펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-03

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	3,615	0	3,615	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	41	13,170	-13,128	장내
합계			3,657	13,170	-9,513	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	236

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,662

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

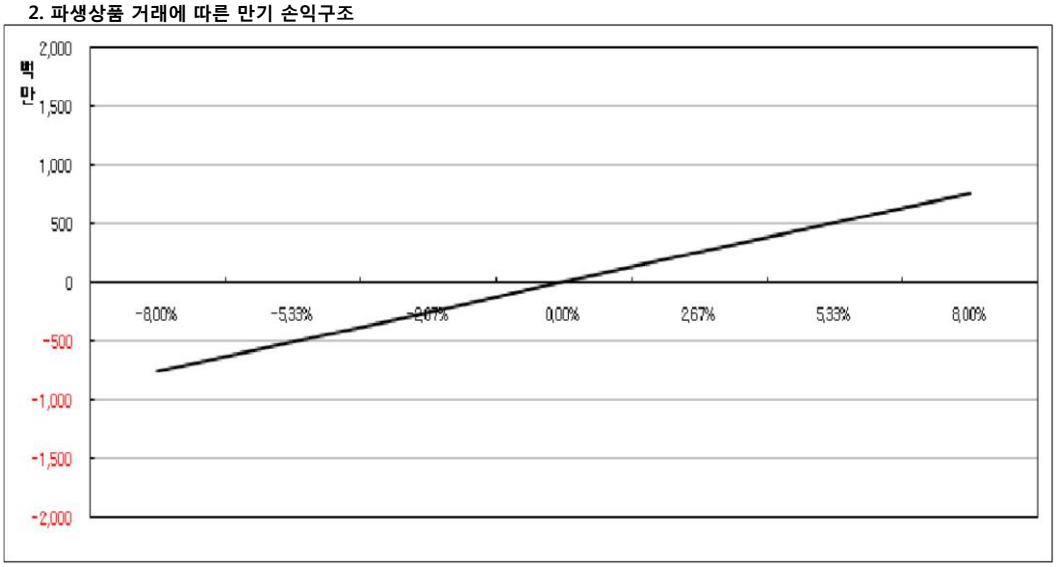
공시일: 2019-01-03

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	258	0	258	장내
합계			258	0	258	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,455

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

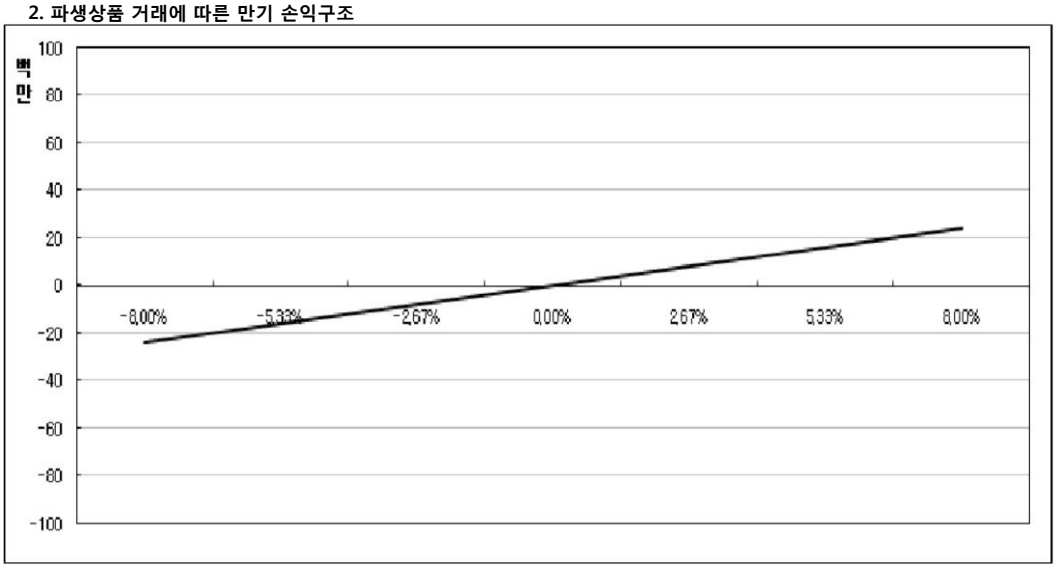
공시일: 2019-01-03

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	904	0	904	장내
합계			904	0	904	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,750

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

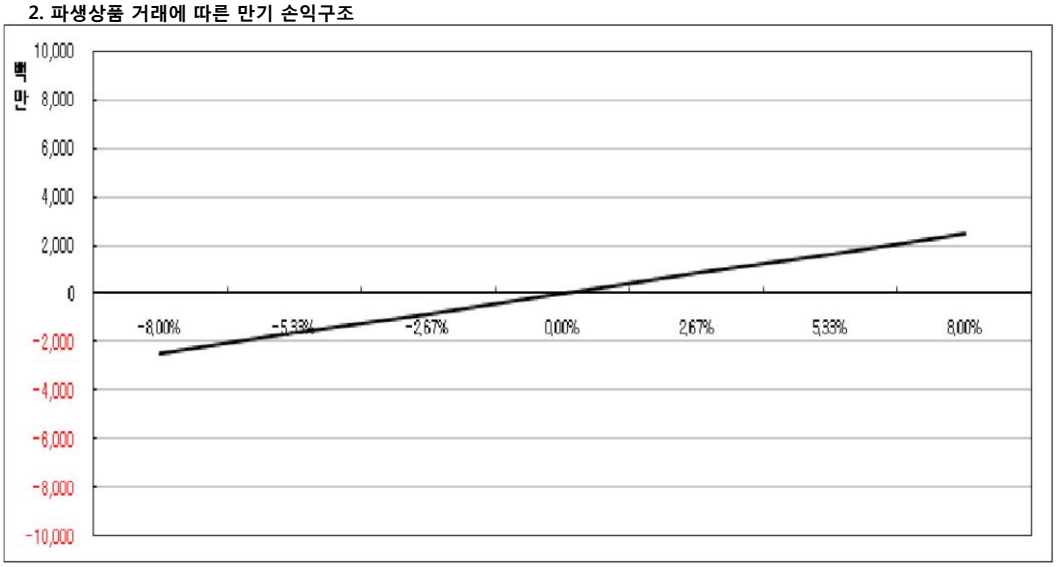
공시일: 2019-01-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	323	-323	장내
누계	주가지수	선물	5,617	0	5,617	장내
합계			5,617	0	5,617	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	450

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	4,780

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

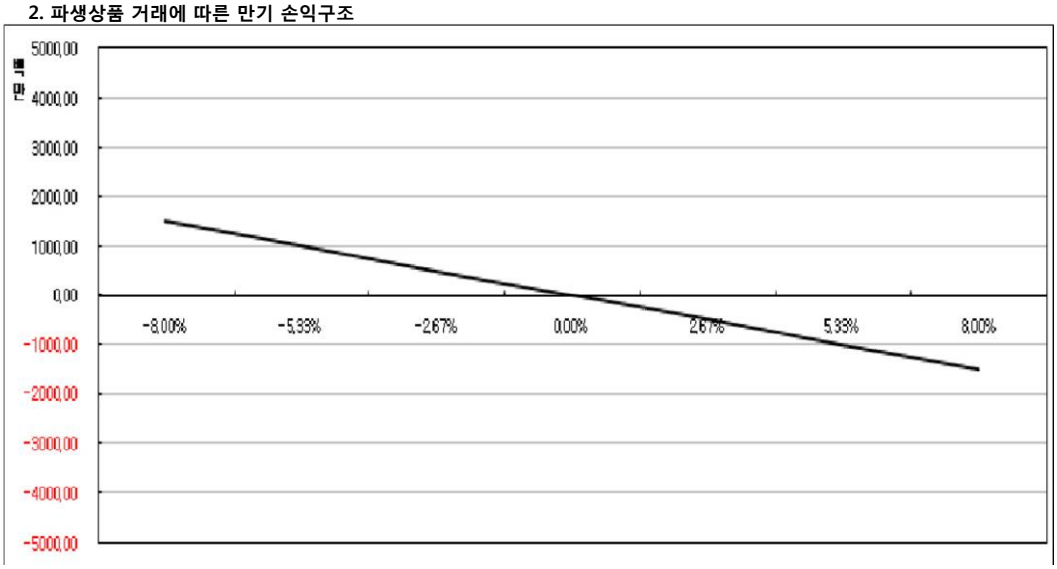
공시일: 2019-01-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	65	-65	장내
누계	주가지수	선물	0	2,130	-2,130	장내
합계			0	2,130	-2,130	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	171

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	147

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

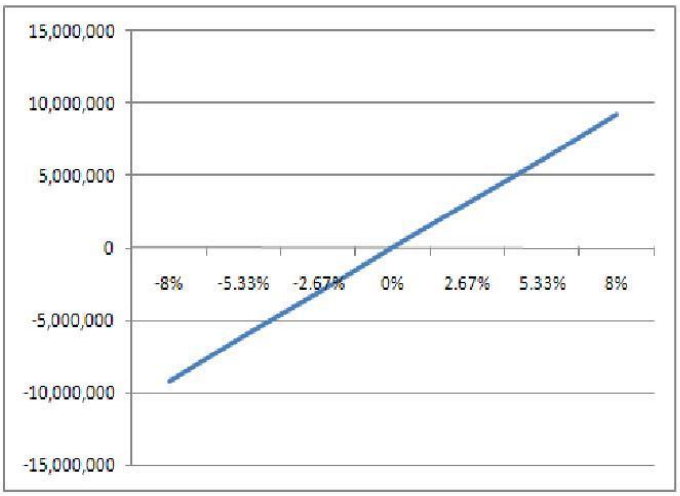
공시일: 2019-01-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	775	-775	장내
누계	주가지수	선물	67,333	0	67,333	장내
합계			67,333	0	67,333	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,400

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38,789