펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-17

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	3,633	0	3,633	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	7,120	-7,116	장내
합계			3,637	7,120	-3,483	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	222

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,103

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

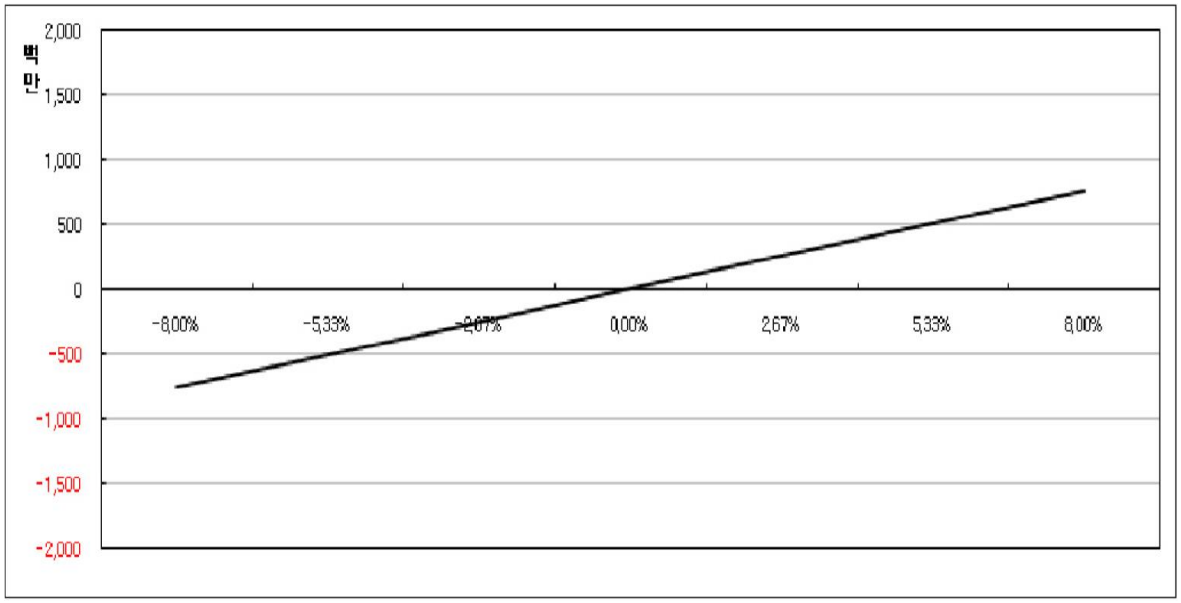
공시일: 2019-04-17

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	291	0	291	장내
합계			291	0	291	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,945

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

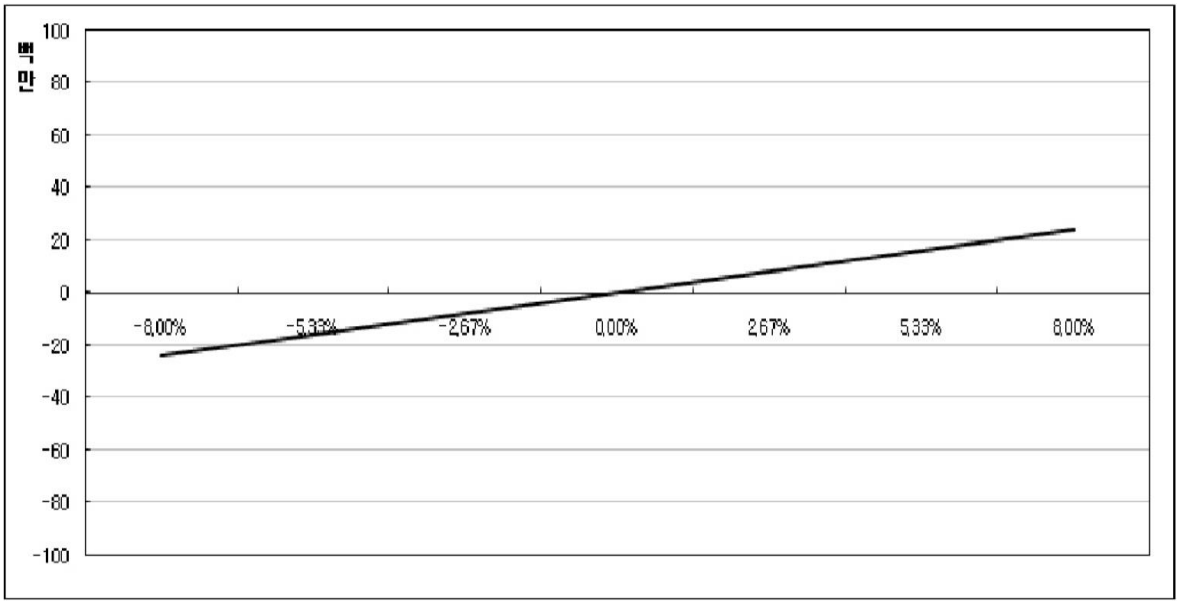
공시일: 2019-04-17

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	872	0	872	장내
합계			872	0	872	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	70

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,285

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

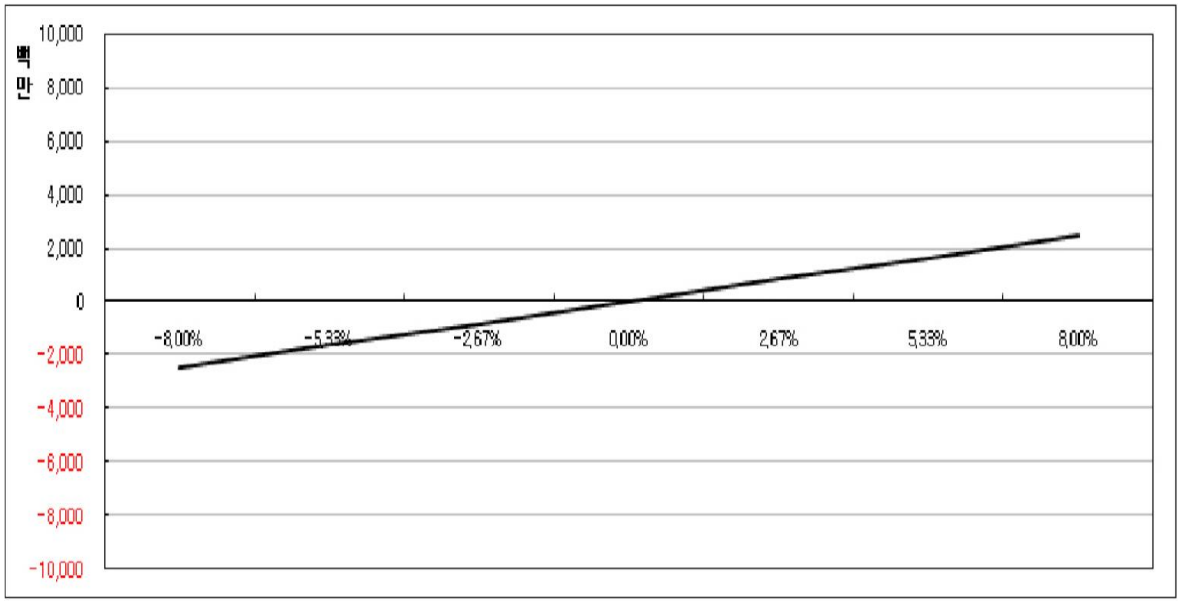
공시일: 2019-04-17

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	3,996	0	3,996	장내
합계			3,996	0	3,996	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

321

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,610

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

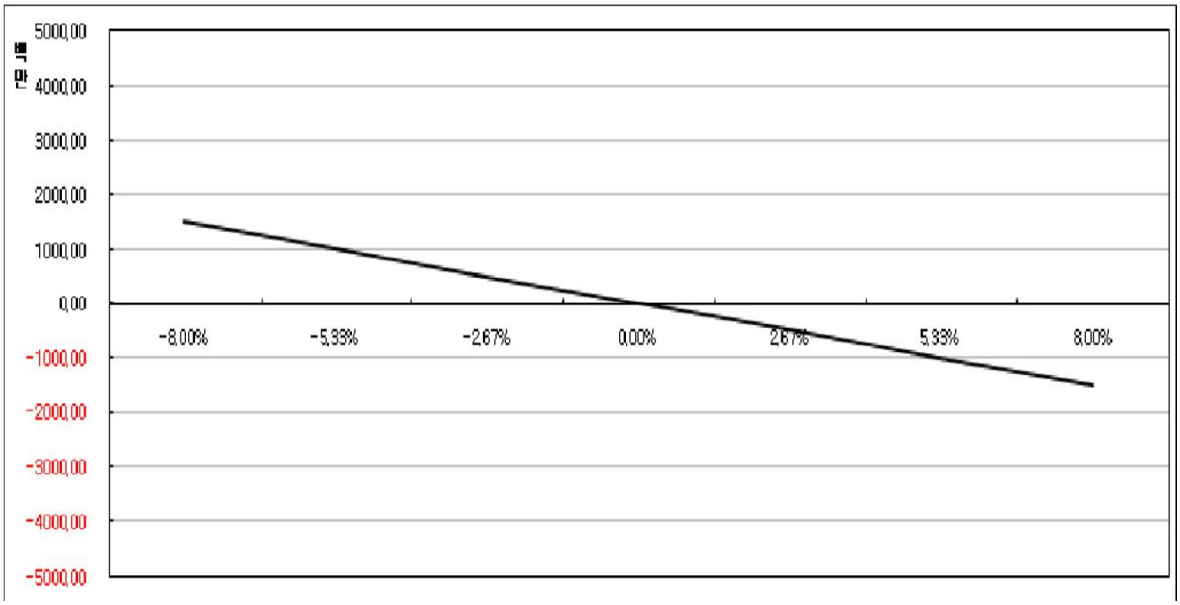
공시일: 2019-04-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	218	-218	장내
누계	주가지수	선물	0	3,269	-3,269	장내
합계			0	3,269	-3,269	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

262

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

217

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

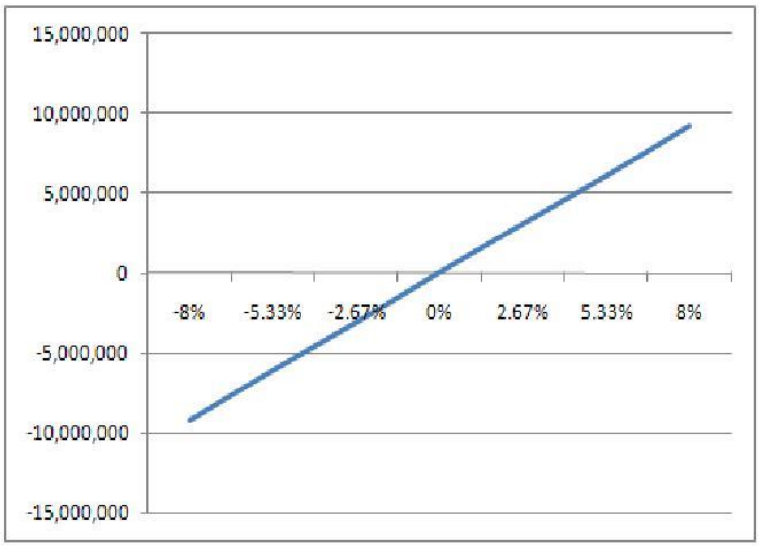
공시일: 2019-04-17

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	67,279	0	67,279	장내
합계			67,279	0	67,279	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,401

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

45,426