펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-15

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	3,458	0	3,458	장내
신규	주가지수	옵션	20	22,016	-21,996	장내
누계	주가지수	옵션	20	13,717	-13,697	장내
합계			3,478	13,717	-10,239	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	676

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	4,561

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

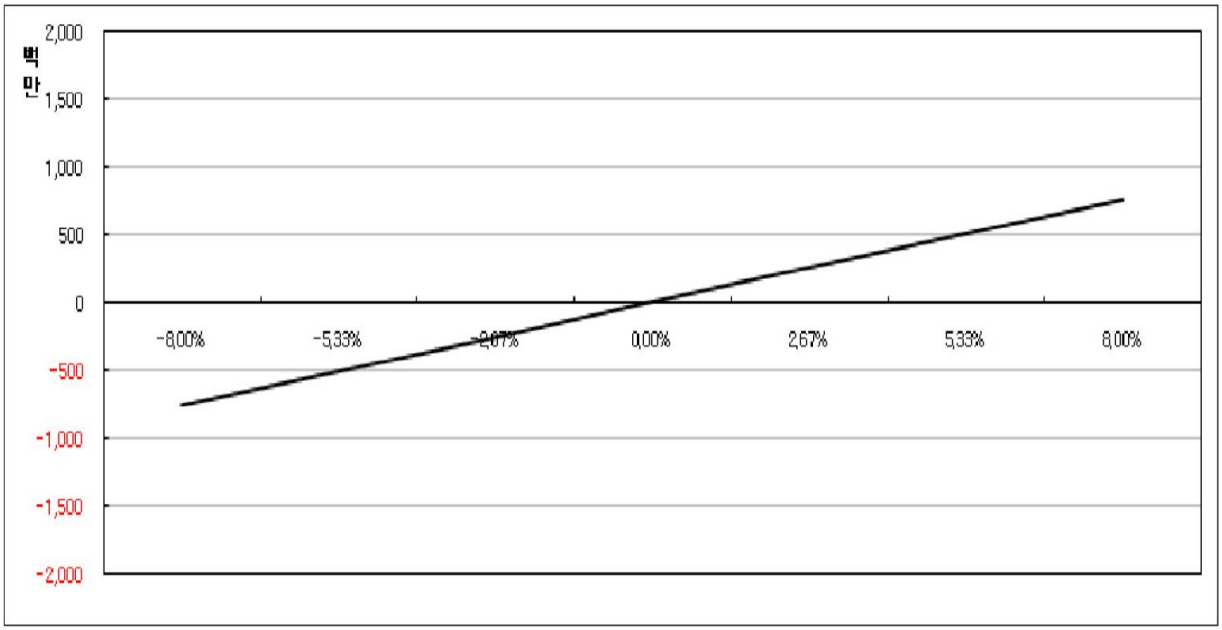
공시일: 2019-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	277	277	0	장내
누계	주가지수	선물	277	0	277	장내
합계			277	0	277	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,745

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

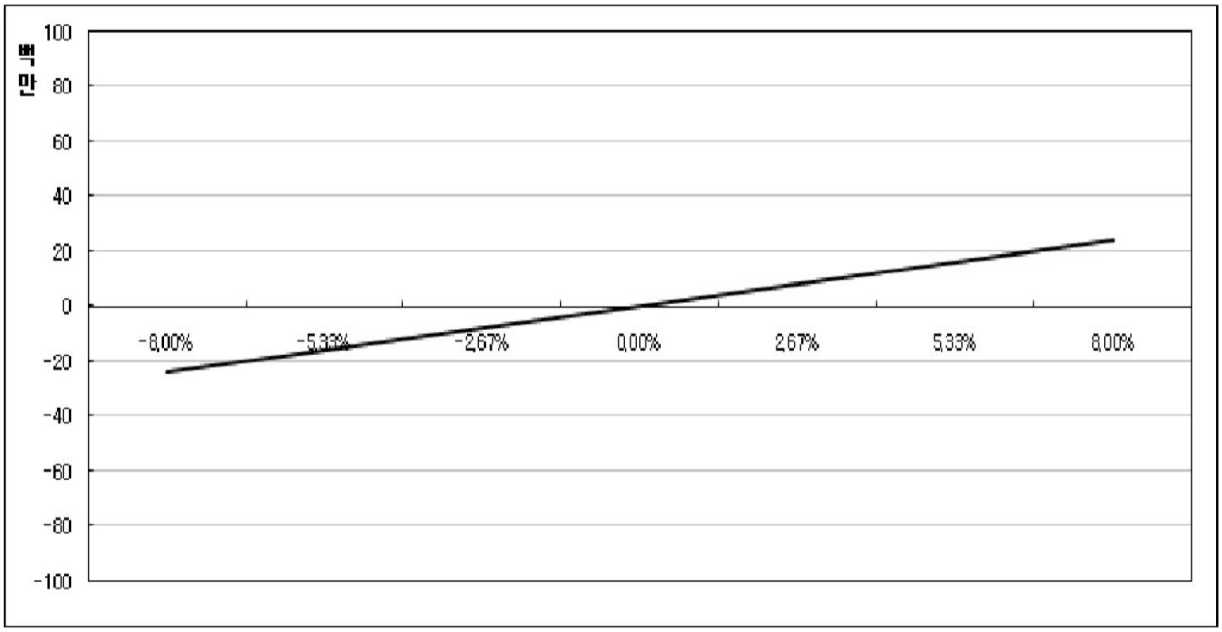
공시일: 2019-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	830	830	0	장내
누계	주가지수	선물	830	0	830	장내
합계			830	0	830	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,063

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

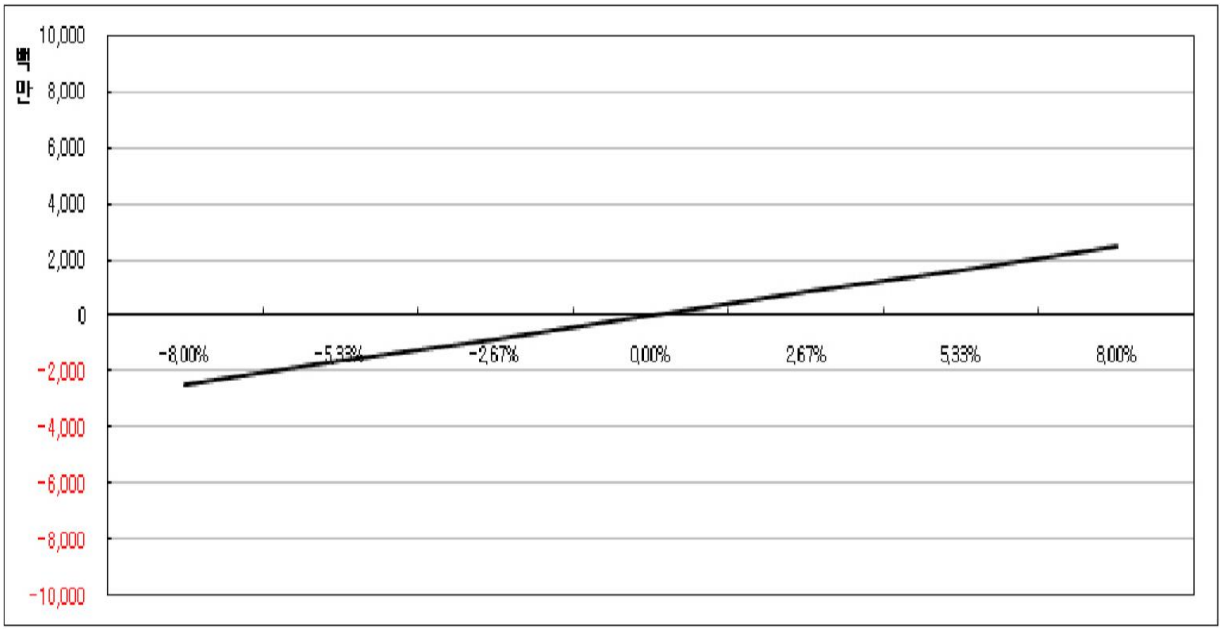
공시일: 2019-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,351	2,351	0	장내
누계	주가지수	선물	4,703	0	4,703	장내
합계			4,703	0	4,703	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

378

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,258

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

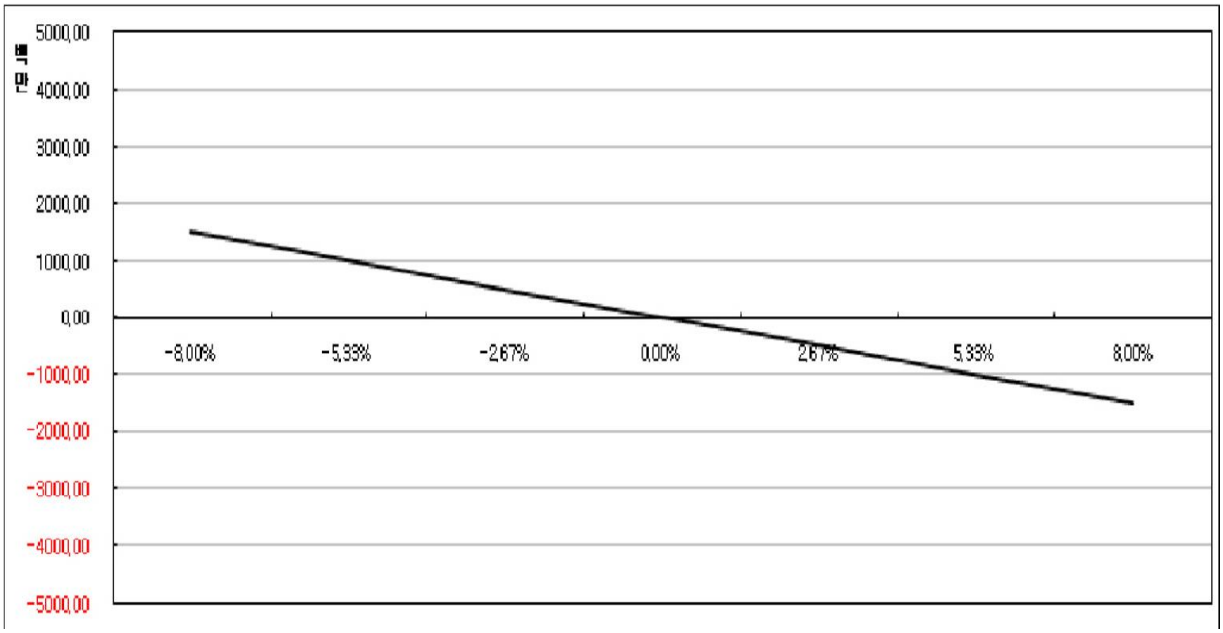
공시일: 2019-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,798	1,867	-69	장내
누계	주가지수	선물	0	2,766	-2,766	장내
합계			0	2,766	-2,766	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

222

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

188

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

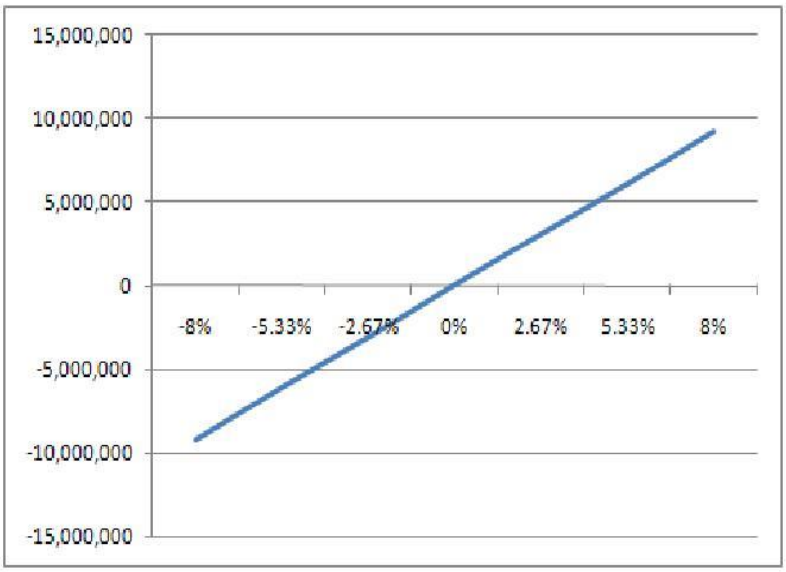
공시일: 2019-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	26,212	26,004	207	장내
누계	주가지수	선물	68,883	0	68,883	장내
합계			68,883	0	68,883	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,532

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

42,618