펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-15

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	3,897	0	3,897	장내
신규	주가지수	옵션	1,106	21,634	-20,528	장내
누계	주가지수	옵션	27	14,417	-14,390	장내
합계			3,924	14,417	-10,493	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	669

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	4,016

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

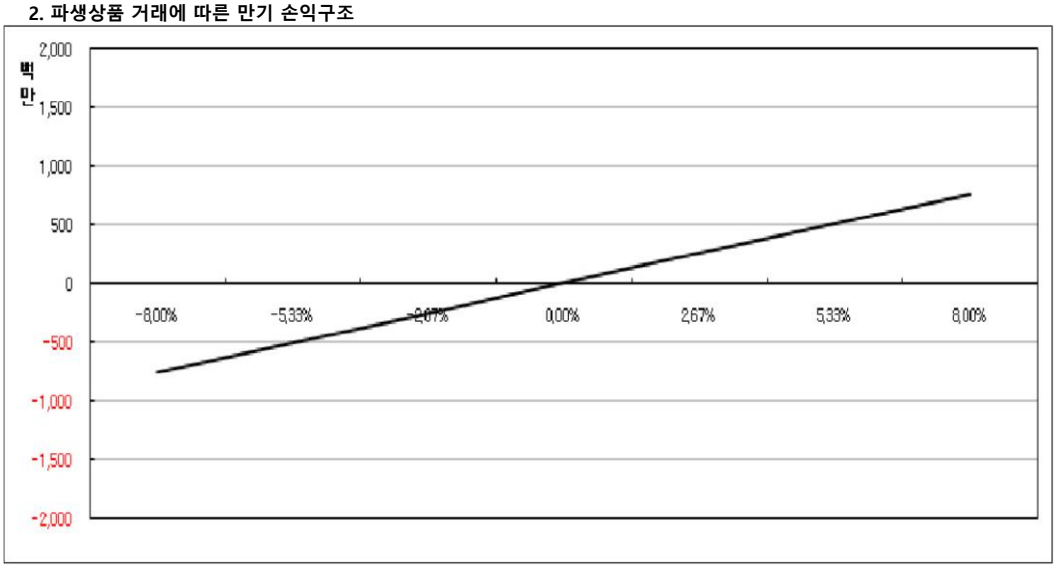
공시일: 2019-02-15

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	289	0	289	장내
합계			289	0	289	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,984

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

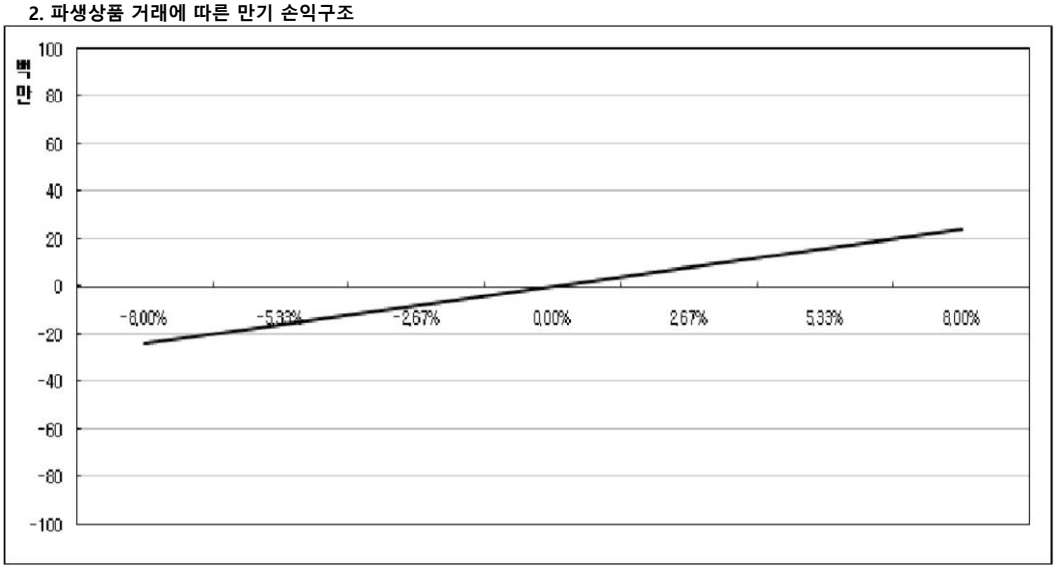
공시일: 2019-02-15

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	866	0	866	장내
합계			866	0	866	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,330

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

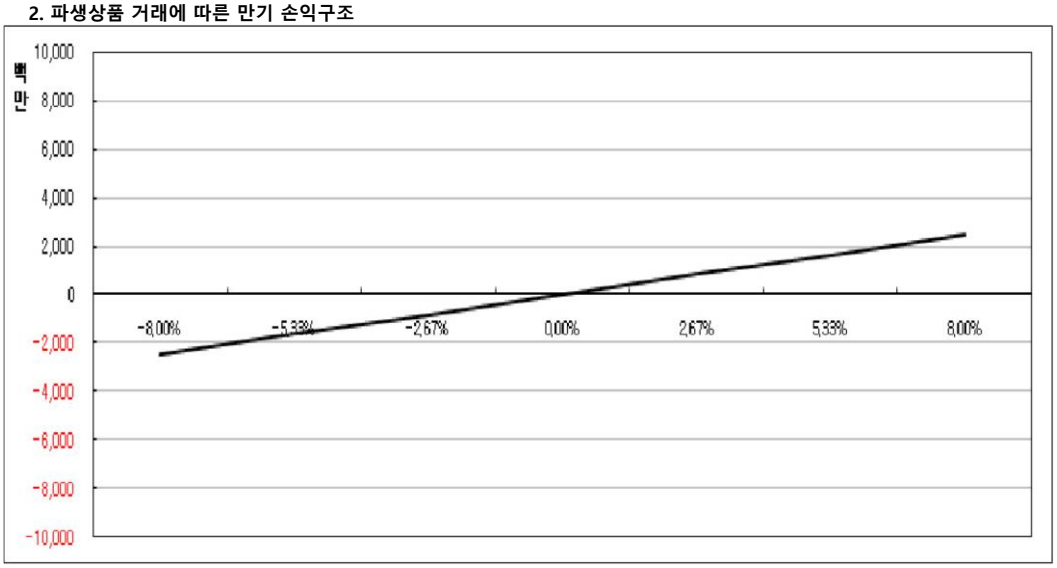
공시일: 2019-02-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	144	217	-72	장내
누계	주가지수	선물	4,475	0	4,475	장내
합계			4,475	0	4,475	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 358

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,698

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

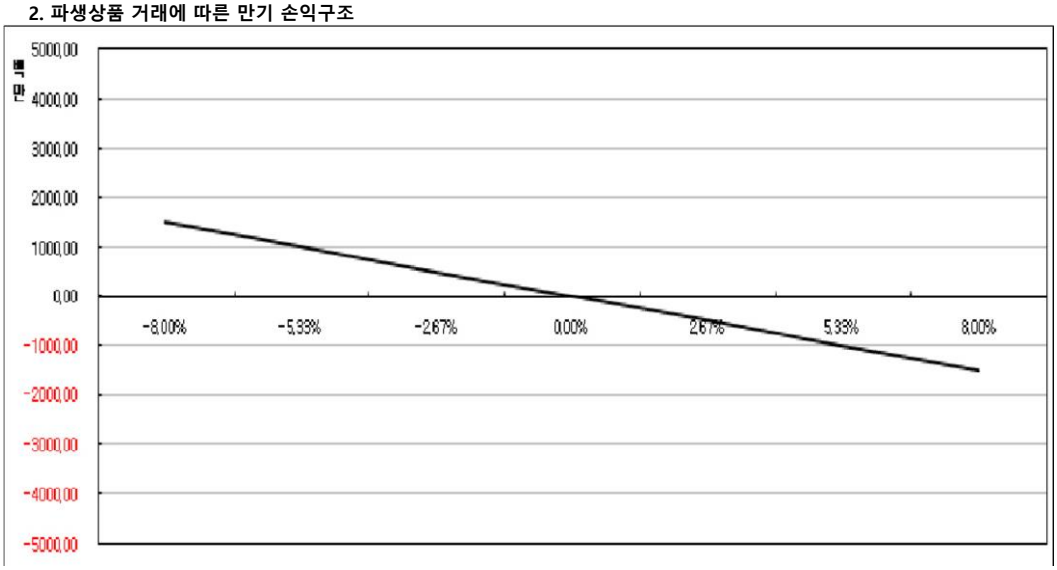
공시일: 2019-02-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	72	-72	장내
누계	주가지수	선물	0	3,031	-3,031	장내
합계			0	3,031	-3,031	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 242

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 209

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

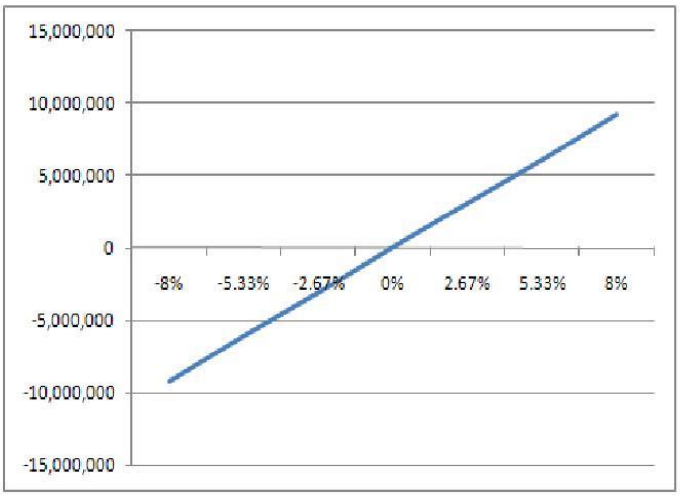
공시일: 2019-02-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	505	0	505	장내
누계	주가지수	선물	72,531	0	72,531	장내
합계			72,531	0	72,531	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,796

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	46,234