펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-07

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	3,498	0	3,498	장내
신규	주가지수	옵션	3	0	3	장내
누계	주가지수	옵션	21	7,136	-7,115	장내
합계			3,519	7,136	-3,617	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	167

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,862

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

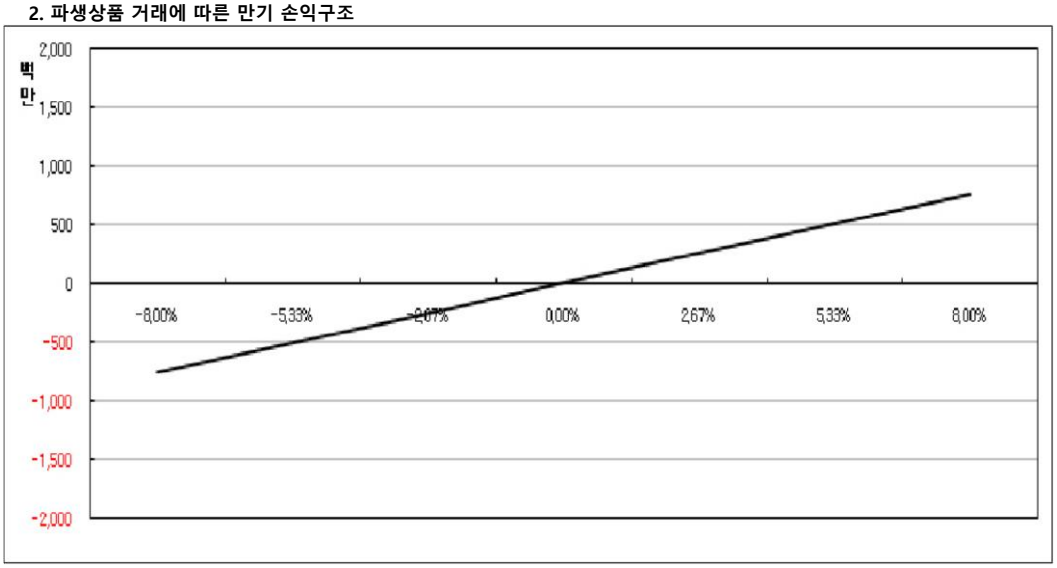
공시일: 2019-03-07

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	280	0	280	장내
합계			280	0	280	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,761

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

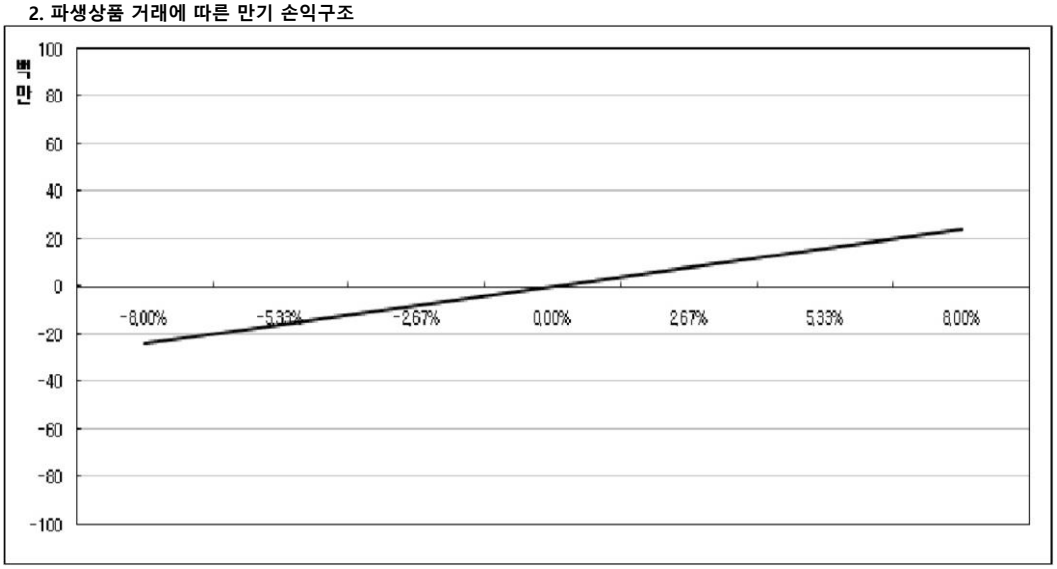
공시일: 2019-03-07

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	840	0	840	장내
합계			840	0	840	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,082

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

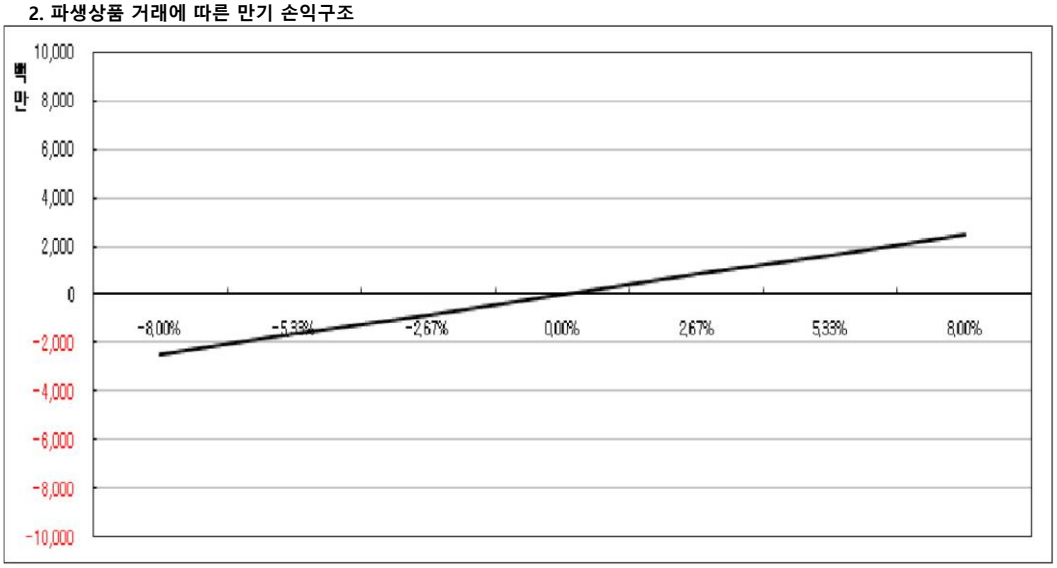
공시일: 2019-03-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	210	0	210	장내
누계	주가지수	선물	4,618	0	4,618	장내
합계			4,618	0	4,618	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 370

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,287

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

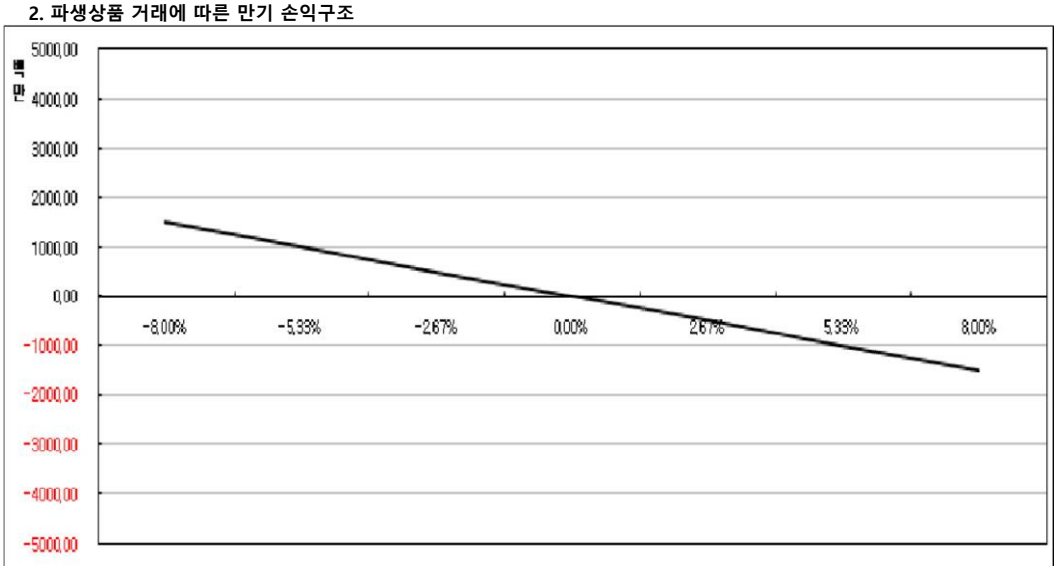
공시일: 2019-03-07

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	3,078	-3,078	장내
합계			0	3,078	-3,078	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

247

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

209

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

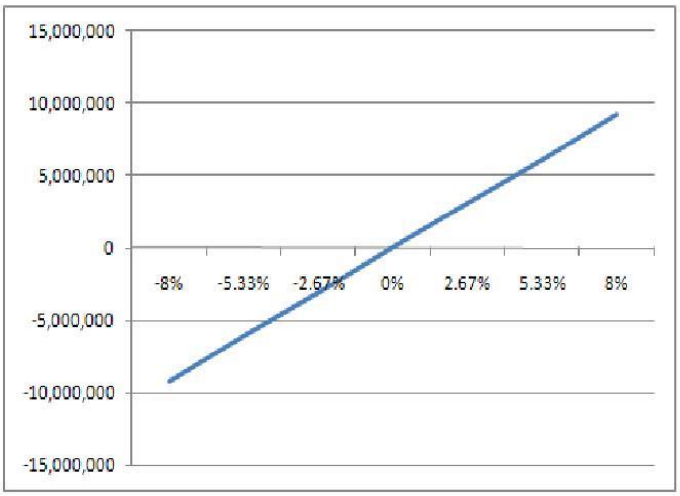
공시일: 2019-03-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	350	0	350	장내
누계	주가지수	선물	68,143	0	68,143	장내
합계			68,143	0	68,143	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,464

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 42,844