펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-11

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	43	16,763	-16,720	장내
누계	주가지수	옵션	42	14,107	-14,065	장내
합계			3,760	14,107	-10,347	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	669

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,405

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

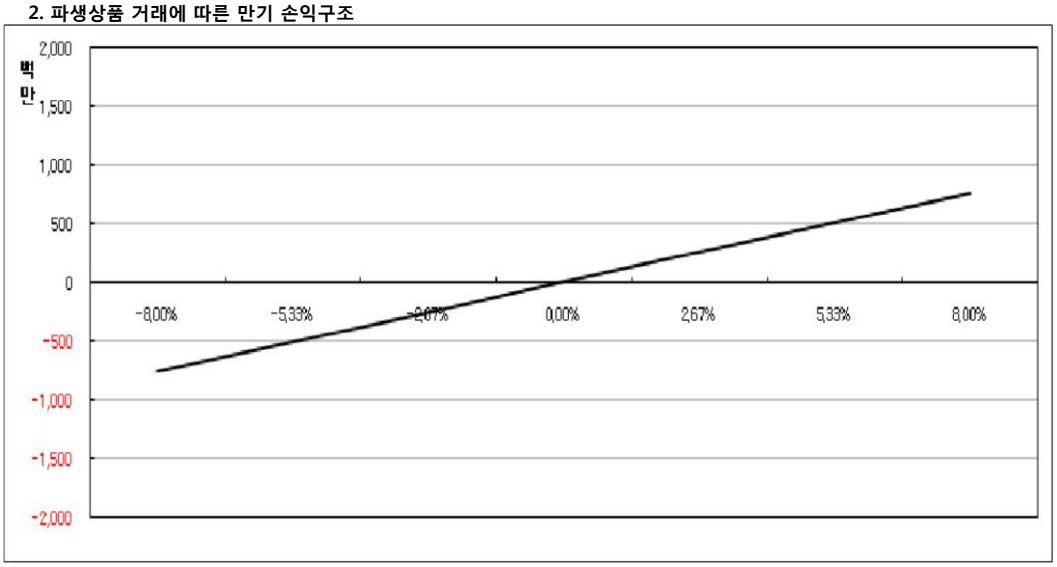
공시일: 2019-01-11

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)	2,526

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

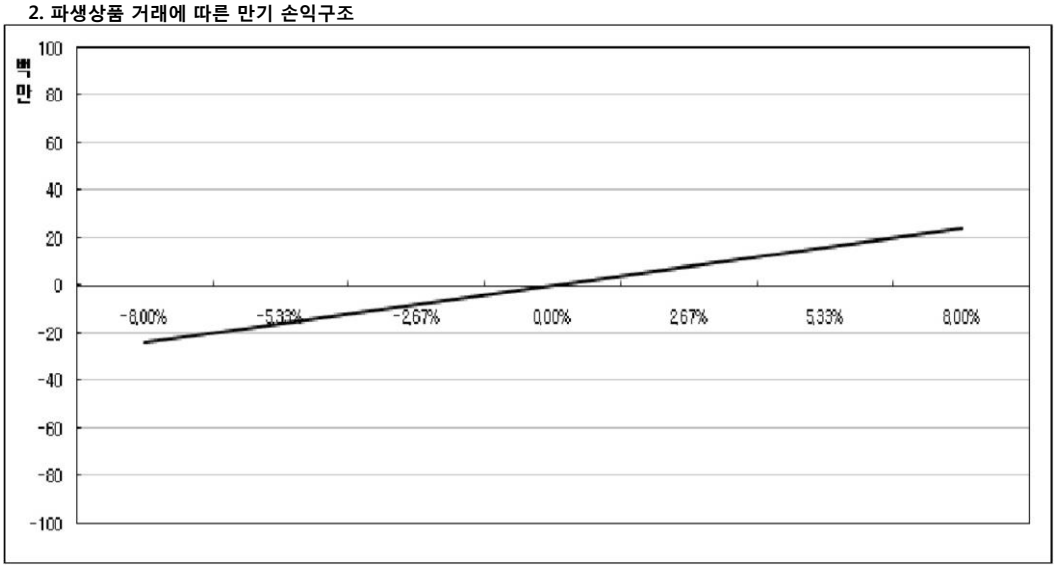
공시일: 2019-01-11

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	929	0	929	장내
합계			929	0	929	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,828

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

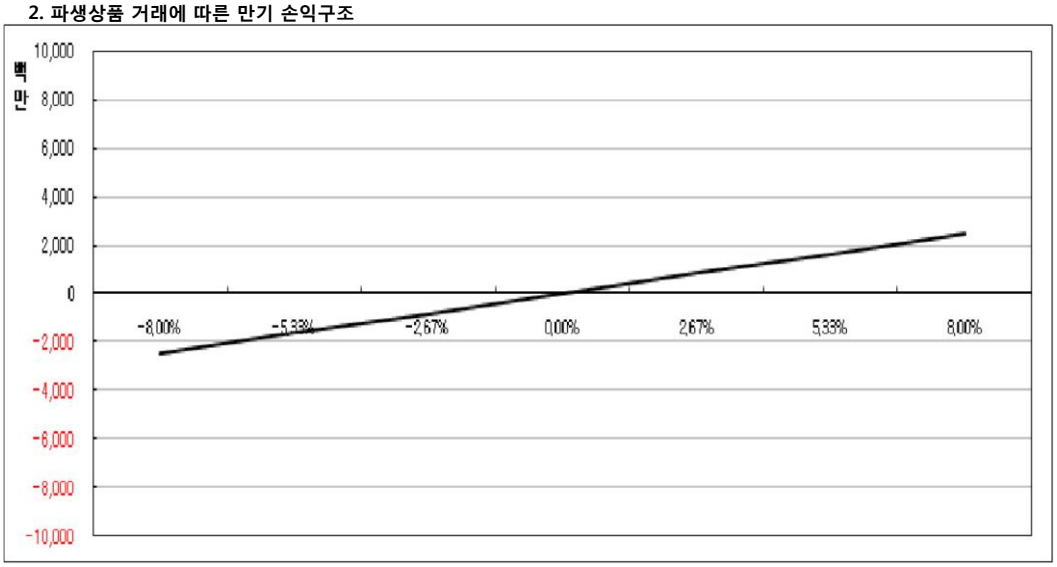
공시일: 2019-01-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	199	-199	장내
누계	주가지수	선물	5,643	0	5,643	장내
합계			5,643	0	5,643	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

452

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,895

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

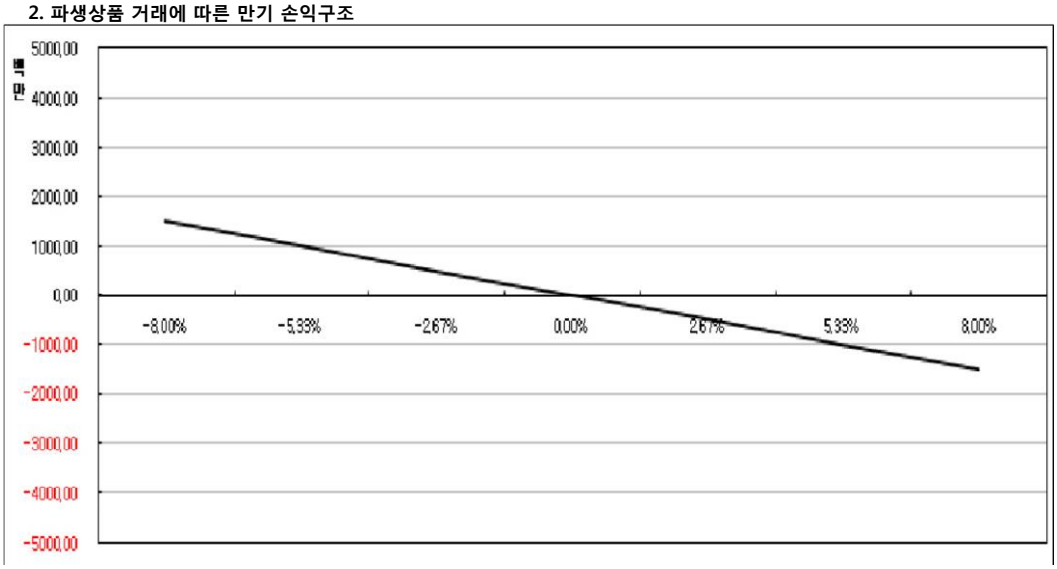
공시일: 2019-01-11

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	2,257	-2,257	장내
합계			0	2,257	-2,257	

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]

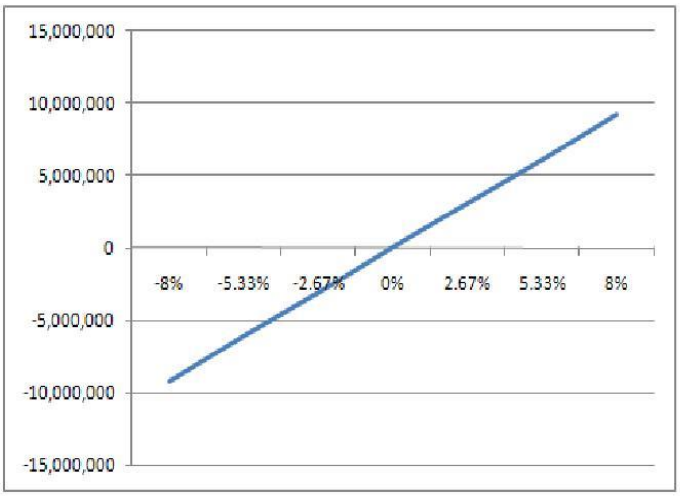
공시일: 2019-01-11

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	70,703	0	70,703	장내
합계			70,703	0	70,703	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,662

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

39,734