펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-10

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	3,756	0	3,756	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	61	13,951	-13,890	장내
합계			3,817	13,951	-10,134	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	548

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,613

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

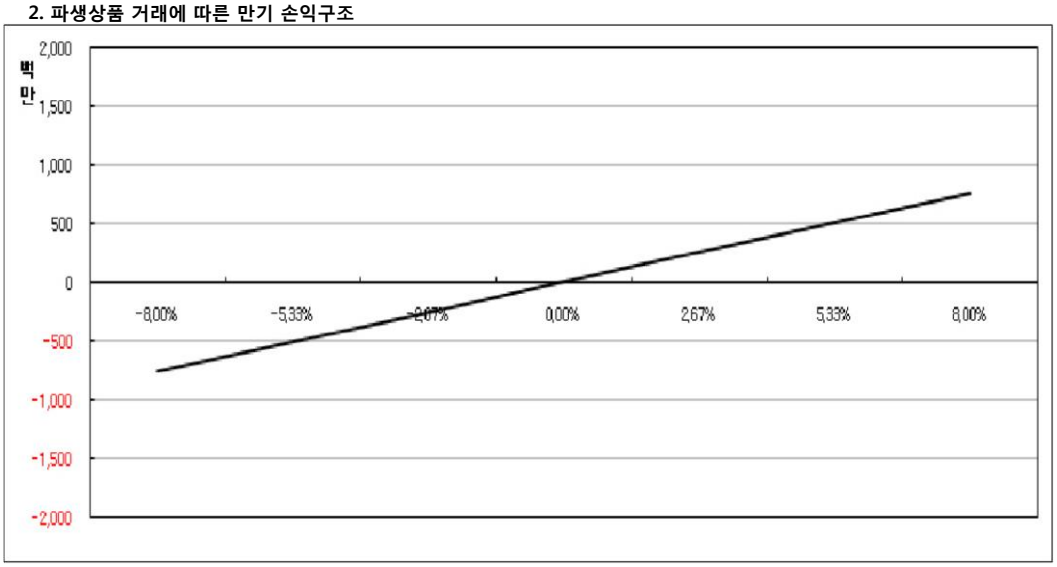
공시일: 2018-12-10

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	268	0	268	장내
합계			268	0	268	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,582

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

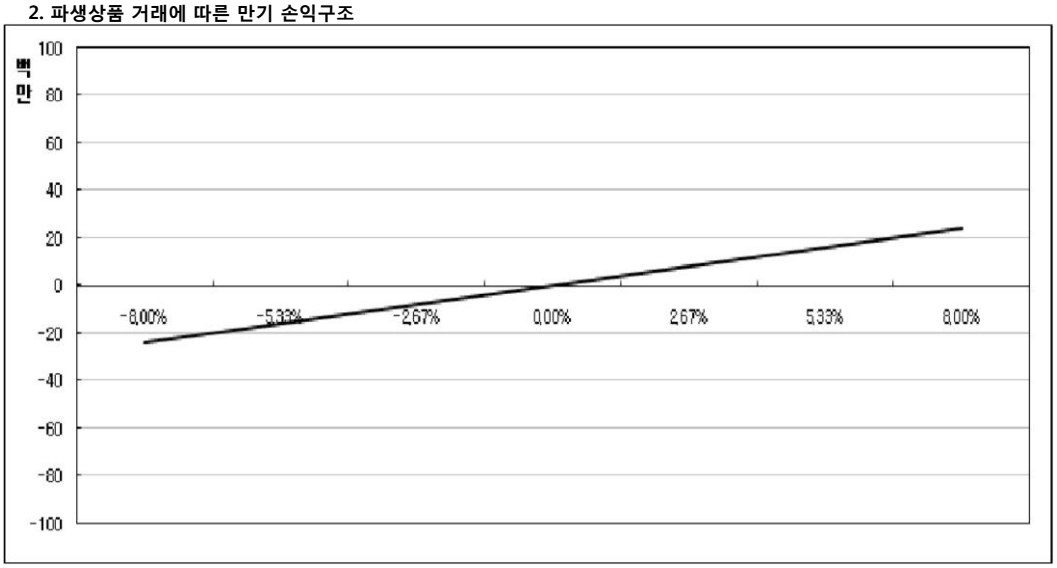
공시일: 2018-12-10

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	805	0	805	장내
합계			805	0	805	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,887

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

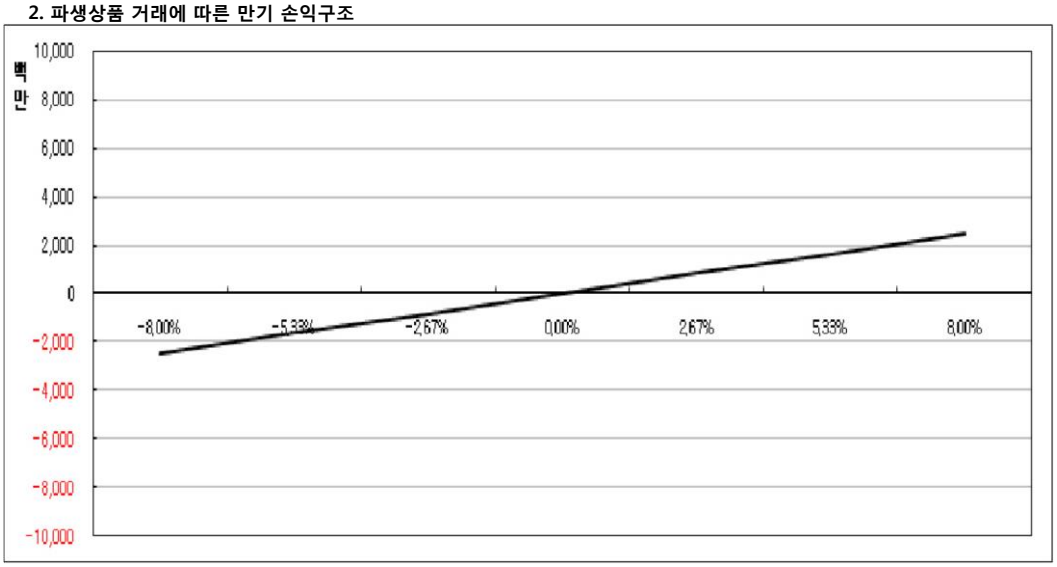
공시일: 2018-12-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	134	0	134	장내
누계	주가지수	선물	5,567	0	5,567	장내
합계			5,567	0	5,567	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 446

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 5,016

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

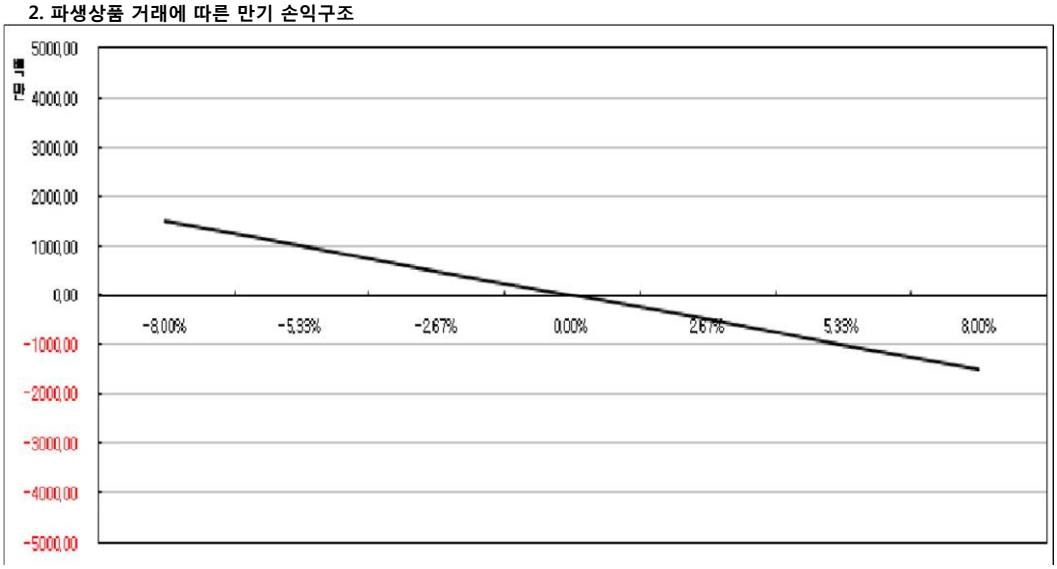
공시일: 2018-12-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	268	0	268	장내
누계	주가지수	선물	0	2,146	-2,146	장내
합계			0	2,146	-2,146	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 172

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 147

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

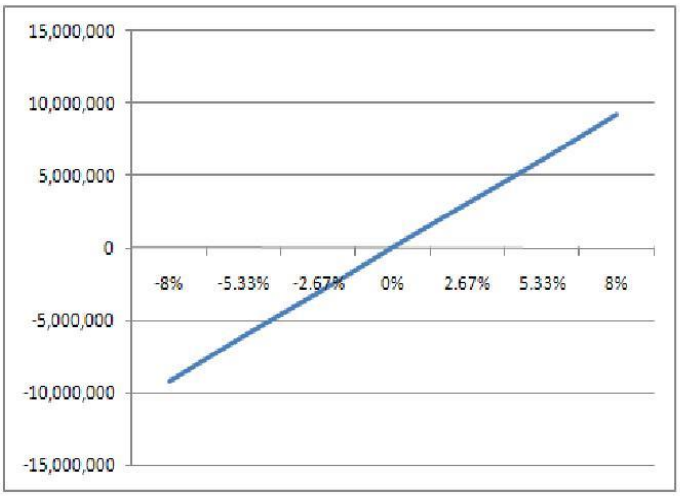
공시일: 2018-12-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	469	0	469	장내
누계	주가지수	선물	83,905	0	83,905	장내
합계			83,905	0	83,905	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,718

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 33,682