펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-01-31

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	3,869	0	3,869	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	15,191	-15,189	장내
합계			3,872	15,191	-11,319	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

880

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13,079

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

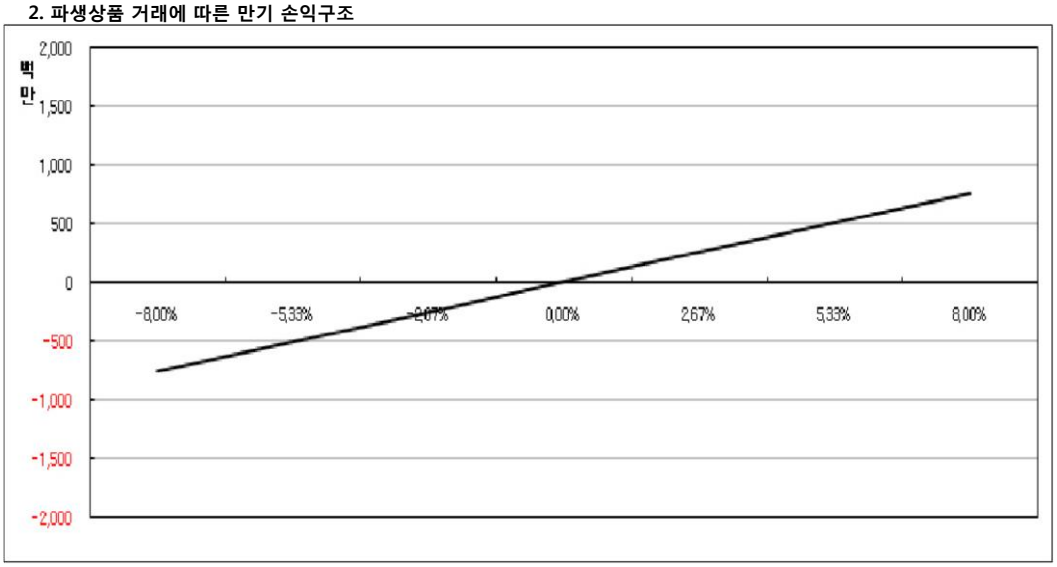
공시일: 2019-01-31

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	287	0	287	장내
합계			287	0	287	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,915

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

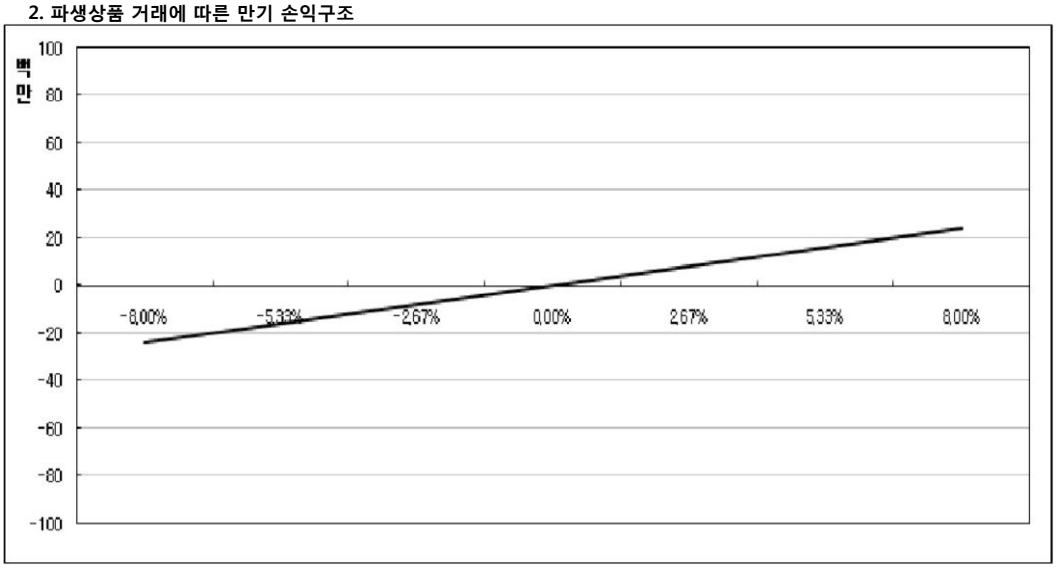
공시일: 2019-01-31

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	1,003	0	1,003	장내
합계			1,003	0	1,003	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 81

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,259

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

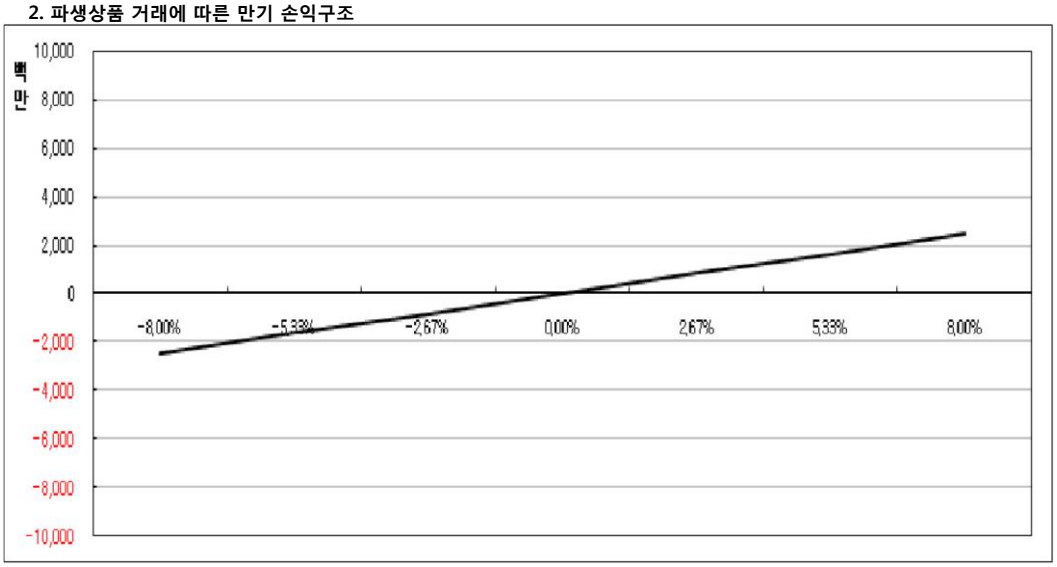
공시일: 2019-01-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	215	0	215	장내
누계	주가지수	선물	5,374	0	5,374	장내
합계			5,374	0	5,374	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 431

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,600

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

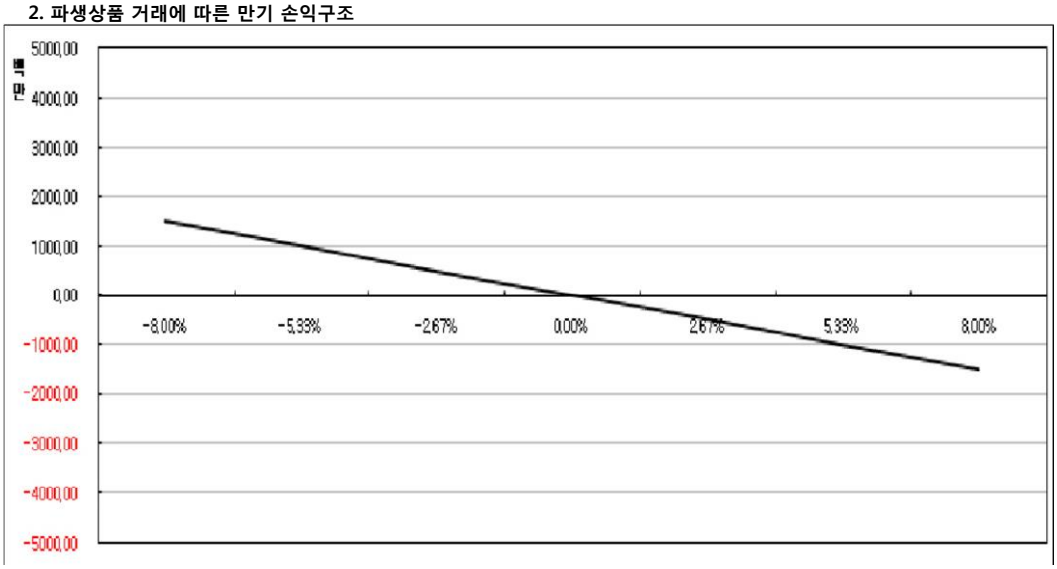
공시일: 2019-01-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	143	0	143	장내
누계	주가지수	선물	0	2,795	-2,795	장내
합계			0	2,795	-2,795	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 224

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 200

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

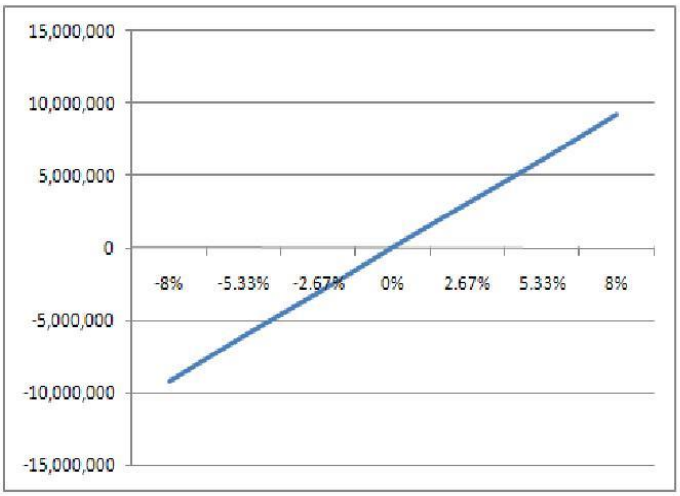
공시일: 2019-01-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	287	-287	장내
누계	주가지수	선물	74,306	0	74,306	장내
합계			74,306	0	74,306	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,965

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 45,405