펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-21

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	3,499	0	3,499	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	12	13,856	-13,844	장내
합계			3,511	13,856	-10,345	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	728

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,063

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

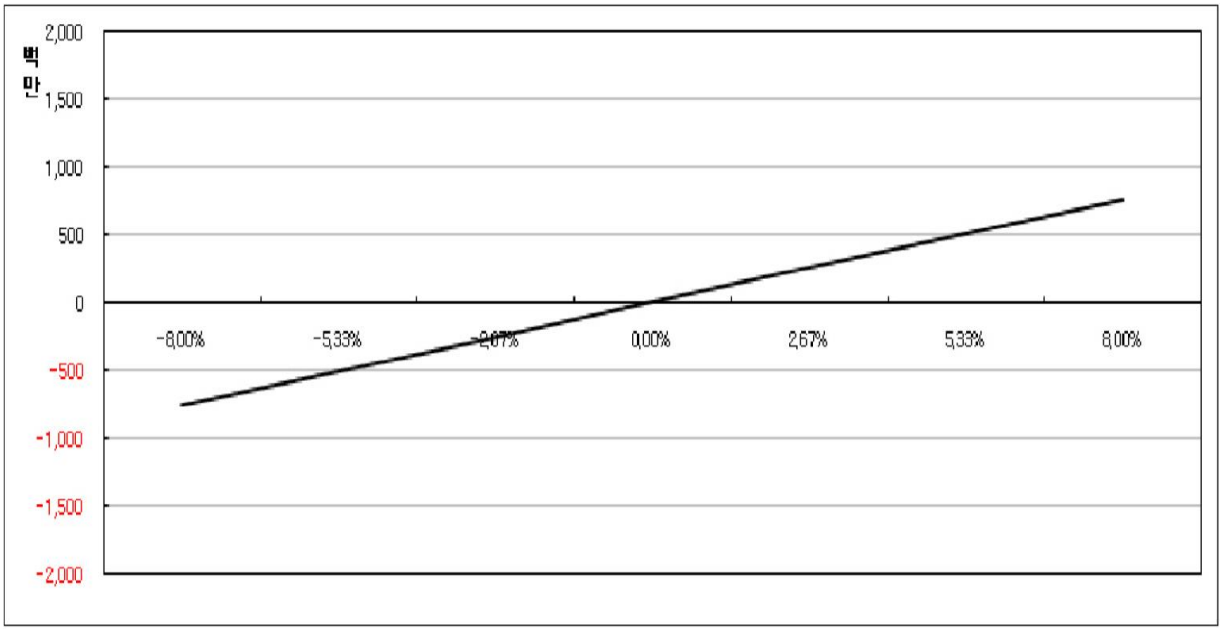
공시일: 2019-03-21

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)

2,760

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

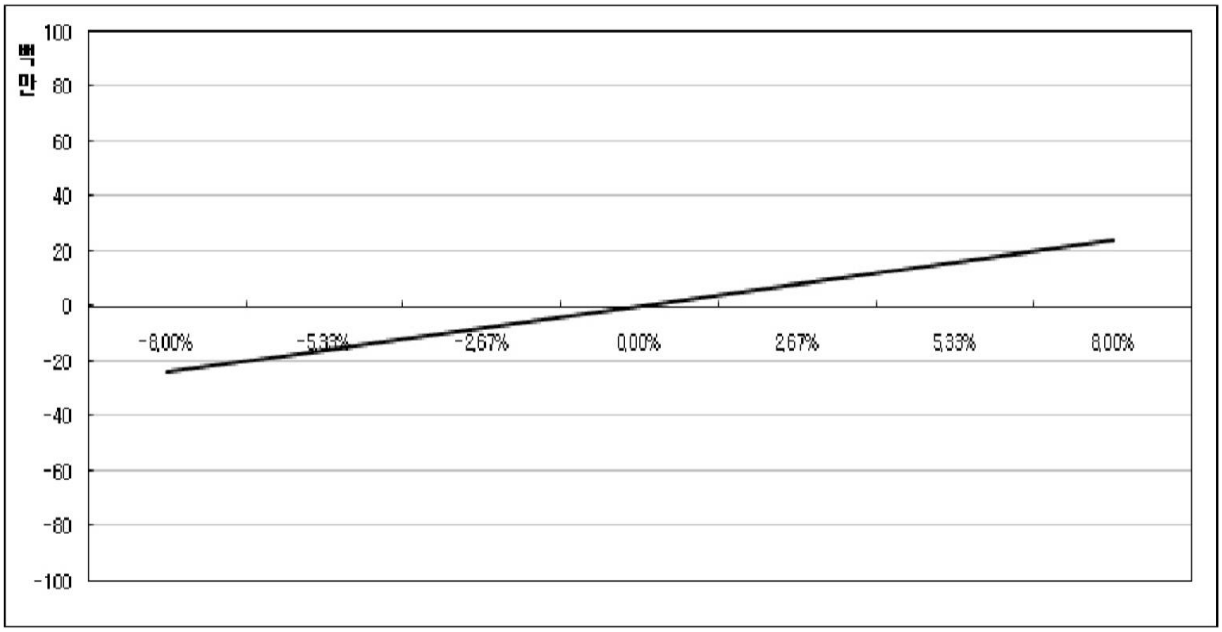
공시일: 2019-03-21

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) 3,080

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

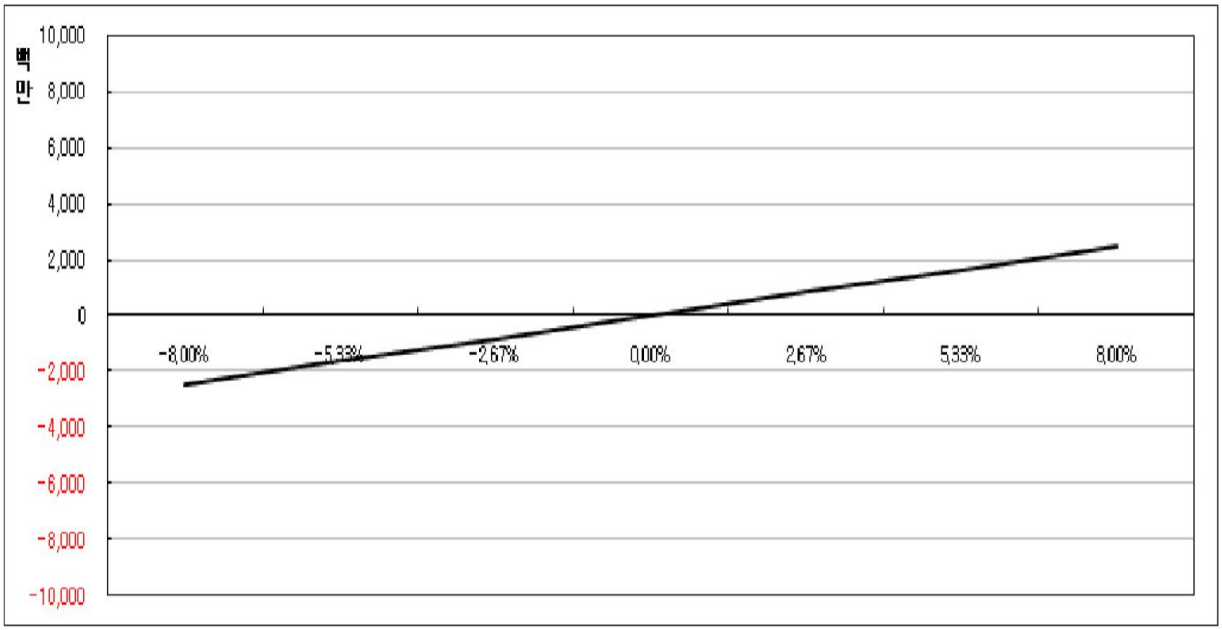
공시일: 2019-03-21

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	4,619	0	4,619	장내
합계			4,619	0	4,619	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

371

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,284

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

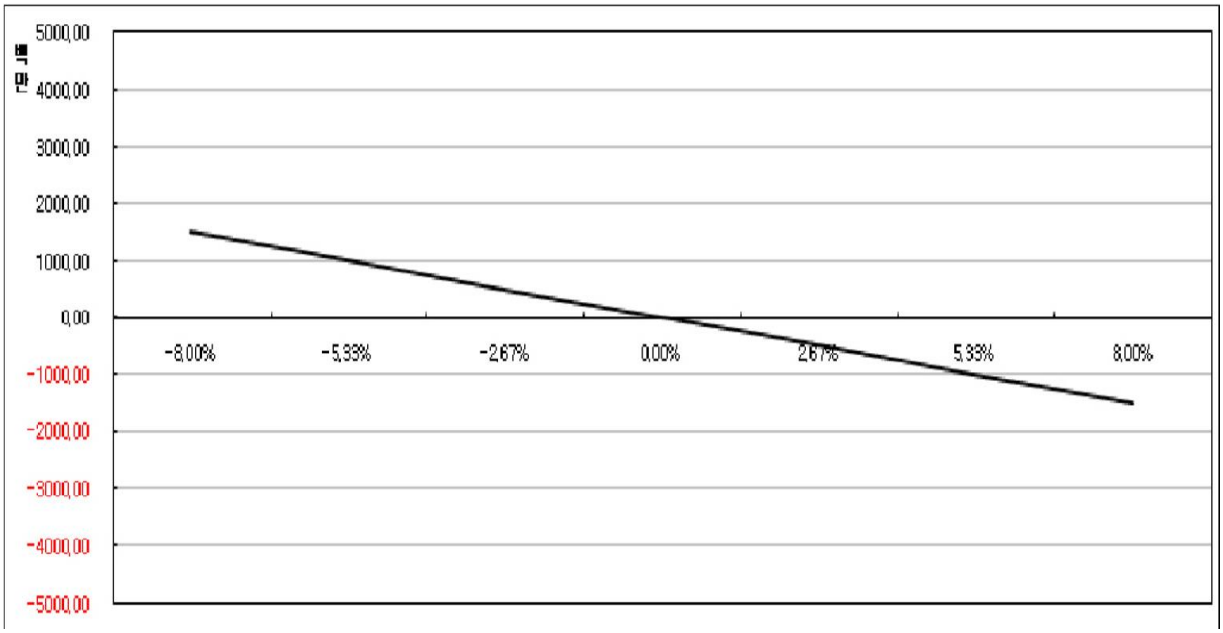
공시일: 2019-03-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	210	-210	장내
누계	주가지수	선물	0	3,009	-3,009	장내
합계			0	3,009	-3,009	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

242

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

205

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

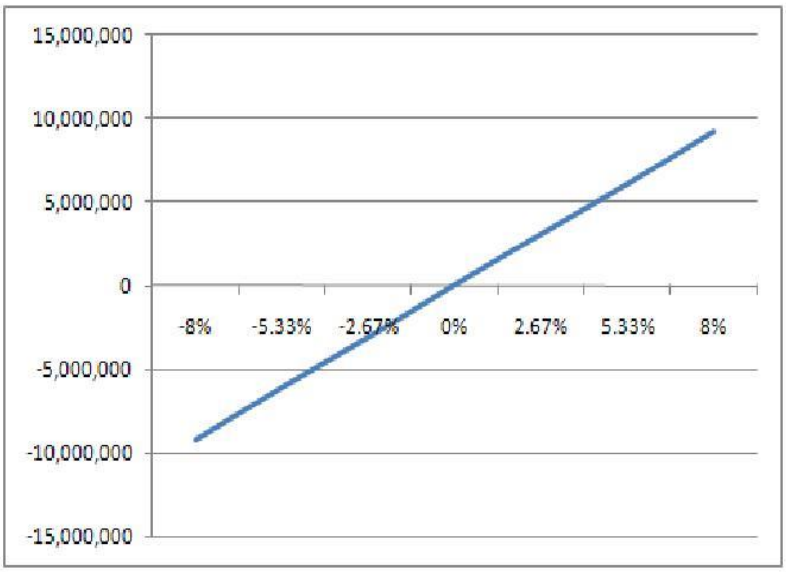
공시일: 2019-03-21

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	70,470	0	70,470	장내
합계			70,470	0	70,470	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,657

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

42,878