펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-19

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	2,513	0	2,513	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	27	9,644	-9,616	장내
합계			2,540	9,644	-7,104	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

417

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,555

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

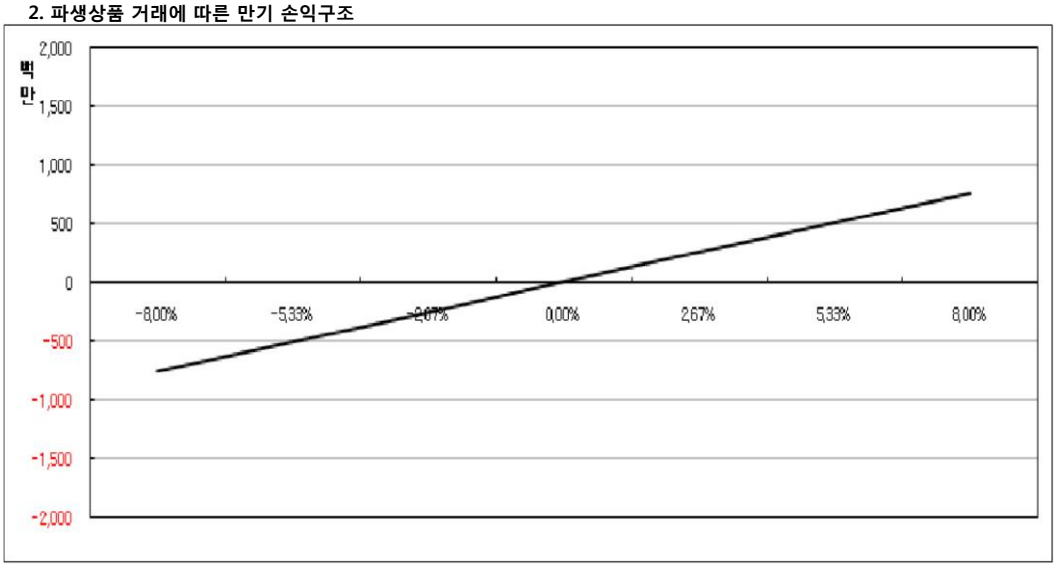
공시일: 2018-11-19

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)	2,748

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

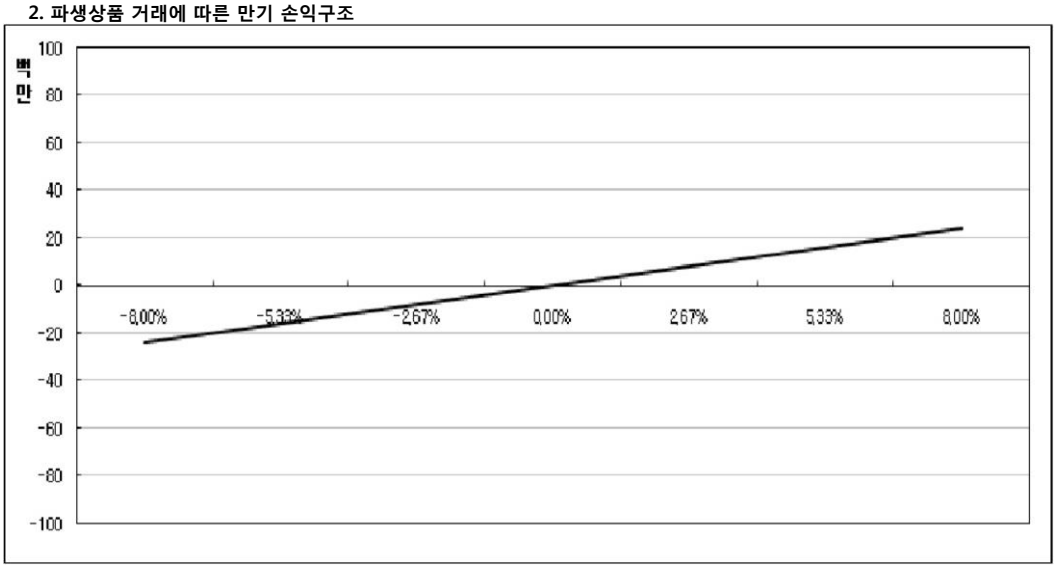
공시일: 2018-11-19

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	747	0	747	장내
합계			747	0	747	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,069

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

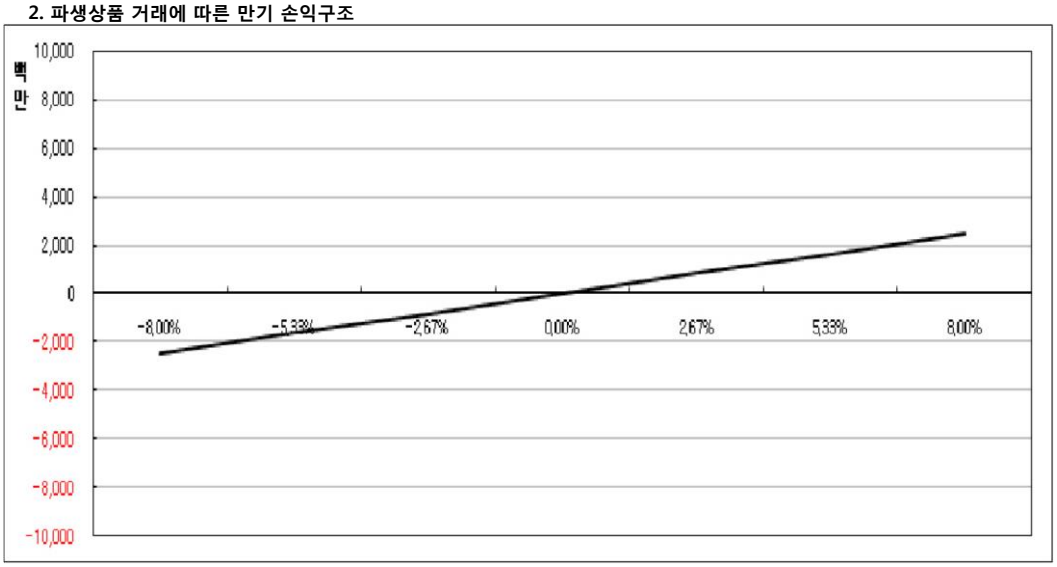
공시일: 2018-11-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	340	407	-68	장내
누계	주가지수	선물	5,569	0	5,569	장내
합계			5,569	0	5,569	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 446

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,331

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

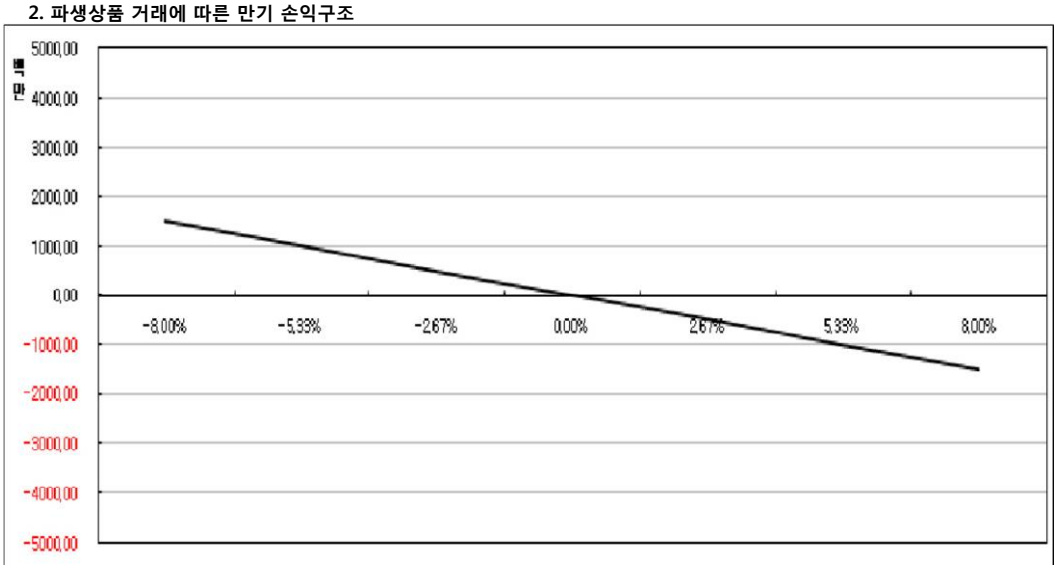
공시일: 2018-11-19

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	2,173	-2,173	장내
합계			0	2,173	-2,173	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 148

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

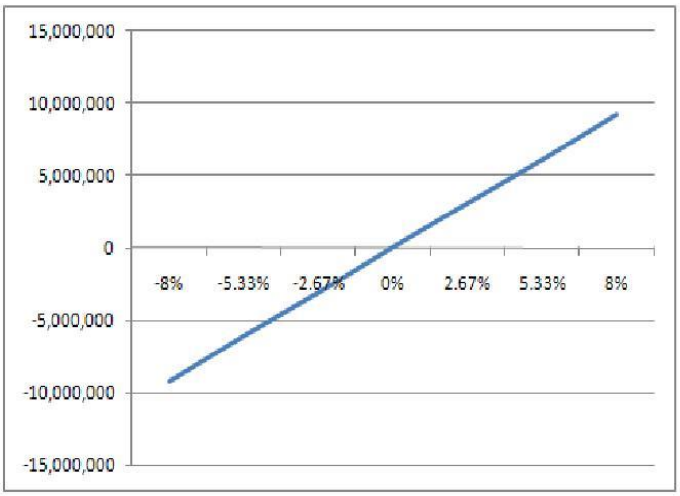
공시일: 2018-11-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	204	-204	장내
누계	주가지수	선물	86,996	0	86,996	장내
합계			86,996	0	86,996	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,961

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	35,792