펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-27

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	3,654	0	3,654	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	64	13,310	-13,246	장내
합계			3,717	13,310	-9,593	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	373

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,604

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

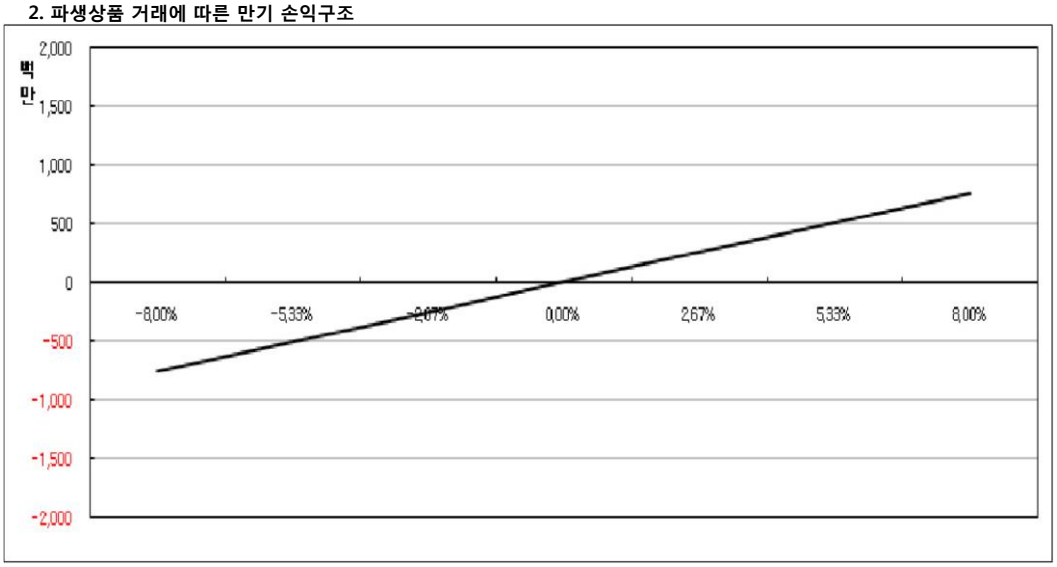
공시일: 2018-12-27

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	196	0	196	장내
합계			196	0	196	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,431

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

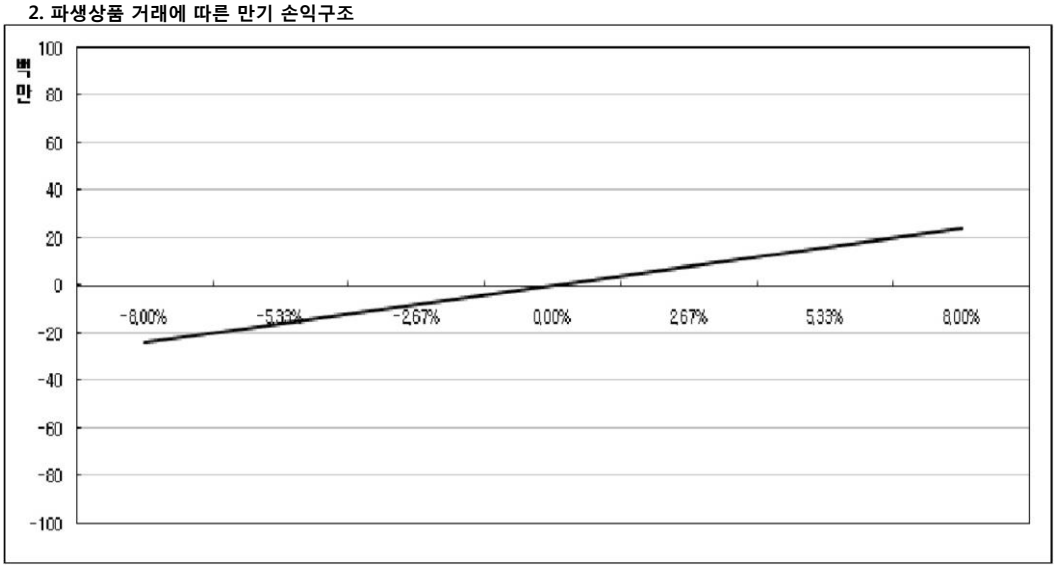
공시일: 2018-12-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	65	0	65	장내
누계	주가지수	선물	848	0	848	장내
합계			848	0	848	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	67

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,724

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

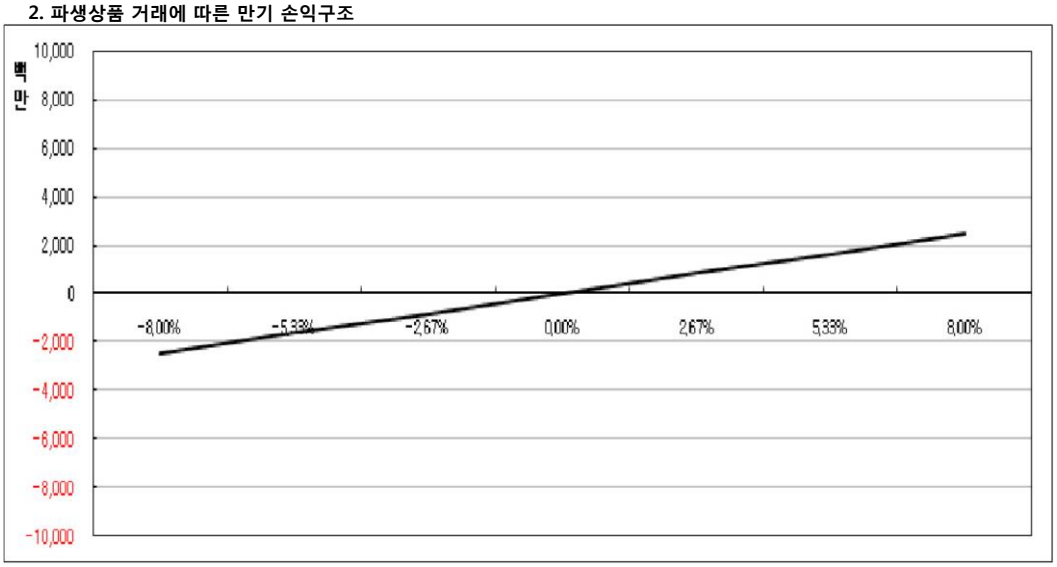
공시일: 2018-12-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	65	0	65	장내
누계	주가지수	선물	5,481	0	5,481	장내
합계			5,481	0	5,481	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 432

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,730

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

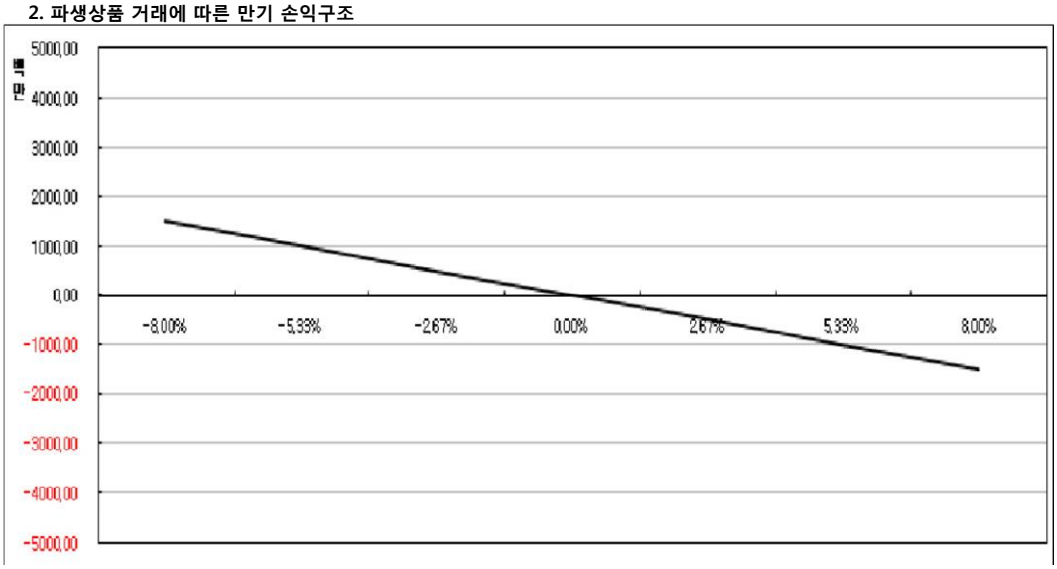
공시일: 2018-12-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	261	-261	장내
누계	주가지수	선물	0	2,414	-2,414	장내
합계			0	2,414	-2,414	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 190

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 164

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

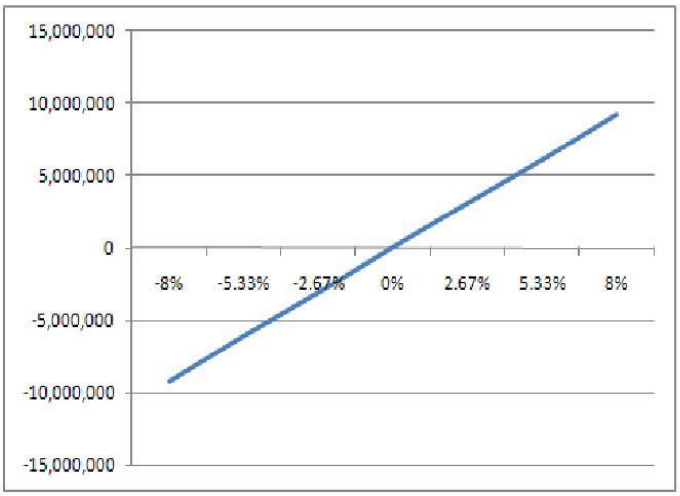
공시일: 2018-12-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	652	-652	장내
누계	주가지수	선물	66,419	0	66,419	장내
합계			66,419	0	66,419	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,239

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38,377