펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-28

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	3,803	0	3,803	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	14,929	-14,925	장내
합계			3,806	14,929	-11,122	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

875

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12,958

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

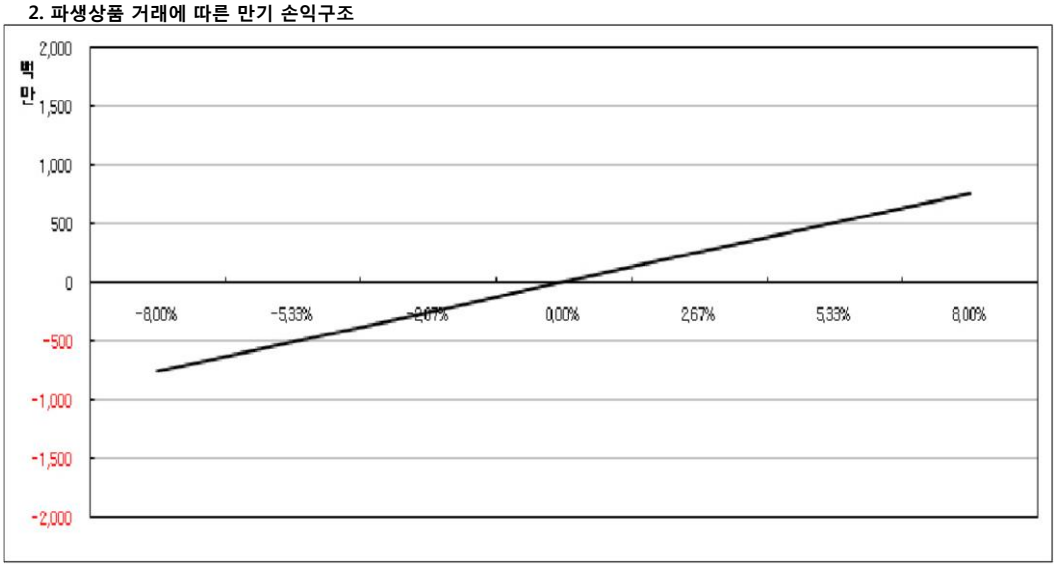
공시일: 2019-01-28

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	282	0	282	장내
합계			282	0	282	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,815

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

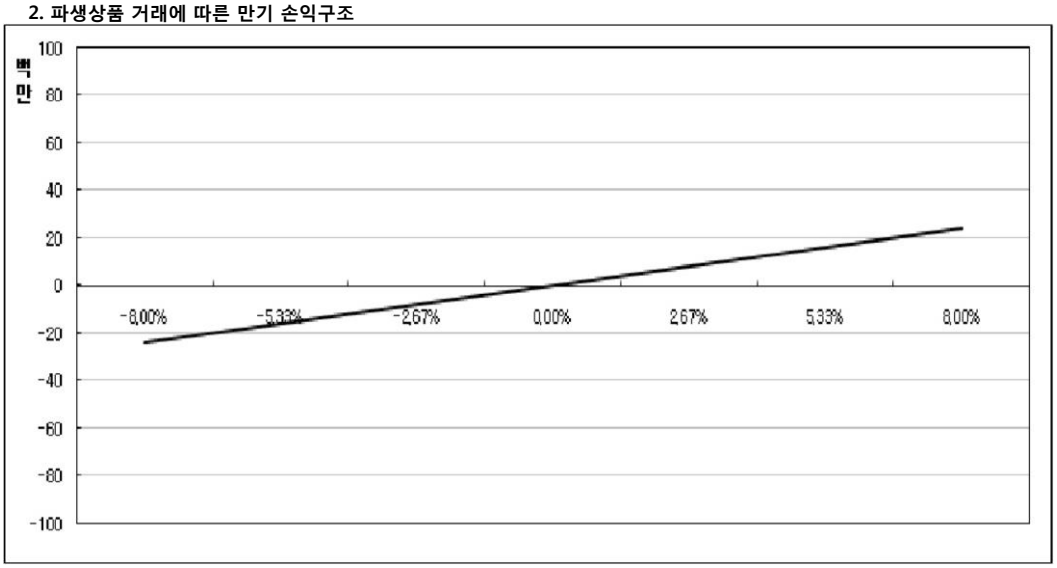
공시일: 2019-01-28

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	986	0	986	장내
합계			986	0	986	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	79

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,145

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

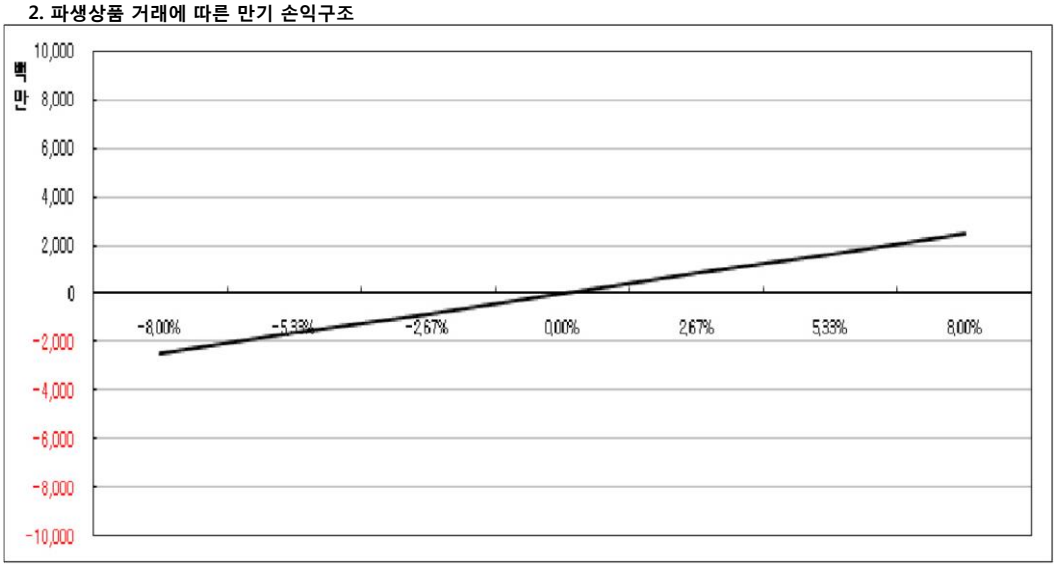
공시일: 2019-01-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	211	-211	장내
누계	주가지수	선물	5,070	0	5,070	장내
합계			5,070	0	5,070	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 407

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,391

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

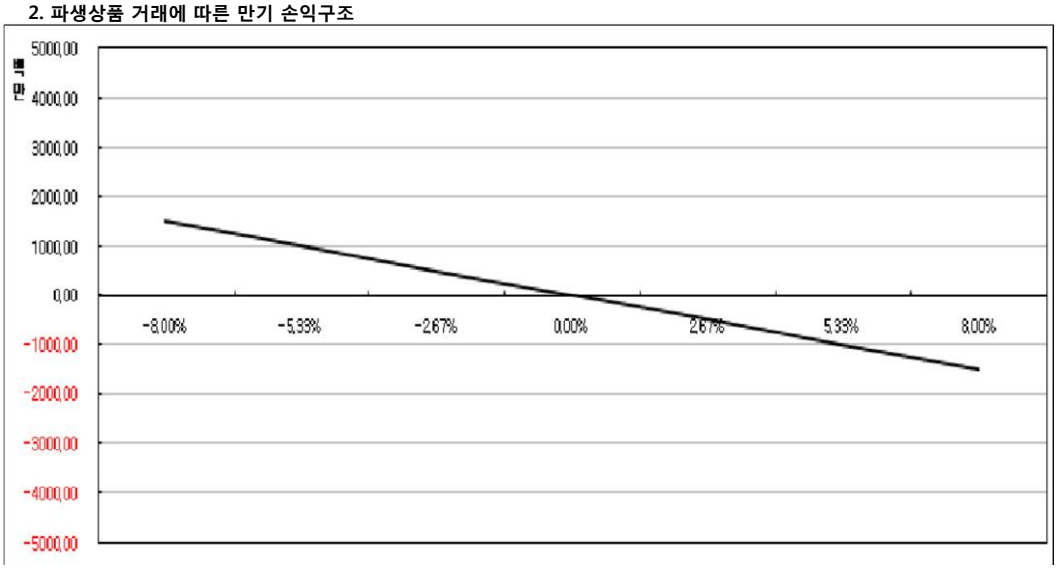
공시일: 2019-01-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	423	-423	장내
누계	주가지수	선물	0	2,746	-2,746	장내
합계			0	2,746	-2,746	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	220

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	196

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

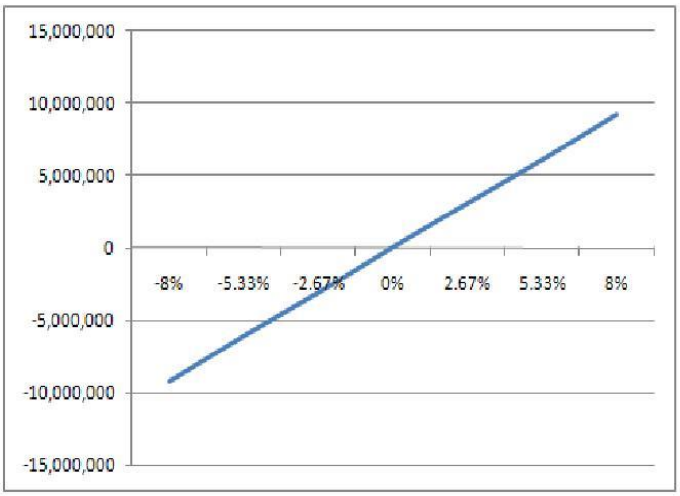
공시일: 2019-01-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	634	0	634	장내
누계	주가지수	선물	74,150	0	74,150	장내
합계			74,150	0	74,150	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,947

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,712