펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-15

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	3,605	0	3,605	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	9	7,065	-7,056	장내
합계			3,614	7,065	-3,451	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	199

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,029

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

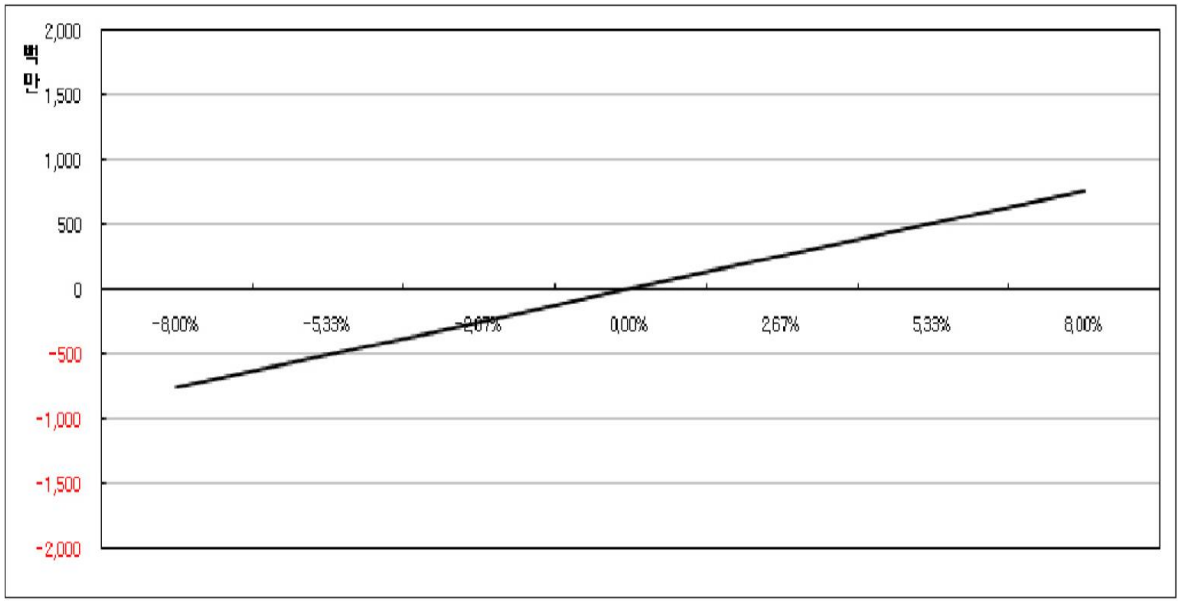
공시일: 2019-04-15

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)	2,921

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

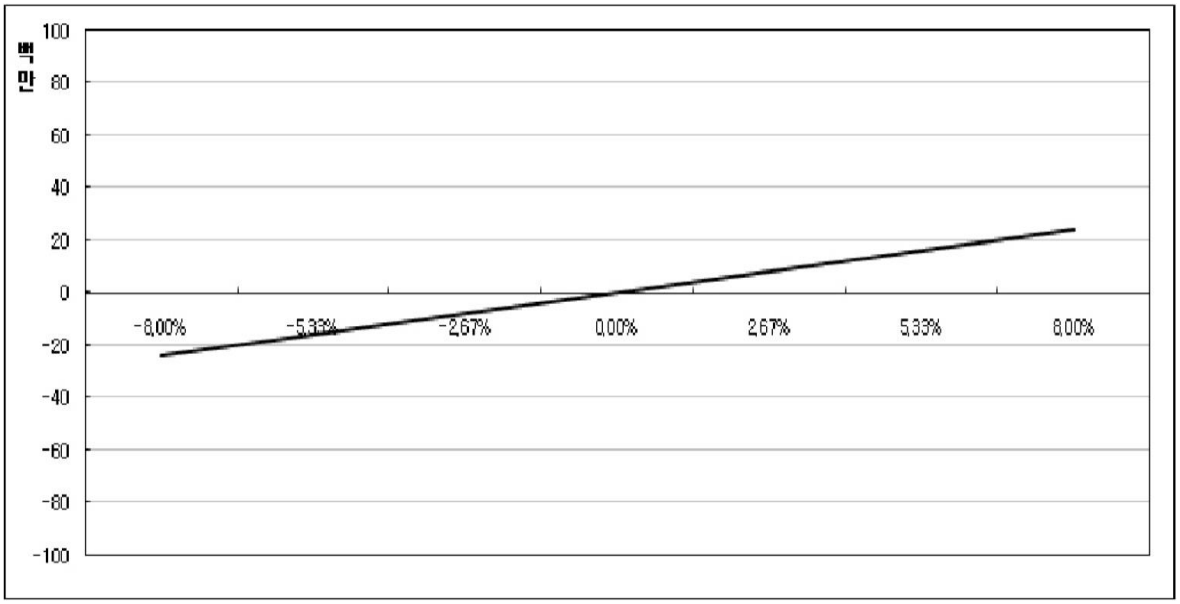
공시일: 2019-04-15

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	865	0	865	장내
합계			865	0	865	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,259

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

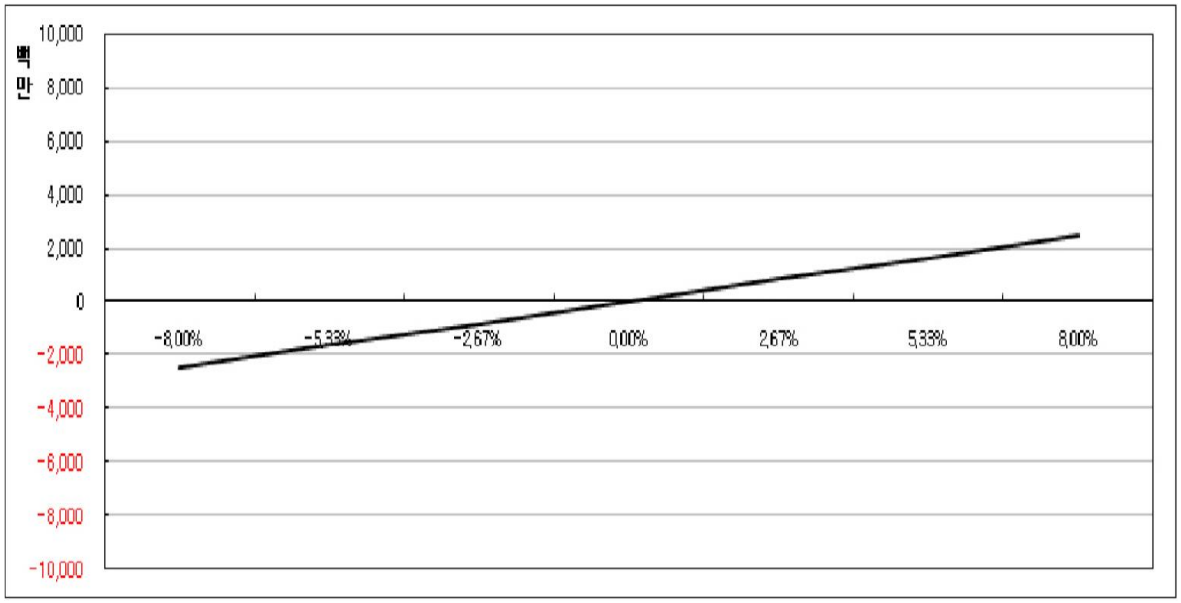
공시일: 2019-04-15

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	4,037	0	4,037	장내
합계			4,037	0	4,037	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

324

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,568

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

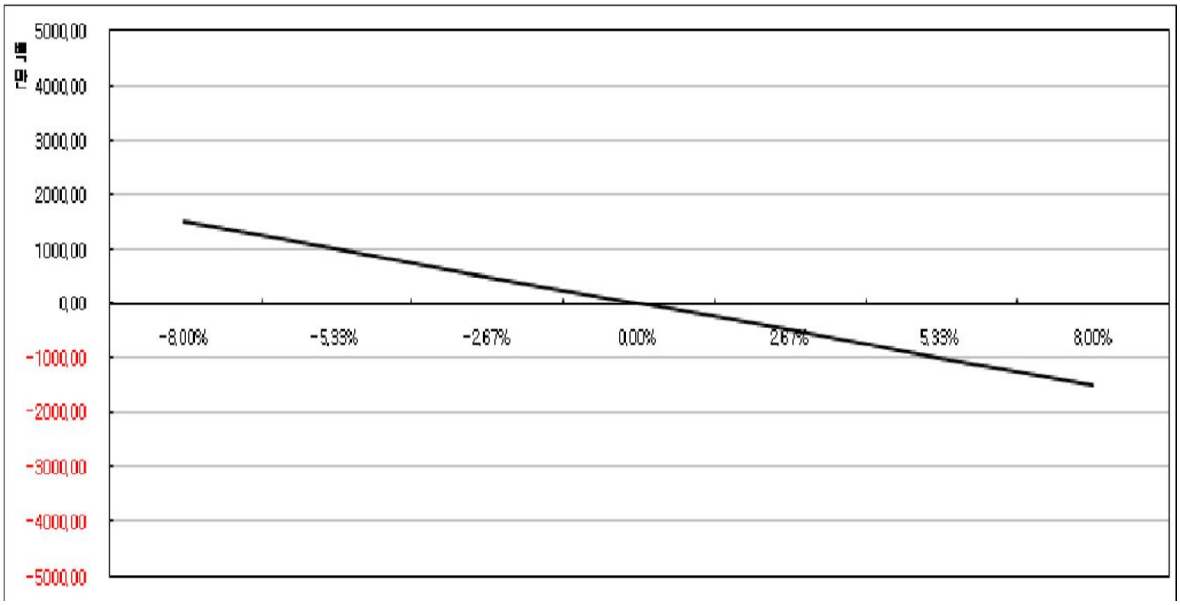
공시일: 2019-04-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	216	0	216	장내
누계	주가지수	선물	0	3,028	-3,028	장내
합계			0	3,028	-3,028	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

243

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

202

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

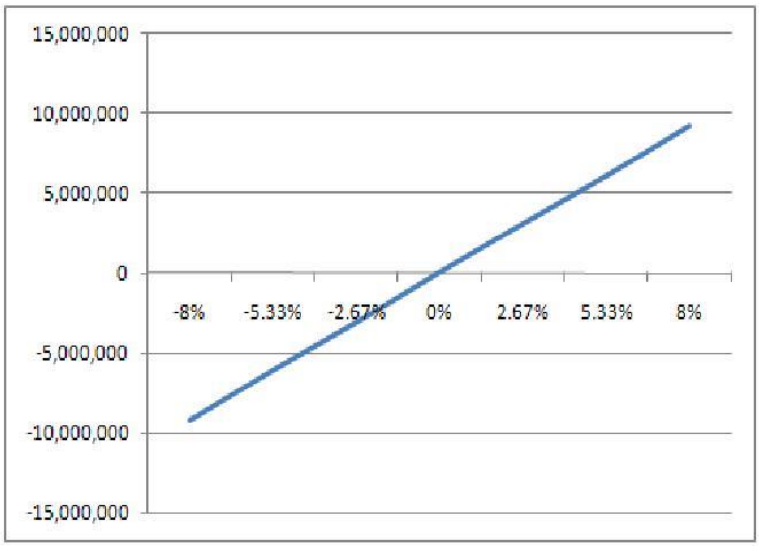
공시일: 2019-04-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	288	0	288	장내
누계	주가지수	선물	67,334	0	67,334	장내
합계			67,334	0	67,334	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,407

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

45,088