펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-07

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	3,610	0	3,610	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	34	13,152	-13,119	장내
합계			3,644	13,152	-9,508	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	198

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,634

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

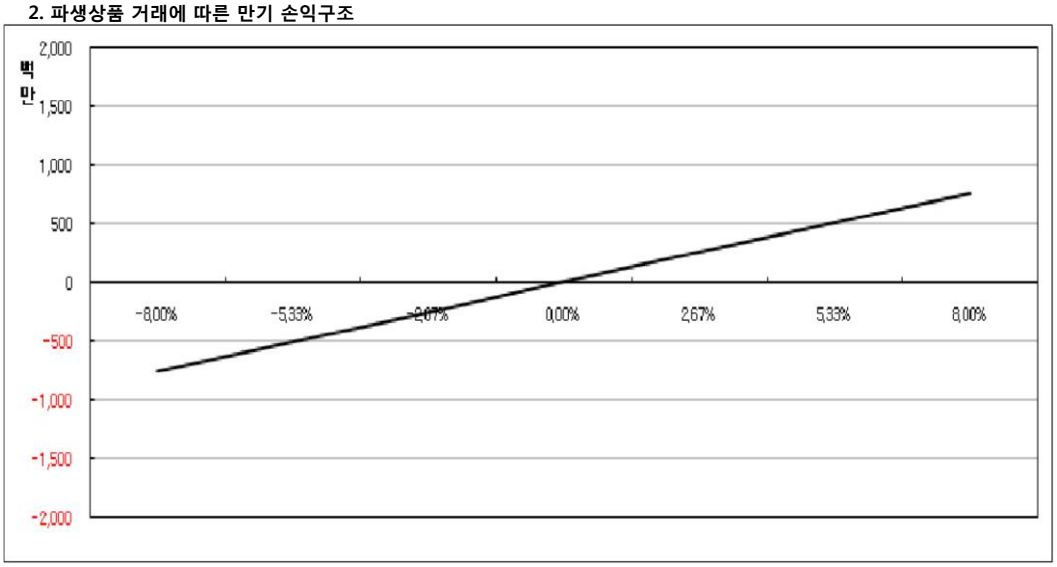
공시일: 2019-01-07

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)	2,384

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

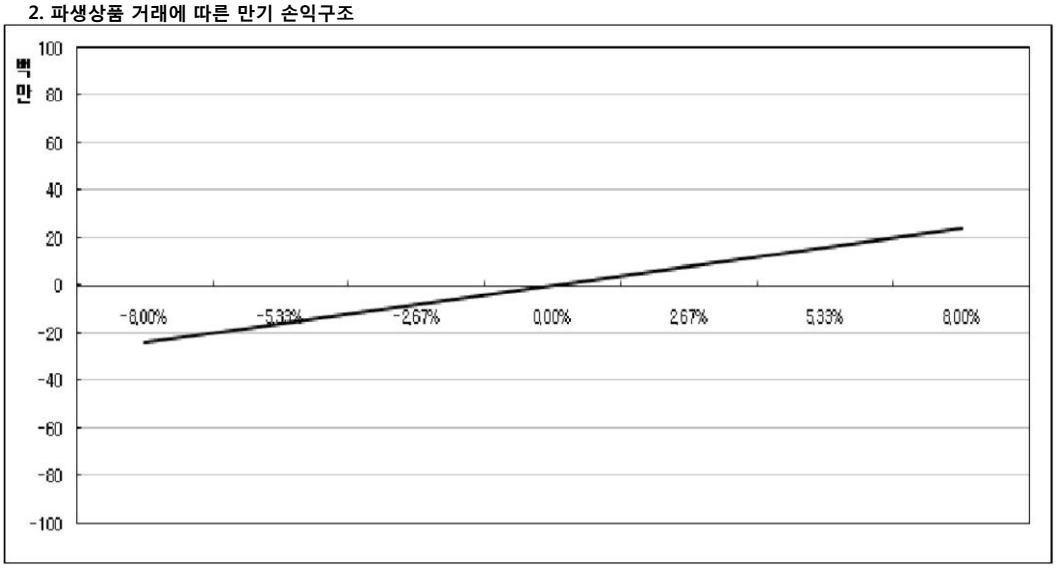
공시일: 2019-01-07

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	903	0	903	장내
합계			903	0	903	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 72

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,671

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

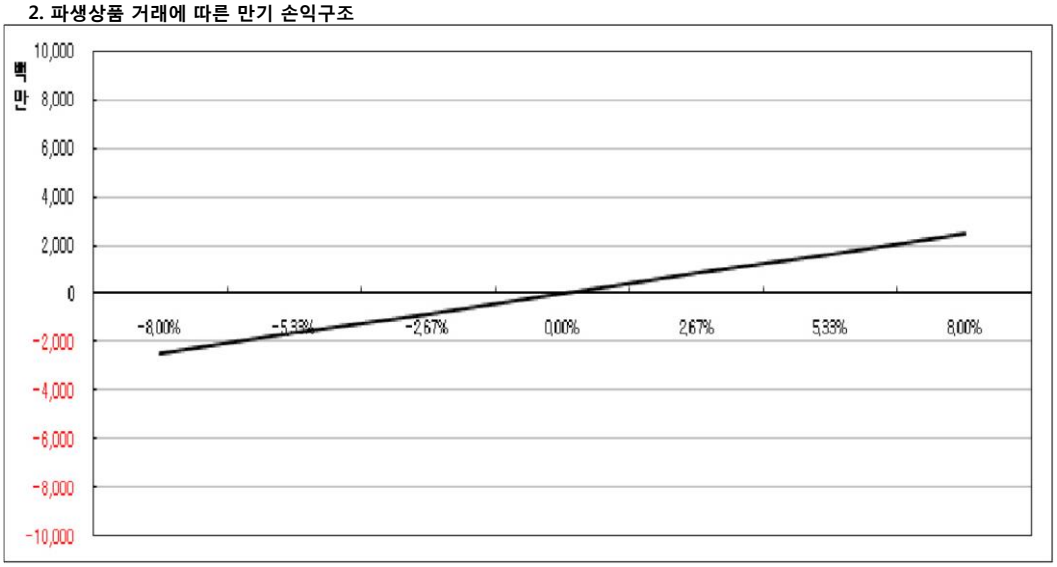
공시일: 2019-01-07

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	5,674	0	5,674	장내
합계			5,674	0	5,674	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 456

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,646

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

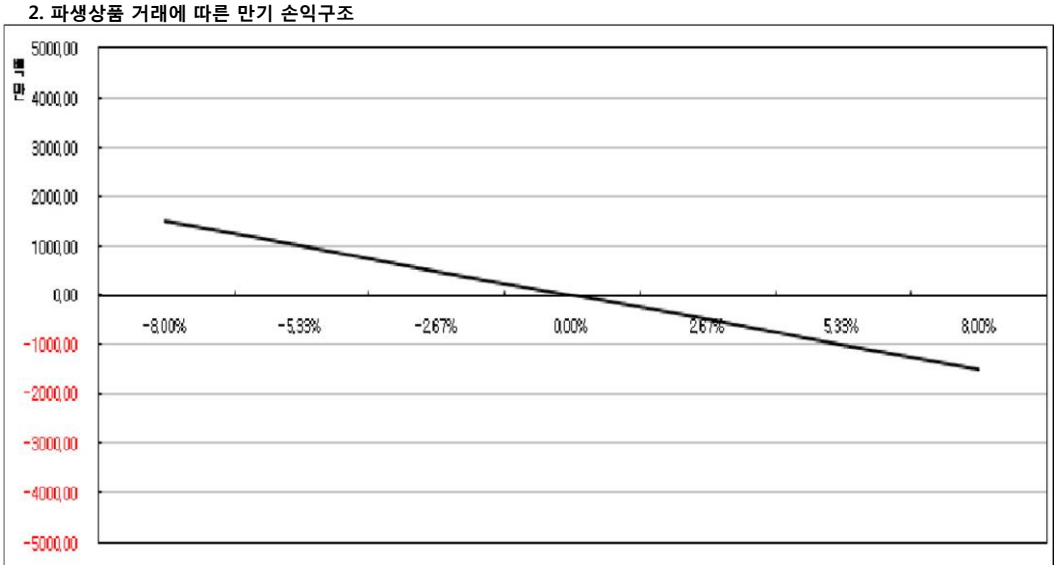
공시일: 2019-01-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	258	129	129	장내
누계	주가지수	선물	0	2,192	-2,192	장내
합계			0	2,192	-2,192	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 176

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 152

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

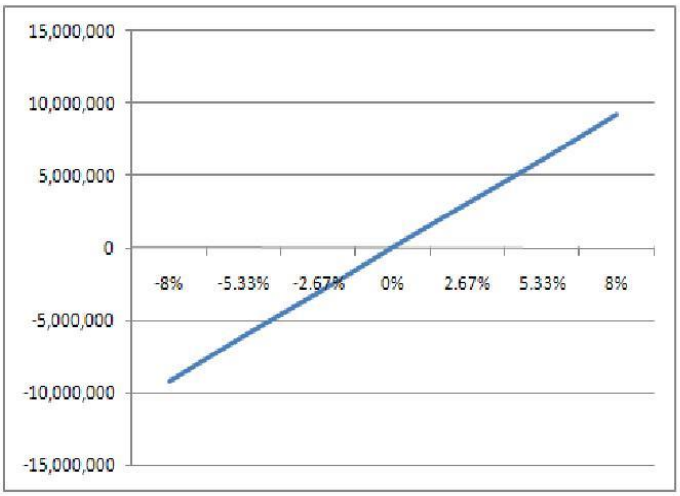
공시일: 2019-01-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	838	0	838	장내
누계	주가지수	선물	67,632	0	67,632	장내
합계			67,632	0	67,632	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,431

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

37,720