펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	68	-68	장내
누계	주가지수	선물	3,729	0	3,729	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	19	14,375	-14,356	장내
합계			3,748	14,375	-10,627	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	299

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	8,574

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

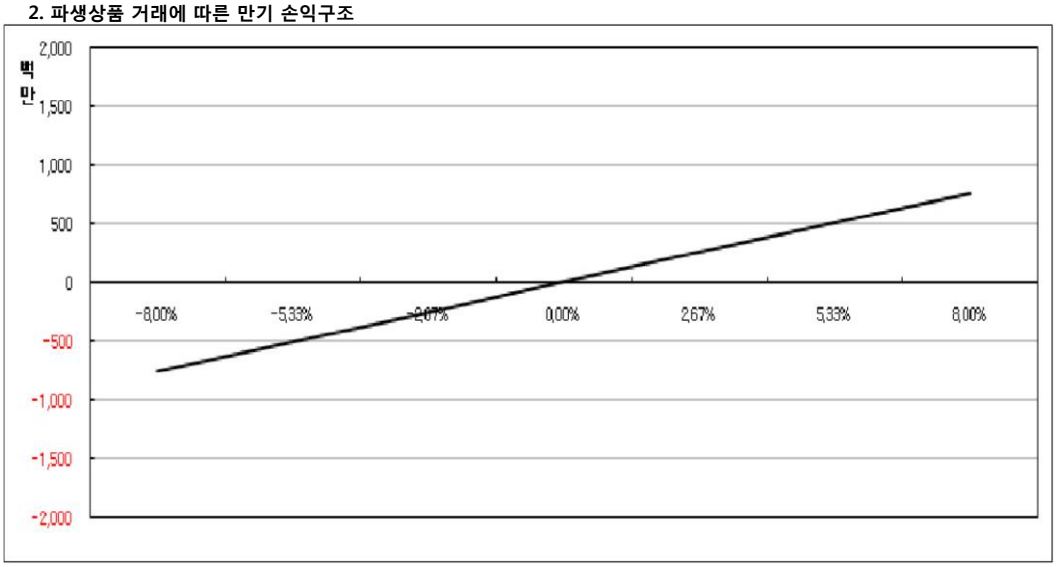
공시일: 2019-01-17

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	271	0	271	장내
합계			271	0	271	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,622

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

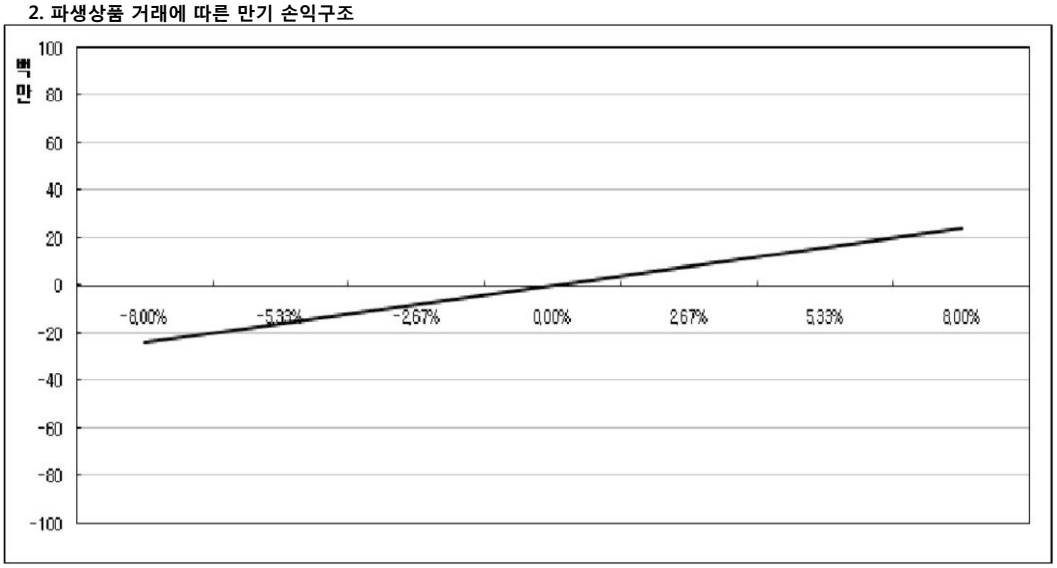
공시일: 2019-01-17

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	949	0	949	장내
합계			949	0	949	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,929

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

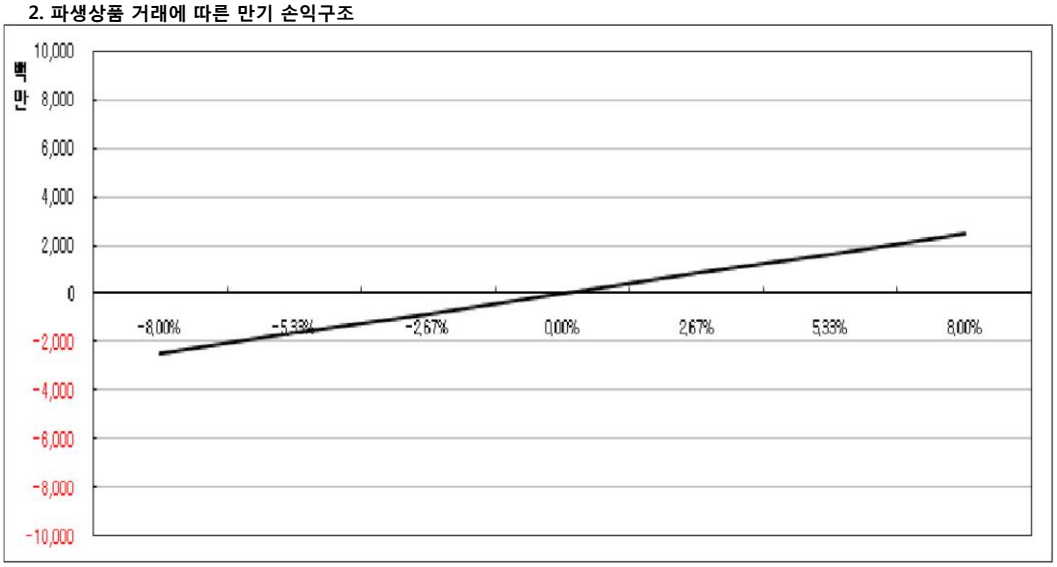
공시일: 2019-01-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	136	271	-136	장내
누계	주가지수	선물	5,628	0	5,628	장내
합계			5,628	0	5,628	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 452

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,040

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

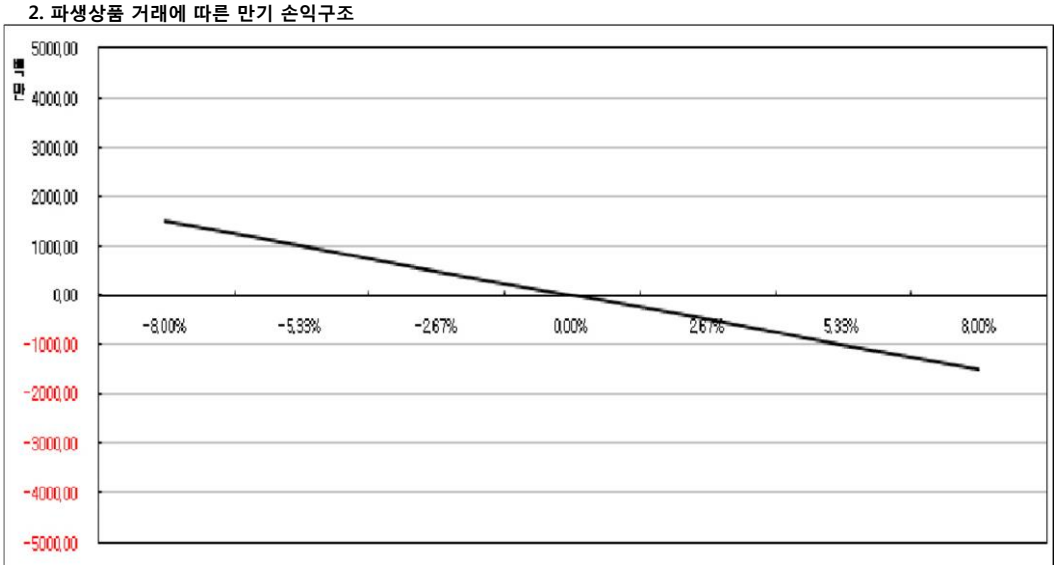
공시일: 2019-01-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	136	0	136	장내
누계	주가지수	선물	0	2,373	-2,373	장내
합계			0	2,373	-2,373	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 190

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 168

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

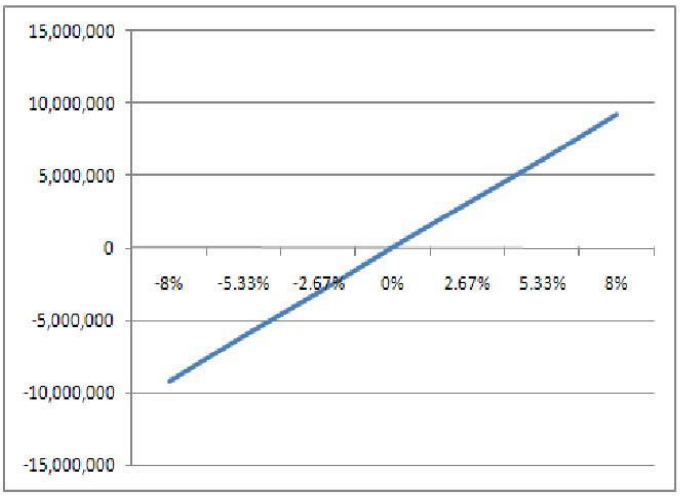
공시일: 2019-01-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	339	-339	장내
누계	주가지수	선물	72,622	0	72,622	장내
합계			72,622	0	72,622	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,828

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

40,762