펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	69	-69	장내
누계	주가지수	선물	3,734	0	3,734	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	5	14,660	-14,655	장내
합계			3,739	14,660	-10,921	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

853

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,469

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

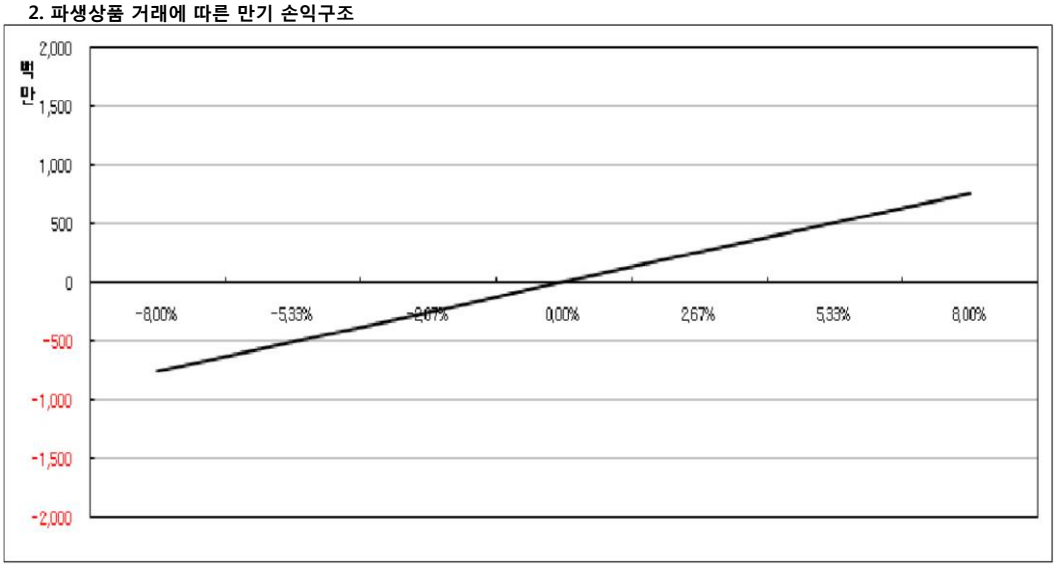
공시일: 2019-01-25

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	277	0	277	장내
합계			277	0	277	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,714

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

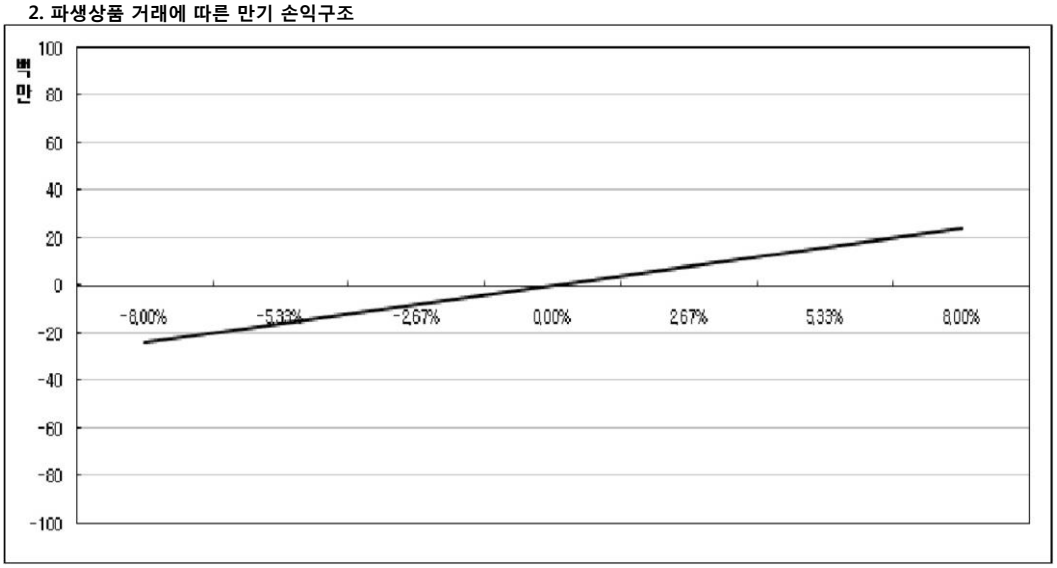
공시일: 2019-01-25

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	968	0	968	장내
합계			968	0	968	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 78

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,032

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

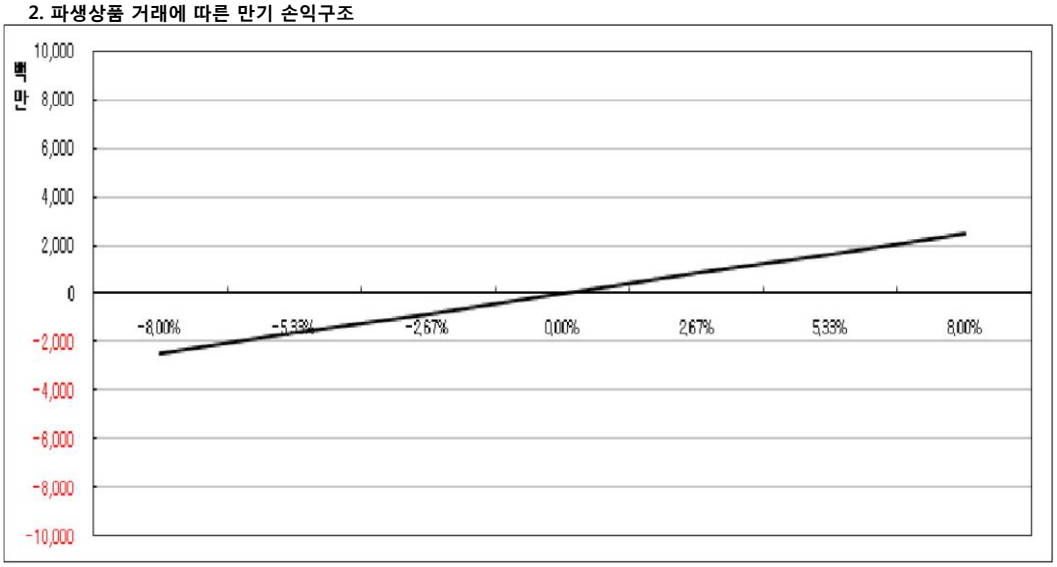
공시일: 2019-01-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	138	553	-415	장내
누계	주가지수	선물	5,186	0	5,186	장내
합계			5,186	0	5,186	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	416

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,203

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

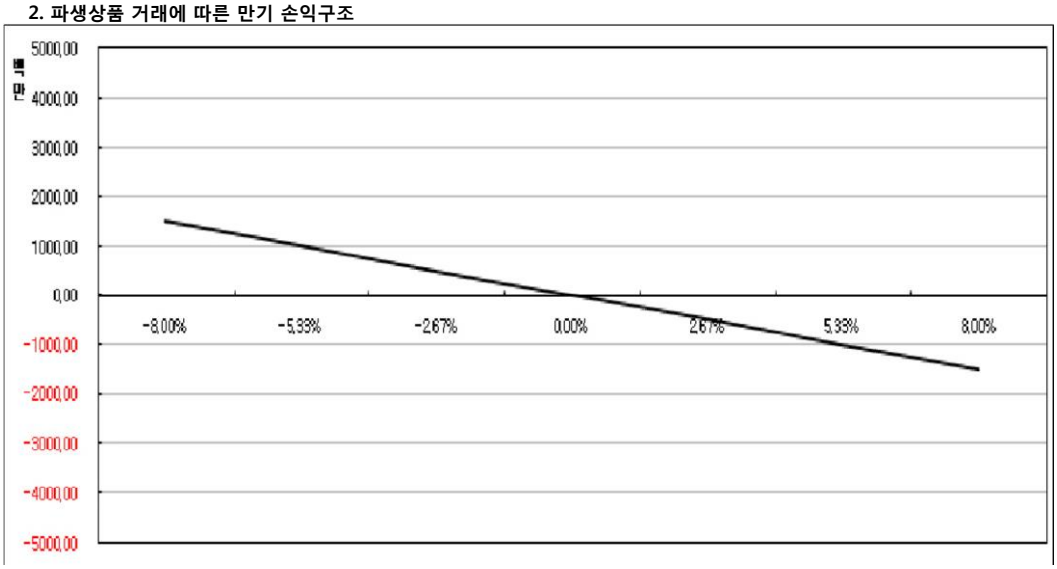
공시일: 2019-01-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	138	0	138	장내
누계	주가지수	선물	0	2,282	-2,282	장내
합계			0	2,282	-2,282	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	183

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	162

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

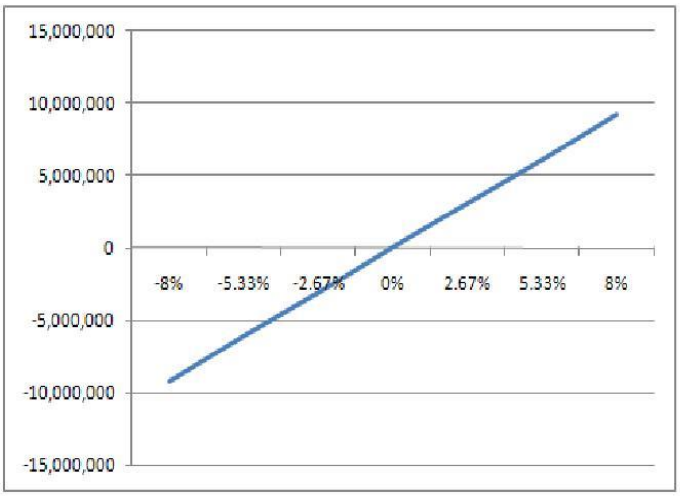
공시일: 2019-01-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	346	0	346	장내
누계	주가지수	선물	72,195	0	72,195	장내
합계			72,195	0	72,195	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,786

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

42,149