펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-05-02

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	3,562	0	3,562	장내
신규	주가지수	옵션	6	0	6	장내
누계	주가지수	옵션	5	3,490	-3,485	장내
합계			3,567	3,490	76	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,859

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

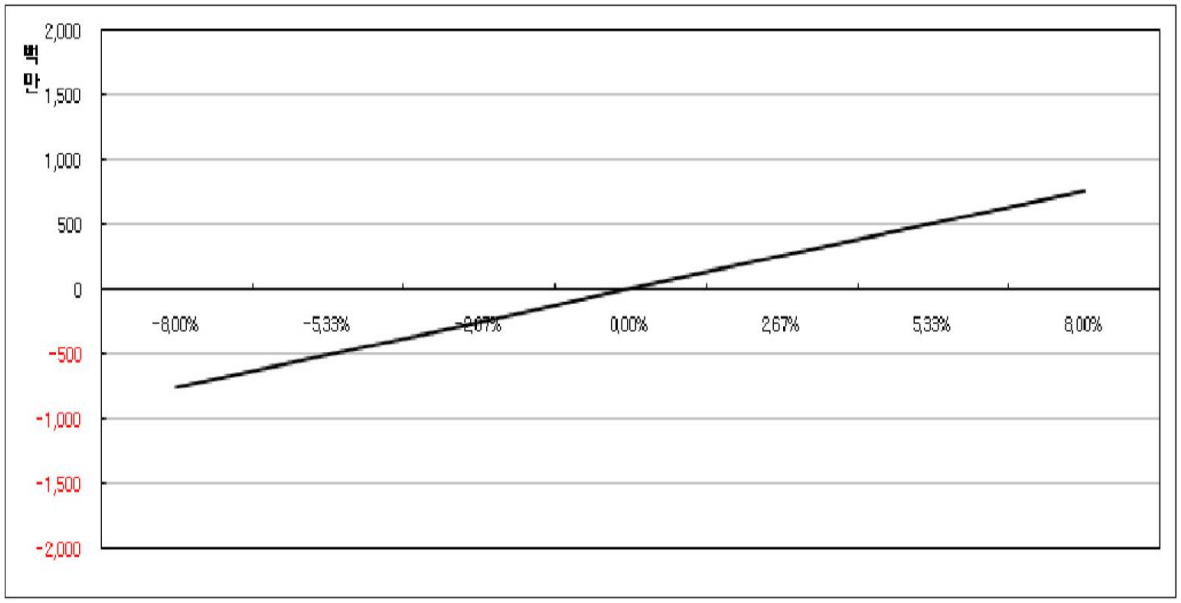
공시일: 2019-05-02

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	214	0	214	장내
합계			214	0	214	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,861

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

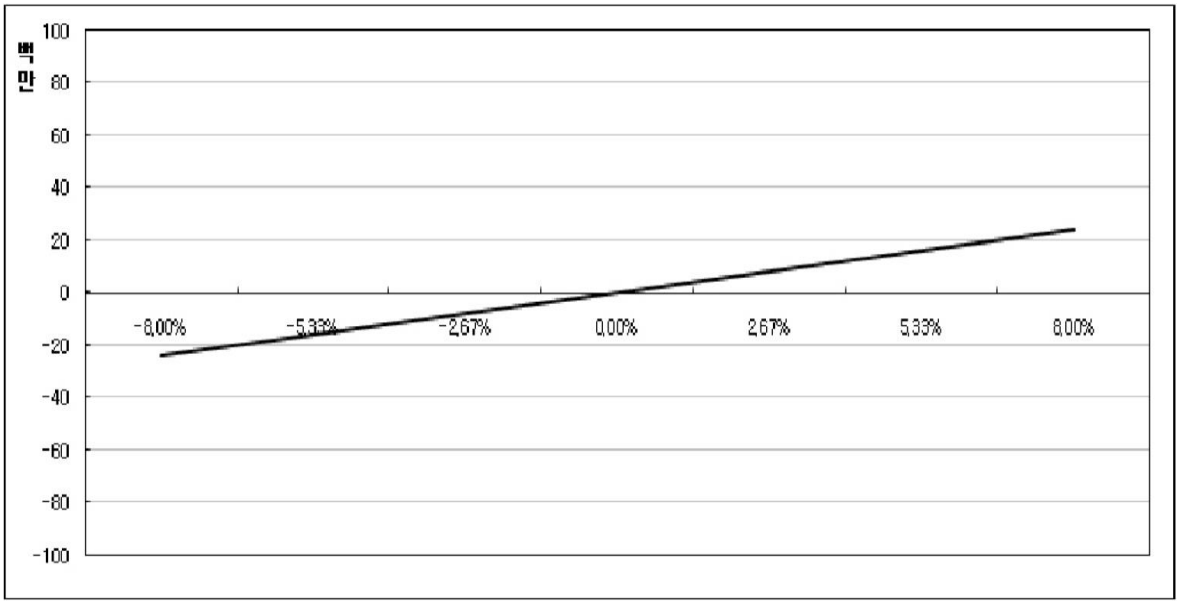
공시일: 2019-05-02

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	855	0	855	장내
합계			855	0	855	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,195

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

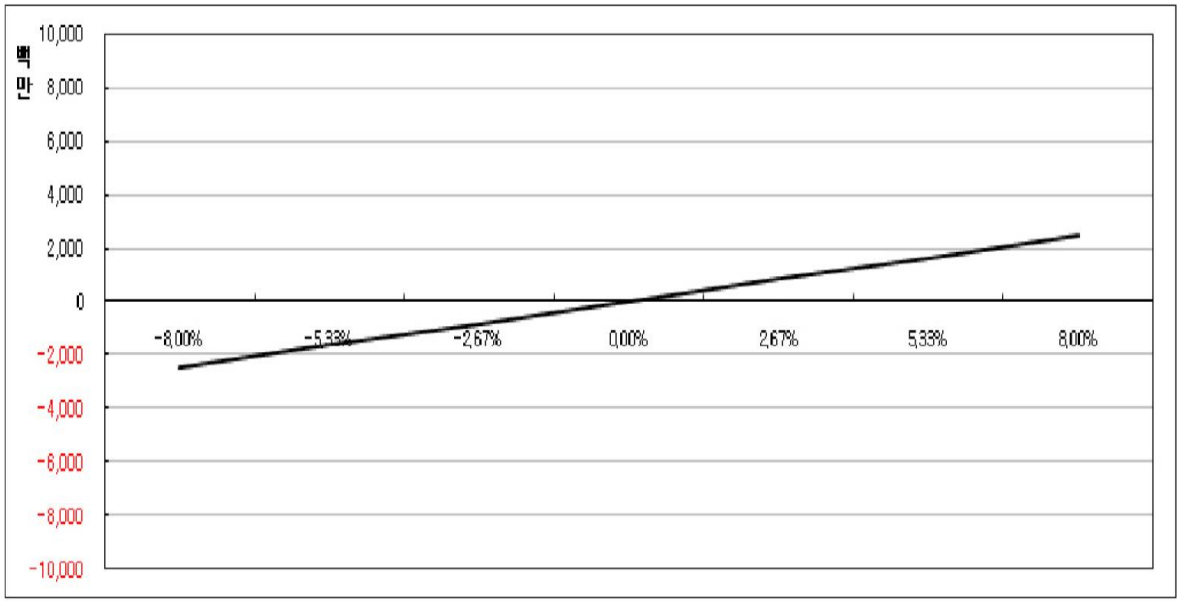
공시일: 2019-05-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	214	285	-71	장내
누계	주가지수	선물	3,989	0	3,989	장내
합계			3,989	0	3,989	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

320

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,458

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

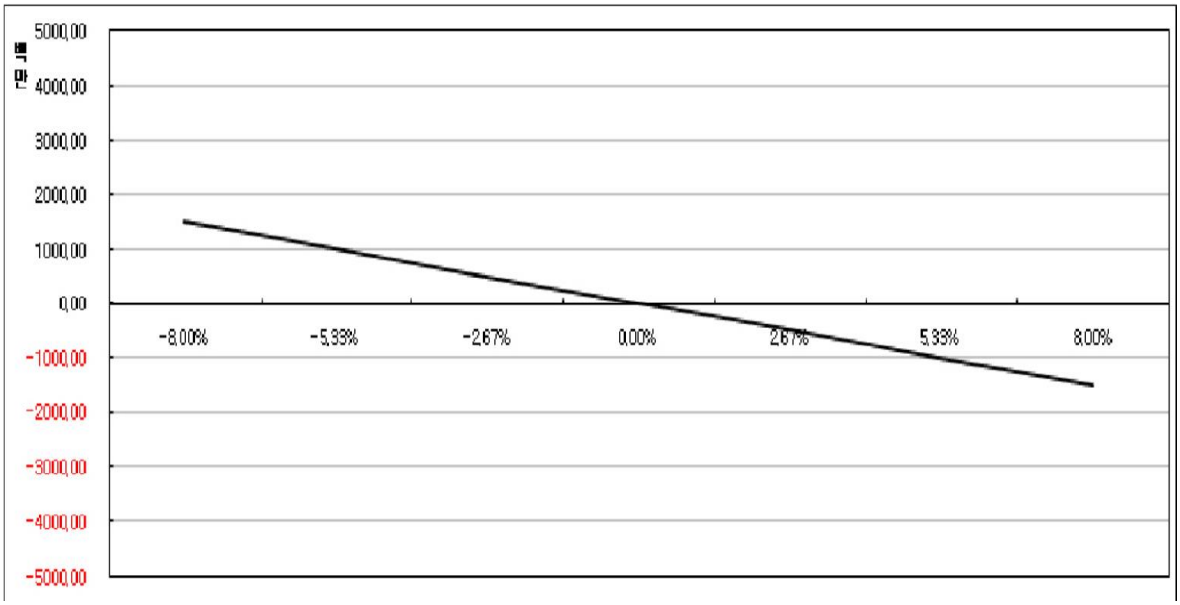
공시일: 2019-05-02

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	3,063	-3,063	장내
합계			0	3,063	-3,063	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

245

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

204

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

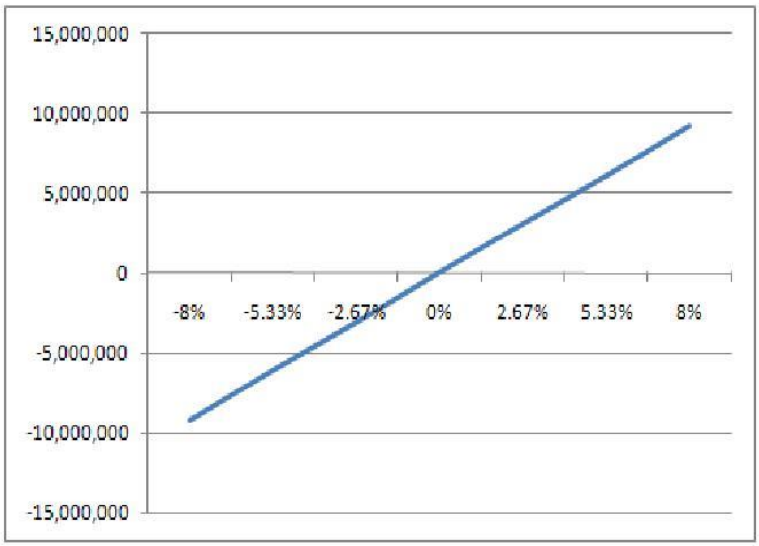
공시일: 2019-05-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	356	-356	장내
누계	주가지수	선물	69,378	0	69,378	장내
합계			69,378	0	69,378	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,560

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,290