펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-12

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	3,593	0	3,593	장내
신규	주가지수	옵션	289	11,353	-11,064	장내
누계	주가지수	옵션	13	7,042	-7,028	장내
합계			3,606	7,042	-3,436	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	193

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,944

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

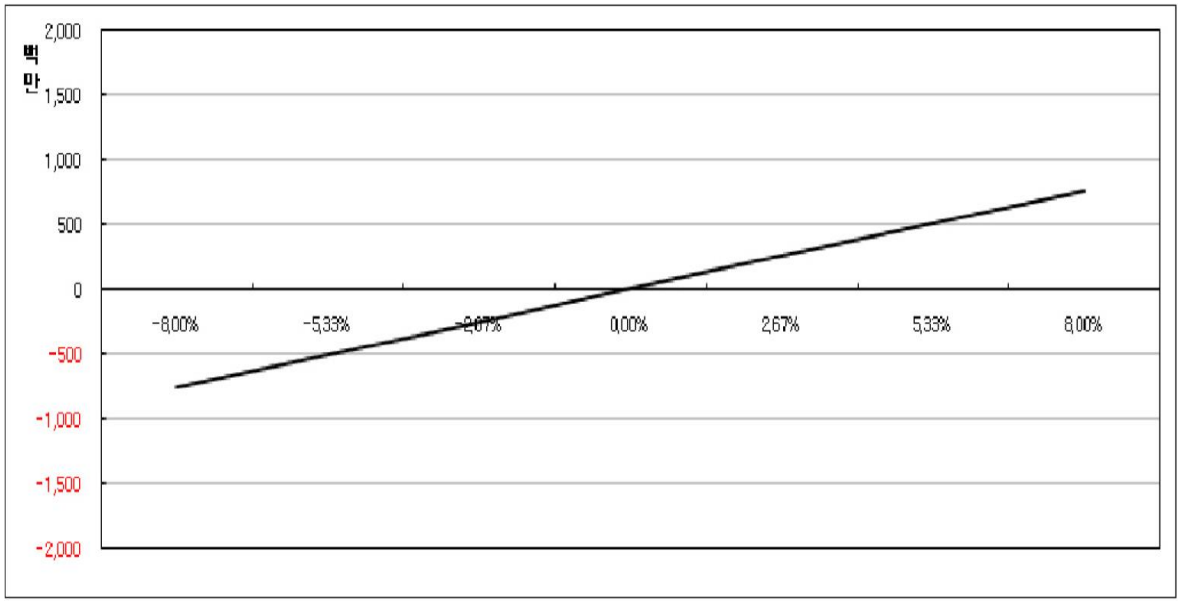
공시일: 2019-04-12

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)

2,884

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

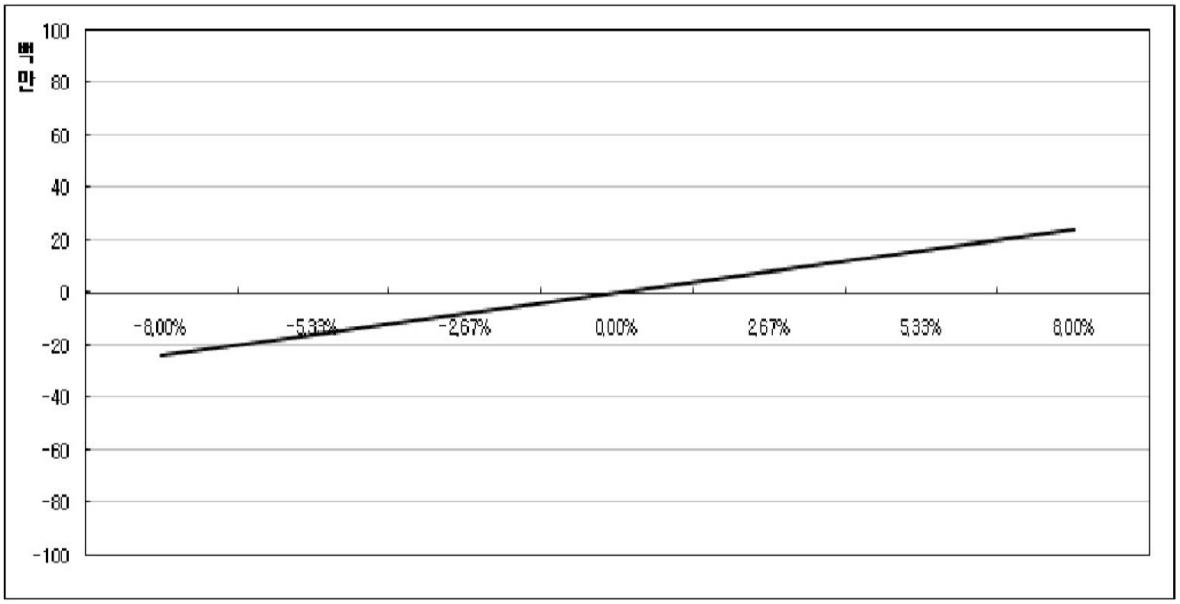
공시일: 2019-04-12

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	862	0	862	장내
합계			862	0	862	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,218

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

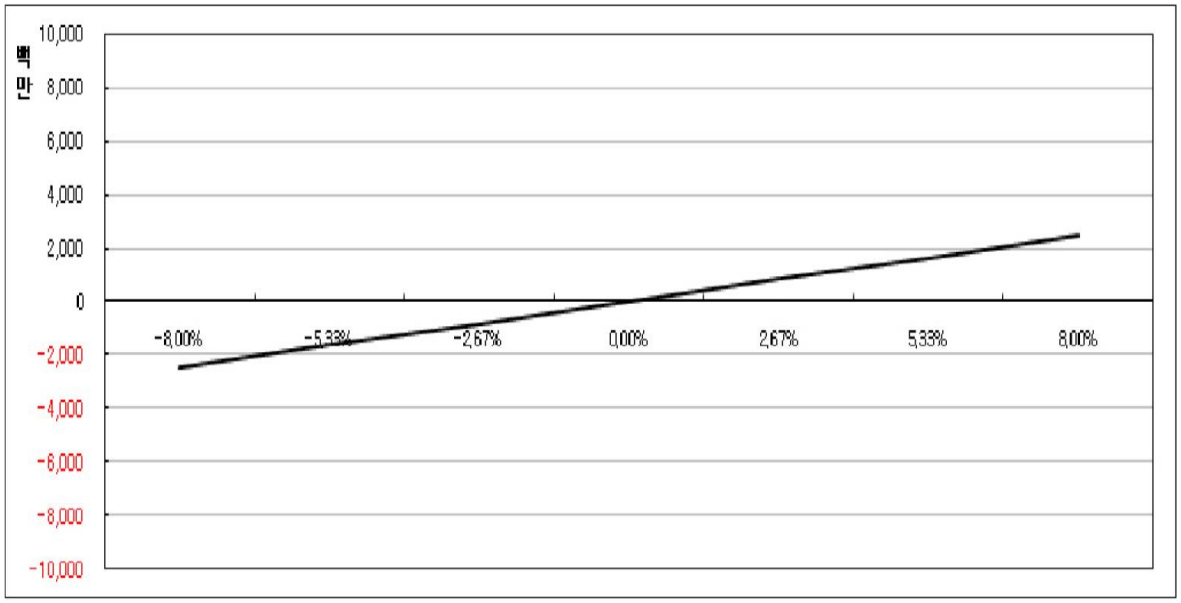
공시일: 2019-04-12

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	4,024	0	4,024	장내
합계			4,024	0	4,024	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

323

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,497

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

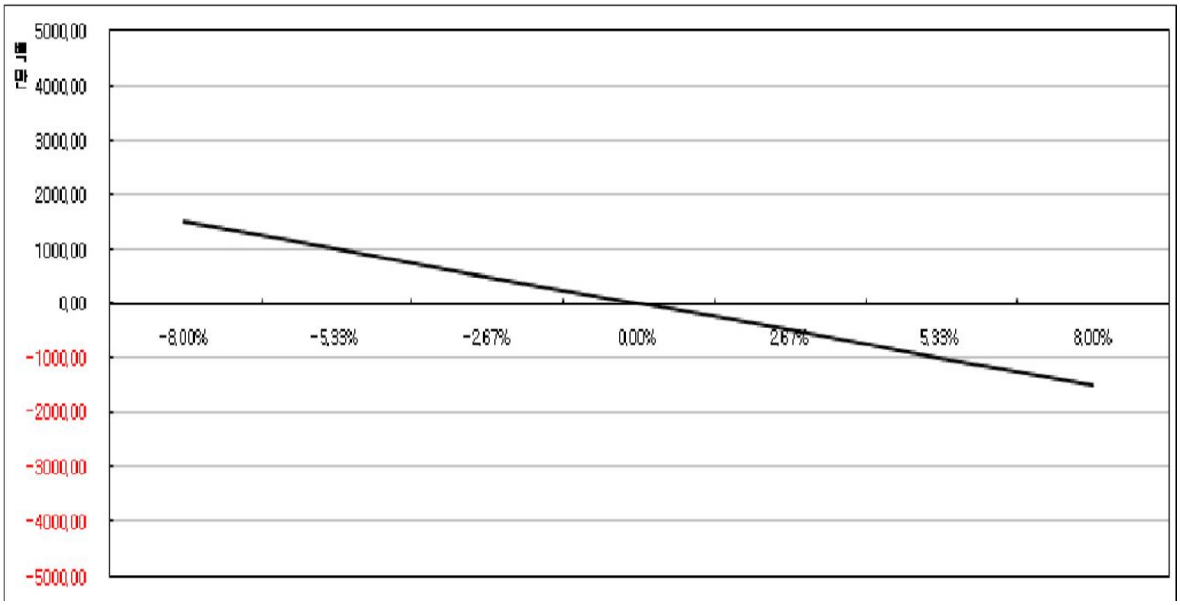
공시일: 2019-04-12

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	3,233	-3,233	장내
합계			0	3,233	-3,233	

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]

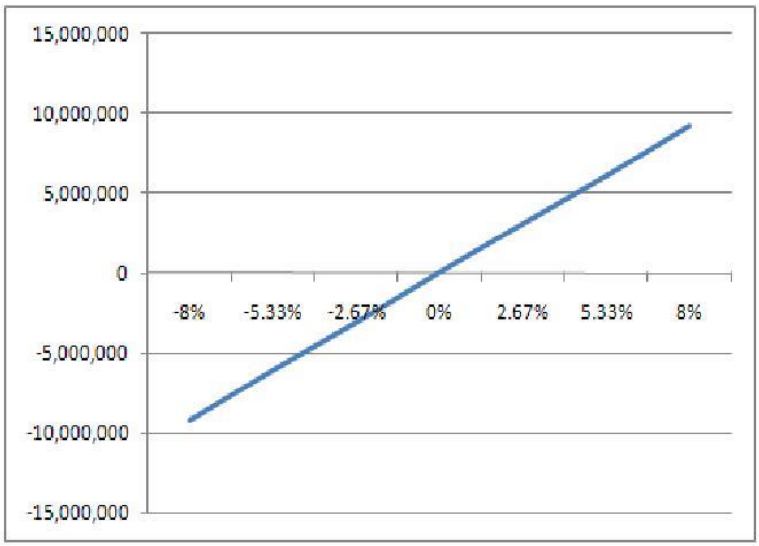
공시일: 2019-04-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,365	-1,365	장내
누계	주가지수	선물	66,825	0	66,825	장내
합계			66,825	0	66,825	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,362

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,506