펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-23

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	2,477	0	2,477	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	33	9,505	-9,473	장내
합계			2,509	9,505	-6,996	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	347

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,418

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

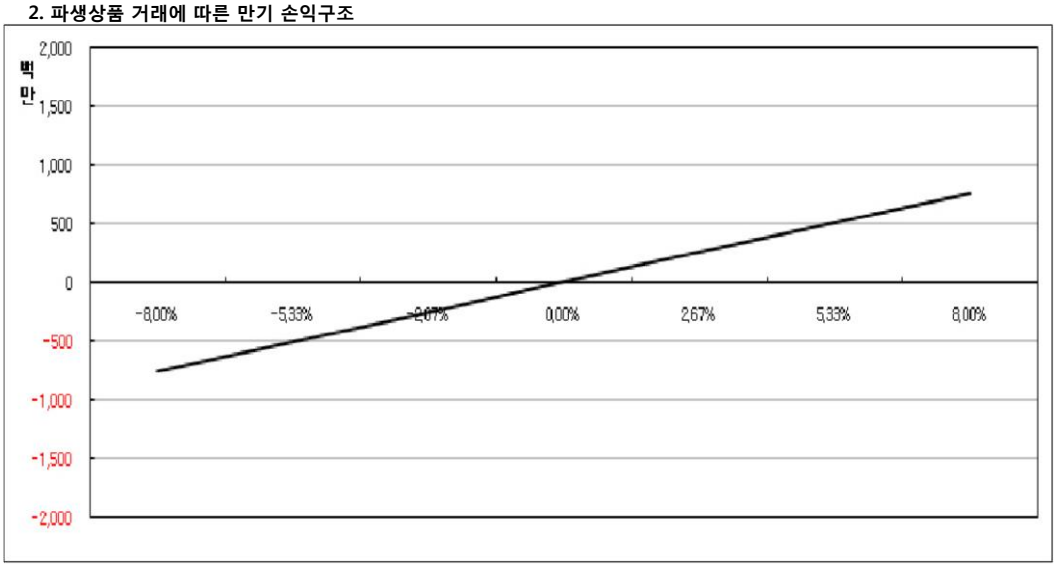
공시일: 2018-11-23

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)	2,662

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

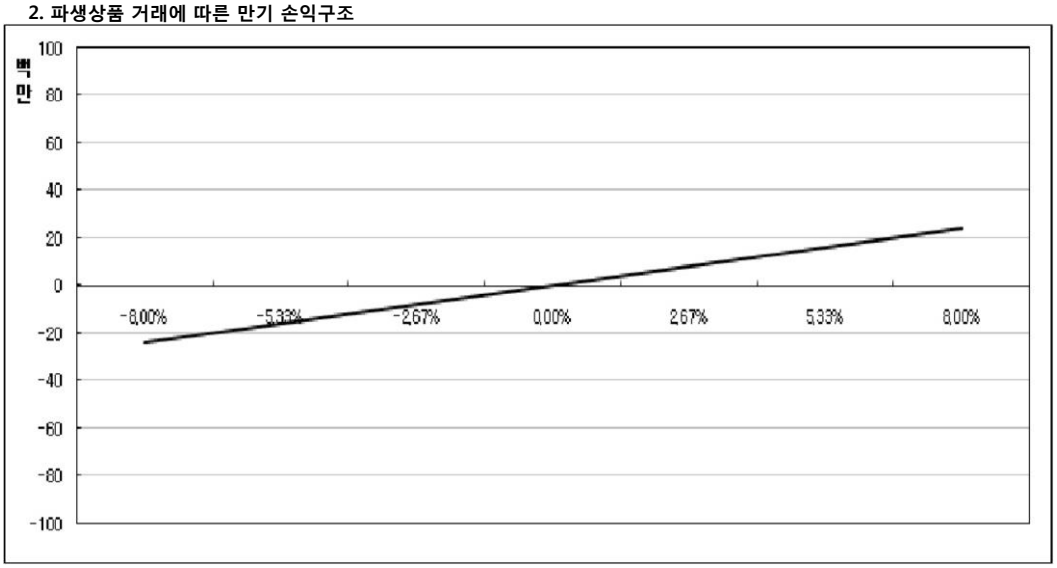
공시일: 2018-11-23

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	803	0	803	장내
합계			803	0	803	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,975

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

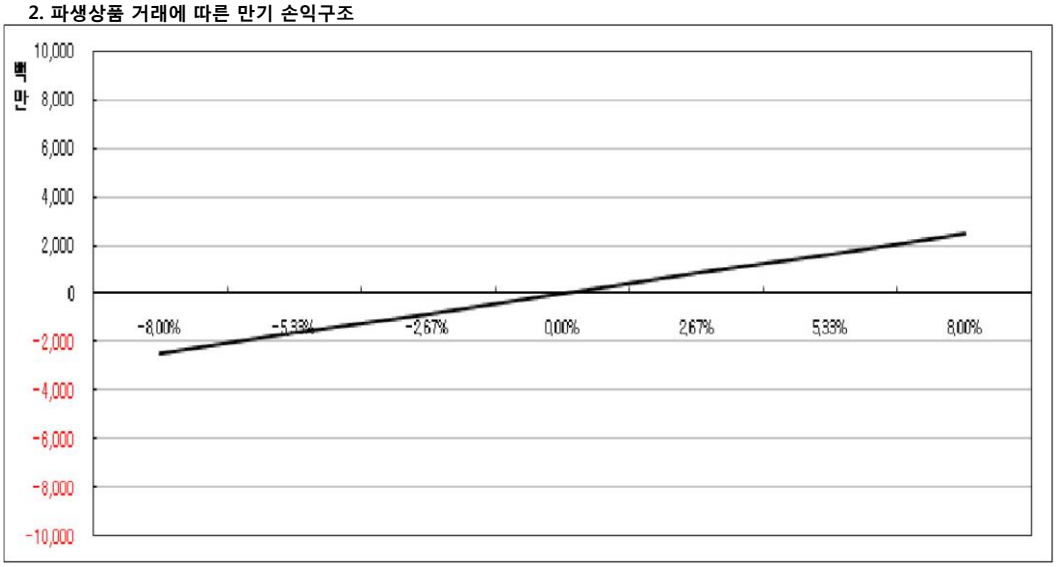
공시일: 2018-11-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	402	669	-268	장내
누계	주가지수	선물	5,556	0	5,556	장내
합계			5,556	0	5,556	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 446

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,168

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

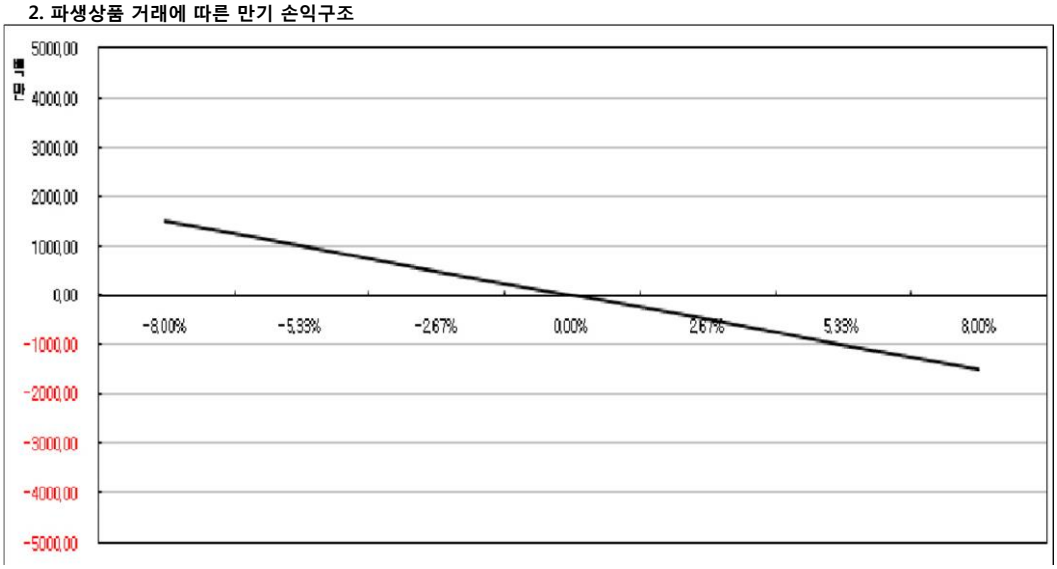
공시일: 2018-11-23

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	2,142	-2,142	장내
합계			0	2,142	-2,142	

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]

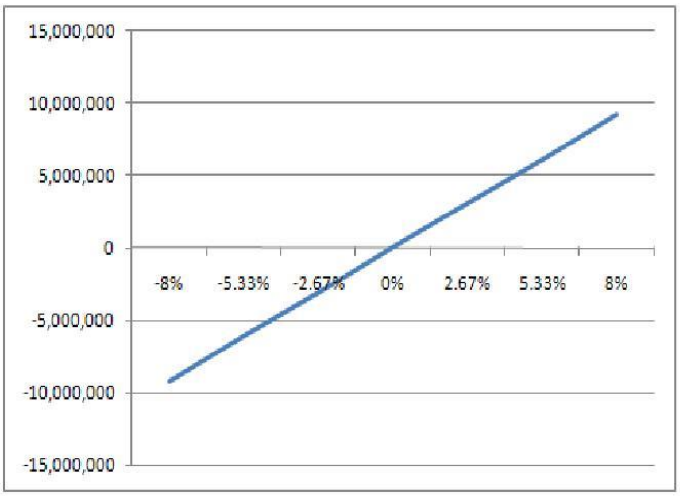
공시일: 2018-11-23

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	85,148	0	85,148	장내
합계			85,148	0	85,148	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,828

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

34,686