펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-26

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	2,464	0	2,464	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	39	9,455	-9,416	장내
합계			2,503	9,455	-6,952	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

322

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,234

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

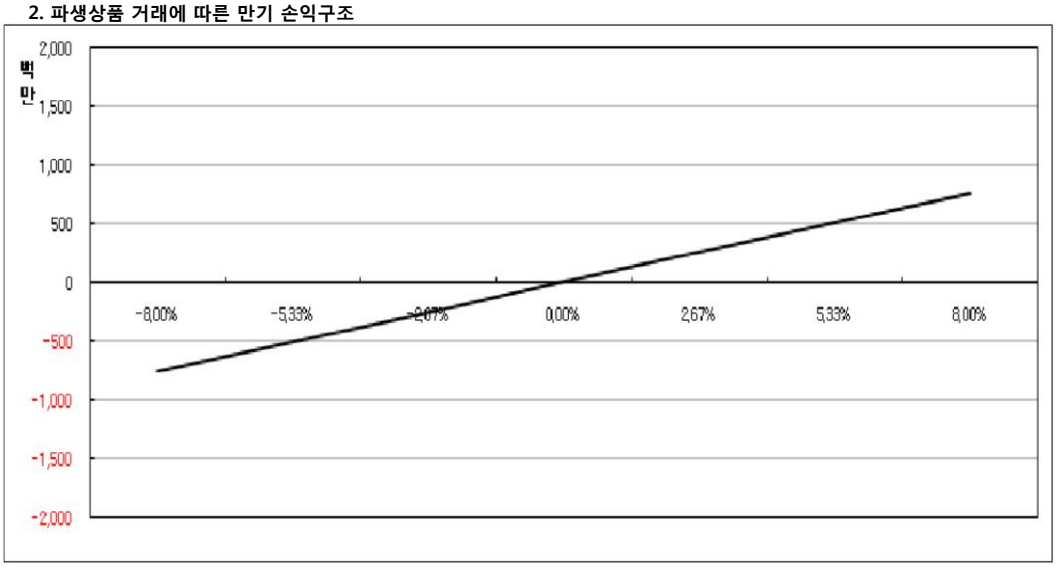
공시일: 2018-11-26

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	266	0	266	장내
합계			266	0	266	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,659

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

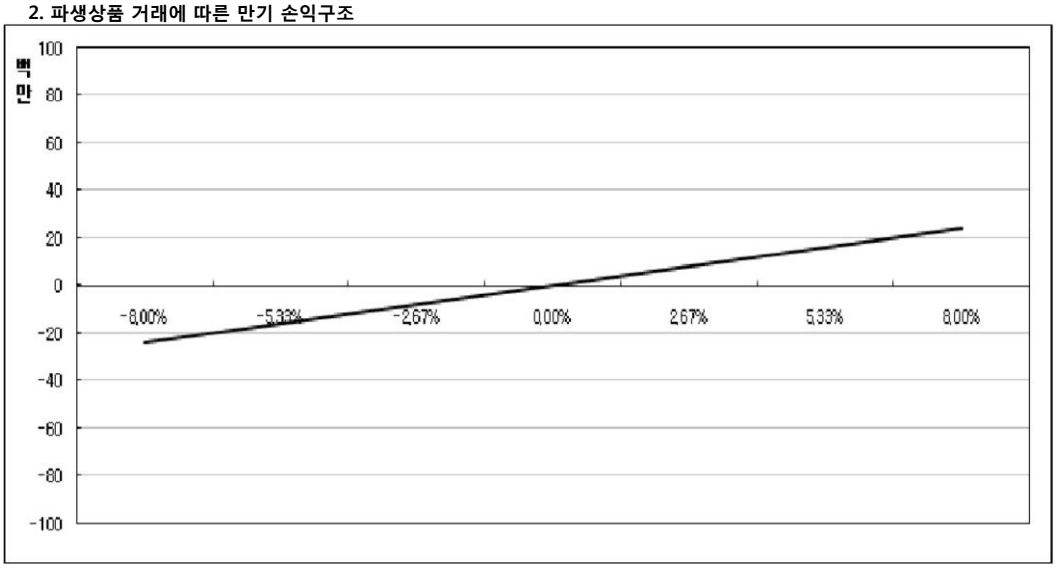
공시일: 2018-11-26

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	799	0	799	장내
합계			799	0	799	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,972

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

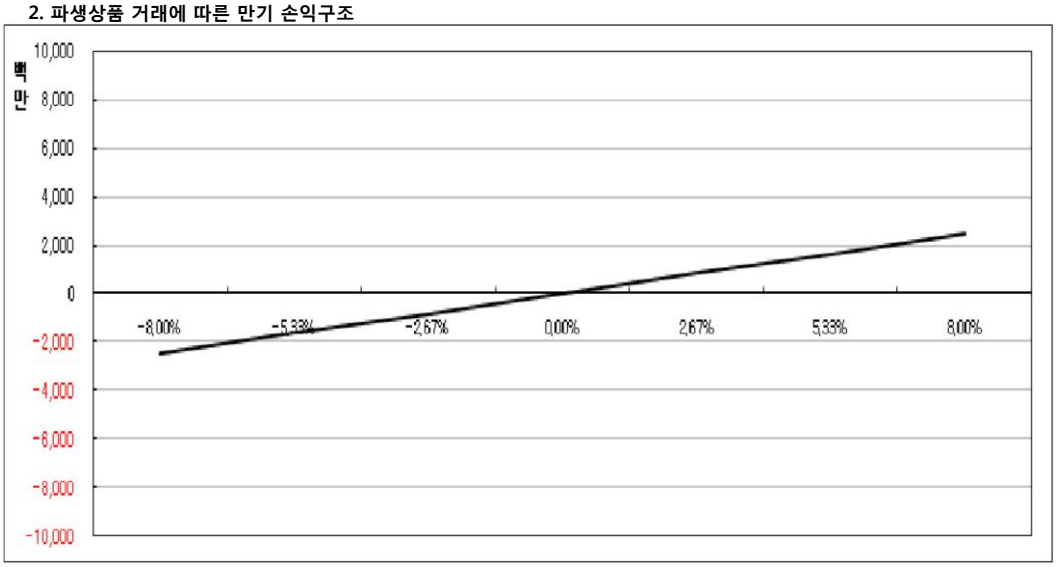
공시일: 2018-11-26

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	5,526	0	5,526	장내
합계			5,526	0	5,526	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 442

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,160

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

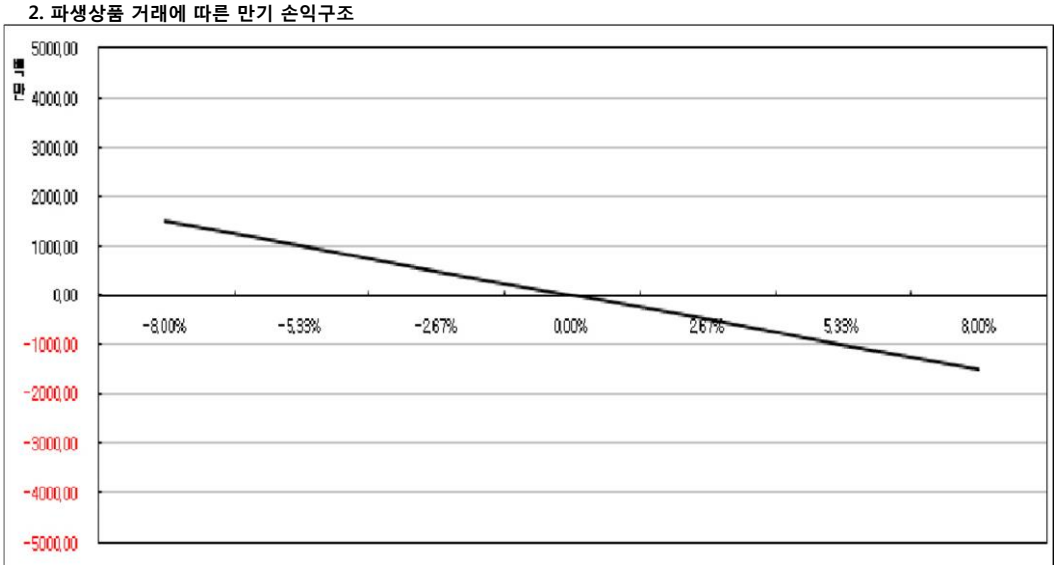
공시일: 2018-11-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	200	-200	장내
누계	주가지수	선물	0	2,330	-2,330	장내
합계			0	2,330	-2,330	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 186

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 159

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

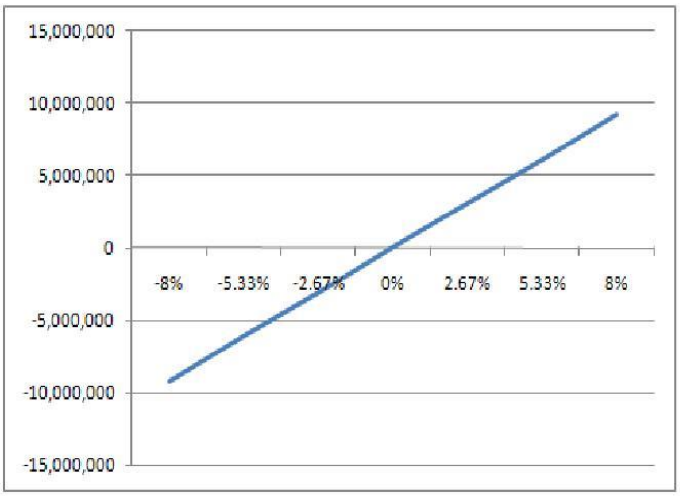
공시일: 2018-11-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	266	-266	장내
누계	주가지수	선물	84,427	0	84,427	장내
합계			84,427	0	84,427	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,756

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 34,608