펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-29

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	3,802	0	3,802	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	14,927	-14,924	장내
합계			3,805	14,927	-11,122	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 888

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 10,901

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

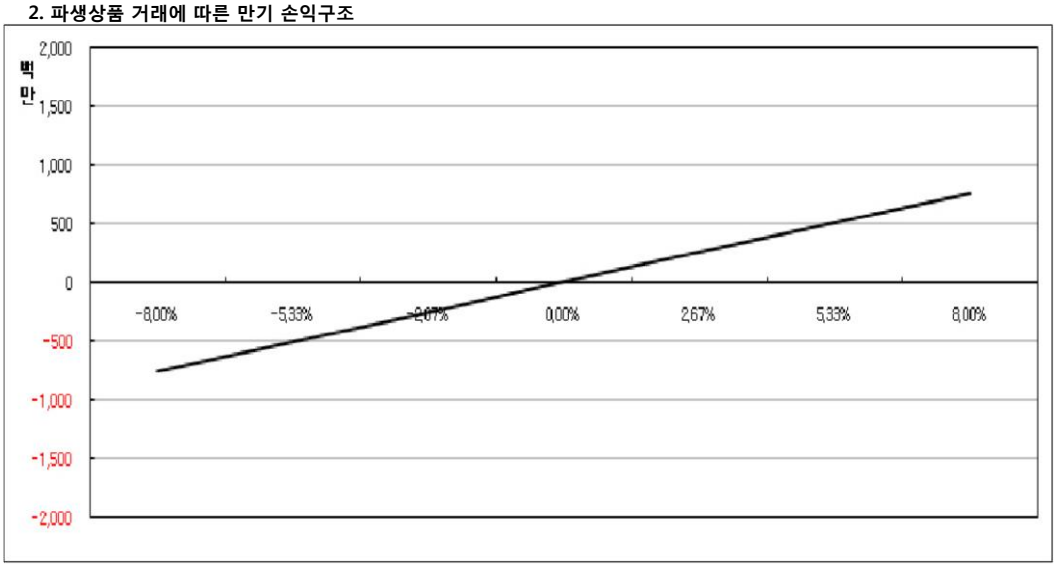
공시일: 2019-01-29

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	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) 2,832

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

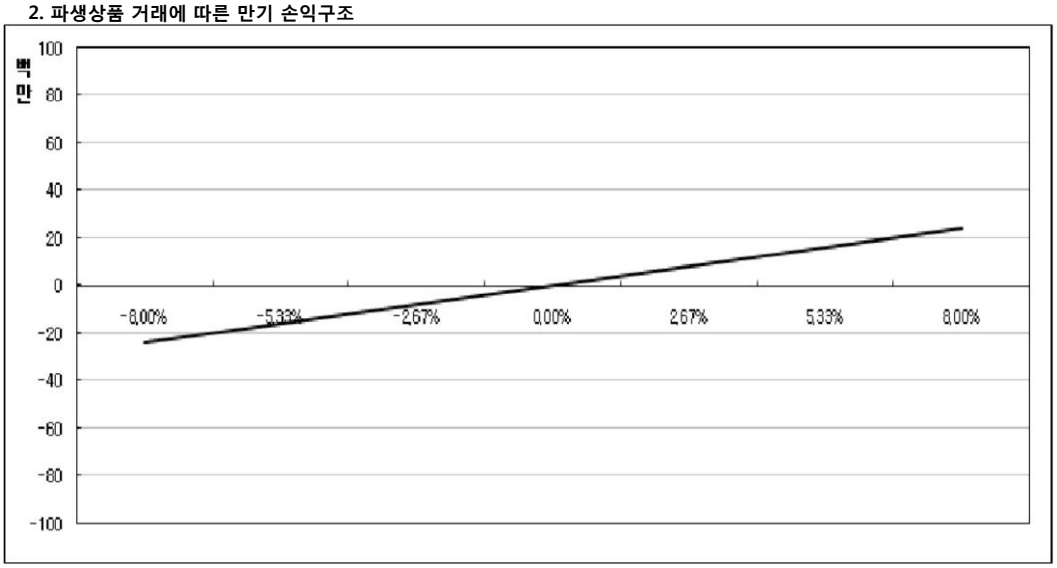
공시일: 2019-01-29

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	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)	3,163

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

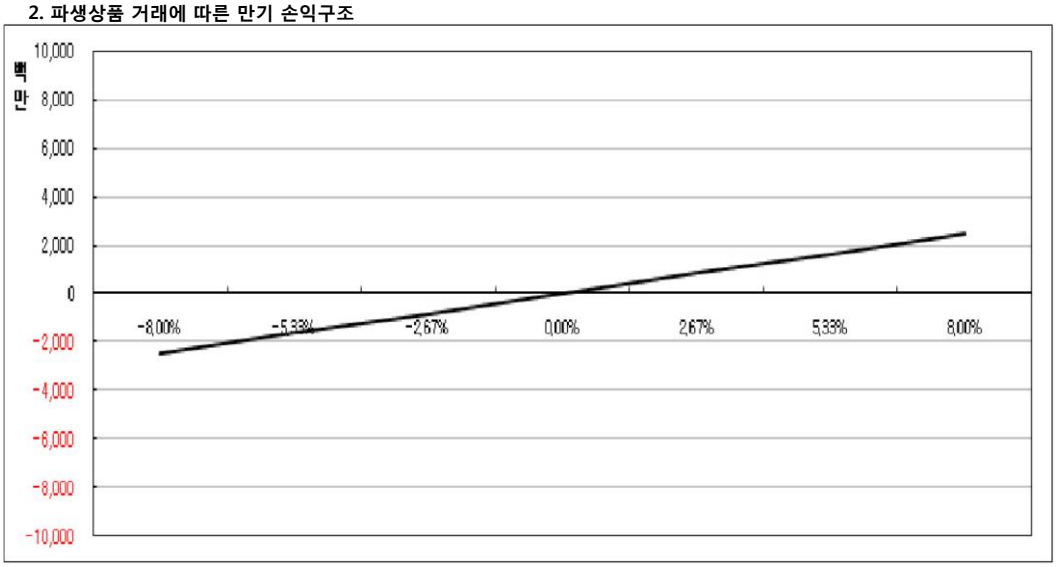
공시일: 2019-01-29

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	5,070	0	5,070	장내
합계			5,070	0	5,070	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 406

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,422

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

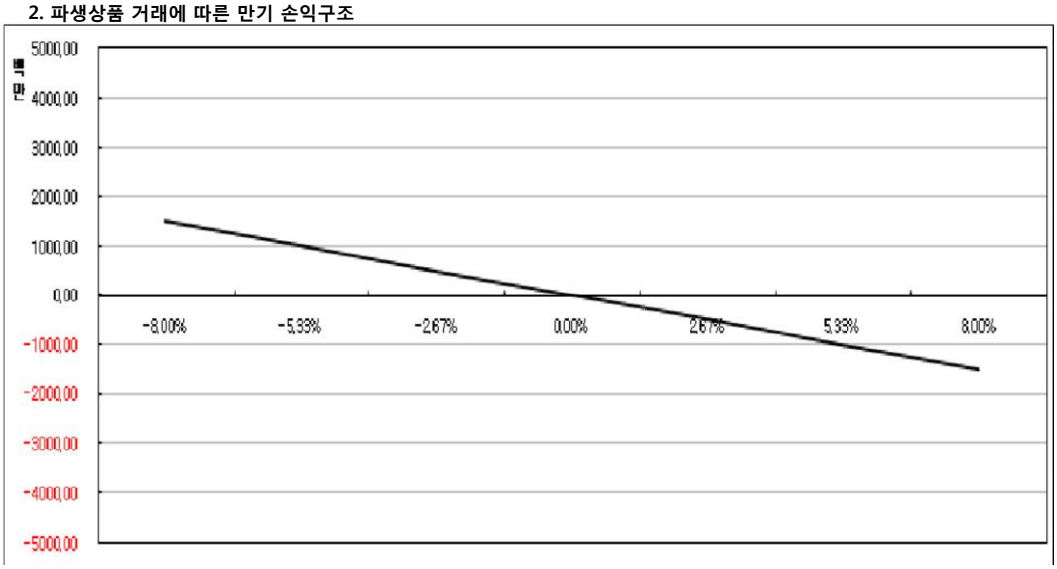
공시일: 2019-01-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	70	-70	장내
누계	주가지수	선물	0	2,816	-2,816	장내
합계			0	2,816	-2,816	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 226

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 201

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

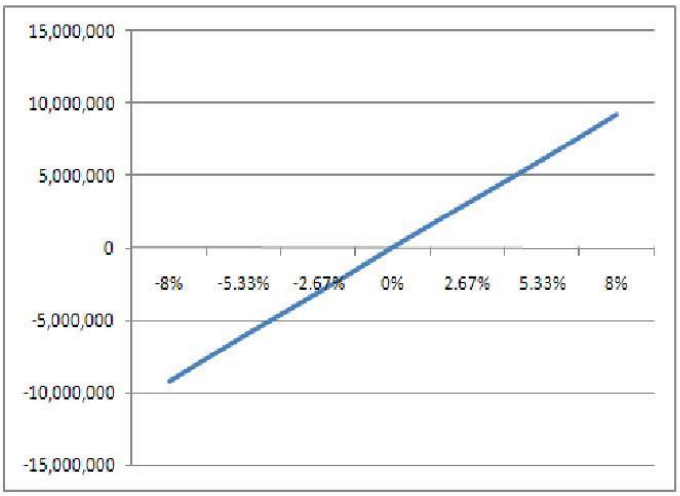
공시일: 2019-01-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	634	-634	장내
누계	주가지수	선물	73,508	0	73,508	장내
합계			73,508	0	73,508	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,891

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	43,936