펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-11-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,302	0	1,302	장내
누계	주가지수	선물	3,838	0	3,838	장내
신규	주가지수	옵션	41	4,524	-4,483	장내
누계	주가지수	옵션	53	14,256	-14,204	장내
합계			3,891	14,256	-10,365	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

694

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,327

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

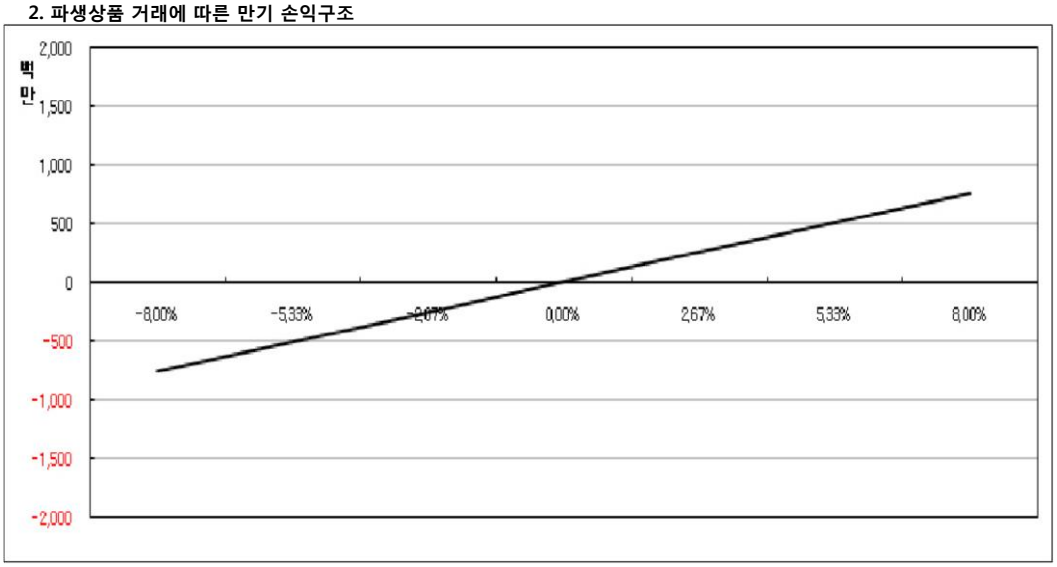
공시일: 2018-11-30

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	274	0	274	장내
합계			274	0	274	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,713

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

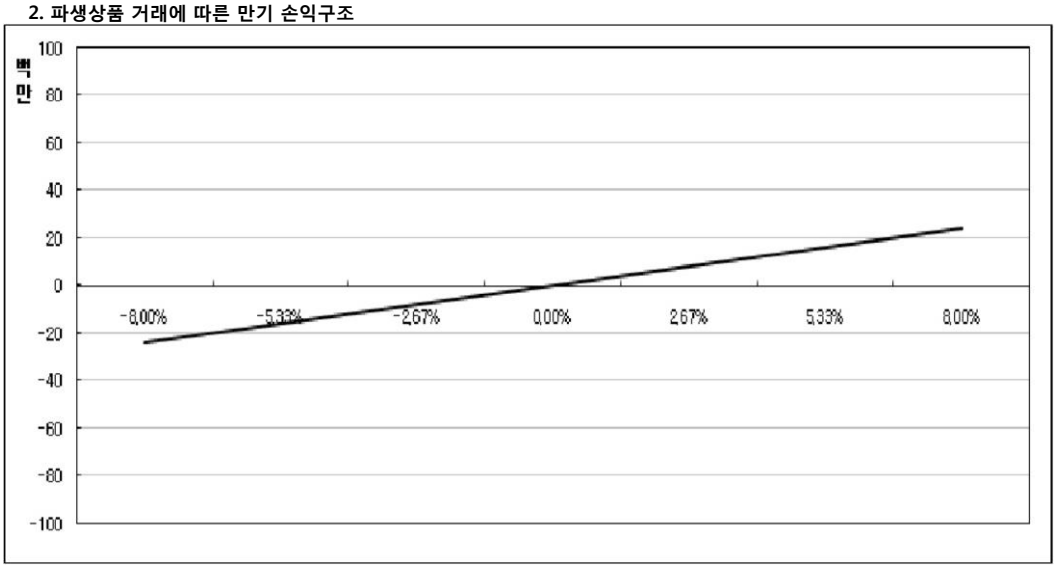
공시일: 2018-11-30

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	822	0	822	장내
합계			822	0	822	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	3,033

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

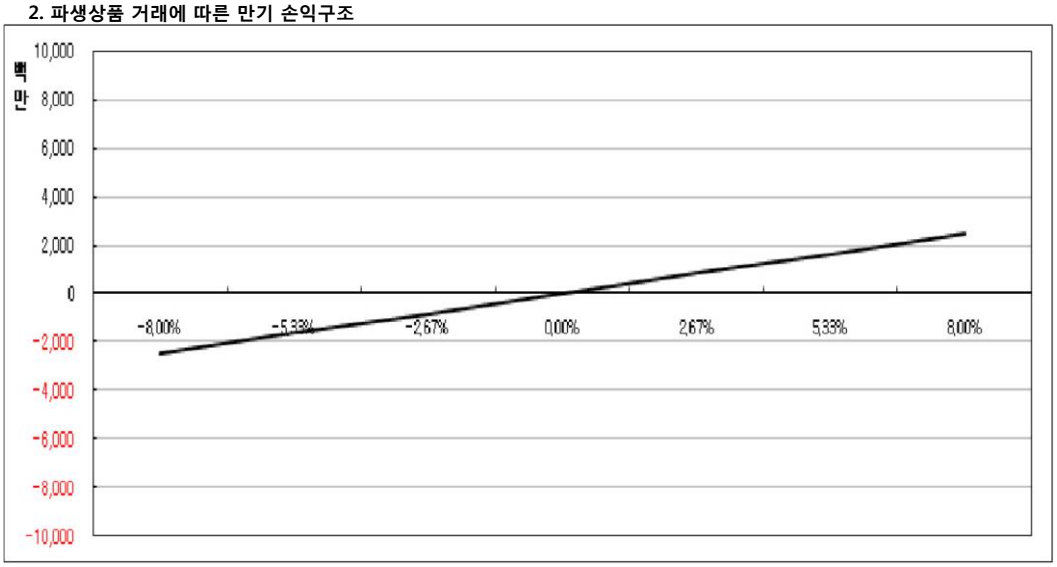
공시일: 2018-11-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	137	-137	장내
누계	주가지수	선물	5,415	0	5,415	장내
합계			5,415	0	5,415	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 433

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,256

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

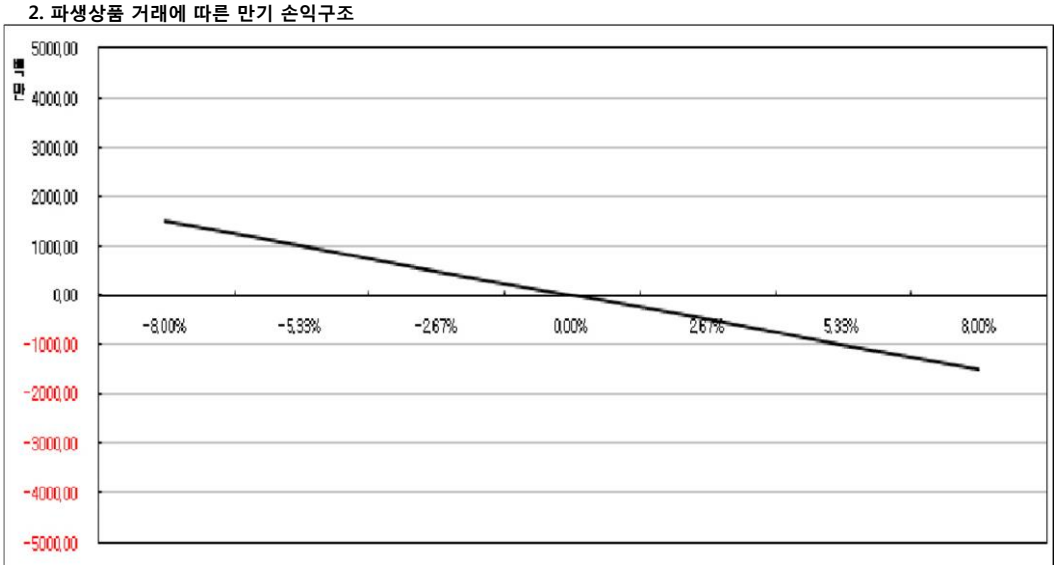
공시일: 2018-11-30

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	2,399	-2,399	장내
합계			0	2,399	-2,399	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 192

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 162

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

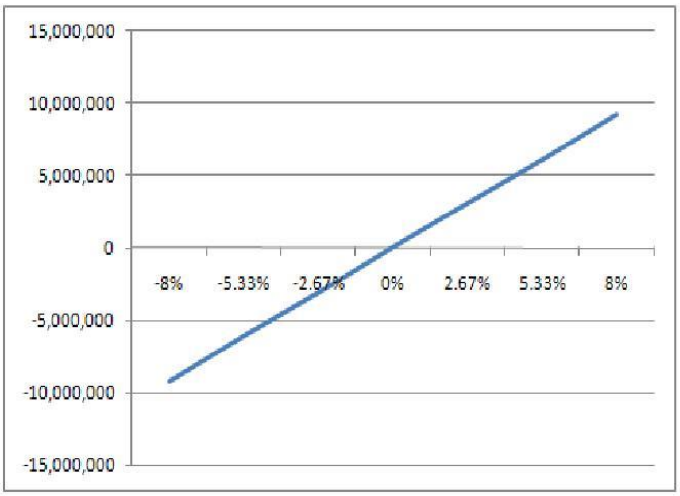
공시일: 2018-11-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	822	-822	장내
누계	주가지수	선물	87,731	0	87,731	장내
합계			87,731	0	87,731	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

7,022

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

35,358