펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,826	3,894	-68	장내
누계	주가지수	선물	3,758	0	3,758	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	30	14,211	-14,181	장내
합계			3,788	14,211	-10,423	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	691

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,793

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

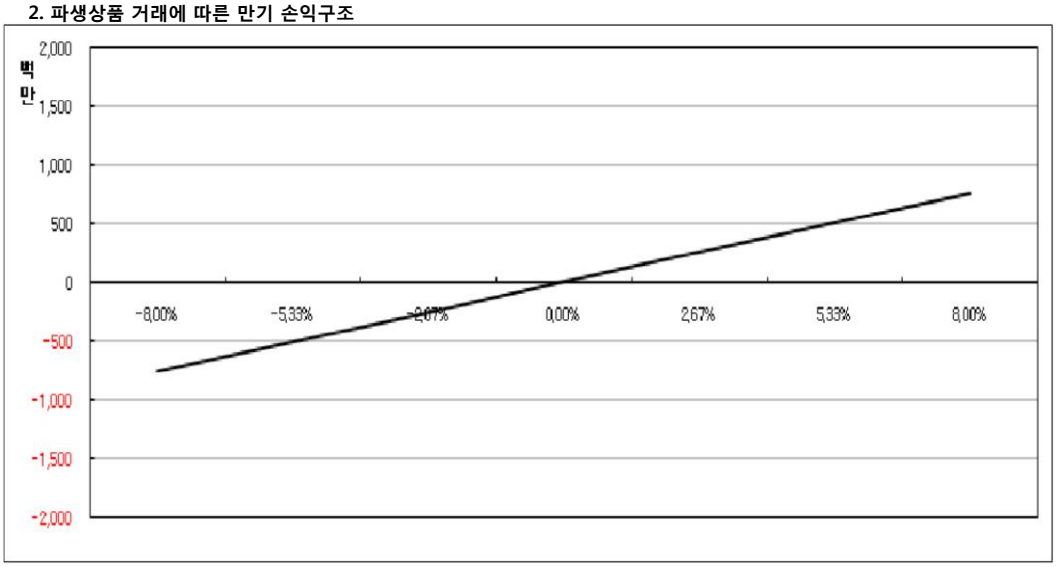
공시일: 2018-12-05

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	273	0	273	장내
합계			273	0	273	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,658

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

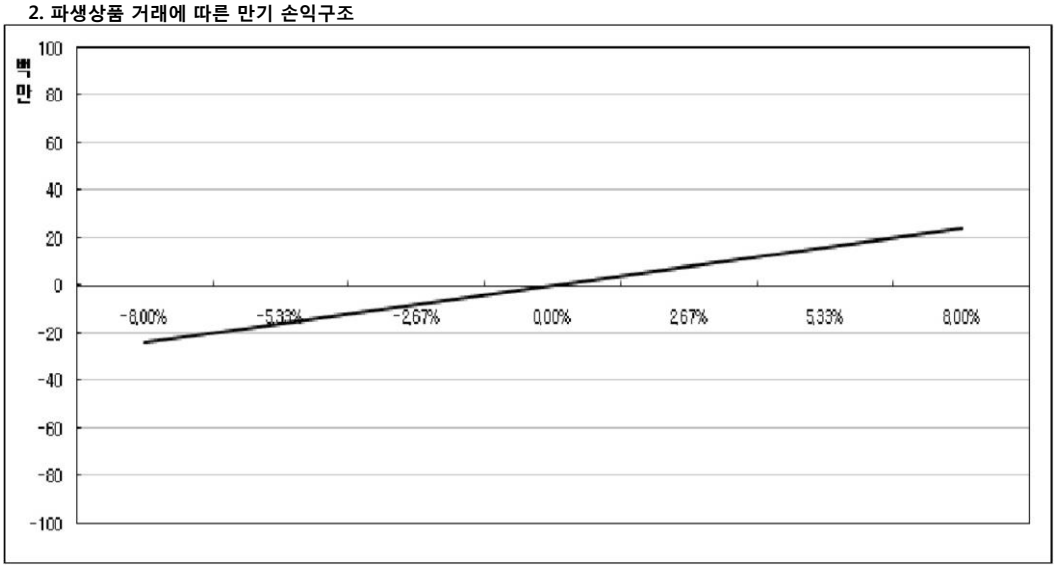
공시일: 2018-12-05

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	820	0	820	장내
합계			820	0	820	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	66

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,971

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

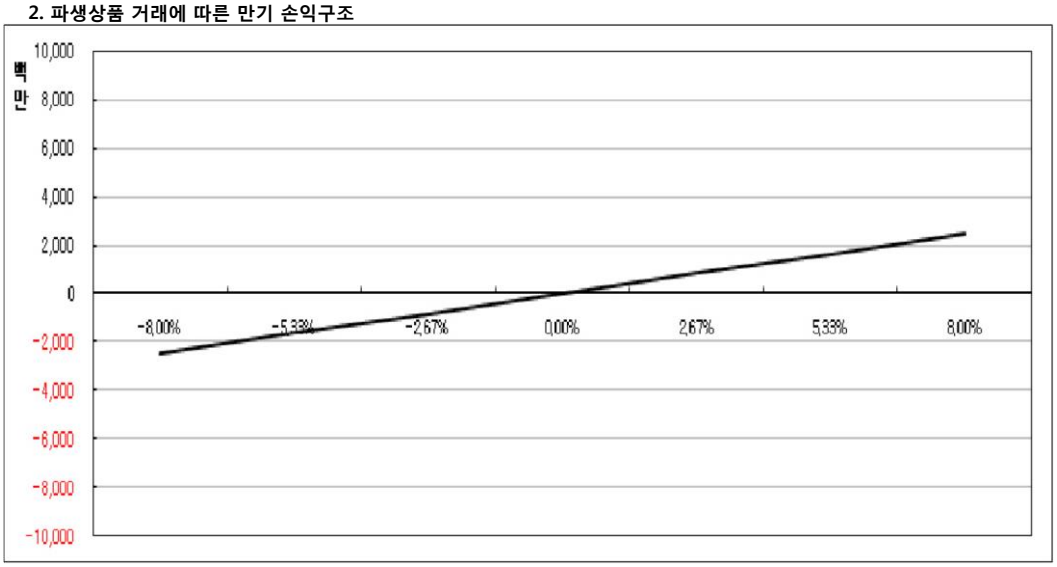
공시일: 2018-12-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	205	0	205	장내
누계	주가지수	선물	5,602	0	5,602	장내
합계			5,602	0	5,602	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 449

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,160

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

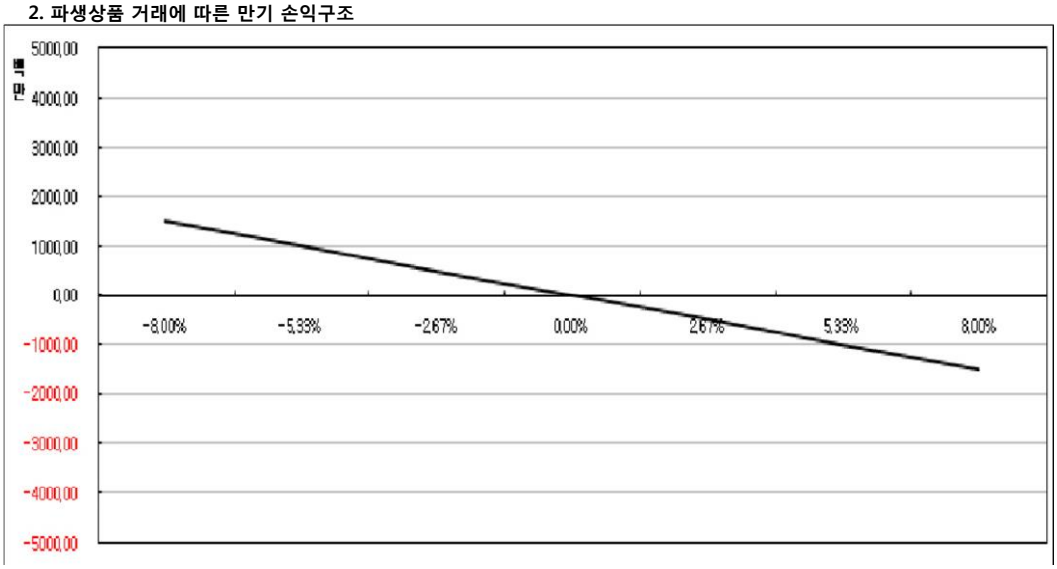
공시일: 2018-12-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	273	0	273	장내
누계	주가지수	선물	0	1,845	-1,845	장내
합계			0	1,845	-1,845	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	148

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	126

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

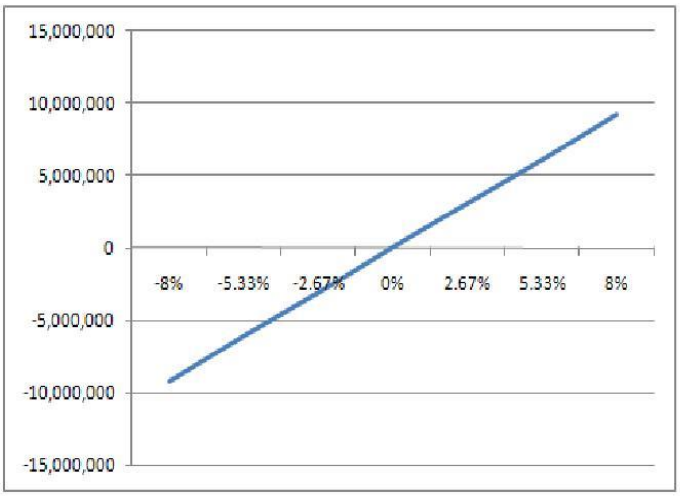
공시일: 2018-12-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	615	-615	장내
누계	주가지수	선물	86,155	0	86,155	장내
합계			86,155	0	86,155	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,904

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 34,666