펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-27

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	3,470	0	3,470	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	7	6,871	-6,864	장내
합계			3,477	6,871	-3,394	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	216

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,938

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

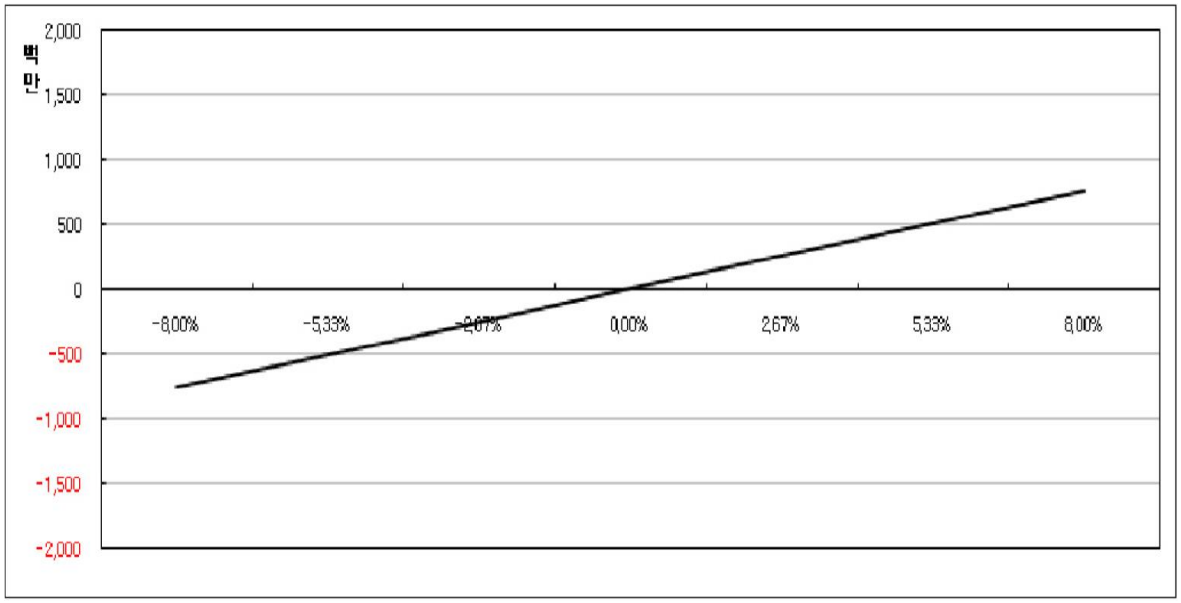
공시일: 2019-03-27

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	278	0	278	장내
합계			278	0	278	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,822

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

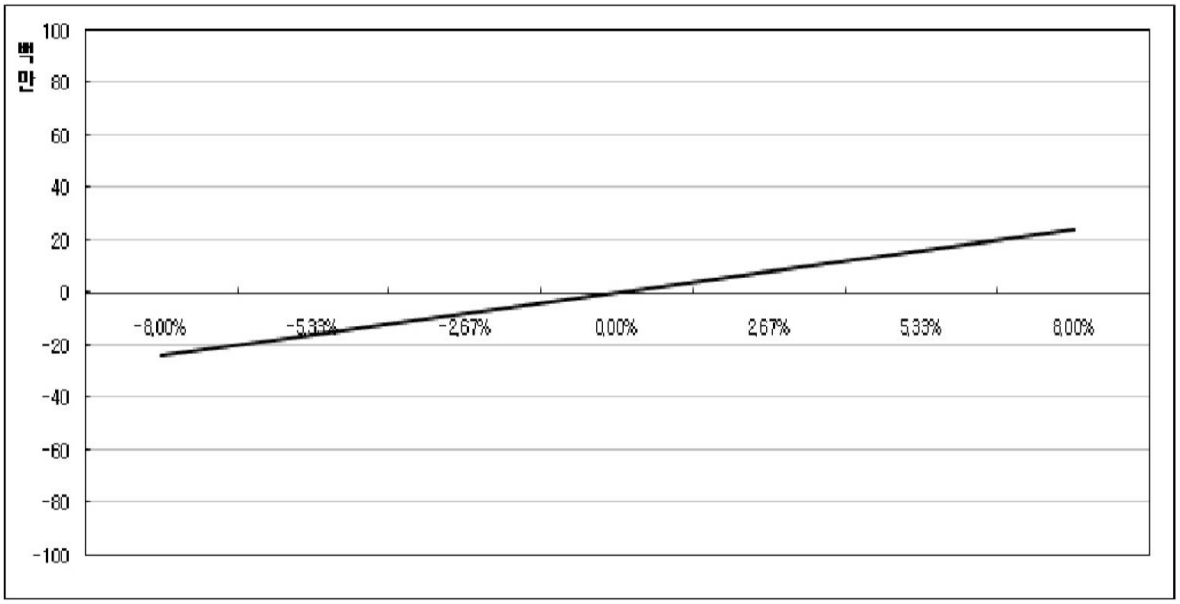
공시일: 2019-03-27

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	833	0	833	장내
합계			833	0	833	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,149

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

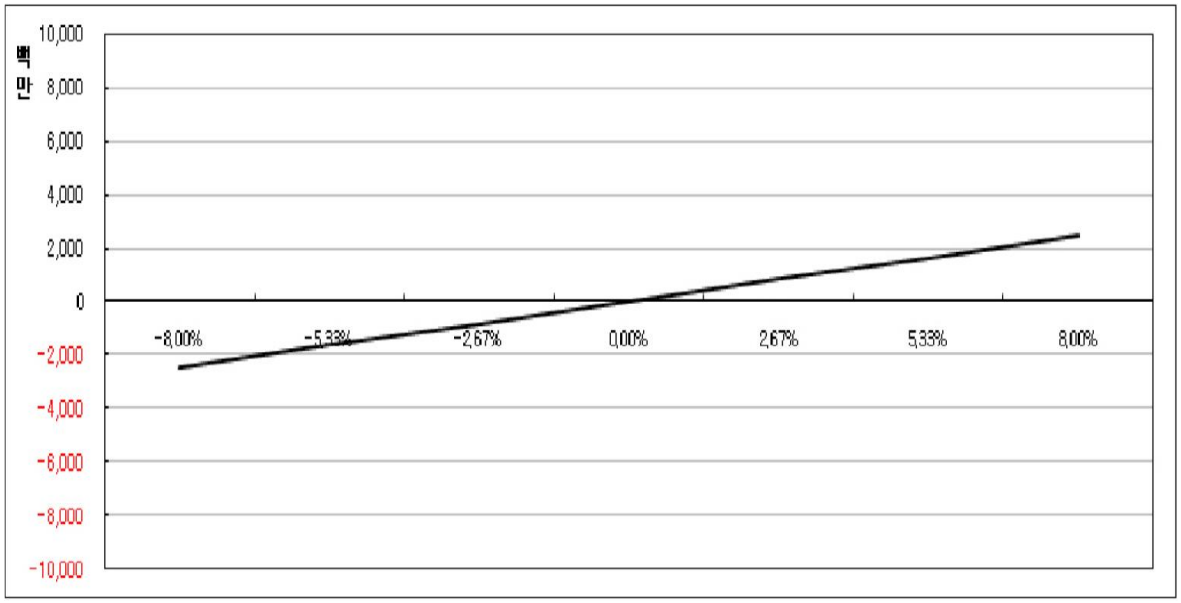
공시일: 2019-03-27

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	4,442	0	4,442	장내
합계			4,442	0	4,442	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

356

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,392

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

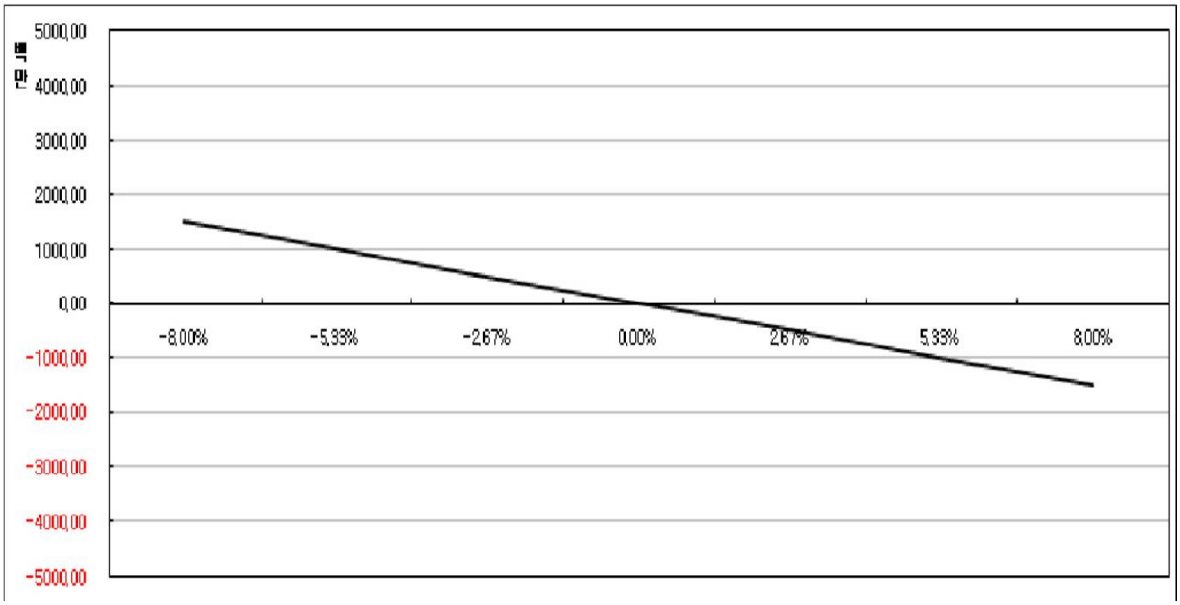
공시일: 2019-03-27

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	3,123	-3,123	장내
합계			0	3,123	-3,123	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	250

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	208

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

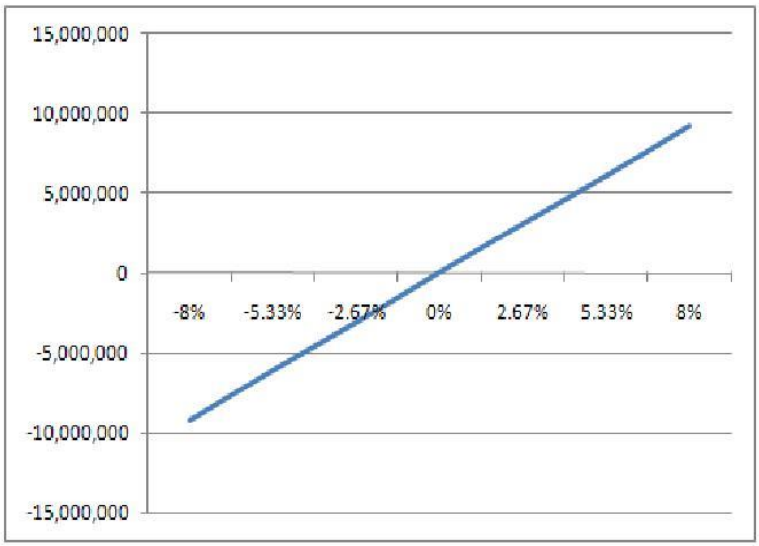
공시일: 2019-03-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	833	0	833	장내
누계	주가지수	선물	68,637	0	68,637	장내
합계			68,637	0	68,637	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,499

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,657