펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-19

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	3,713	0	3,713	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	44	13,524	-13,480	장내
합계			3,757	13,524	-9,767	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

498

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,590

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

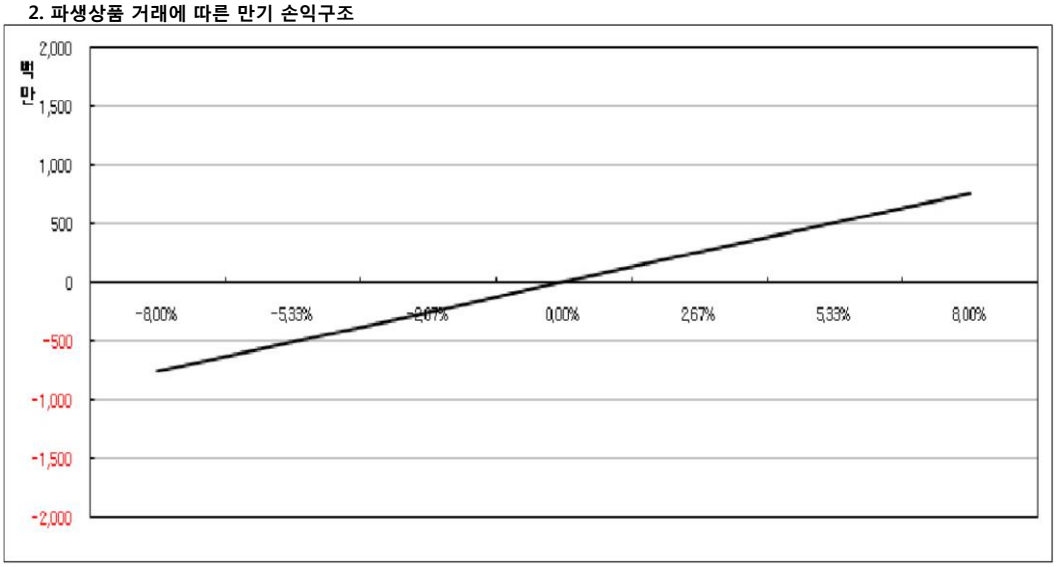
공시일: 2018-12-19

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)	2,464

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

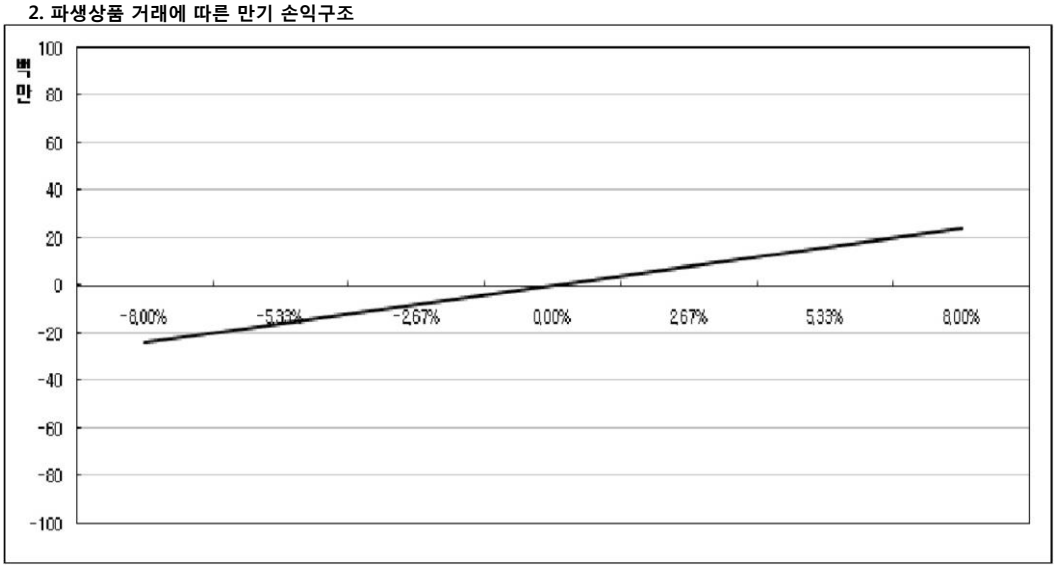
공시일: 2018-12-19

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	796	0	796	장내
합계			796	0	796	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	63

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,755

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

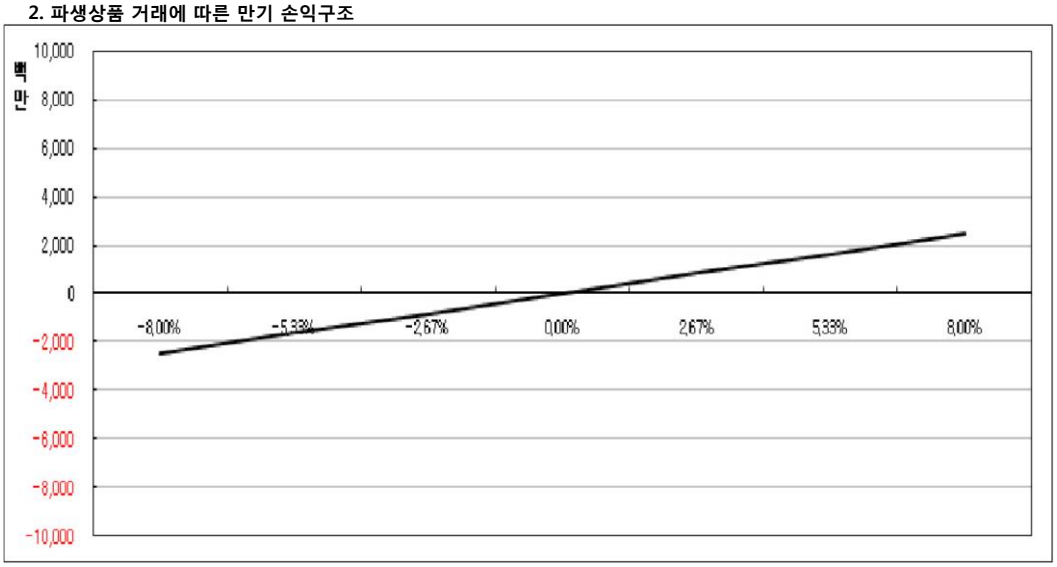
공시일: 2018-12-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	331	265	66	장내
누계	주가지수	선물	5,502	0	5,502	장내
합계			5,502	0	5,502	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 436

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,792

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

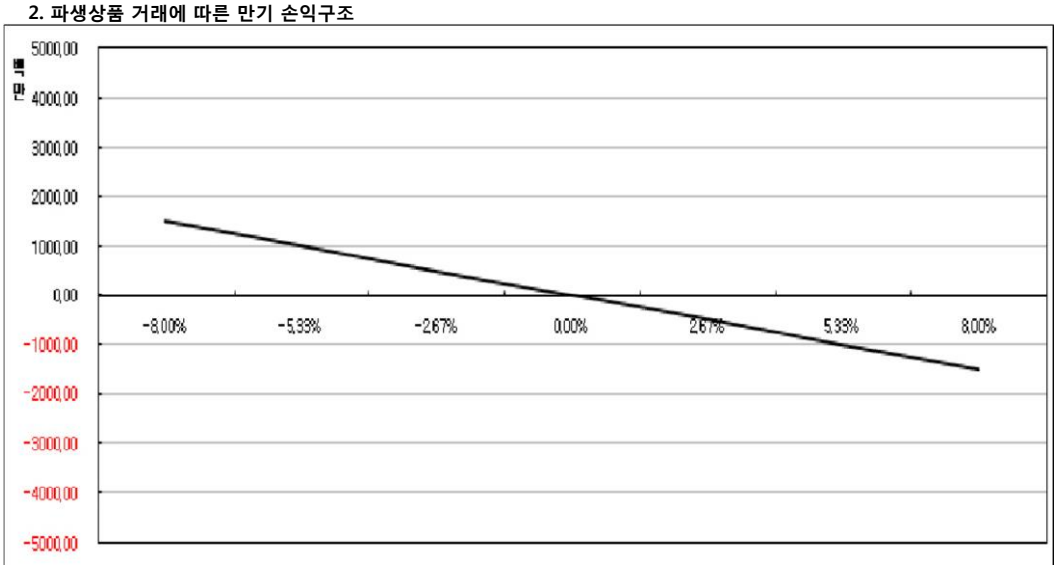
공시일: 2018-12-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	66	0	66	장내
누계	주가지수	선물	0	2,121	-2,121	장내
합계			0	2,121	-2,121	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 168

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 145

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

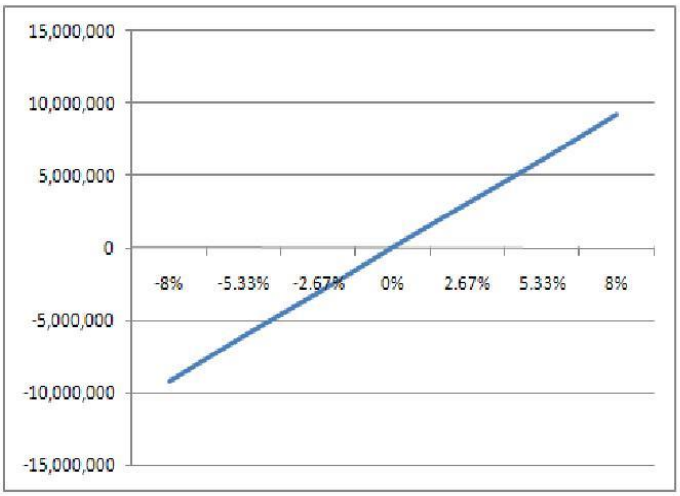
공시일: 2018-12-19

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	68,615	0	68,615	장내
합계			68,615	0	68,615	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 5,435

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 38,951