펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-24

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	3,711	0	3,711	장내
신규	주가지수	옵션	0	530	-530	장내
누계	주가지수	옵션	40	13,518	-13,478	장내
합계			3,751	13,518	-9,767	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 496

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 1,553

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

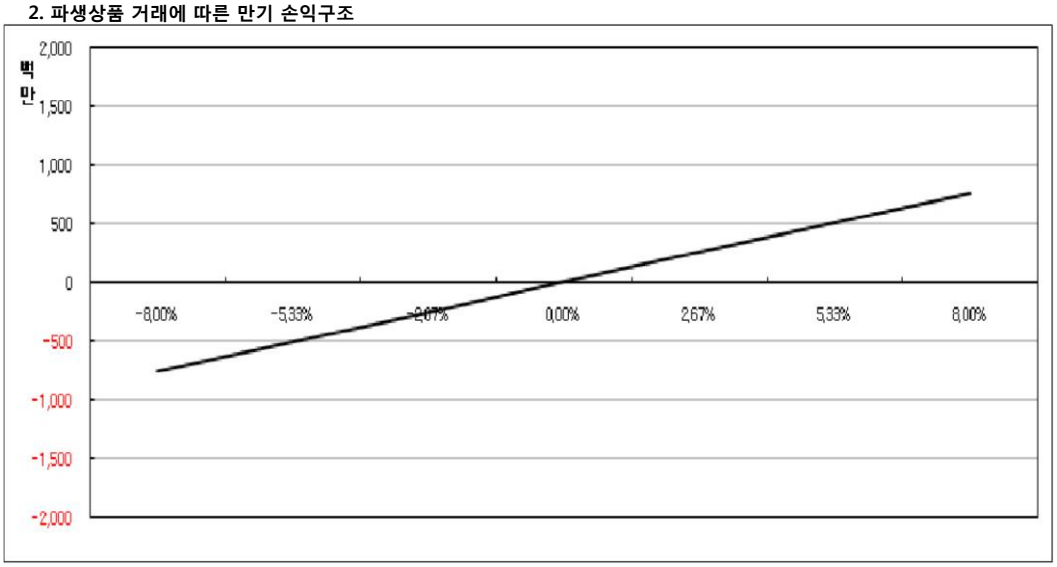
공시일: 2018-12-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	66	-66	장내
누계	주가지수	선물	199	0	199	장내
합계			199	0	199	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,448

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

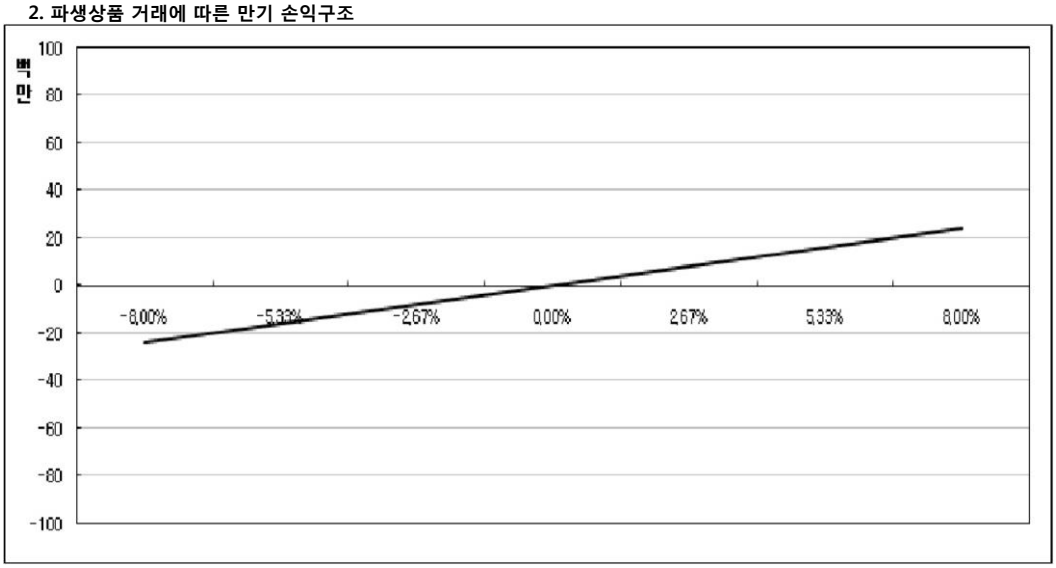
공시일: 2018-12-24

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	795	0	795	장내
합계			795	0	795	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	63

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,739

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

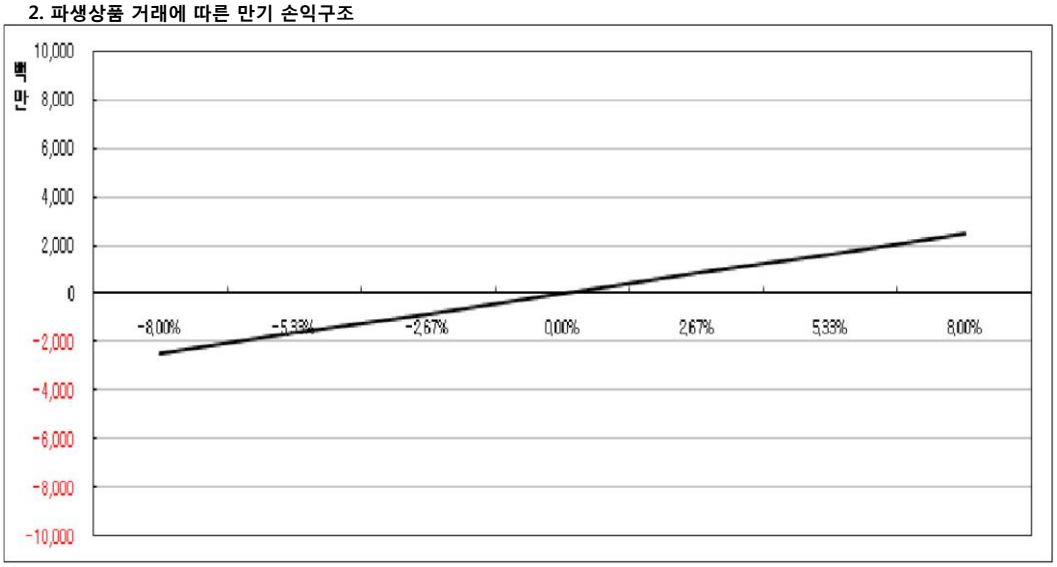
공시일: 2018-12-24

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	5,500	0	5,500	장내
합계			5,500	0	5,500	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 434

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,762

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

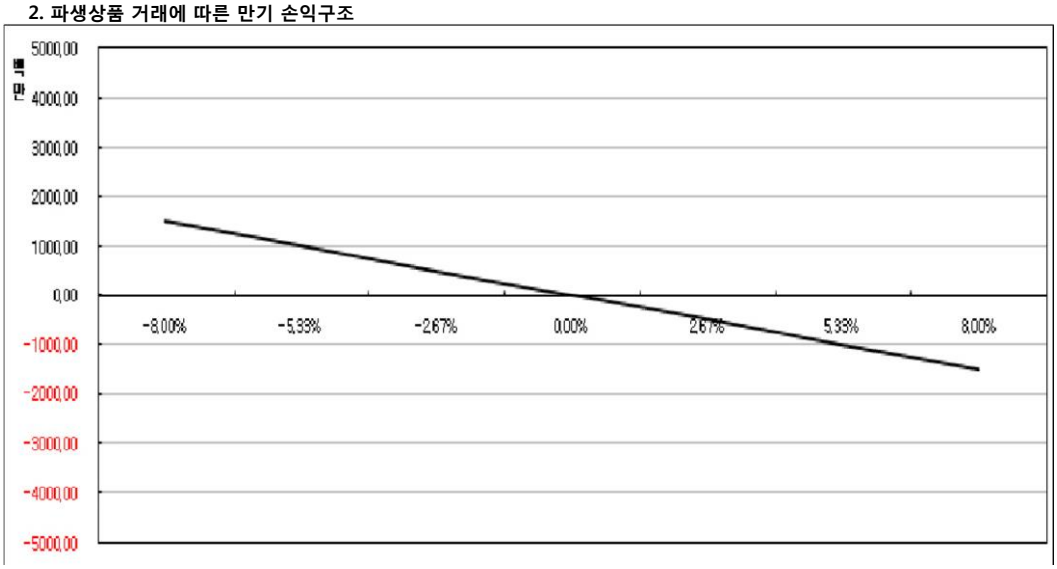
공시일: 2018-12-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	199	265	-66	장내
누계	주가지수	선물	0	2,187	-2,187	장내
합계			0	2,187	-2,187	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 173

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 148

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

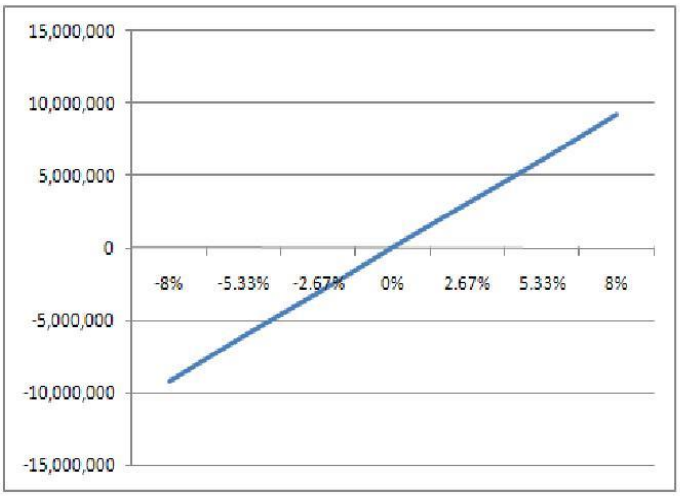
공시일: 2018-12-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	199	0	199	장내
누계	주가지수	선물	68,120	0	68,120	장내
합계			68,120	0	68,120	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,380

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	38,690