# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-17

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 | 3,718 | 0 | 3,718 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 47 | 13,543 | -13,496 | 장내 |
| 합계 | | | 3,764 | 13,543 | -9,779 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 512 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 1,637 |
|---|---|

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

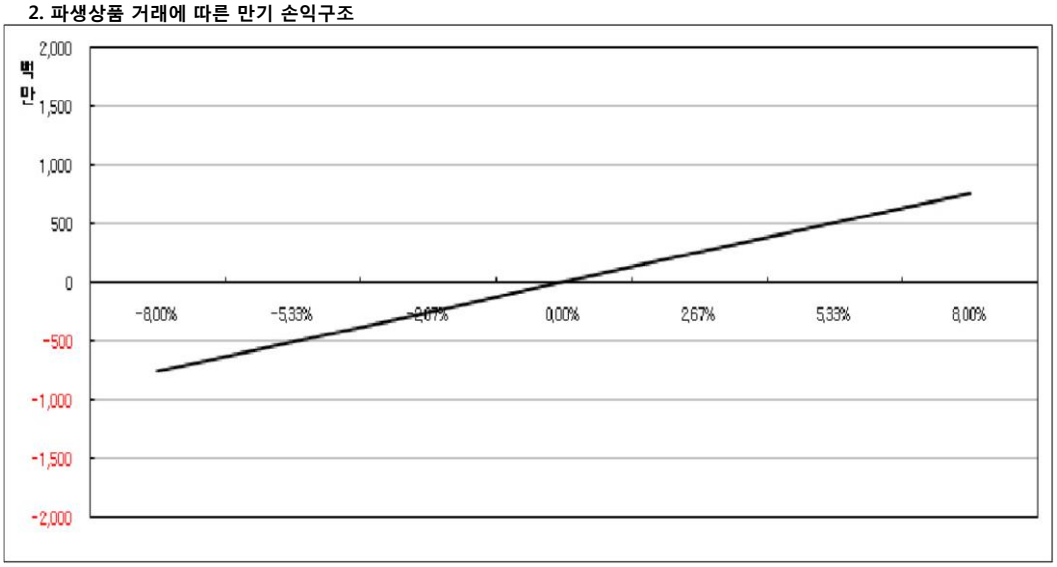
공시일: 2018-12-17

## 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 | 266 | 0 | 266 | 장내 |
| 합계 | | | 266 | 0 | 266 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 21 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 2,467 |
|---|---|

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

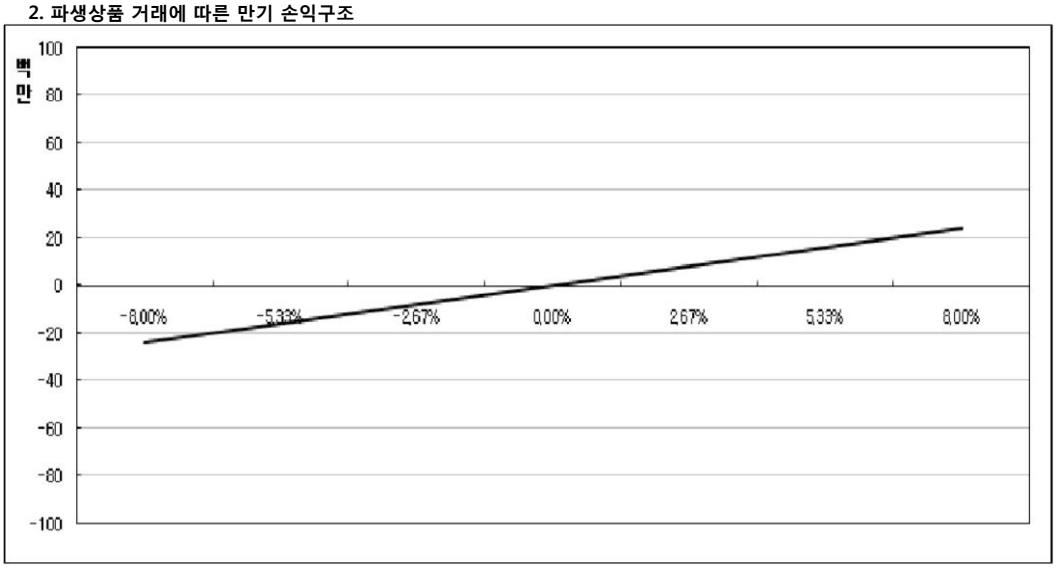
공시일: 2018-12-17

**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 | 797 | 0 | 797 | 장내 |
| 합계 | | | 797 | 0 | 797 | |

**2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조**




(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 63 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 2,759 |
|---|---|

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

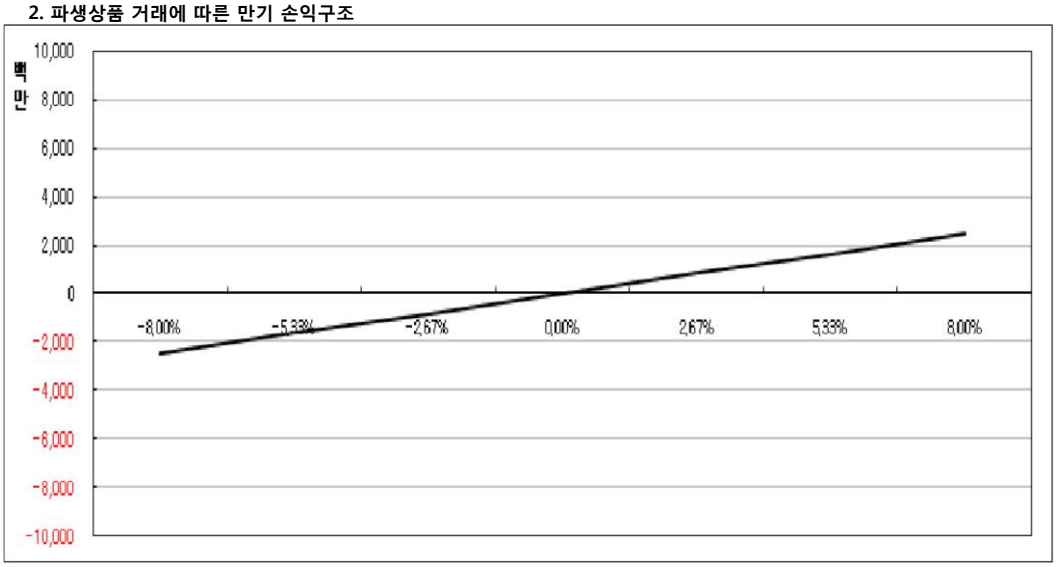
공시일: 2018-12-17

**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 | 5,444 | 0 | 5,444 | 장내 |
| 합계 | | | 5,444 | 0 | 5,444 | |

**2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조**




(단위: 백만원)

**3. 시나리오법에 의한 손익변동** 431

(단위: 백만원)

**4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)** 4,797

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

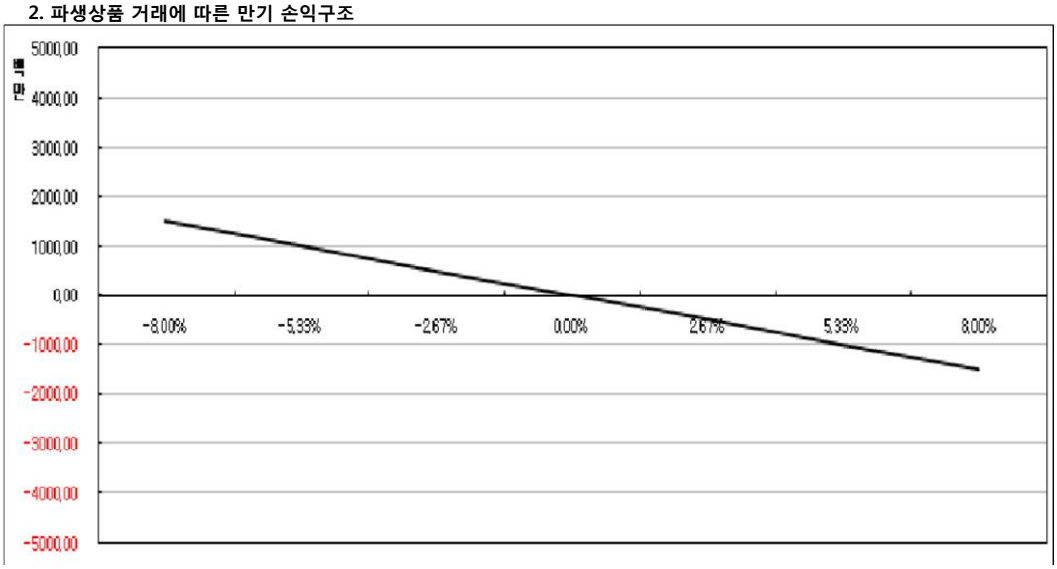
공시일: 2018-12-17

**1. 계약금액**

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 266 | -266 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 2,324 | -2,324 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 2,324 | -2,324 | |

**2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조**




(단위: 백만원)

**3. 시나리오법에 의한 손익변동** 184

(단위: 백만원)

**4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)** 158

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

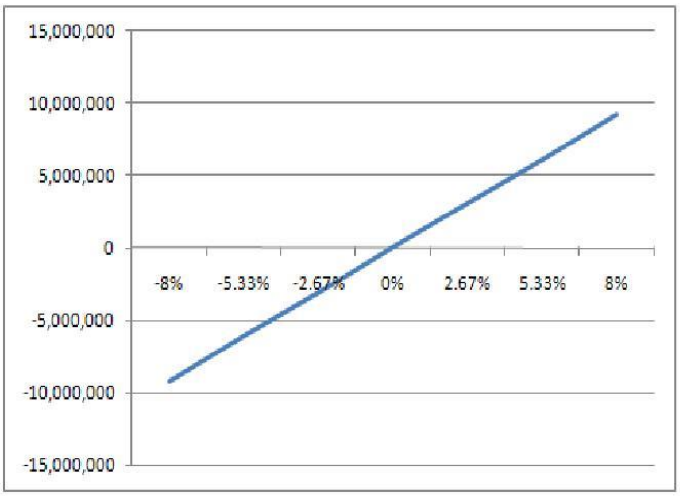
공시일: 2018-12-17

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 664 | -664 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 68,711 | 0 | 68,711 | 장내 |
| 합계 | | | 68,711 | 0 | 68,711 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,438

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

39,011