펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-25

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	3,539	0	3,539	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	14,015	-14,010	장내
합계			3,544	14,015	-10,471	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	811

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,774

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

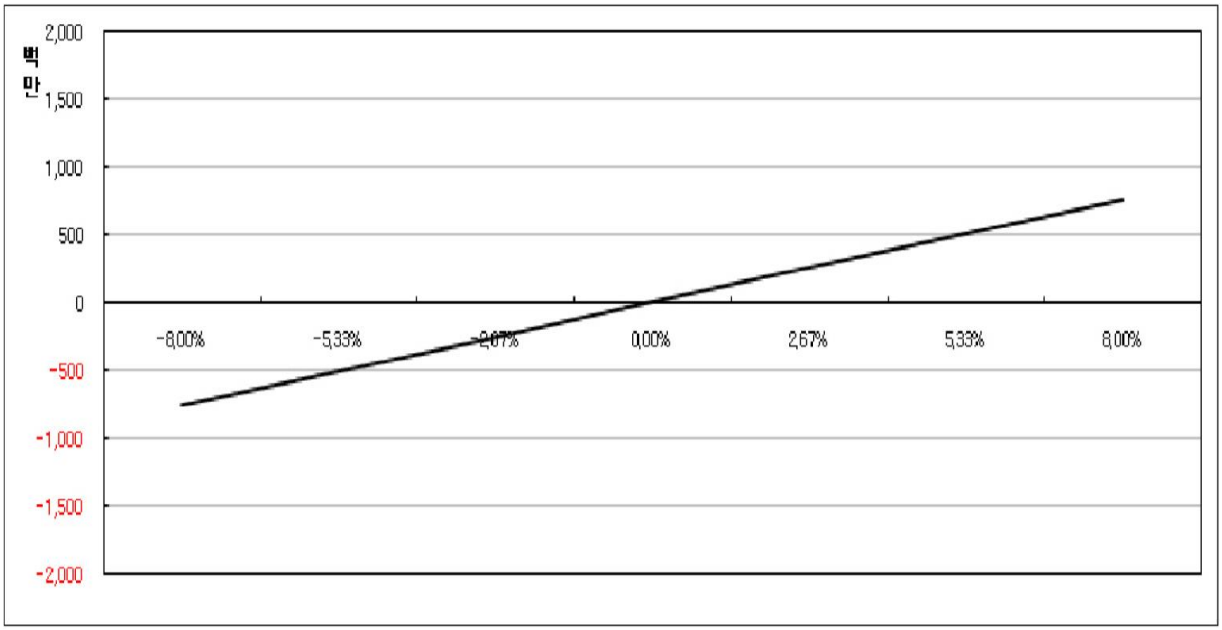
공시일: 2019-03-25

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	283	0	283	장내
합계			283	0	283	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,895

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

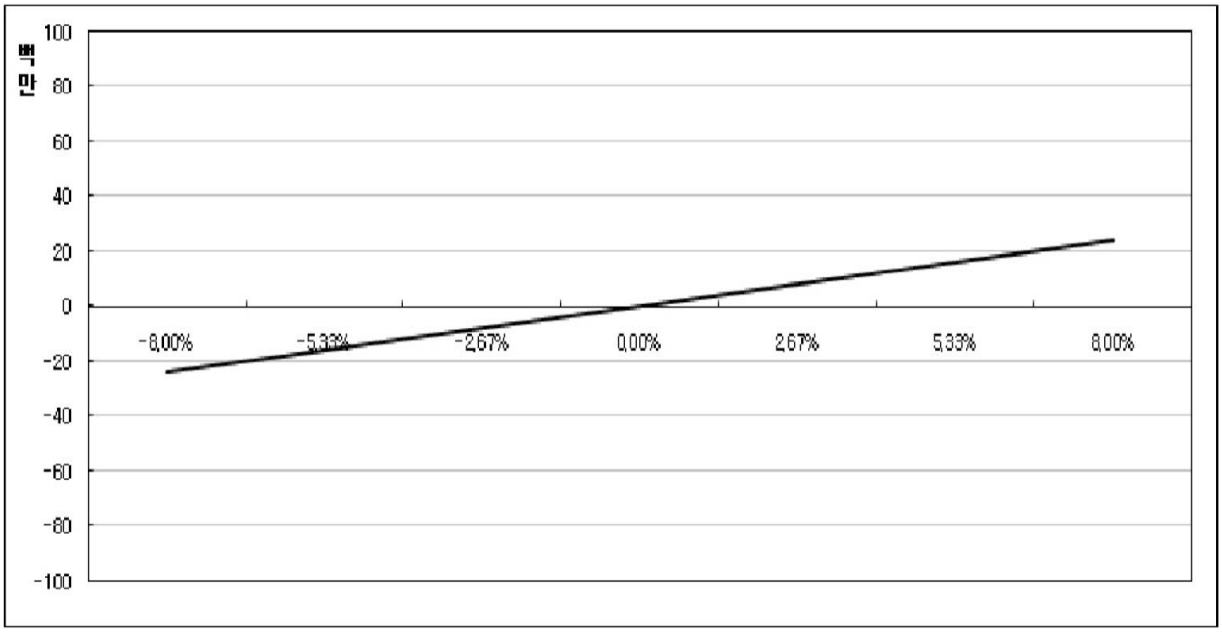
공시일: 2019-03-25

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	849	0	849	장내
합계			849	0	849	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,229

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

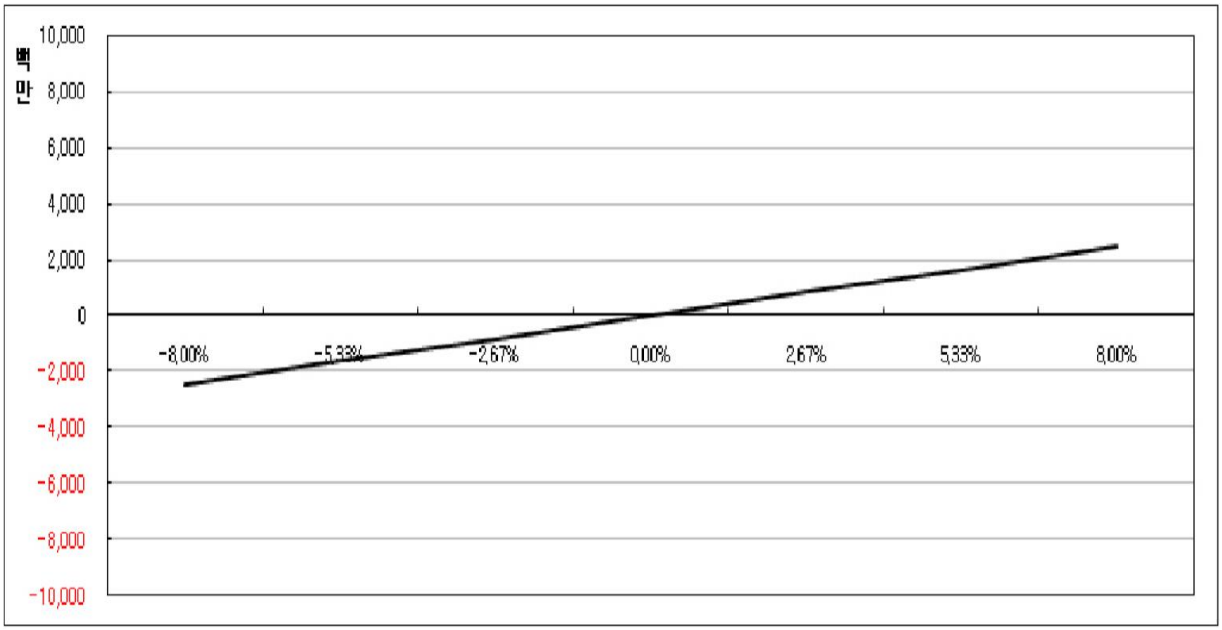
공시일: 2019-03-25

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	4,530	0	4,530	장내
합계			4,530	0	4,530	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

363

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,527

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

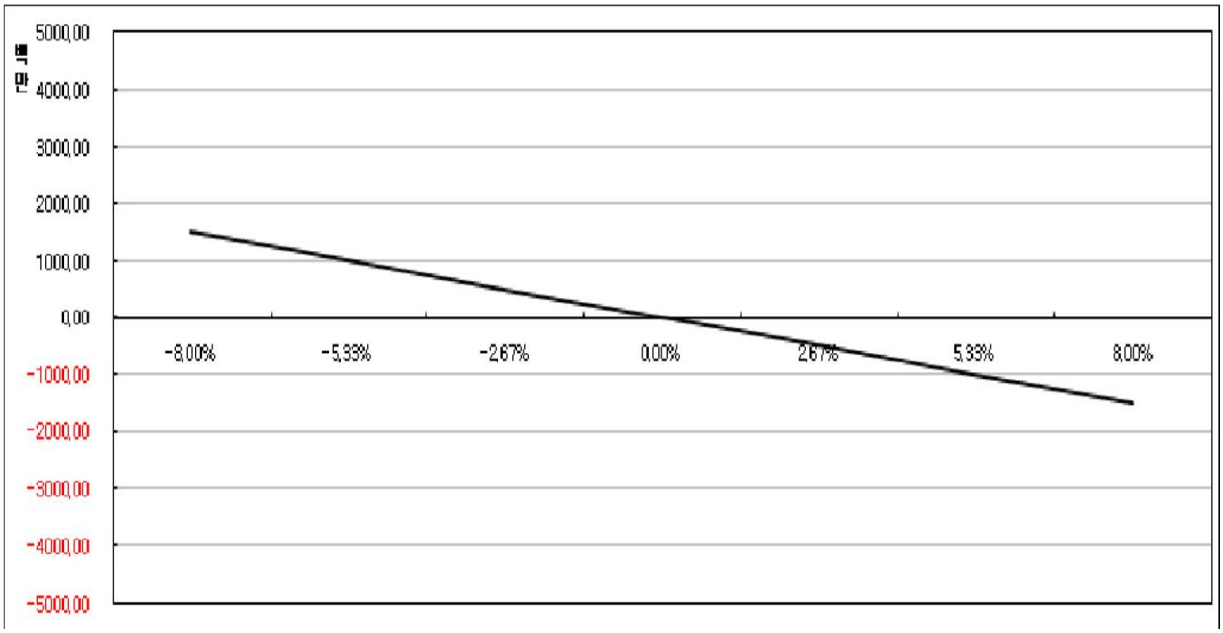
공시일: 2019-03-25

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	2,902	-2,902	장내
합계			0	2,902	-2,902	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 232

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 192

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

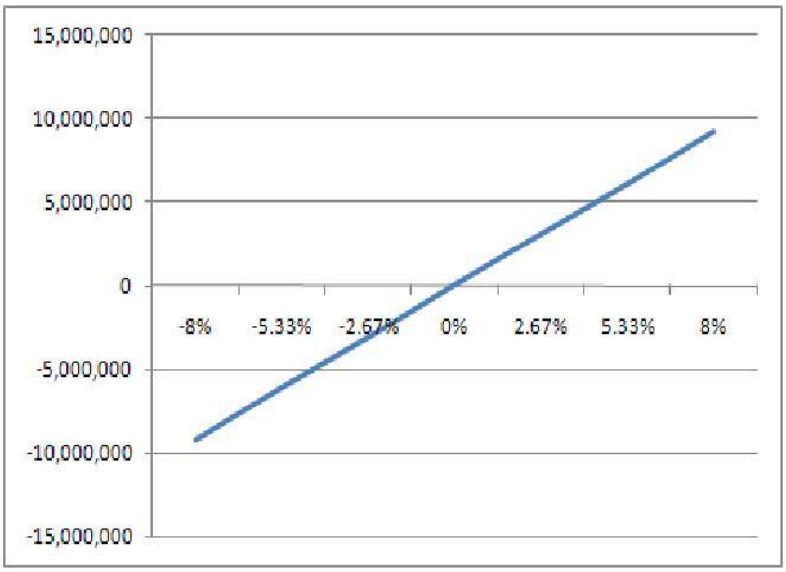
공시일: 2019-03-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	354	-354	장내
누계	주가지수	선물	70,216	0	70,216	장내
합계			70,216	0	70,216	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,622

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,743