펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-26

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	3,702	0	3,702	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	40	13,487	-13,447	장내
합계			3,742	13,487	-9,745	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 474

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 1,549

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

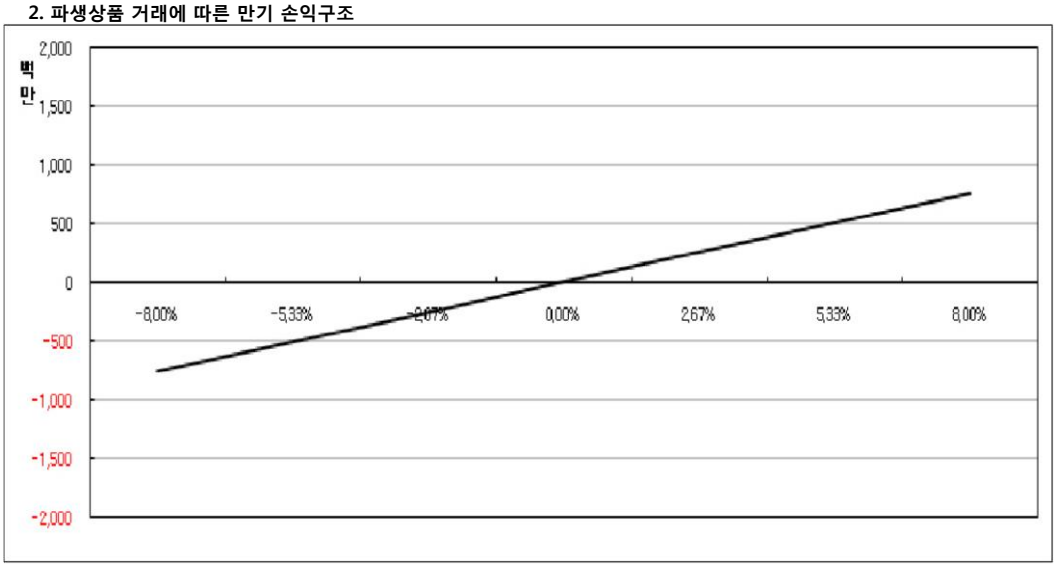
공시일: 2018-12-26

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	198	0	198	장내
합계			198	0	198	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,456

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

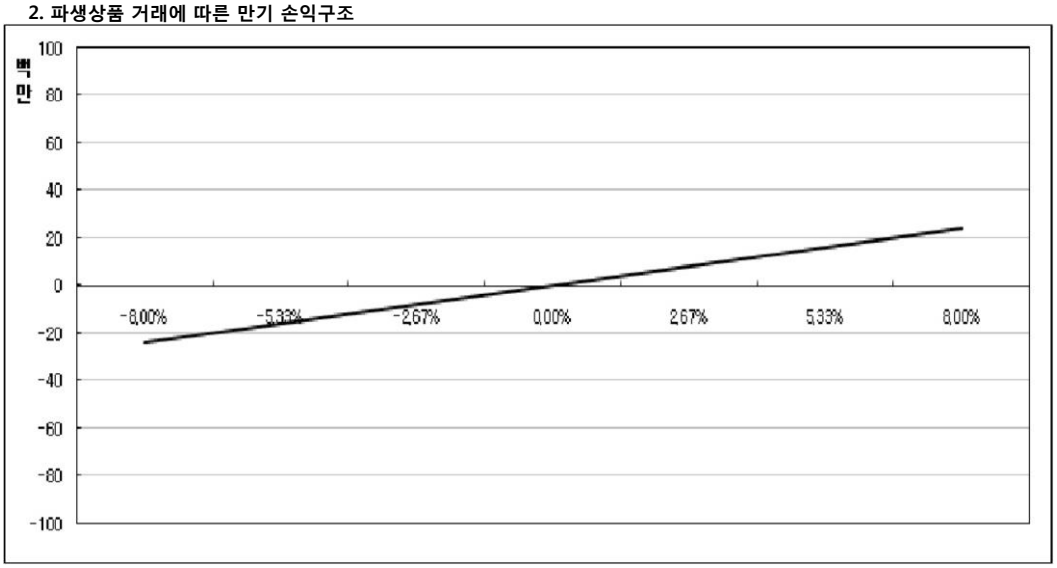
공시일: 2018-12-26

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	793	0	793	장내
합계			793	0	793	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	63

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,749

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

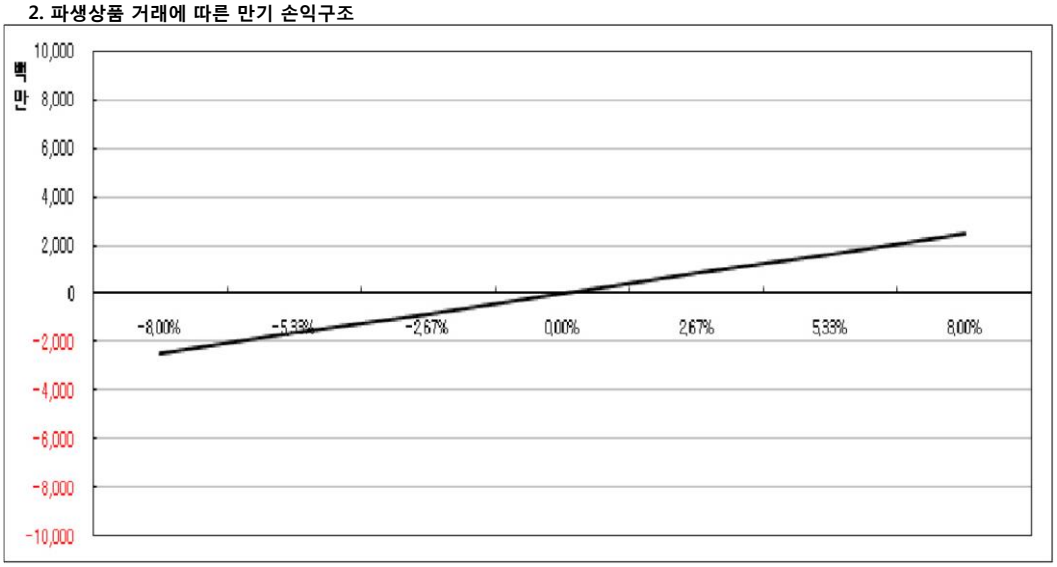
공시일: 2018-12-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	331	331	0	장내
누계	주가지수	선물	5,487	0	5,487	장내
합계			5,487	0	5,487	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 434

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,777

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

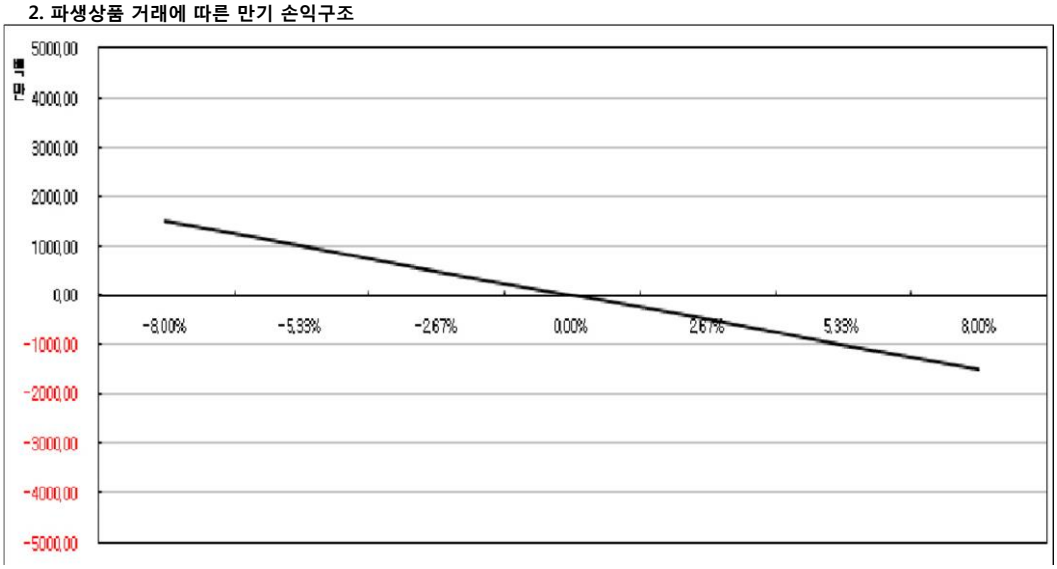
공시일: 2018-12-26

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	2,182	-2,182	장내
합계			0	2,182	-2,182	

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]

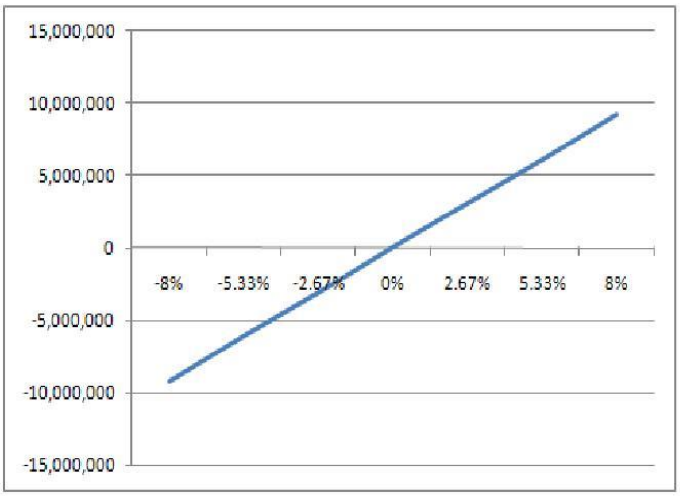
공시일: 2018-12-26

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	67,964	0	67,964	장내
합계			67,964	0	67,964	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,377

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	38,808