펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-19

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	3,573	0	3,573	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	11	7,003	-6,992	장내
합계			3,584	7,003	-3,419	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,831

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

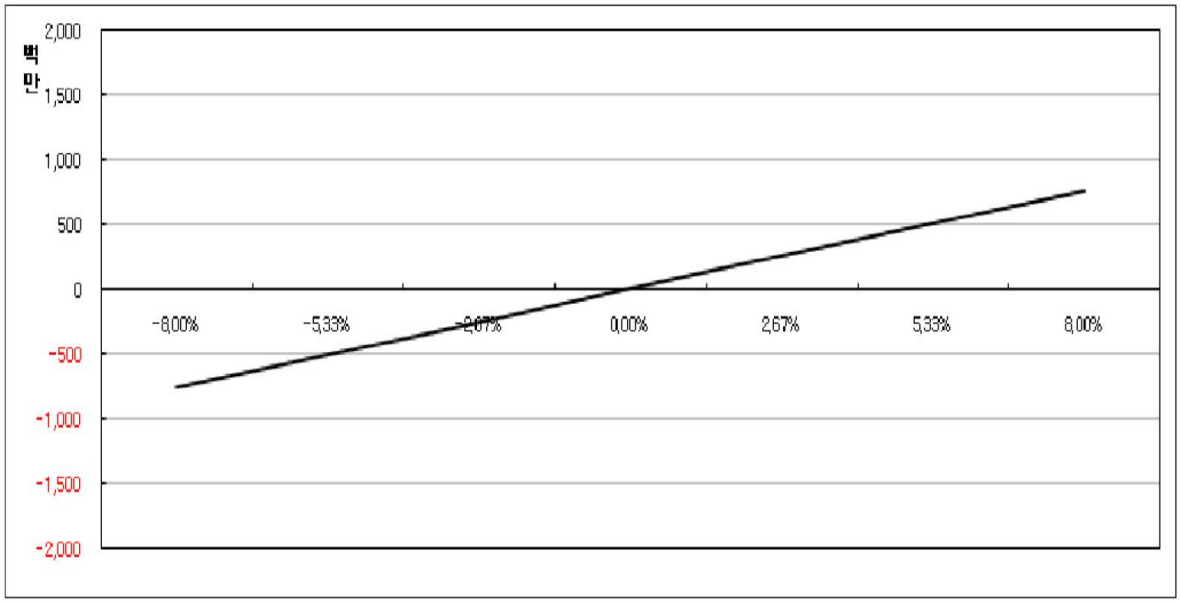
공시일: 2019-04-19

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	286	0	286	장내
합계			286	0	286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,847

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

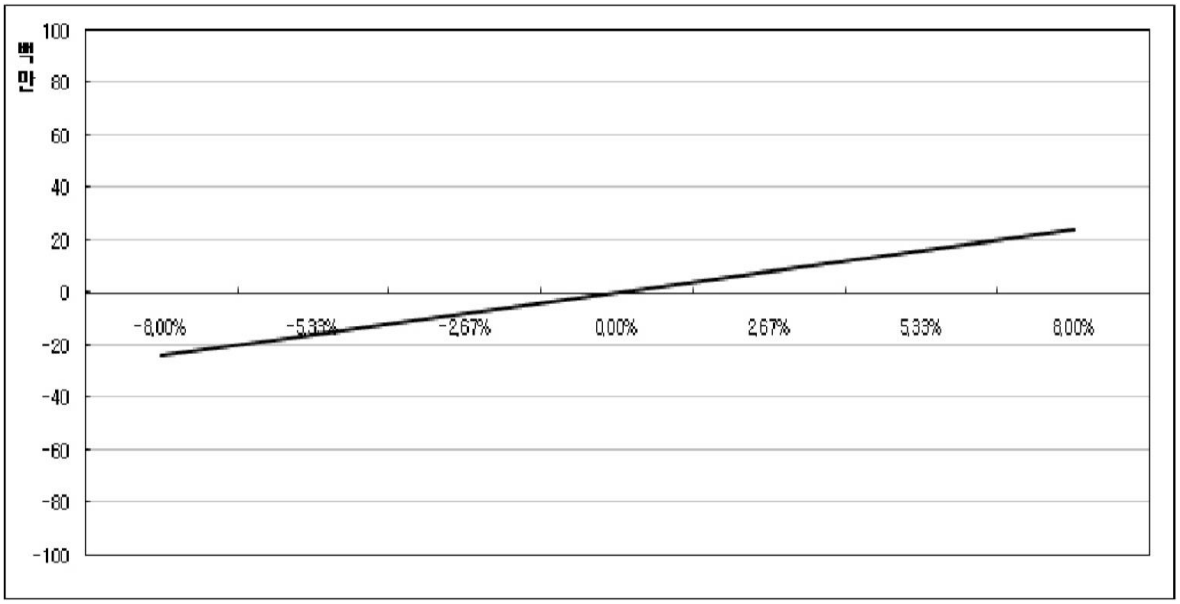
공시일: 2019-04-19

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	857	0	857	장내
합계			857	0	857	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,177

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

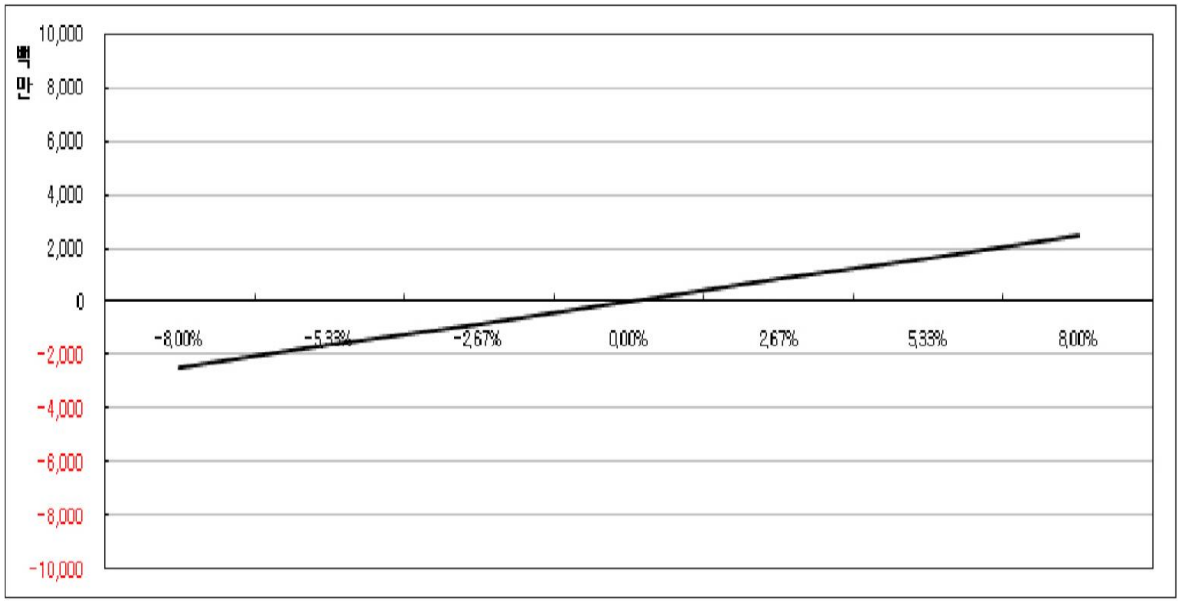
공시일: 2019-04-19

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	3,930	0	3,930	장내
합계			3,930	0	3,930	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

315

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,427

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

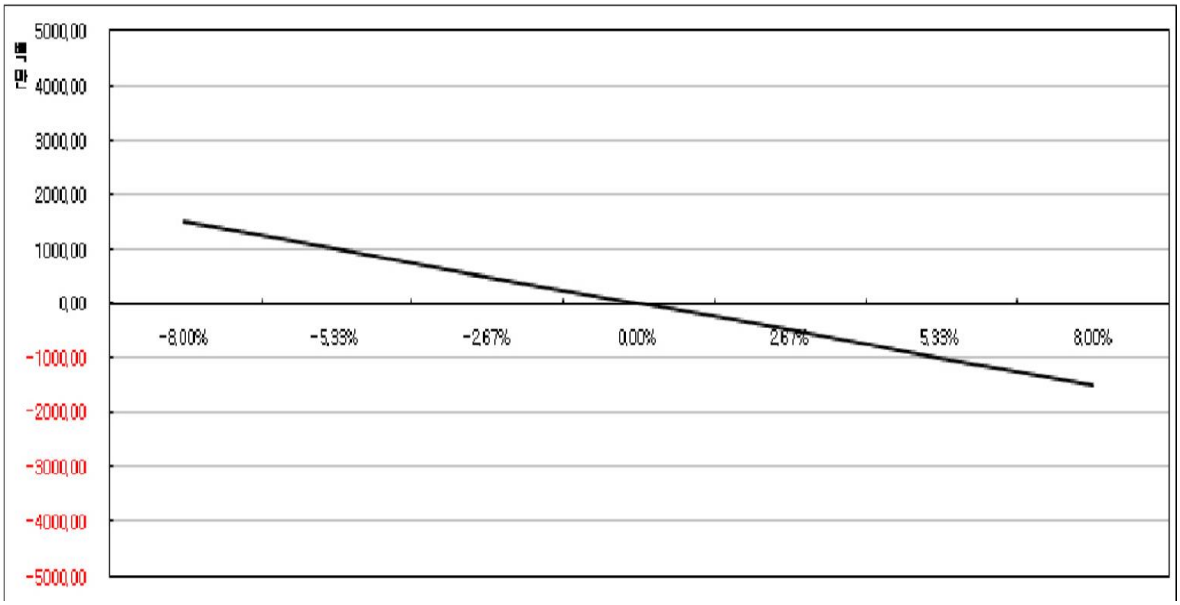
공시일: 2019-04-19

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	3,215	-3,215	장내
합계			0	3,215	-3,215	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

258

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

214

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

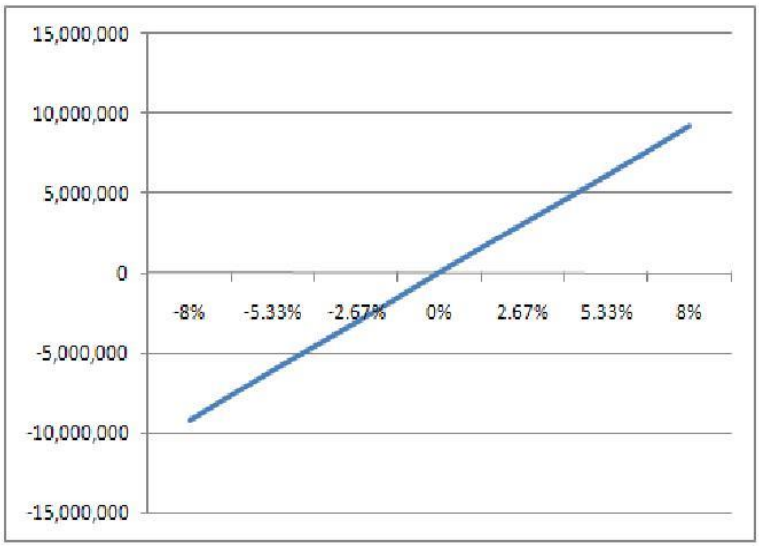
공시일: 2019-04-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,000	-1,000	장내
누계	주가지수	선물	64,810	0	64,810	장내
합계			64,810	0	64,810	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,197

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,936