펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-12

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	3,808	0	3,808	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	14,951	-14,951	장내
합계			3,809	14,951	-11,143	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	890

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,905

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

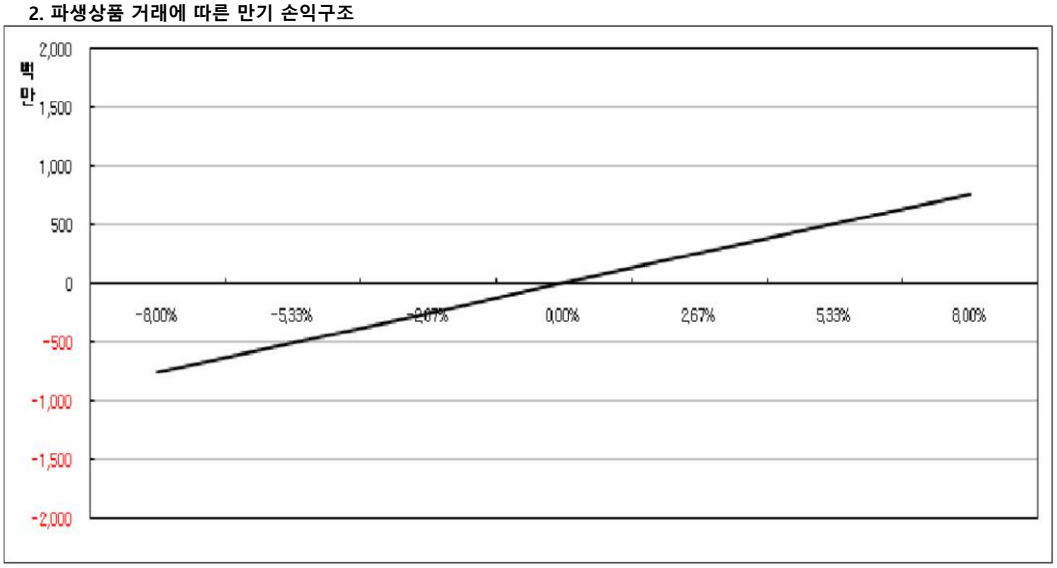
공시일: 2019-02-12

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	282	0	282	장내
합계			282	0	282	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,839

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

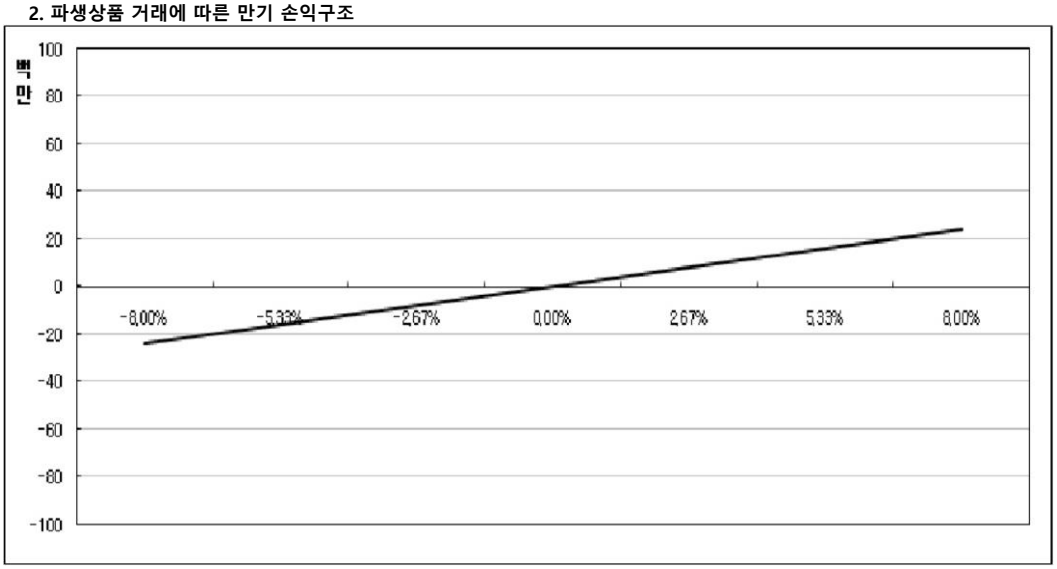
공시일: 2019-02-12

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	846	0	846	장내
합계			846	0	846	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,170

하나UBS자산운용

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

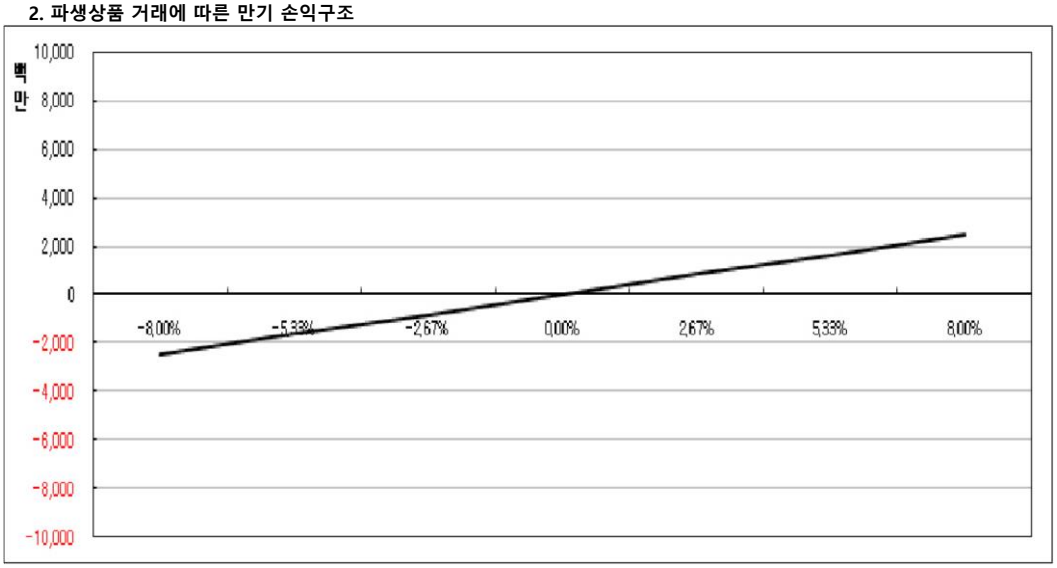
공시일: 2019-02-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	141	0	141	장내
누계	주가지수	선물	4,443	0	4,443	장내
합계			4,443	0	4,443	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 356

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,429

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

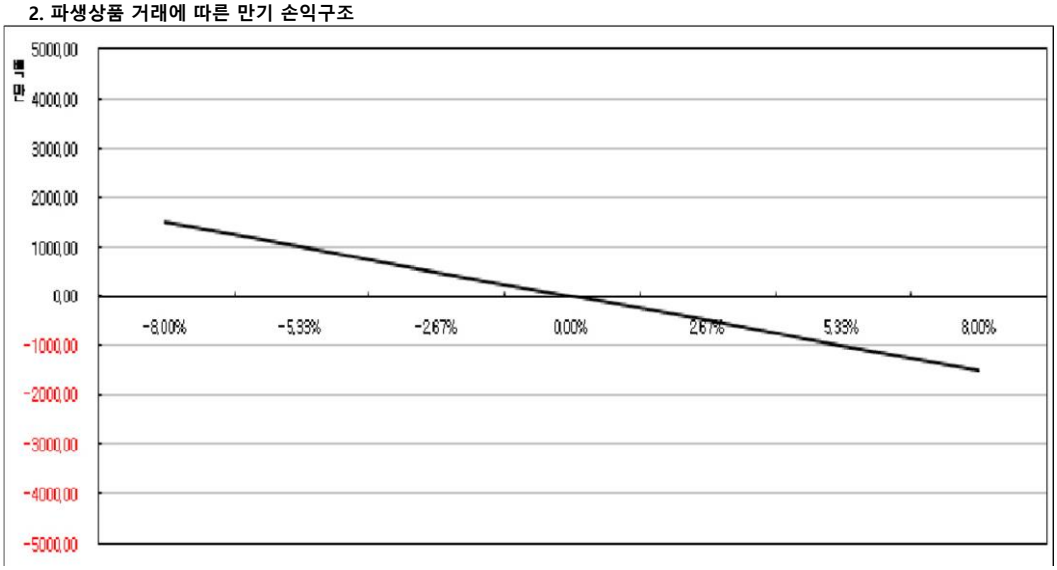
공시일: 2019-02-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	282	71	212	장내
누계	주가지수	선물	0	2,892	-2,892	장내
합계			0	2,892	-2,892	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 232

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 200

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

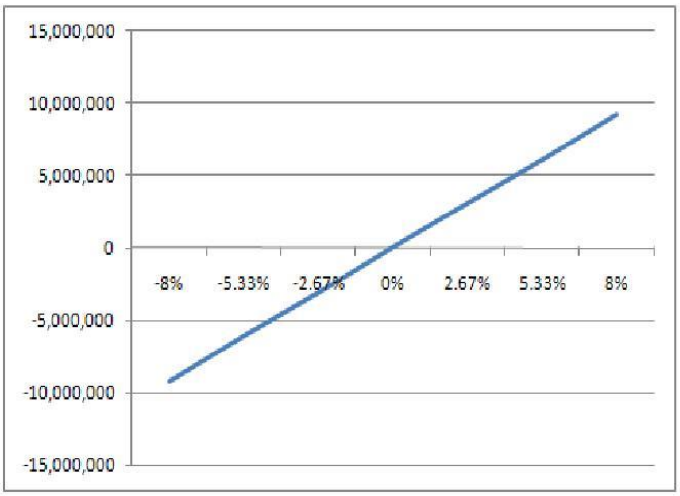
공시일: 2019-02-12

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	70,102	0	70,102	장내
합계			70,102	0	70,102	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,619

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 44,065