펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-18

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	3,629	0	3,629	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	7,113	-7,109	장내
합계			3,633	7,113	-3,480	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	218

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,063

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

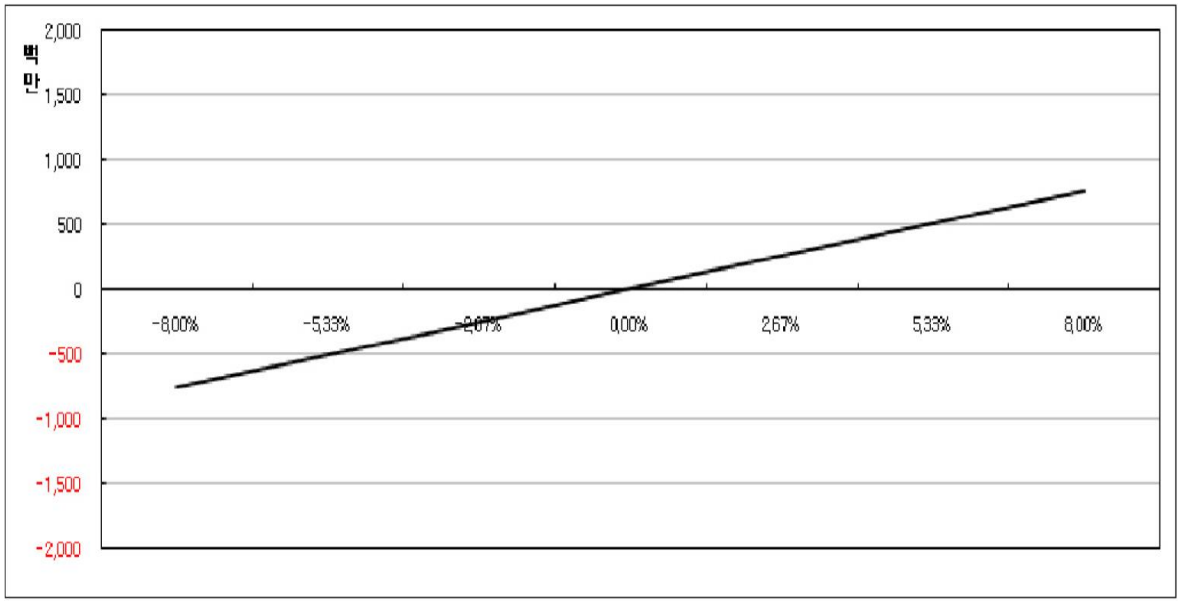
공시일: 2019-04-18

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	290	0	290	장내
합계			290	0	290	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,932

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

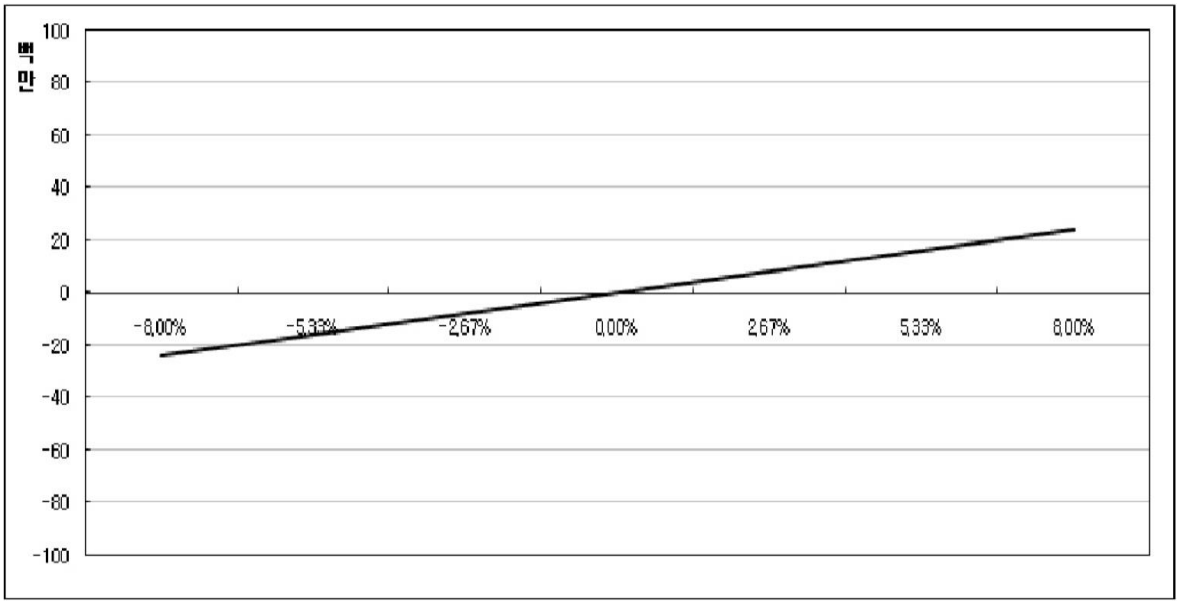
공시일: 2019-04-18

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	871	0	871	장내
합계			871	0	871	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	70

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,272

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

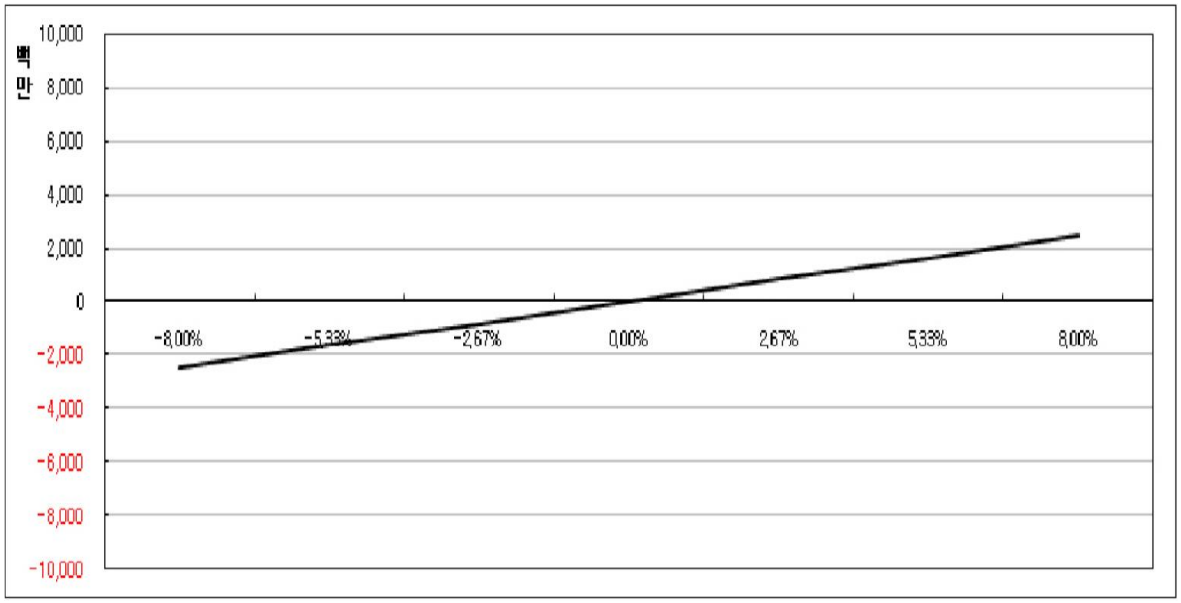
공시일: 2019-04-18

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	3,992	0	3,992	장내
합계			3,992	0	3,992	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

321

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,587

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

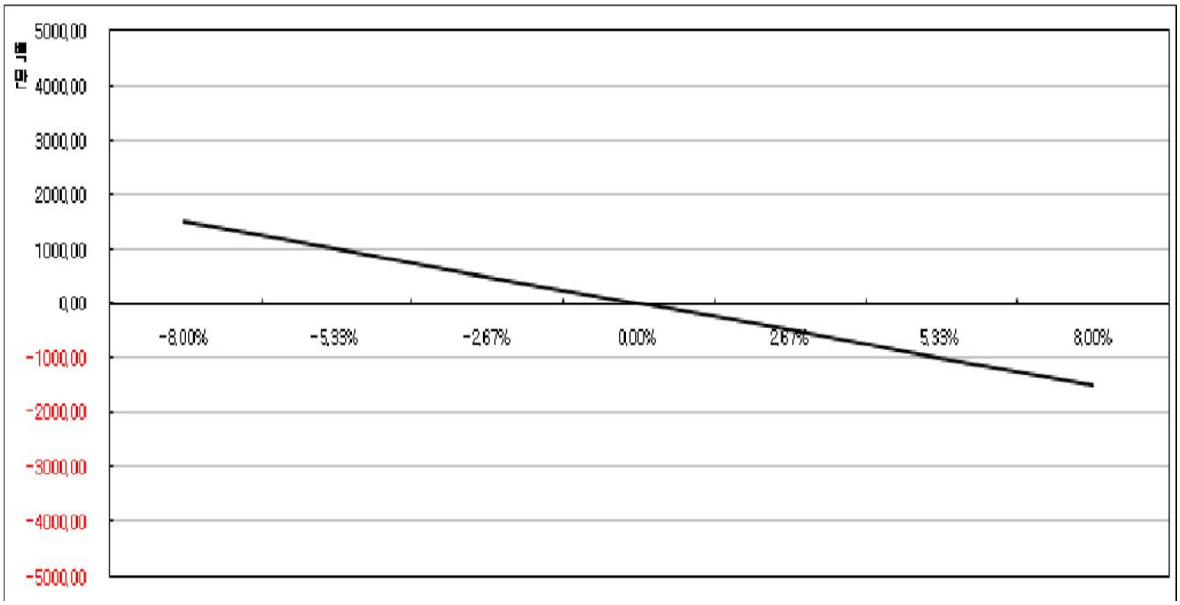
공시일: 2019-04-18

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	3,266	-3,266	장내
합계			0	3,266	-3,266	

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]

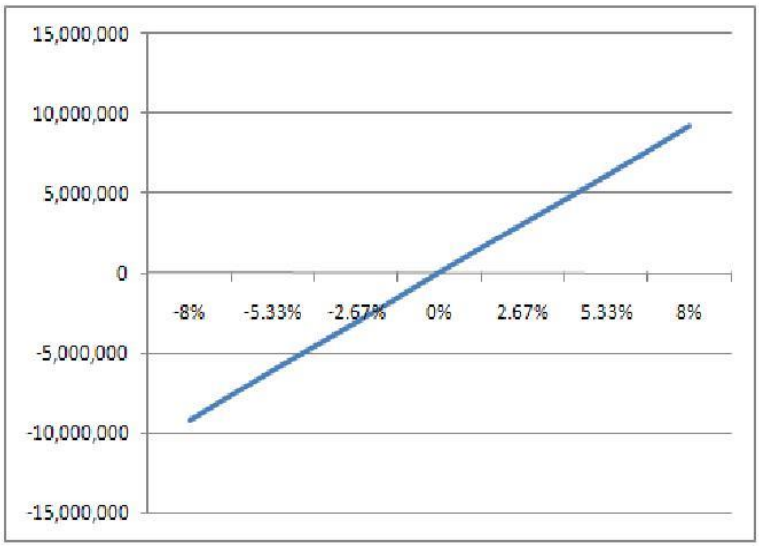
공시일: 2019-04-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	363	-363	장내
누계	주가지수	선물	66,848	0	66,848	장내
합계			66,848	0	66,848	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,370

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

45,237