펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-06

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	2,431	0	2,431	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	22	1,350	-1,328	장내
합계			2,453	1,350	1,103	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,338

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

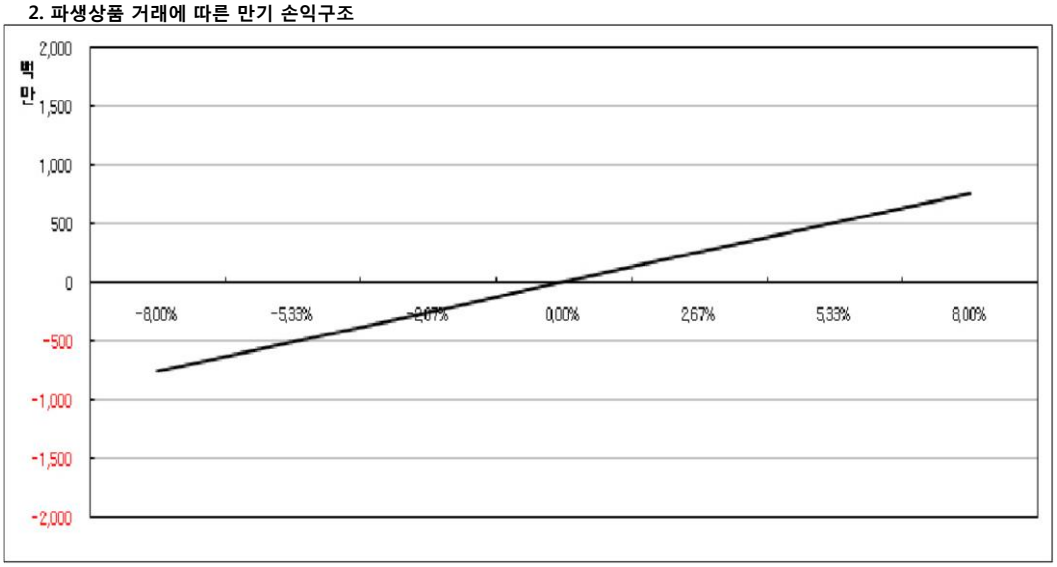
공시일: 2018-11-06

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	270	0	270	장내
합계			270	0	270	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,733

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

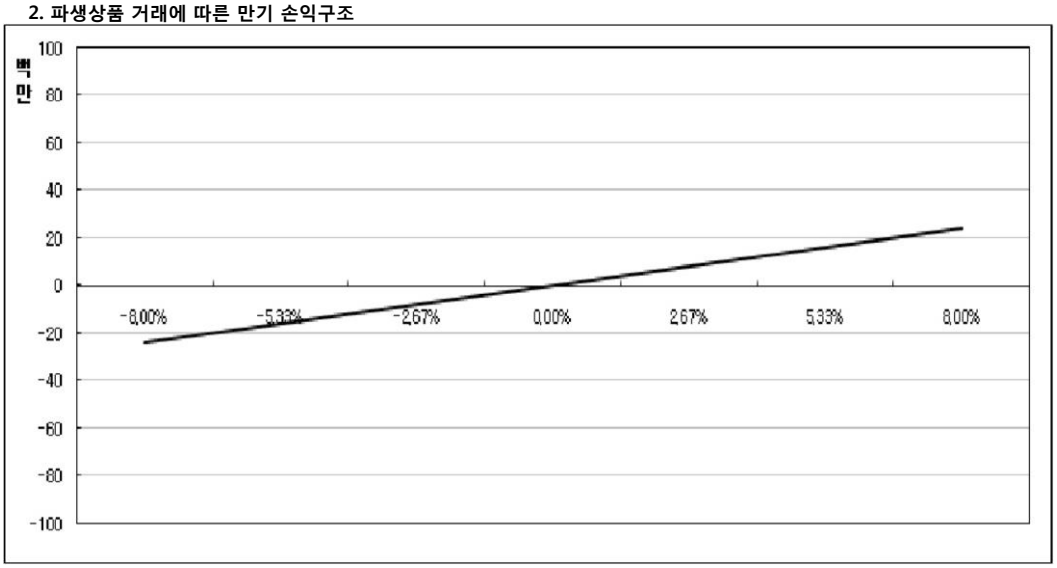
공시일: 2018-11-06

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	675	0	675	장내
합계			675	0	675	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	54

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,049

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

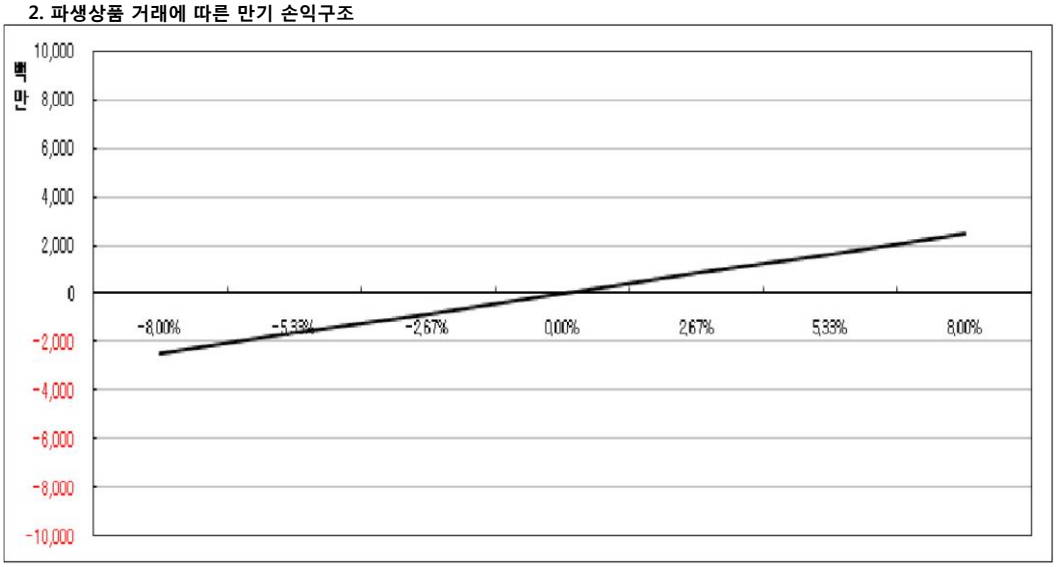
공시일: 2018-11-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	338	270	68	장내
누계	주가지수	선물	5,469	0	5,469	장내
합계			5,469	0	5,469	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 437

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,296

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

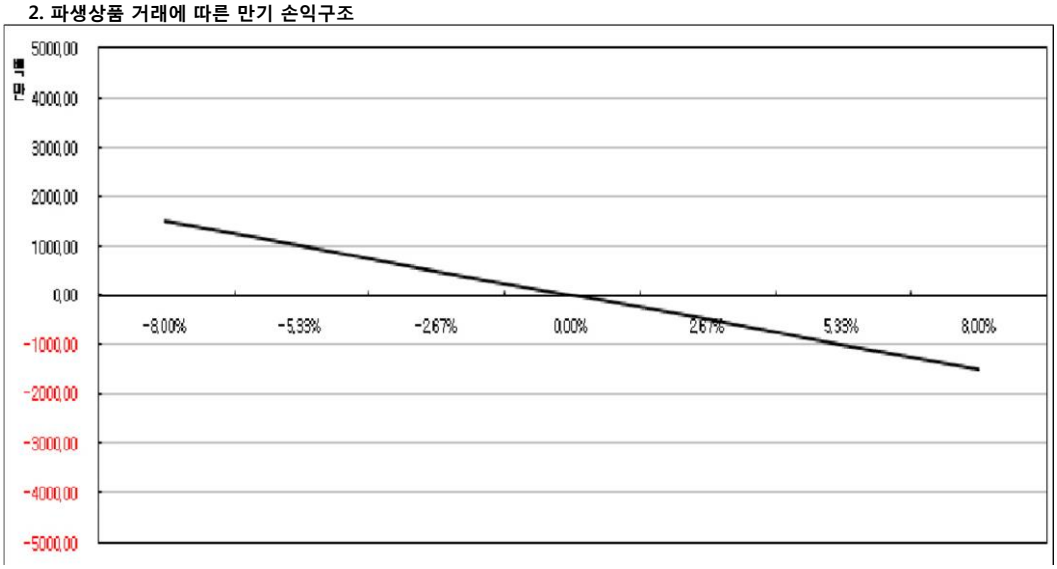
공시일: 2018-11-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	203	0	203	장내
누계	주가지수	선물	0	2,093	-2,093	장내
합계			0	2,093	-2,093	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	167

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	142

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

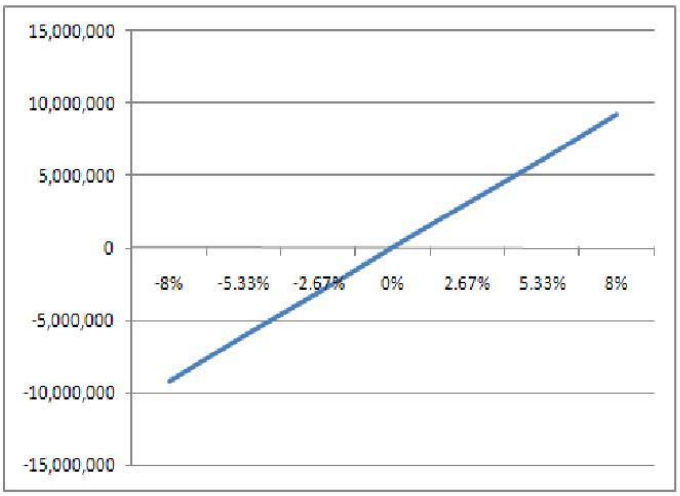
공시일: 2018-11-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	338	-338	장내
누계	주가지수	선물	85,612	0	85,612	장내
합계			85,612	0	85,612	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,848

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

35,512