펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-09

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	2,449	0	2,449	장내
신규	주가지수	옵션	24	12,382	-12,358	장내
누계	주가지수	옵션	24	9,661	-9,637	장내
합계			2,473	9,661	-7,188	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

433

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,409

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

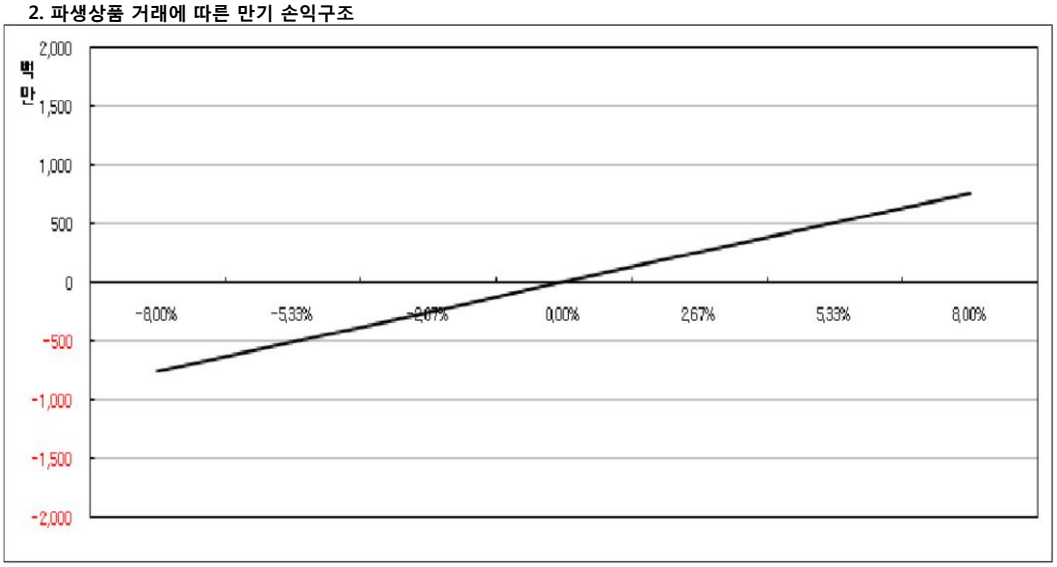
공시일: 2018-11-09

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) 2,752

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

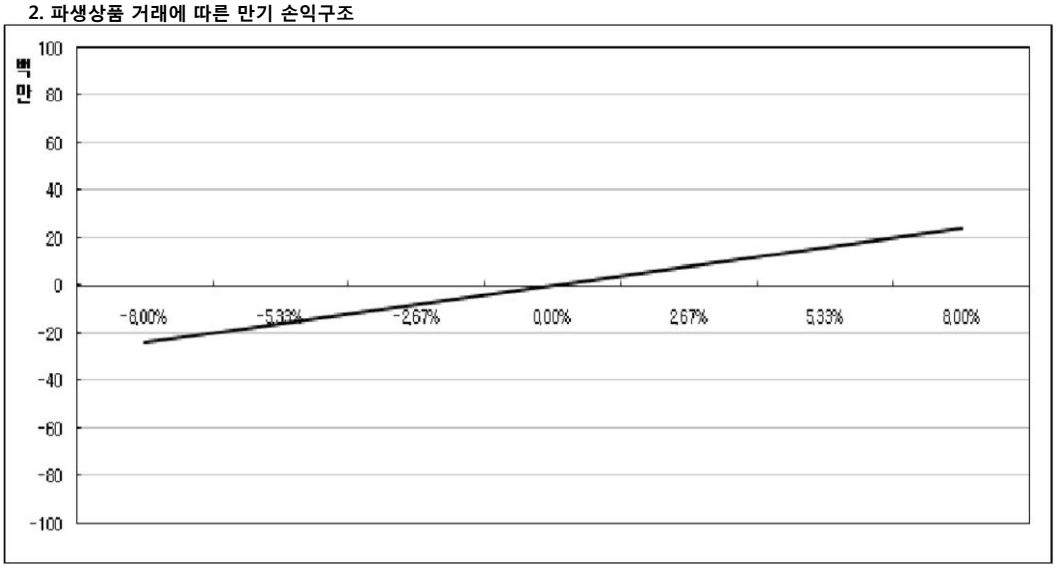
공시일: 2018-11-09

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	748	0	748	장내
합계			748	0	748	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,073

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

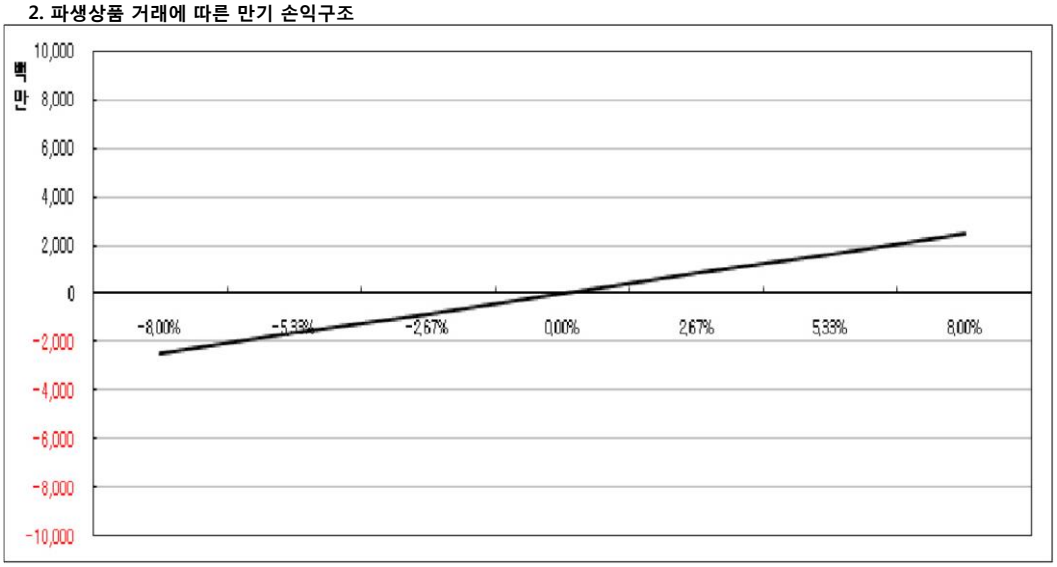
공시일: 2018-11-09

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	5,510	0	5,510	장내
합계			5,510	0	5,510	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 442

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,336

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

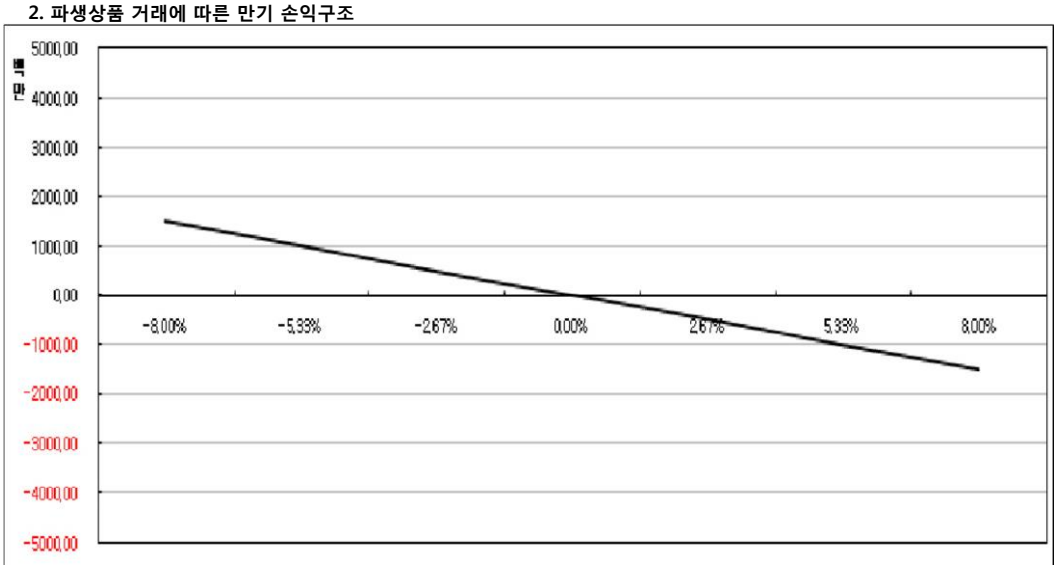
공시일: 2018-11-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	204	0	204	장내
누계	주가지수	선물	0	2,177	-2,177	장내
합계			0	2,177	-2,177	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 175

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 148

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

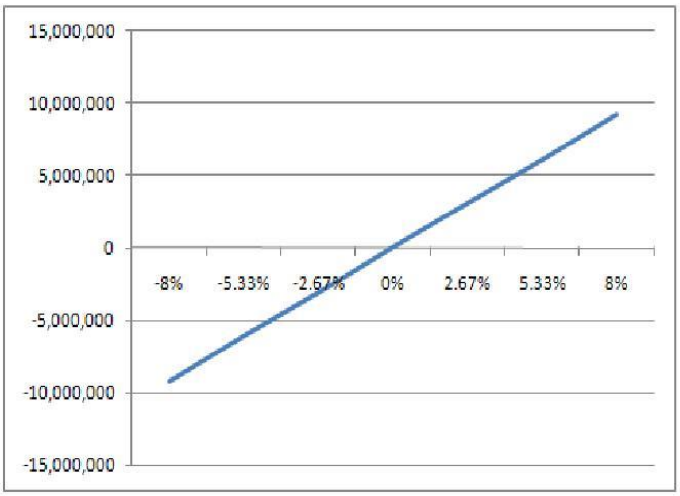
공시일: 2018-11-09

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	86,259	0	86,259	장내
합계			86,259	0	86,259	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,925

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	35,812