펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-28

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	3,648	0	3,648	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	35	13,289	-13,254	장내
합계			3,683	13,289	-9,606	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	341

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,541

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

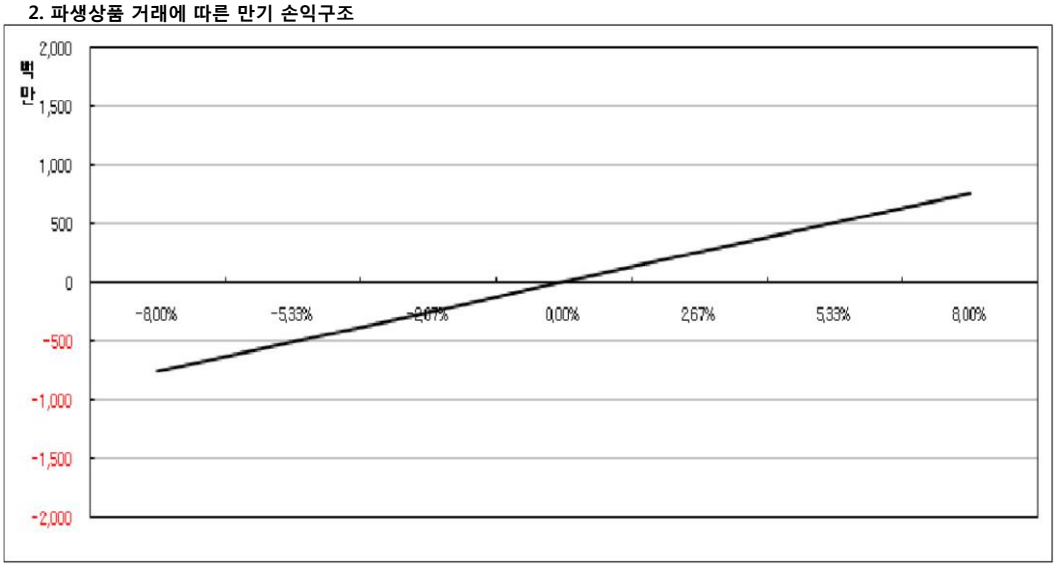
공시일: 2018-12-28

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	195	0	195	장내
합계			195	0	195	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,426

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

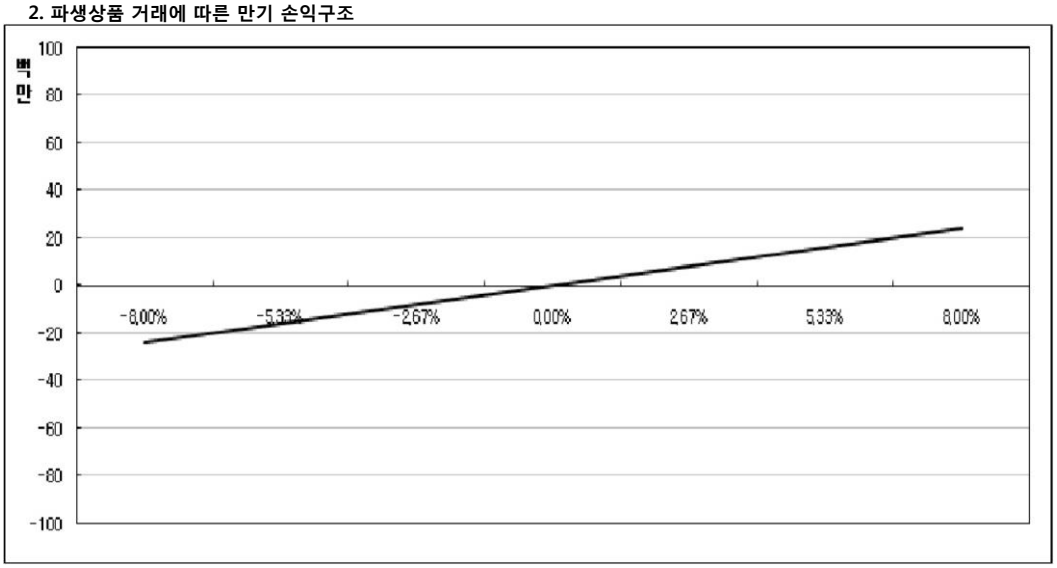
공시일: 2018-12-28

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	847	0	847	장내
합계			847	0	847	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	68

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,718

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

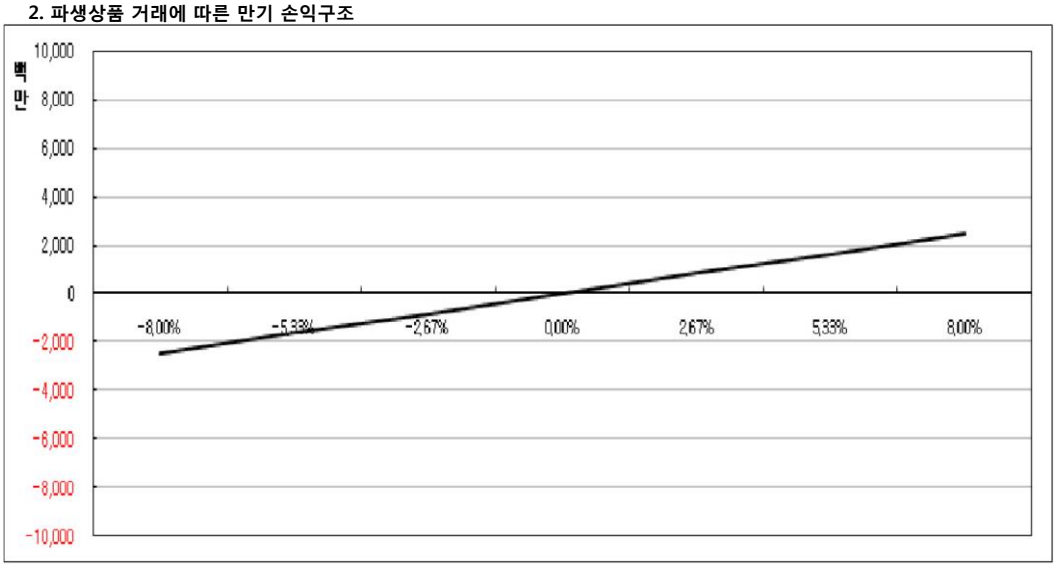
공시일: 2018-12-28

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	5,472	0	5,472	장내
합계			5,472	0	5,472	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 439

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,723

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

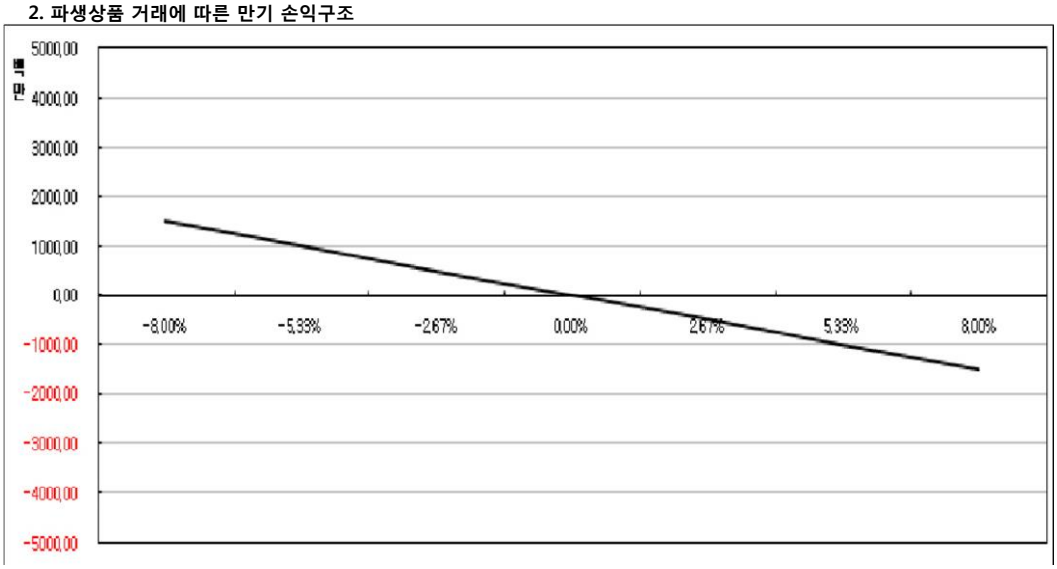
공시일: 2018-12-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	261	0	261	장내
누계	주가지수	선물	0	2,150	-2,150	장내
합계			0	2,150	-2,150	

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]

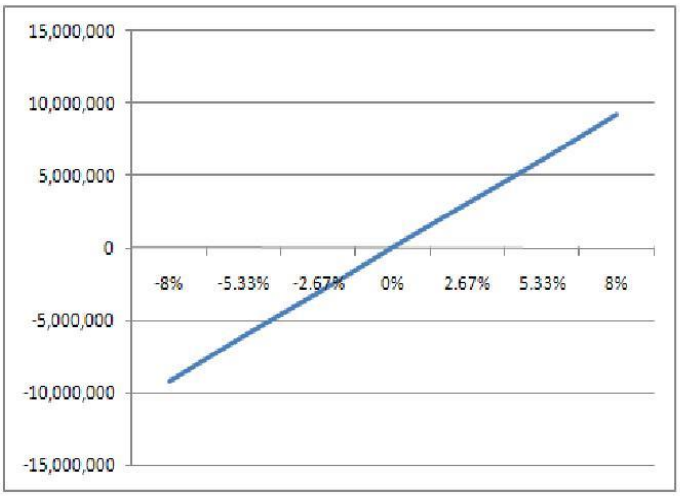
공시일: 2018-12-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	326	0	326	장내
누계	주가지수	선물	66,641	0	66,641	장내
합계			66,641	0	66,641	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	5,349

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	38,350