펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-27

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	2,496	0	2,496	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	22	9,578	-9,556	장내
합계			2,517	9,578	-7,060	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

384

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,498

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

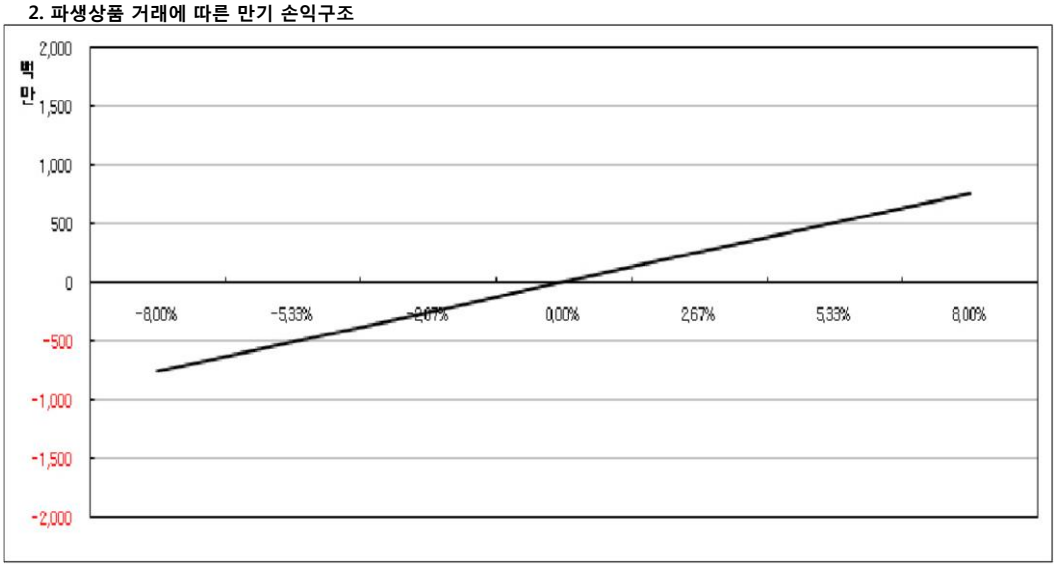
공시일: 2018-11-27

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)	2,679

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

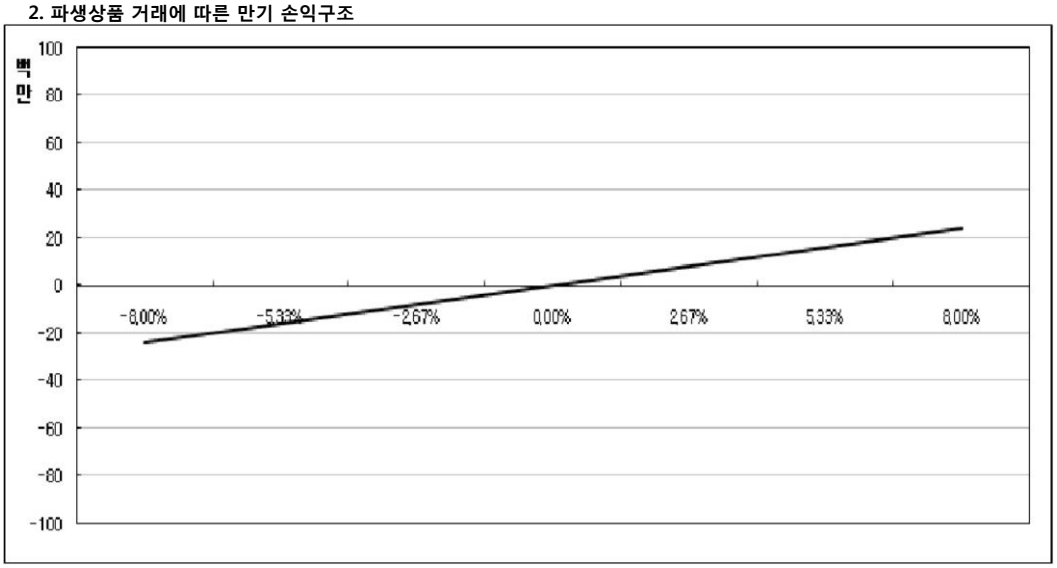
공시일: 2018-11-27

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	809	0	809	장내
합계			809	0	809	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,993

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

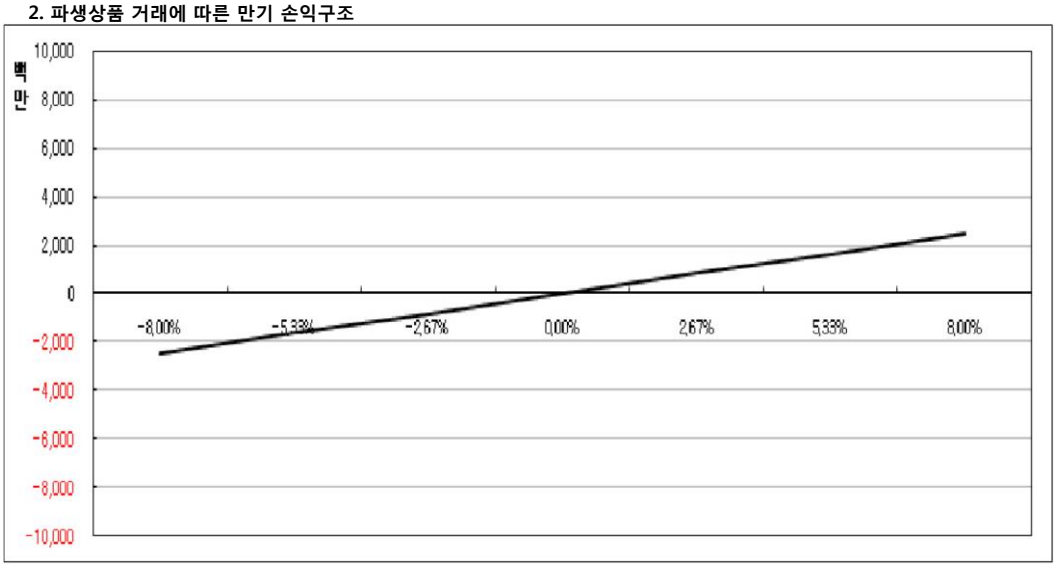
공시일: 2018-11-27

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	5,598	0	5,598	장내
합계			5,598	0	5,598	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 449

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,197

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

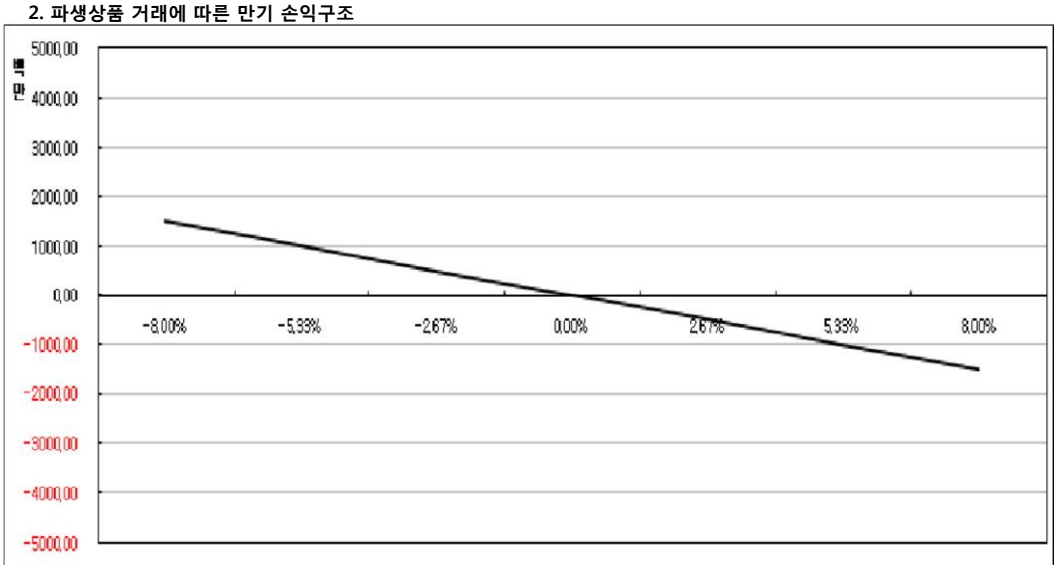
공시일: 2018-11-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	405	202	202	장내
누계	주가지수	선물	0	2,158	-2,158	장내
합계			0	2,158	-2,158	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 173

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 147

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

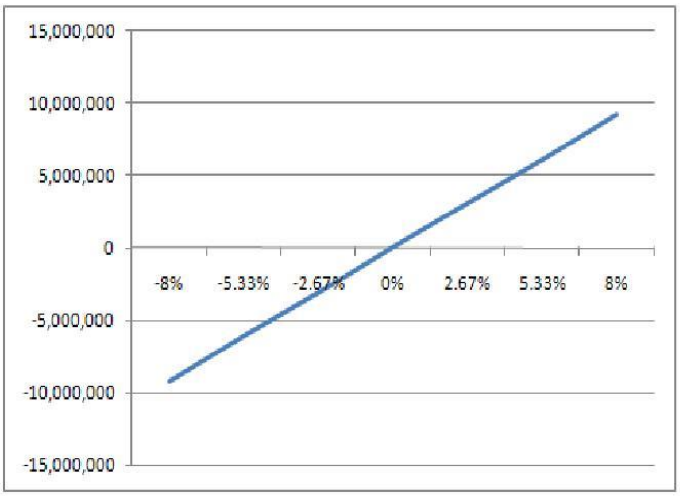
공시일: 2018-11-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	944	0	944	장내
누계	주가지수	선물	86,468	0	86,468	장내
합계			86,468	0	86,468	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,936

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

34,893