펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-04

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	3,867	0	3,867	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	21	14,361	-14,341	장내
합계			3,887	14,361	-10,474	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

744

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,333

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

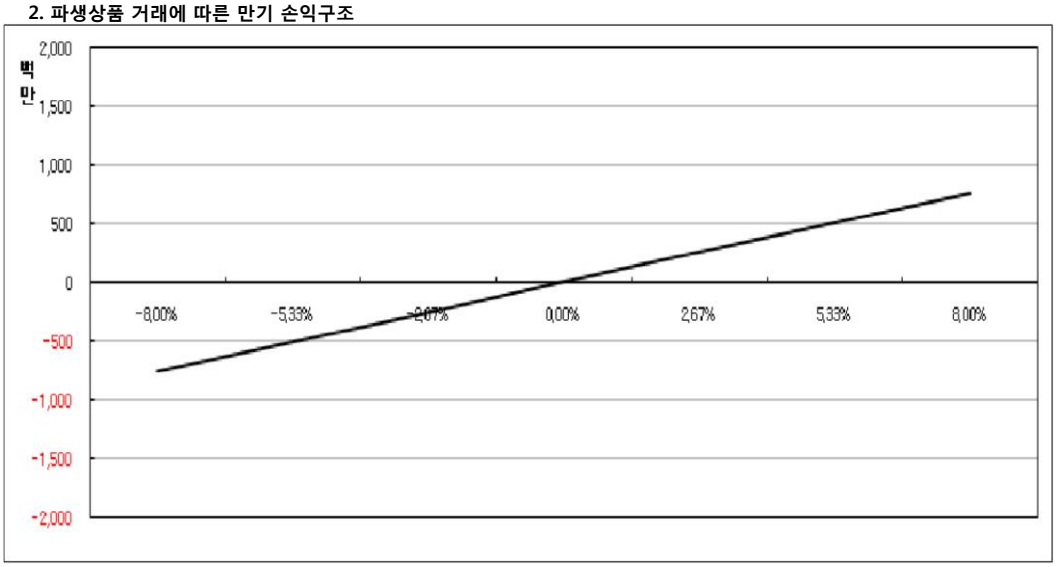
공시일: 2018-12-04

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	276	0	276	장내
합계			276	0	276	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,724

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

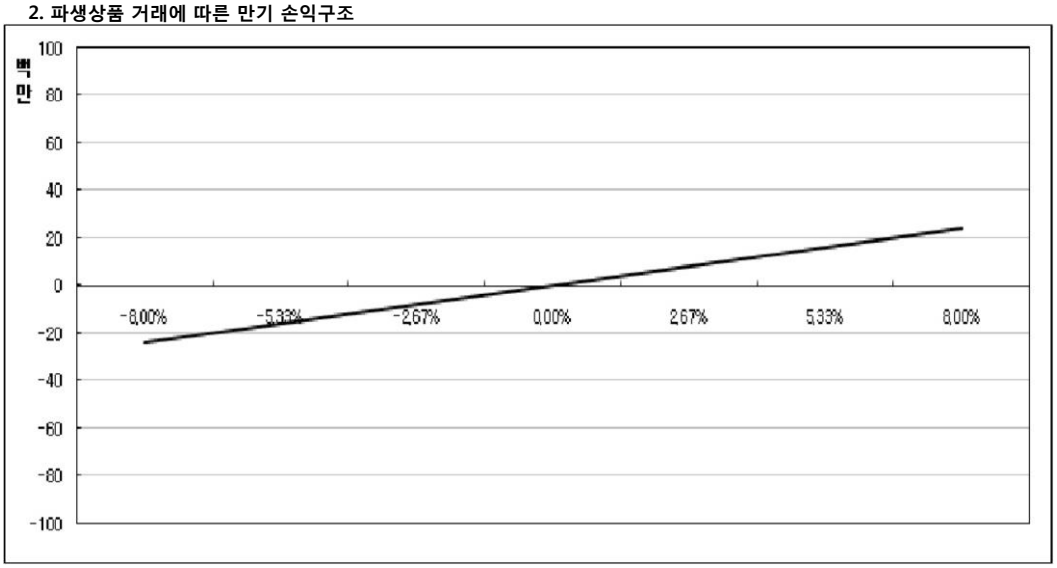
공시일: 2018-12-04

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	829	0	829	장내
합계			829	0	829	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 3,045

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

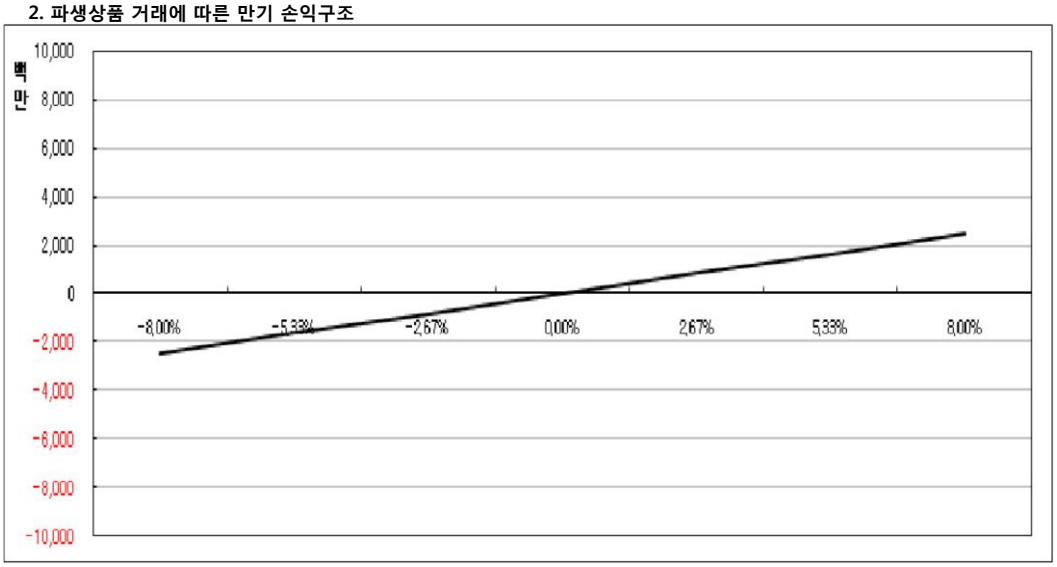
공시일: 2018-12-04

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	5,455	0	5,455	장내
합계			5,455	0	5,455	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 437

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,280

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

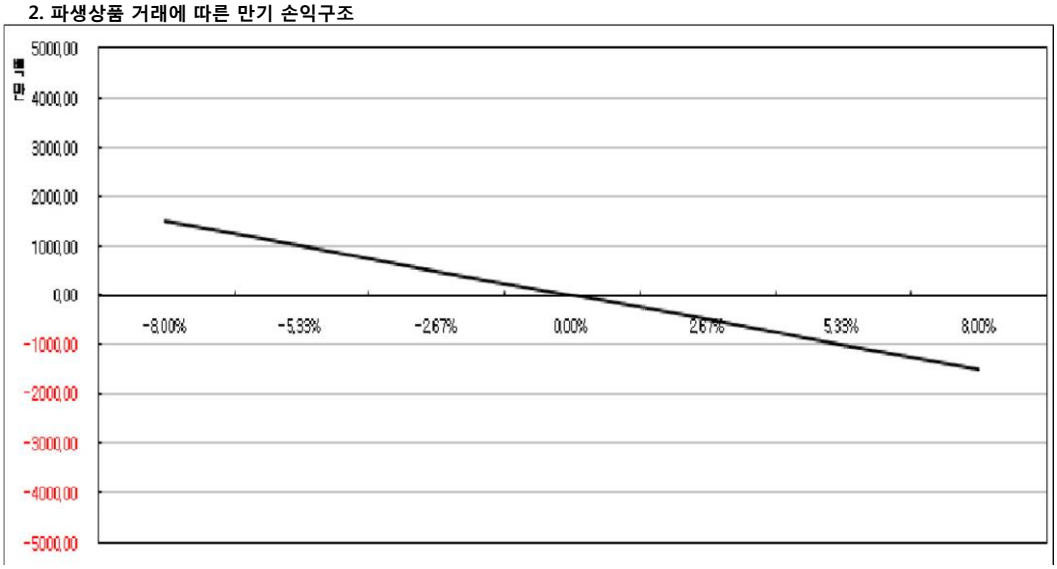
공시일: 2018-12-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	276	0	276	장내
누계	주가지수	선물	0	2,140	-2,140	장내
합계			0	2,140	-2,140	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 171

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 146

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

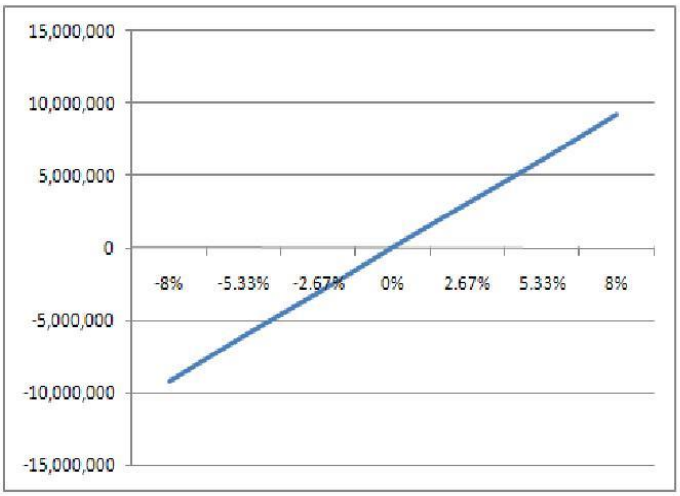
공시일: 2018-12-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	414	0	414	장내
누계	주가지수	선물	87,687	0	87,687	장내
합계			87,687	0	87,687	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

7,021

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

35,518