펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-08

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	3,486	0	3,486	장내
신규	주가지수	옵션	4	0	4	장내
누계	주가지수	옵션	28	3,486	-3,458	장내
합계			3,514	3,486	28	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,924

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

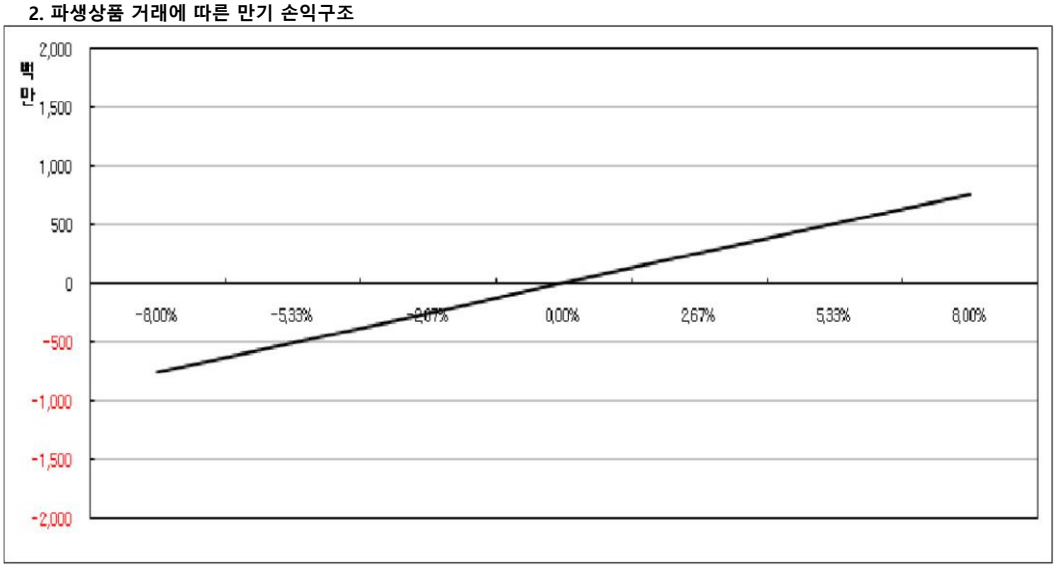
공시일: 2019-03-08

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	279	0	279	장내
합계			279	0	279	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,785

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

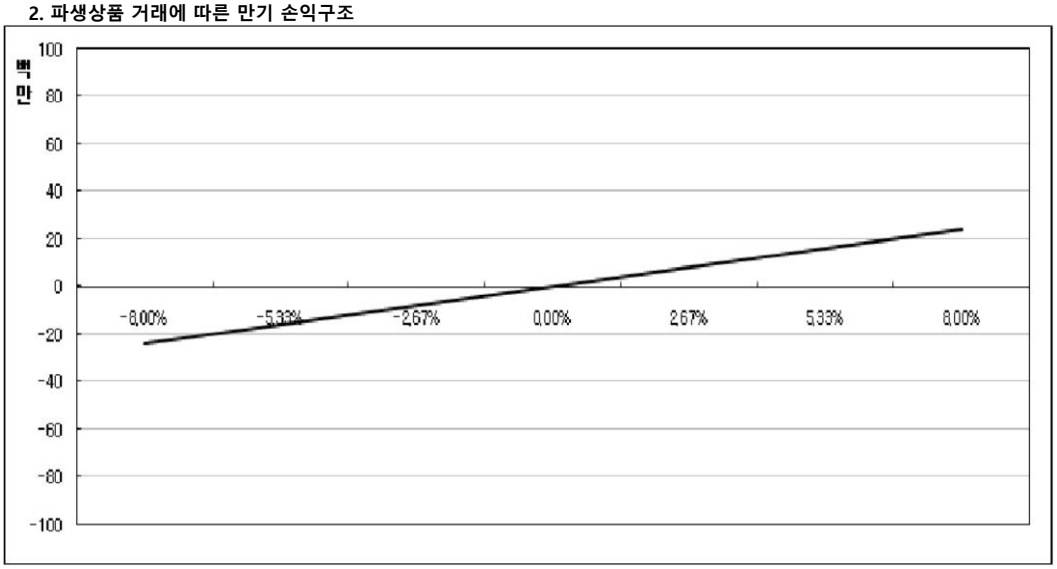
공시일: 2019-03-08

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	837	0	837	장내
합계			837	0	837	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,108

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

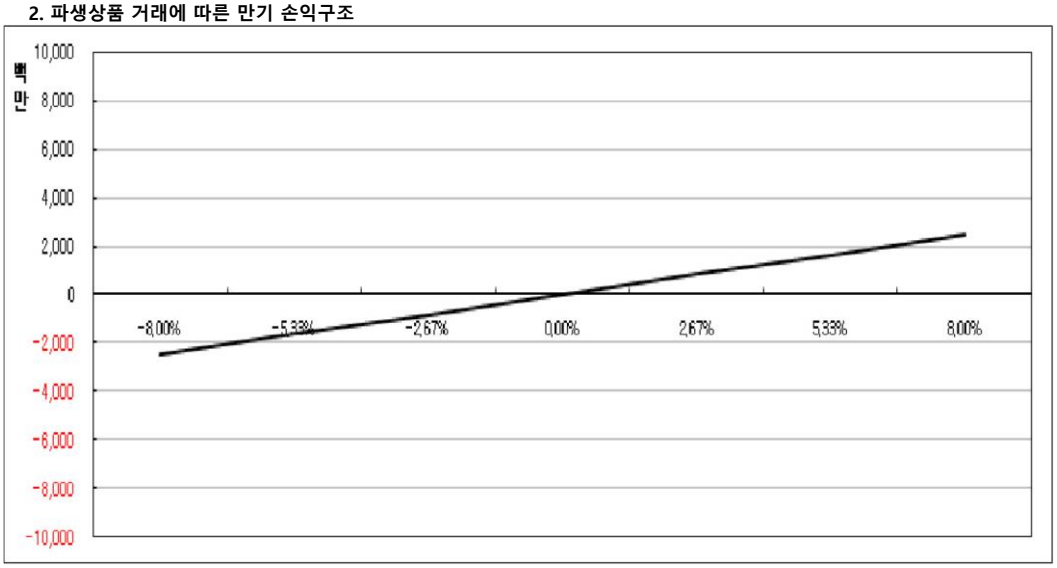
공시일: 2019-03-08

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	4,601	0	4,601	장내
합계			4,601	0	4,601	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 368

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,329

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

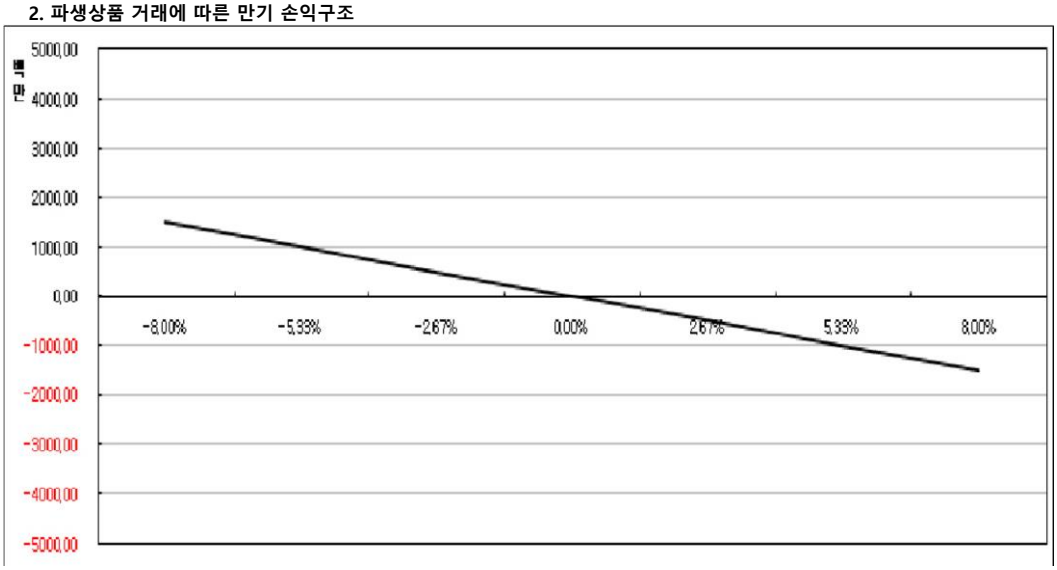
공시일: 2019-03-08

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	3,068	-3,068	장내
합계			0	3,068	-3,068	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 245

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 208

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

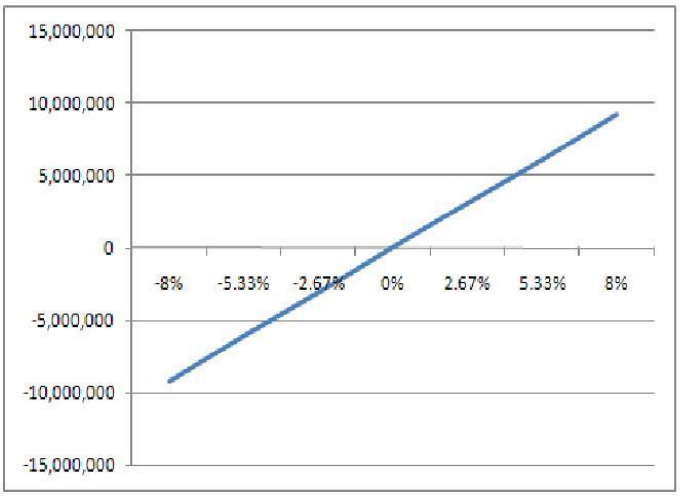
공시일: 2019-03-08

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	67,905	0	67,905	장내
합계			67,905	0	67,905	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,433

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	43,165