펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-01

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	3,860	0	3,860	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	2	15,152	-15,151	장내
합계			3,861	15,152	-11,291	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

891

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11,647

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

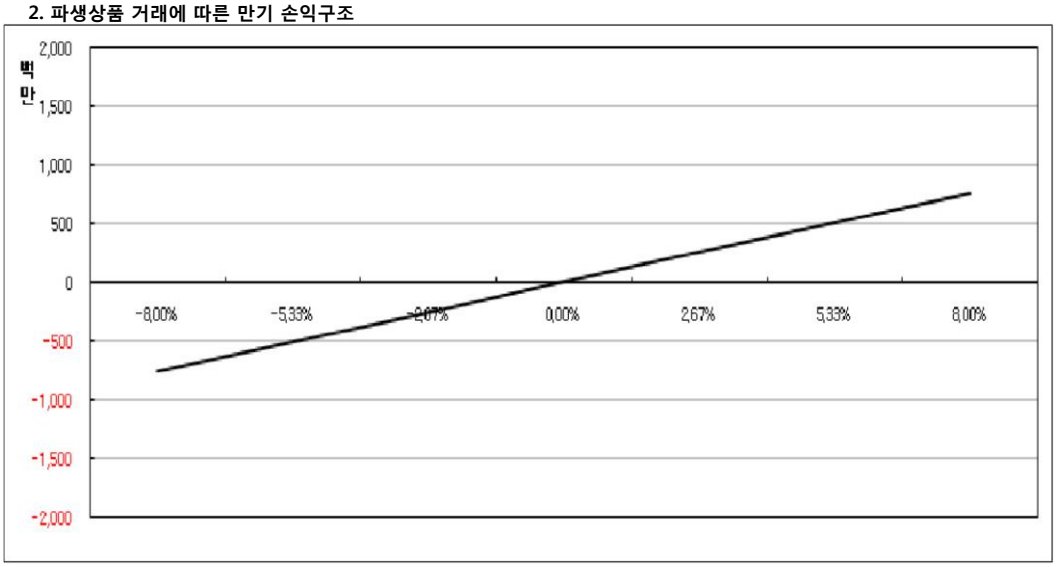
공시일: 2019-02-01

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	286	0	286	장내
합계			286	0	286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,900

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

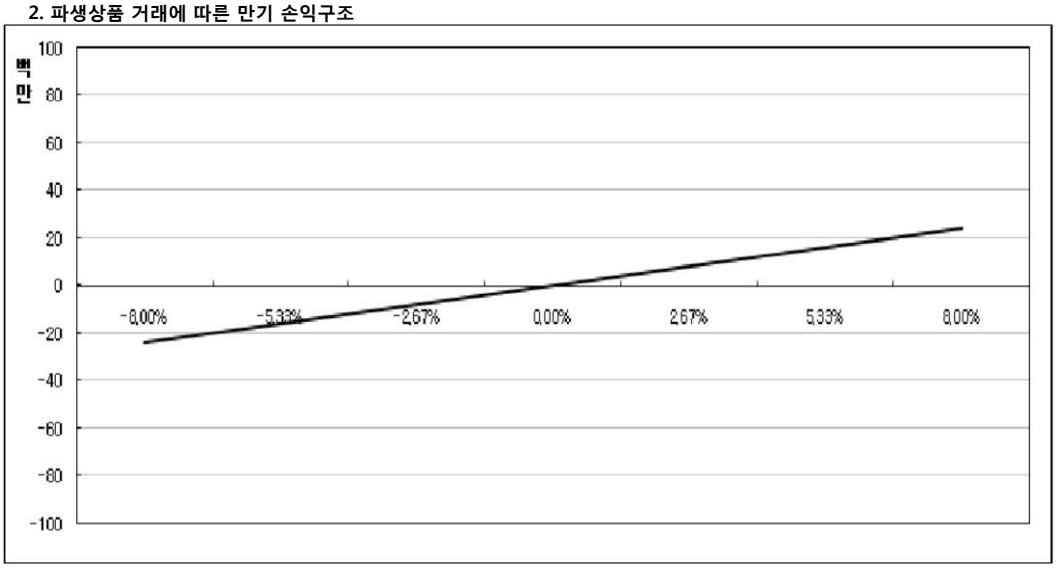
공시일: 2019-02-01

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	1,001	0	1,001	장내
합계			1,001	0	1,001	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	80

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,242

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

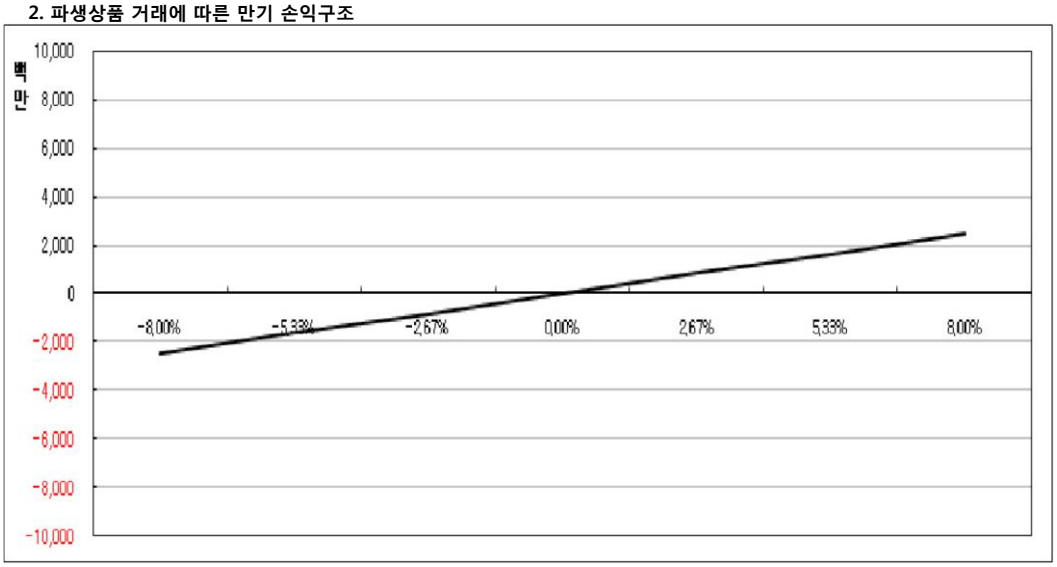
공시일: 2019-02-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	429	-429	장내
누계	주가지수	선물	4,932	0	4,932	장내
합계			4,932	0	4,932	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	396

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,561

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

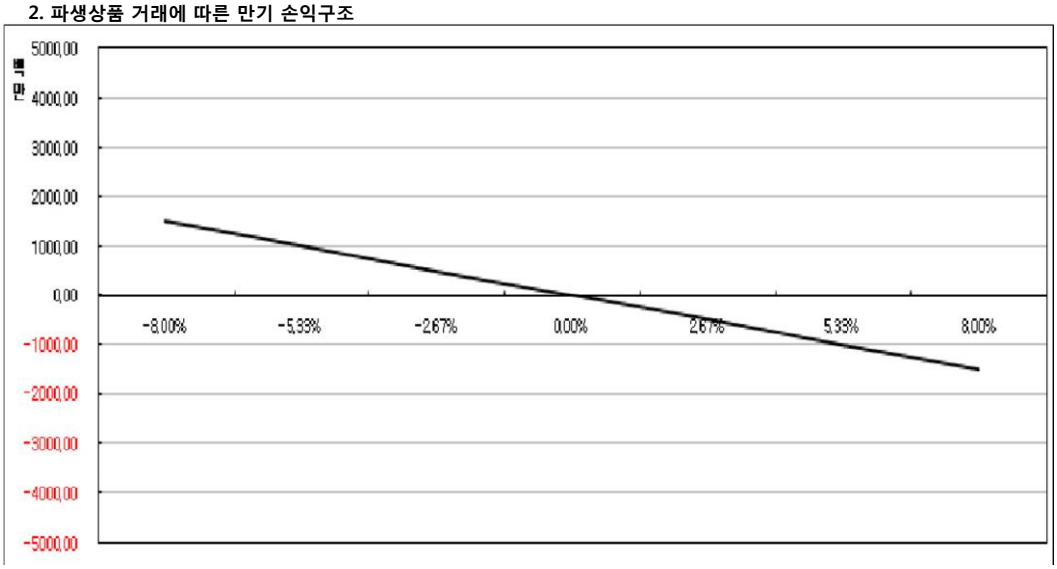
공시일: 2019-02-01

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	0	2,787	-2,787	장내
합계			0	2,787	-2,787	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	224

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	199

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

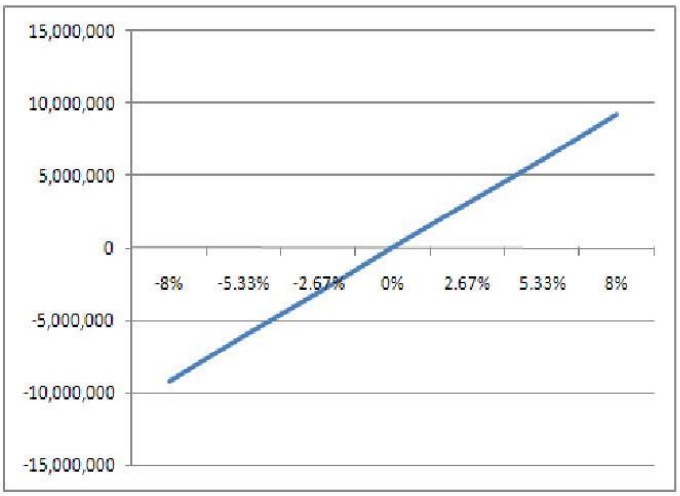
공시일: 2019-02-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,858	-1,858	장내
누계	주가지수	선물	72,259	0	72,259	장내
합계			72,259	0	72,259	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,802

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	45,125