펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-20

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	2,519	0	2,519	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	22	9,667	-9,645	장내
합계			2,541	9,667	-7,126	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	427

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,493

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

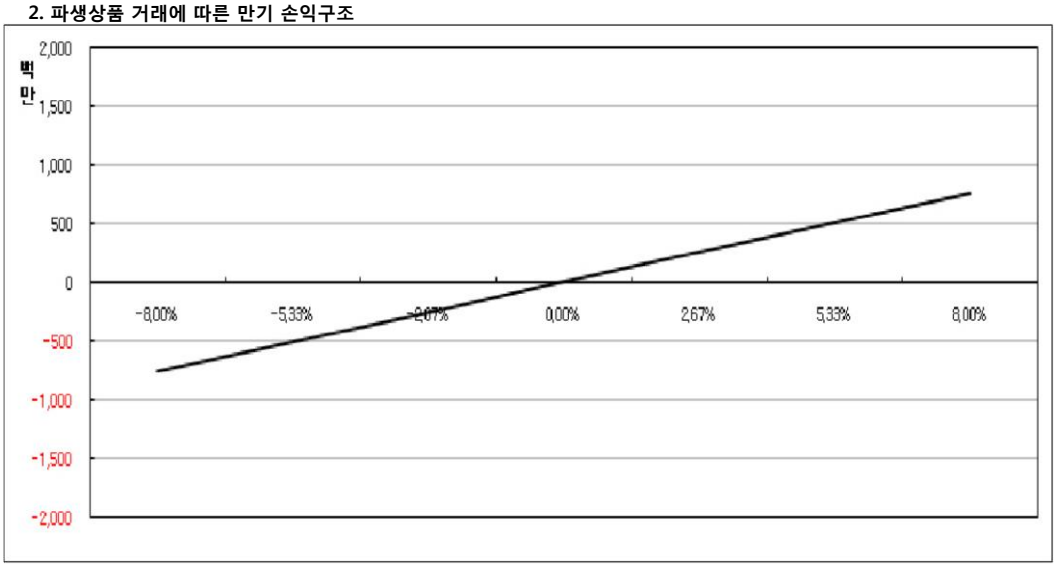
공시일: 2018-11-20

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)	2,732

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

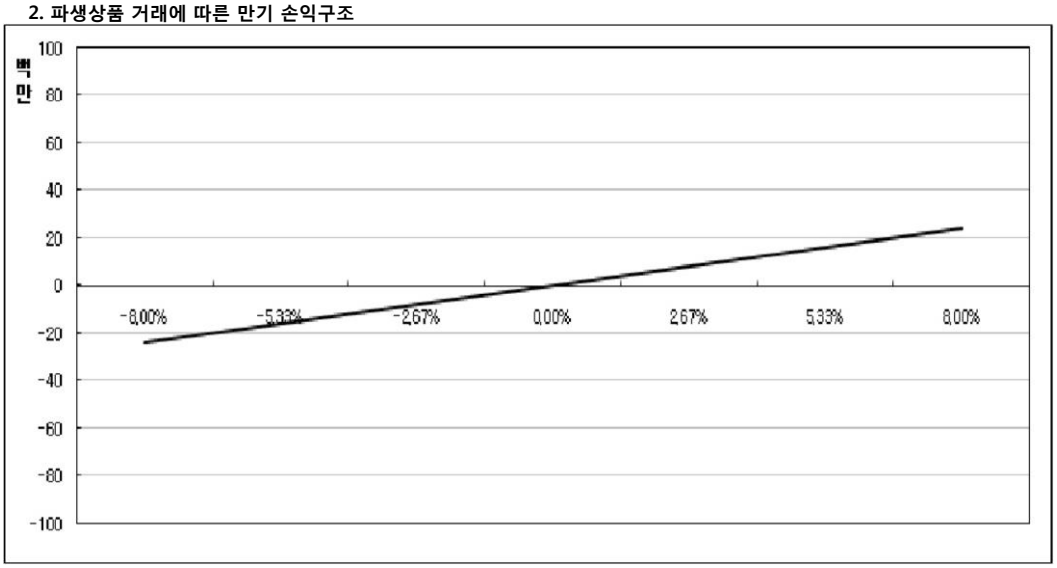
공시일: 2018-11-20

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	749	0	749	장내
합계			749	0	749	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,050

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

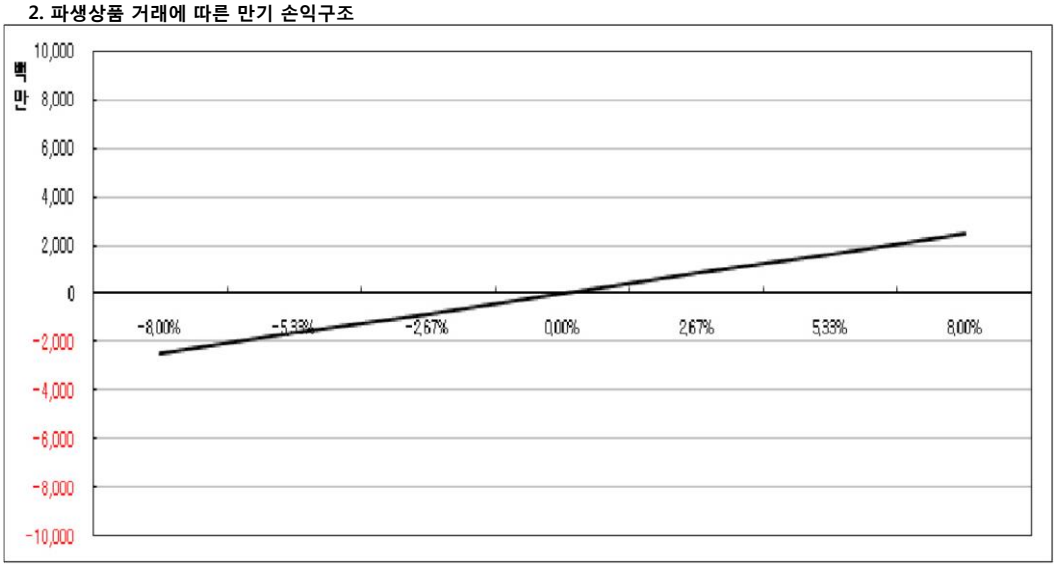
공시일: 2018-11-20

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	5,582	0	5,582	장내
합계			5,582	0	5,582	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	447

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,300

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

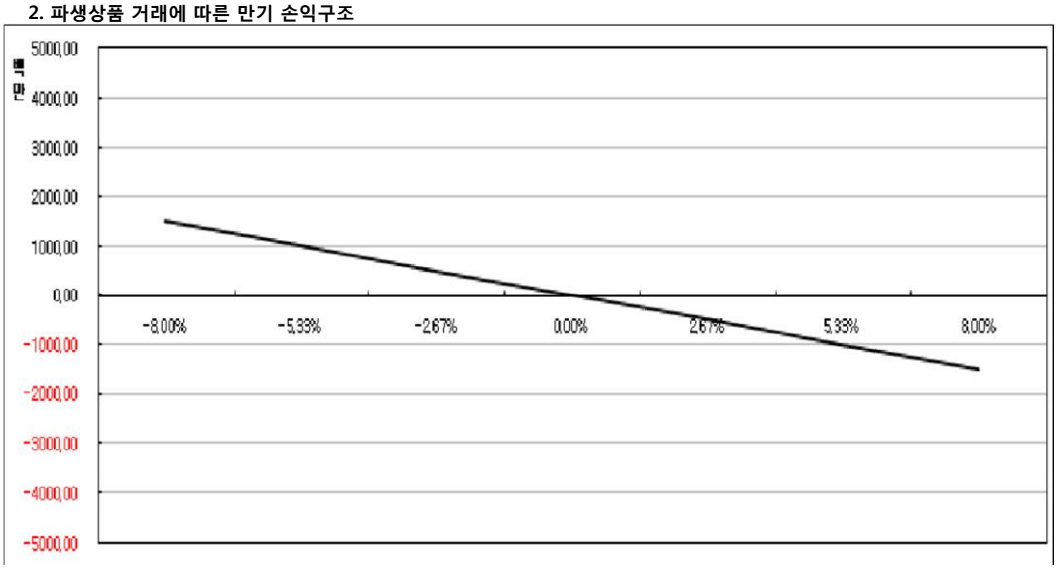
공시일: 2018-11-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	272	-272	장내
누계	주가지수	선물	0	2,451	-2,451	장내
합계			0	2,451	-2,451	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 196

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 167

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

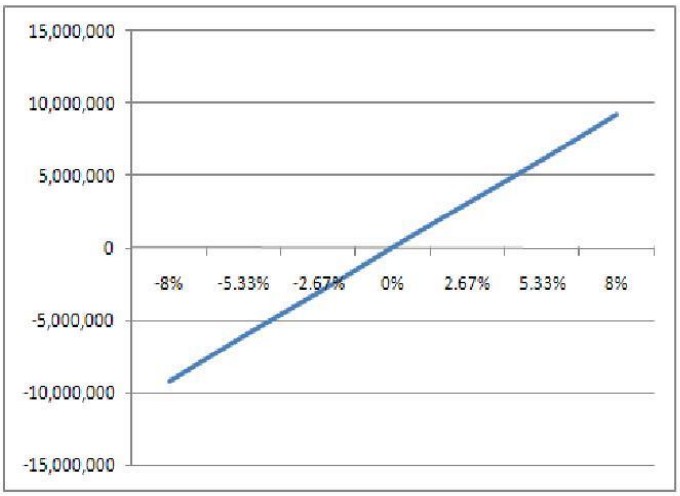
공시일: 2018-11-20

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	87,207	0	87,207	장내
합계			87,207	0	87,207	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,984

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

35,604