펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-16

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	3,617	0	3,617	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	7	7,090	-7,083	장내
합계			3,624	7,090	-3,466	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	205

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,071

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

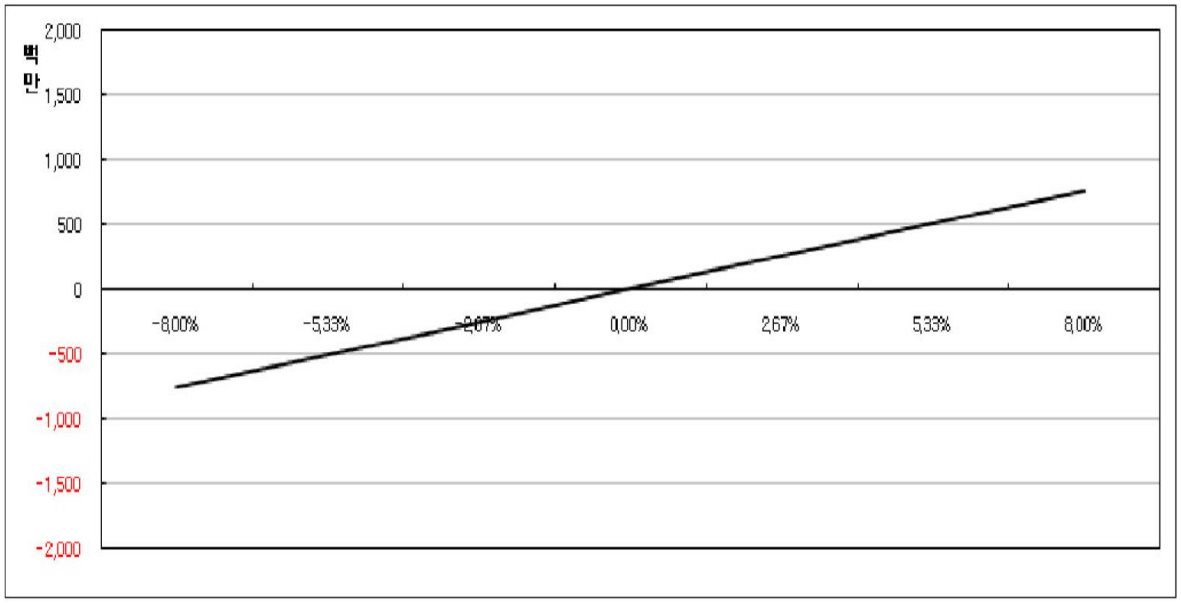
공시일: 2019-04-16

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	289	0	289	장내
합계			289	0	289	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,934

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

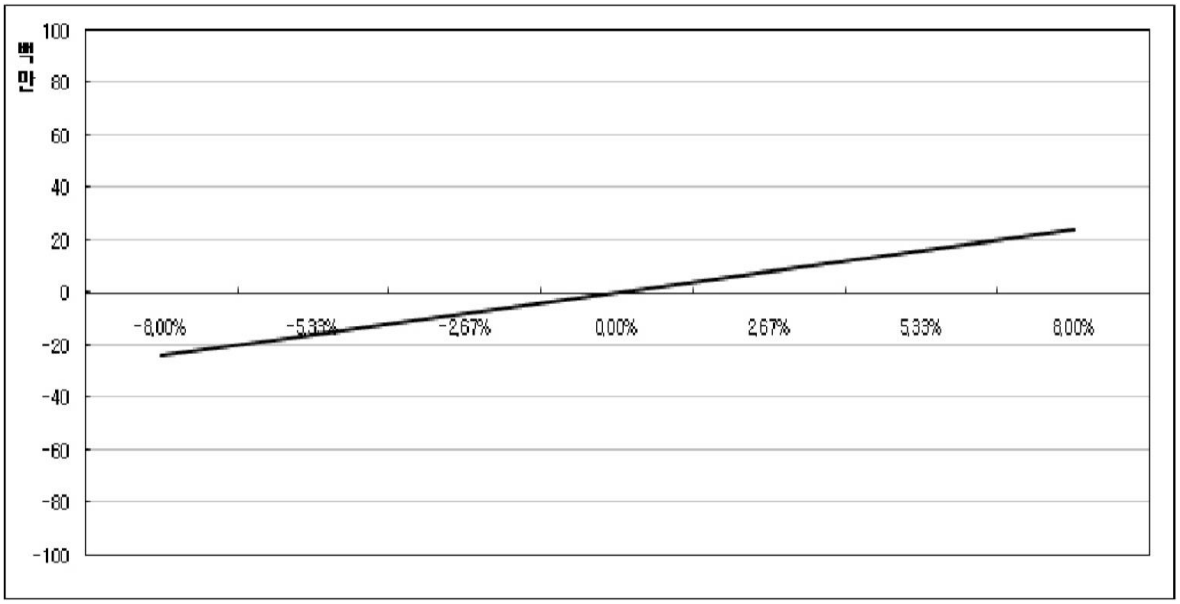
공시일: 2019-04-16

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	868	0	868	장내
합계			868	0	868	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

70

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,274

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

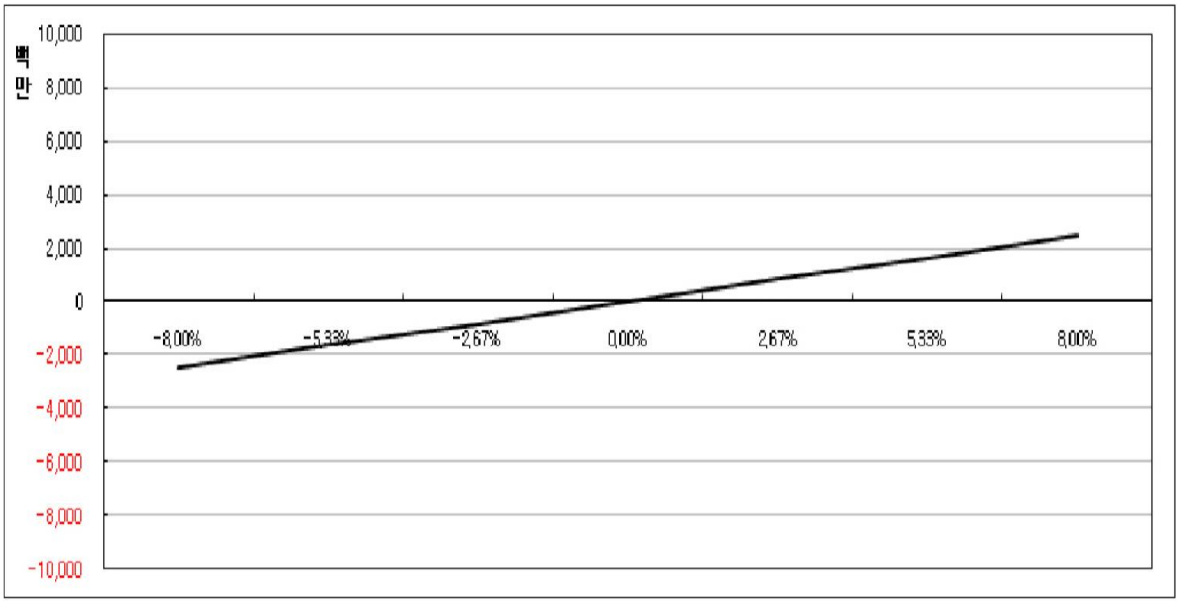
공시일: 2019-04-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	72	-72	장내
누계	주가지수	선물	3,979	0	3,979	장내
합계			3,979	0	3,979	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

320

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,591

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

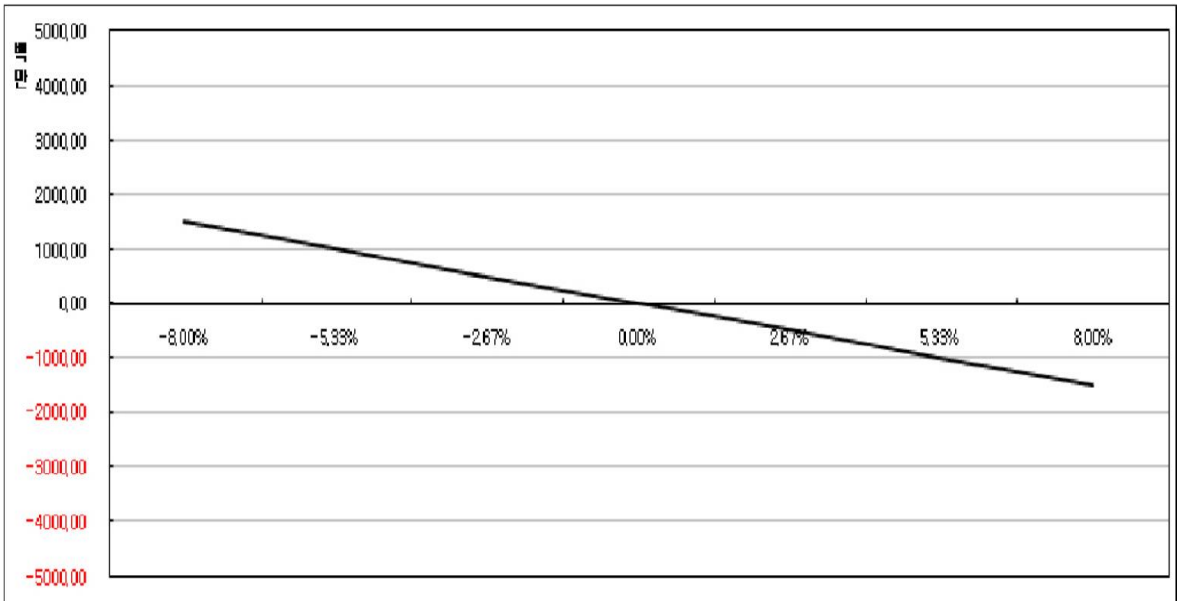
공시일: 2019-04-16

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	3,038	-3,038	장내
합계			0	3,038	-3,038	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

244

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

203

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

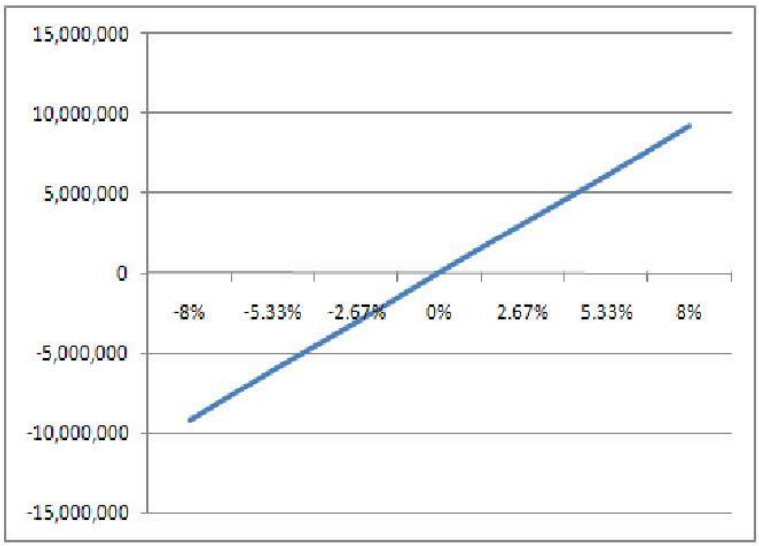
공시일: 2019-04-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	579	-579	장내
누계	주가지수	선물	66,991	0	66,991	장내
합계			66,991	0	66,991	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,385

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

45,277