# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-02-14

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 | 3,847 | 0 | 3,847 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 15,103 | -15,103 | 장내 |
| 합계 | | | 3,847 | 15,103 | -11,256 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 898 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 2,229 |
|---|---|

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

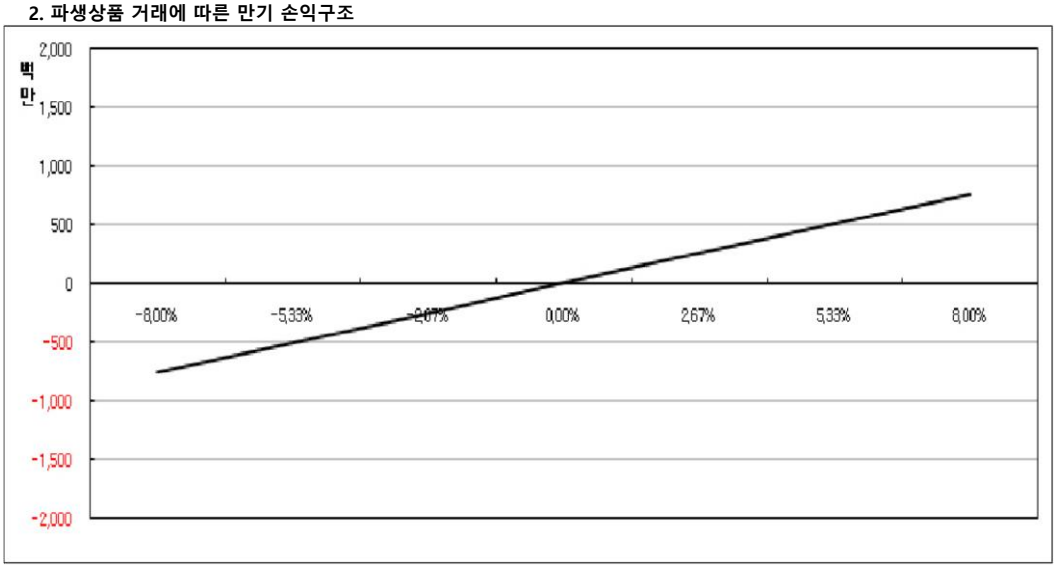
공시일: 2019-02-14

## 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 | 285 | 0 | 285 | 장내 |
| 합계 | | | 285 | 0 | 285 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 23 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 2,907 |
|---|---|

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

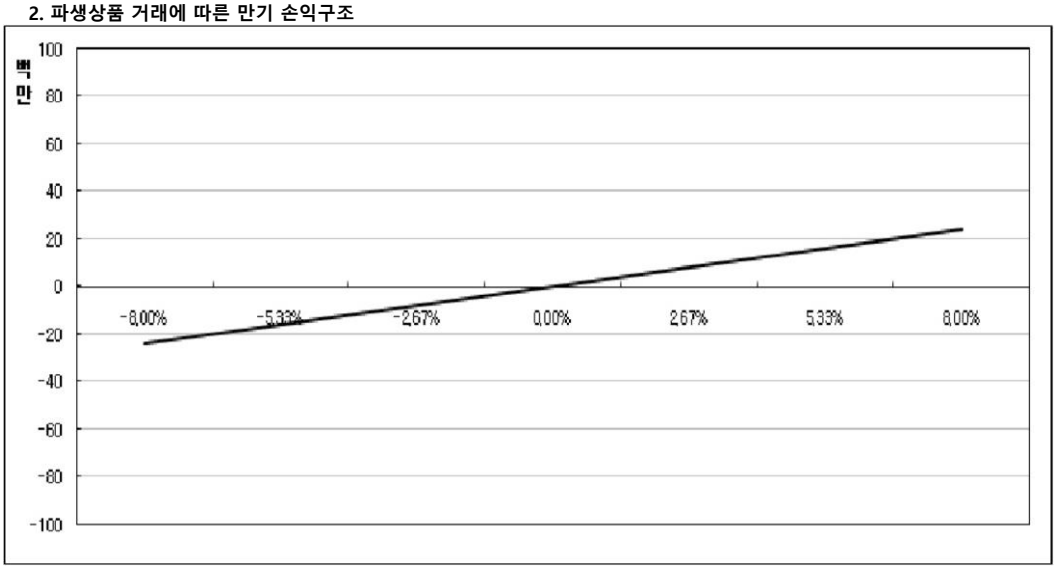
공시일: 2019-02-14

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 | 855 | 0 | 855 | 장내 |
| 합계 | | | 855 | 0 | 855 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 69 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 3,245 |
|---|---|

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

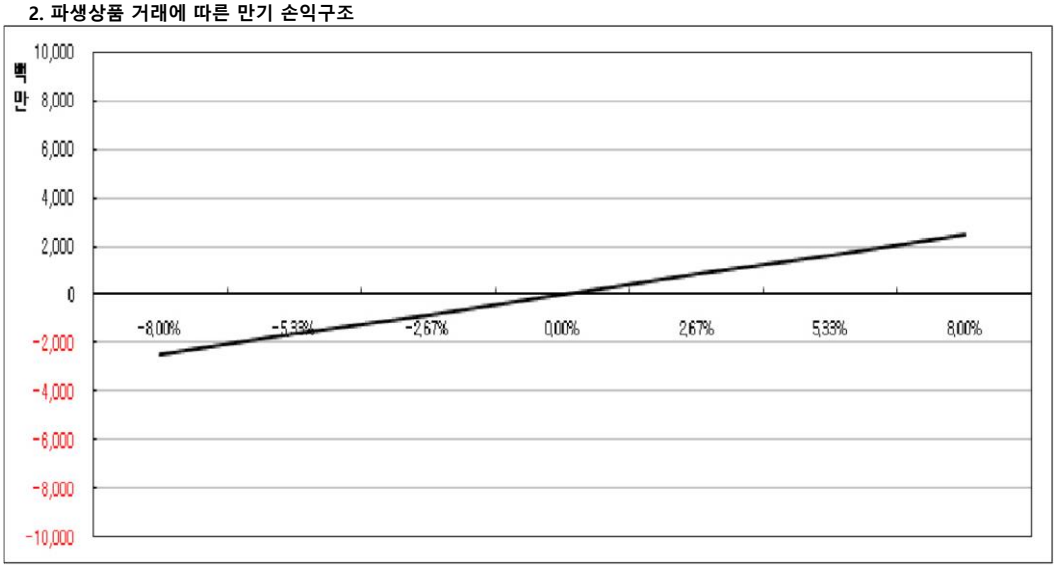
공시일: 2019-02-14

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 214 | -214 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 4,488 | 0 | 4,488 | 장내 |
| 합계 | | | 4,488 | 0 | 4,488 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 360 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 5,556 |
|---|---|

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

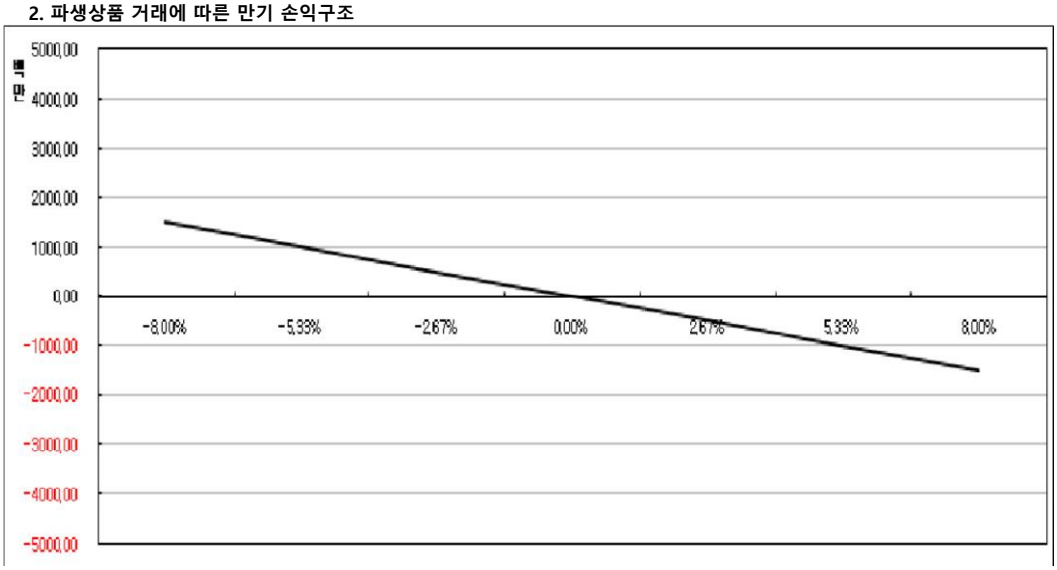
공시일: 2019-02-14

**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 | 0 | 2,921 | -2,921 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 2,921 | -2,921 | |

**2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조**




(단위: 백만원)

**3. 시나리오법에 의한 손익변동** 234

(단위: 백만원)

**4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)** 201

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

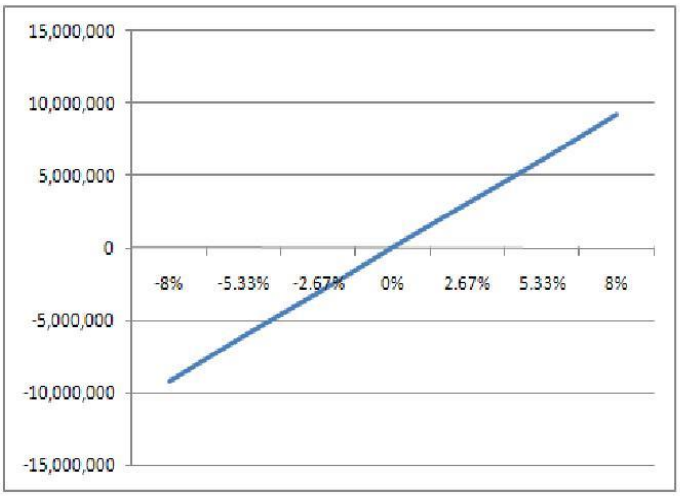
공시일: 2019-02-14

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 | 71,100 | 0 | 71,100 | 장내 |
| 합계 | | | 71,100 | 0 | 71,100 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 5,703 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 45,075 |
|---|---|