펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-04

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	3,581	0	3,581	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	52	13,044	-12,992	장내
합계			3,633	13,044	-9,411	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,645

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

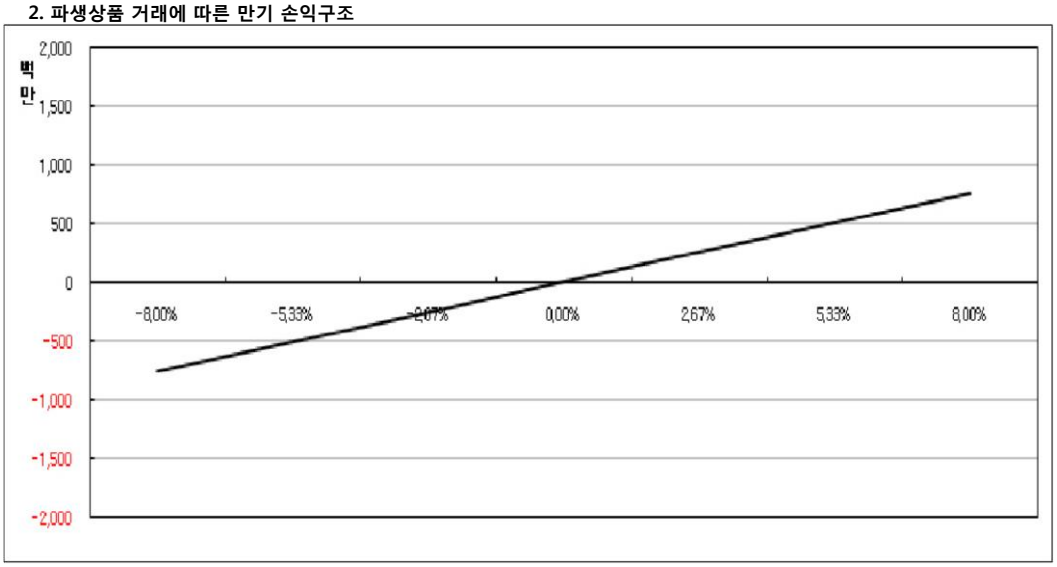
공시일: 2019-01-04

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	256	0	256	장내
합계			256	0	256	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,389

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

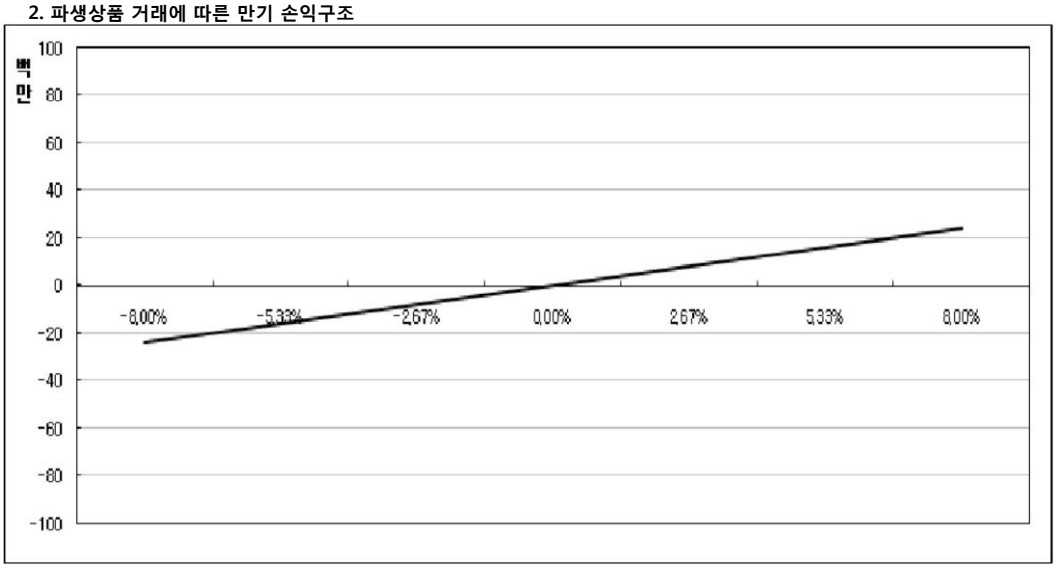
공시일: 2019-01-04

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	895	0	895	장내
합계			895	0	895	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,677

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

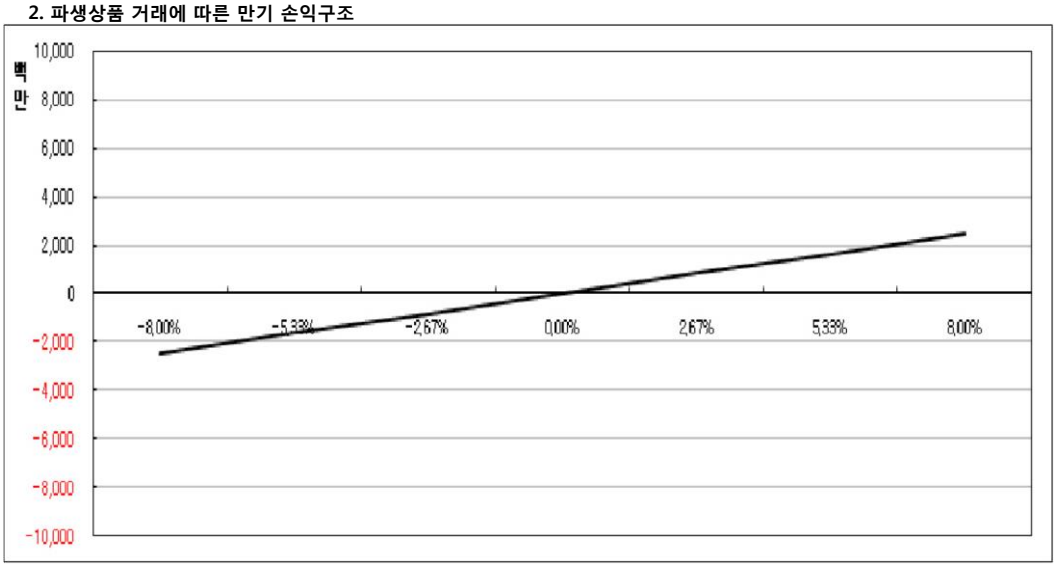
공시일: 2019-01-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	128	64	64	장내
누계	주가지수	선물	5,627	0	5,627	장내
합계			5,627	0	5,627	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 452

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,656

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

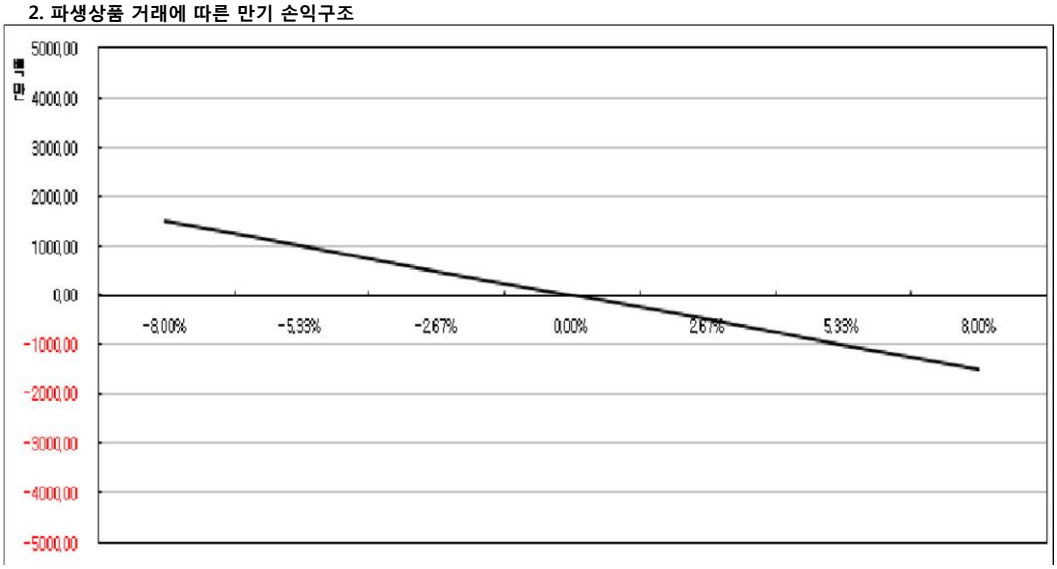
공시일: 2019-01-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	192	-192	장내
누계	주가지수	선물	0	2,302	-2,302	장내
합계			0	2,302	-2,302	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	185

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	159

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

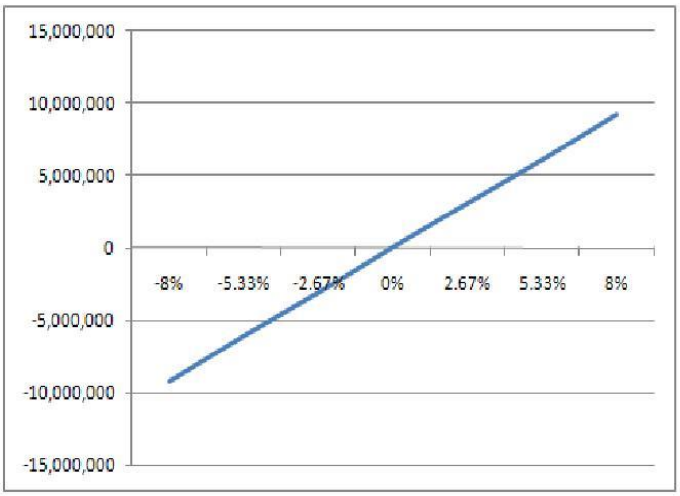
공시일: 2019-01-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	448	-448	장내
누계	주가지수	선물	66,244	0	66,244	장내
합계			66,244	0	66,244	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,317

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	37,759