펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-08

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	2,434	0	2,434	장내
신규	주가지수	옵션	1	0	1	장내
누계	주가지수	옵션	13	1,352	-1,339	장내
합계			2,447	1,352	1,095	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,363

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

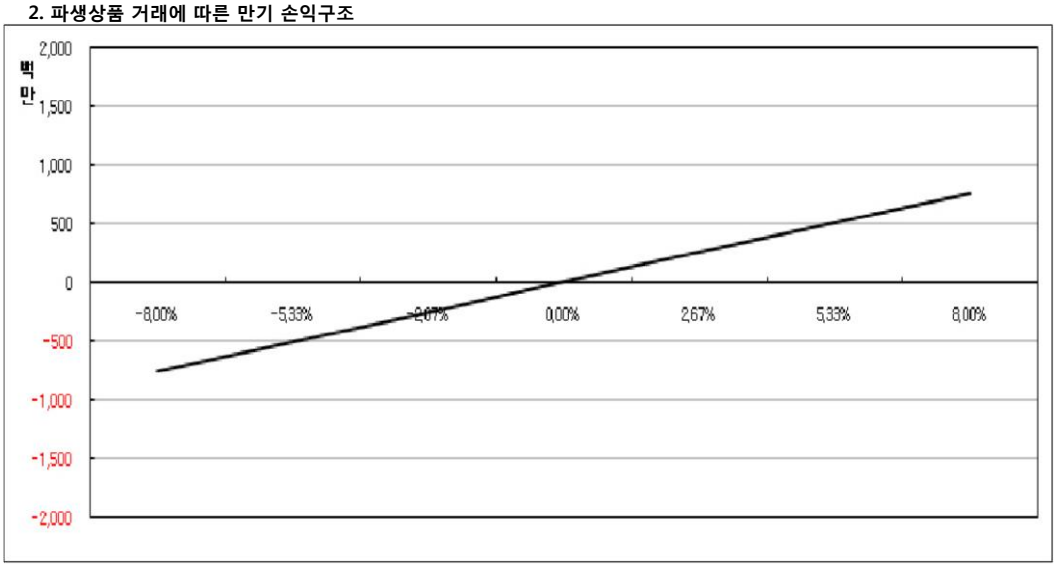
공시일: 2018-11-08

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)	2,746

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

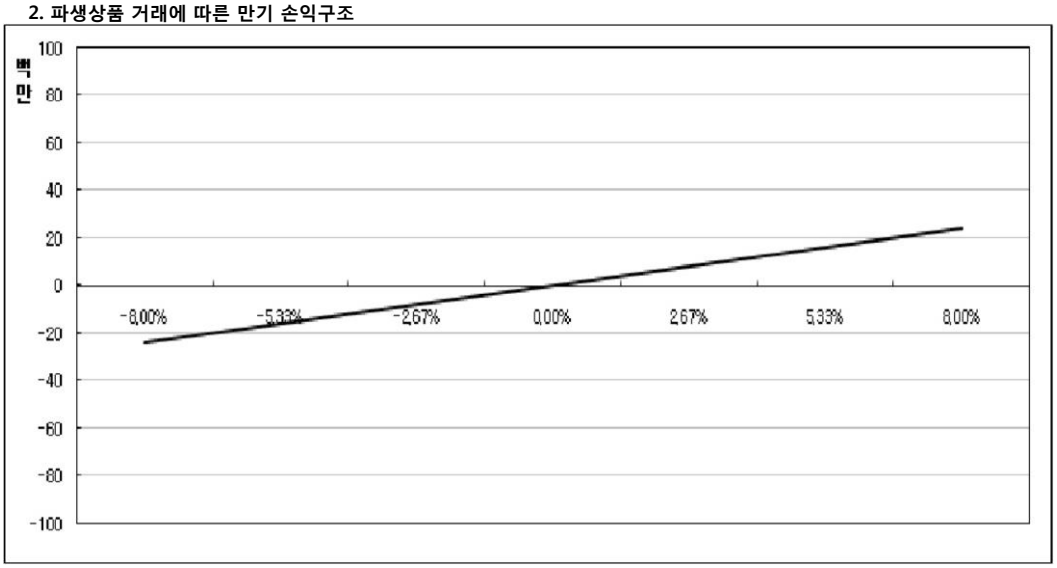
공시일: 2018-11-08

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	744	0	744	장내
합계			744	0	744	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,066

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

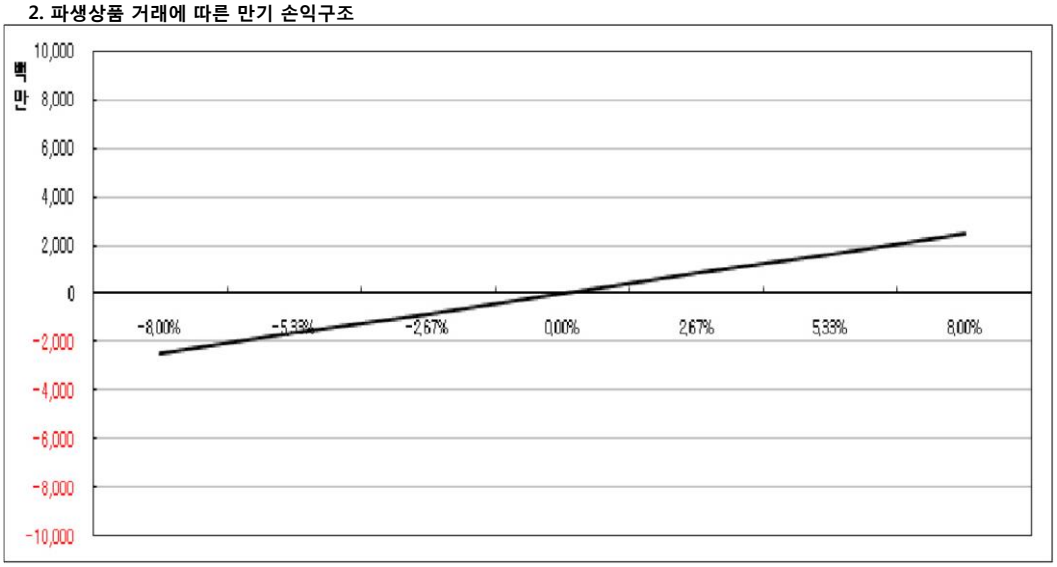
공시일: 2018-11-08

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	5,477	0	5,477	장내
합계			5,477	0	5,477	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 439

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,322

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

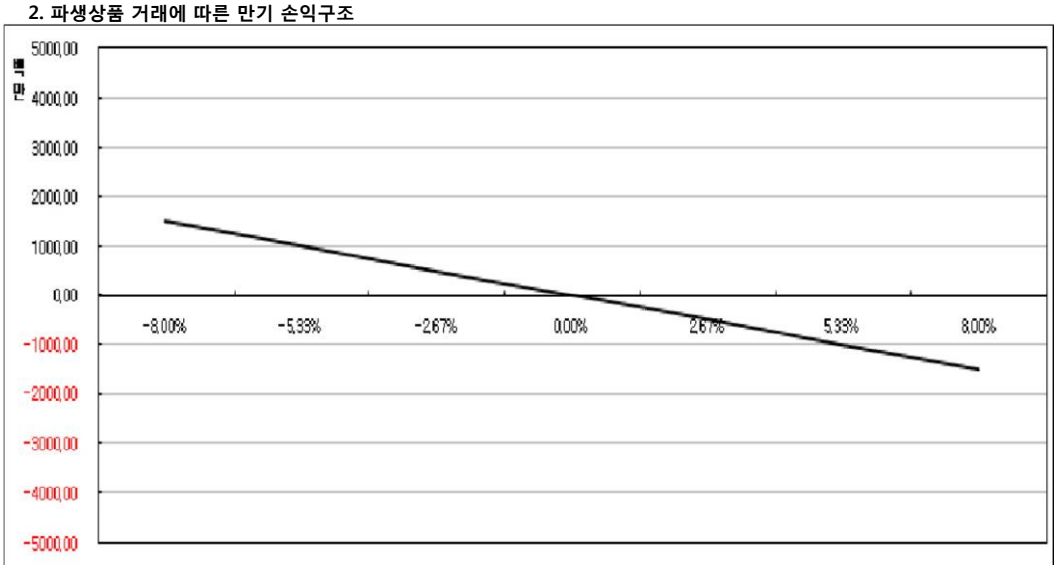
공시일: 2018-11-08

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	2,366	-2,366	장내
합계			0	2,366	-2,366	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	190

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	160

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

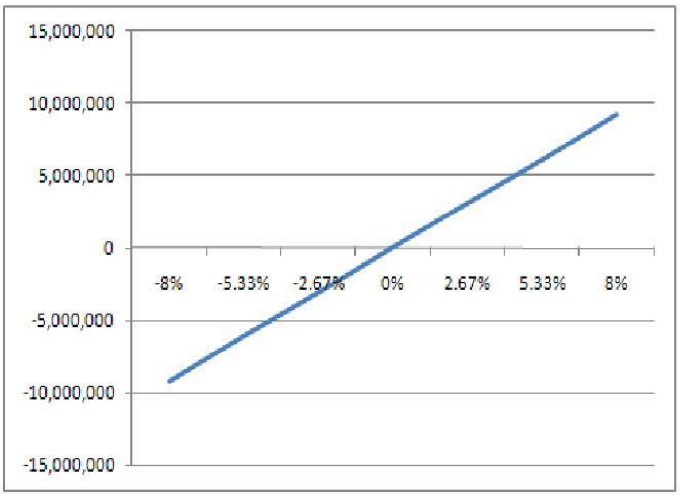
공시일: 2018-11-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	541	-541	장내
누계	주가지수	선물	85,733	0	85,733	장내
합계			85,733	0	85,733	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,866

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

35,691