펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-14

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	3,772	0	3,772	장내
신규	주가지수	옵션	44	25,690	-25,646	장내
누계	주가지수	옵션	44	13,567	-13,523	장내
합계			3,815	13,567	-9,751	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	516

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,791

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

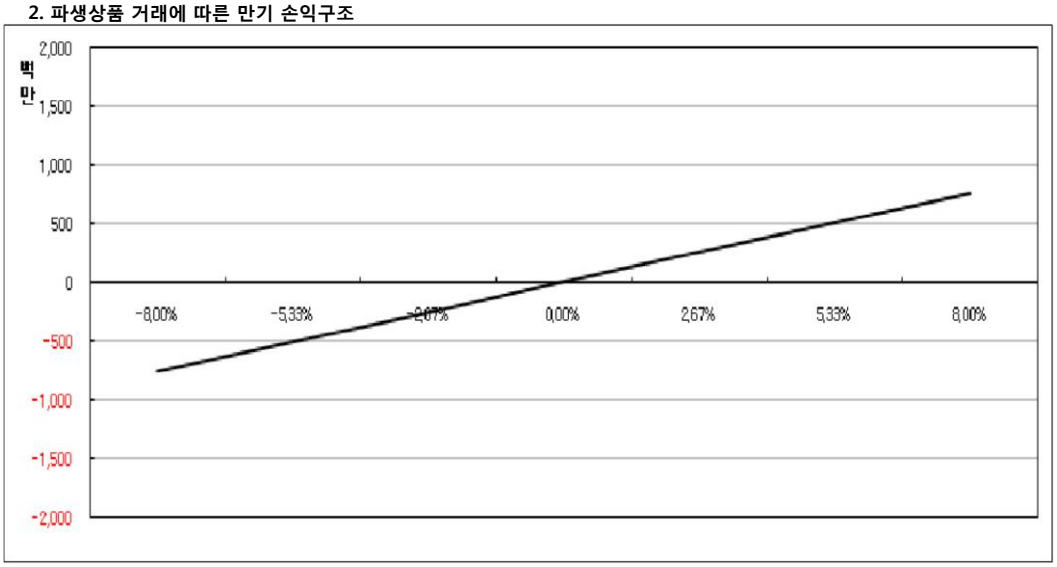
공시일: 2018-12-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	269	269	0	장내
누계	주가지수	선물	269	0	269	장내
합계			269	0	269	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,530

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

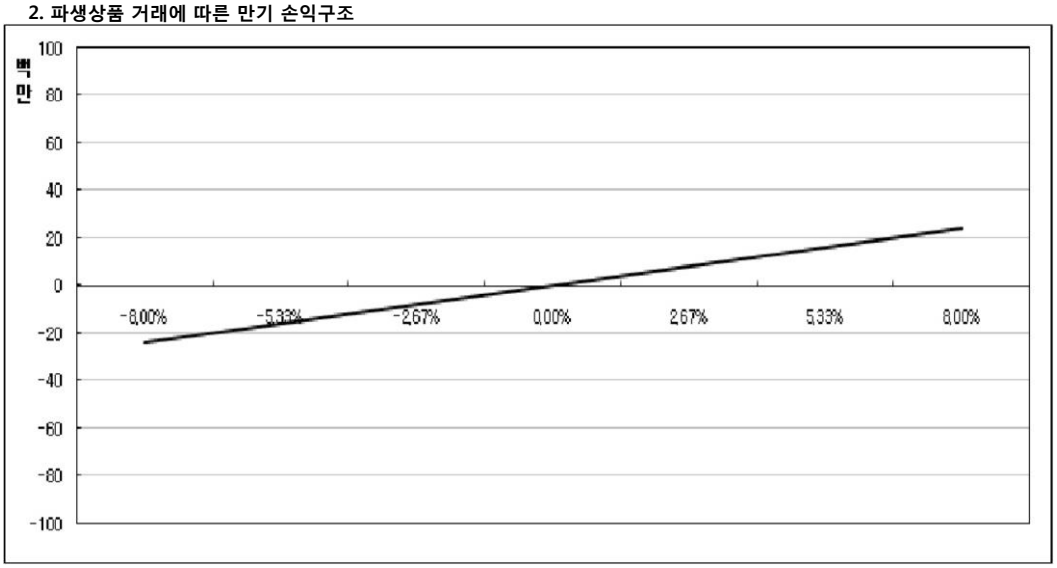
공시일: 2018-12-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	808	808	0	장내
누계	주가지수	선물	808	0	808	장내
합계			808	0	808	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 64

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 2,830

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

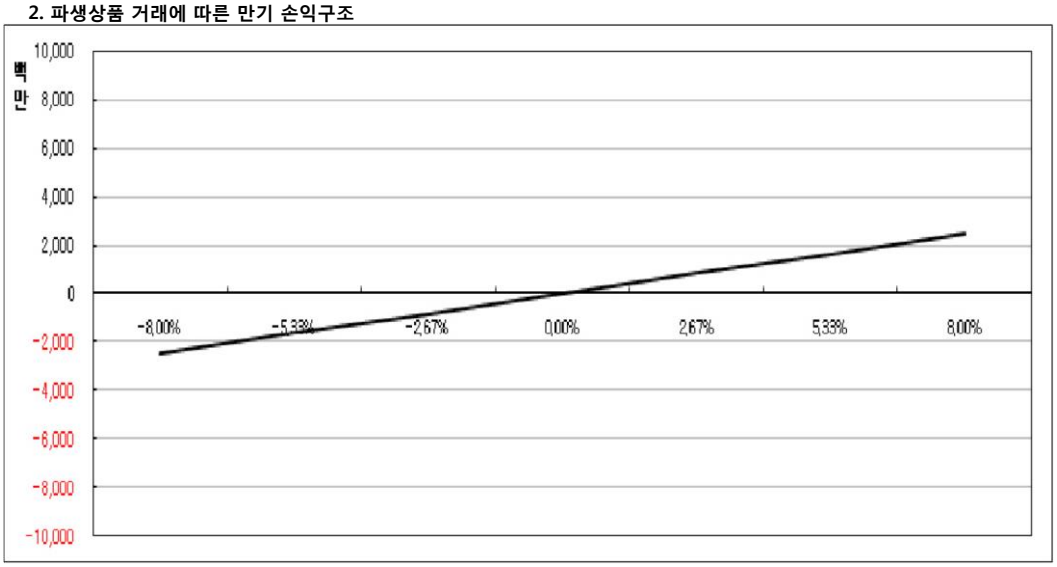
공시일: 2018-12-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,021	2,088	-67	장내
누계	주가지수	선물	5,523	0	5,523	장내
합계			5,523	0	5,523	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 439

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,919

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

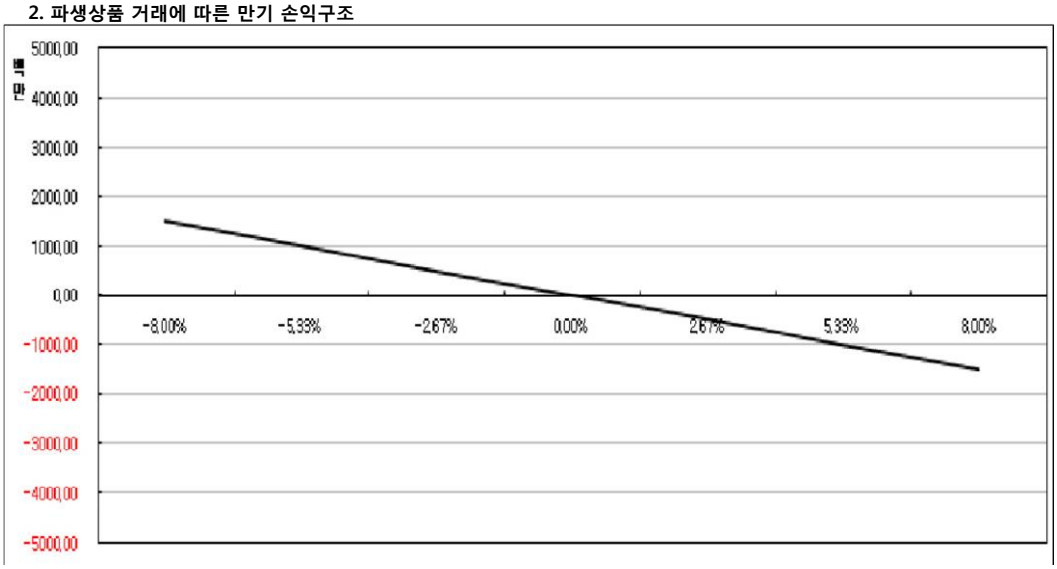
공시일: 2018-12-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,010	1,010	0	장내
누계	주가지수	선물	0	2,088	-2,088	장내
합계			0	2,088	-2,088	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	166

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	143

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

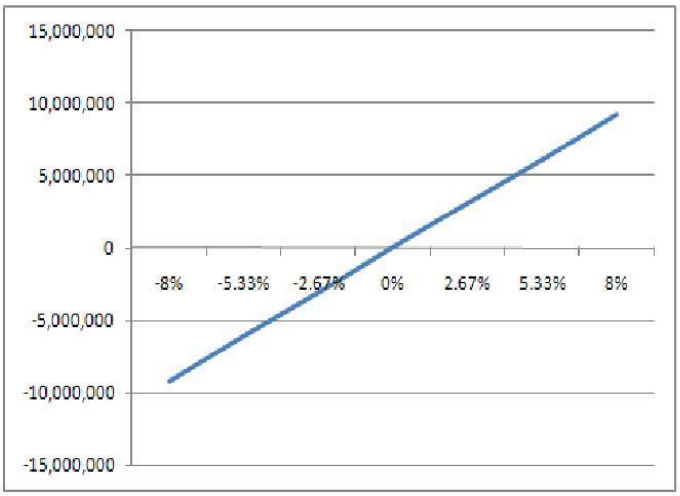
공시일: 2018-12-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	13,268	28,221	-14,952	장내
누계	주가지수	선물	70,383	0	70,383	장내
합계			70,383	0	70,383	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,597

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

40,021