펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-23

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	3,750	0	3,750	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	13	14,454	-14,441	장내
합계			3,762	14,454	-10,691	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

797

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,495

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

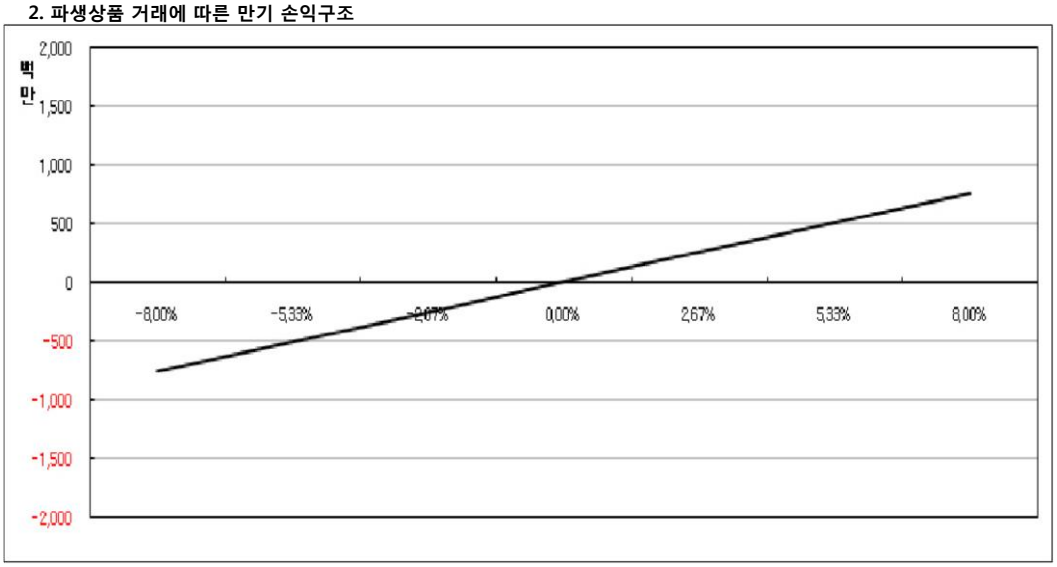
공시일: 2019-01-23

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	273	0	273	장내
합계			273	0	273	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,661

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

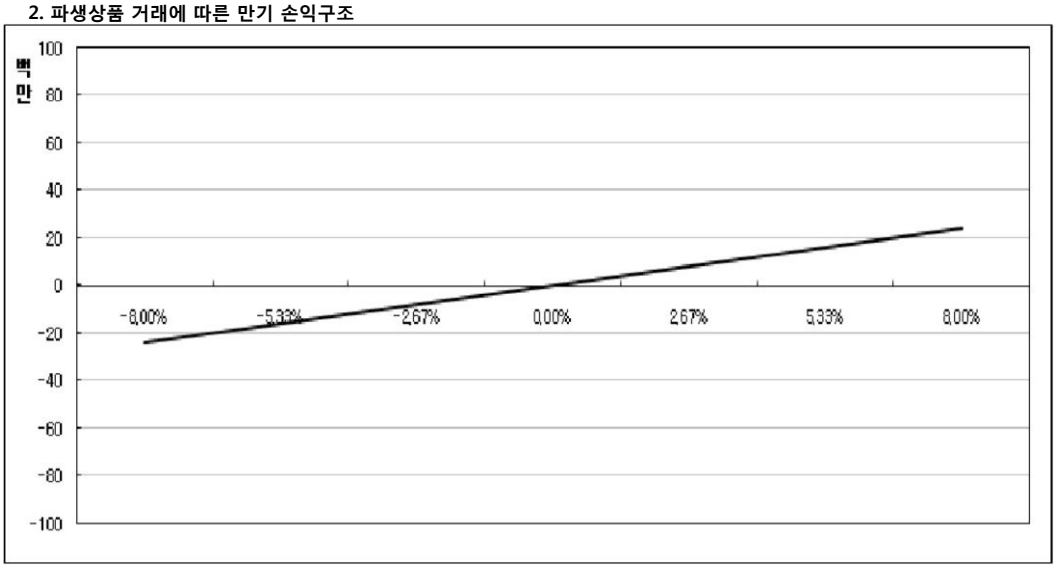
공시일: 2019-01-23

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	954	0	954	장내
합계			954	0	954	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,973

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

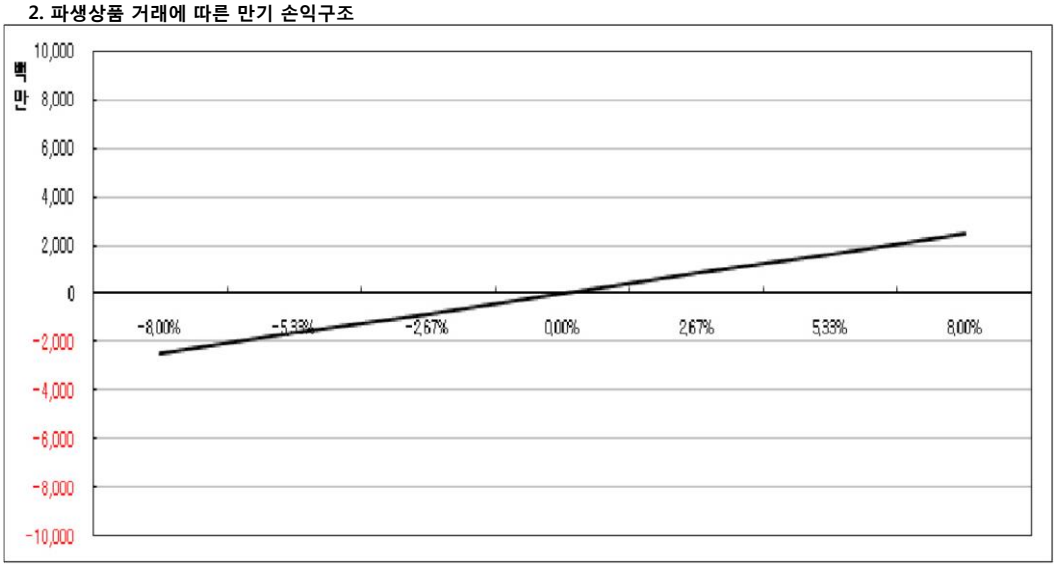
공시일: 2019-01-23

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	5,386	0	5,386	장내
합계			5,386	0	5,386	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

431

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,110

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

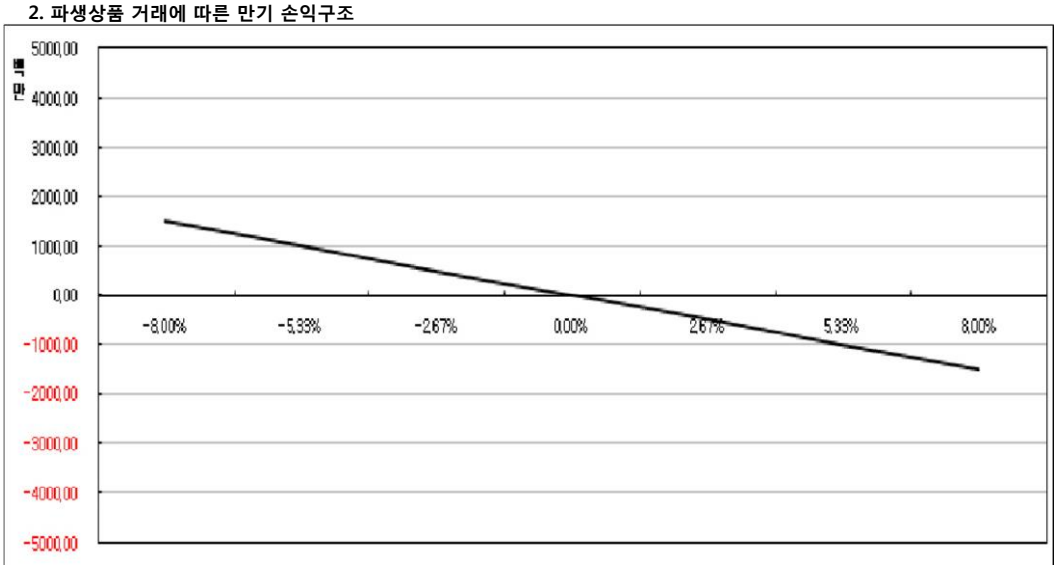
공시일: 2019-01-23

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	0	2,523	-2,523	장내
합계			0	2,523	-2,523	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

202

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

179

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

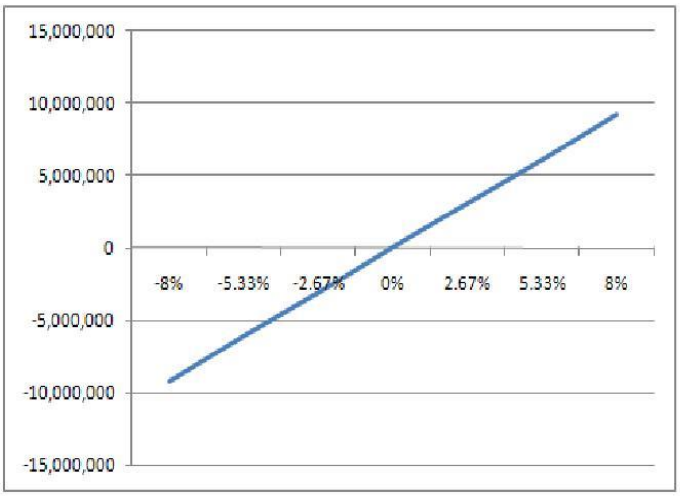
공시일: 2019-01-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	341	-341	장내
누계	주가지수	선물	71,245	0	71,245	장내
합계			71,245	0	71,245	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,708

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

41,335