펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	67	0	67	장내
누계	주가지수	선물	2,487	0	2,487	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	37	9,545	-9,509	장내
합계			2,524	9,545	-7,022	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

369

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,056

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

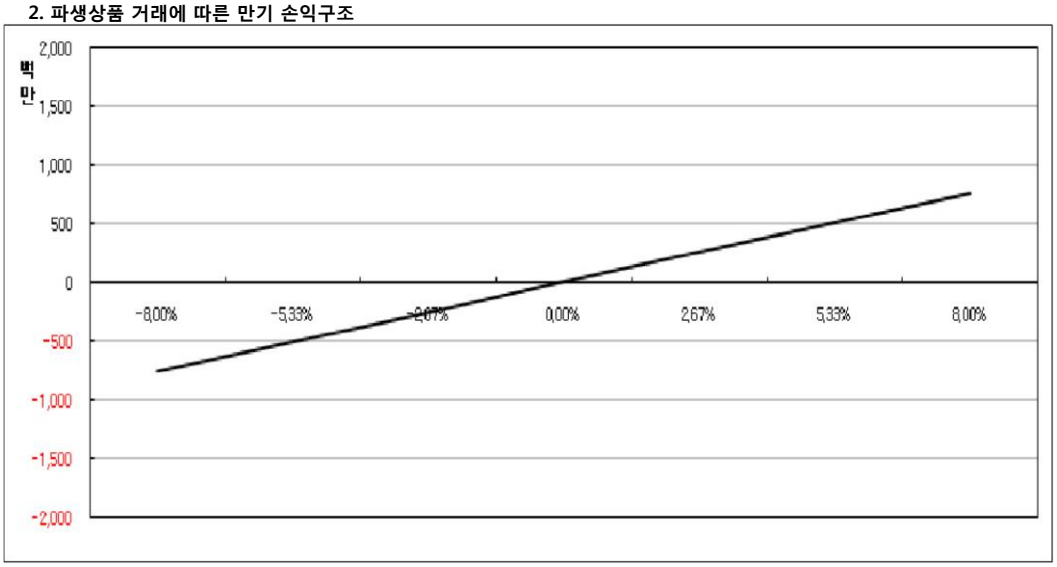
공시일: 2018-11-15

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	269	0	269	장내
합계			269	0	269	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,750

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

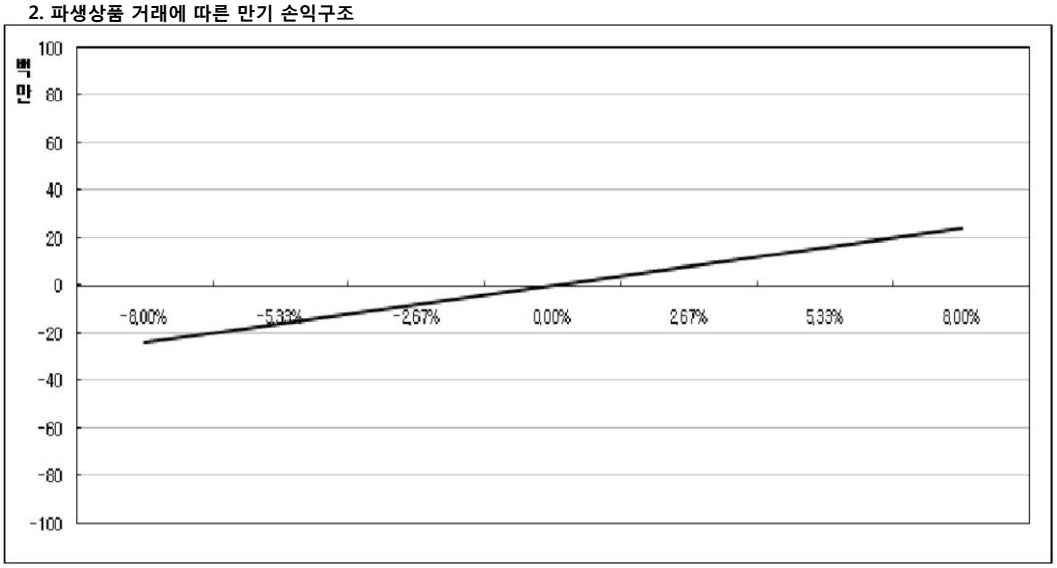
공시일: 2018-11-15

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	739	0	739	장내
합계			739	0	739	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,071

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

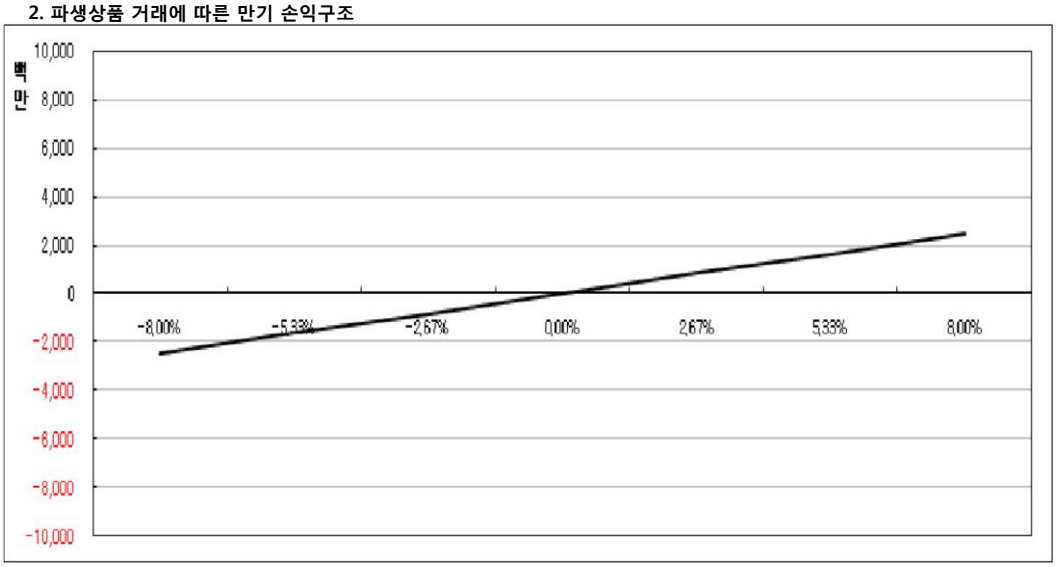
공시일: 2018-11-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	269	-269	장내
누계	주가지수	선물	5,579	0	5,579	장내
합계			5,579	0	5,579	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	447

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,336

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

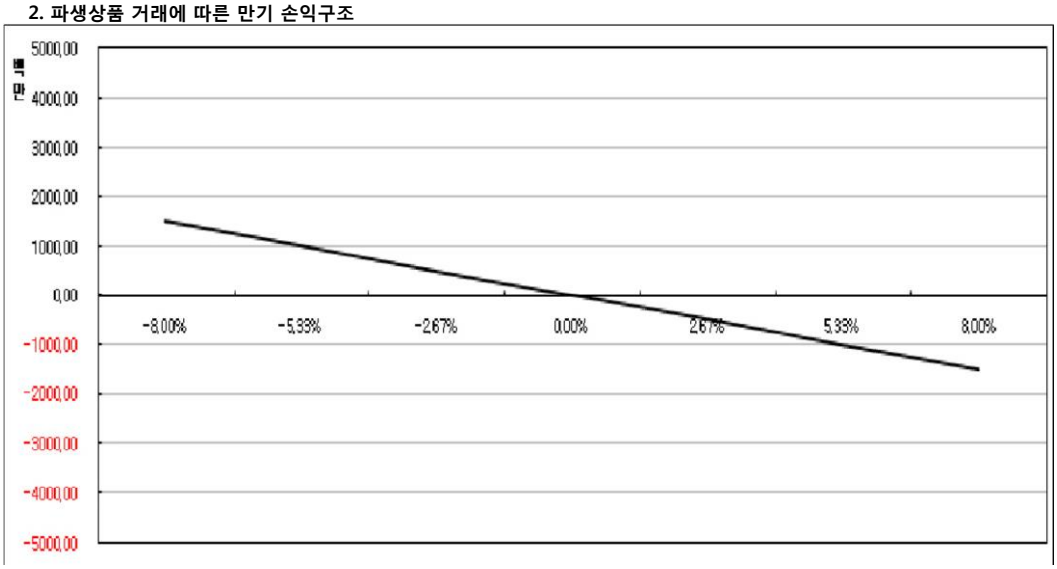
공시일: 2018-11-15

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	2,084	-2,084	장내
합계			0	2,084	-2,084	

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]

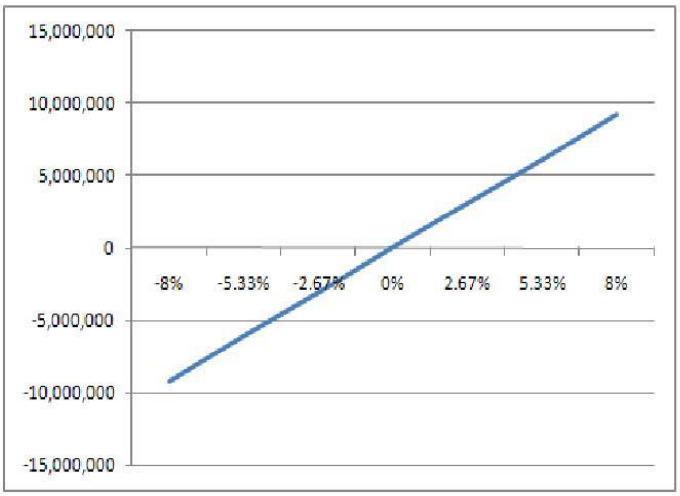
공시일: 2018-11-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	336	-336	장내
누계	주가지수	선물	85,369	0	85,369	장내
합계			85,369	0	85,369	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,840

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 35,765