펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-12

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	3,706	0	3,706	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	87	13,764	-13,677	장내
합계			3,793	13,764	-9,971	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

391

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,682

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

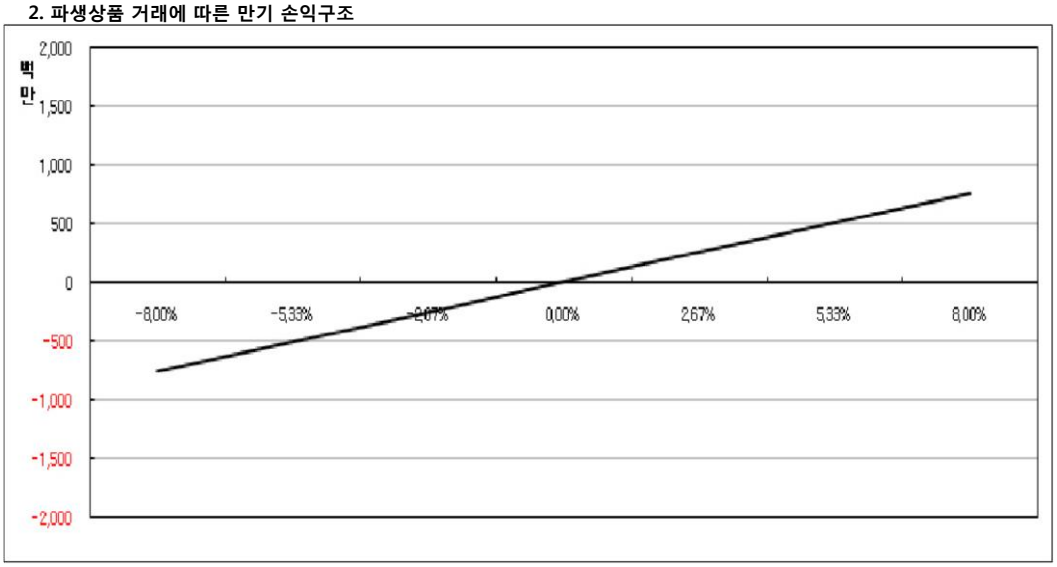
공시일: 2018-12-12

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	265	0	265	장내
합계			265	0	265	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,539

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

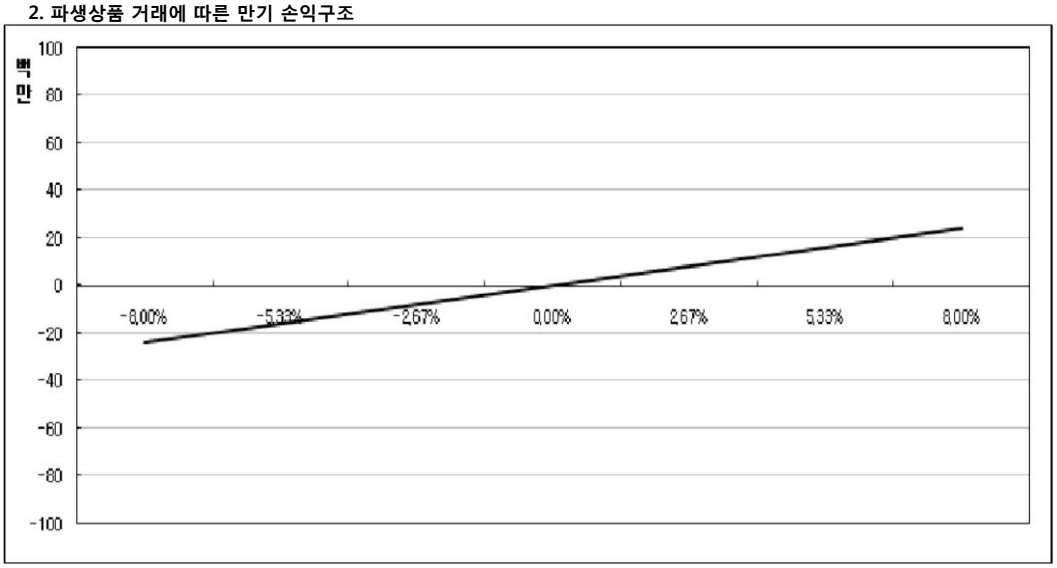
공시일: 2018-12-12

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	794	0	794	장내
합계			794	0	794	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,839

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

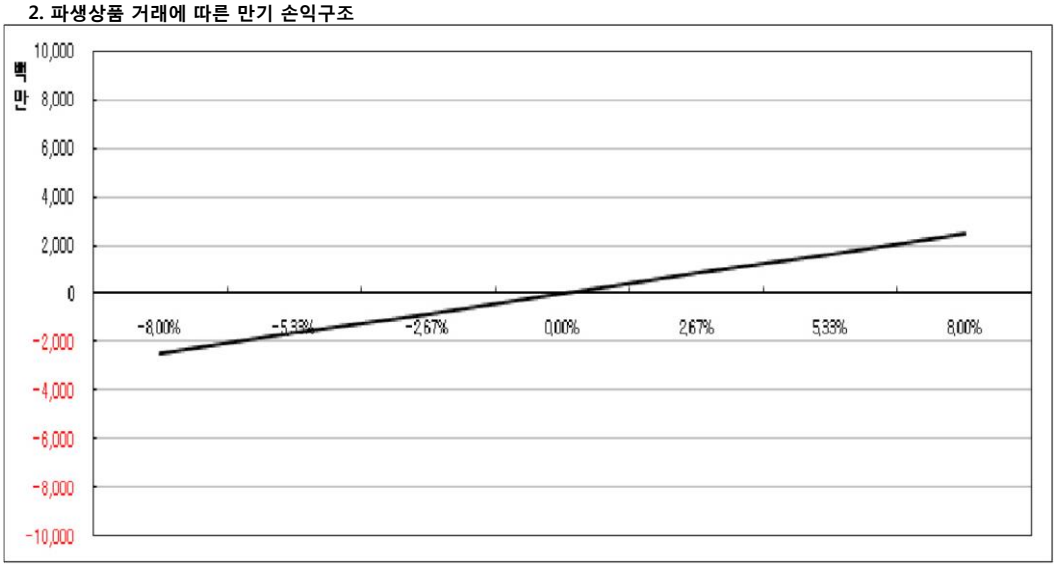
공시일: 2018-12-12

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	5,492	0	5,492	장내
합계			5,492	0	5,492	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 440

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,935

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

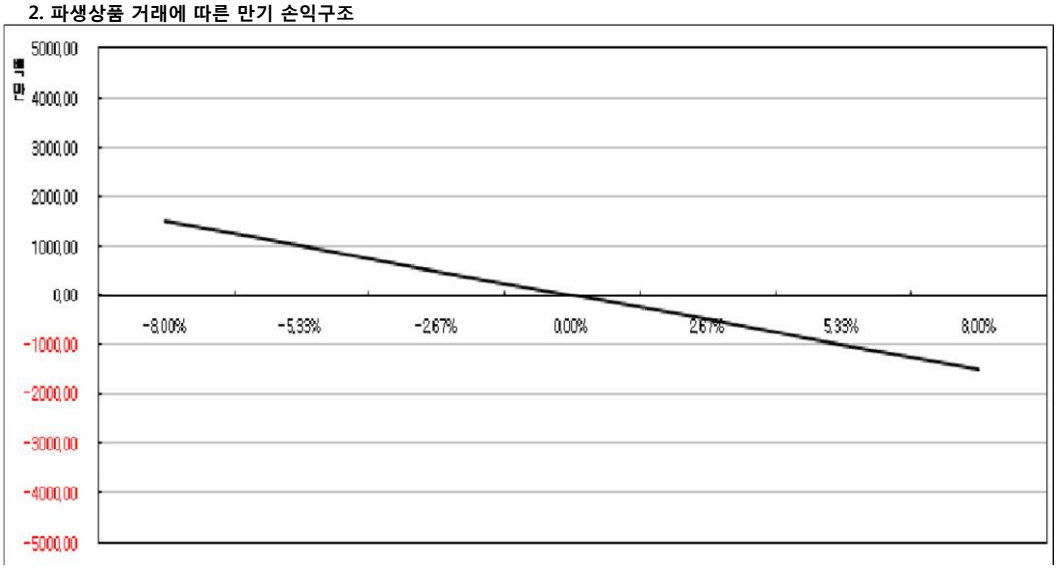
공시일: 2018-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	199	-199	장내
누계	주가지수	선물	0	2,316	-2,316	장내
합계			0	2,316	-2,316	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 186

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 159

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

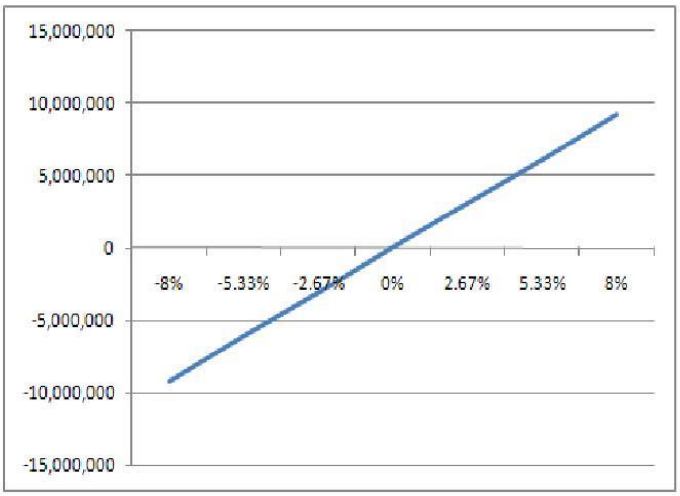
공시일: 2018-12-12

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	82,319	0	82,319	장내
합계			82,319	0	82,319	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6,597

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 33,149