펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-30

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	3,821	0	3,821	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	14,999	-14,997	장내
합계			3,823	14,999	-11,177	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	887

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	11,296

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

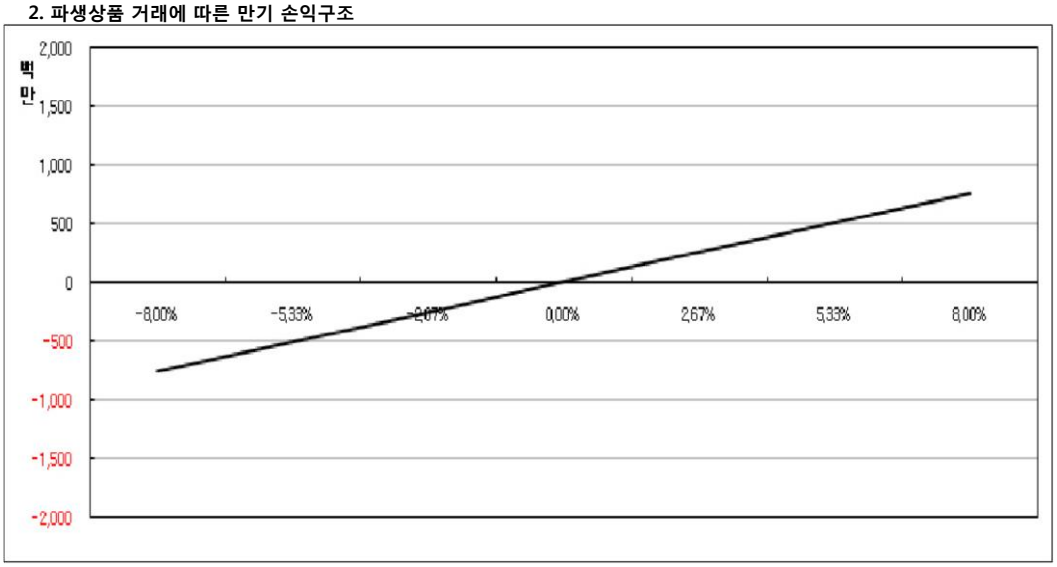
공시일: 2019-01-30

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	283	0	283	장내
합계			283	0	283	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,860

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

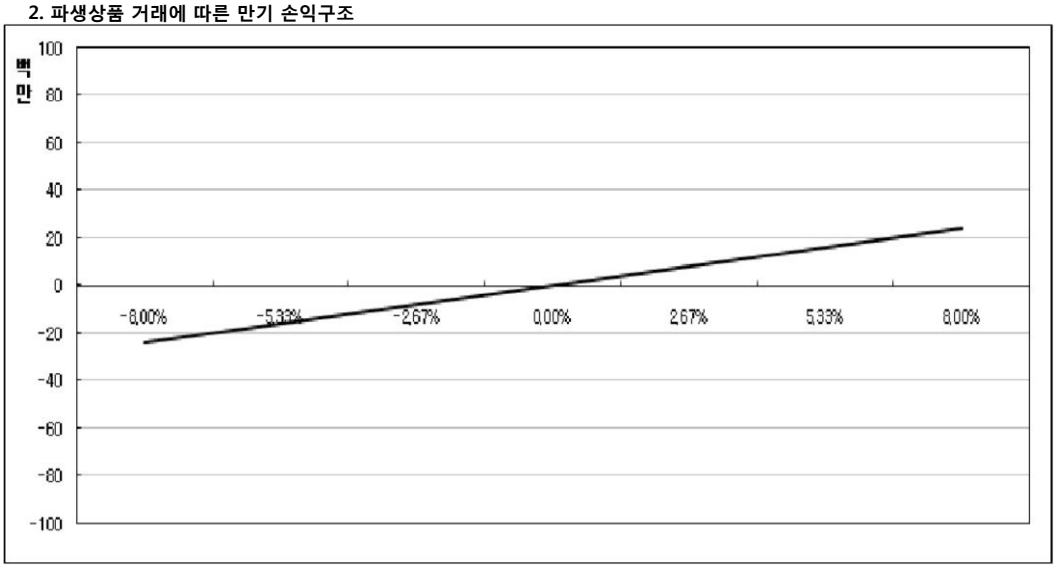
공시일: 2019-01-30

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	991	0	991	장내
합계			991	0	991	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	79

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,196

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

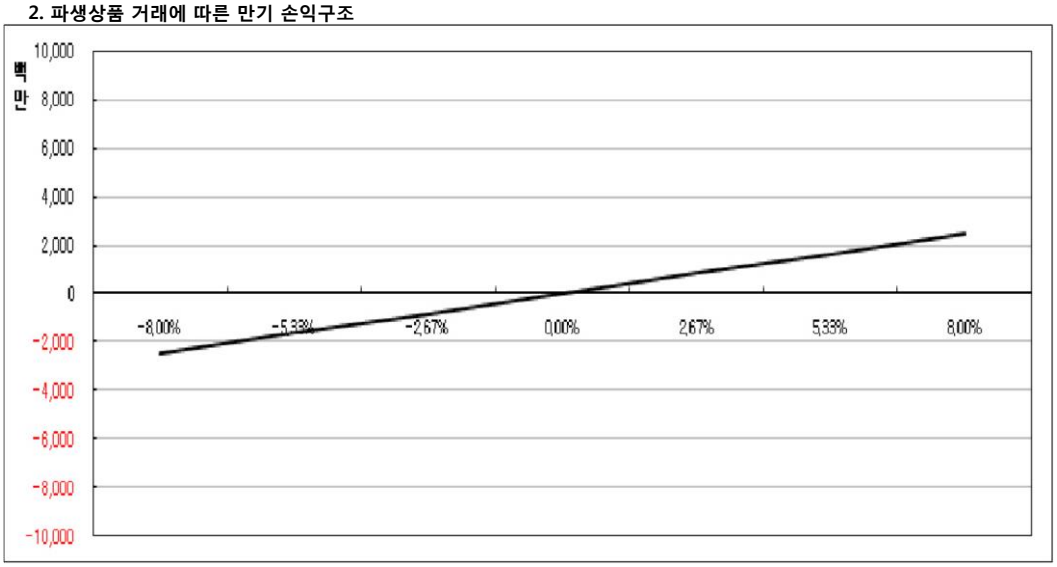
공시일: 2019-01-30

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	5,094	0	5,094	장내
합계			5,094	0	5,094	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	408

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,482

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

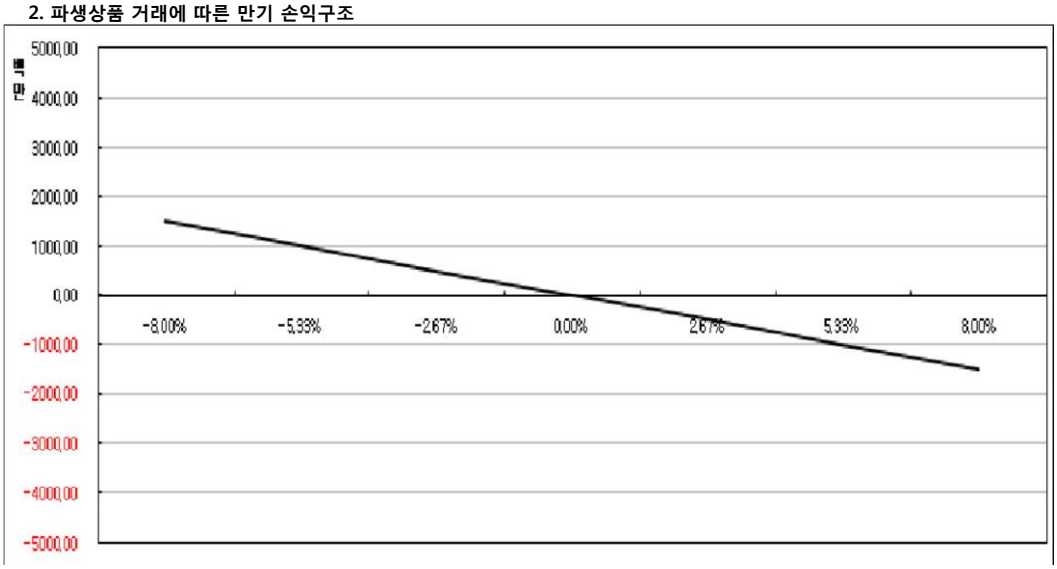
공시일: 2019-01-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	142	212	-71	장내
누계	주가지수	선물	0	2,901	-2,901	장내
합계			0	2,901	-2,901	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	233

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	206

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

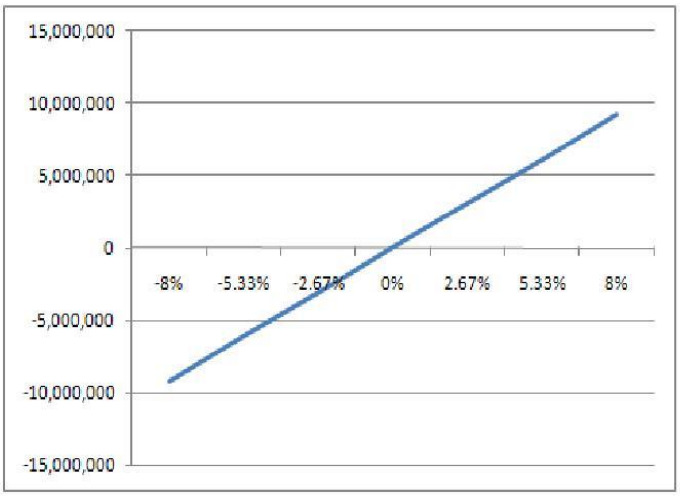
공시일: 2019-01-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	212	-212	장내
누계	주가지수	선물	73,651	0	73,651	장내
합계			73,651	0	73,651	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,904

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,459