펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-22

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	2,481	0	2,481	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	34	9,524	-9,489	장내
합계			2,516	9,524	-7,008	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	358

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,486

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

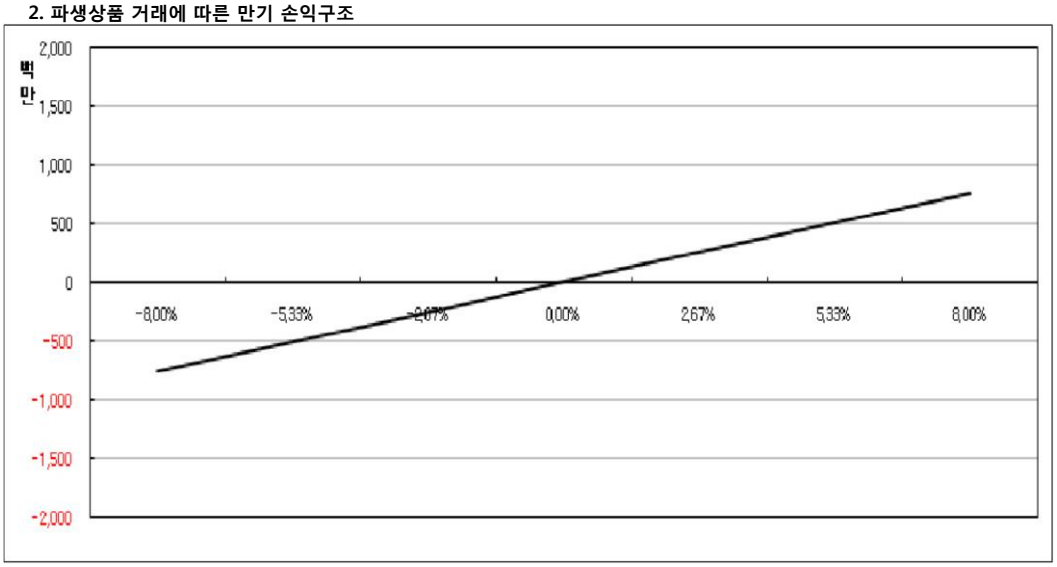
공시일: 2018-11-22

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	268	0	268	장내
합계			268	0	268	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,642

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

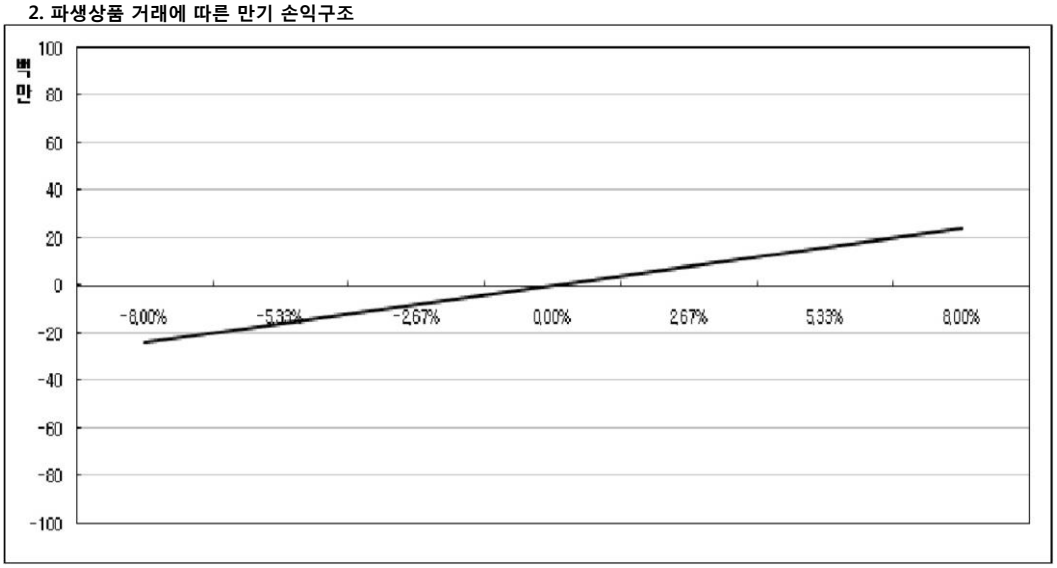
공시일: 2018-11-22

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	738	0	738	장내
합계			738	0	738	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,951

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

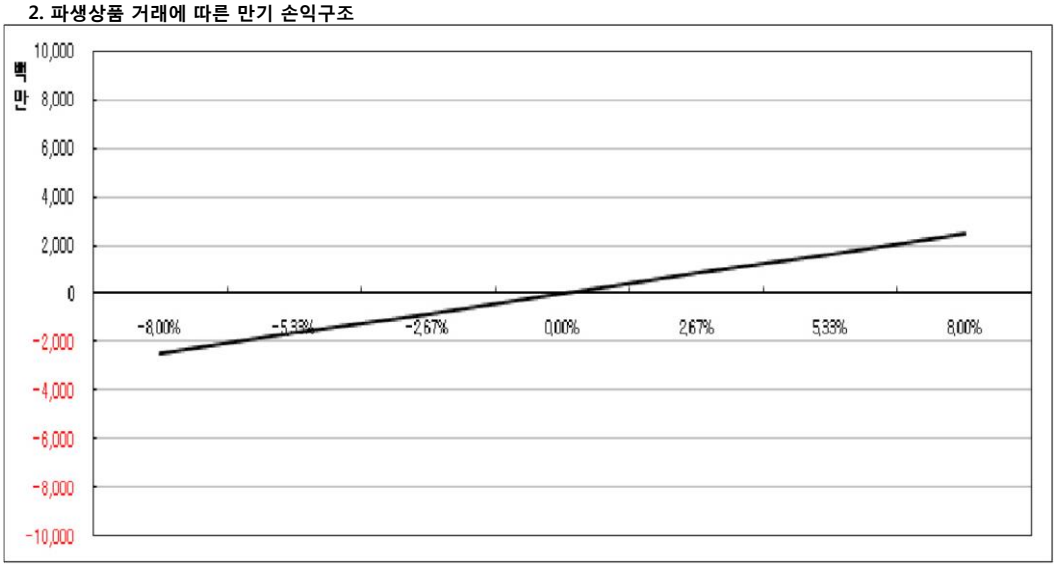
공시일: 2018-11-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	671	0	671	장내
누계	주가지수	선물	5,835	0	5,835	장내
합계			5,835	0	5,835	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 467

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,139

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

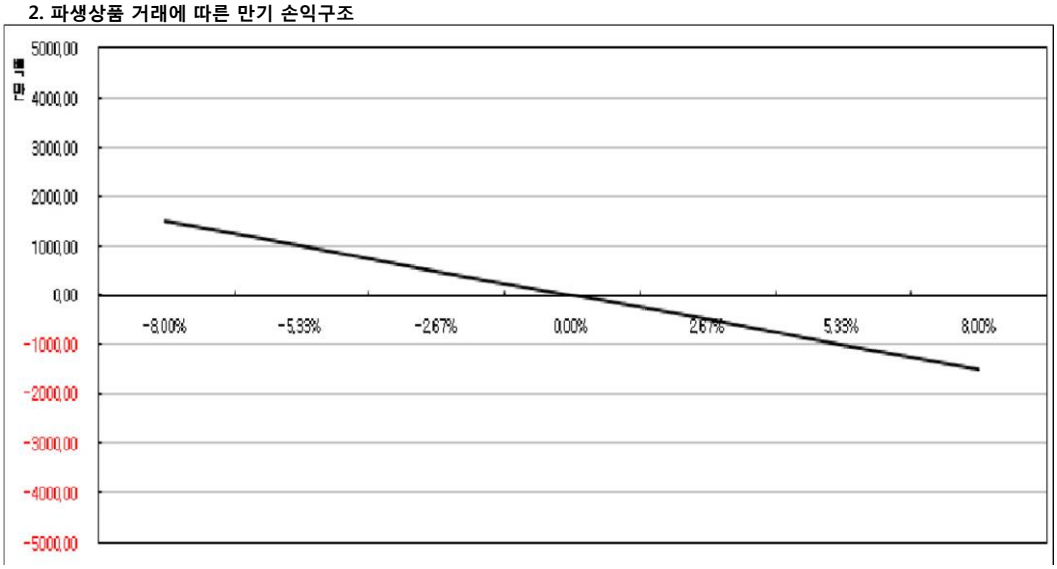
공시일: 2018-11-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	268	0	268	장내
누계	주가지수	선물	0	2,146	-2,146	장내
합계			0	2,146	-2,146	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 172

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 146

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

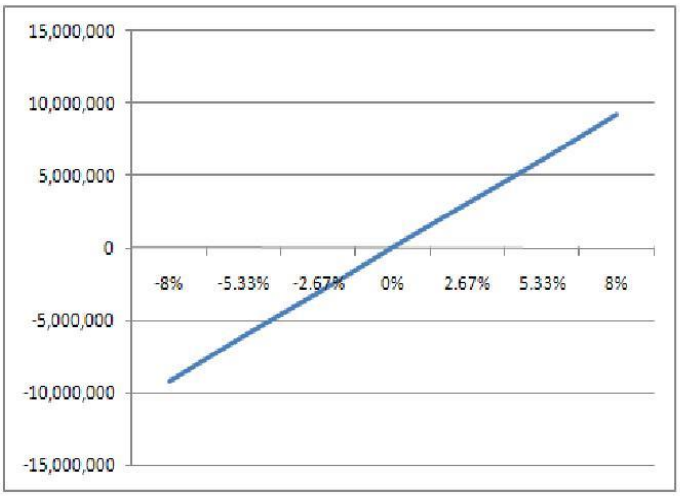
공시일: 2018-11-22

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	85,310	0	85,310	장내
합계			85,310	0	85,310	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,832

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 34,453