펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-09

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	3,580	0	3,580	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	14,176	-14,176	장내
합계			3,580	14,176	-10,596	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

847

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,247

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

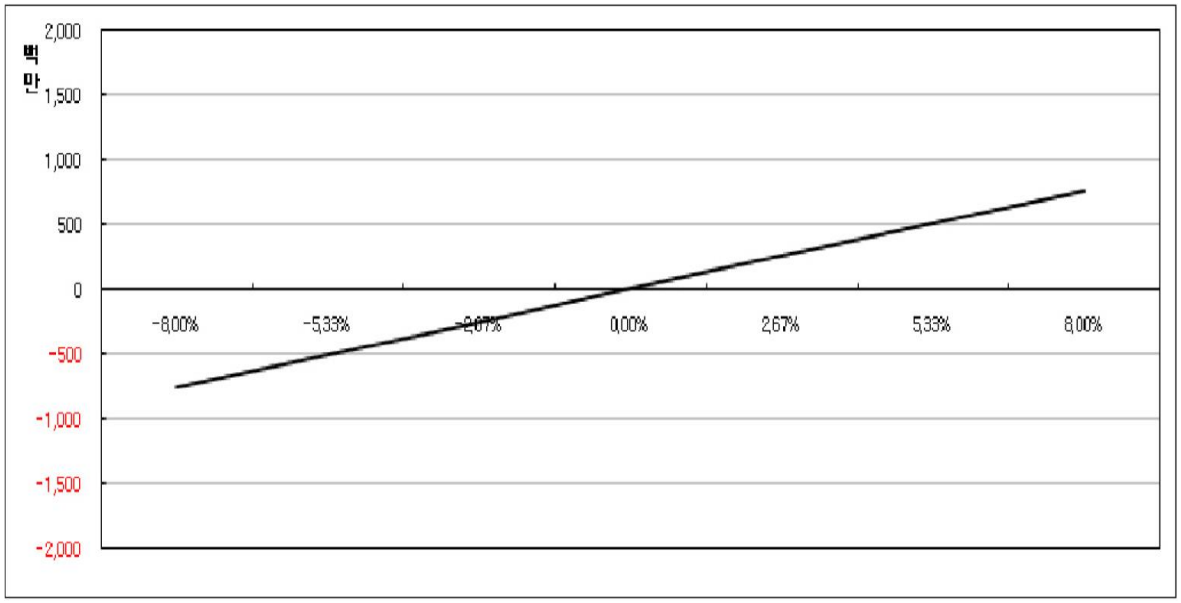
공시일: 2019-04-09

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	286	0	286	장내
합계			286	0	286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,905

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

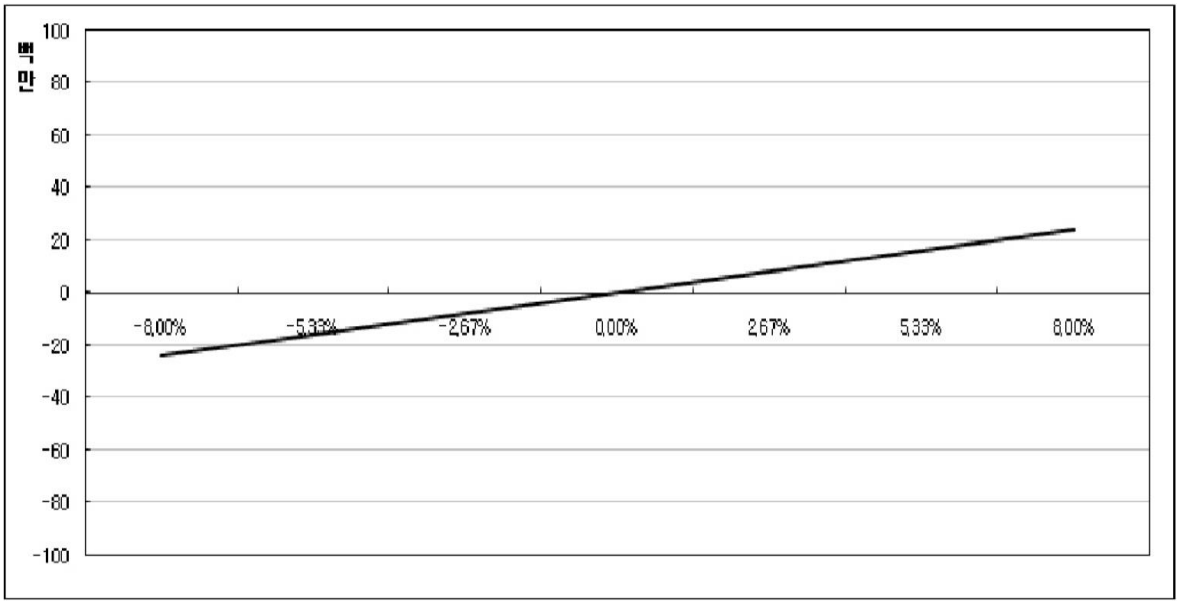
공시일: 2019-04-09

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	859	0	859	장내
합계			859	0	859	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,242

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

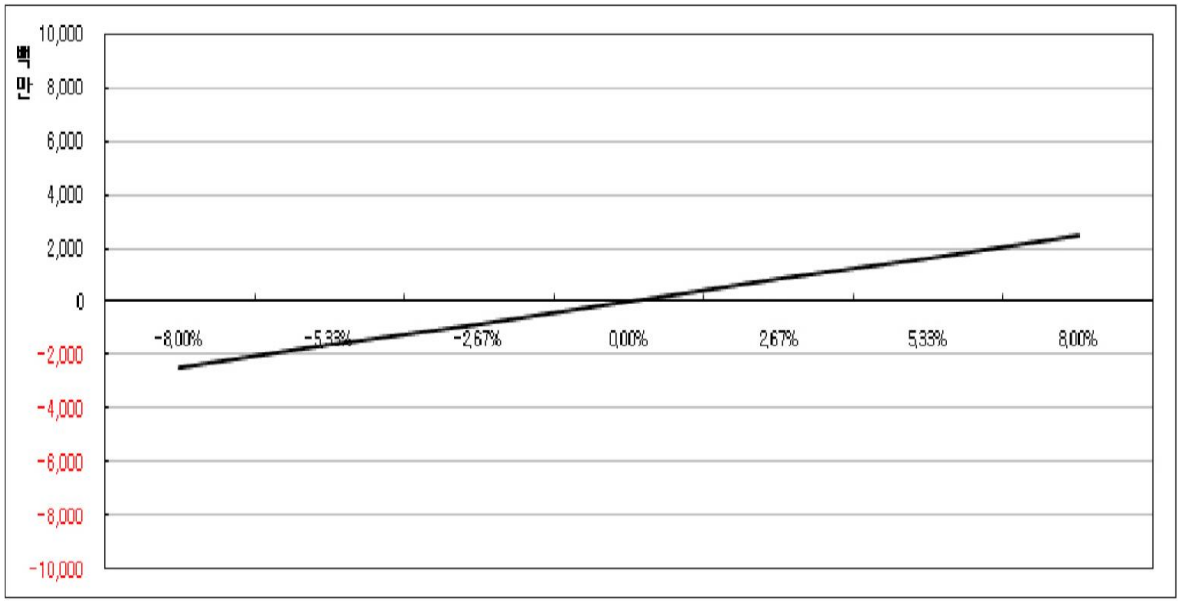
공시일: 2019-04-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	501	-501	장내
누계	주가지수	선물	4,009	0	4,009	장내
합계			4,009	0	4,009	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

322

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,537

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

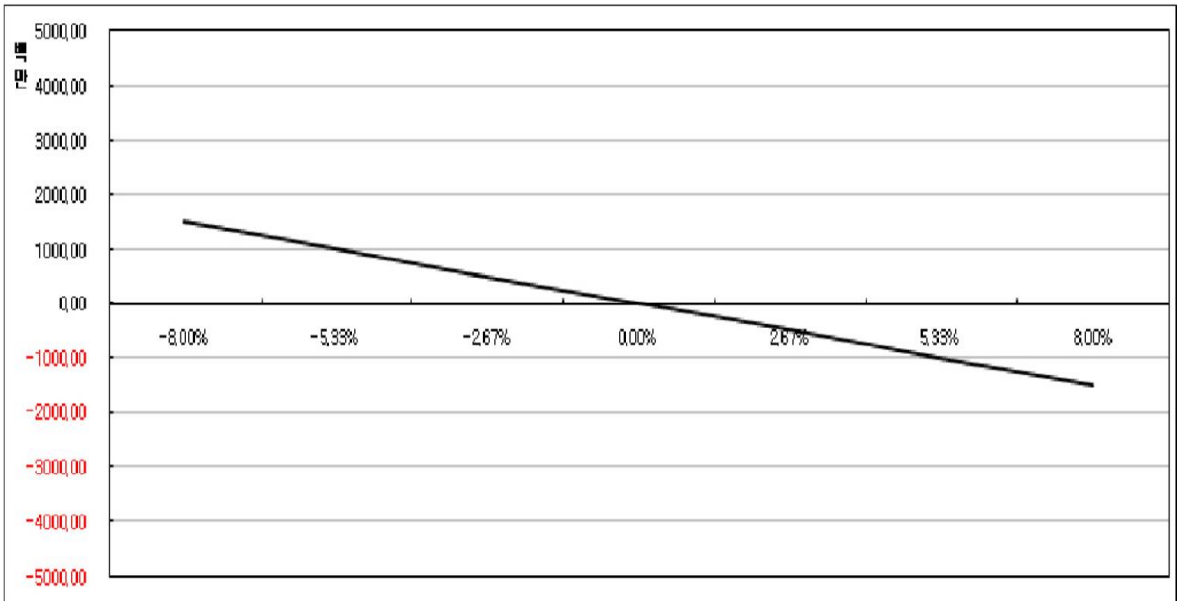
공시일: 2019-04-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	143	-143	장내
누계	주가지수	선물	0	2,935	-2,935	장내
합계			0	2,935	-2,935	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

236

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

195

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

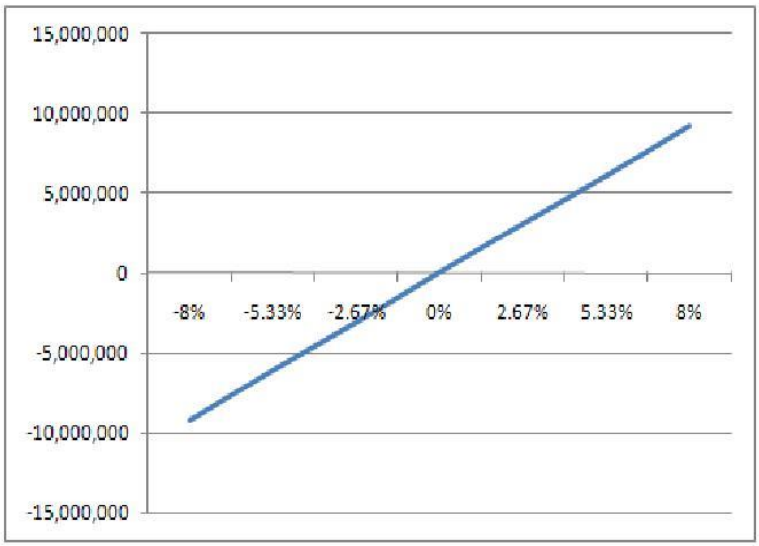
공시일: 2019-04-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,432	-1,432	장내
누계	주가지수	선물	68,230	0	68,230	장내
합계			68,230	0	68,230	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,475

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,863