펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-15

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	3,710	0	3,710	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	46	14,044	-13,998	장내
합계			3,756	14,044	-10,289	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 650

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,750

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

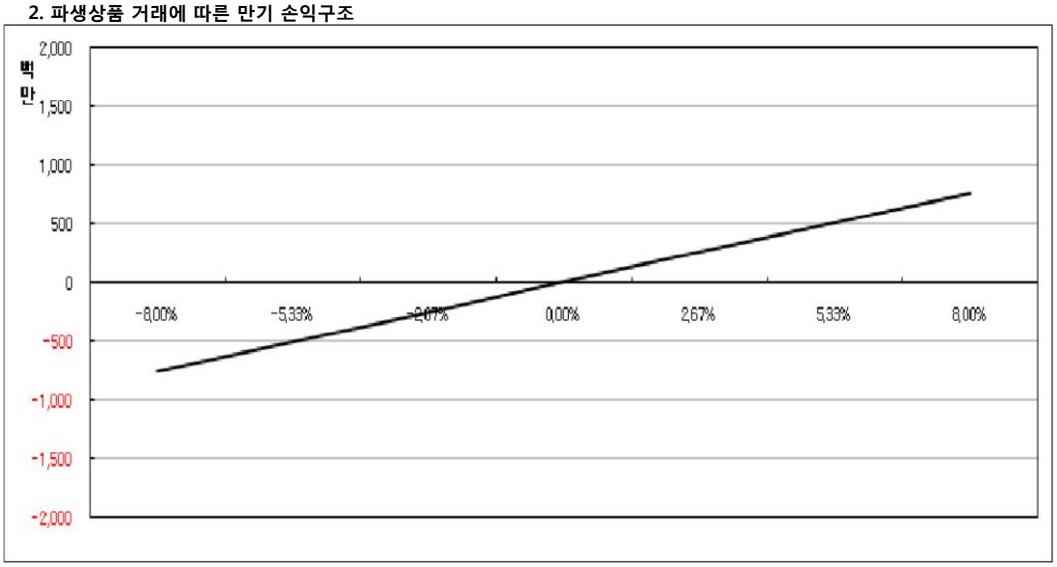
공시일: 2019-01-15

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	265	0	265	장내
합계			265	0	265	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,537

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

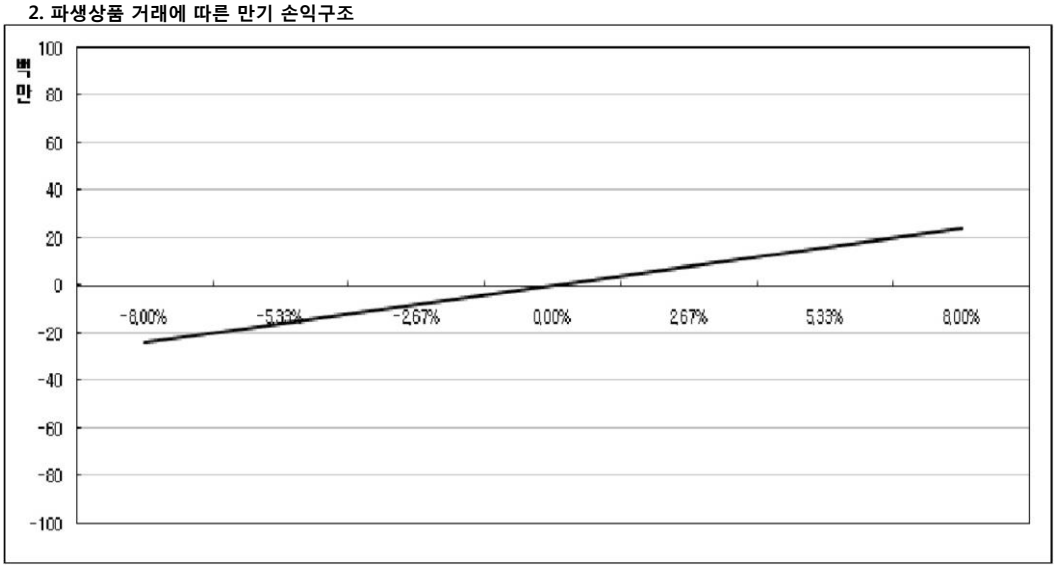
공시일: 2019-01-15

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	927	0	927	장내
합계			927	0	927	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,835

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

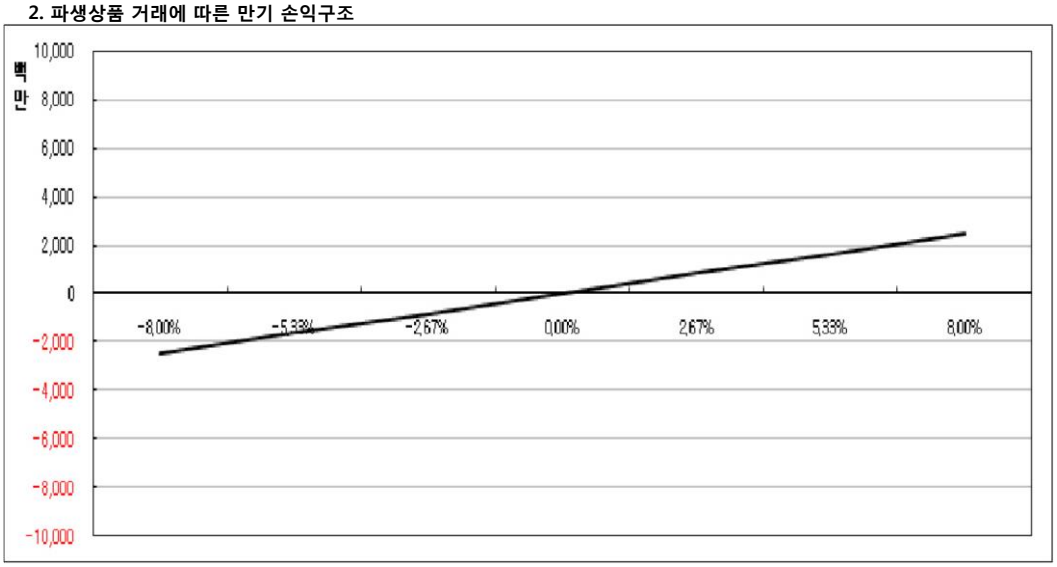
공시일: 2019-01-15

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	5,631	0	5,631	장내
합계			5,631	0	5,631	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 451

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,881

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

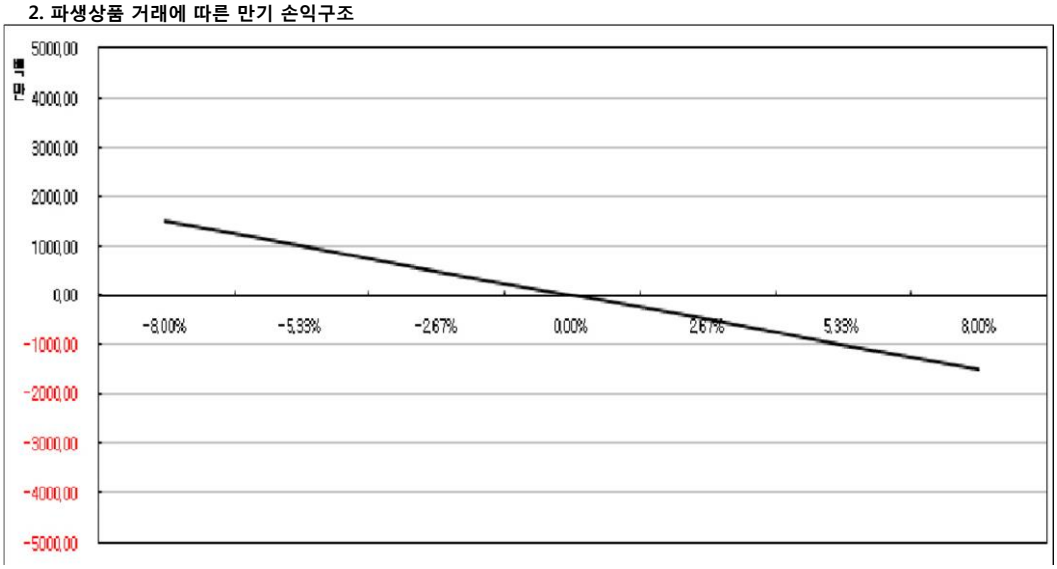
공시일: 2019-01-15

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	2,517	-2,517	장내
합계			0	2,517	-2,517	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 202

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 177

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

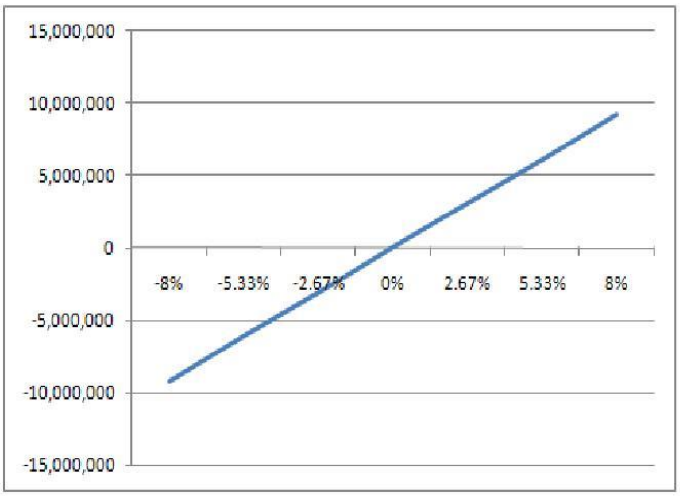
공시일: 2019-01-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	397	-397	장내
누계	주가지수	선물	70,355	0	70,355	장내
합계			70,355	0	70,355	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,637

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

39,442