펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-26

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	3,535	0	3,535	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	13	6,929	-6,916	장내
합계			3,548	6,929	-3,381	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	130

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,795

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

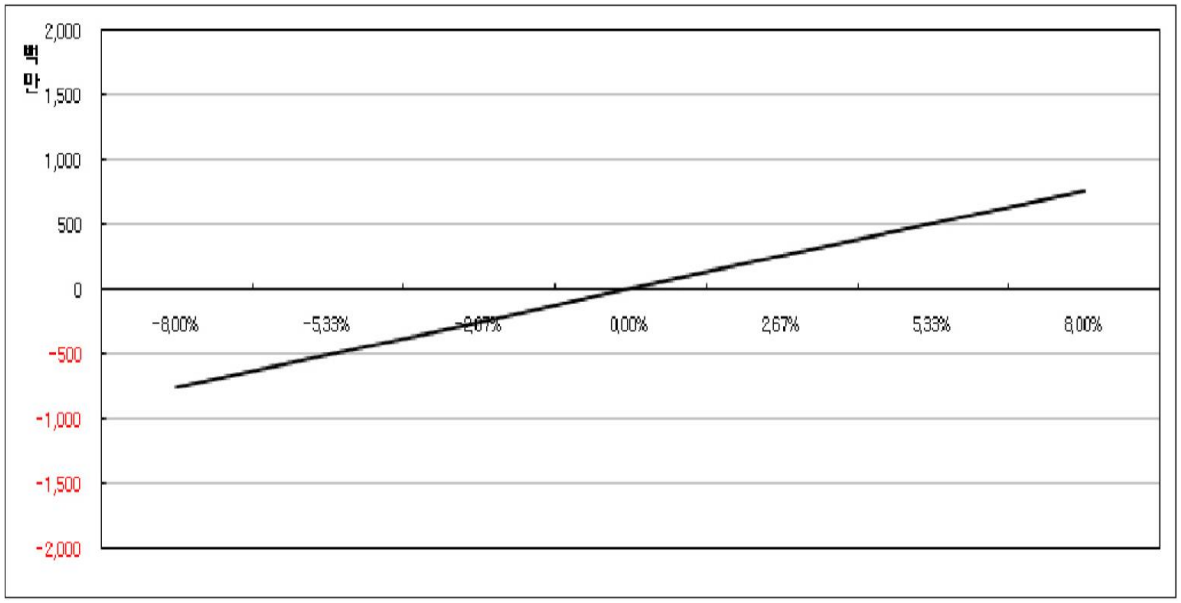
공시일: 2019-04-26

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	212	0	212	장내
합계			212	0	212	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,788

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

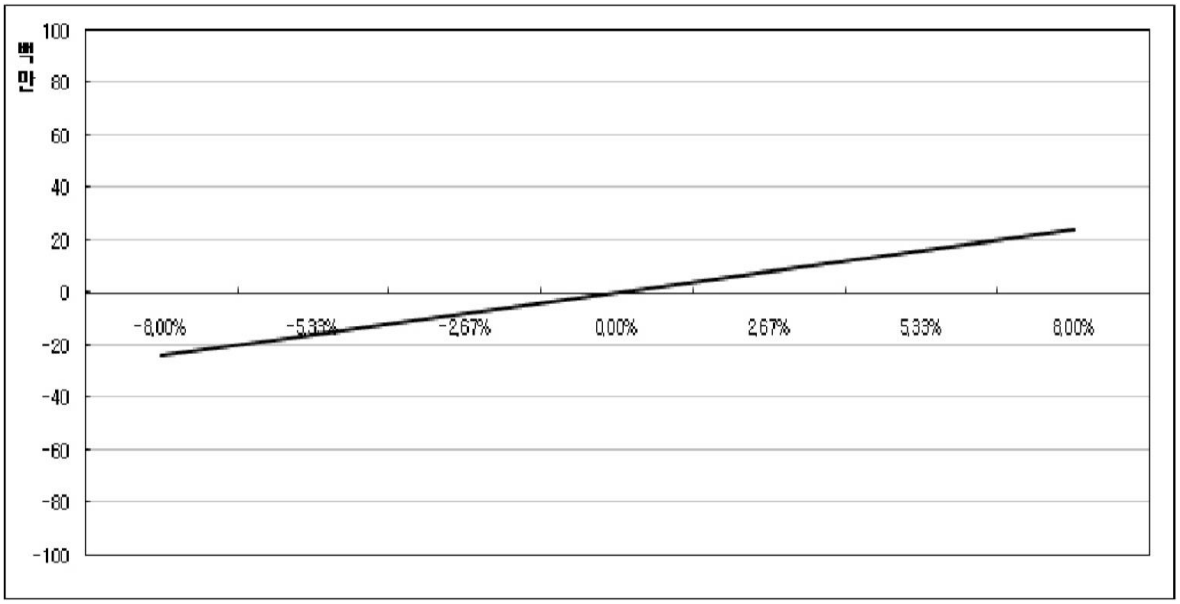
공시일: 2019-04-26

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	848	0	848	장내
합계			848	0	848	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,113

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

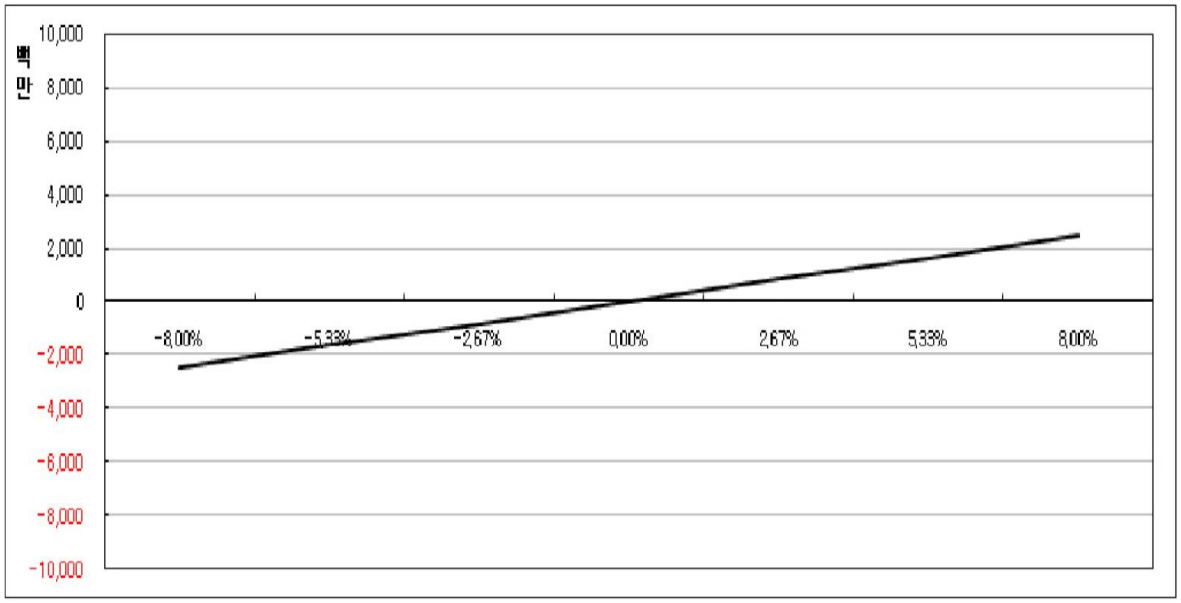
공시일: 2019-04-26

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	4,030	0	4,030	장내
합계			4,030	0	4,030	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

323

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,319

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

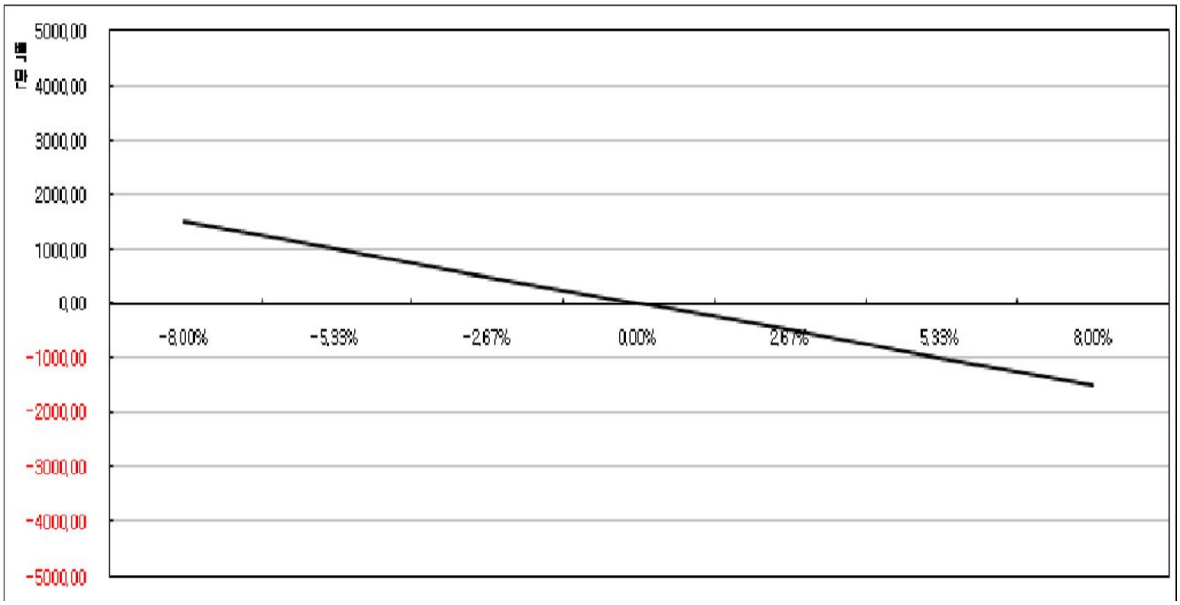
공시일: 2019-04-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	141	-141	장내
누계	주가지수	선물	0	3,253	-3,253	장내
합계			0	3,253	-3,253	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

261

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

215

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

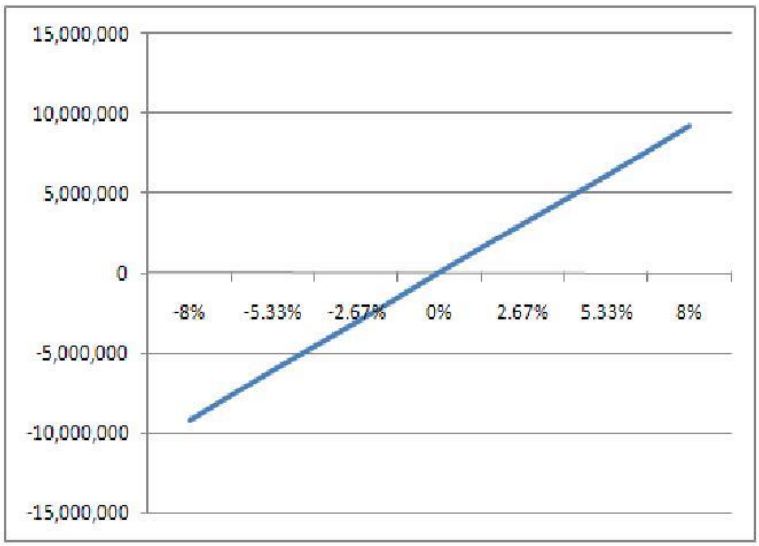
공시일: 2019-04-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	212	0	212	장내
누계	주가지수	선물	66,324	0	66,324	장내
합계			66,324	0	66,324	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,314

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43,078