펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-11-13

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	1,560	0	1,560	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,766	-2,766	장내
합계			1,560	2,766	-1,205	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

96

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

110

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

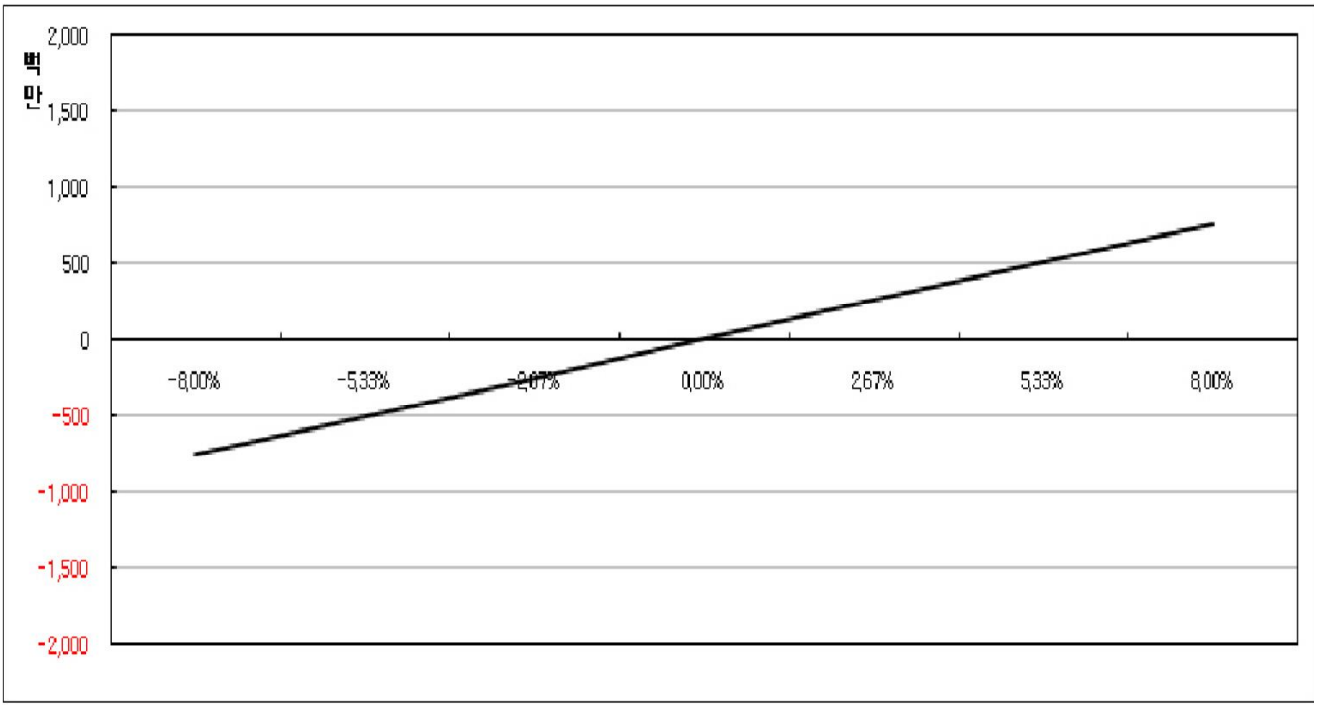
공시일: 2019-11-13

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	425	0	425	장내
합계			425	0	425	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

341

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

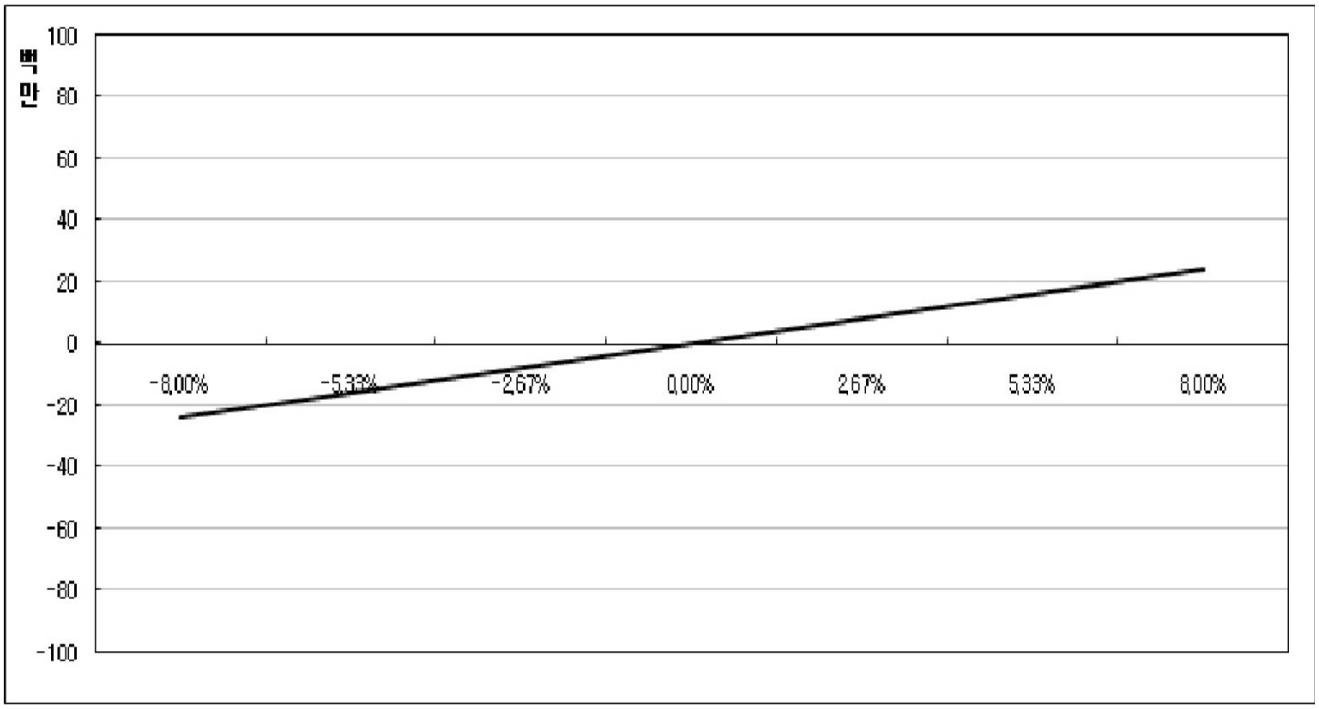
공시일: 2019-11-13

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	1,135	0	1,135	장내
합계			1,135	0	1,135	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

449

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

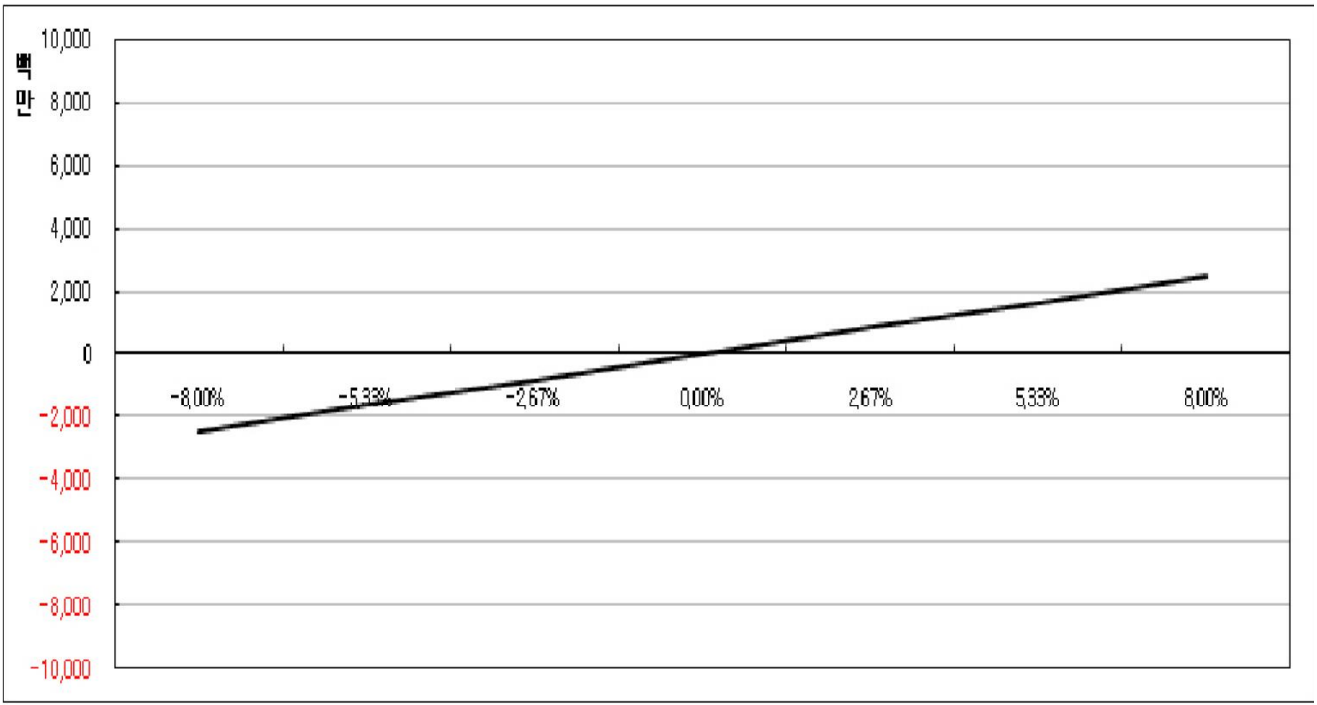
공시일: 2019-11-13

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	4,751	0	4,751	장내
합계			4,751	0	4,751	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

381

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

873

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

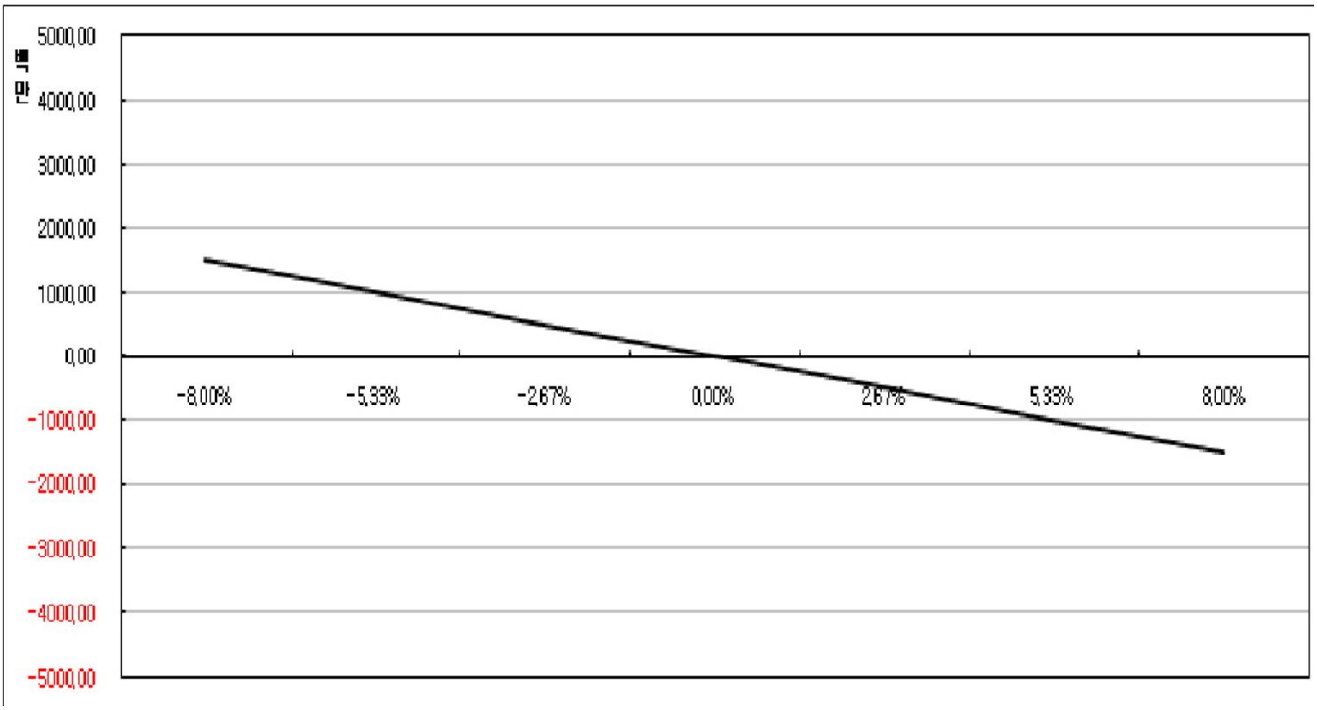
공시일: 2019-11-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	284	0	284	장내
누계	주가지수	선물	0	1,702	-1,702	장내
합계			0	1,702	-1,702	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

136

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

107

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

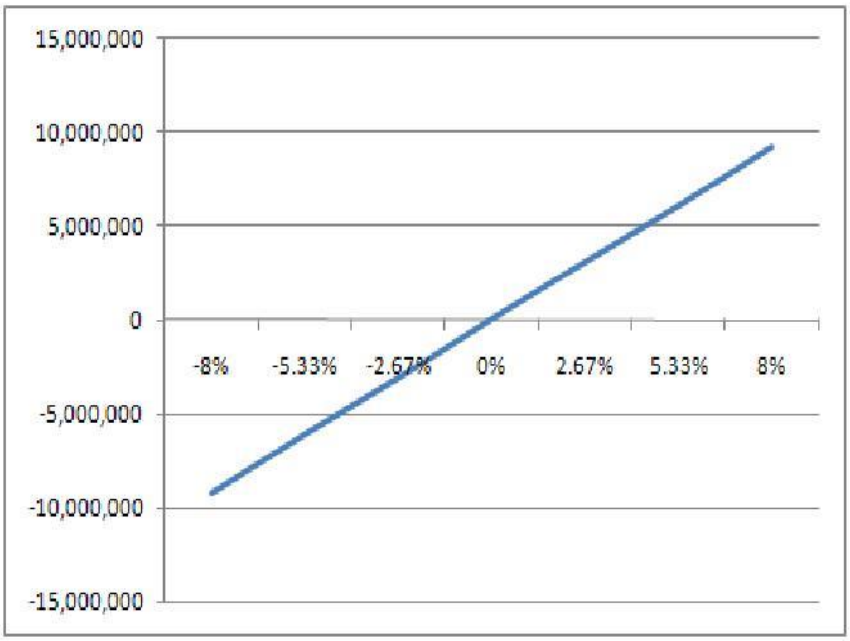
공시일: 2019-11-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	638	0	638	장내
누계	주가지수	선물	65,169	0	65,169	장내
합계			65,169	0	65,169	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,222

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,077