펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-20

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	3,742	0	3,742	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	35	13,633	-13,597	장내
합계			3,778	13,633	-9,855	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

557

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,792

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

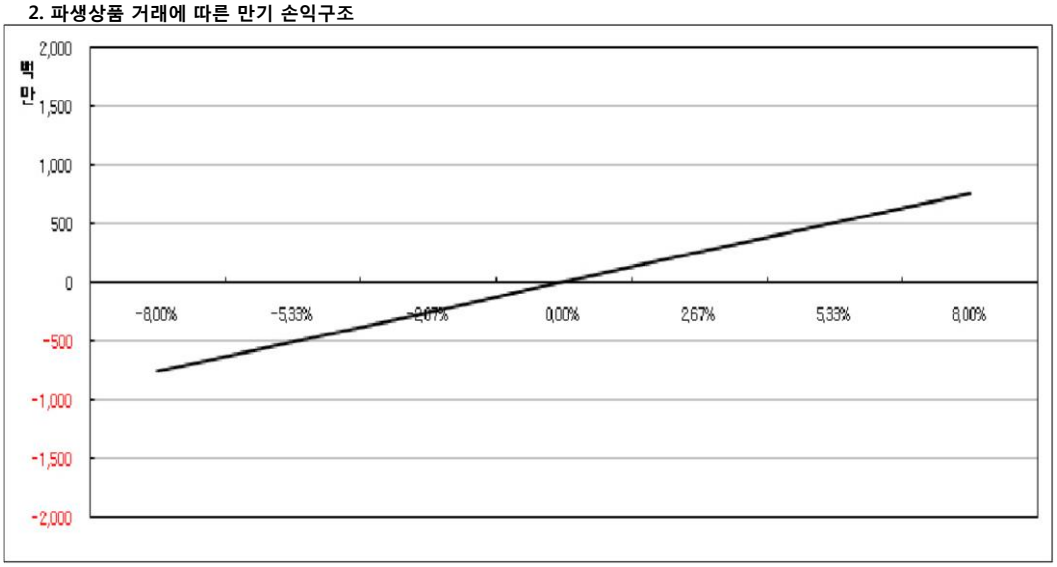
공시일: 2018-12-20

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	267	0	267	장내
합계			267	0	267	

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]

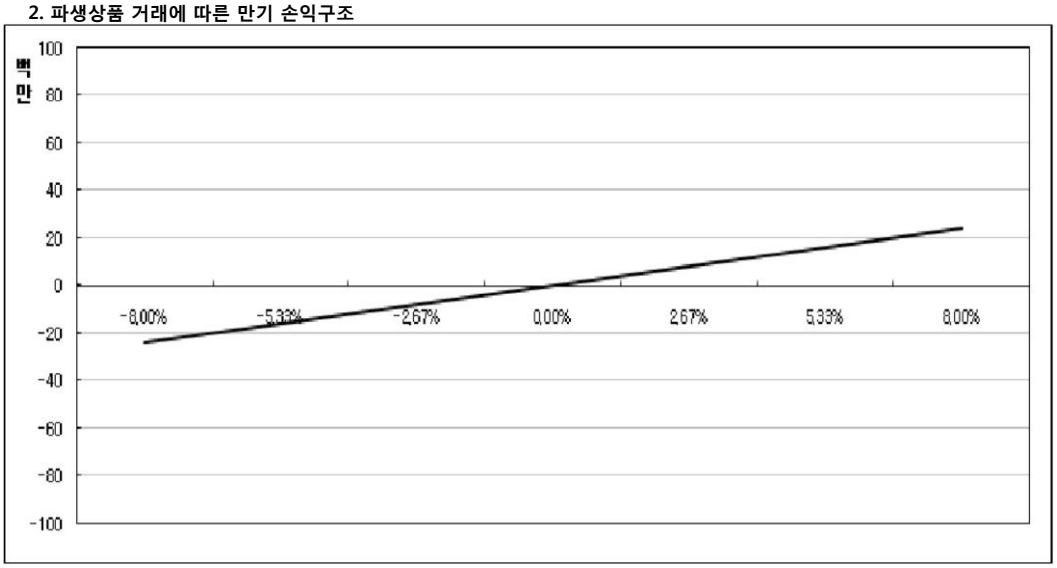
공시일: 2018-12-20

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	802	0	802	장내
합계			802	0	802	

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]

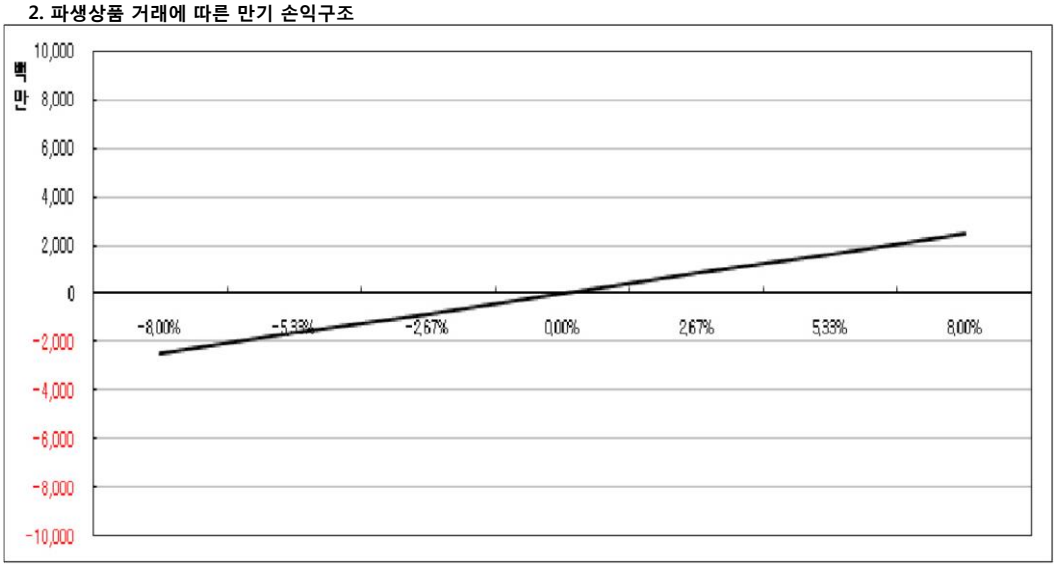
공시일: 2018-12-20

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	5,547	0	5,547	장내
합계			5,547	0	5,547	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 439

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,822

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

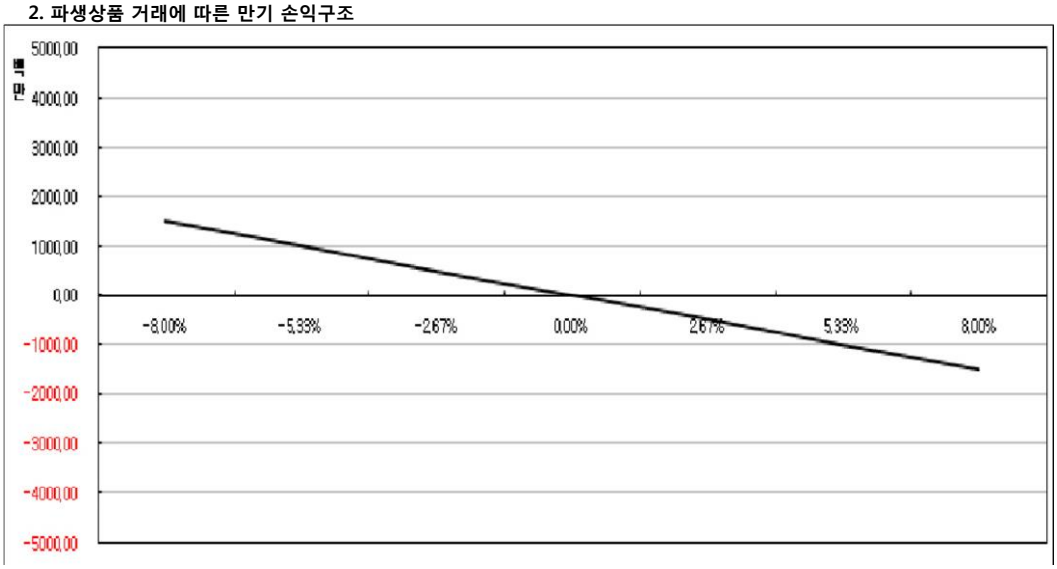
공시일: 2018-12-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	267	267	0	장내
누계	주가지수	선물	0	2,138	-2,138	장내
합계			0	2,138	-2,138	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	146

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

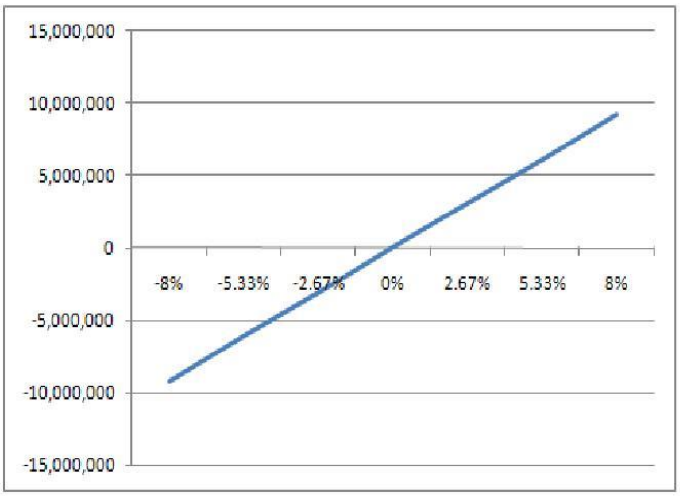
공시일: 2018-12-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	535	0	535	장내
누계	주가지수	선물	69,701	0	69,701	장내
합계			69,701	0	69,701	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,516

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	39,217