펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-14

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	2,427	0	2,427	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	36	9,574	-9,538	장내
합계			2,463	9,574	-7,111	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 392

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,180

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

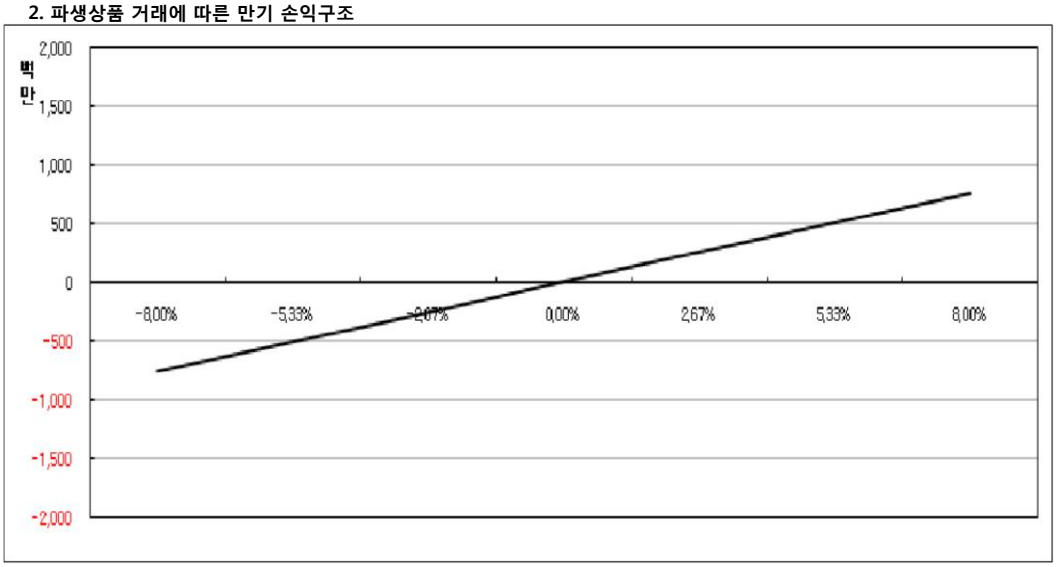
공시일: 2018-11-14

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)	2,776

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

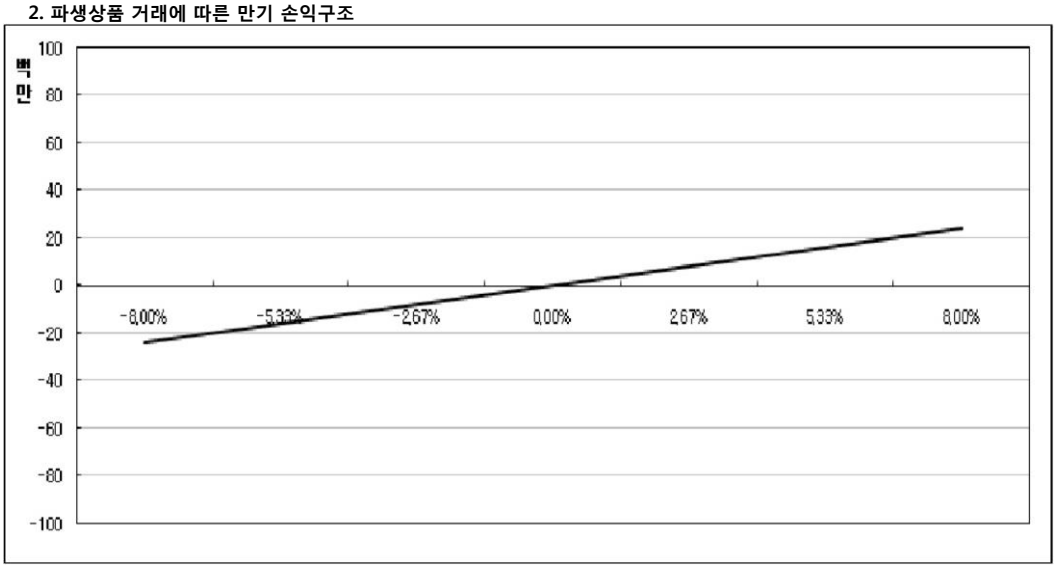
공시일: 2018-11-14

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	742	0	742	장내
합계			742	0	742	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,099

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

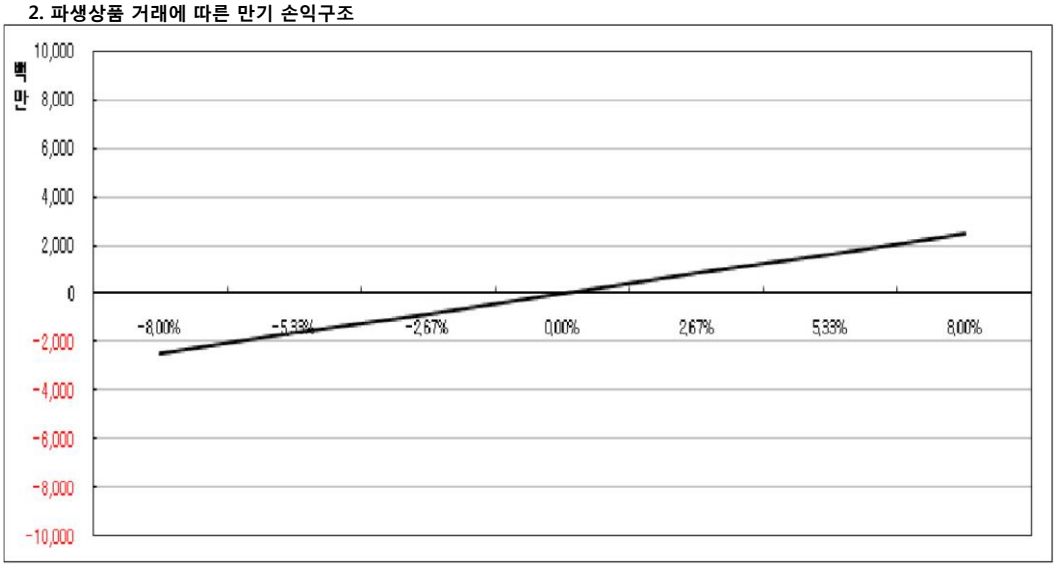
공시일: 2018-11-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	337	0	337	장내
누계	주가지수	선물	5,866	0	5,866	장내
합계			5,866	0	5,866	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 469

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,394

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

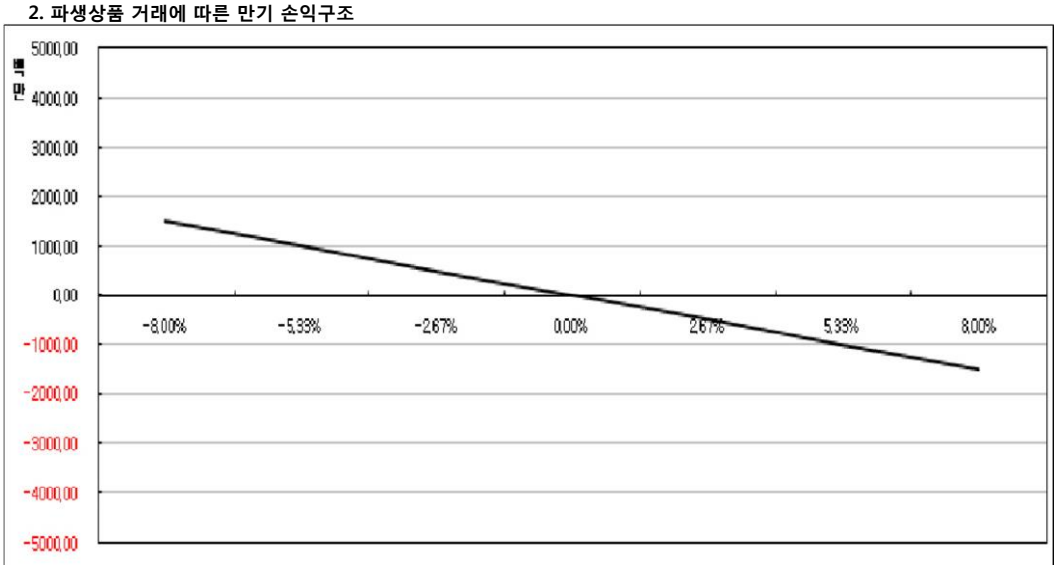
공시일: 2018-11-14

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	2,090	-2,090	장내
합계			0	2,090	-2,090	

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]

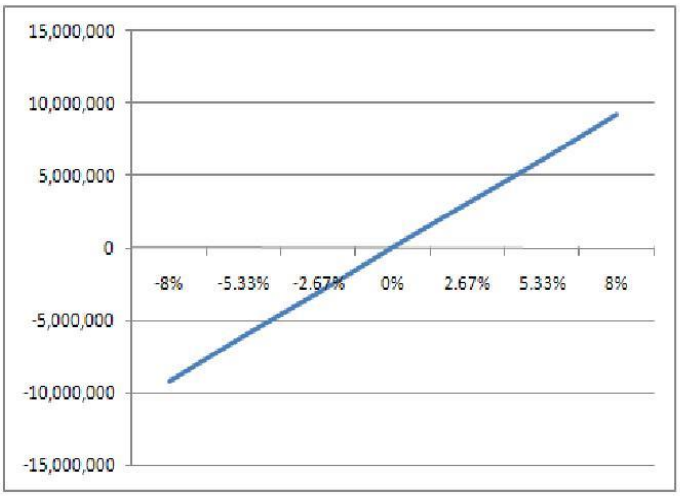
공시일: 2018-11-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	742	0	742	장내
누계	주가지수	선물	85,967	0	85,967	장내
합계			85,967	0	85,967	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,870

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 36,096