펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-13

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	3,759	0	3,759	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	13	13,960	-13,947	장내
합계			3,772	13,960	-10,189	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	528

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,715

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

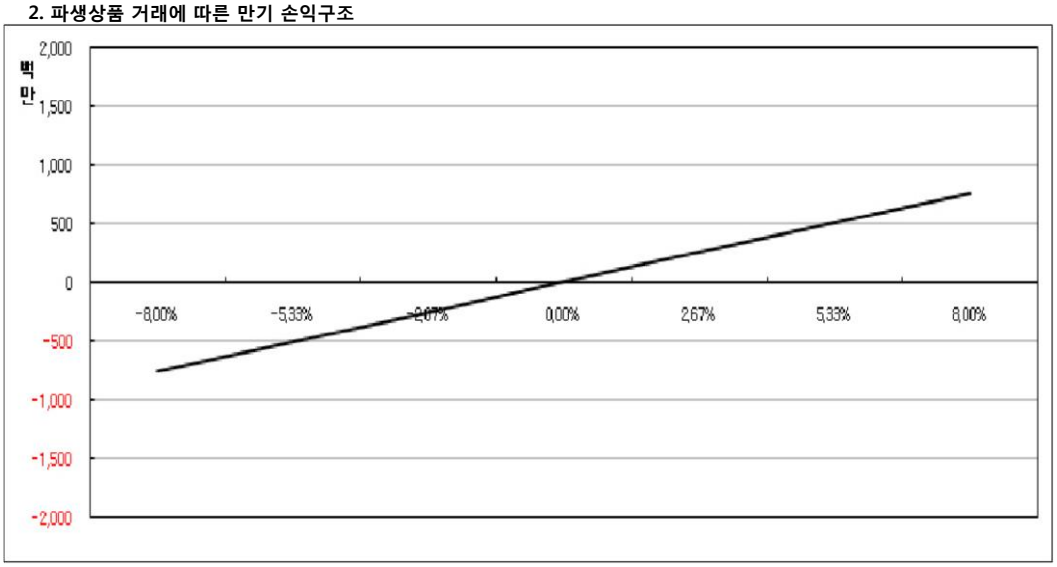
공시일: 2018-12-13

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	268	0	268	장내
합계			268	0	268	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,554

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

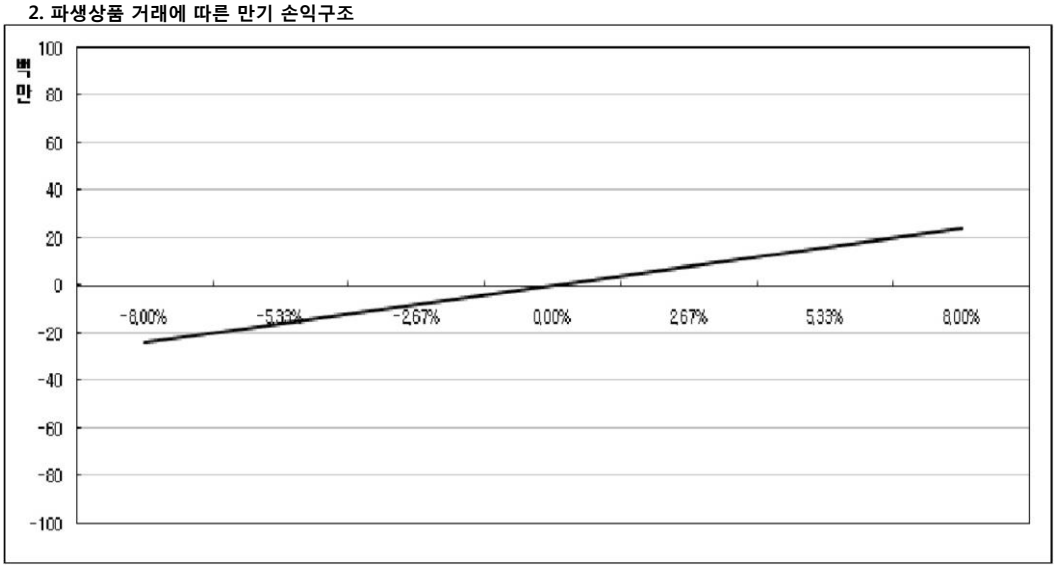
공시일: 2018-12-13

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	805	0	805	장내
합계			805	0	805	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,856

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

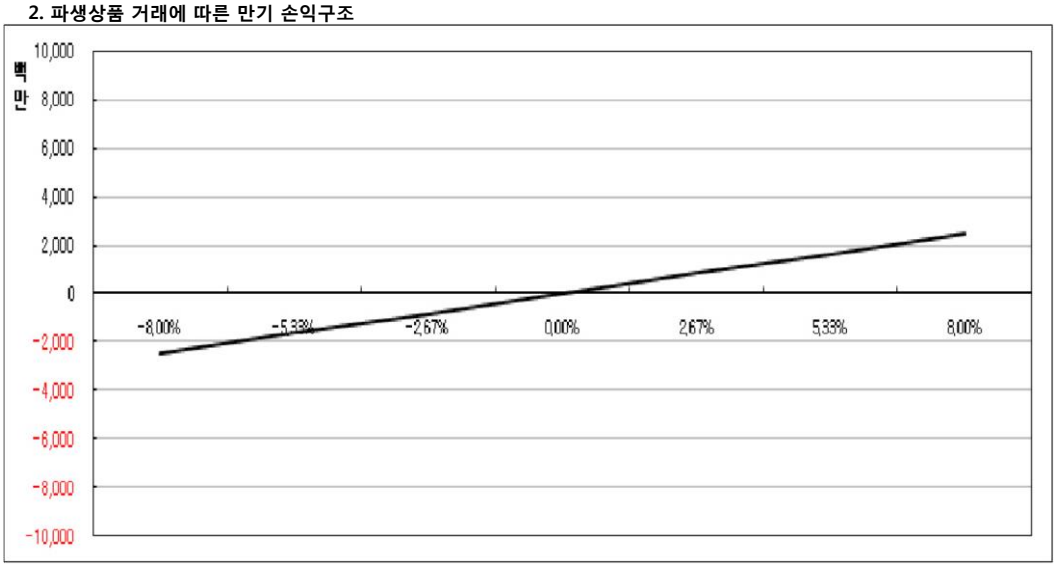
공시일: 2018-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,960	3,960	0	장내
누계	주가지수	선물	5,571	0	5,571	장내
합계			5,571	0	5,571	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 443

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,964

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

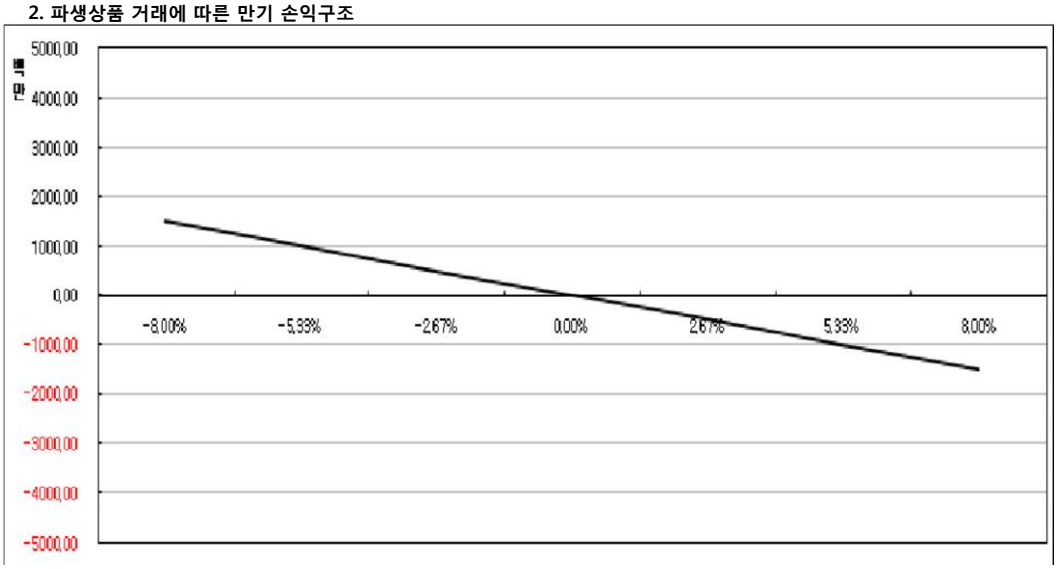
공시일: 2018-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,342	1,074	268	장내
누계	주가지수	선물	0	2,081	-2,081	장내
합계			0	2,081	-2,081	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	166

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	142

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

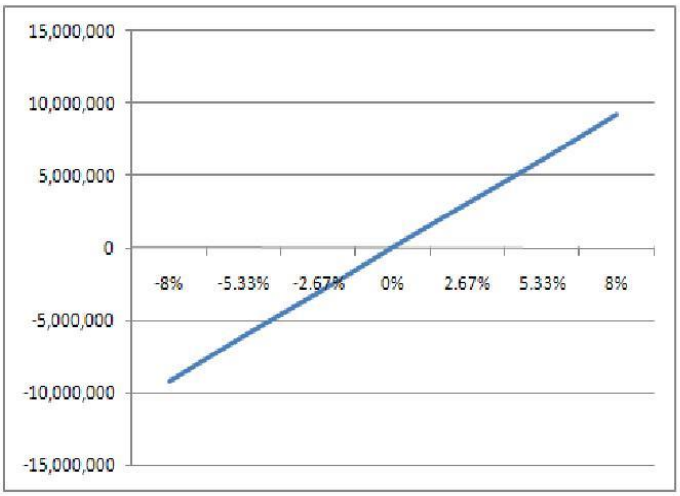
공시일: 2018-12-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	58,459	56,916	1,544	장내
누계	주가지수	선물	85,038	0	85,038	장내
합계			85,038	0	85,038	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6,762

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	33,404