펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	284	-284	장내
누계	주가지수	선물	3,550	0	3,550	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	40	14,341	-14,301	장내
합계			3,589	14,341	-10,752	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	672

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,851

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

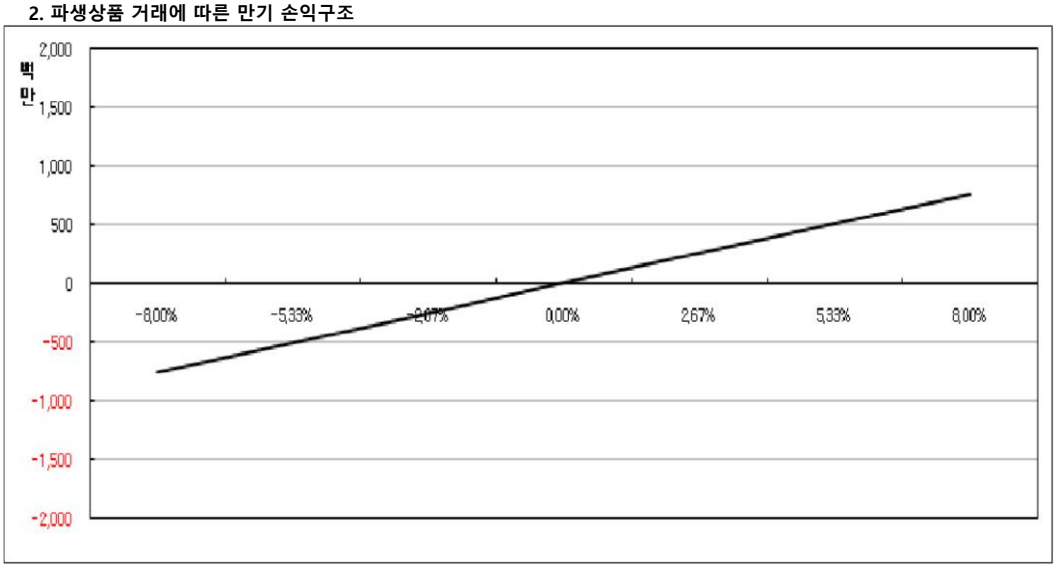
공시일: 2019-02-18

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	284	0	284	장내
합계			284	0	284	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,892

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

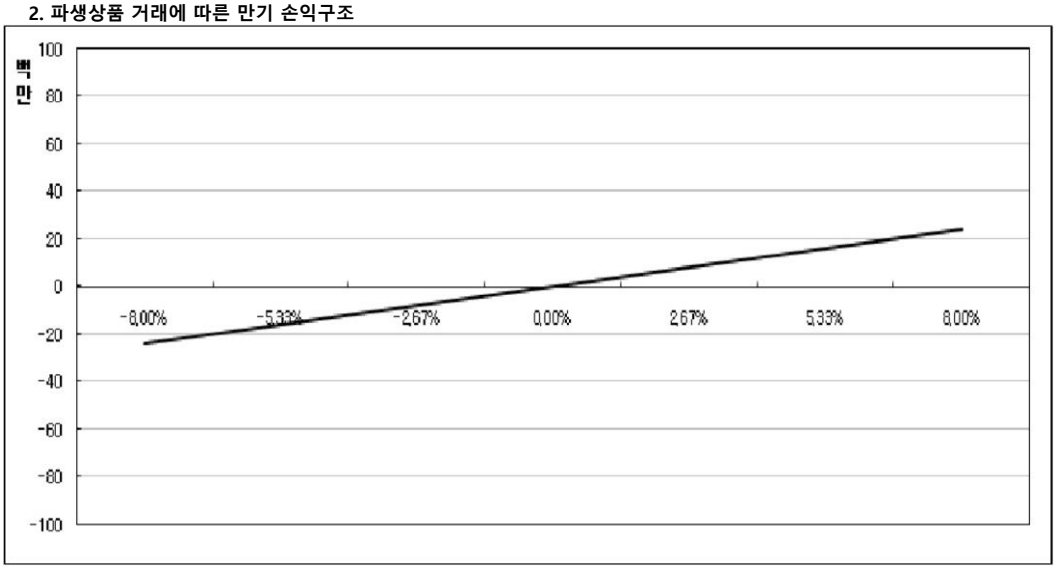
공시일: 2019-02-18

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	852	0	852	장내
합계			852	0	852	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,227

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

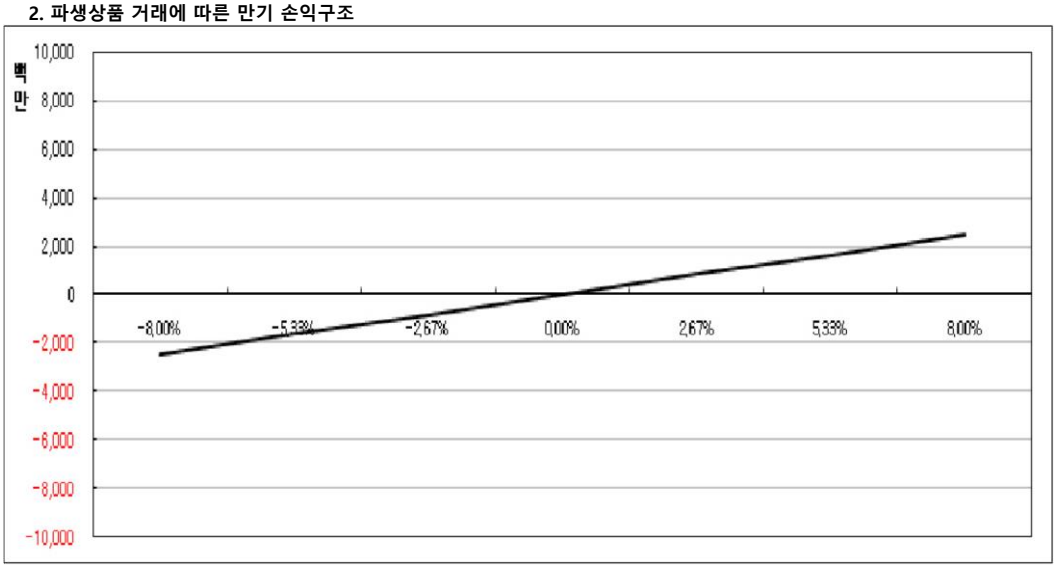
공시일: 2019-02-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	426	284	142	장내
누계	주가지수	선물	4,544	0	4,544	장내
합계			4,544	0	4,544	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 364

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,528

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

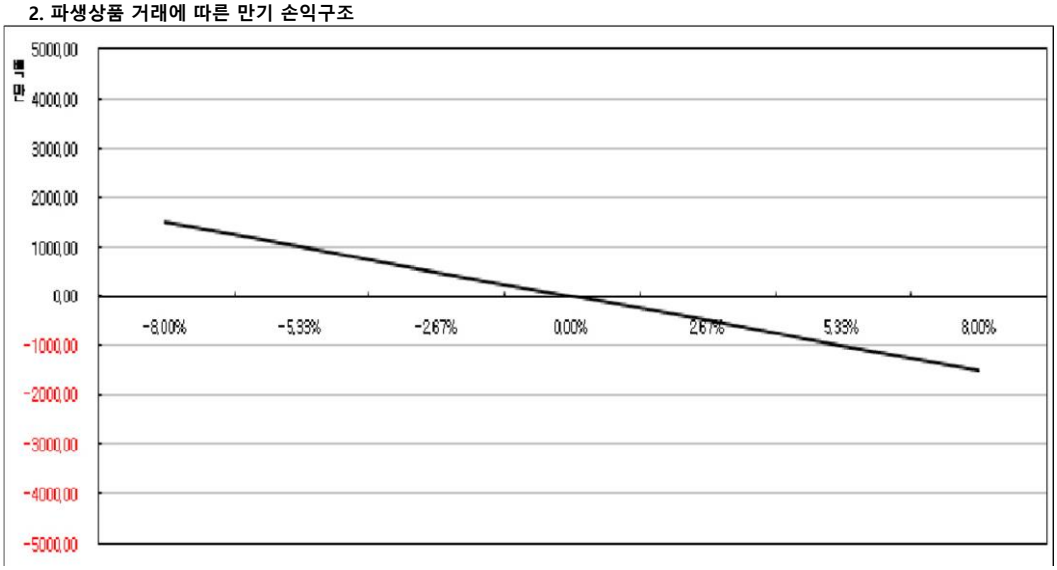
공시일: 2019-02-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	213	0	213	장내
누계	주가지수	선물	0	2,769	-2,769	장내
합계			0	2,769	-2,769	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 222

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 192

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

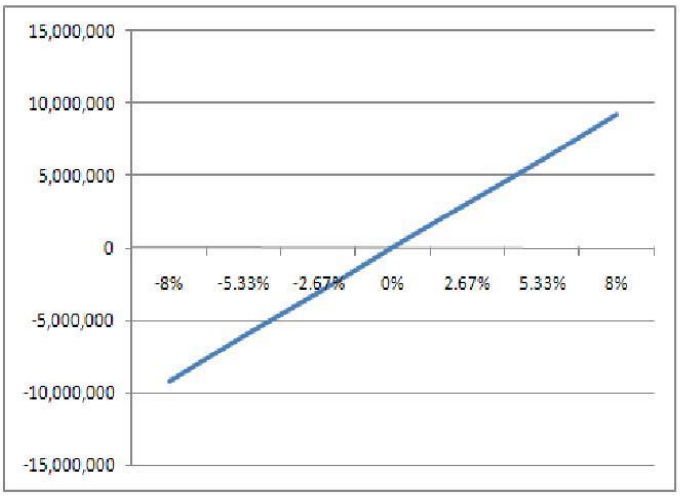
공시일: 2019-02-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	994	-994	장내
누계	주가지수	선물	70,356	0	70,356	장내
합계			70,356	0	70,356	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,632

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 44,824