펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-11-26

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	1,552	0	1,552	장내
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	4	2,751	-2,747	장내
합계			1,556	2,751	-1,195	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	60

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	161

펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

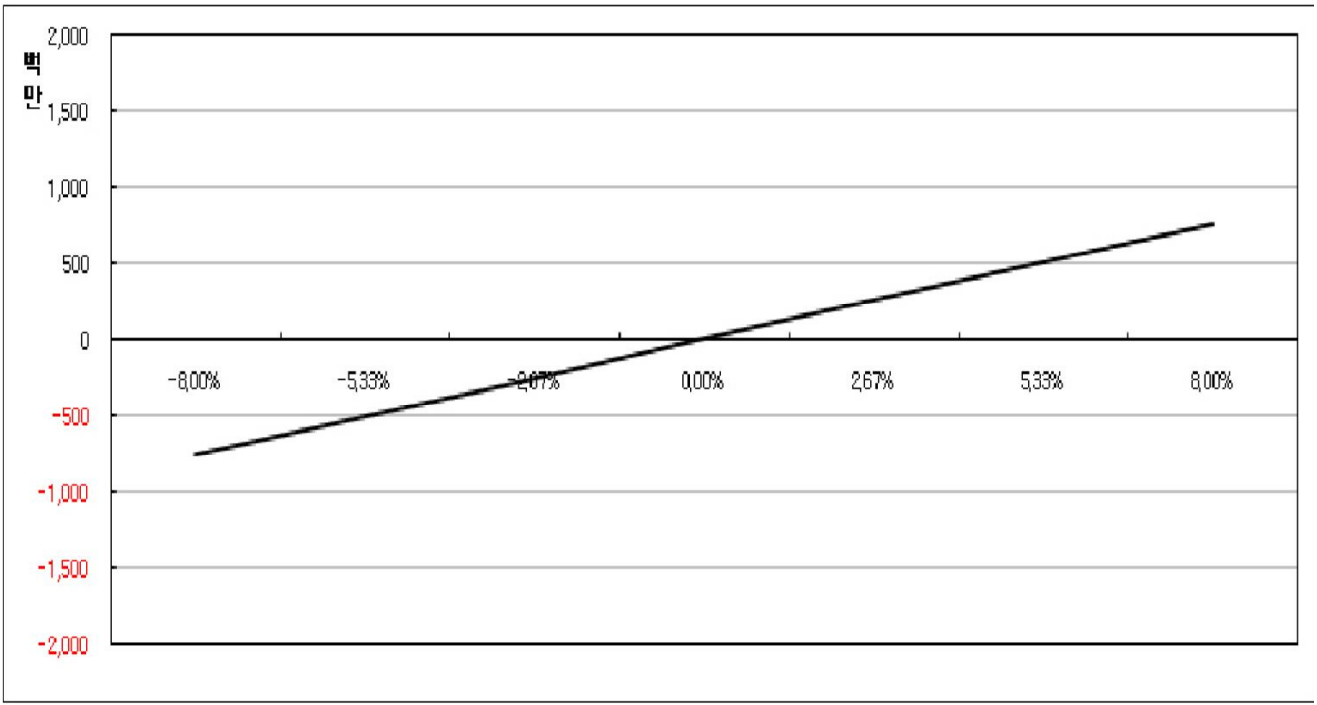
공시일: 2019-11-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	71	-71	장내
누계	주가지수	선물	353	0	353	장내
합계			353	0	353	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

338

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

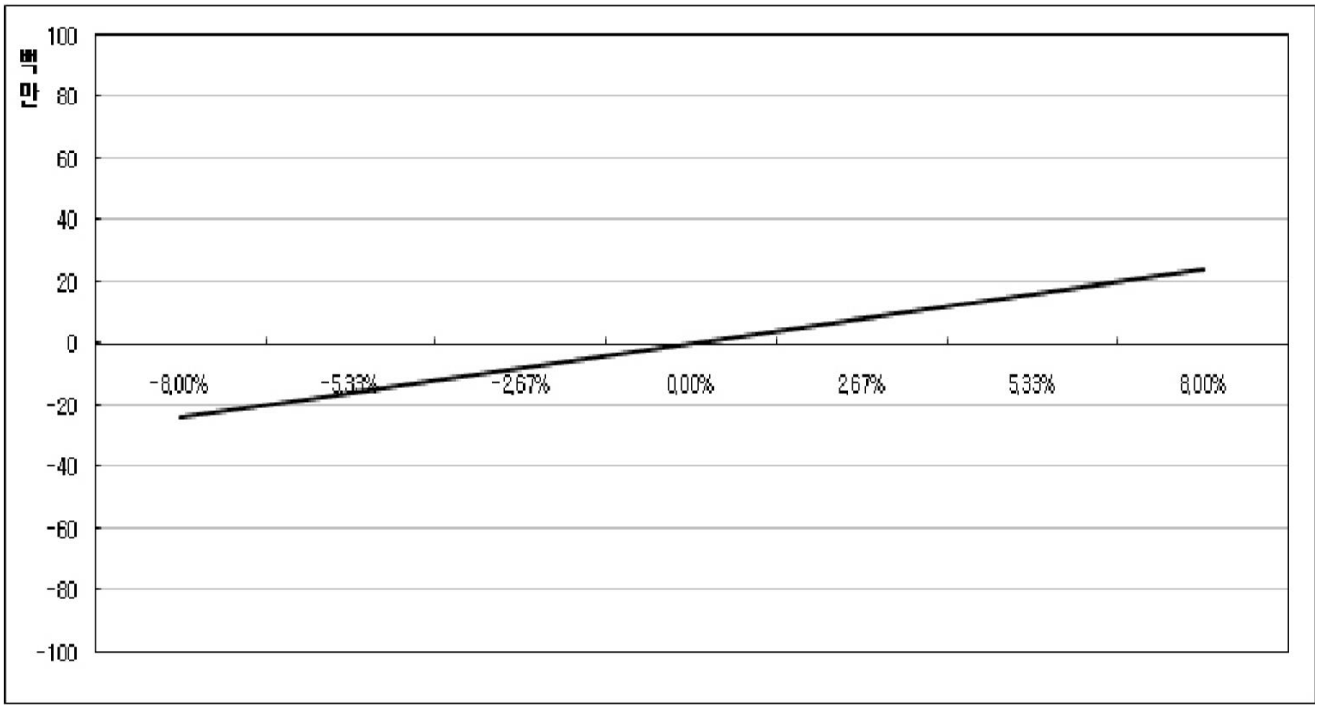
공시일: 2019-11-26

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	1,129	0	1,129	장내
합계			1,129	0	1,129	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

447

펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

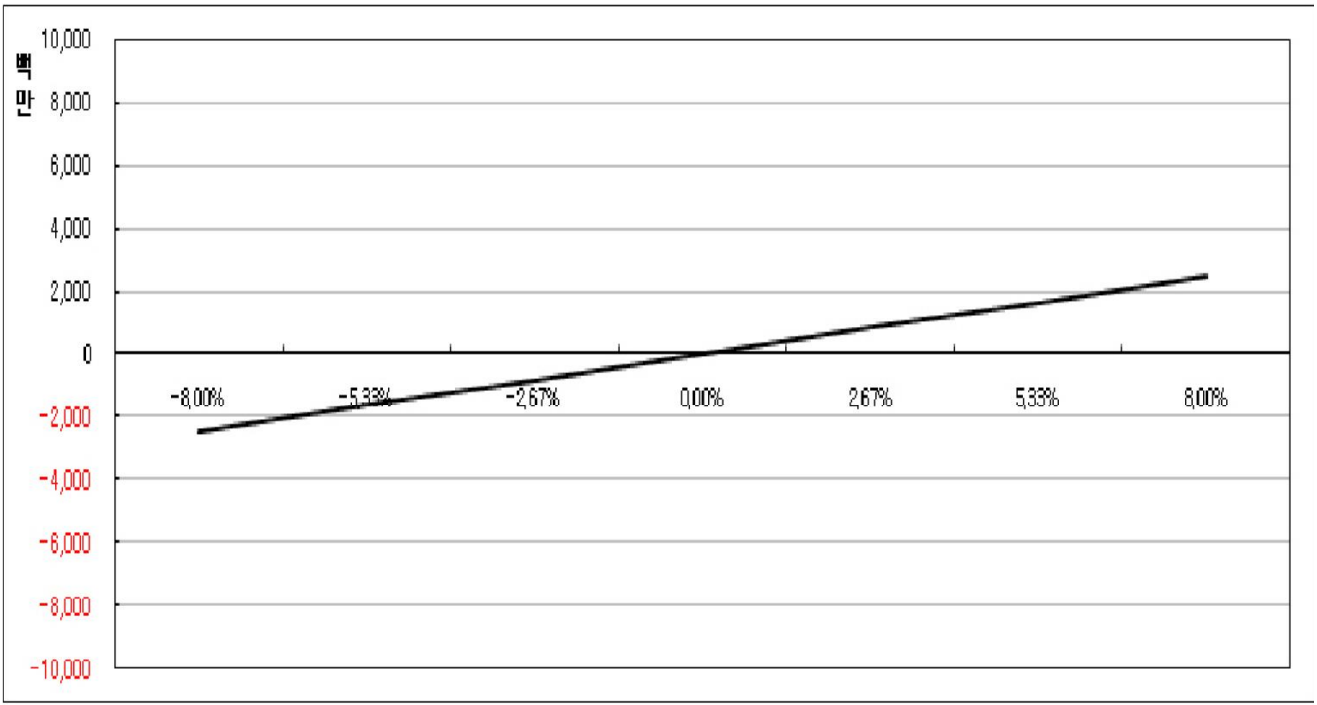
공시일: 2019-11-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	71	0	71	장내
누계	주가지수	선물	4,797	0	4,797	장내
합계			4,797	0	4,797	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

385

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

880

펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

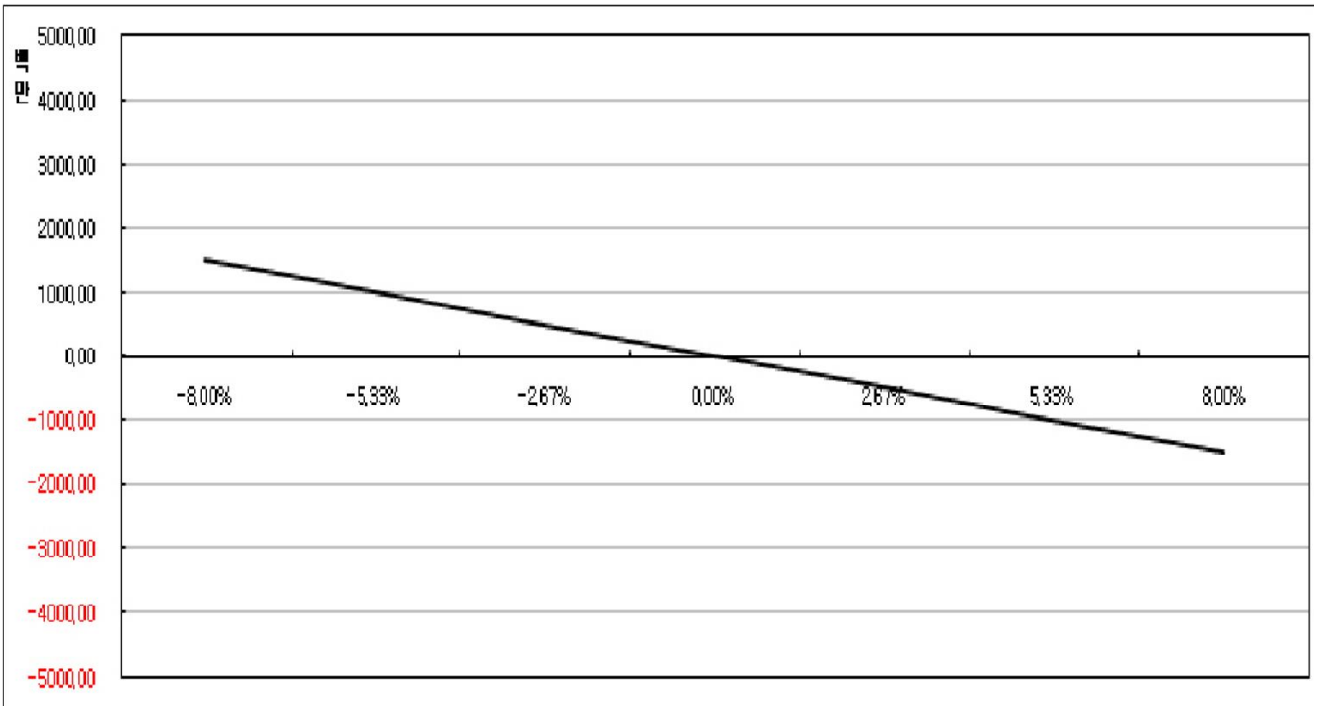
공시일: 2019-11-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	71	0	71	장내
누계	주가지수	선물	0	1,764	-1,764	장내
합계			0	1,764	-1,764	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

141

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

112

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

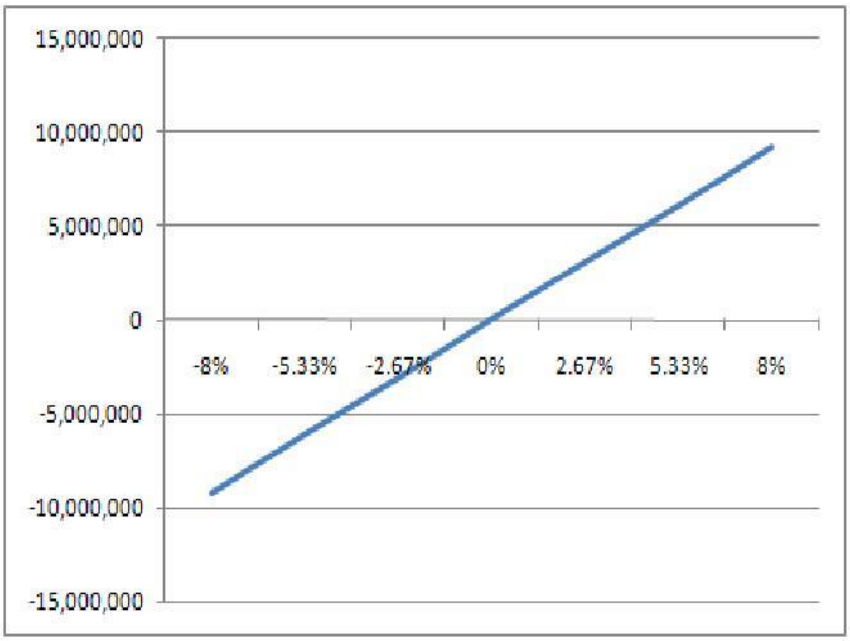
공시일: 2019-11-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	705	0	705	장내
누계	주가지수	선물	70,406	0	70,406	장내
합계			70,406	0	70,406	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,645

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,424