펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-12

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	2,442	0	2,442	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	25	9,632	-9,607	장내
합계			2,467	9,632	-7,165	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

419

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,014

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

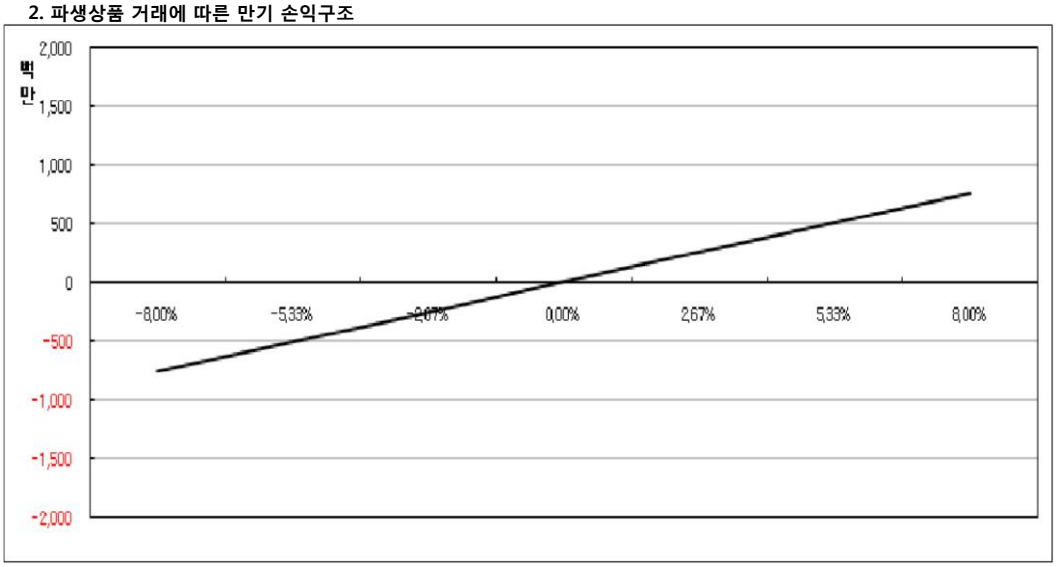
공시일: 2018-11-12

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	271	0	271	장내
합계			271	0	271	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,765

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

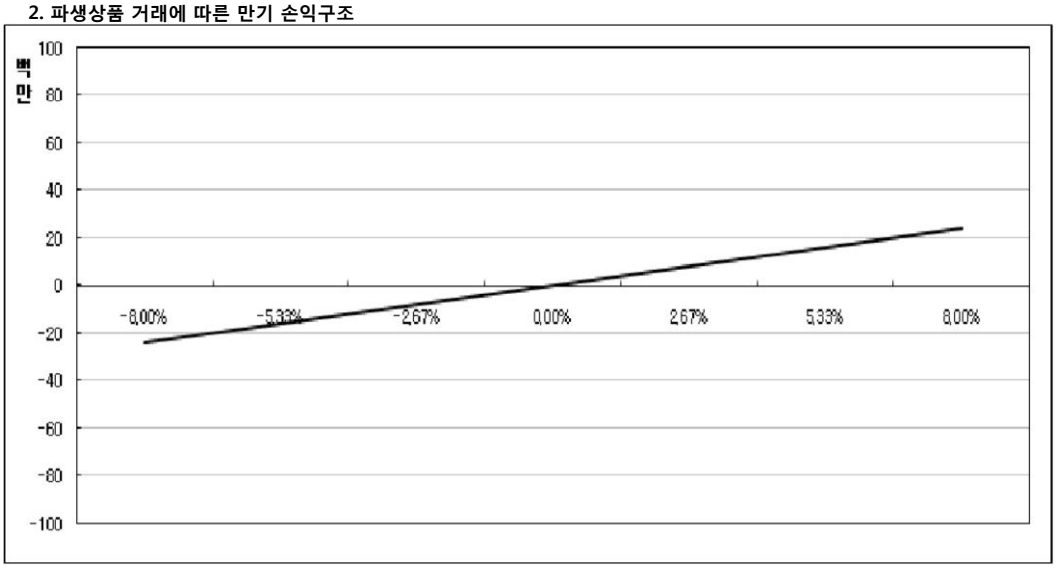
공시일: 2018-11-12

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	746	0	746	장내
합계			746	0	746	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,087

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

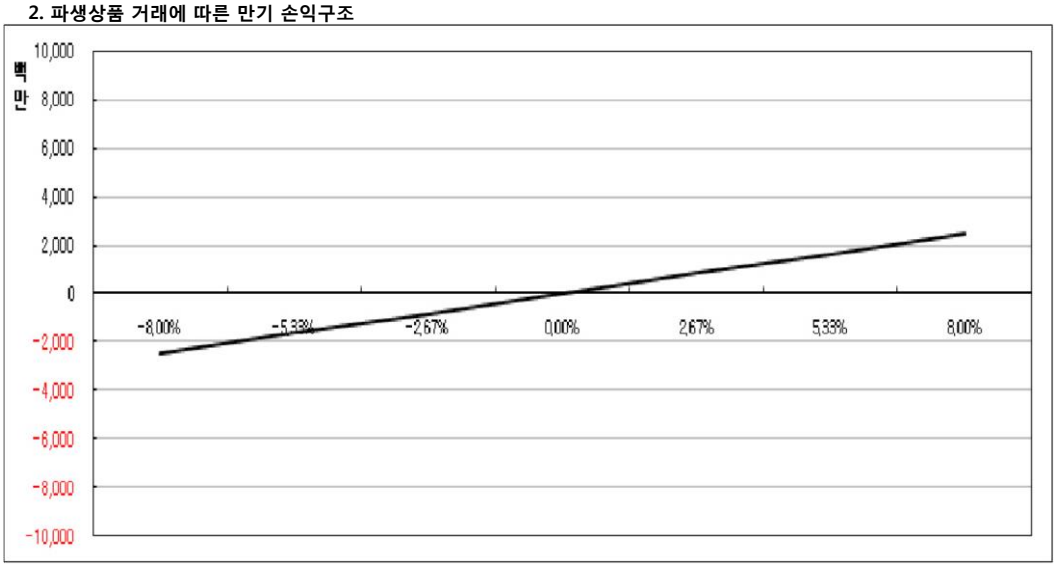
공시일: 2018-11-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	271	0	271	장내
누계	주가지수	선물	5,766	0	5,766	장내
합계			5,766	0	5,766	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 462

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,368

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

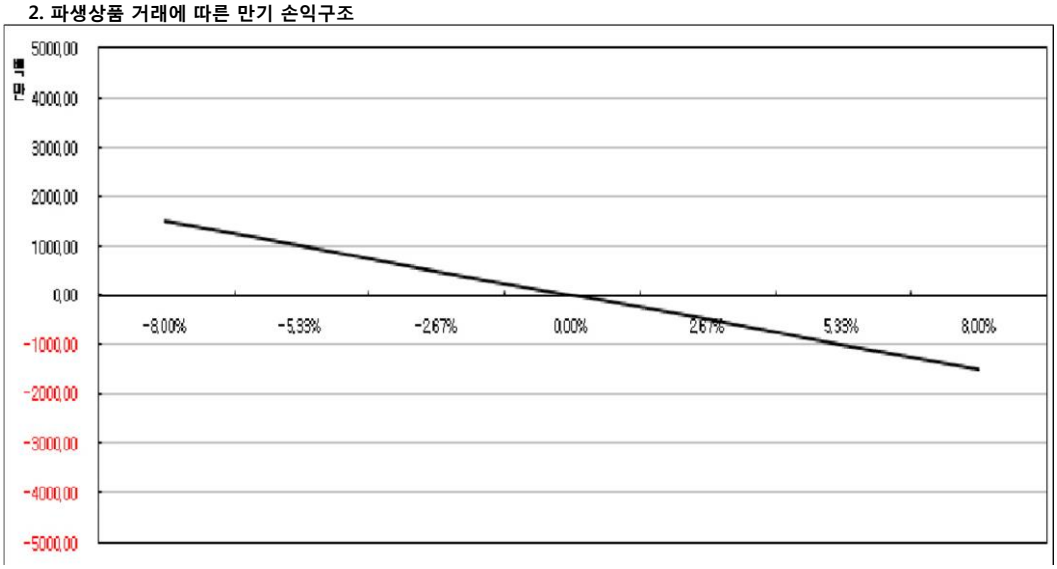
공시일: 2018-11-12

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	2,171	-2,171	장내
합계			0	2,171	-2,171	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 147

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

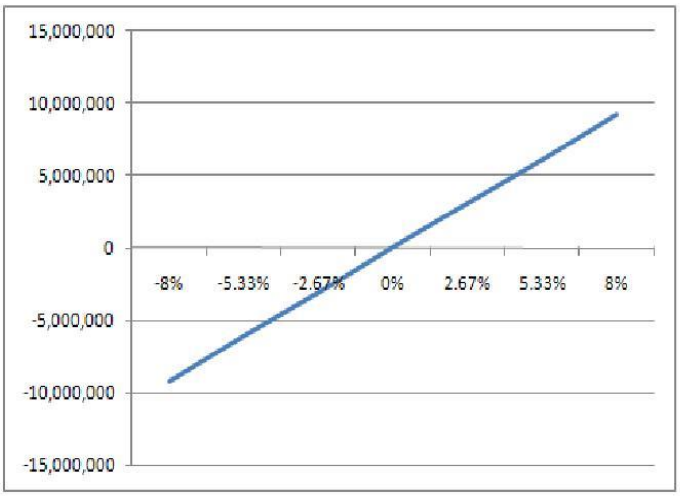
공시일: 2018-11-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	407	-407	장내
누계	주가지수	선물	85,605	0	85,605	장내
합계			85,605	0	85,605	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,853

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	35,931