펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-04-30

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	3,585	0	3,585	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	7,026	-7,022	장내
합계			3,589	7,026	-3,437	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	193

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,819

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

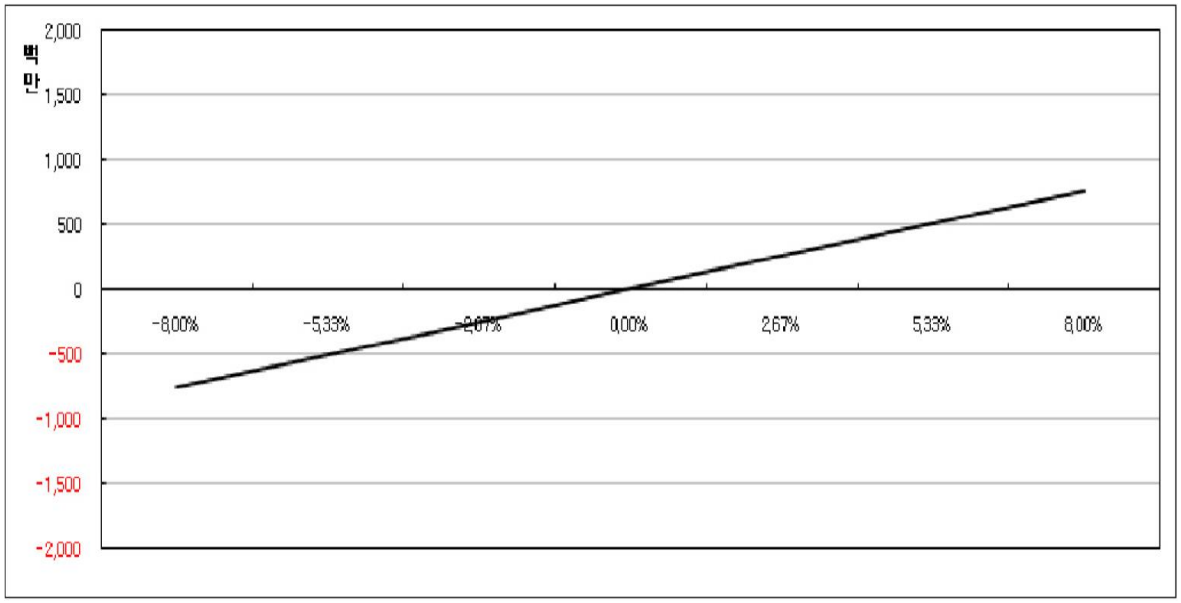
공시일: 2019-04-30

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	215	0	215	장내
합계			215	0	215	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,878

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

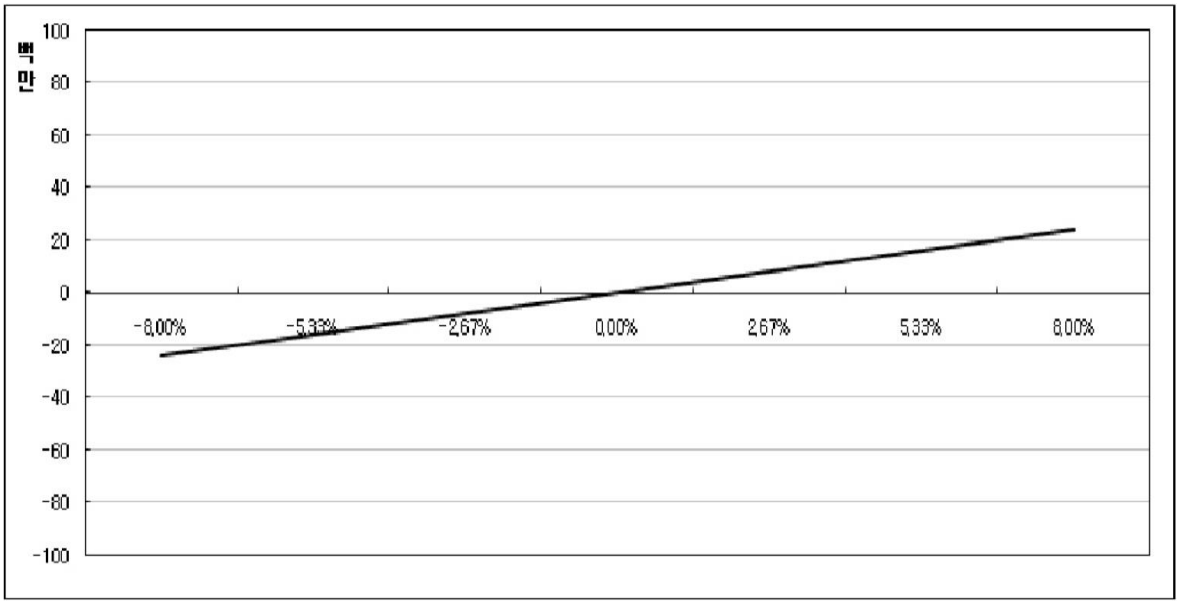
공시일: 2019-04-30

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	860	0	860	장내
합계			860	0	860	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,213

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

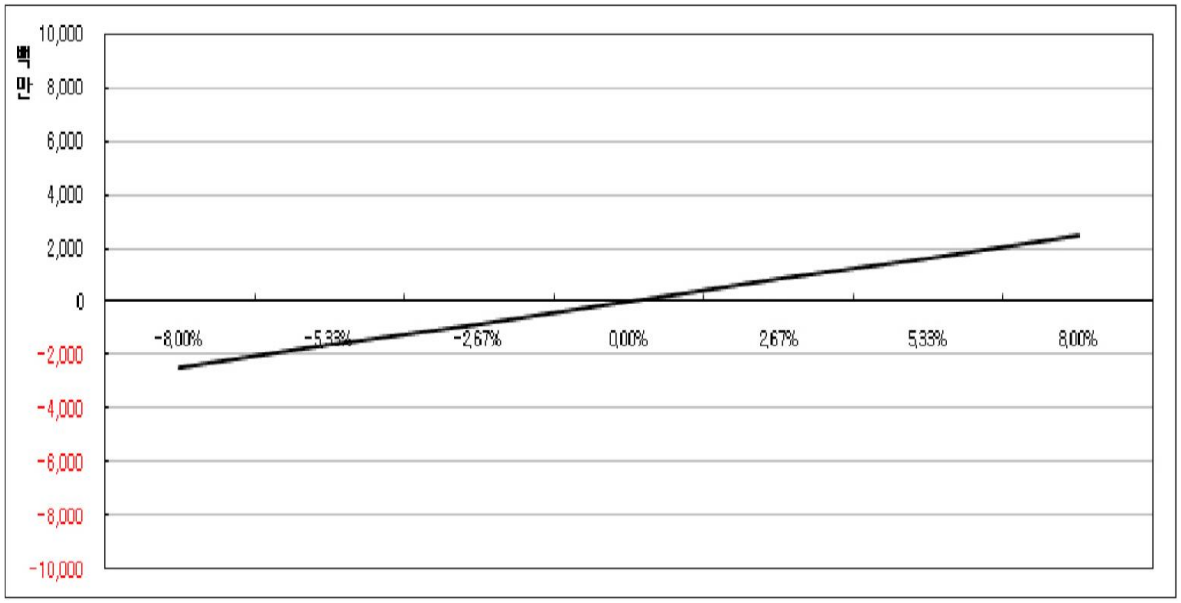
공시일: 2019-04-30

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	4,087	0	4,087	장내
합계			4,087	0	4,087	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

328

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,489

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

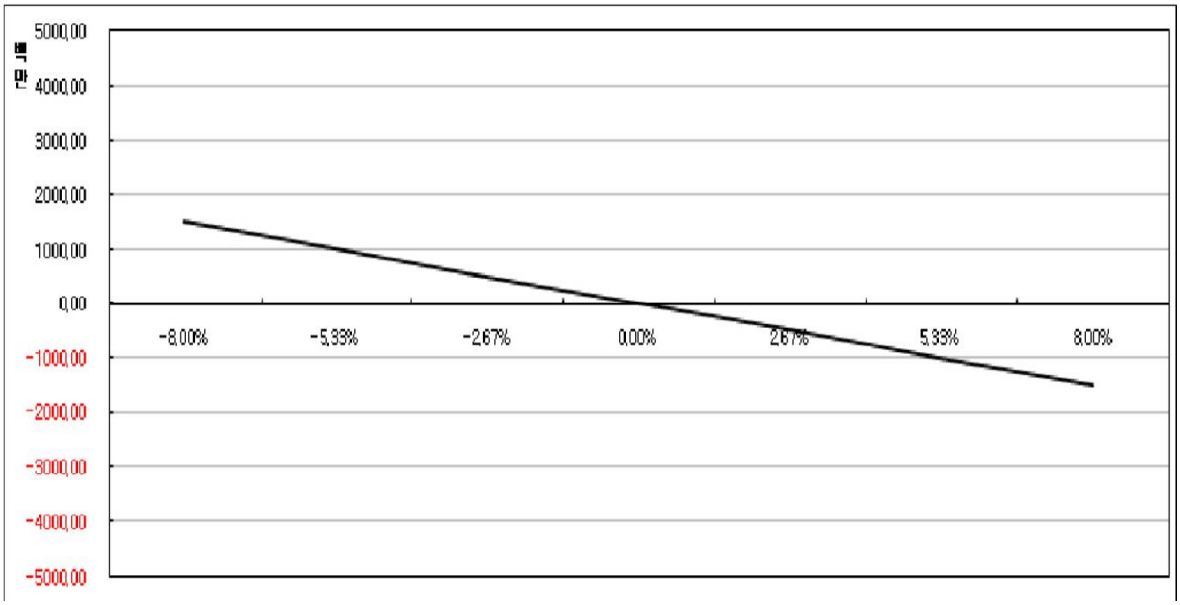
공시일: 2019-04-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	215	0	215	장내
누계	주가지수	선물	0	3,083	-3,083	장내
합계			0	3,083	-3,083	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

247

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

206

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

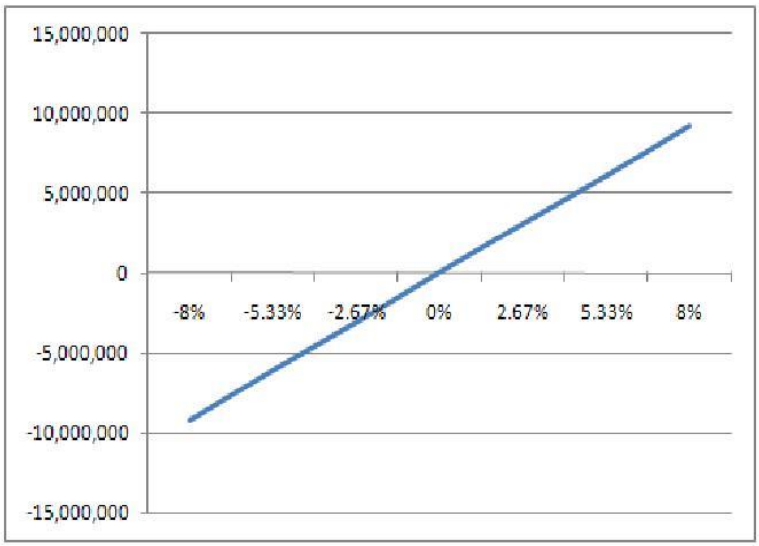
공시일: 2019-04-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,577	0	1,577	장내
누계	주가지수	선물	70,192	0	70,192	장내
합계			70,192	0	70,192	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,632

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,521