펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-11-20

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	1,574	0	1,574	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	3	2,791	-2,788	장내
합계			1,578	2,791	-1,213	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

78

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

415

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

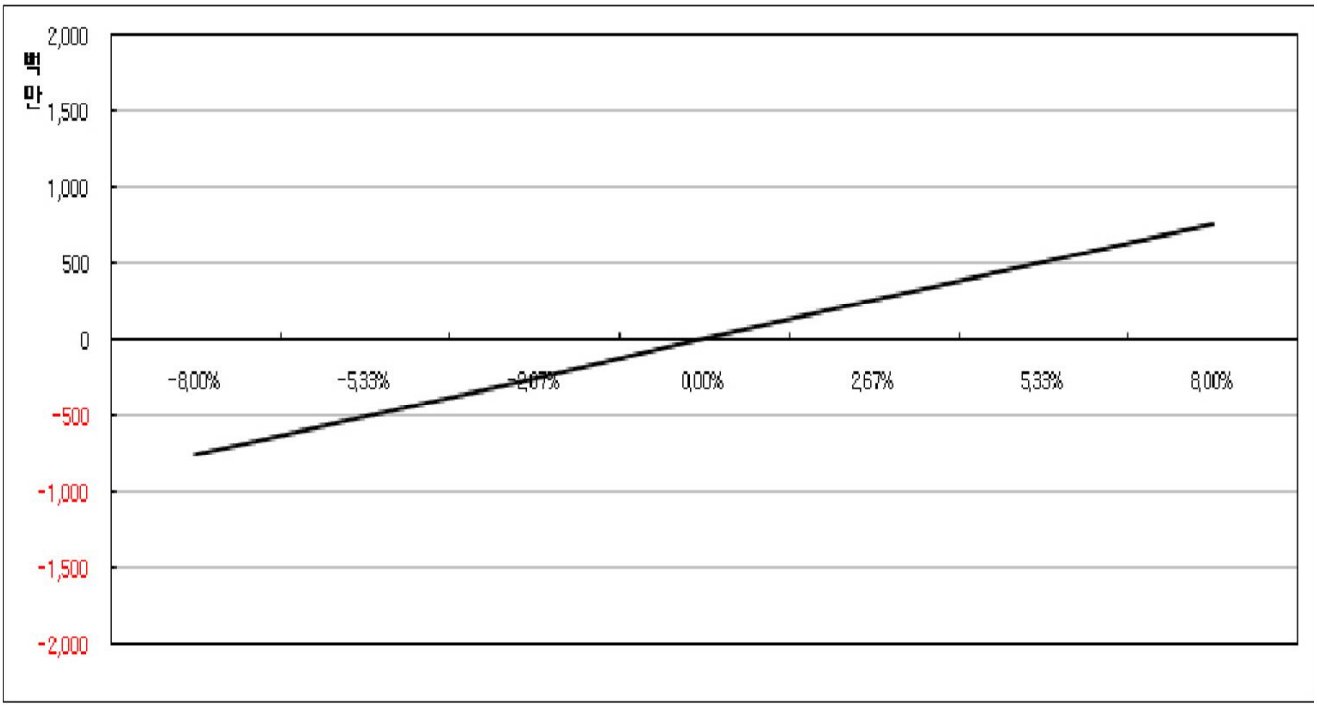
공시일: 2019-11-20

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	429	0	429	장내
합계			429	0	429	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

345

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

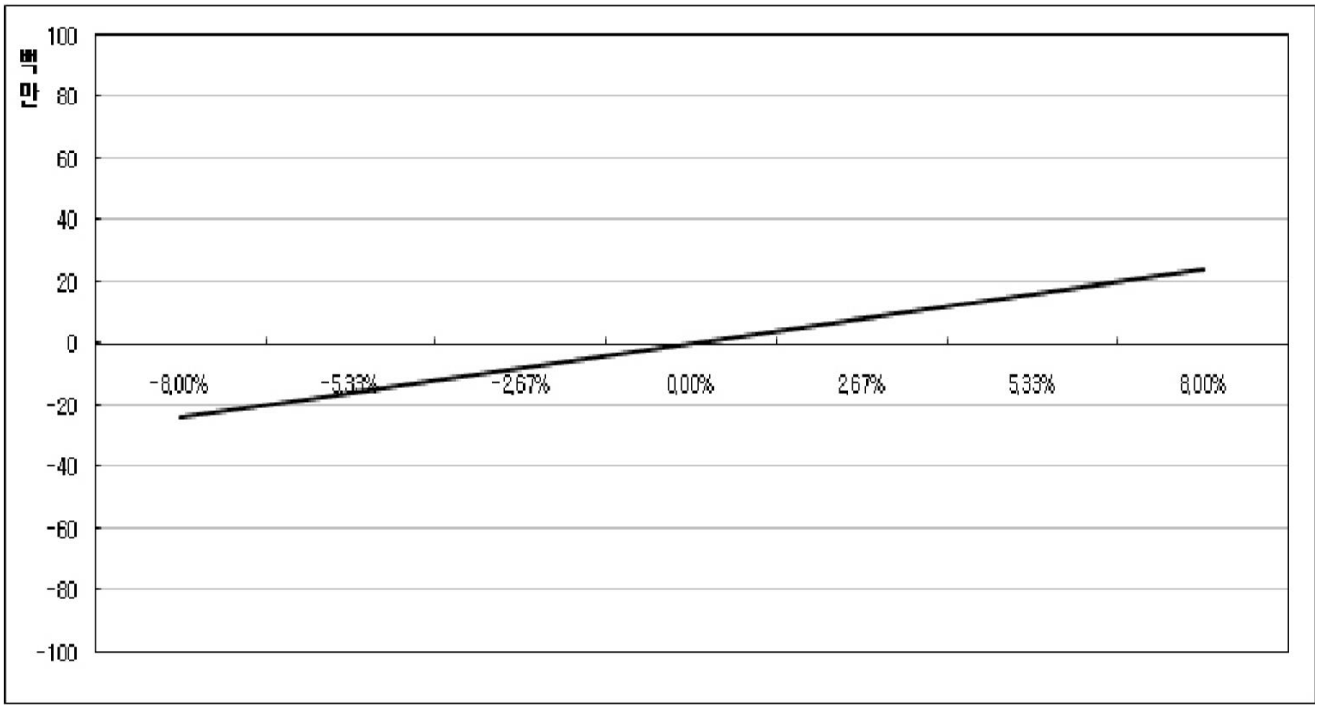
공시일: 2019-11-20

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	1,145	0	1,145	장내
합계			1,145	0	1,145	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

92

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

454

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

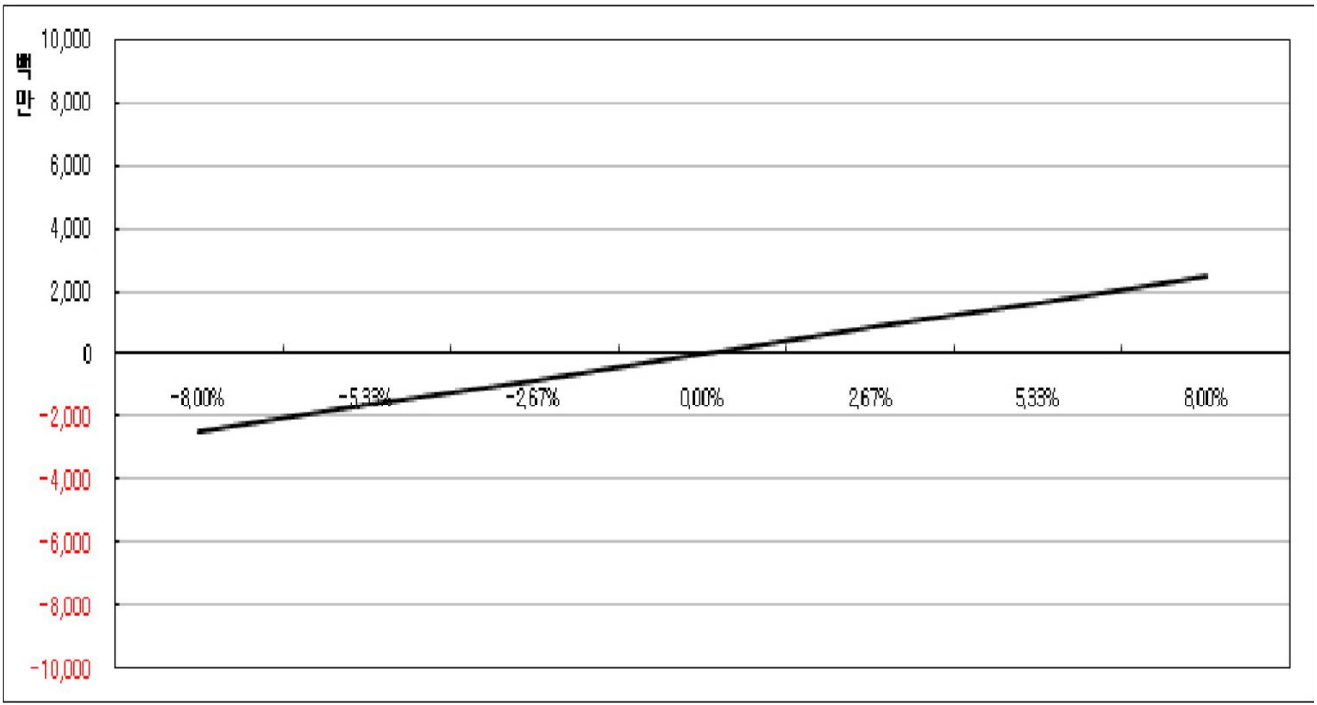
공시일: 2019-11-20

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	4,437	0	4,437	장내
합계			4,437	0	4,437	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

355

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

867

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

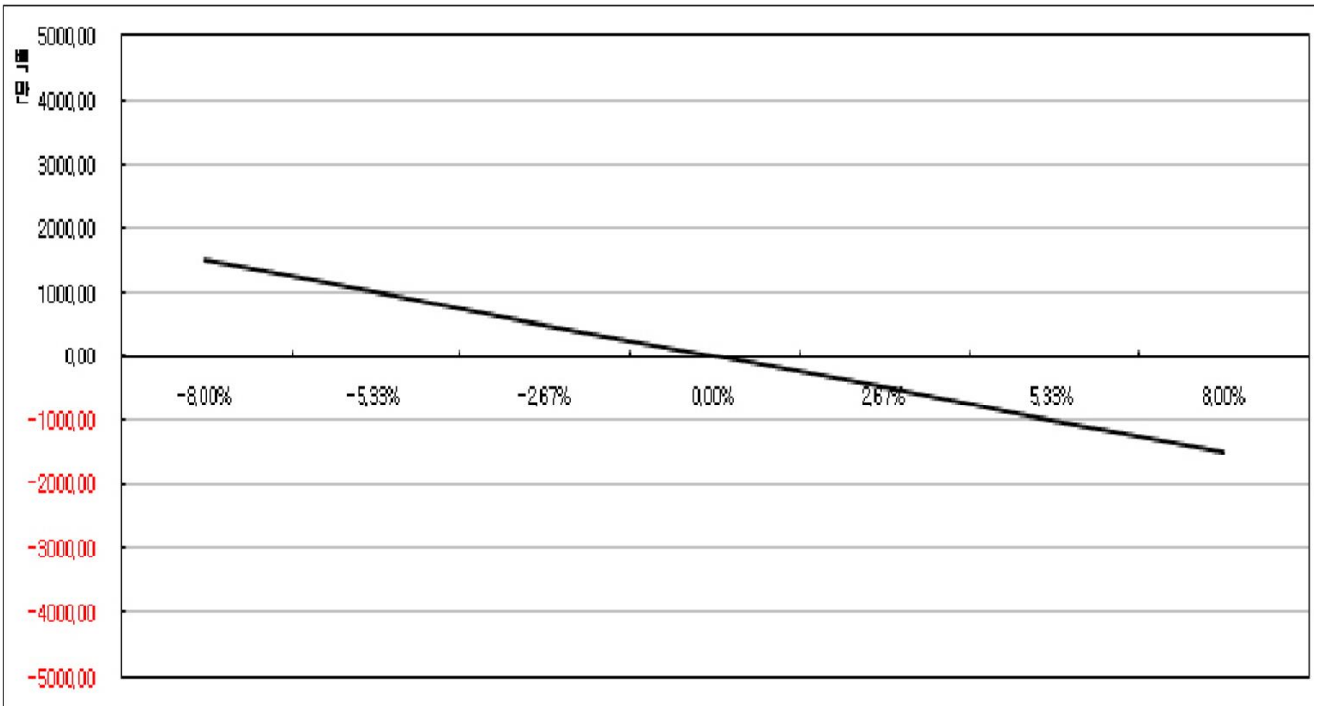
공시일: 2019-11-20

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	0	1,932	-1,932	장내
합계			0	1,932	-1,932	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

155

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

122

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

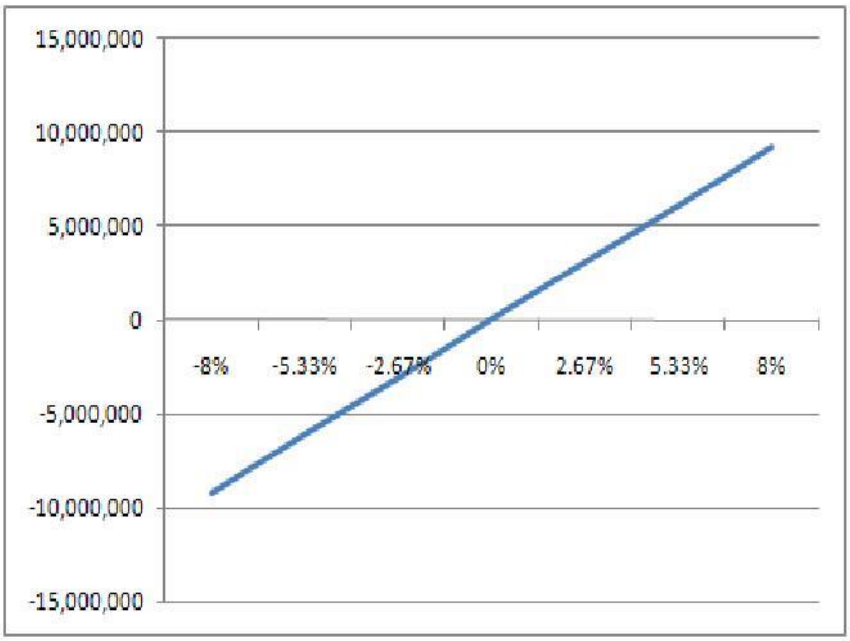
공시일: 2019-11-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	215	-215	장내
누계	주가지수	선물	68,051	0	68,051	장내
합계			68,051	0	68,051	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,444

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,297