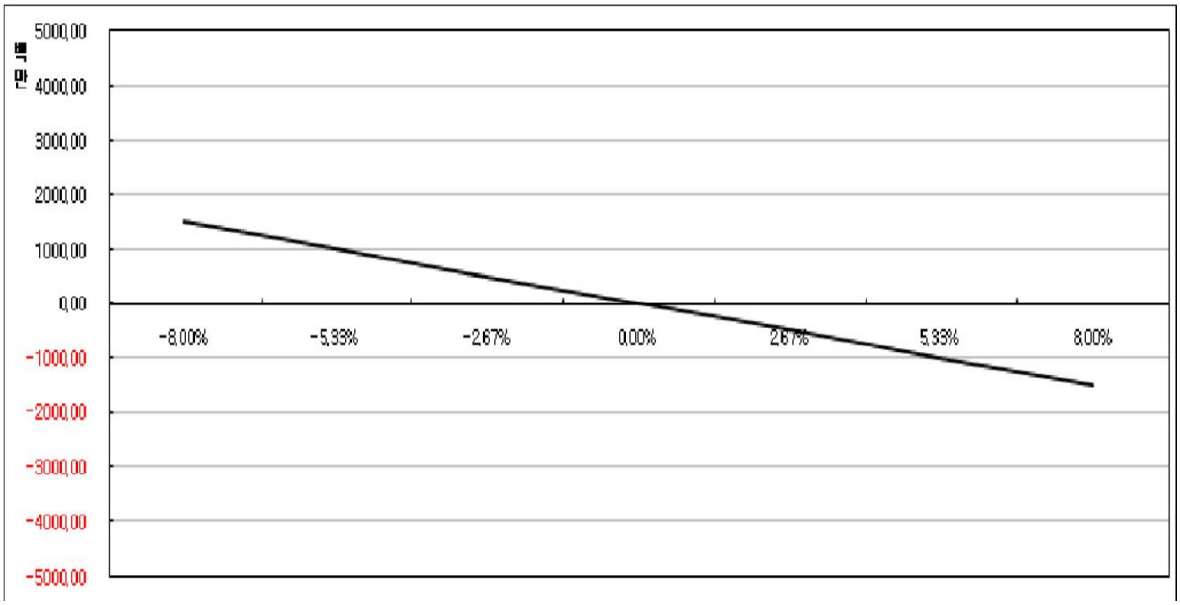
공시일: 2019-04-11

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	3,239	-3,239	장내
합계			0	3,239	-3,239	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

260

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

216

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

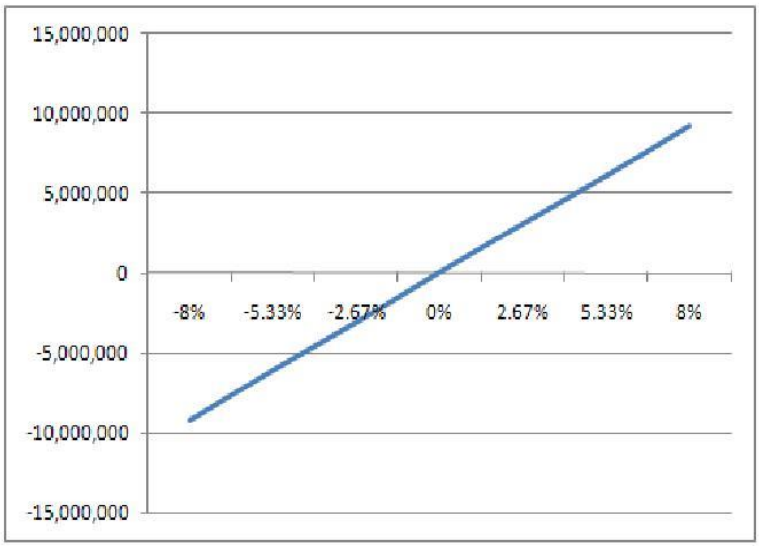
공시일: 2019-04-11

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	68,309	0	68,309	장내
합계			68,309	0	68,309	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,489

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,945