펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-28

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	3,610	0	3,610	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	10	14,582	-14,572	장내
합계			3,619	14,582	-10,963	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

799

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,138

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

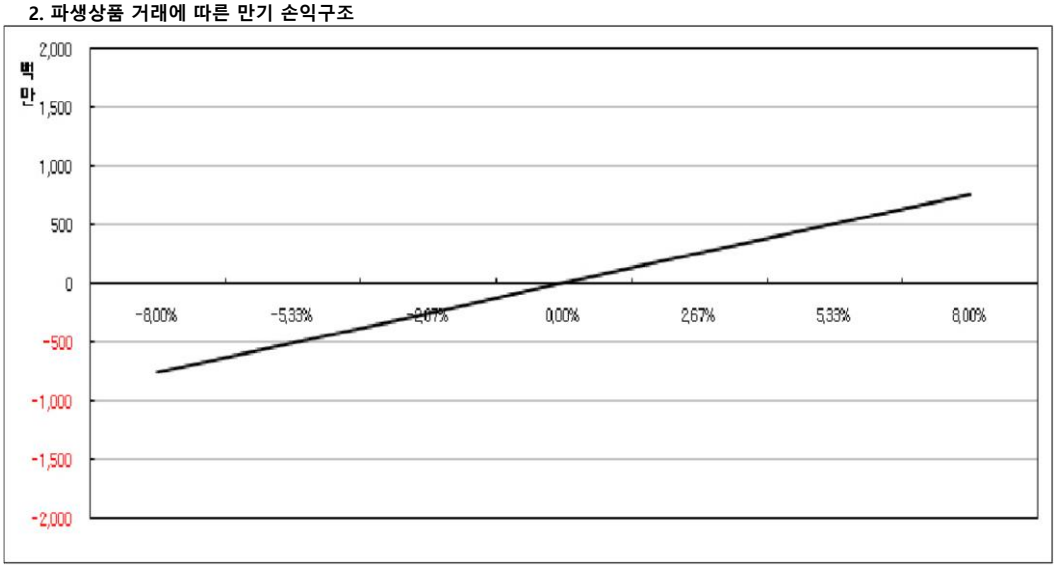
공시일: 2019-02-28

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	289	0	289	장내
합계			289	0	289	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,928

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

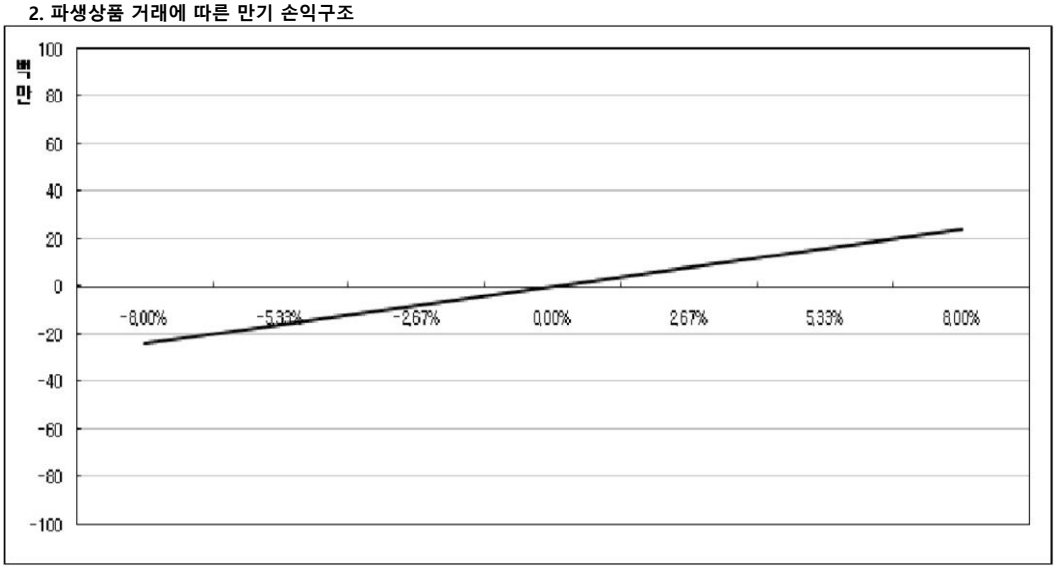
공시일: 2019-02-28

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	866	0	866	장내
합계			866	0	866	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,268

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

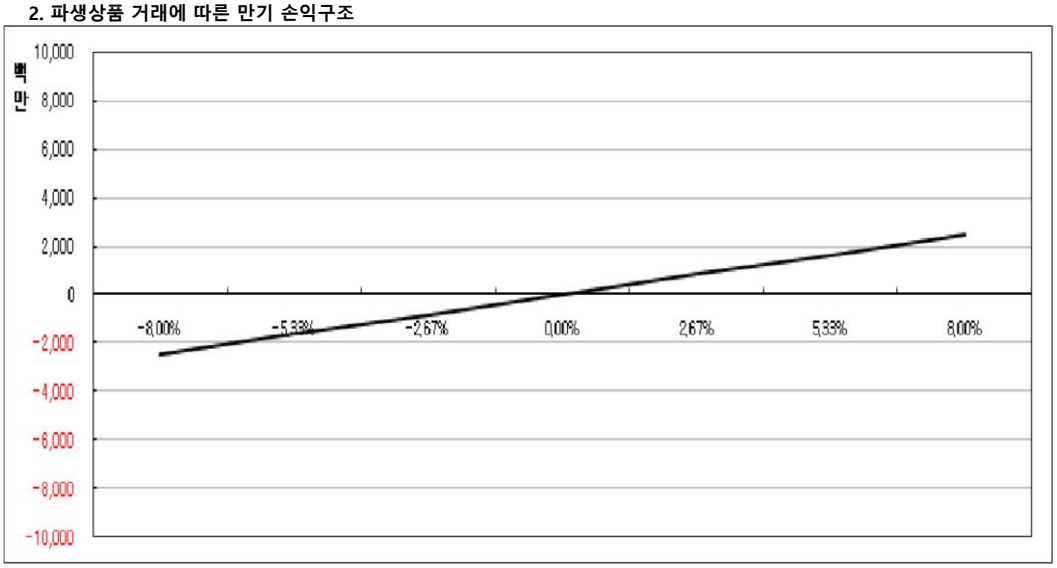
공시일: 2019-02-28

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	4,548	0	4,548	장내
합계			4,548	0	4,548	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

363

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,595

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

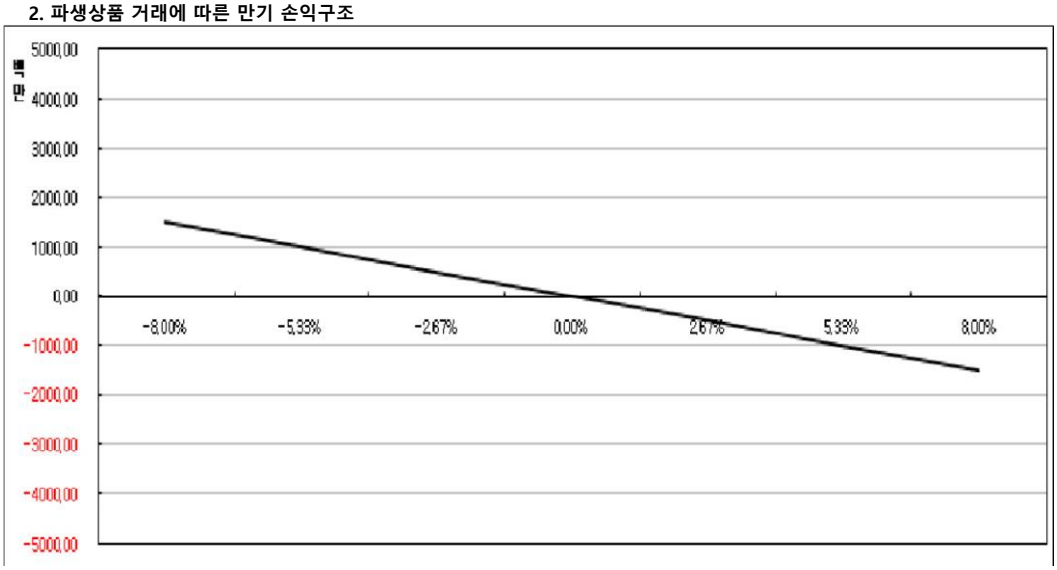
공시일: 2019-02-28

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	0	2,888	-2,888	장내
합계			0	2,888	-2,888	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 231

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 198

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

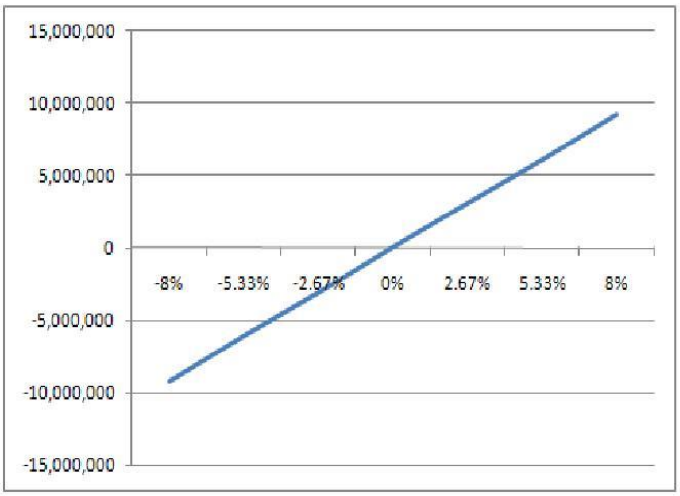
공시일: 2019-02-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	433	0	433	장내
누계	주가지수	선물	71,757	0	71,757	장내
합계			71,757	0	71,757	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,734

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 45,378