펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-06

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	3,733	0	3,733	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	42	14,117	-14,075	장내
합계			3,775	14,117	-10,342	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

648

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,619

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

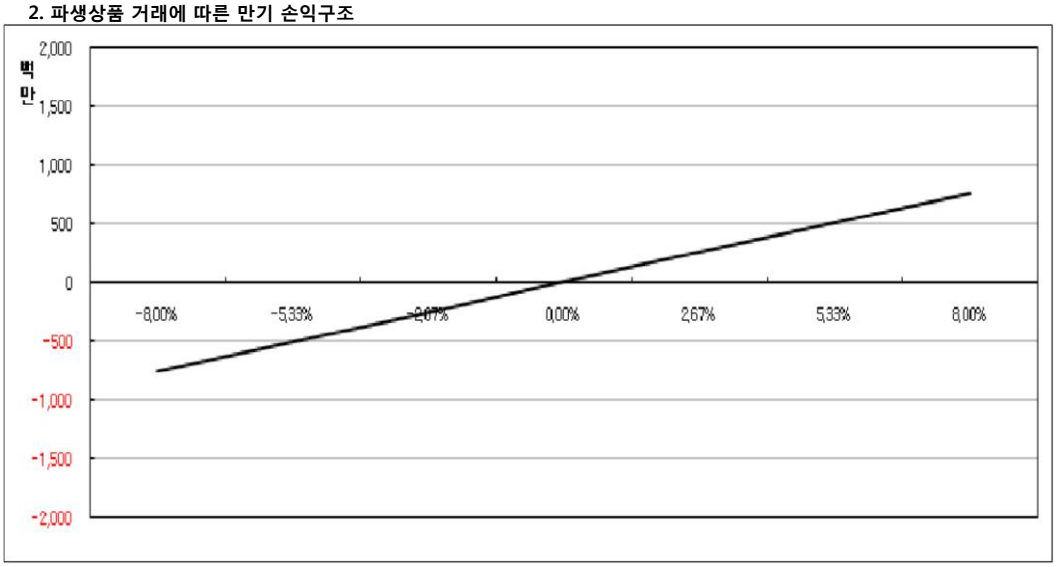
공시일: 2018-12-06

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	271	0	271	장내
합계			271	0	271	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,615

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

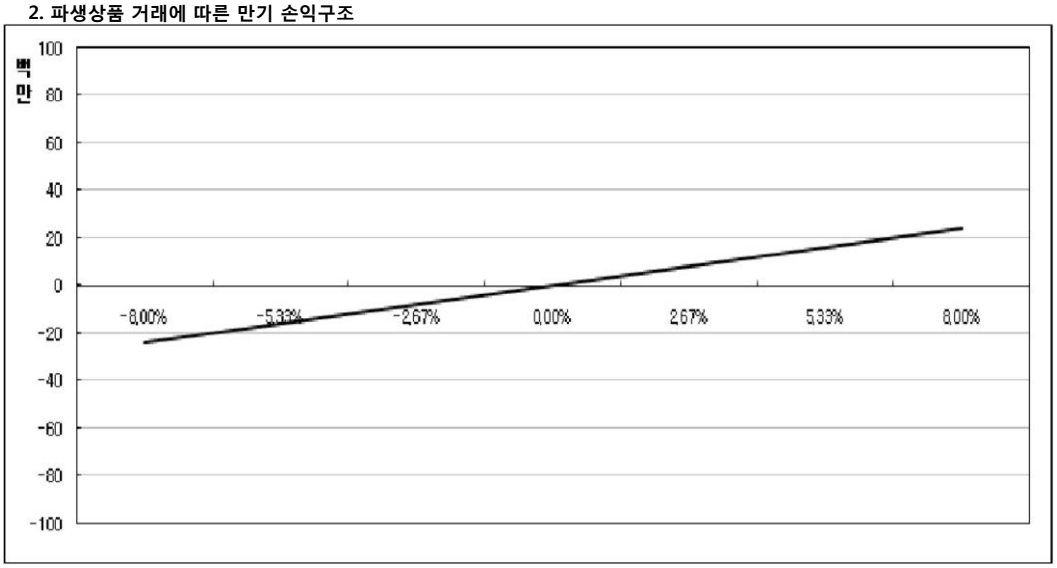
공시일: 2018-12-06

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	814	0	814	장내
합계			814	0	814	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,924

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

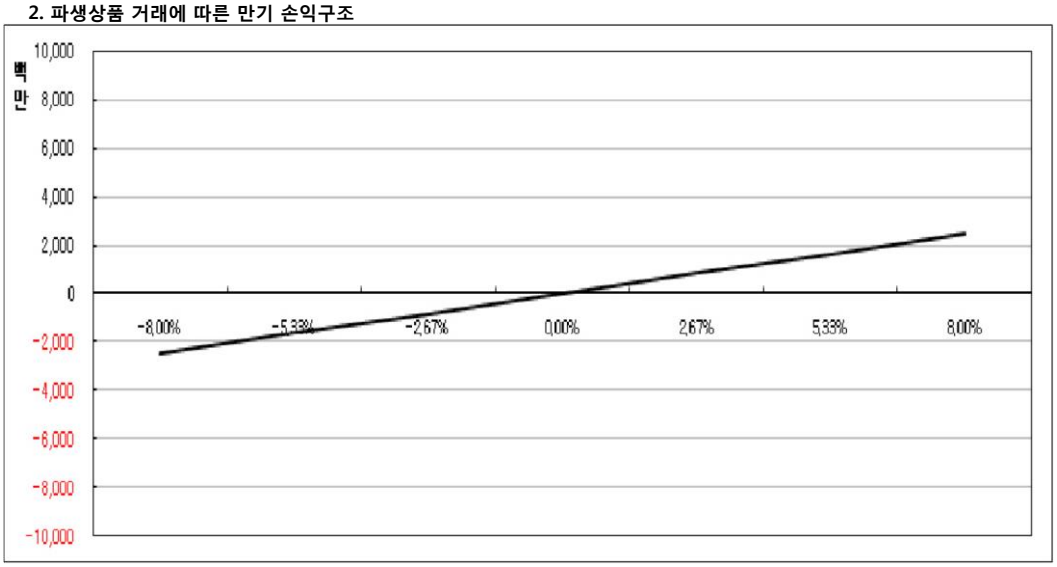
공시일: 2018-12-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	136	-136	장내
누계	주가지수	선물	5,430	0	5,430	장내
합계			5,430	0	5,430	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 435

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,073

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

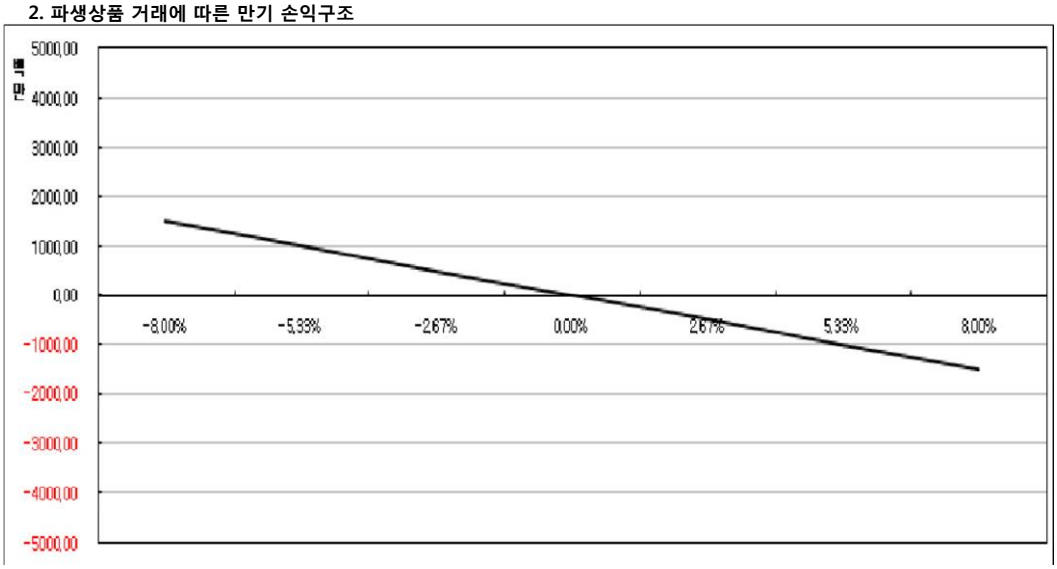
공시일: 2018-12-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	475	-475	장내
누계	주가지수	선물	0	2,308	-2,308	장내
합계			0	2,308	-2,308	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 185

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 157

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

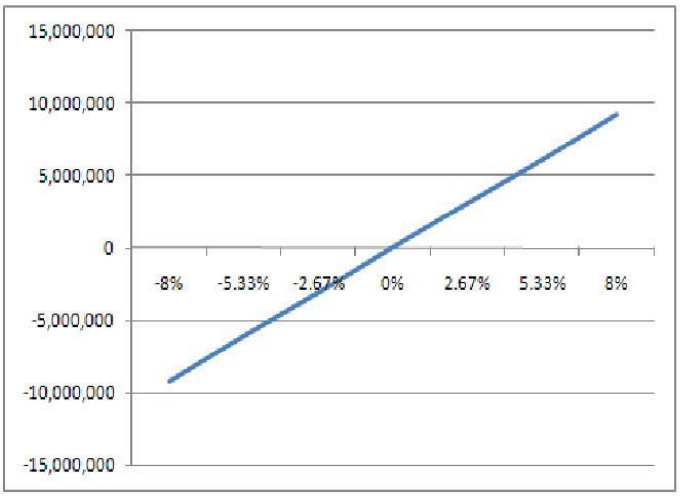
공시일: 2018-12-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	204	-204	장내
누계	주가지수	선물	85,384	0	85,384	장내
합계			85,384	0	85,384	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,841

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	34,118