펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-16

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	3,779	0	3,779	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	24	14,306	-14,283	장내
합계			3,803	14,306	-10,504	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	724

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	7,988

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

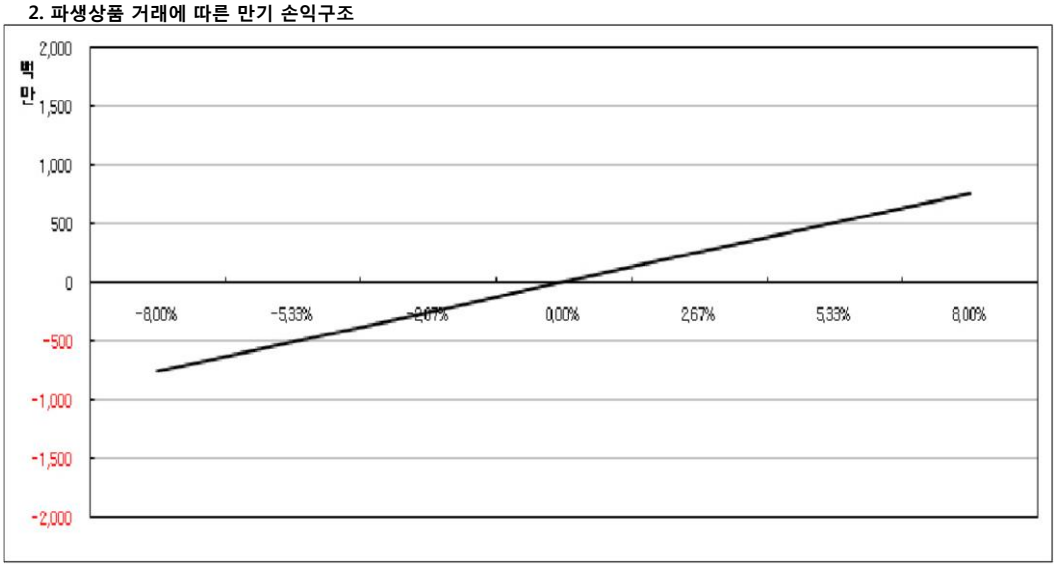
공시일: 2019-01-16

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	270	0	270	장내
합계			270	0	270	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,601

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

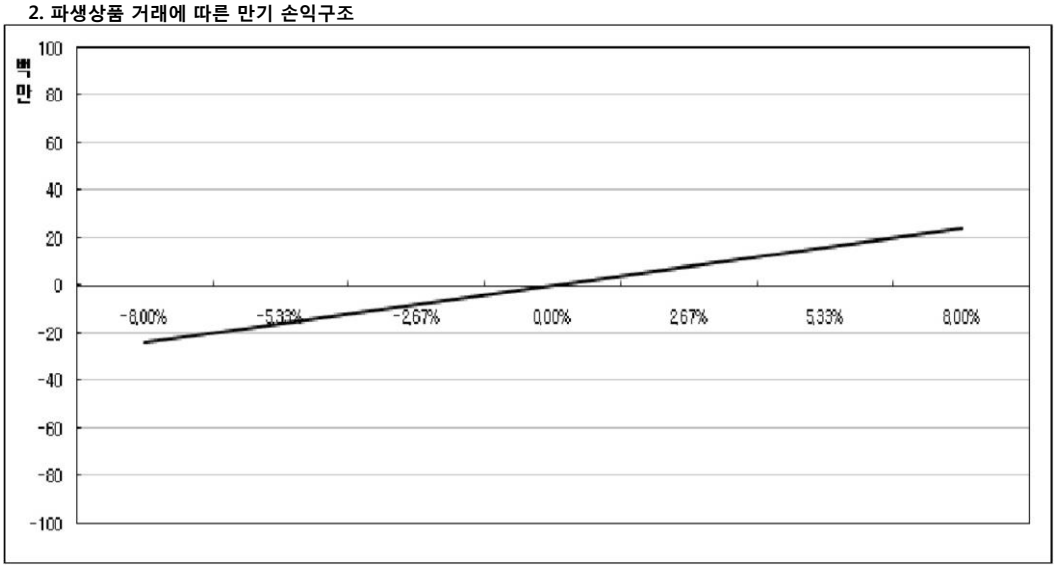
공시일: 2019-01-16

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	945	0	945	장내
합계			945	0	945	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,906

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

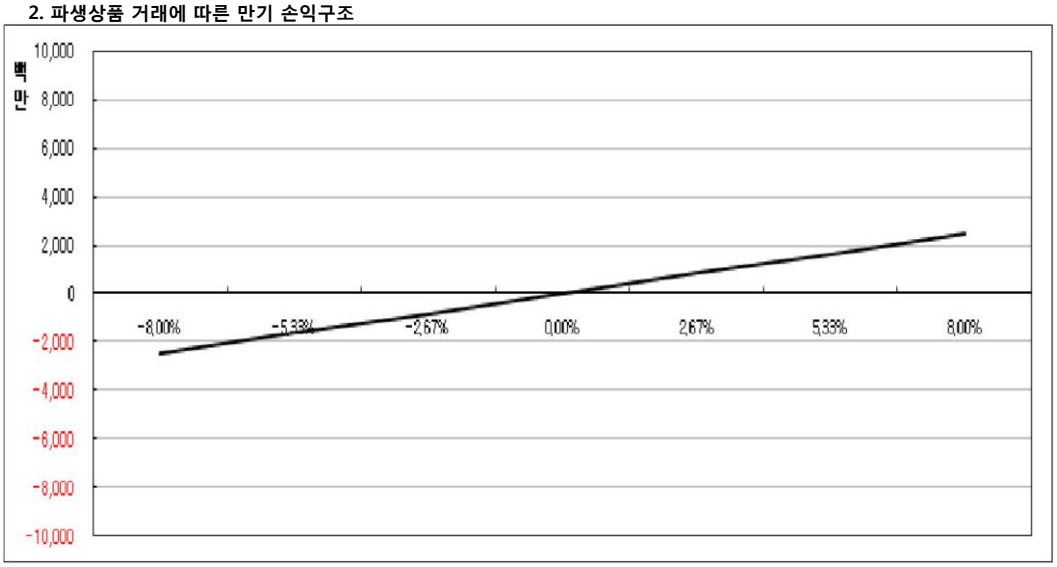
공시일: 2019-01-16

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	5,736	0	5,736	장내
합계			5,736	0	5,736	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 460

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,004

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

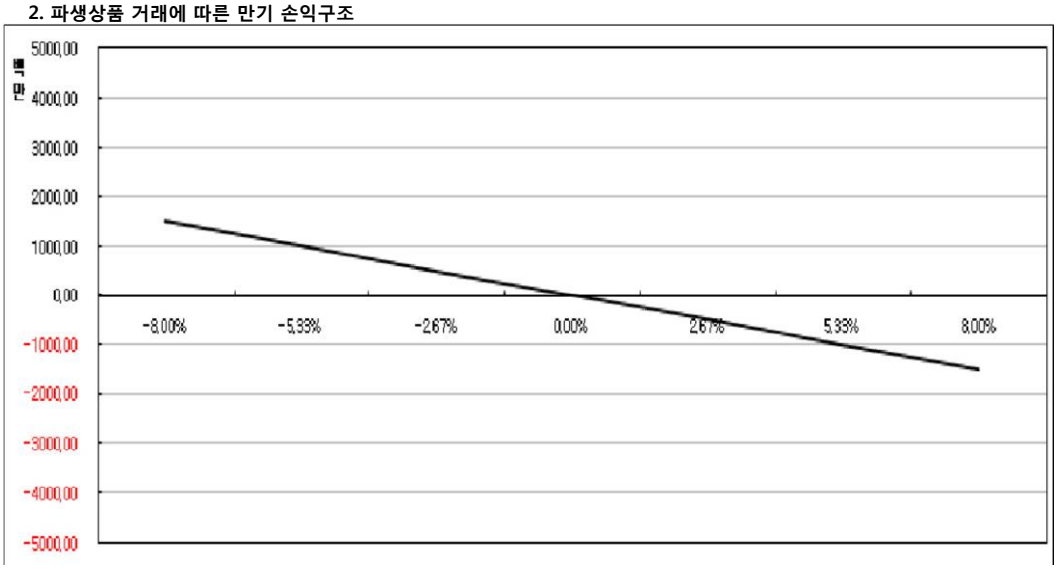
공시일: 2019-01-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	202	135	67	장내
누계	주가지수	선물	0	2,497	-2,497	장내
합계			0	2,497	-2,497	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	200

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	177

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

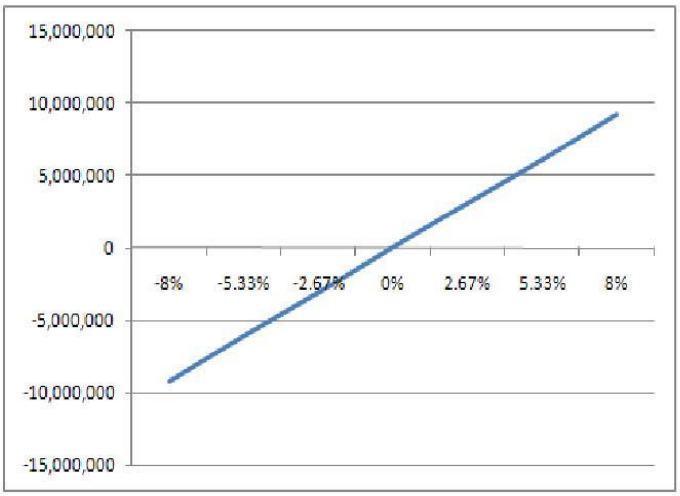
공시일: 2019-01-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	945	0	945	장내
누계	주가지수	선물	72,611	0	72,611	장내
합계			72,611	0	72,611	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,829

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

40,460