펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-29

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	3,517	0	3,517	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	17	6,893	-6,876	장내
합계			3,533	6,893	-3,360	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	102

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,816

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

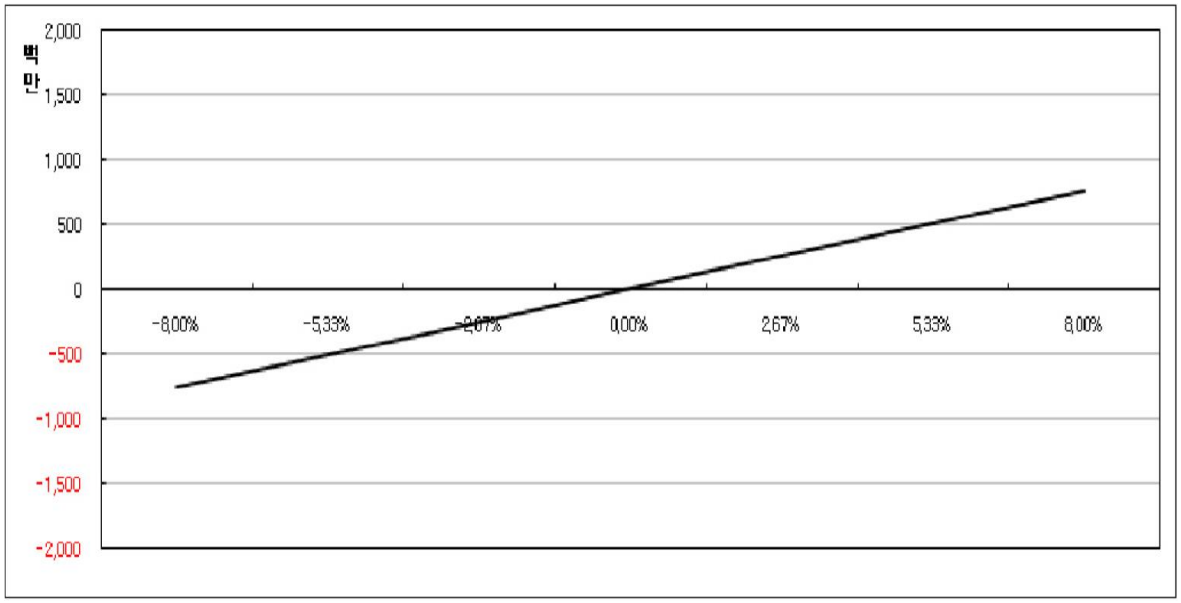
공시일: 2019-04-29

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	211	0	211	장내
합계			211	0	211	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,798

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

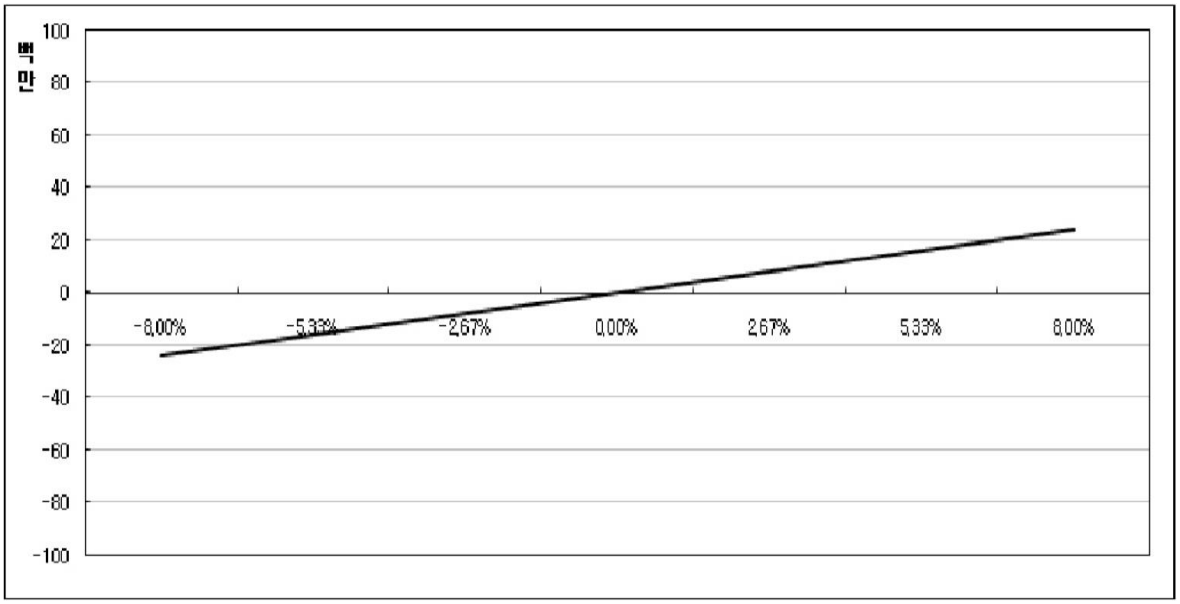
공시일: 2019-04-29

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	844	0	844	장내
합계			844	0	844	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,123

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

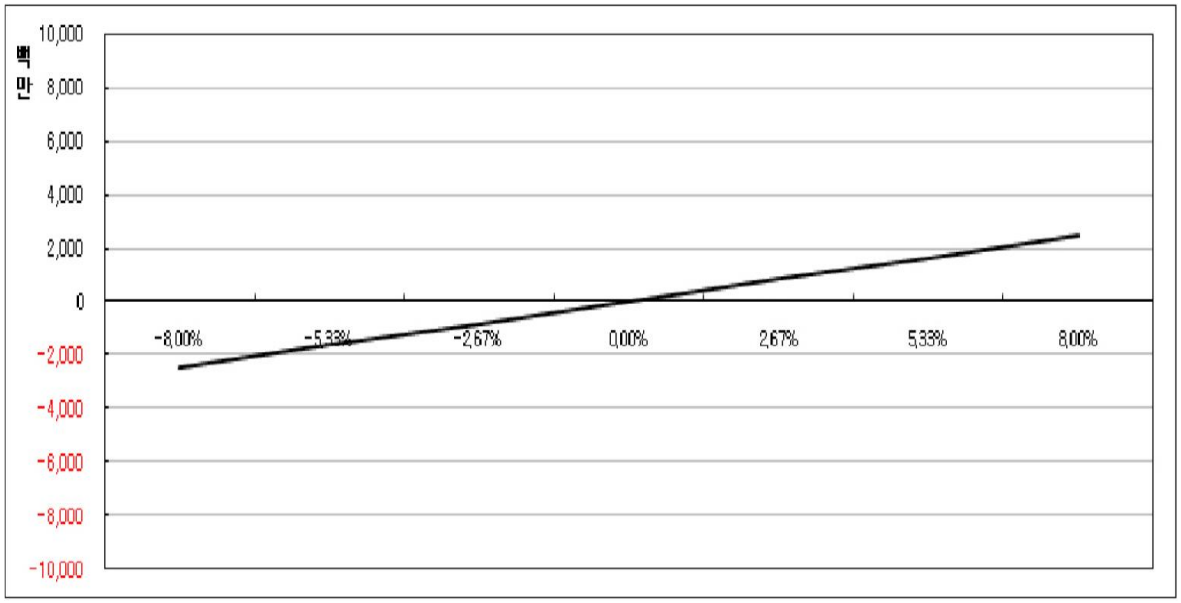
공시일: 2019-04-29

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	4,009	0	4,009	장내
합계			4,009	0	4,009	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

321

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,335

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

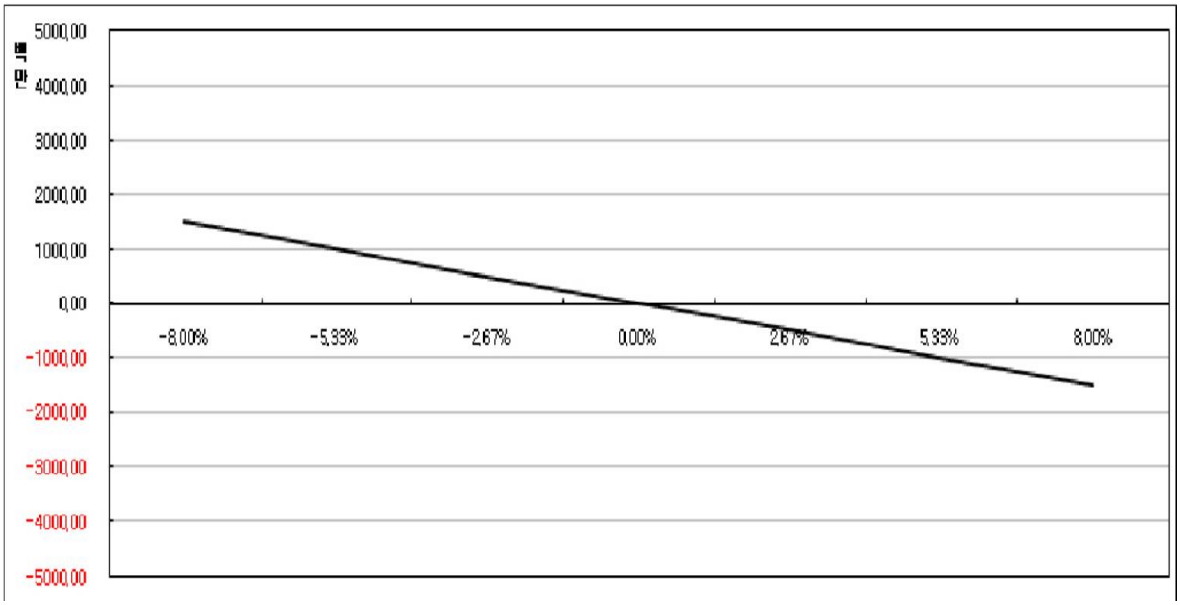
공시일: 2019-04-29

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	3,235	-3,235	장내
합계			0	3,235	-3,235	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

259

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

214

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

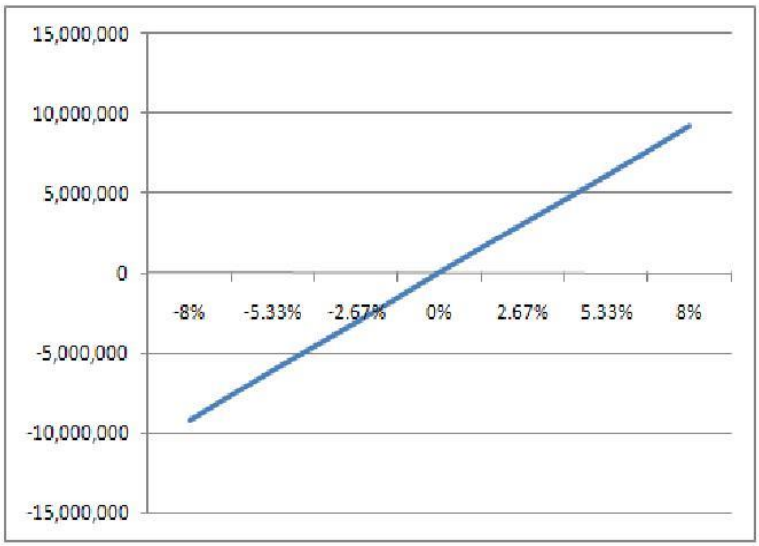
공시일: 2019-04-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,336	0	1,336	장내
누계	주가지수	선물	67,311	0	67,311	장내
합계			67,311	0	67,311	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,393

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,224