펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-09

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	3,635	0	3,635	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	15	13,242	-13,227	장내
합계			3,650	13,242	-9,592	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

254

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,683

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

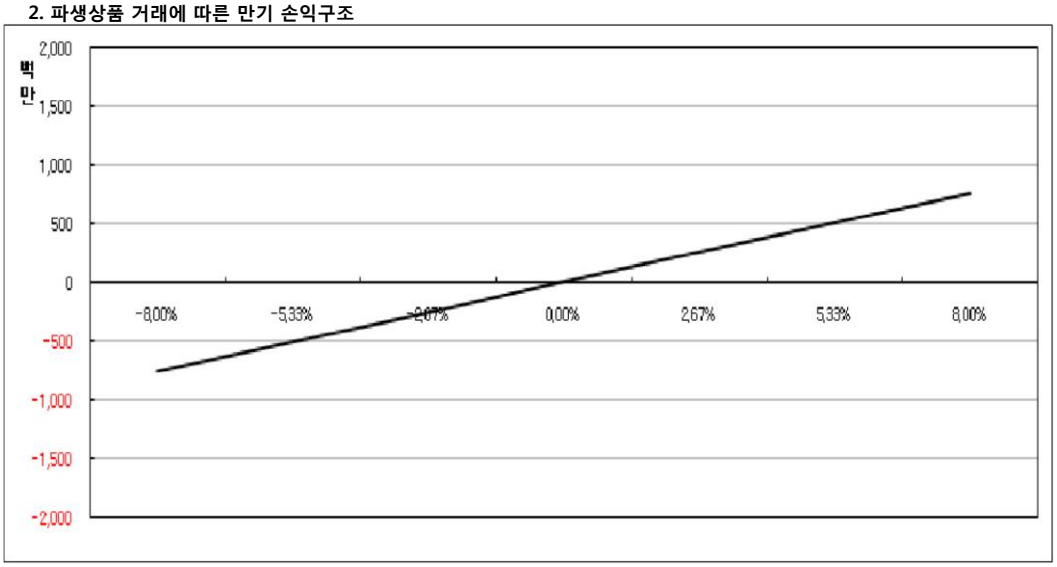
공시일: 2019-01-09

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	260	0	260	장내
합계			260	0	260	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,422

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

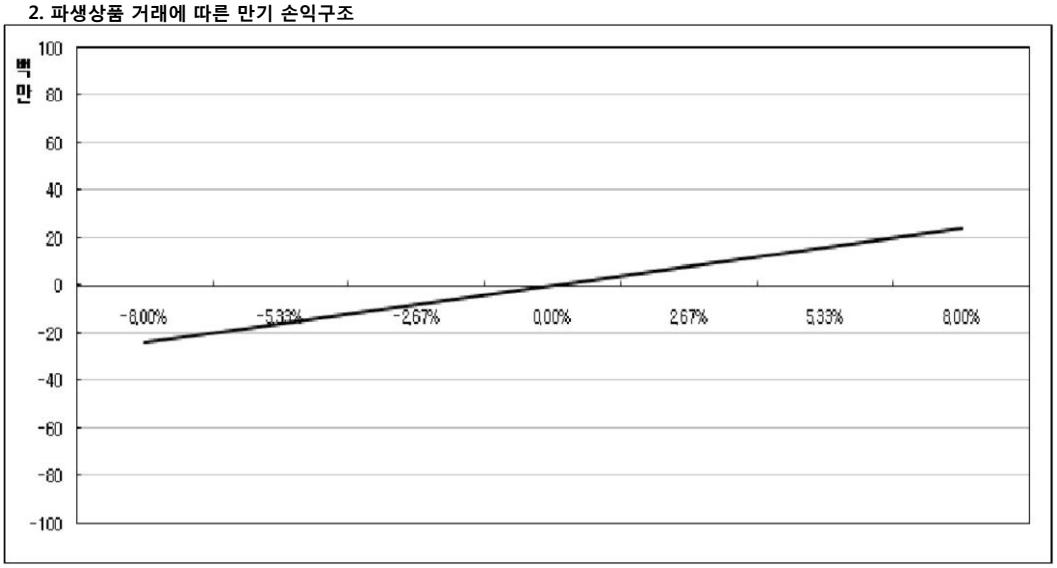
공시일: 2019-01-09

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	909	0	909	장내
합계			909	0	909	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	73

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,711

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

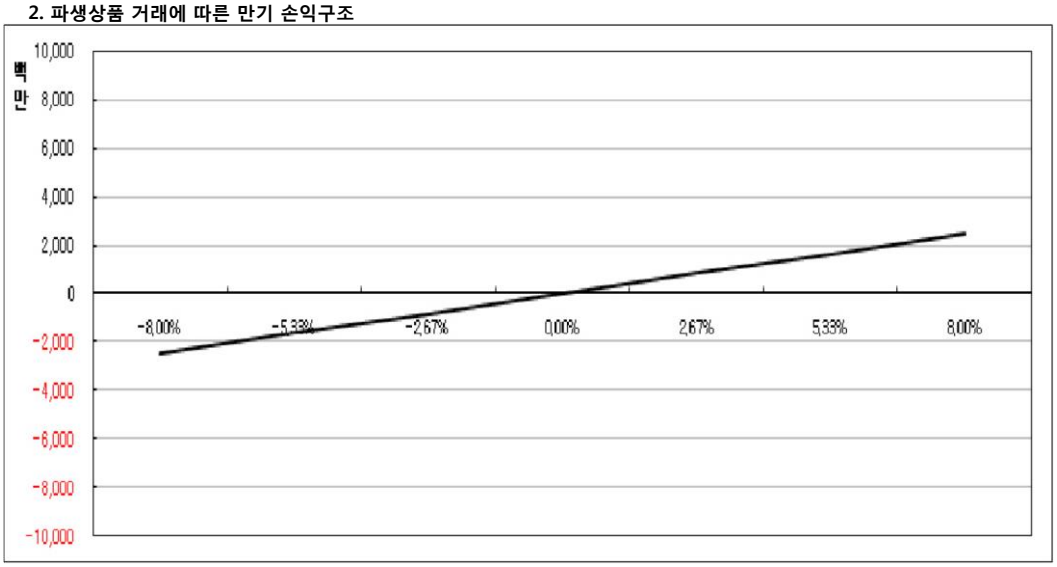
공시일: 2019-01-09

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	5,712	0	5,712	장내
합계			5,712	0	5,712	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 459

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,701

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

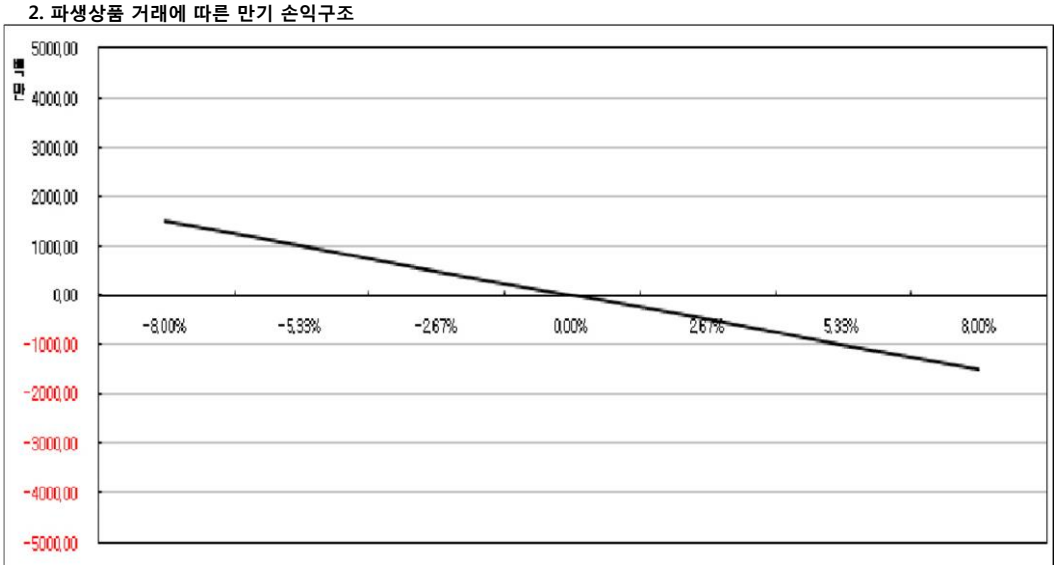
공시일: 2019-01-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	260	-260	장내
누계	주가지수	선물	0	2,467	-2,467	장내
합계			0	2,467	-2,467	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	198

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	172

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

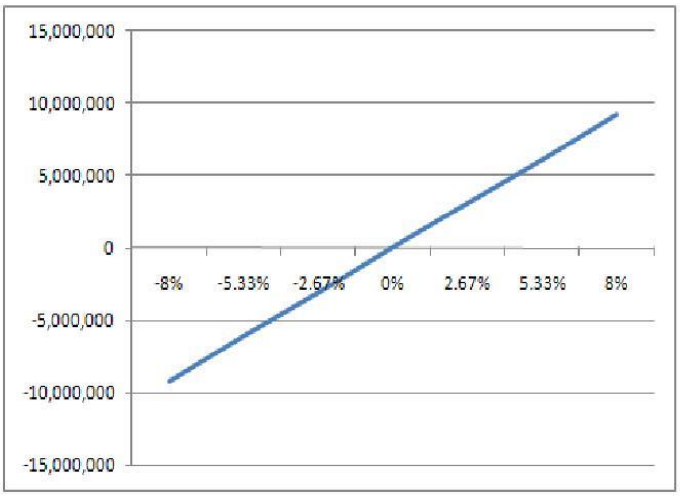
공시일: 2019-01-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	260	-260	장내
누계	주가지수	선물	68,677	0	68,677	장내
합계			68,677	0	68,677	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,517

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38,106