펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-18

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	3,738	0	3,738	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	19	14,410	-14,391	장내
합계			3,757	14,410	-10,653	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	775

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	8,630

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

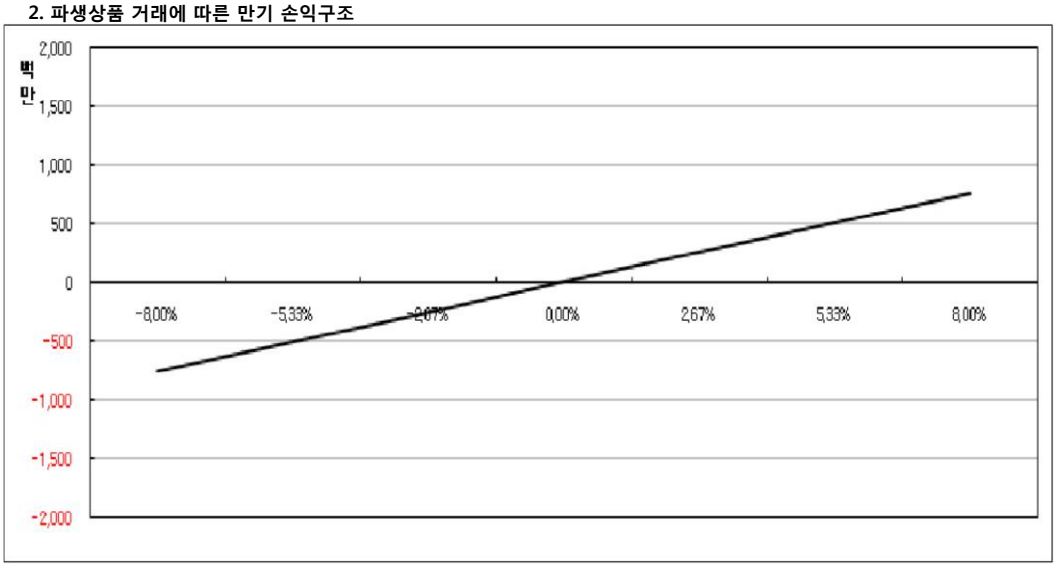
공시일: 2019-01-18

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	272	0	272	장내
합계			272	0	272	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,651

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

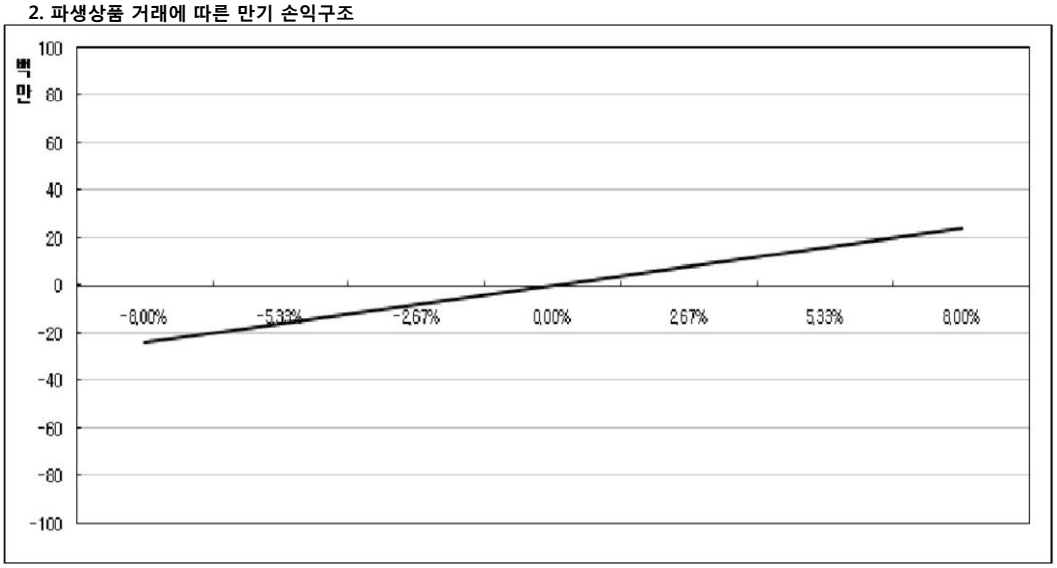
공시일: 2019-01-18

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	952	0	952	장내
합계			952	0	952	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,962

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

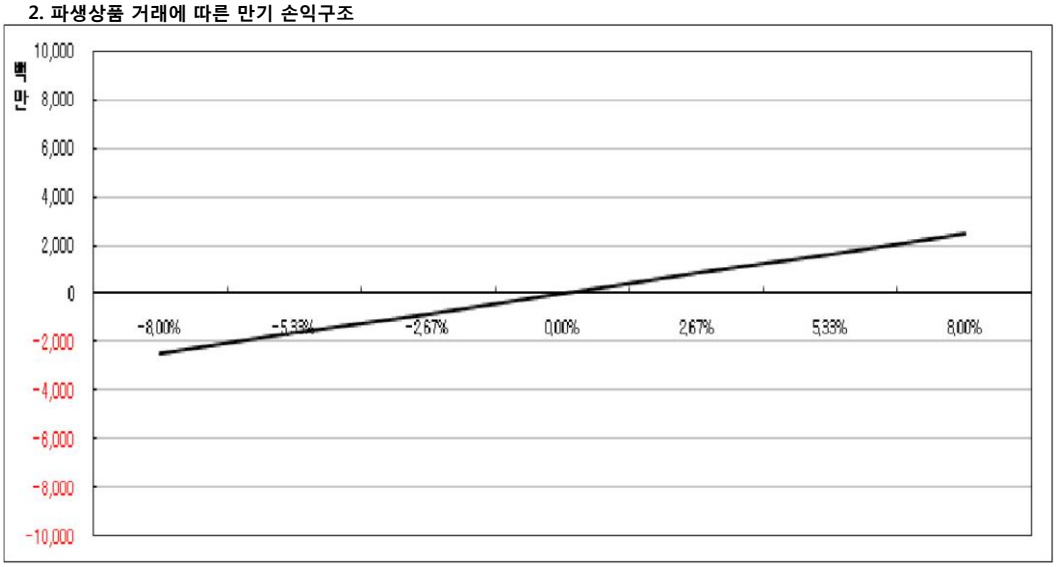
공시일: 2019-01-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	136	-136	장내
누계	주가지수	선물	5,506	0	5,506	장내
합계			5,506	0	5,506	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 441

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,091

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

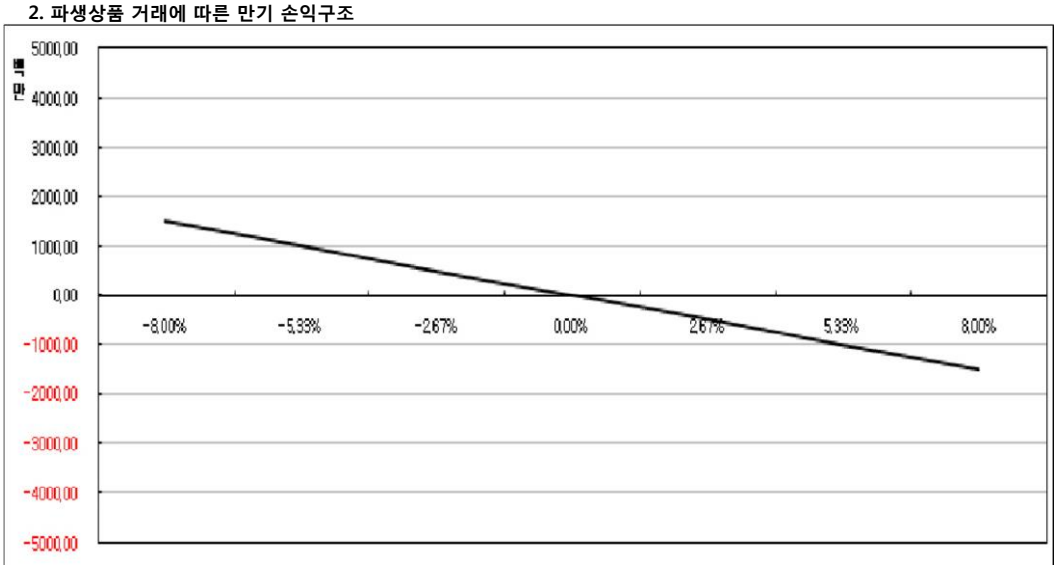
공시일: 2019-01-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	204	-204	장내
누계	주가지수	선물	0	2,583	-2,583	장내
합계			0	2,583	-2,583	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

207

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

183

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

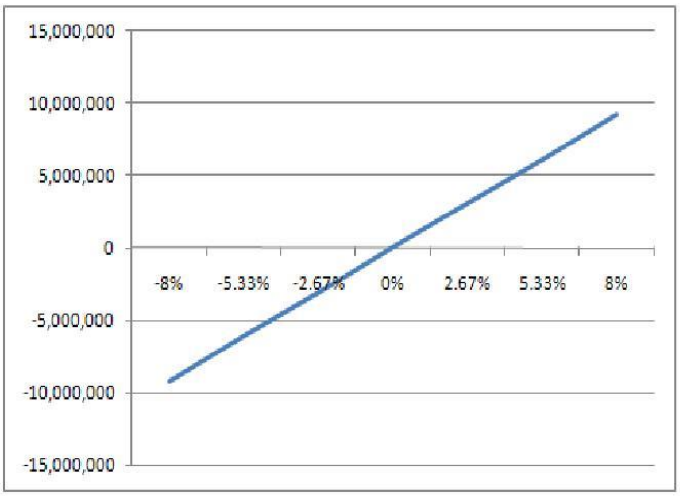
공시일: 2019-01-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,020	0	1,020	장내
누계	주가지수	선물	73,815	0	73,815	장내
합계			73,815	0	73,815	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,915

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	41,219