펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-10-29

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	2,364	0	2,364	장내
신규	주가지수	옵션	2	263	-261	장내
누계	주가지수	옵션	68	4,597	-4,529	장내
합계			2,432	4,597	-2,165	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,367

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

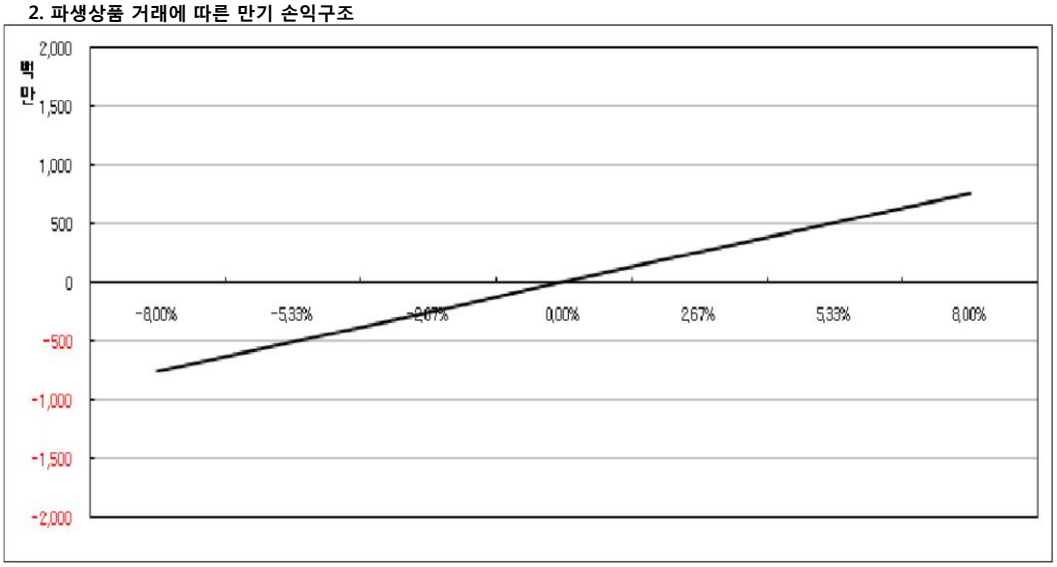
공시일: 2018-10-29

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	263	0	263	장내
합계			263	0	263	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,556

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

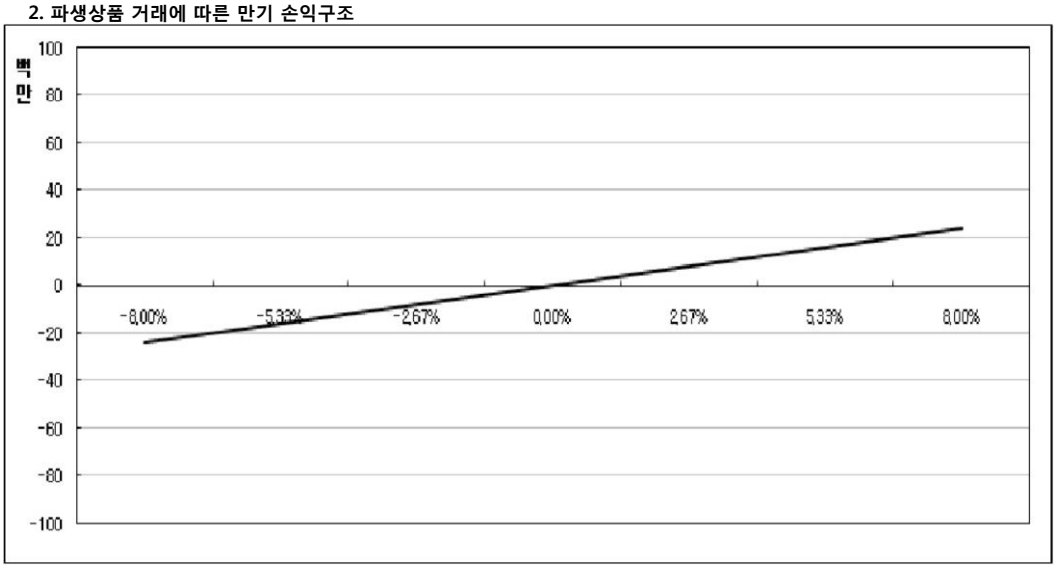
공시일: 2018-10-29

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	657	0	657	장내
합계			657	0	657	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	53

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,852

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

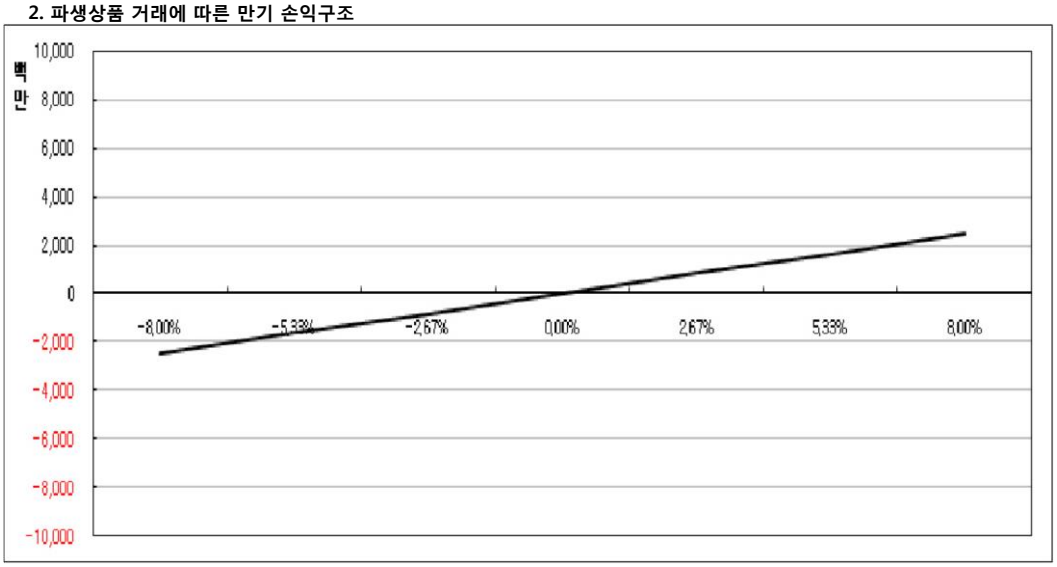
공시일: 2018-10-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	131	0	131	장내
누계	주가지수	선물	5,319	0	5,319	장내
합계			5,319	0	5,319	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 427

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,954

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

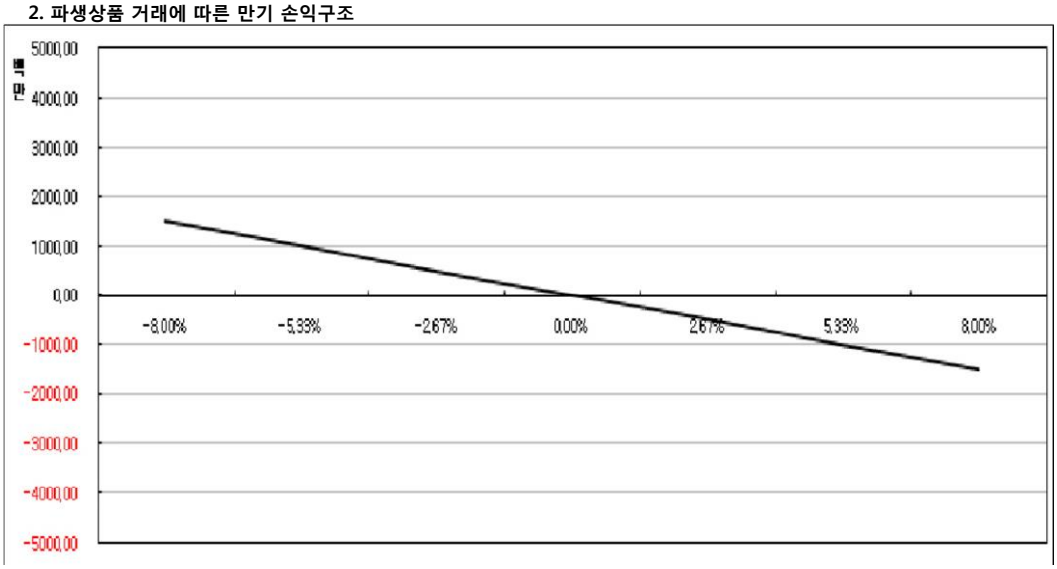
공시일: 2018-10-29

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	0	2,824	-2,824	장내
합계			0	2,824	-2,824	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 227

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 186

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

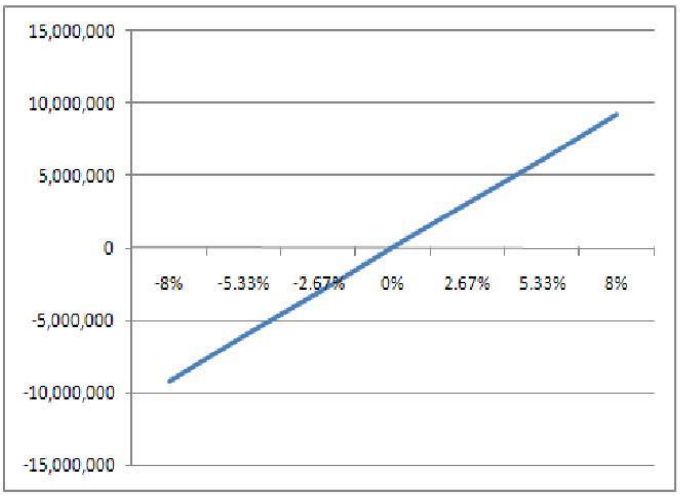
공시일: 2018-10-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	722	-722	장내
누계	주가지수	선물	82,222	0	82,222	장내
합계			82,222	0	82,222	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,597

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	31,728