펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-21

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	3,707	0	3,707	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	49	13,505	-13,456	장내
합계			3,756	13,505	-9,749	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

493

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,530

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

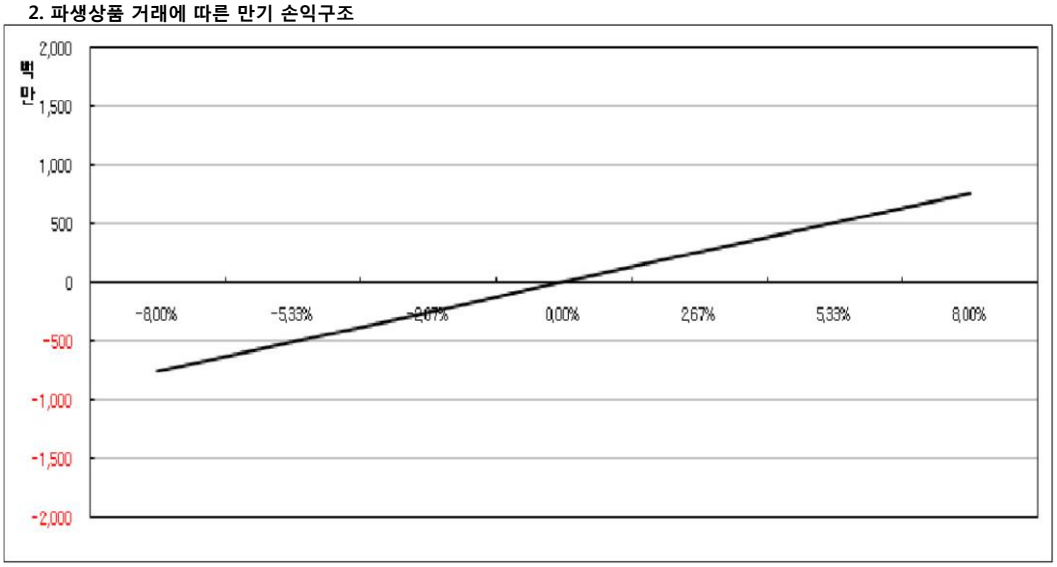
공시일: 2018-12-21

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)	2,450

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

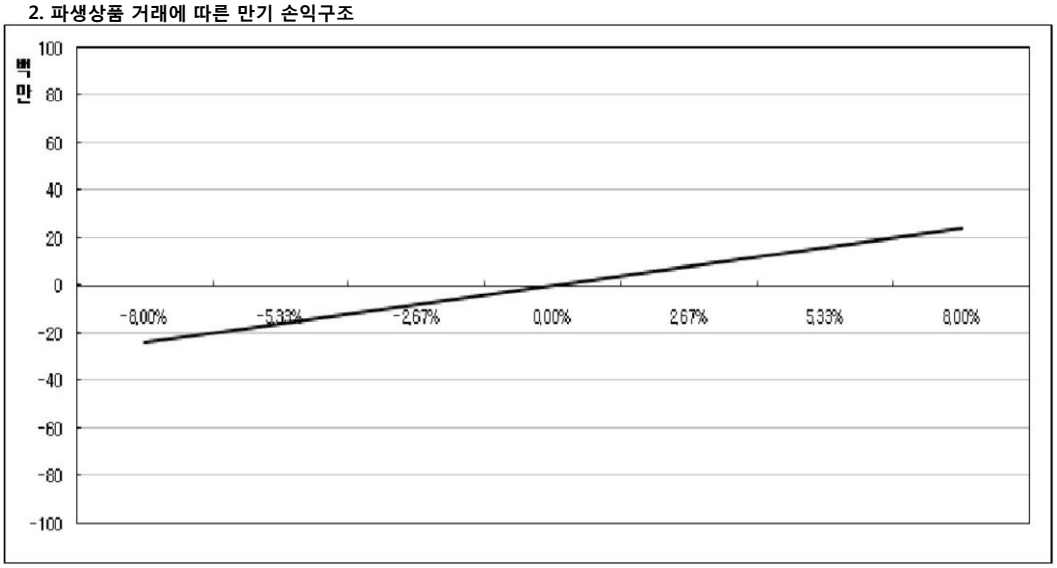
공시일: 2018-12-21

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	63

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,740

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

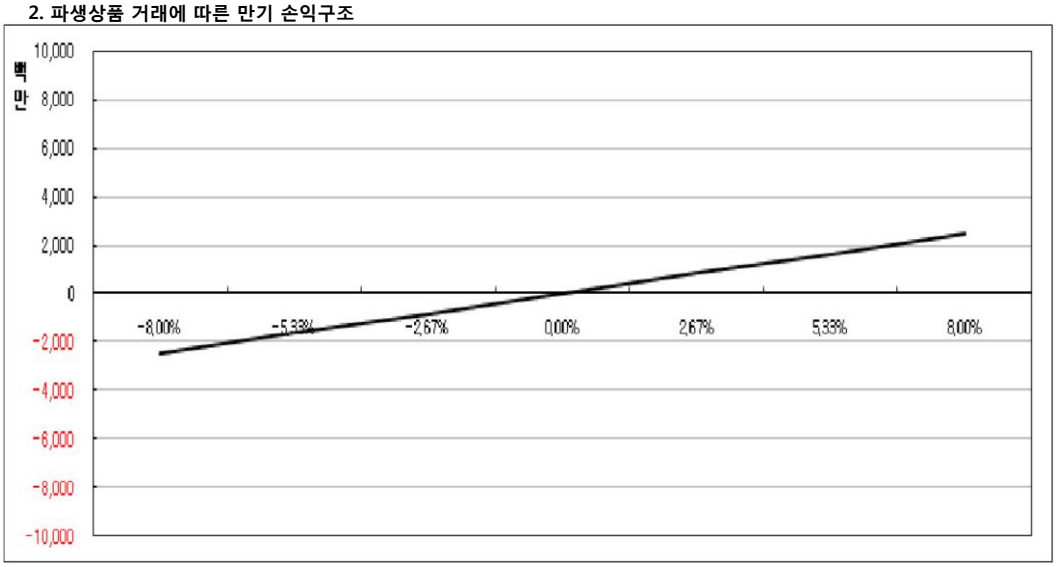
공시일: 2018-12-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	265	265	0	장내
누계	주가지수	선물	5,495	0	5,495	장내
합계			5,495	0	5,495	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	434

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	4,764

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

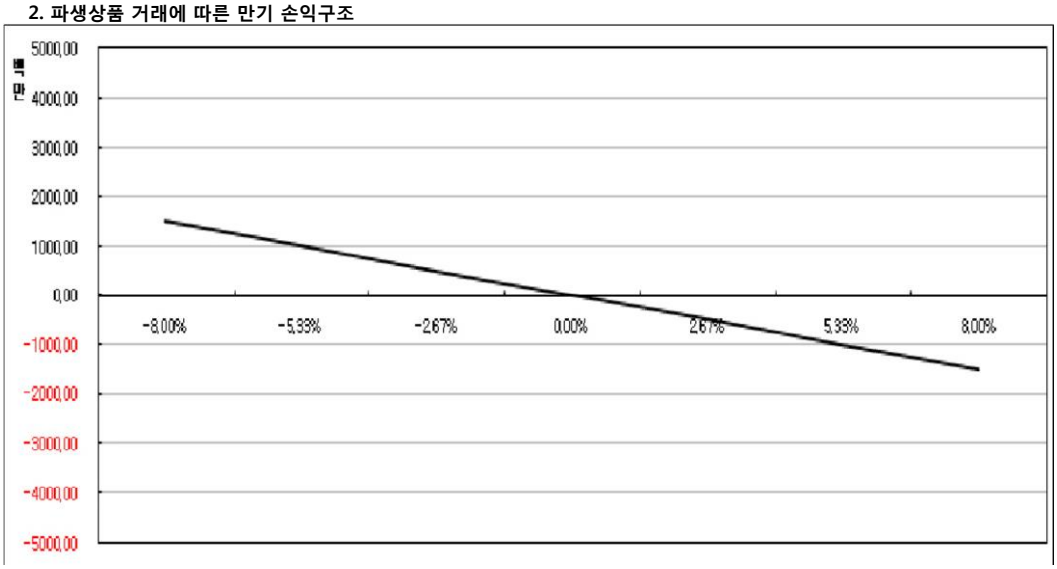
공시일: 2018-12-21

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	0	2,118	-2,118	장내
합계			0	2,118	-2,118	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	167

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	144

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

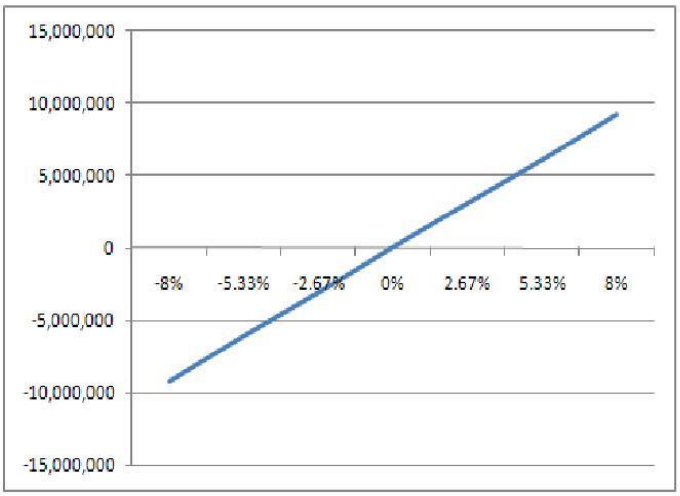
공시일: 2018-12-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,192	-1,192	장내
누계	주가지수	선물	67,858	0	67,858	장내
합계			67,858	0	67,858	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,360

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38,691