펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-22

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	3,574	0	3,574	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	9	7,004	-6,996	장내
합계			3,582	7,004	-3,422	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

177

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,814

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

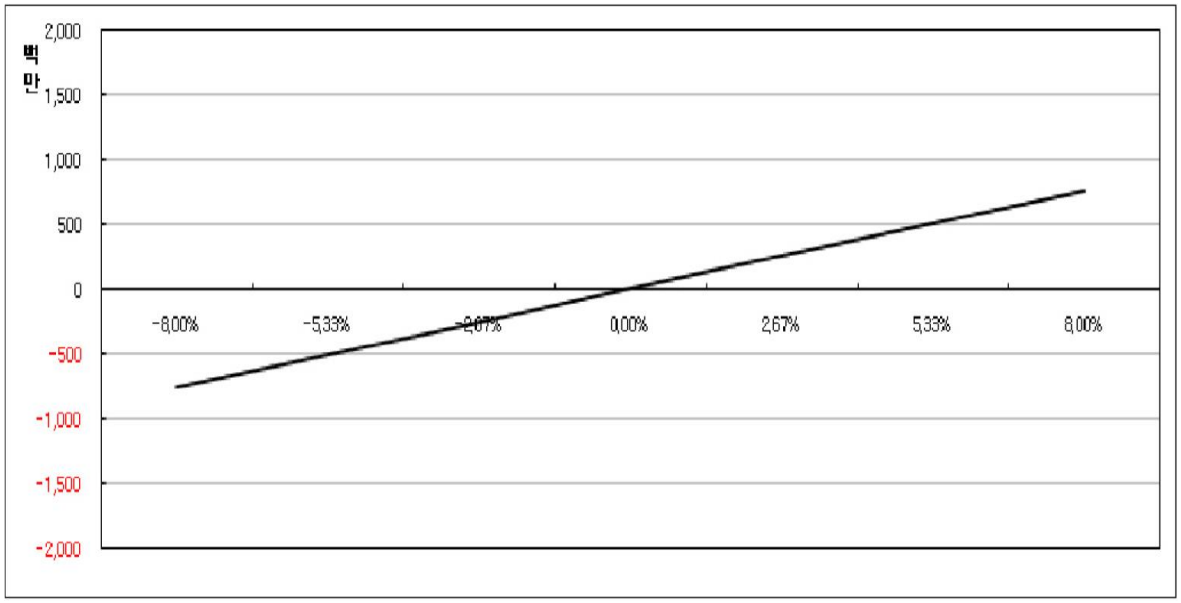
공시일: 2019-04-22

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)

2,830

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

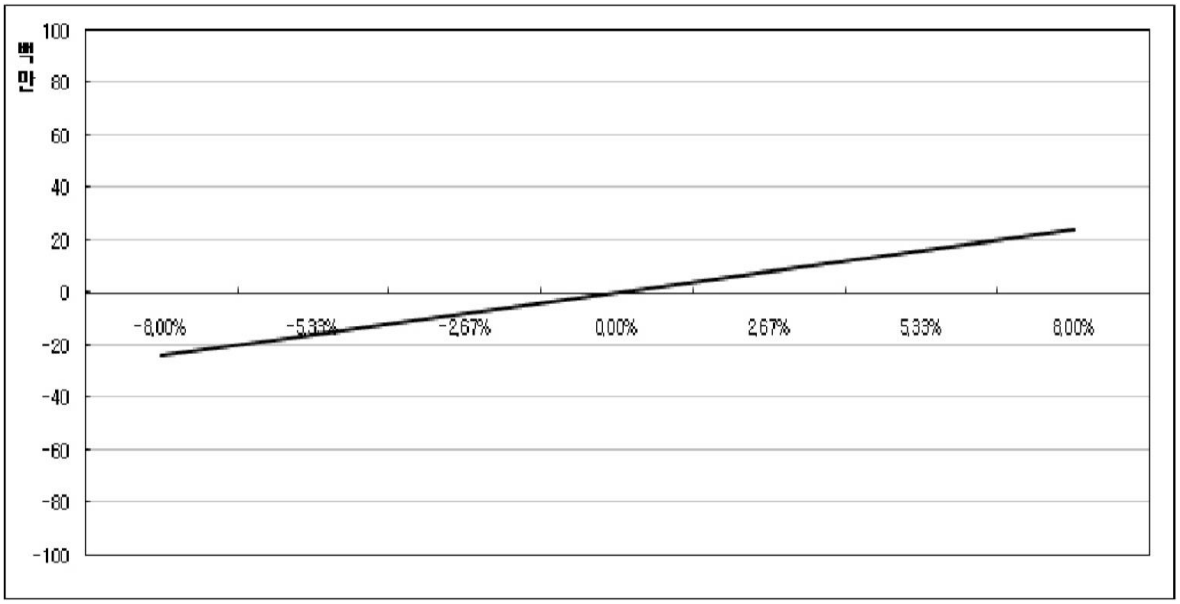
공시일: 2019-04-22

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	858	0	858	장내
합계			858	0	858	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,159

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

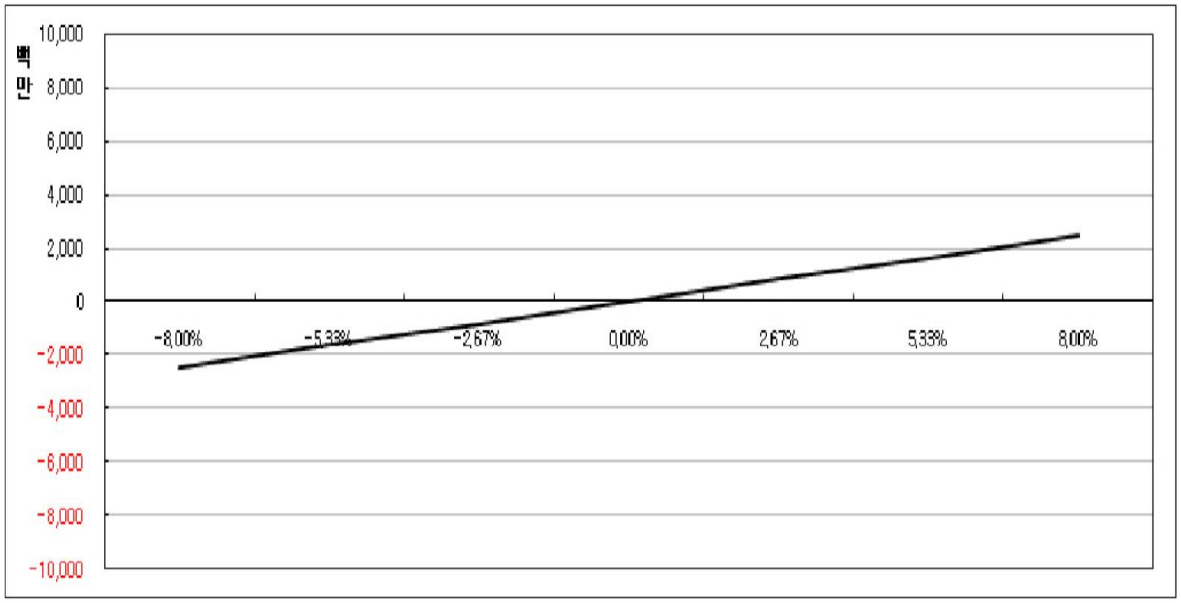
공시일: 2019-04-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	143	0	143	장내
누계	주가지수	선물	4,074	0	4,074	장내
합계			4,074	0	4,074	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

327

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,399

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

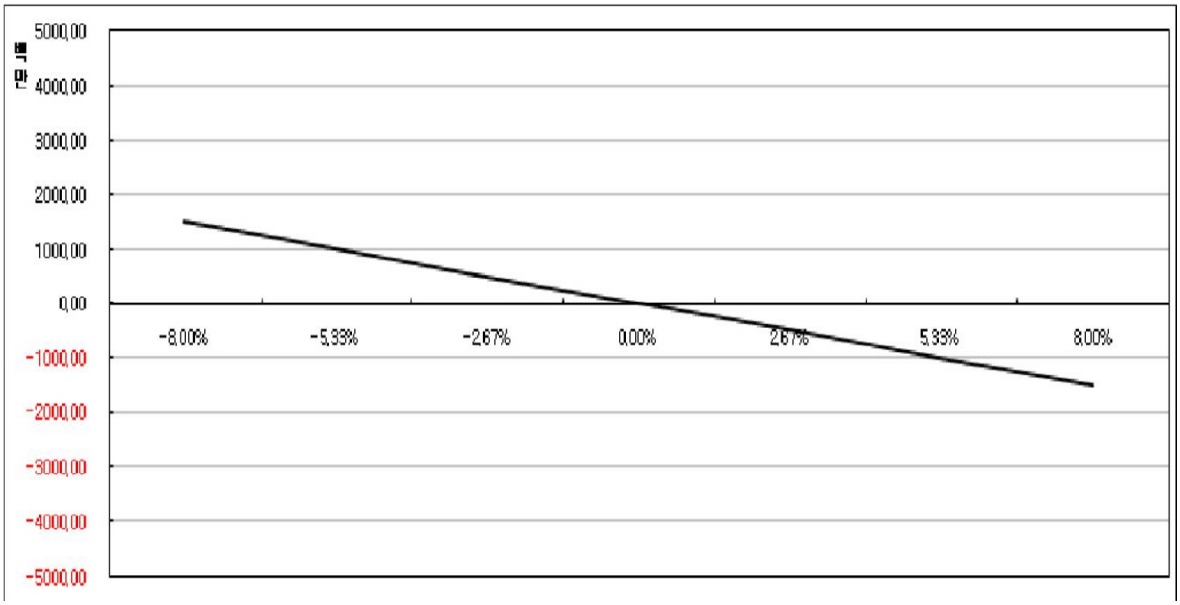
공시일: 2019-04-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	143	-143	장내
누계	주가지수	선물	0	3,359	-3,359	장내
합계			0	3,359	-3,359	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

269

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

224

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

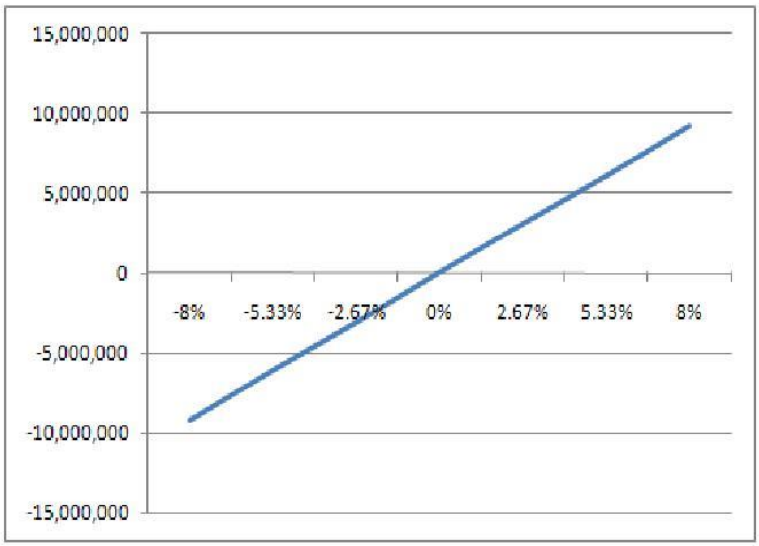
공시일: 2019-04-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	214	0	214	장내
누계	주가지수	선물	65,040	0	65,040	장내
합계			65,040	0	65,040	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,215

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,701