펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-21

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	2,494	0	2,494	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	31	9,570	-9,539	장내
합계			2,525	9,570	-7,045	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	383

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,726

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

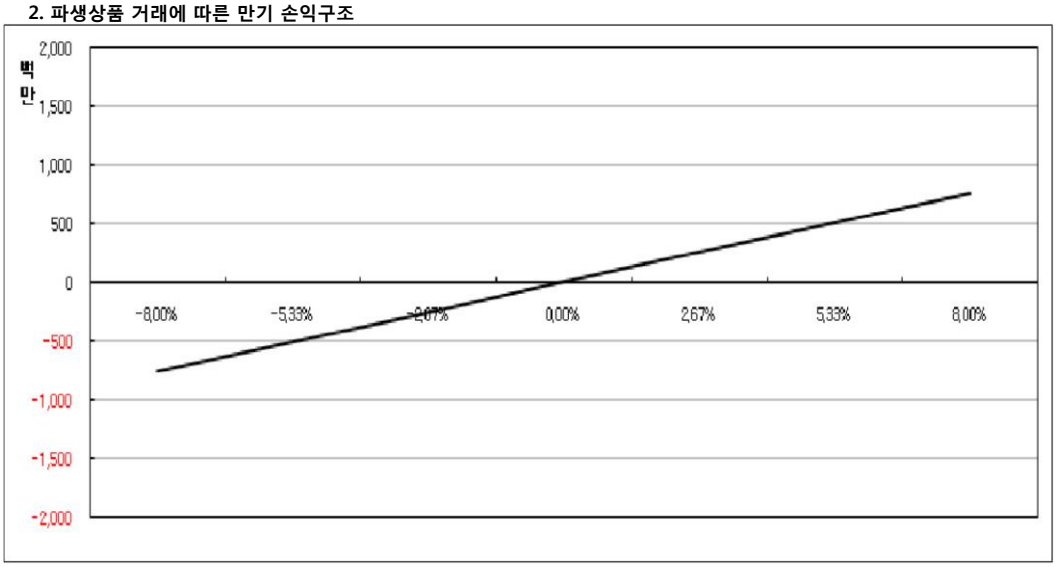
공시일: 2018-11-21

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)	2,681

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

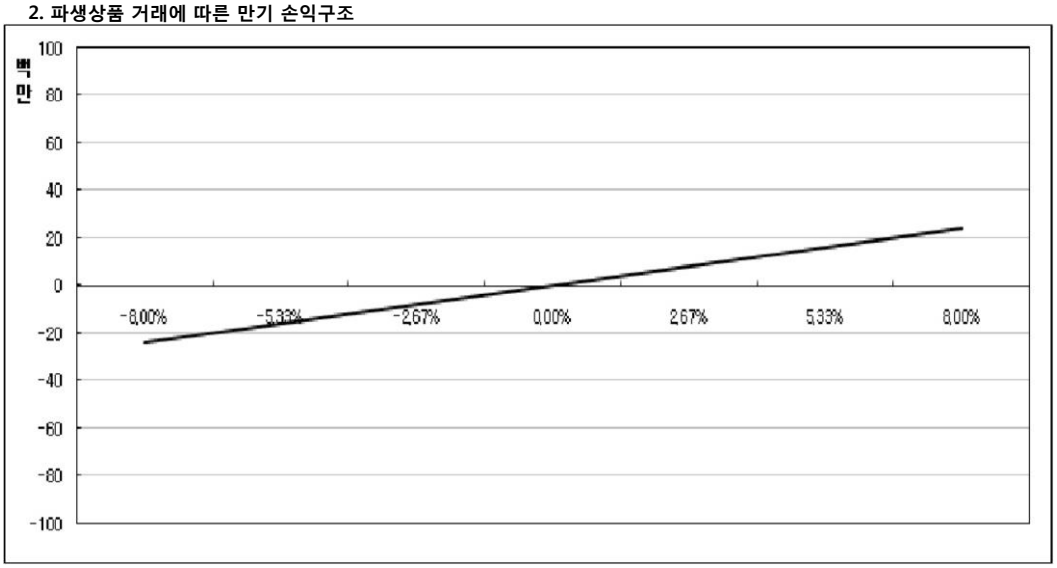
공시일: 2018-11-21

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	741	0	741	장내
합계			741	0	741	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,994

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

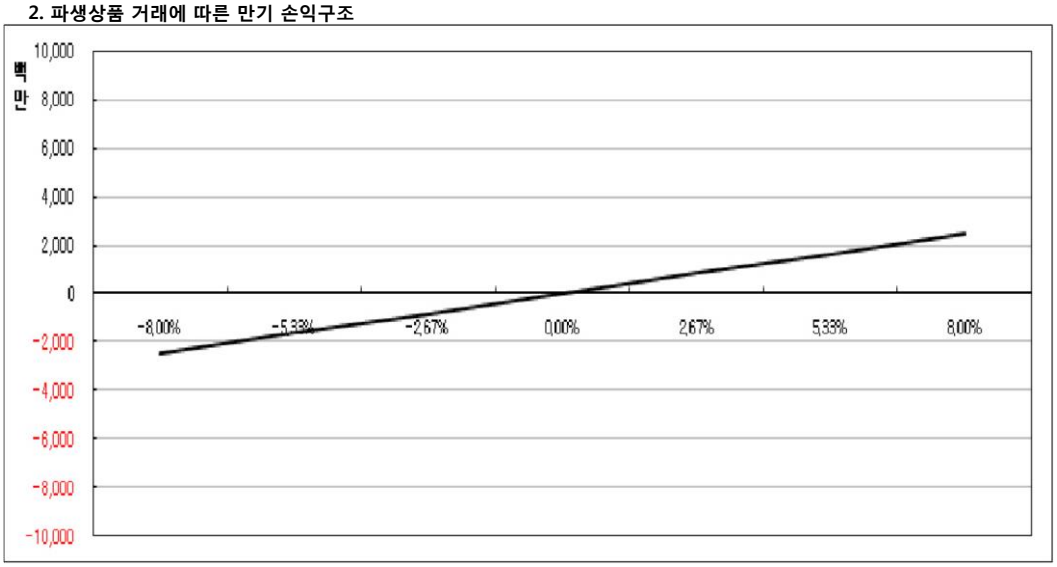
공시일: 2018-11-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	337	-337	장내
누계	주가지수	선물	5,189	0	5,189	장내
합계			5,189	0	5,189	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	415

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	5,191

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

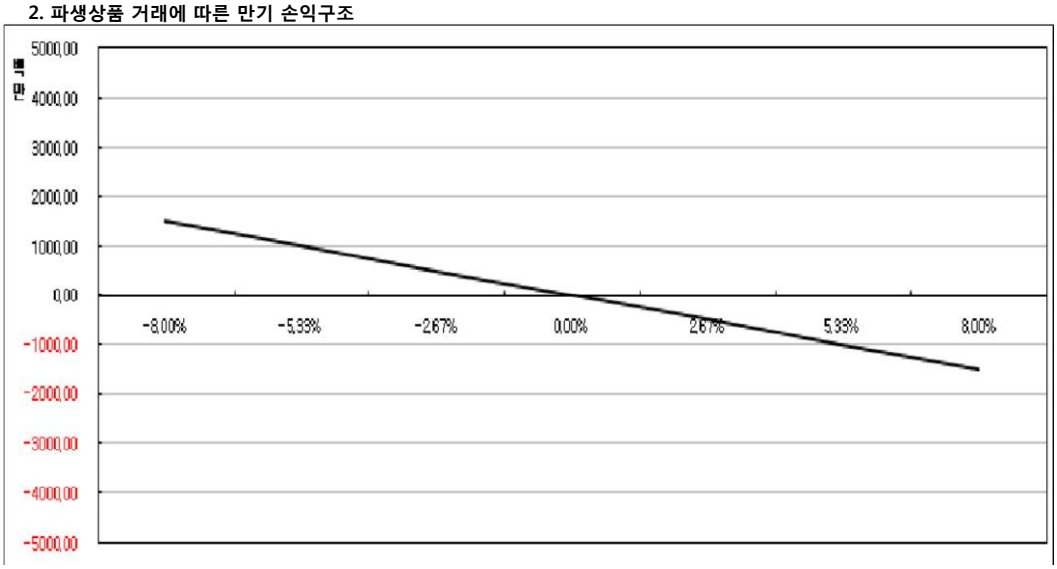
공시일: 2018-11-21

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	2,426	-2,426	장내
합계			0	2,426	-2,426	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	194

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	165

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

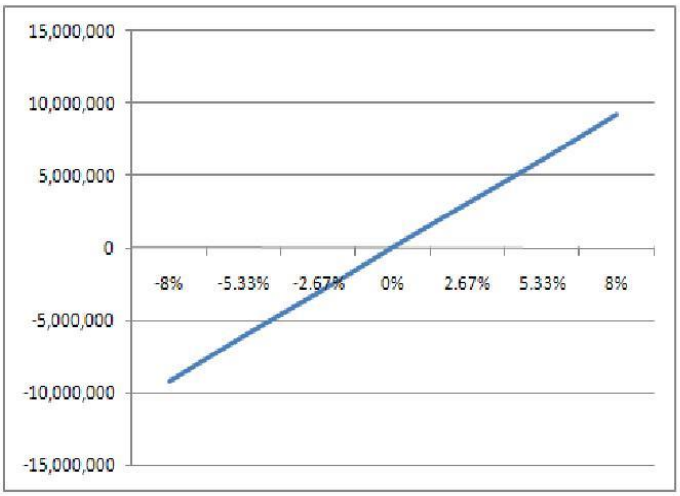
공시일: 2018-11-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	607	-607	장내
누계	주가지수	선물	85,726	0	85,726	장내
합계			85,726	0	85,726	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,859

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	34,943