펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-28

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	2,517	0	2,517	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	16	9,659	-9,643	장내
합계			2,532	9,659	-7,127	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 430

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 1,694

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

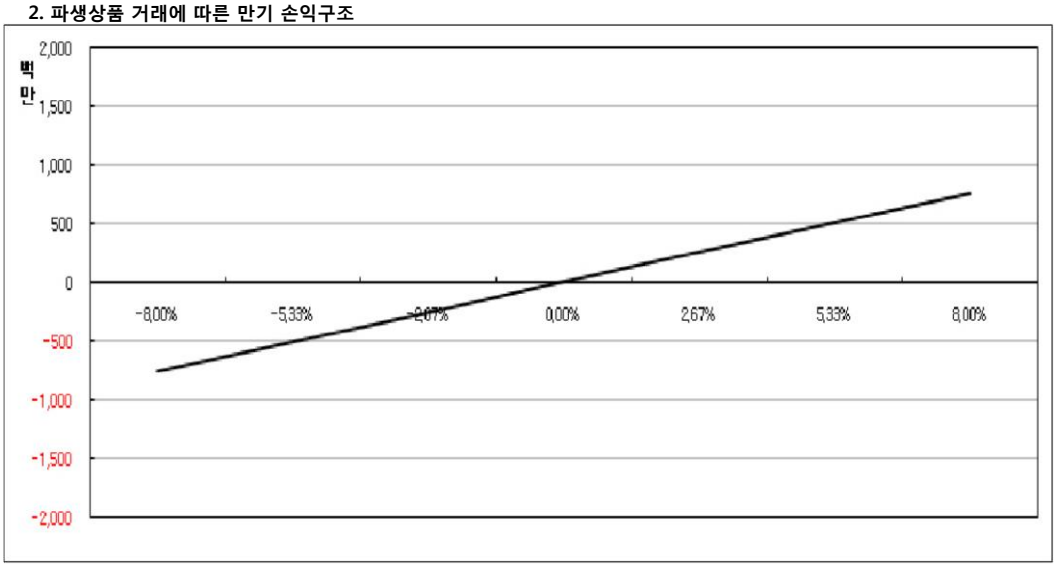
공시일: 2018-11-28

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	272	0	272	장내
합계			272	0	272	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,706

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

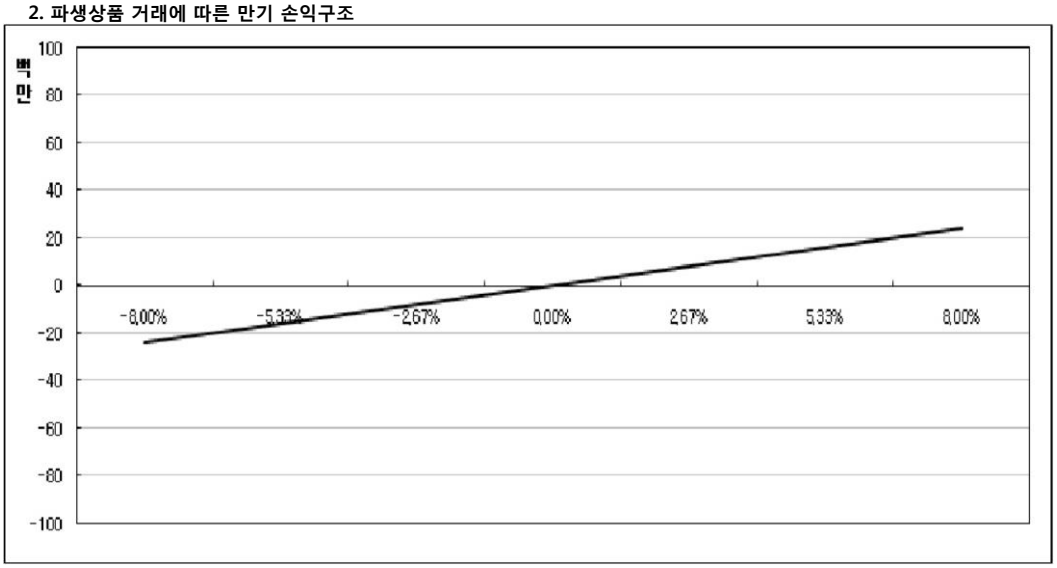
공시일: 2018-11-28

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	816	0	816	장내
합계			816	0	816	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,024

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

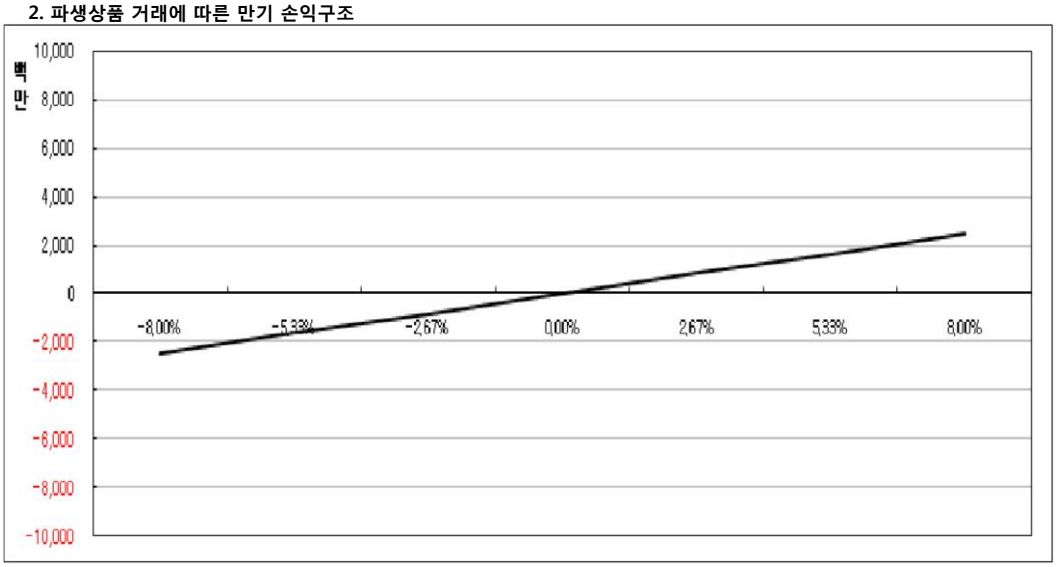
공시일: 2018-11-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	340	476	-136	장내
누계	주가지수	선물	5,510	0	5,510	장내
합계			5,510	0	5,510	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 441

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,246

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

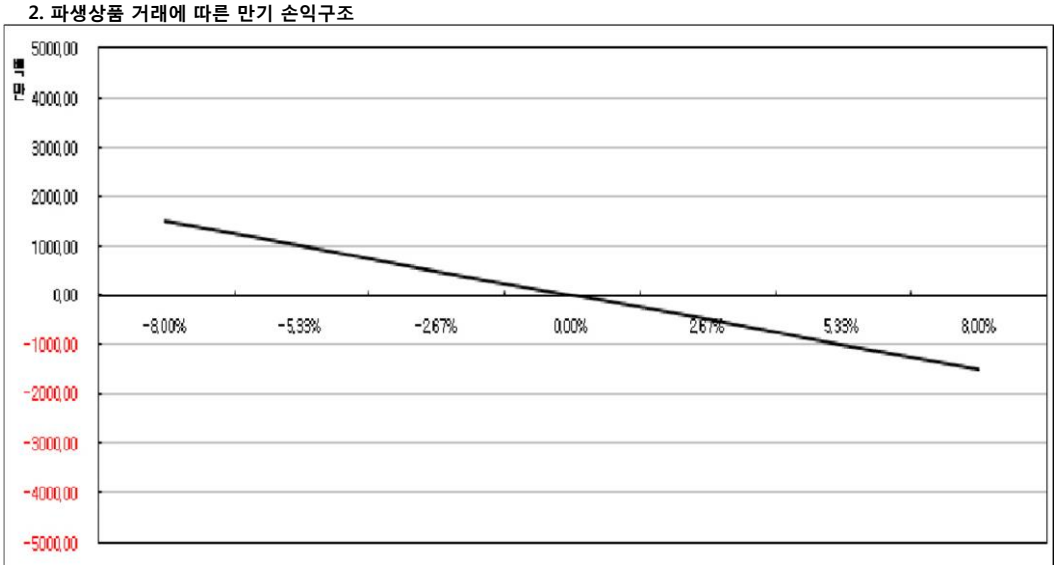
공시일: 2018-11-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	68	0	68	장내
누계	주가지수	선물	0	2,109	-2,109	장내
합계			0	2,109	-2,109	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 143

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

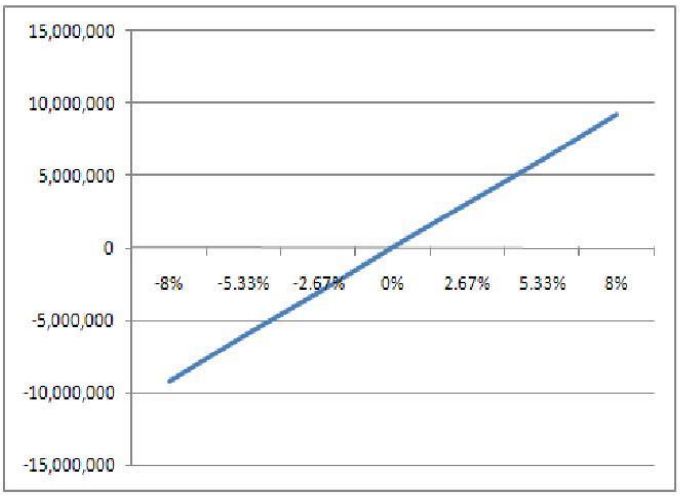
공시일: 2018-11-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	680	0	680	장내
누계	주가지수	선물	87,882	0	87,882	장내
합계			87,882	0	87,882	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

7,040

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

35,277