펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-03-04

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	3,548	0	3,548	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	27	14,332	-14,305	장내
합계			3,574	14,332	-10,758	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	666

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,052

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

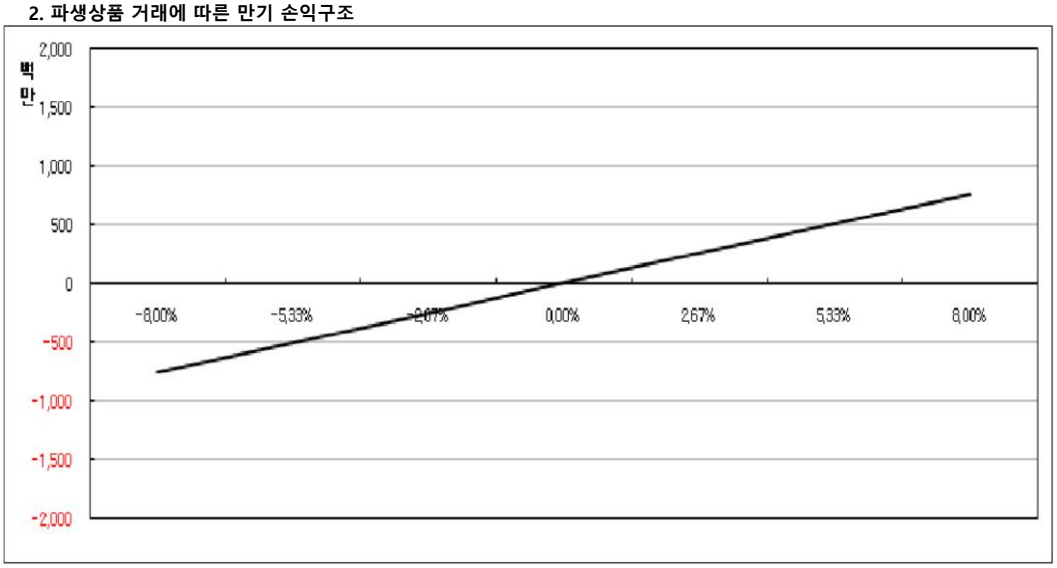
공시일: 2019-03-04

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)	2,832

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

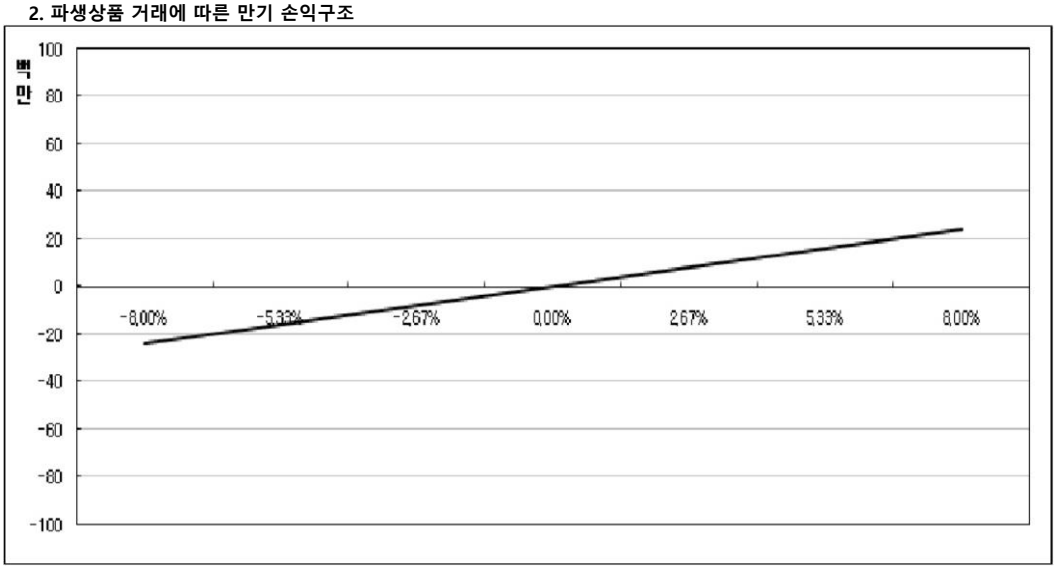
공시일: 2019-03-04

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	851	0	851	장내
합계			851	0	851	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,161

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

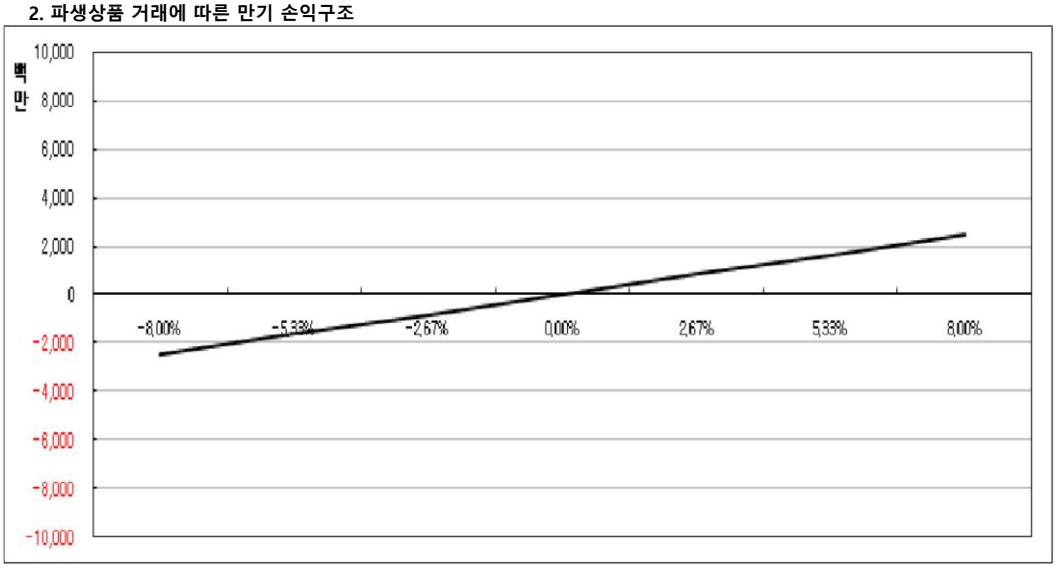
공시일: 2019-03-04

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	4,470	0	4,470	장내
합계			4,470	0	4,470	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

358

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,413

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

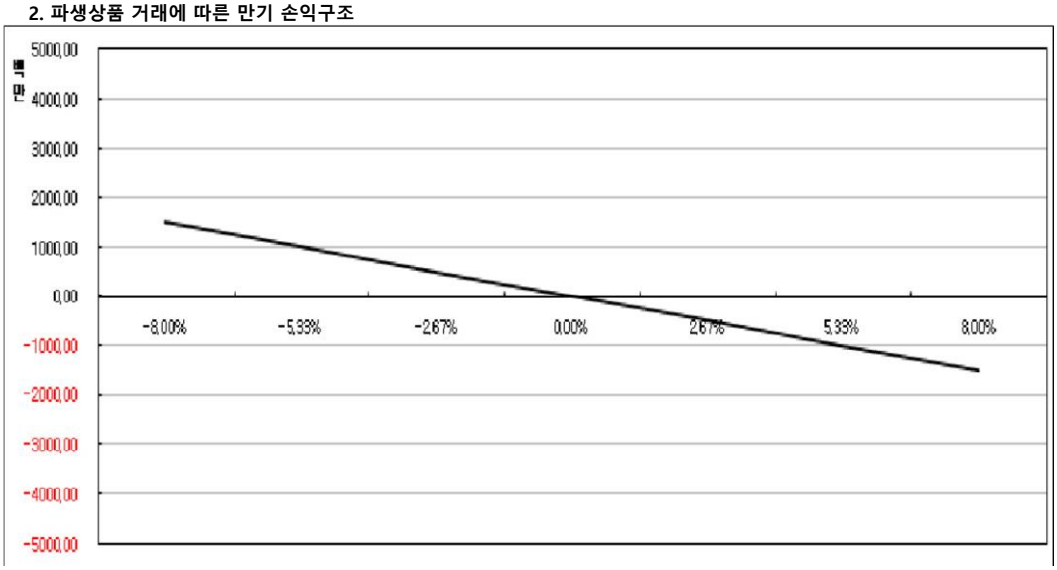
공시일: 2019-03-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	142	-142	장내
누계	주가지수	선물	0	2,980	-2,980	장내
합계			0	2,980	-2,980	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

238

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

205

하나UBS자산운용

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

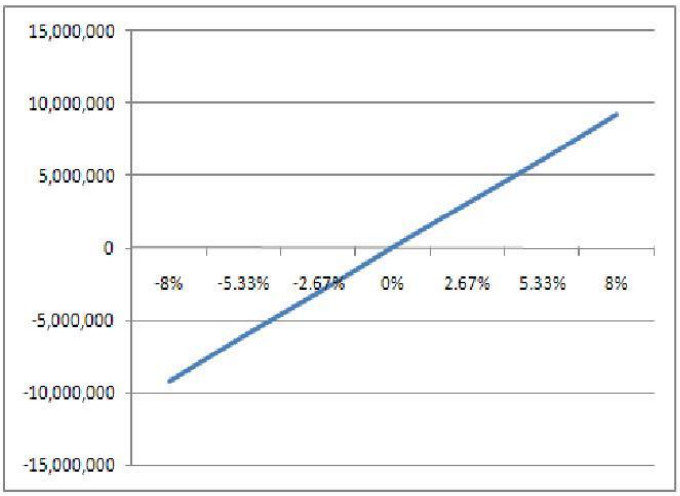
공시일: 2019-03-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	922	-922	장내
누계	주가지수	선물	69,602	0	69,602	장내
합계			69,602	0	69,602	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,569

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	43,904