펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-08

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	3,662	0	3,662	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	11	13,340	-13,329	장내
합계			3,673	13,340	-9,667	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	353

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,674

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

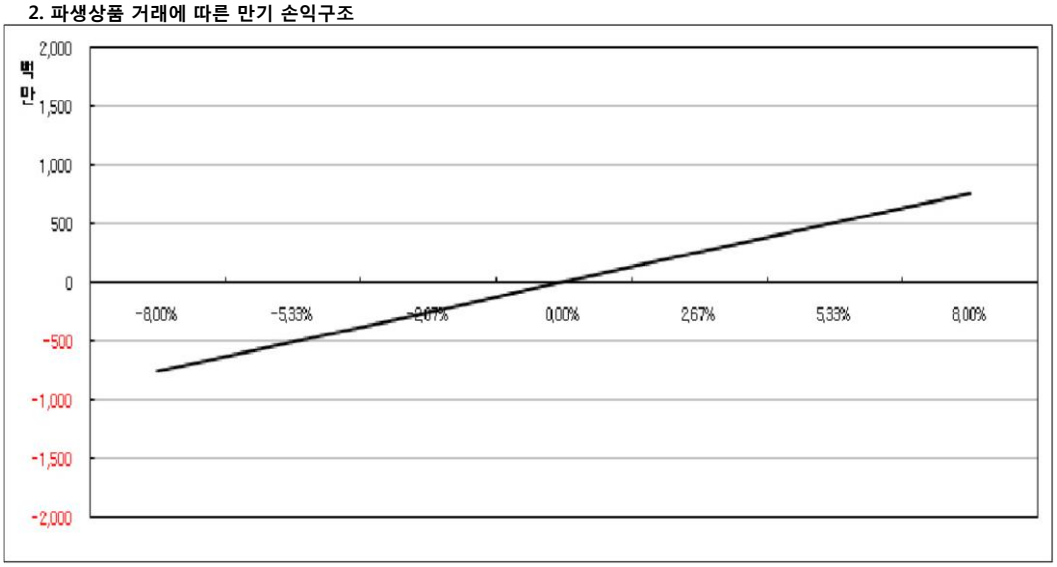
공시일: 2019-01-08

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	262	0	262	장내
합계			262	0	262	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,460

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

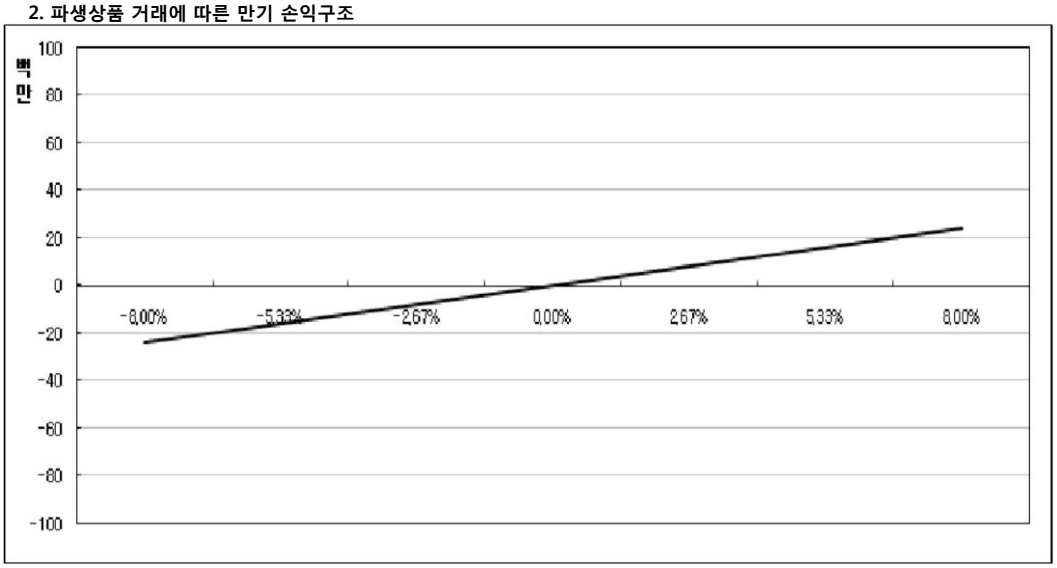
공시일: 2019-01-08

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	915	0	915	장내
합계			915	0	915	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,754

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

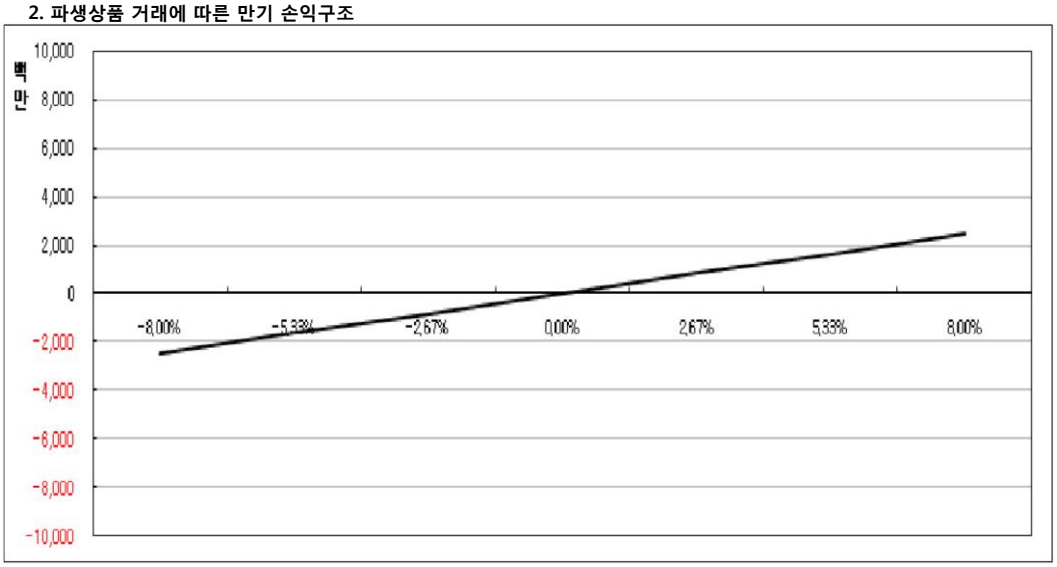
공시일: 2019-01-08

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	5,755	0	5,755	장내
합계			5,755	0	5,755	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

463

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,775

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

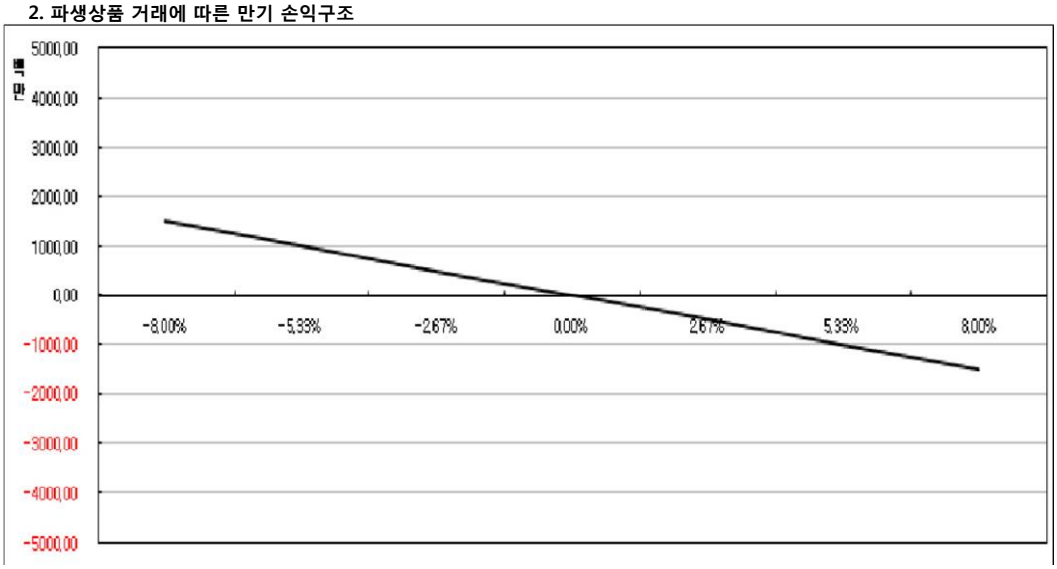
공시일: 2019-01-08

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	0	2,223	-2,223	장내
합계			0	2,223	-2,223	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	179

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	155

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

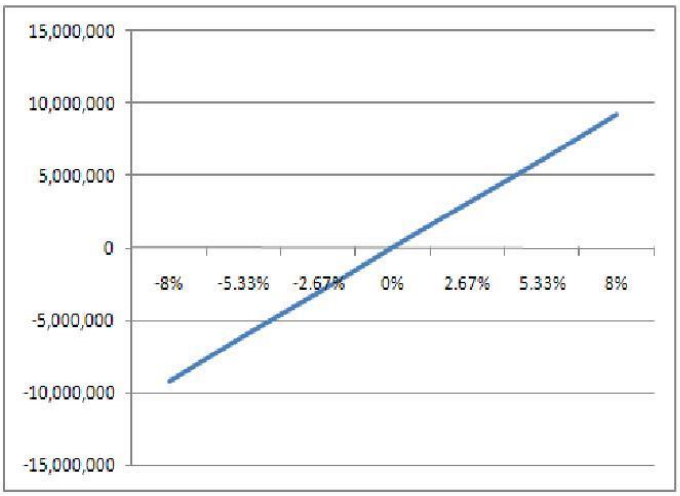
공시일: 2019-01-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	850	0	850	장내
누계	주가지수	선물	69,447	0	69,447	장내
합계			69,447	0	69,447	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,582

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38,713

하나UBS자산운용