펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-23

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	8	7,004	-6,995	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)	1,808

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

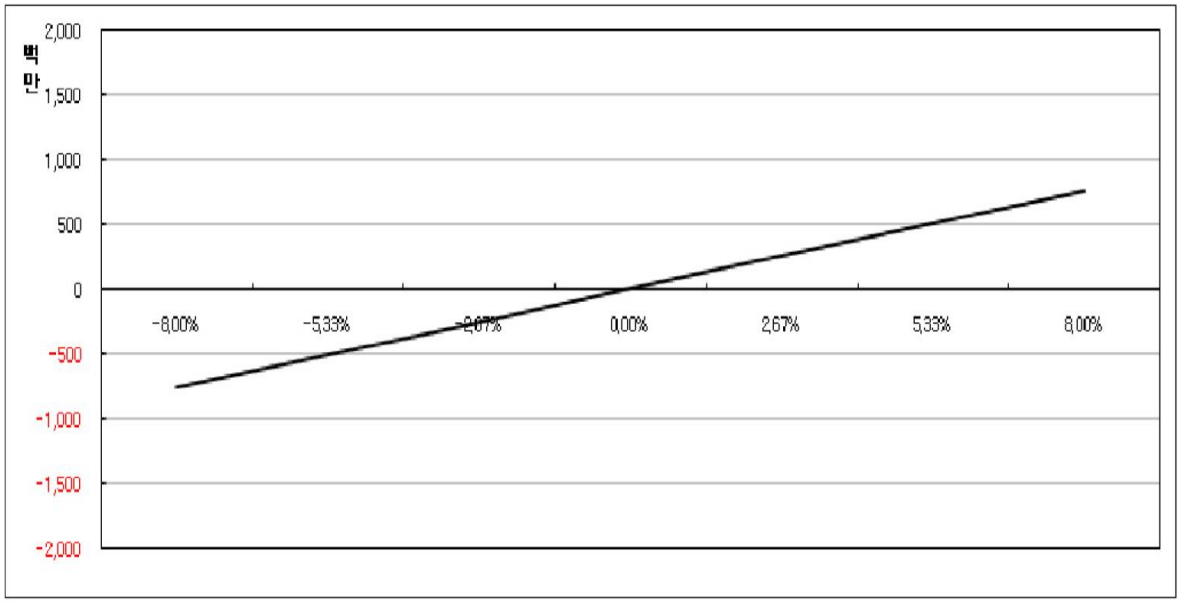
공시일: 2019-04-23

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)	2,833

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

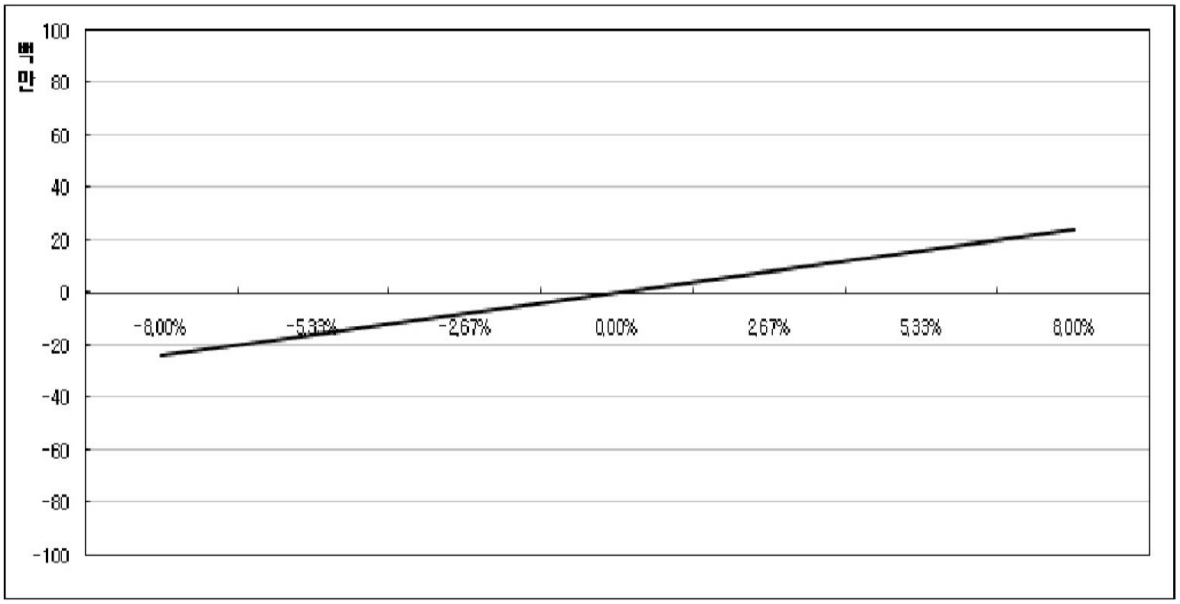
공시일: 2019-04-23

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)	3,162

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

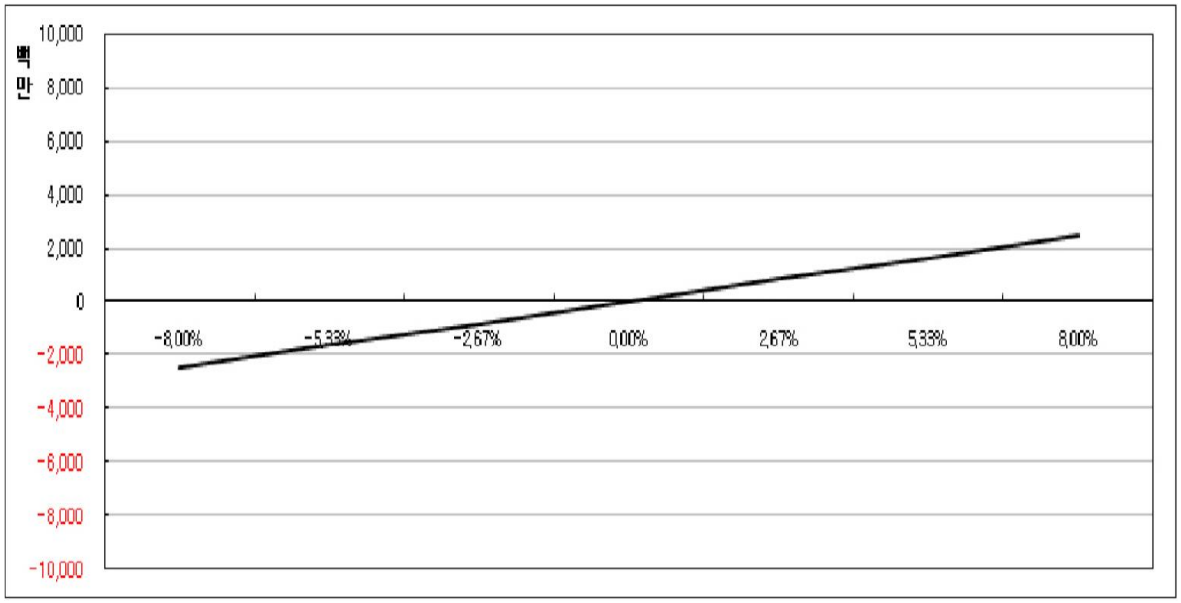
공시일: 2019-04-23

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	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)

5,404

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

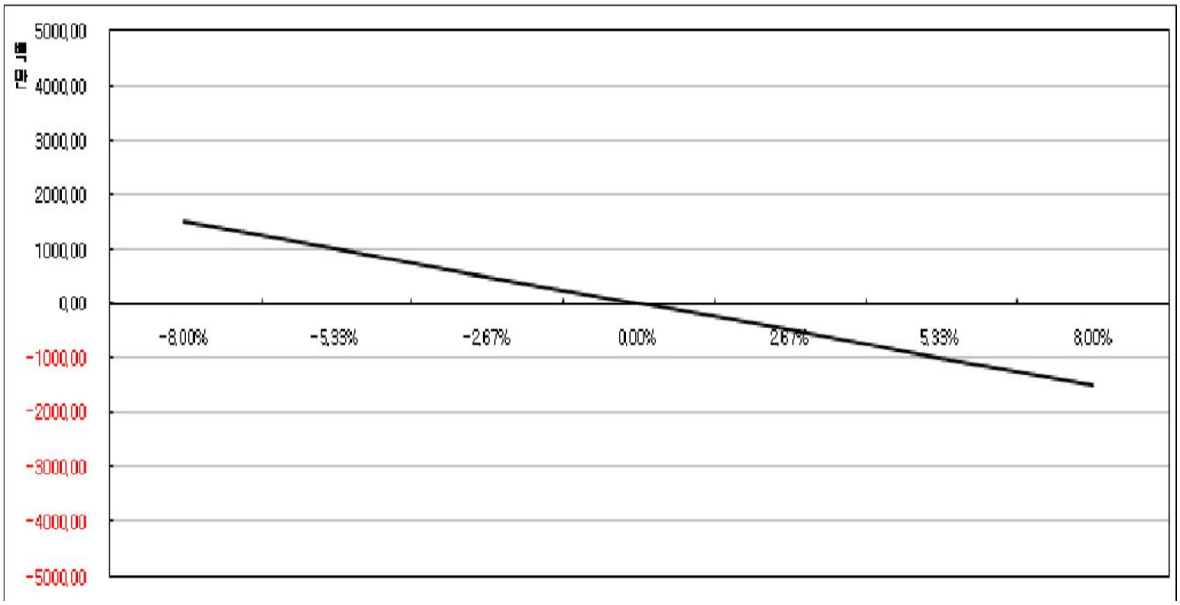
공시일: 2019-04-23

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	3,359	-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)	223

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

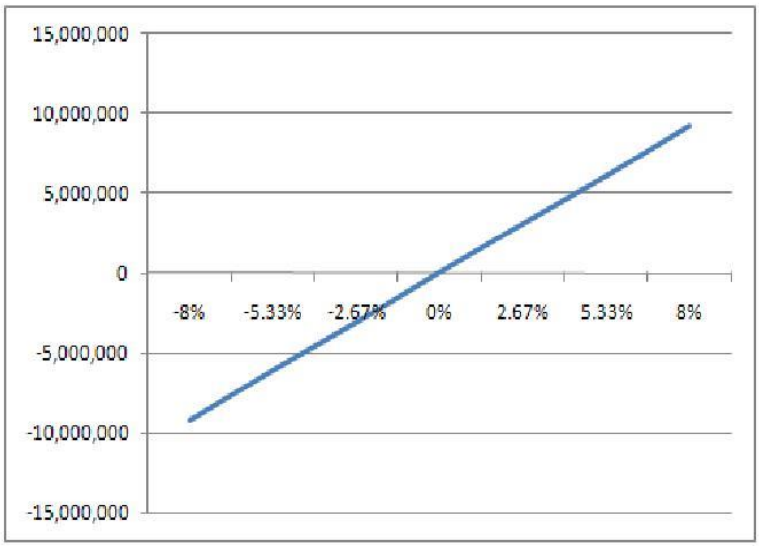
공시일: 2019-04-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	858	0	858	장내
누계	주가지수	선물	65,893	0	65,893	장내
합계			65,893	0	65,893	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,283

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,757