펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-29

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	3,439	0	3,439	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	8	6,808	-6,800	장내
합계			3,446	6,808	-3,362	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	188

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,877

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

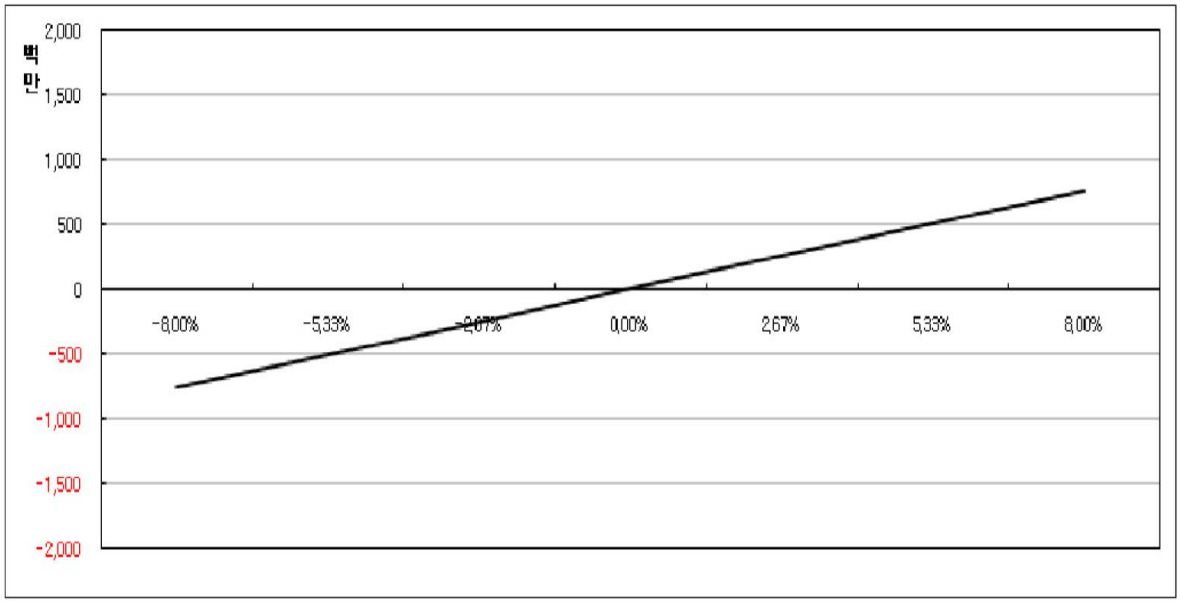
공시일: 2019-03-29

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	275	0	275	장내
합계			275	0	275	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,795

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

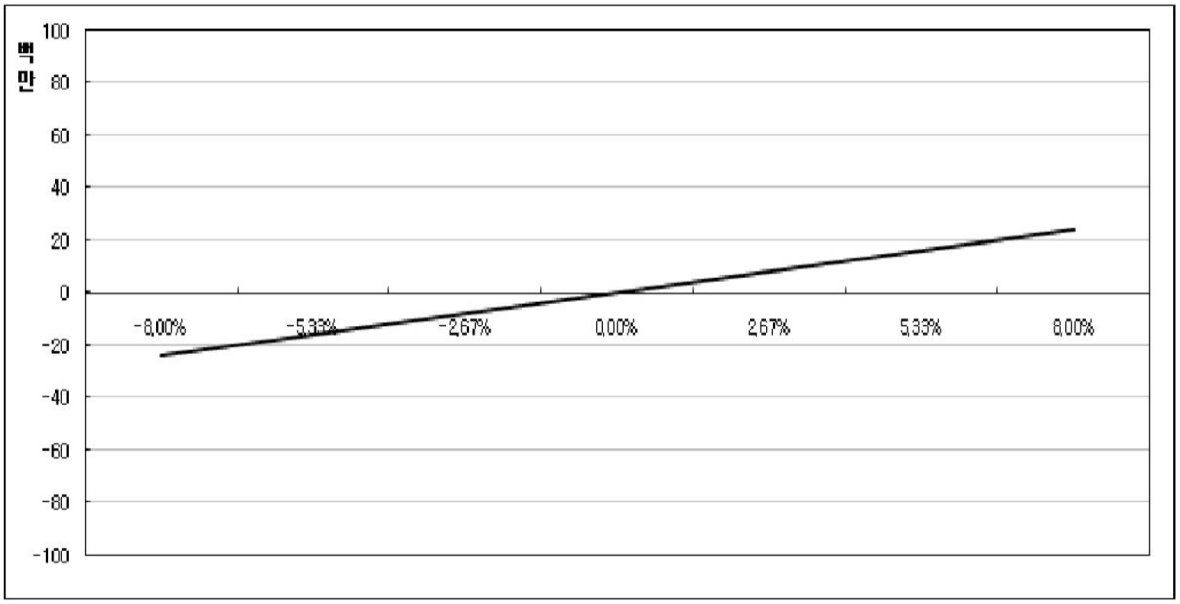
공시일: 2019-03-29

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	825	0	825	장내
합계			825	0	825	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,118

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

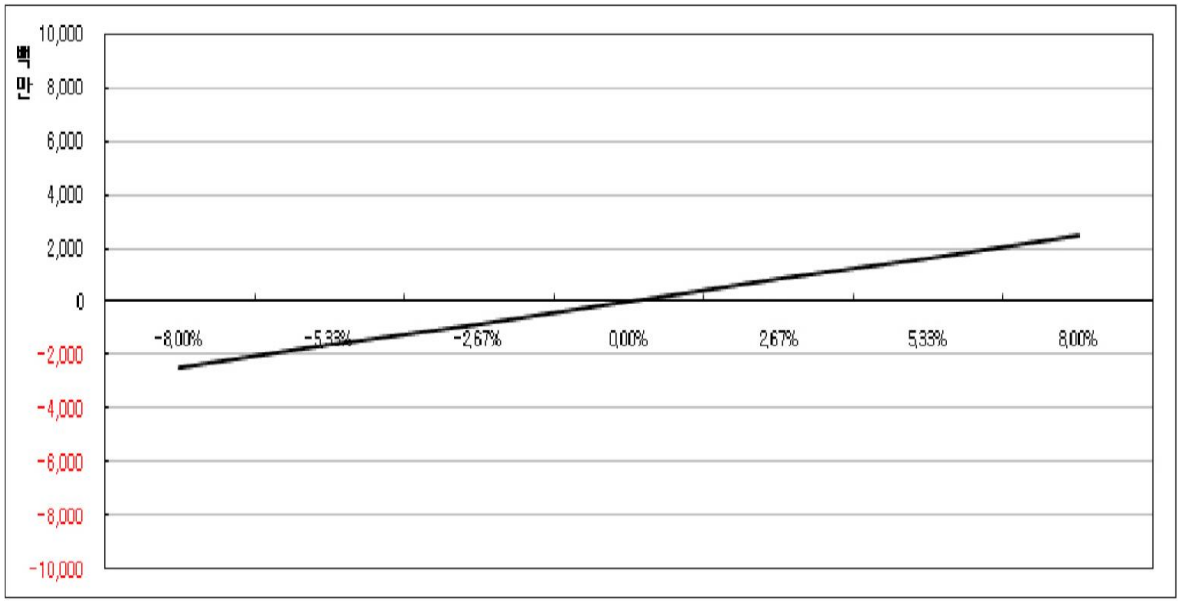
공시일: 2019-03-29

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	4,401	0	4,401	장내
합계			4,401	0	4,401	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

354

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,338

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

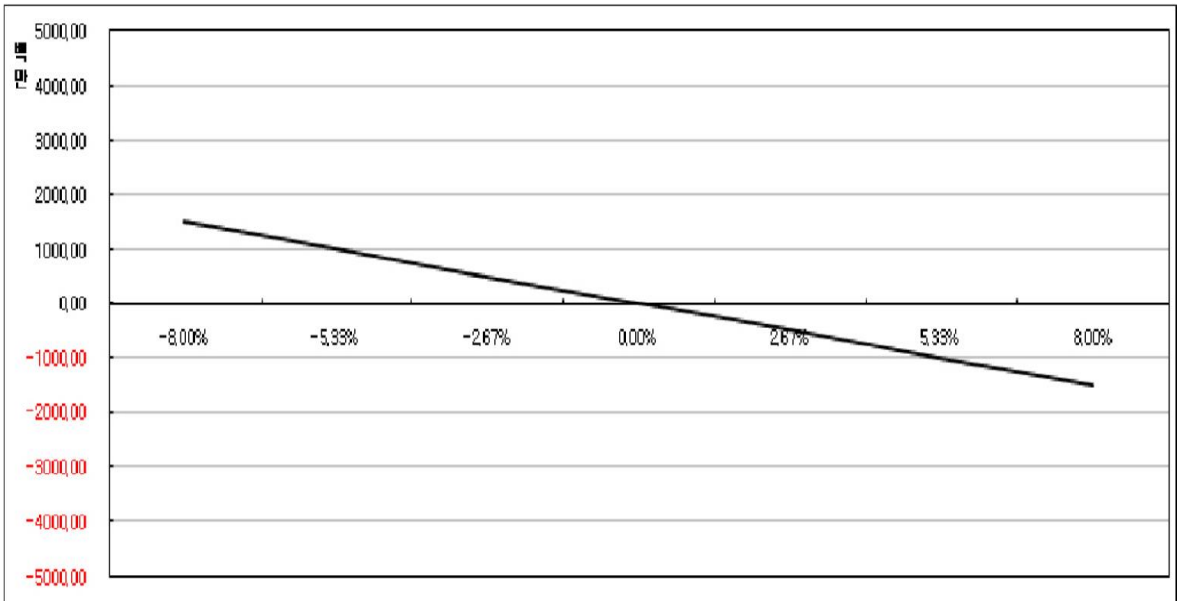
공시일: 2019-03-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	206	0	206	장내
누계	주가지수	선물	0	2,751	-2,751	장내
합계			0	2,751	-2,751	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

221

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

184

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

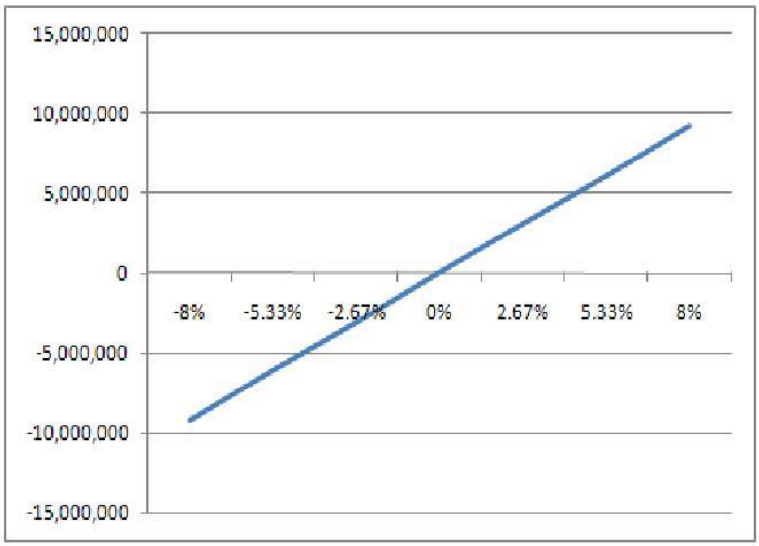
공시일: 2019-03-29

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	68,220	0	68,220	장내
합계			68,220	0	68,220	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,484

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,212