펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-21

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	3,766	0	3,766	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	12	14,516	-14,504	장내
합계			3,777	14,516	-10,738	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	793

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	10,208

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

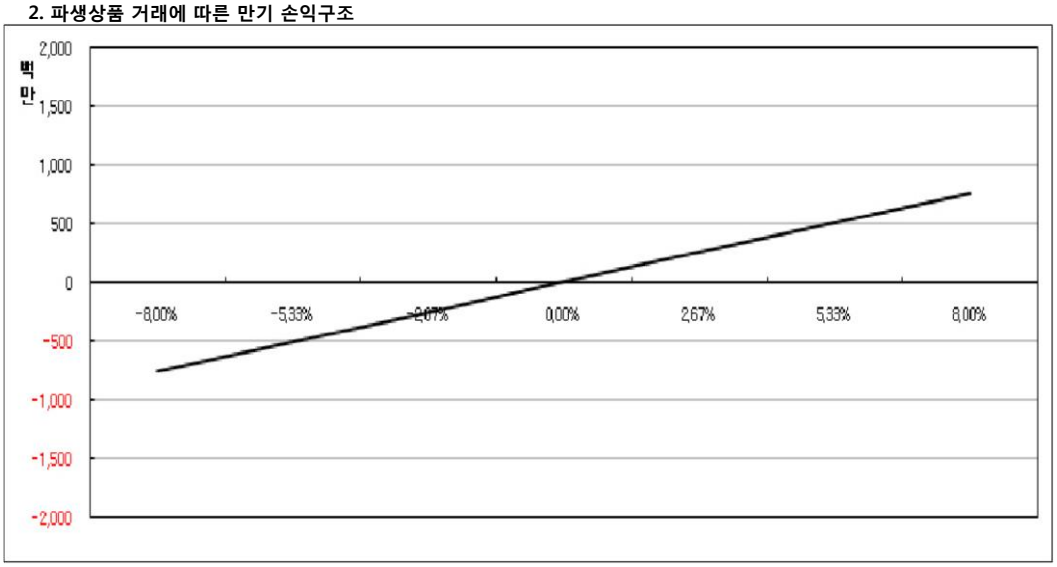
공시일: 2019-01-21

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	274	0	274	장내
합계			274	0	274	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,674

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

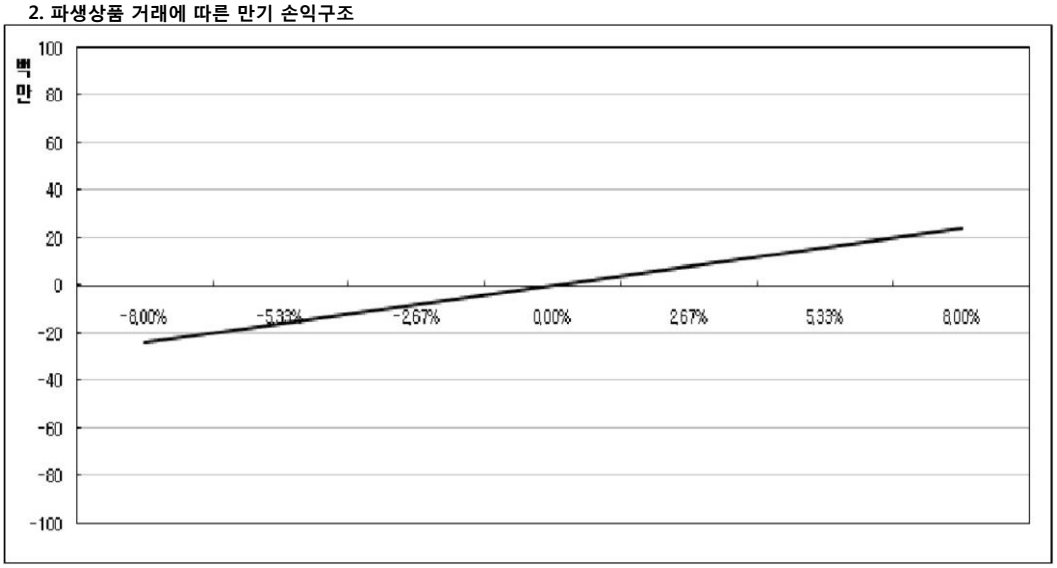
공시일: 2019-01-21

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	959	0	959	장내
합계			959	0	959	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,987

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

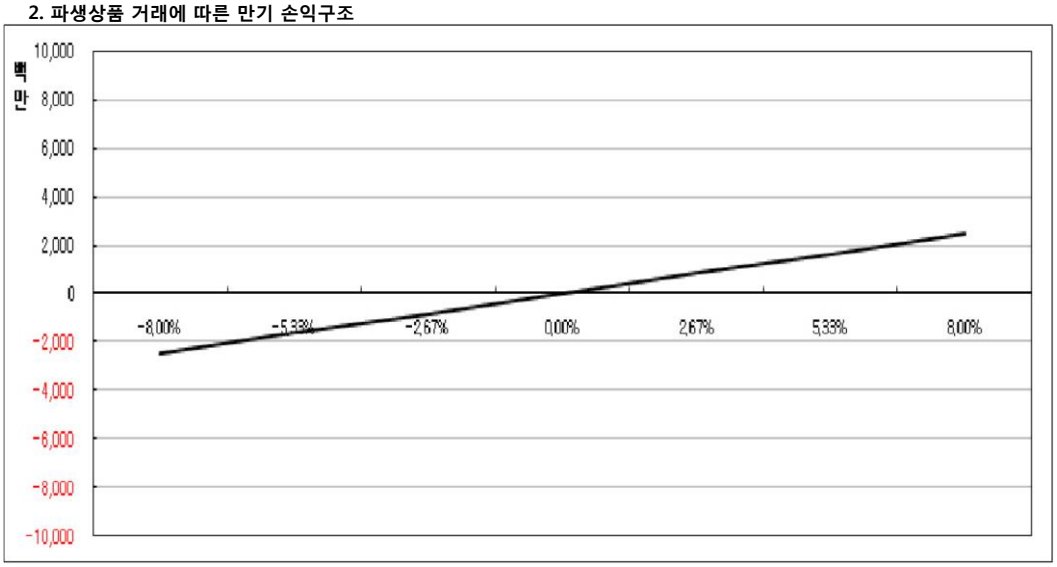
공시일: 2019-01-21

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	5,546	0	5,546	장내
합계			5,546	0	5,546	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 445

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,136

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

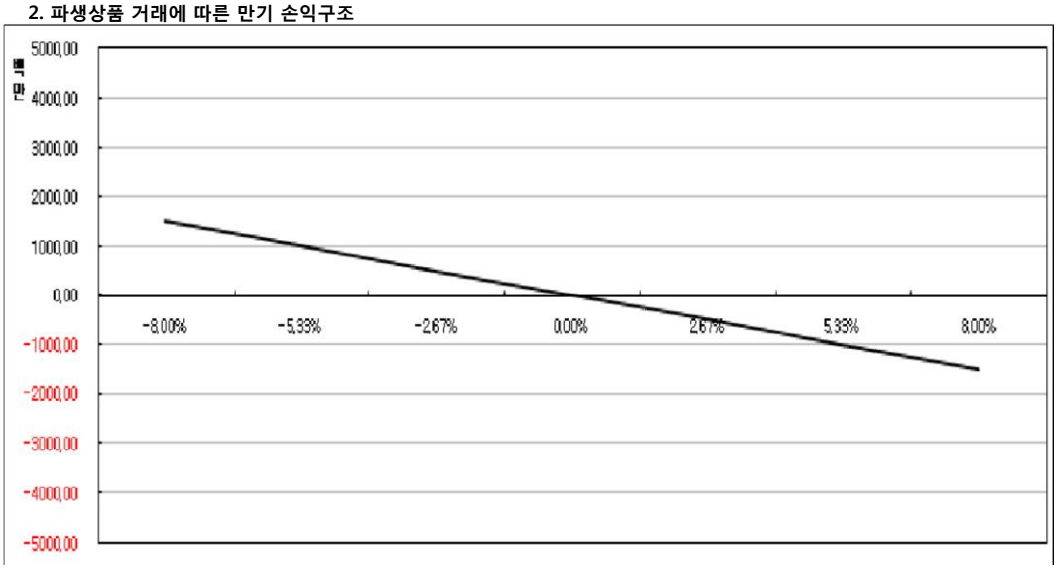
공시일: 2019-01-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	205	0	205	장내
누계	주가지수	선물	0	2,396	-2,396	장내
합계			0	2,396	-2,396	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 192

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 170

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

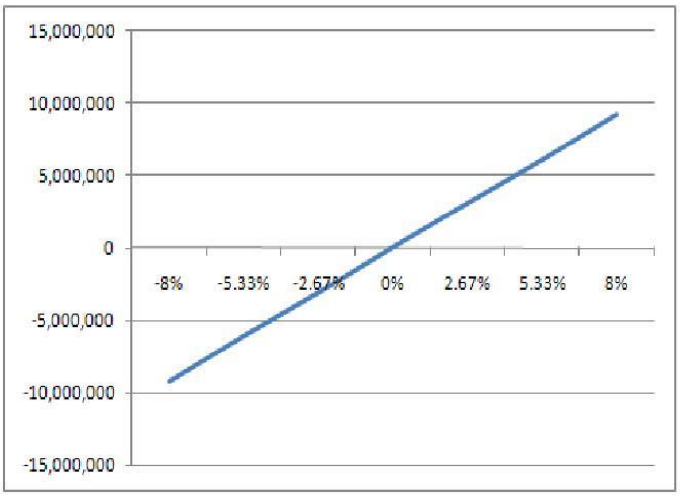
공시일: 2019-01-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	2,123	-2,123	장내
누계	주가지수	선물	72,236	0	72,236	장내
합계			72,236	0	72,236	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,797

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

41,529