펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-18

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	3,729	0	3,729	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	39	13,583	-13,544	장내
합계			3,768	13,583	-9,815	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	531

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,697

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

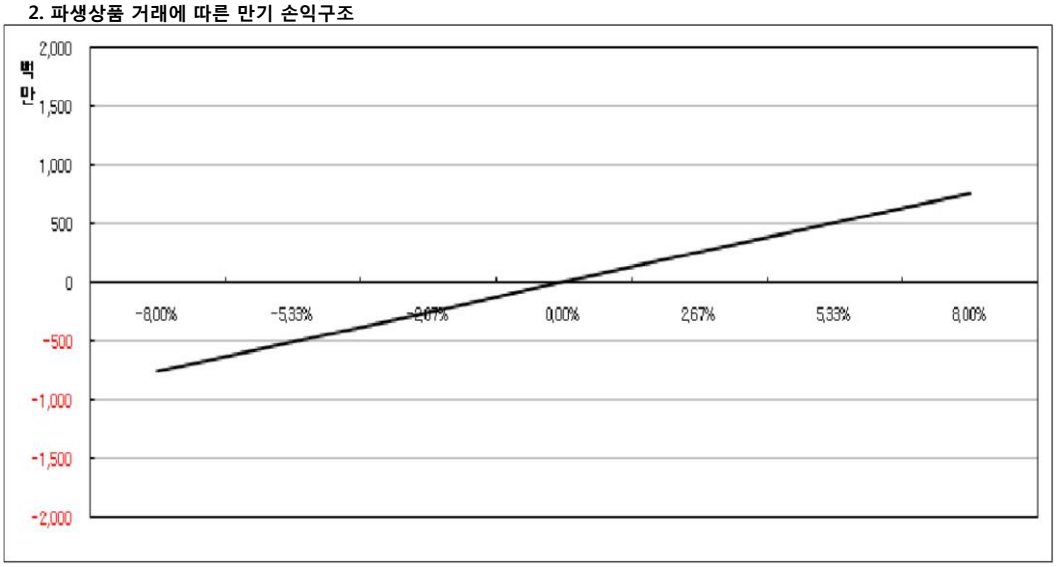
공시일: 2018-12-18

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)	2,479

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

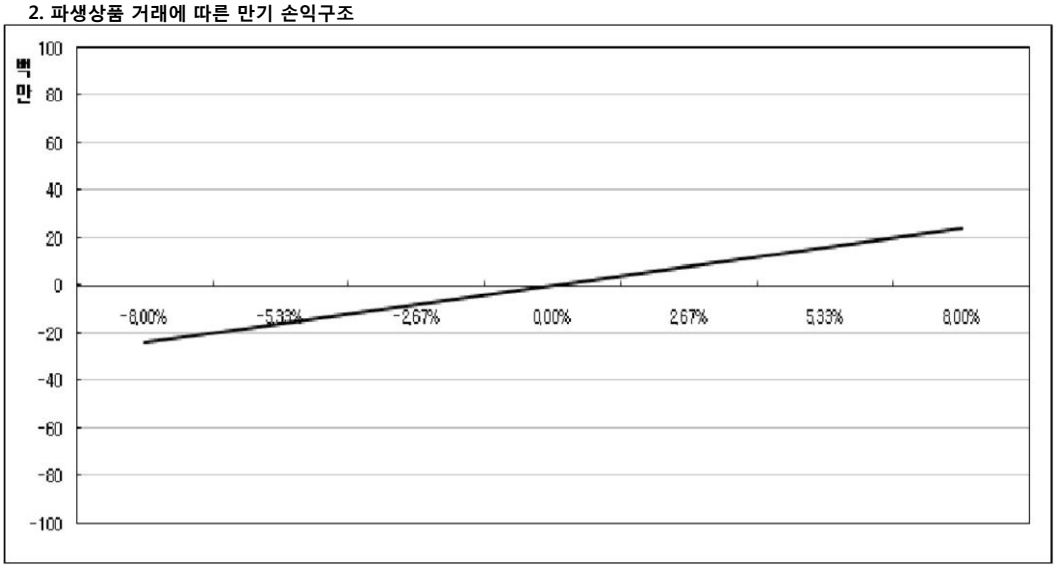
공시일: 2018-12-18

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	799	0	799	장내
합계			799	0	799	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	63

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,772

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

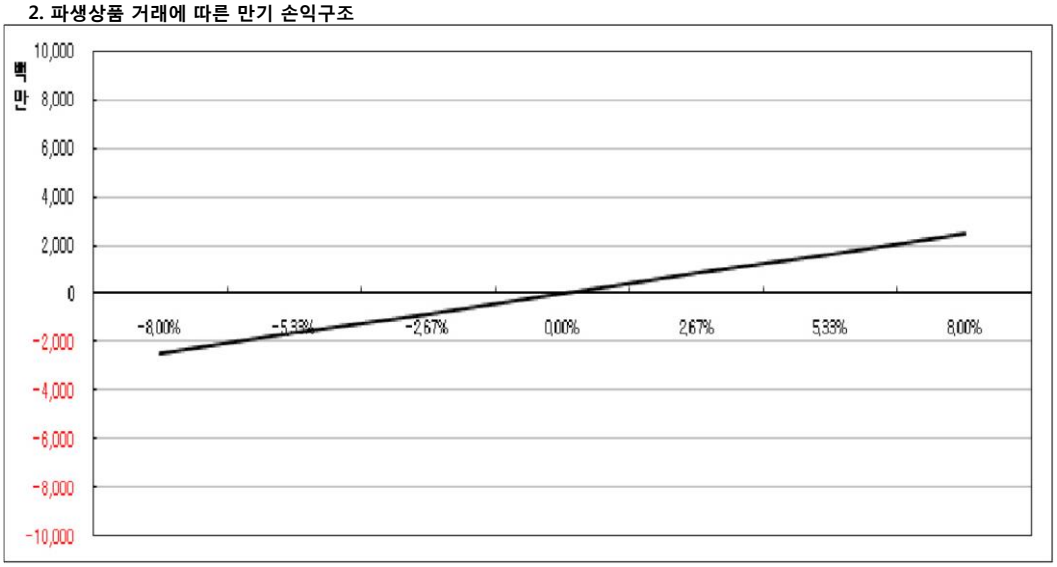
공시일: 2018-12-18

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	5,460	0	5,460	장내
합계			5,460	0	5,460	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 432

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,819

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

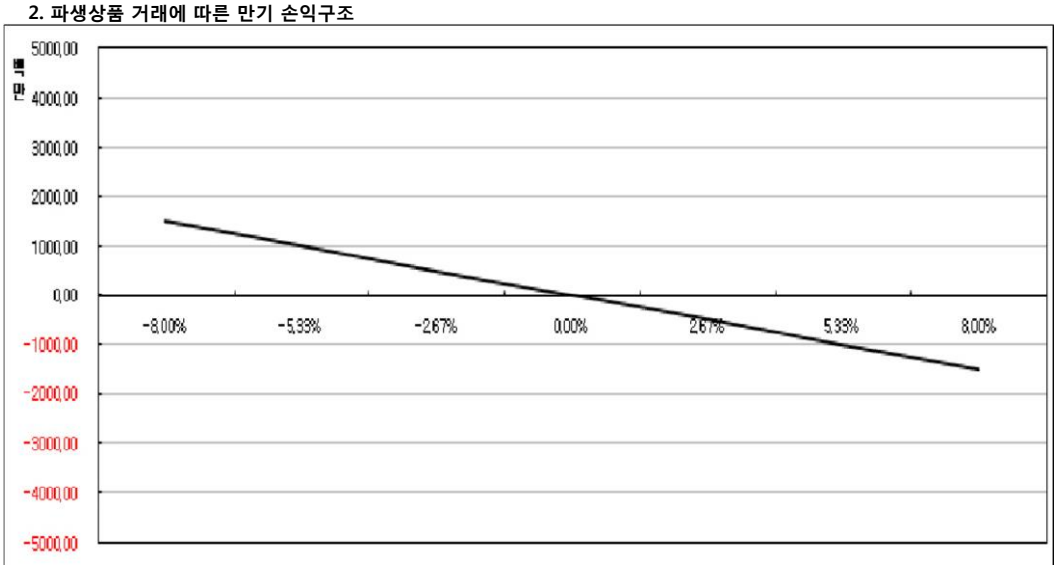
공시일: 2018-12-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	266	133	133	장내
누계	주가지수	선물	0	2,197	-2,197	장내
합계			0	2,197	-2,197	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 174

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 150

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

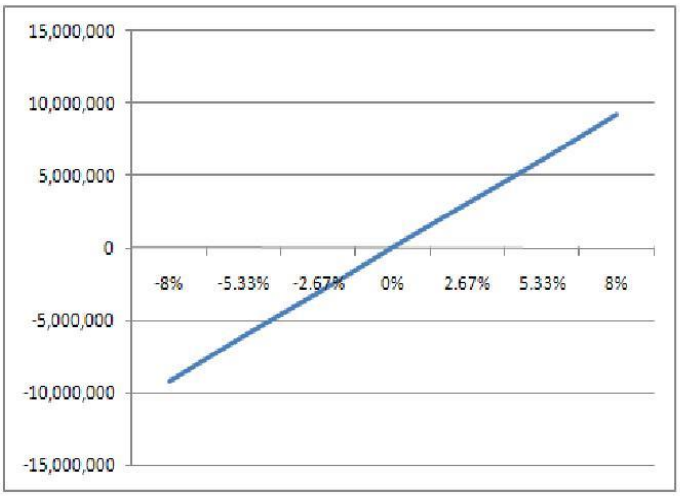
공시일: 2018-12-18

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	68,913	0	68,913	장내
합계			68,913	0	68,913	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,458

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 39,188