펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-24

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	3,581	0	3,581	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	7	7,019	-7,012	장내
합계			3,588	7,019	-3,431	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	188

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,798

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

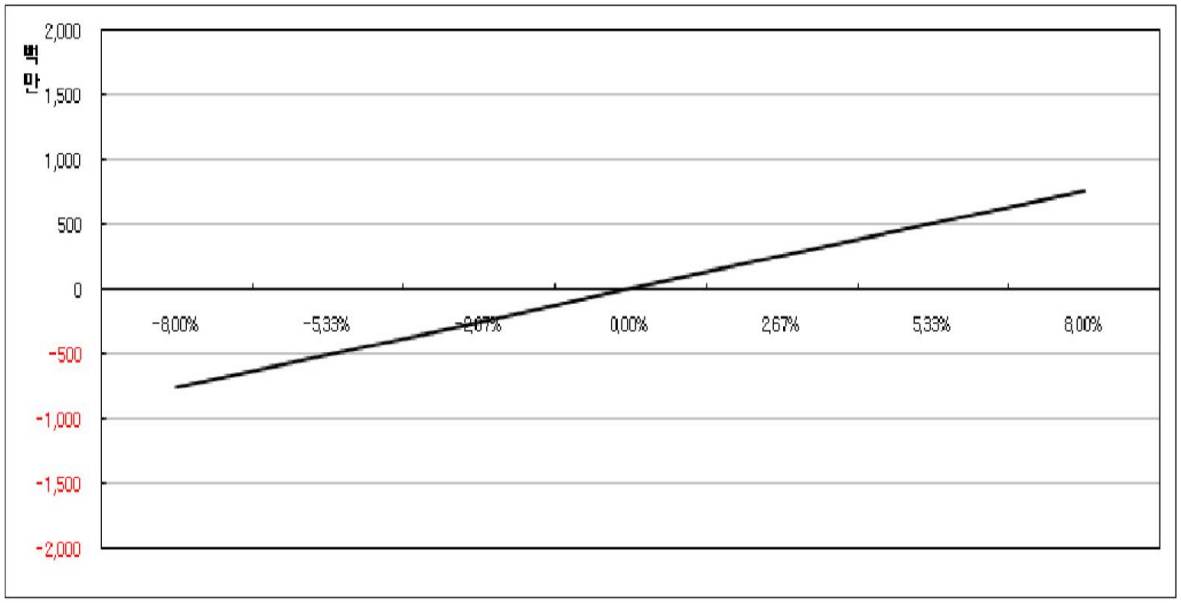
공시일: 2019-04-24

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)	2,825

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

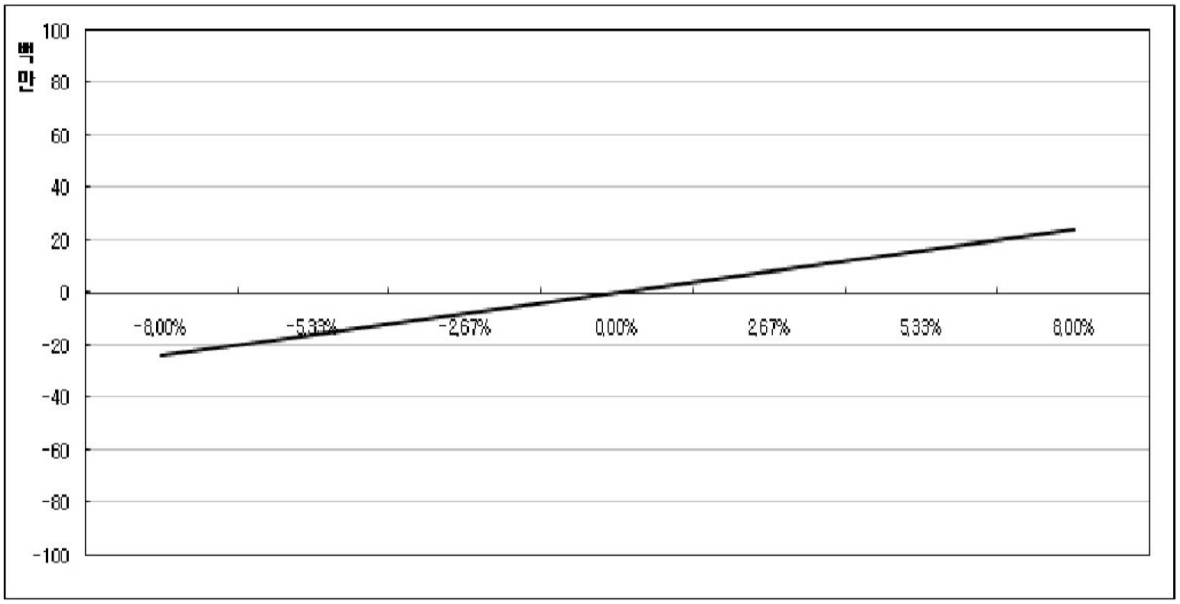
공시일: 2019-04-24

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	859	0	859	장내
합계			859	0	859	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,152

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

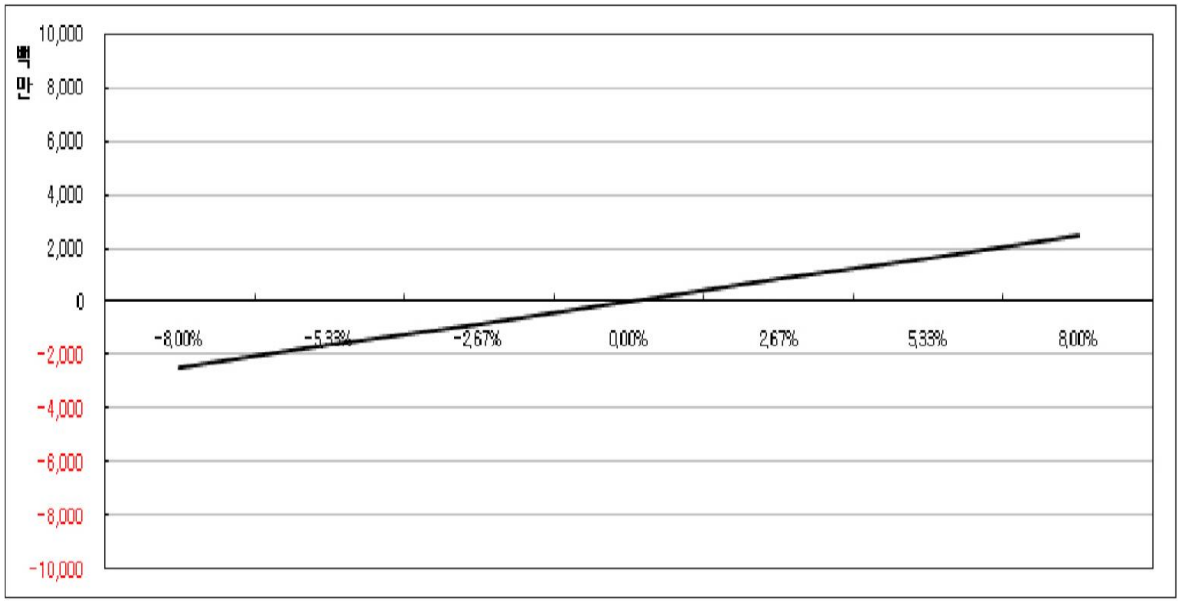
공시일: 2019-04-24

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	4,082	0	4,082	장내
합계			4,082	0	4,082	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

327

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,388

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

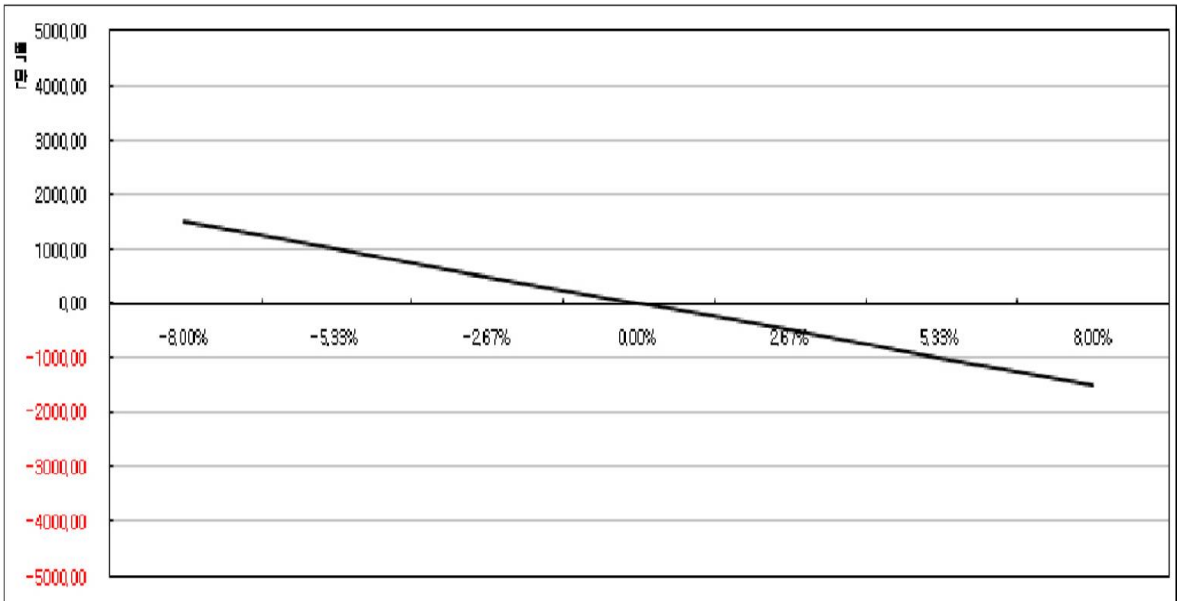
공시일: 2019-04-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	215	0	215	장내
누계	주가지수	선물	0	3,151	-3,151	장내
합계			0	3,151	-3,151	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

253

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

209

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

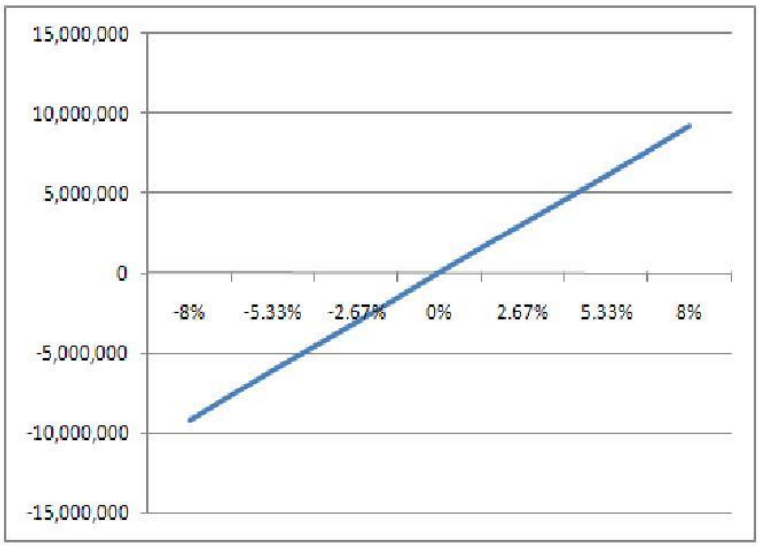
공시일: 2019-04-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	286	0	286	장내
누계	주가지수	선물	66,318	0	66,318	장내
합계			66,318	0	66,318	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,315

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,633