펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-07

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	2,444	0	2,444	장내
신규	주가지수	옵션	2	0	2	장내
누계	주가지수	옵션	15	1,358	-1,342	장내
합계			2,460	1,358	1,102	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	25

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,343

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

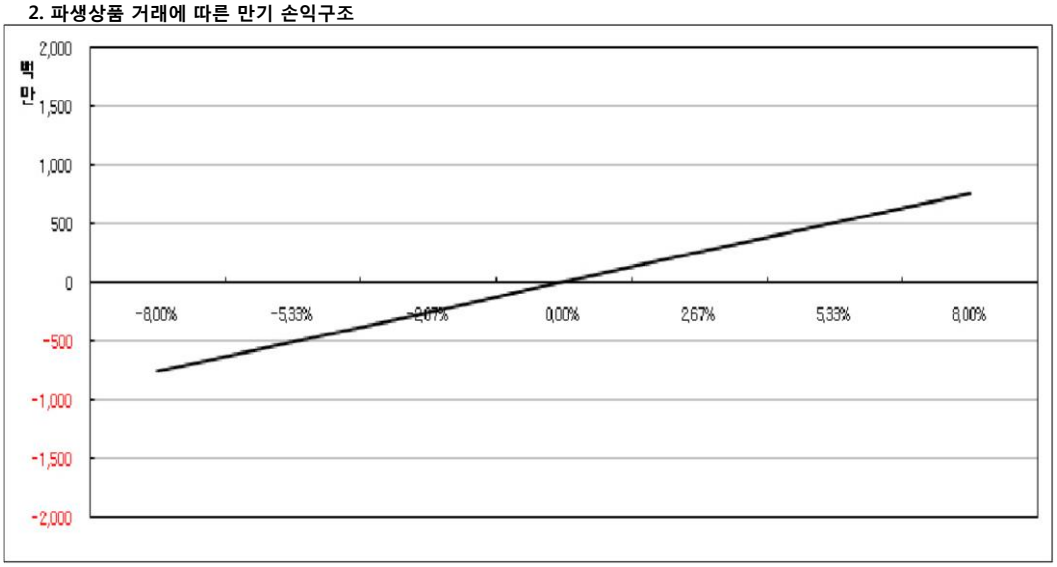
공시일: 2018-11-07

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	272	0	272	장내
합계			272	0	272	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,734

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

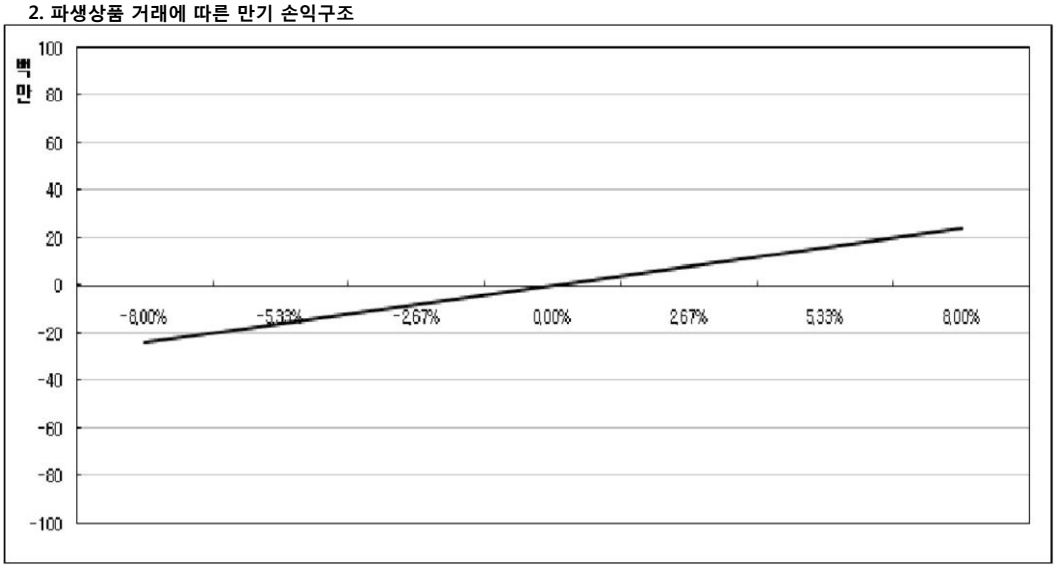
공시일: 2018-11-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	68	0	68	장내
누계	주가지수	선물	747	0	747	장내
합계			747	0	747	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,053

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

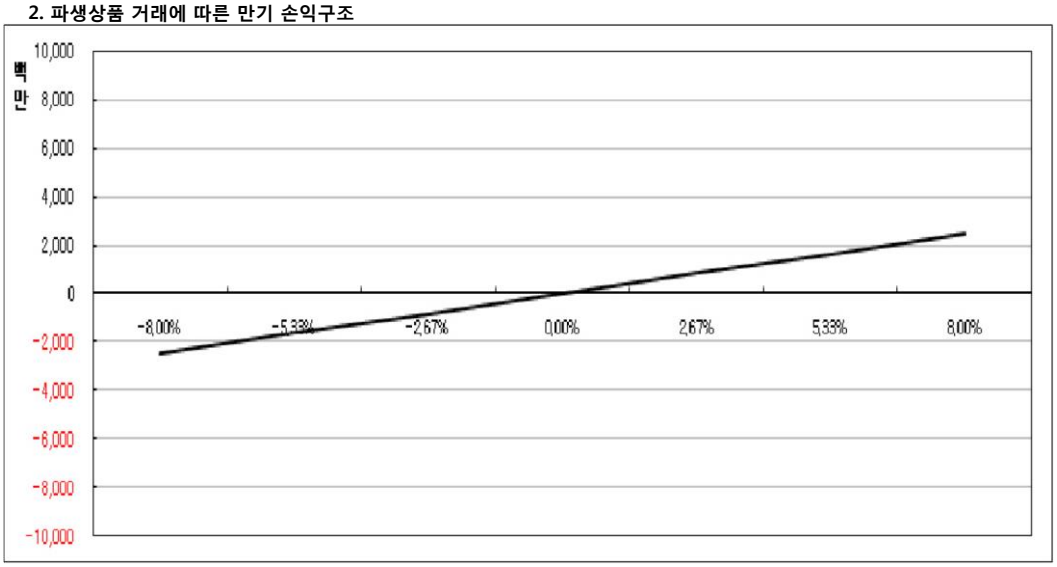
공시일: 2018-11-07

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	5,499	0	5,499	장내
합계			5,499	0	5,499	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

441

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,300

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

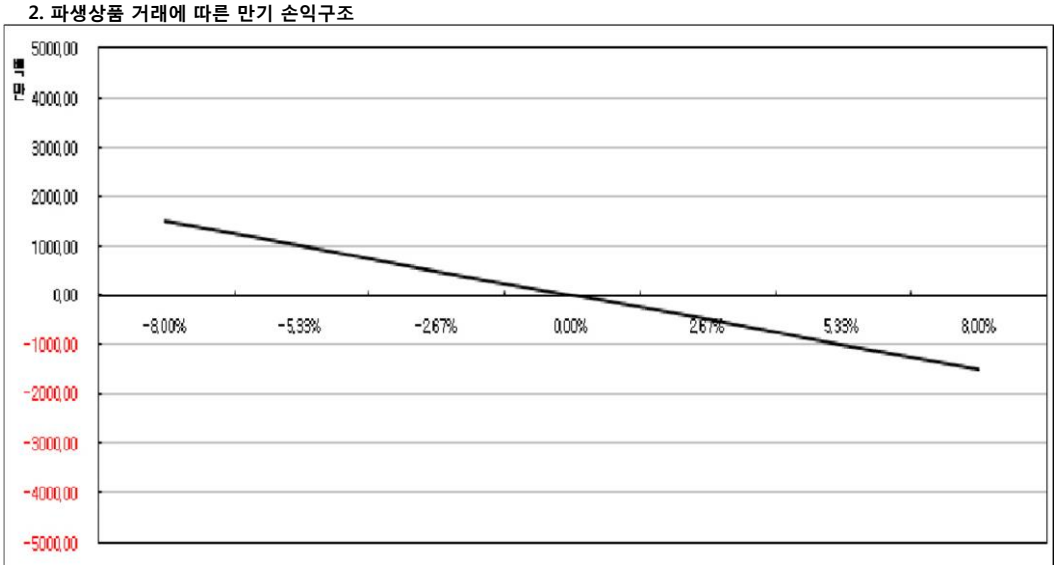
공시일: 2018-11-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	272	-272	장내
누계	주가지수	선물	0	2,376	-2,376	장내
합계			0	2,376	-2,376	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	190

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	161

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

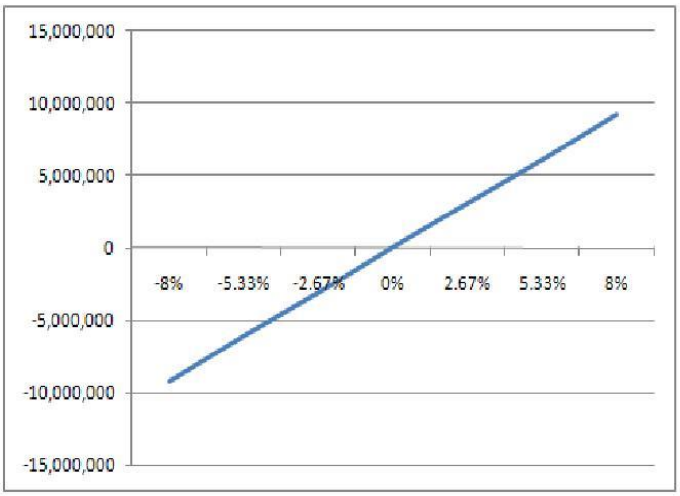
공시일: 2018-11-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	543	0	543	장내
누계	주가지수	선물	86,631	0	86,631	장내
합계			86,631	0	86,631	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,943

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 35,583