펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-25

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	3,546	0	3,546	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	12	6,951	-6,939	장내
합계			3,558	6,951	-3,393	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	145

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,791

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

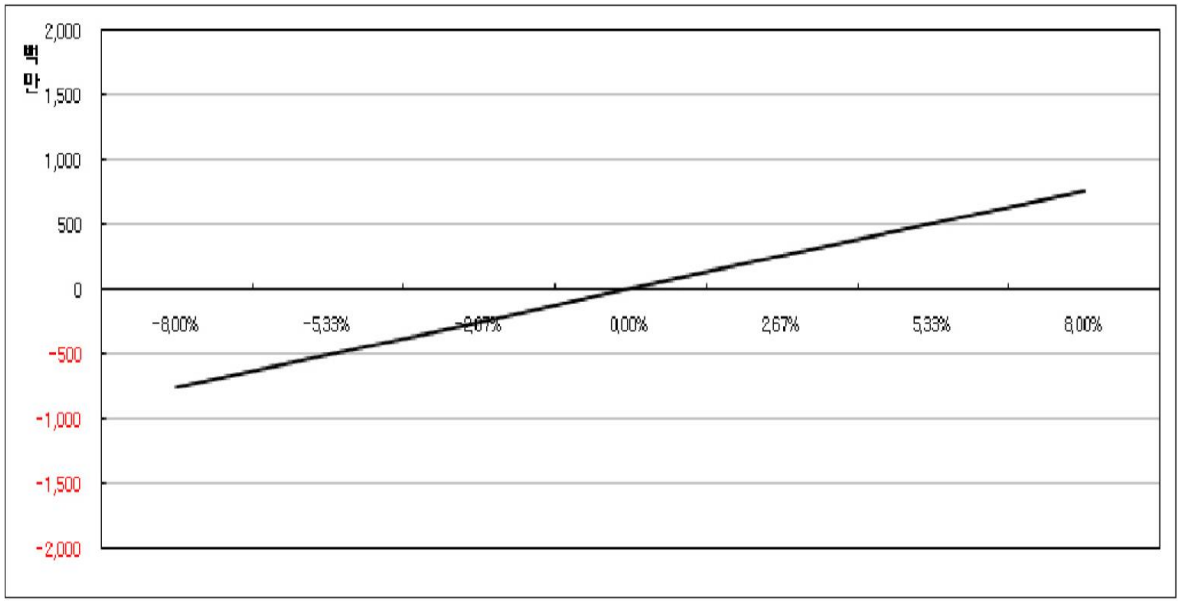
공시일: 2019-04-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	71	-71	장내
누계	주가지수	선물	213	0	213	장내
합계			213	0	213	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,795

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

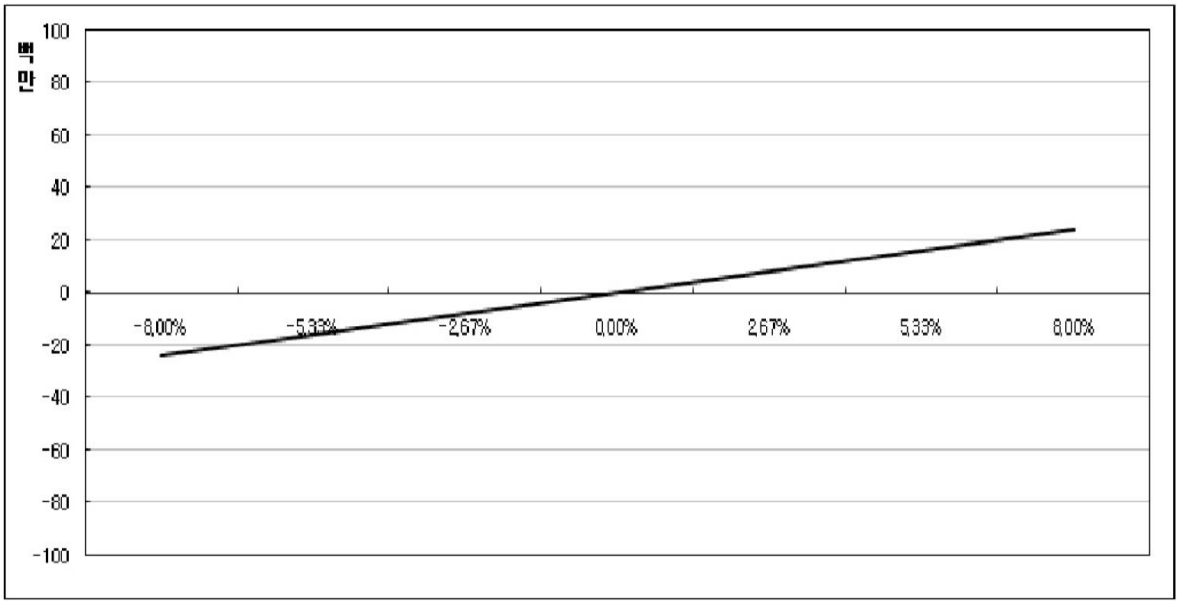
공시일: 2019-04-25

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	851	0	851	장내
합계			851	0	851	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,121

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

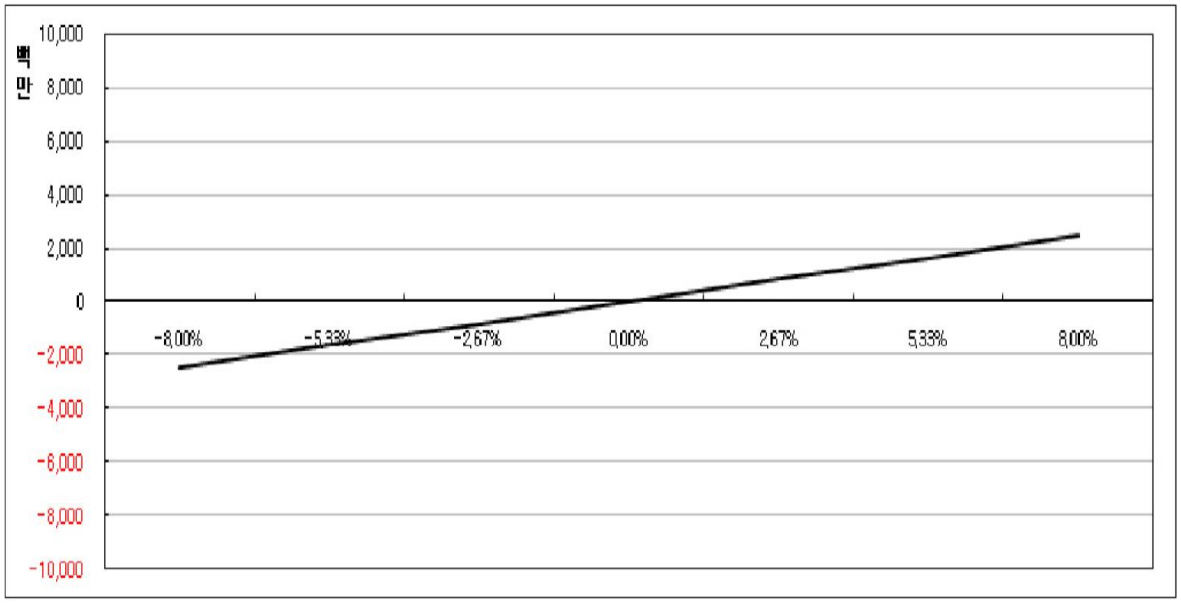
공시일: 2019-04-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	284	284	0	장내
누계	주가지수	선물	4,043	0	4,043	장내
합계			4,043	0	4,043	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

324

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,333

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

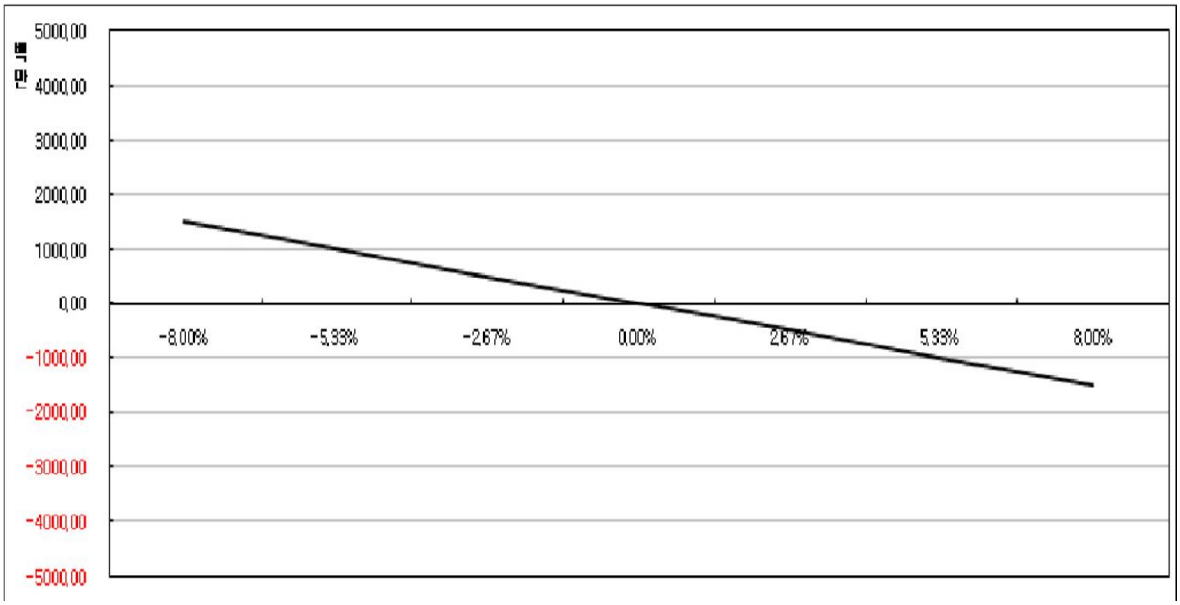
공시일: 2019-04-25

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	3,121	-3,121	장내
합계			0	3,121	-3,121	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

250

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

207

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

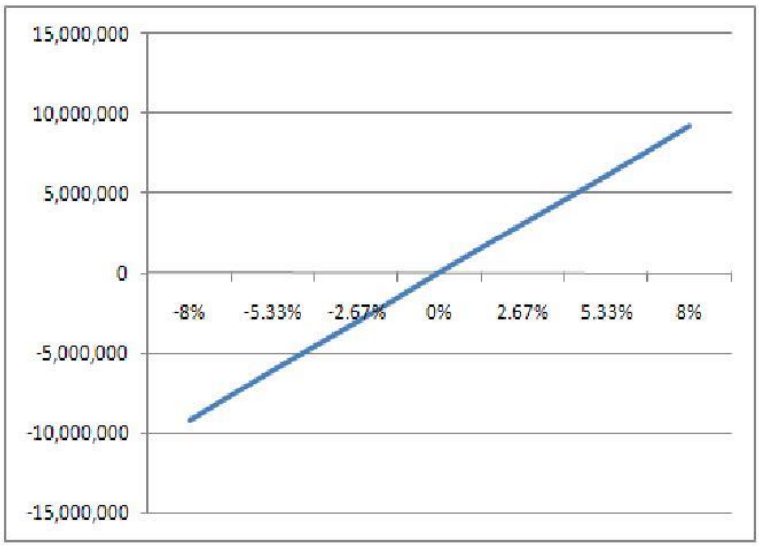
공시일: 2019-04-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	638	0	638	장내
누계	주가지수	선물	66,315	0	66,315	장내
합계			66,315	0	66,315	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,315

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,197