펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-08

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	3,856	0	3,856	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	15,139	-15,139	장내
합계			3,857	15,139	-11,283	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	899

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	6,073

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

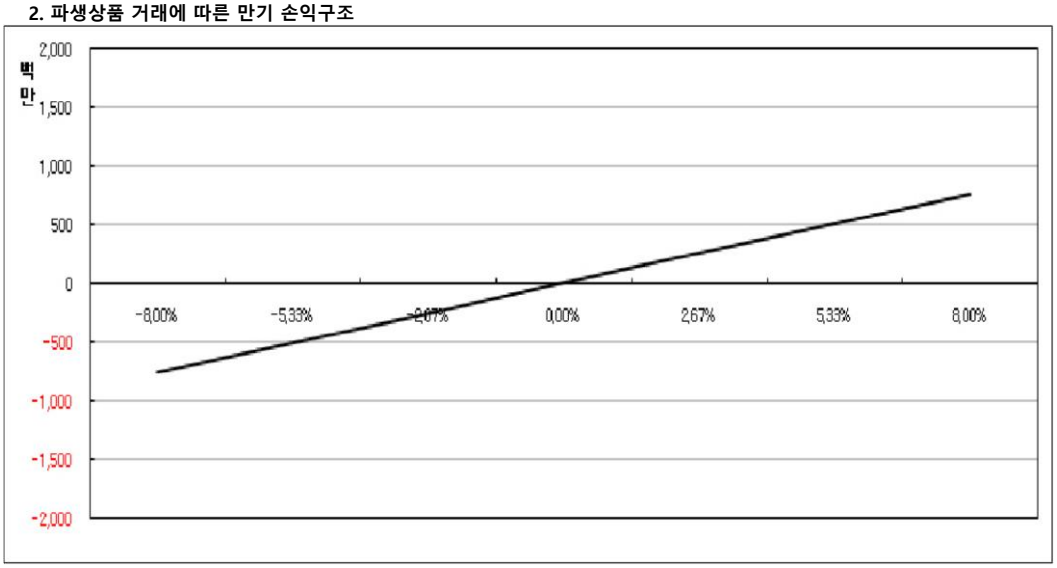
공시일: 2019-02-08

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)	2,912

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

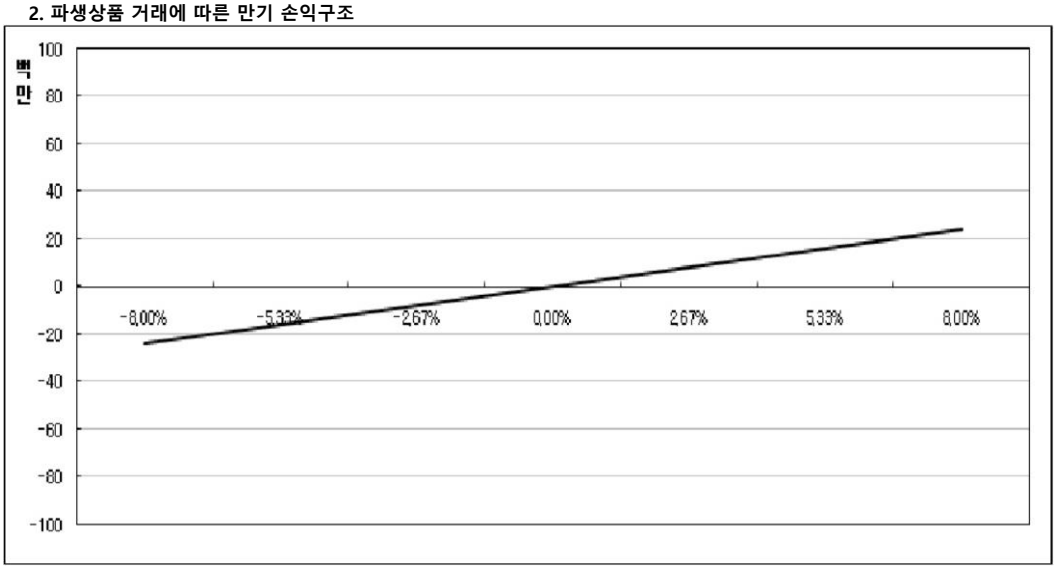
공시일: 2019-02-08

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	1,000	0	1,000	장내
합계			1,000	0	1,000	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 80

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,253

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

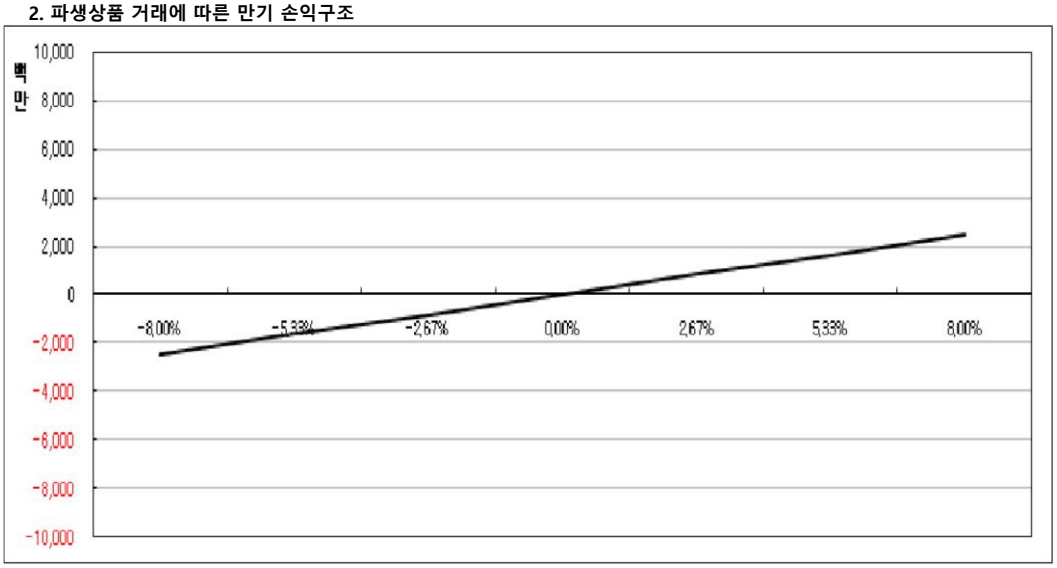
공시일: 2019-02-08

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	4,713	0	4,713	장내
합계			4,713	0	4,713	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	378

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,570

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

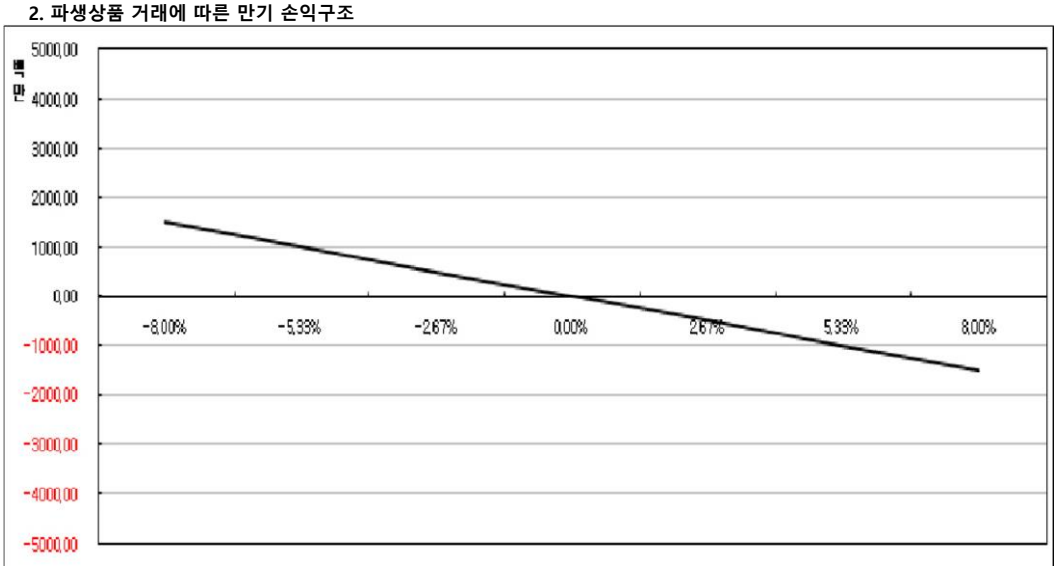
공시일: 2019-02-08

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	2,999	-2,999	장내
합계			0	2,999	-2,999	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	240

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	209

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

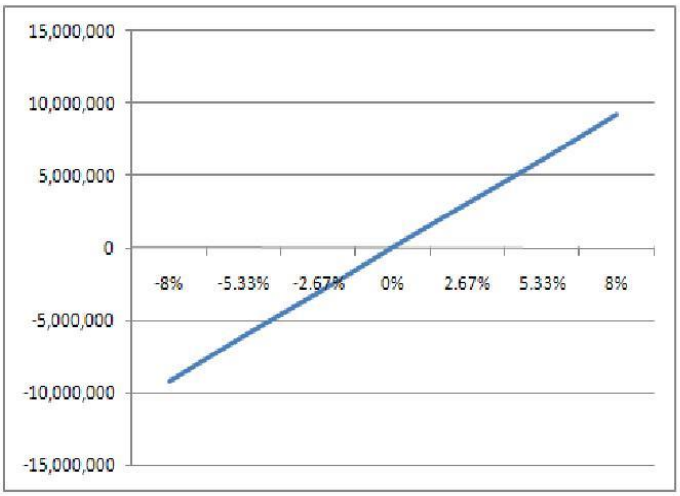
공시일: 2019-02-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	214	-214	장내
누계	주가지수	선물	71,698	0	71,698	장내
합계			71,698	0	71,698	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,743

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	45,174