펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-14

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	3,740	0	3,740	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	37	14,158	-14,121	장내
합계			3,776	14,158	-10,382	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

683

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,178

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

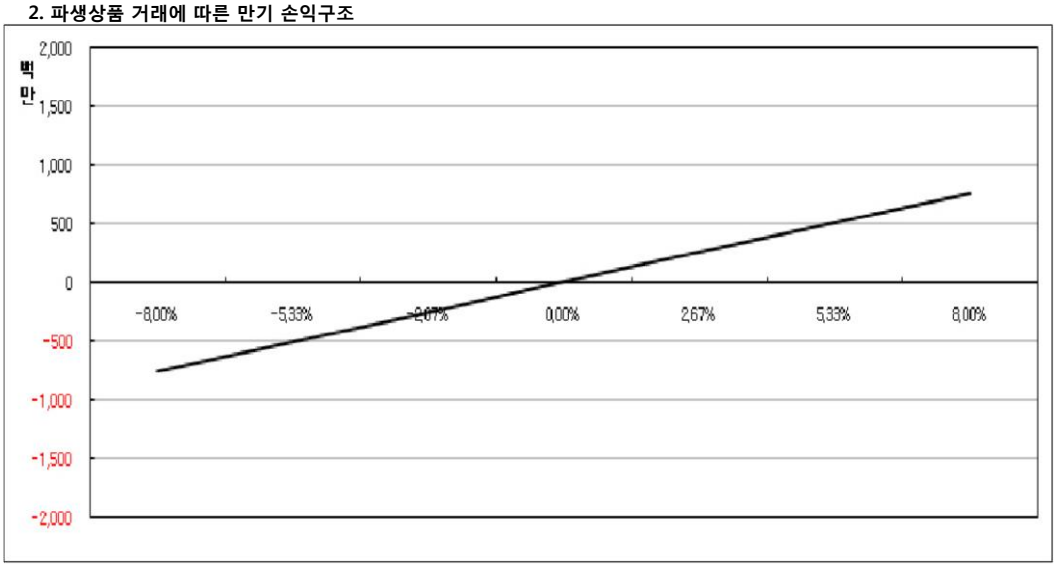
공시일: 2019-01-14

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	267	0	267	장내
합계			267	0	267	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,567

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

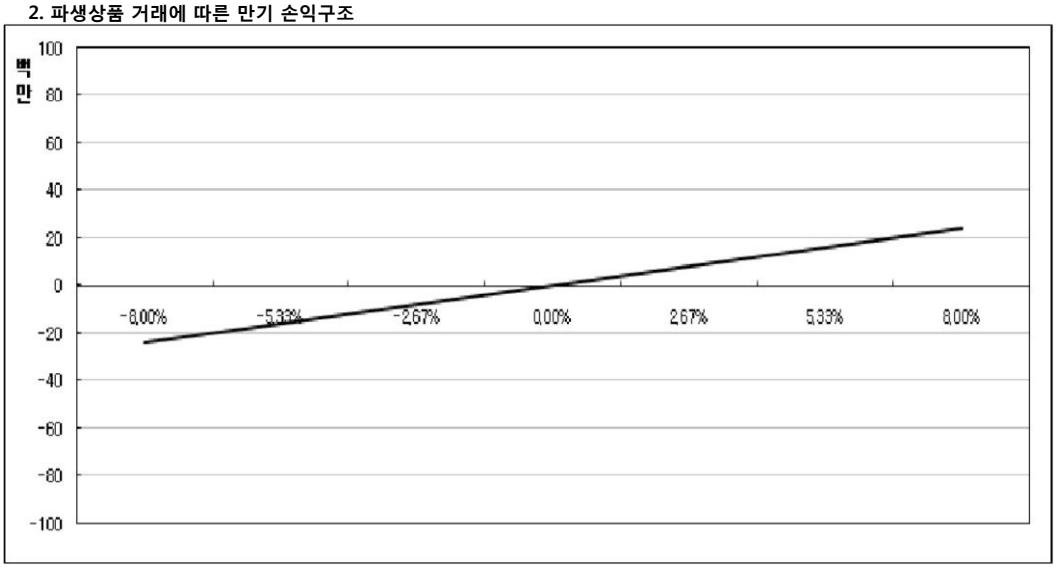
공시일: 2019-01-14

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	935	0	935	장내
합계			935	0	935	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	75

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,872

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

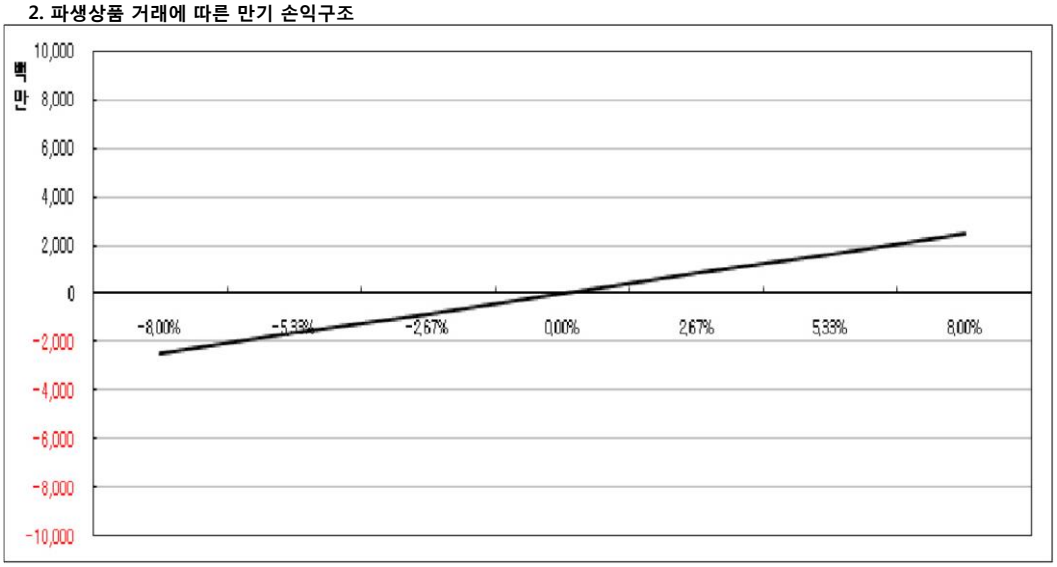
공시일: 2019-01-14

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	5,677	0	5,677	장내
합계			5,677	0	5,677	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 456

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,971

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

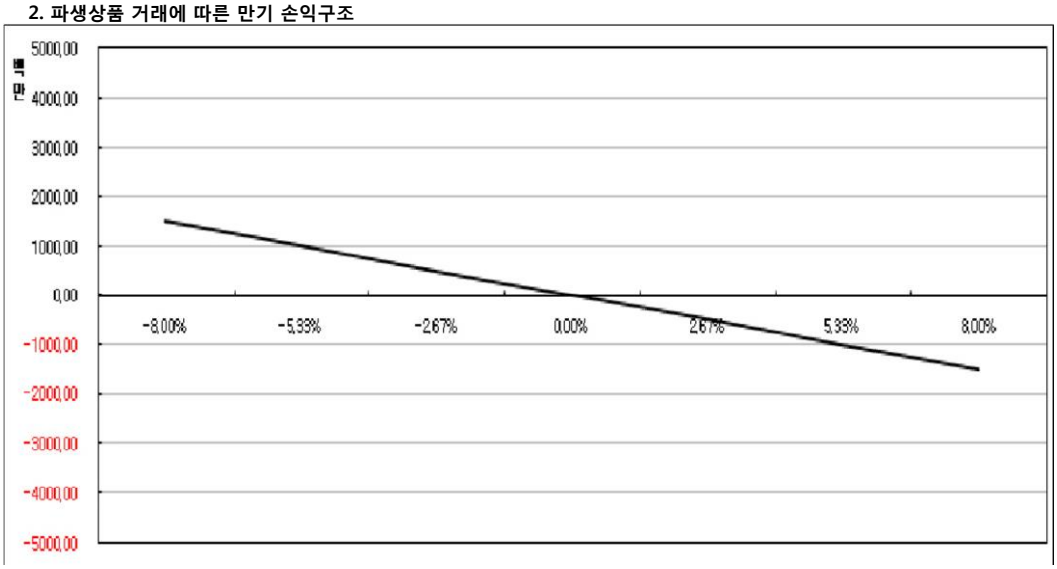
공시일: 2019-01-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	267	-267	장내
누계	주가지수	선물	0	2,538	-2,538	장내
합계			0	2,538	-2,538	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 204

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 178

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

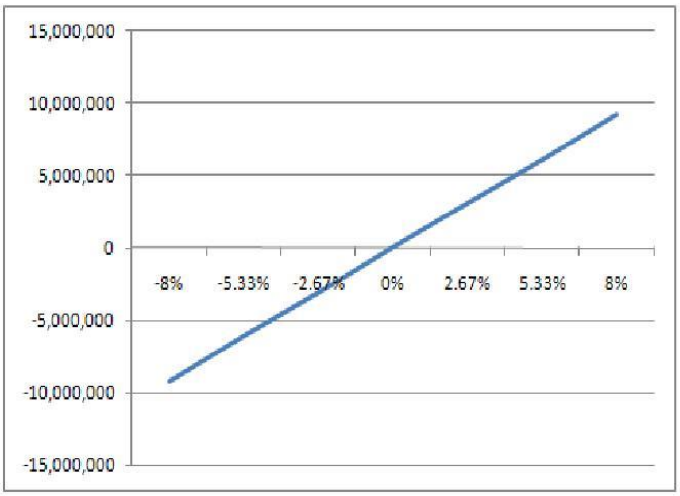
공시일: 2019-01-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	200	0	200	장내
누계	주가지수	선물	71,324	0	71,324	장내
합계			71,324	0	71,324	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,723

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

40,343