펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	67	0	67	장내
누계	주가지수	선물	3,741	0	3,741	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	98	13,893	-13,796	장내
합계			3,838	13,893	-10,055	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	527

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,683

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

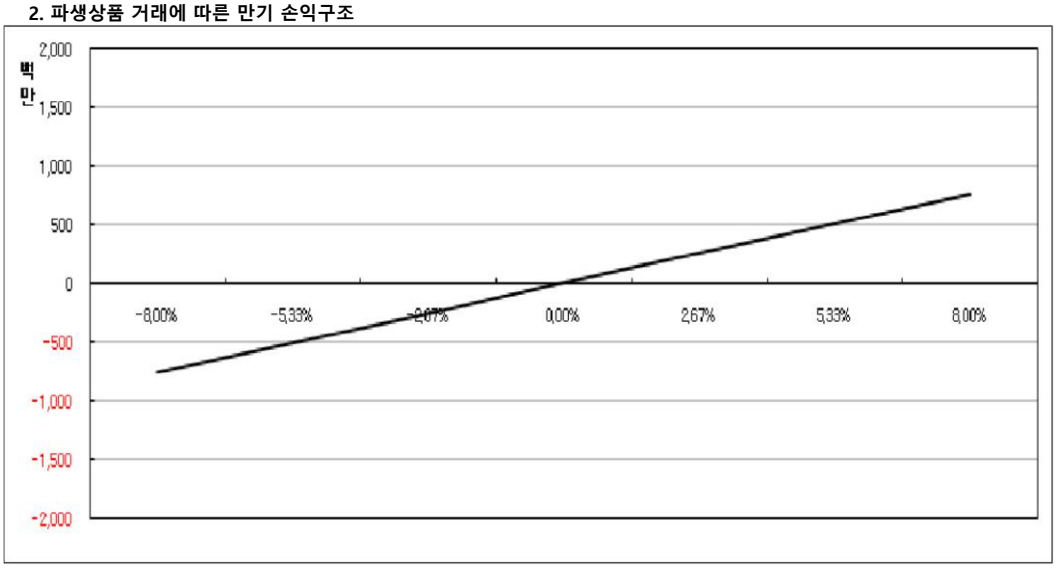
공시일: 2018-12-07

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	267	0	267	장내
합계			267	0	267	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,548

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

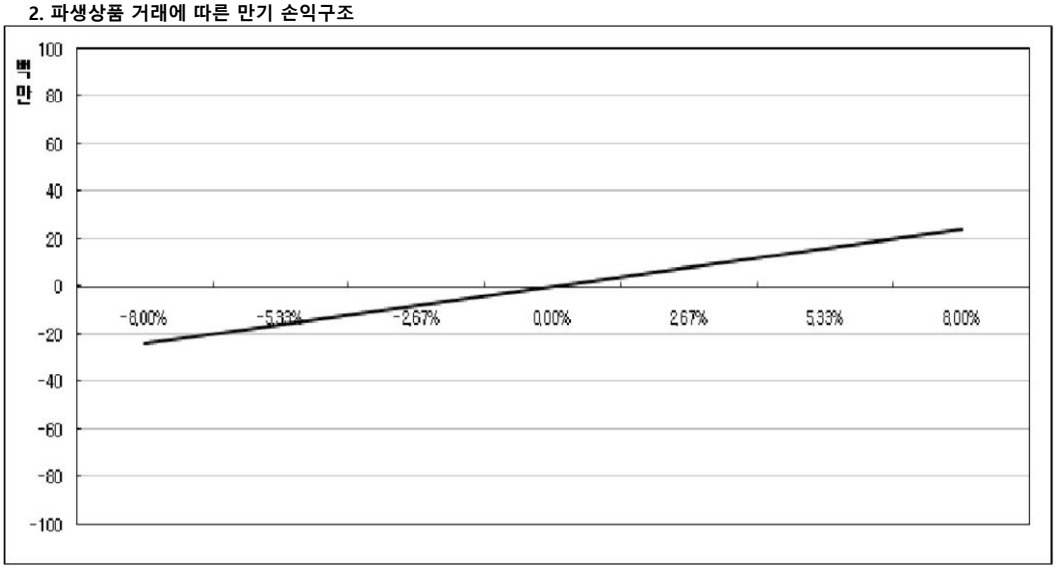
공시일: 2018-12-07

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	802	0	802	장내
합계			802	0	802	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,834

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

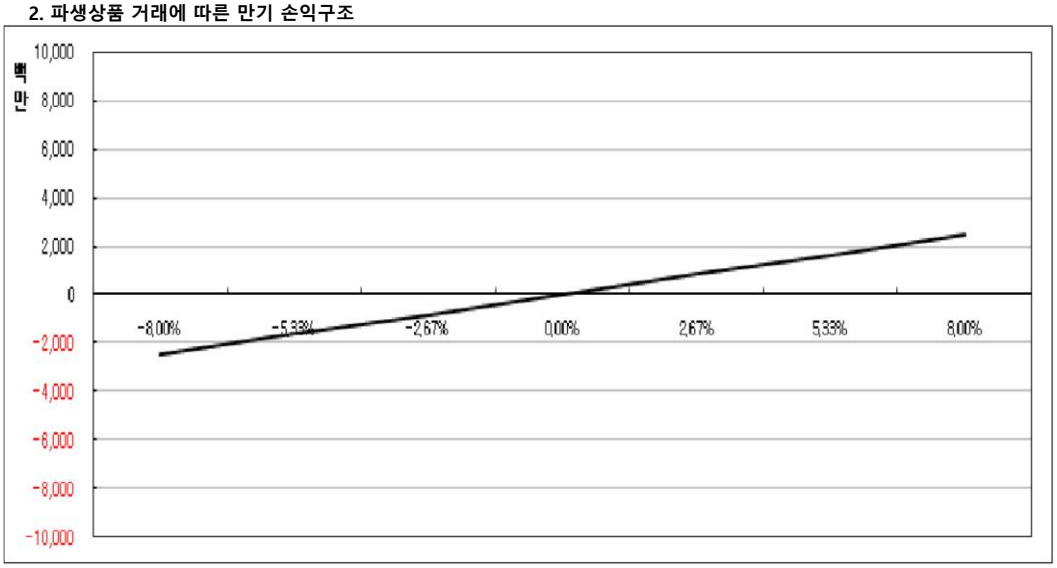
공시일: 2018-12-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	67	0	67	장내
누계	주가지수	선물	5,410	0	5,410	장내
합계			5,410	0	5,410	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 433

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,790

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

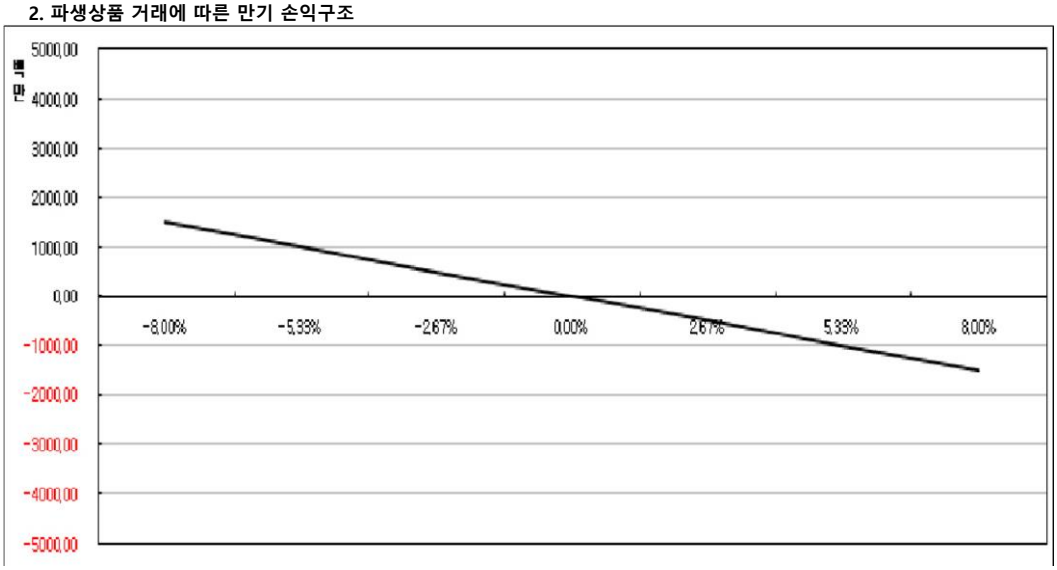
공시일: 2018-12-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	134	-134	장내
누계	주가지수	선물	0	2,405	-2,405	장내
합계			0	2,405	-2,405	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 193

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 0

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

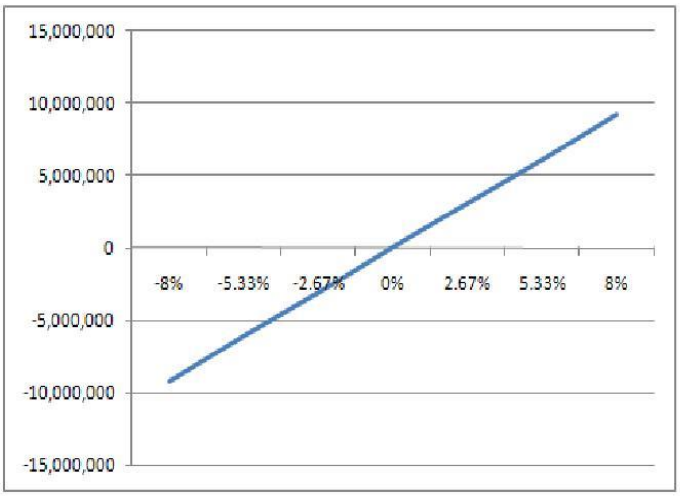
공시일: 2018-12-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	935	-935	장내
누계	주가지수	선물	83,093	0	83,093	장내
합계			83,093	0	83,093	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,653

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	30,469