펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-10

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	3,718	0	3,718	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	1	13,546	-13,545	장내
합계			3,719	13,546	-9,826	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	561

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,676

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

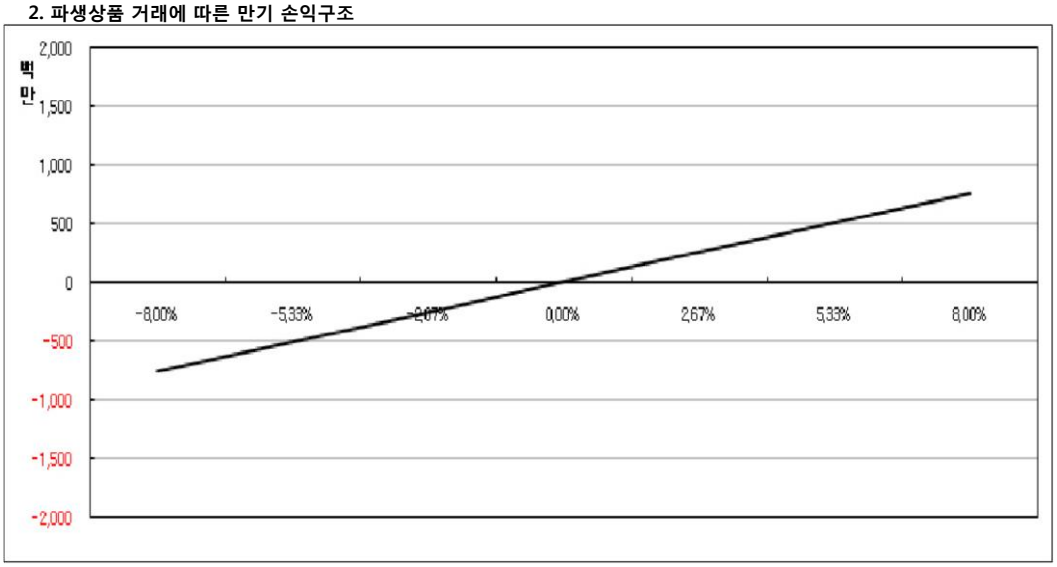
공시일: 2019-01-10

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	266	0	266	장내
합계			266	0	266	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,515

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

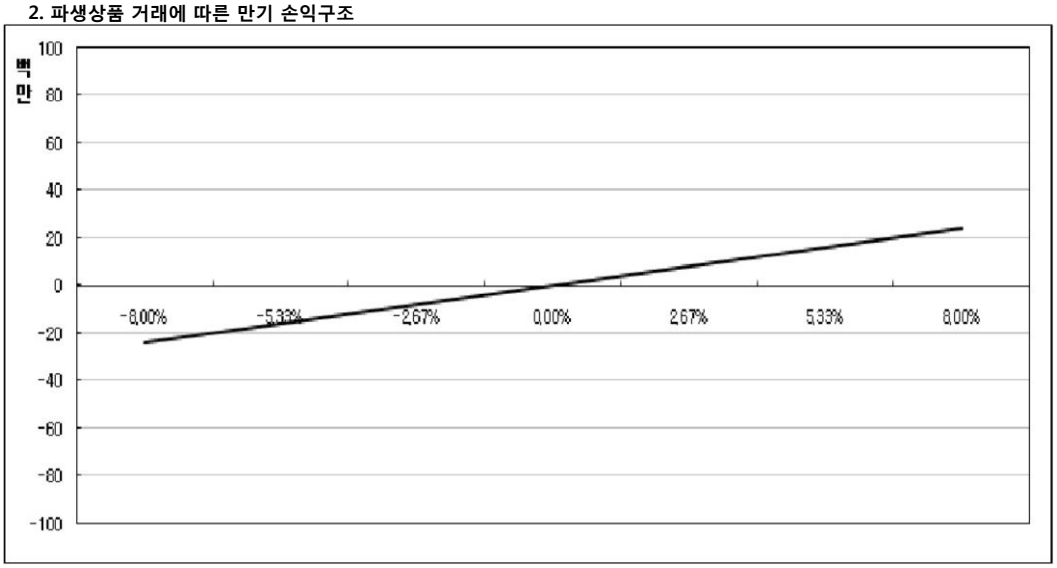
공시일: 2019-01-10

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	930	0	930	장내
합계			930	0	930	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,815

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

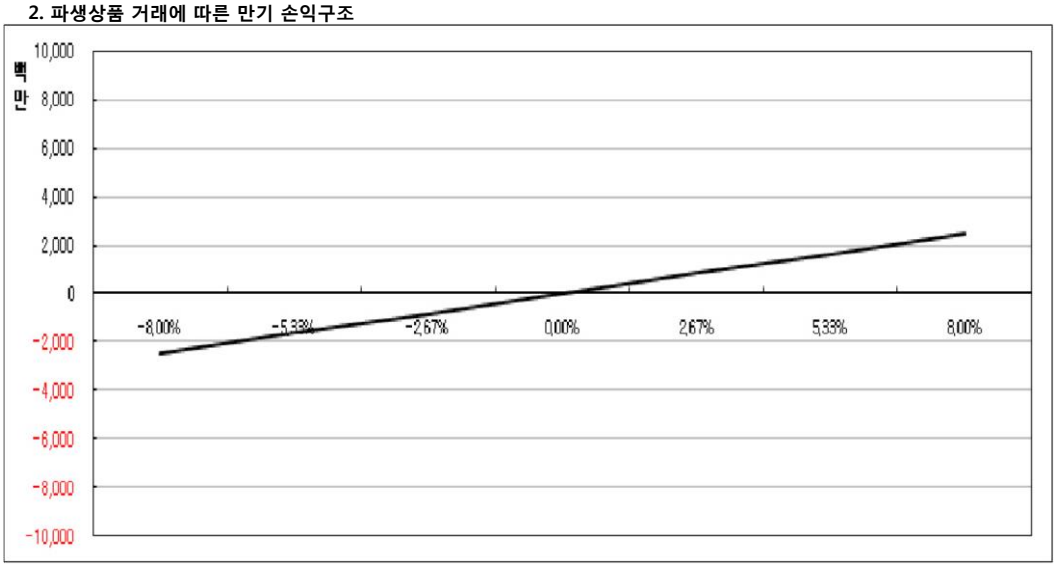
공시일: 2019-01-10

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	5,843	0	5,843	장내
합계			5,843	0	5,843	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 468

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,879

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

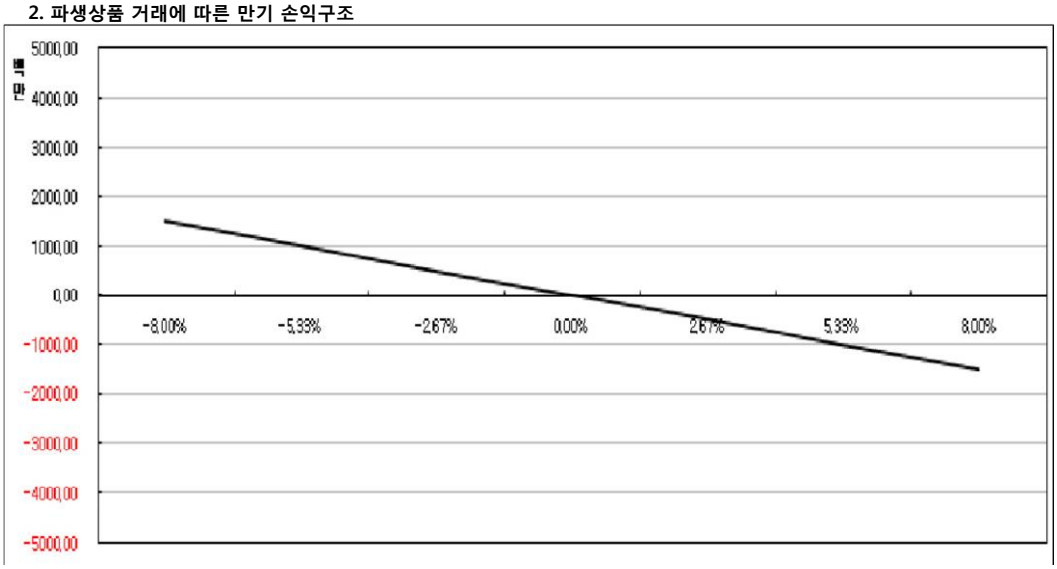
공시일: 2019-01-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	266	0	266	장내
누계	주가지수	선물	0	2,258	-2,258	장내
합계			0	2,258	-2,258	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 181

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 158

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

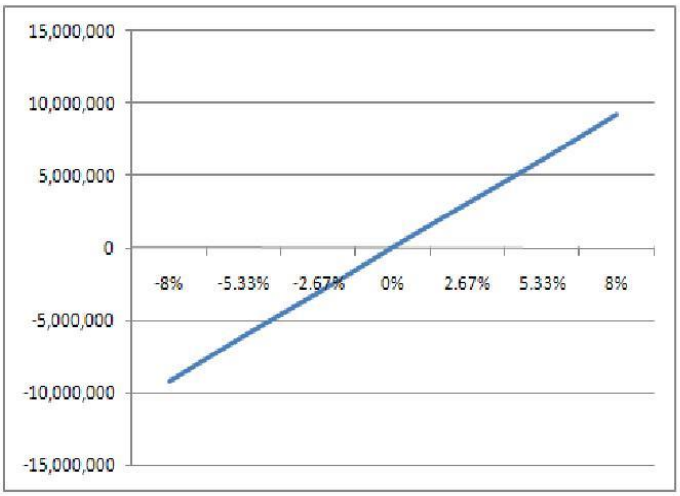
공시일: 2019-01-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	465	0	465	장내
누계	주가지수	선물	70,716	0	70,716	장내
합계			70,716	0	70,716	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,667

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	39,559