펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2018-12-31

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	3,668	0	3,668	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	30	13,361	-13,331	장내
합계			3,698	13,361	-9,663	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

395

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,593

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

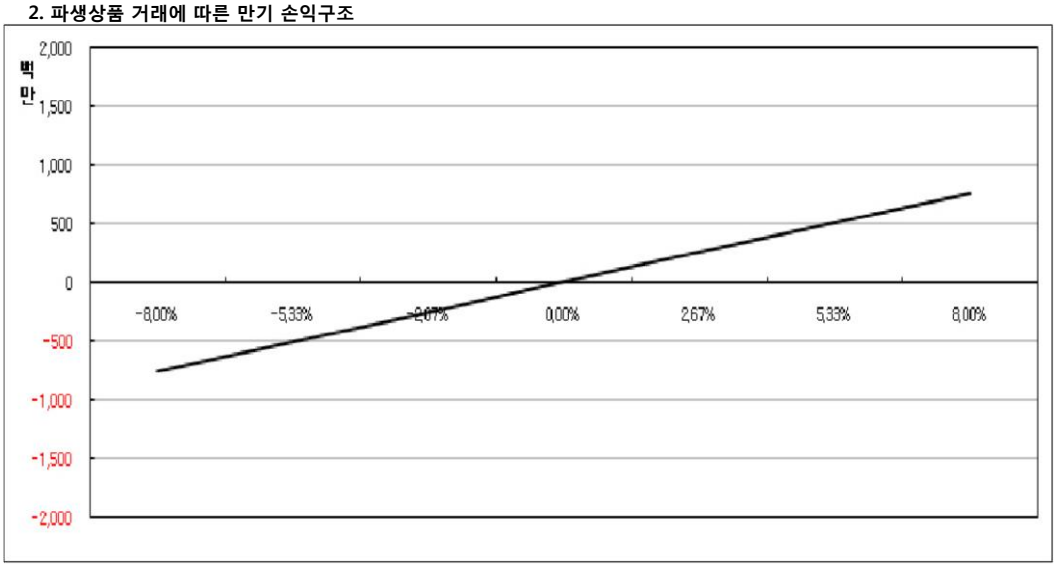
공시일: 2018-12-31

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	262	0	262	장내
합계			262	0	262	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,455

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

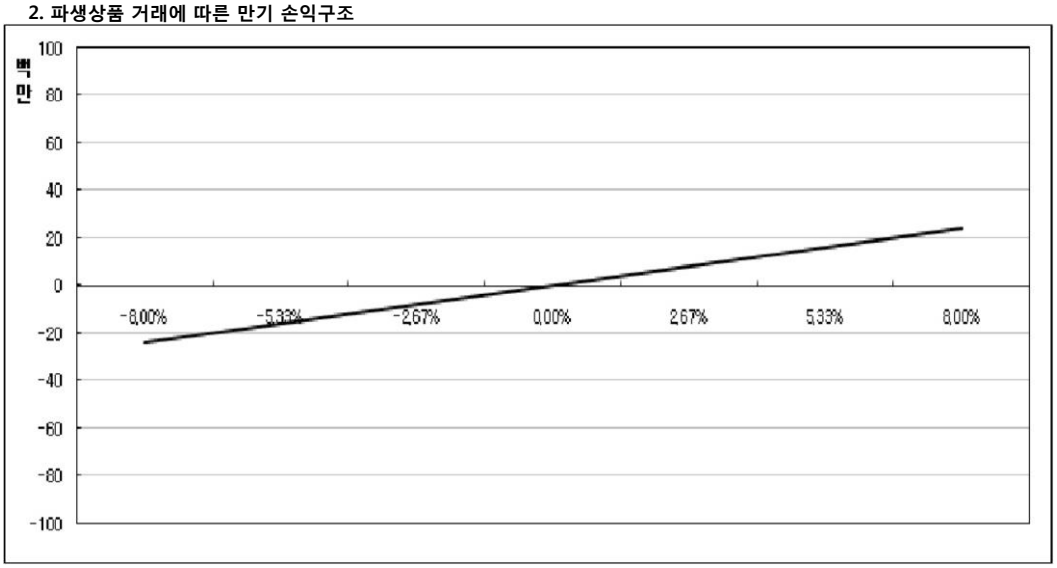
공시일: 2018-12-31

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	917	0	917	장내
합계			917	0	917	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	73

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,750

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

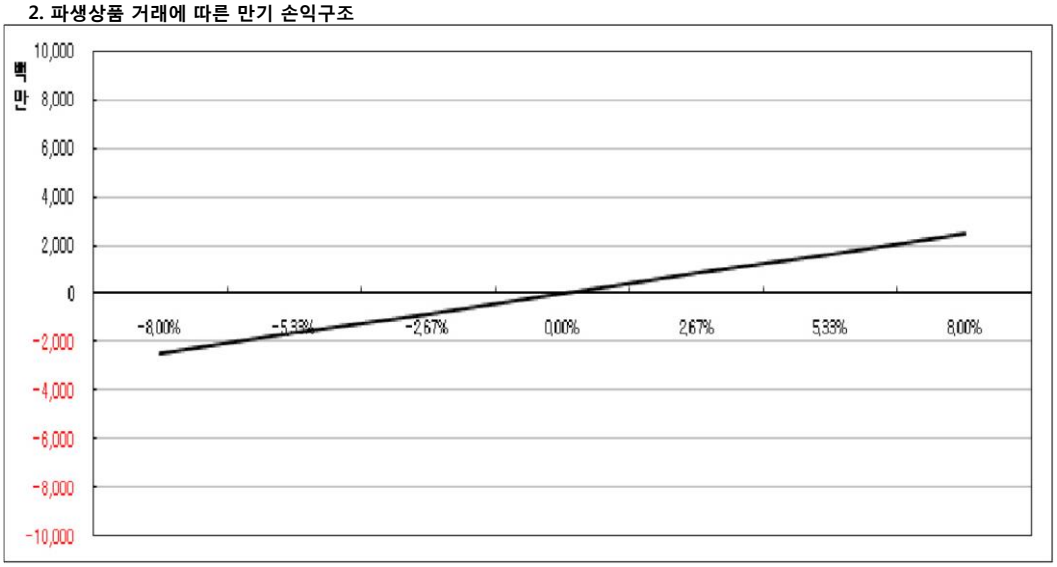
공시일: 2018-12-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	524	0	524	장내
누계	주가지수	선물	6,026	0	6,026	장내
합계			6,026	0	6,026	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 482

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4,792

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

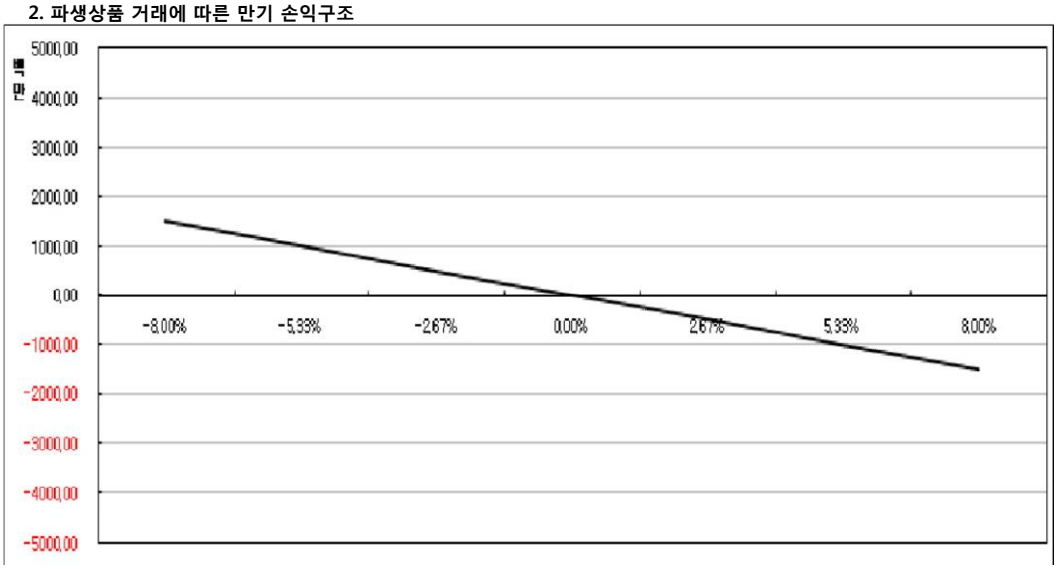
공시일: 2018-12-31

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	0	2,096	-2,096	장내
합계			0	2,096	-2,096	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 168

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 144

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

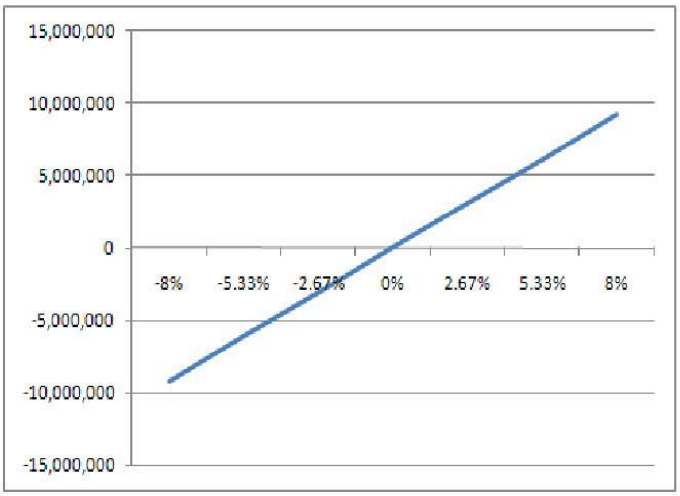
공시일: 2018-12-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,096	0	2,096	장내
누계	주가지수	선물	69,097	0	69,097	장내
합계			69,097	0	69,097	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,528

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38,829