# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-10-07

## 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 | 1,471 | 0 | 1,471 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 4 | 2,674 | -2,670 | 장내 |
| 합계 | | | 1,475 | 2,674 | -1,199 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

56

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

109

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

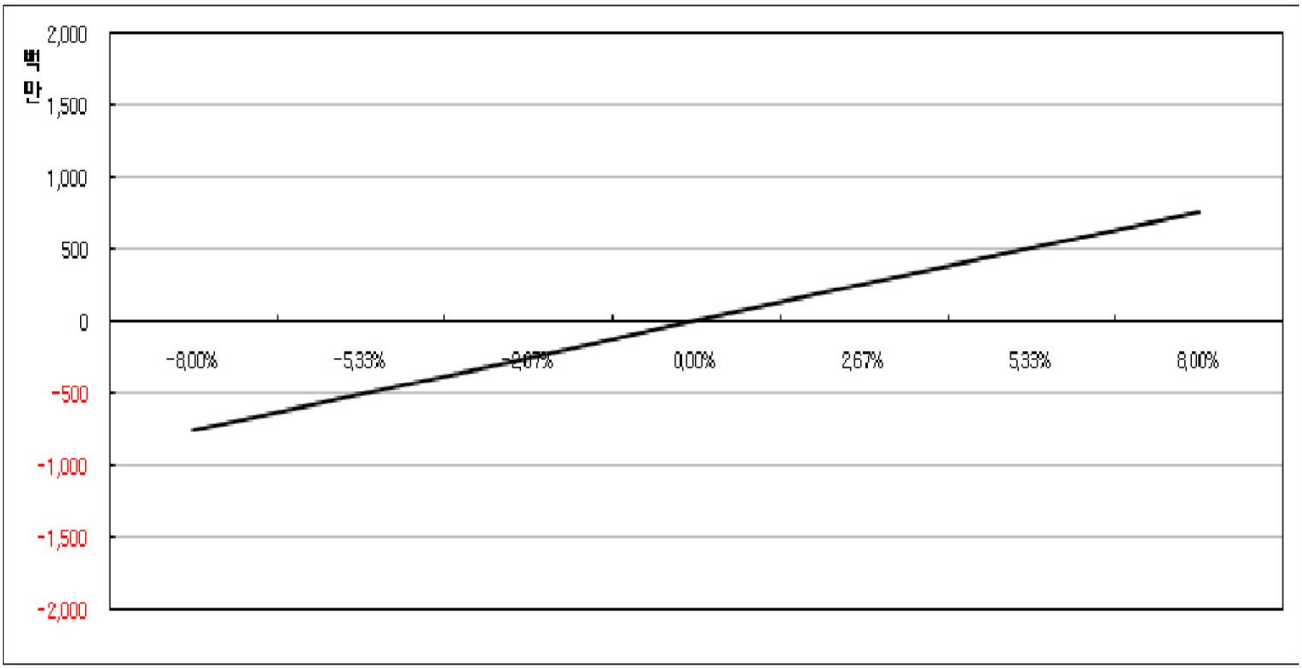
공시일: 2019-10-07

## 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 | 134 | 0 | 134 | 장내 |
| 합계 | | | 134 | 0 | 134 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

420

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

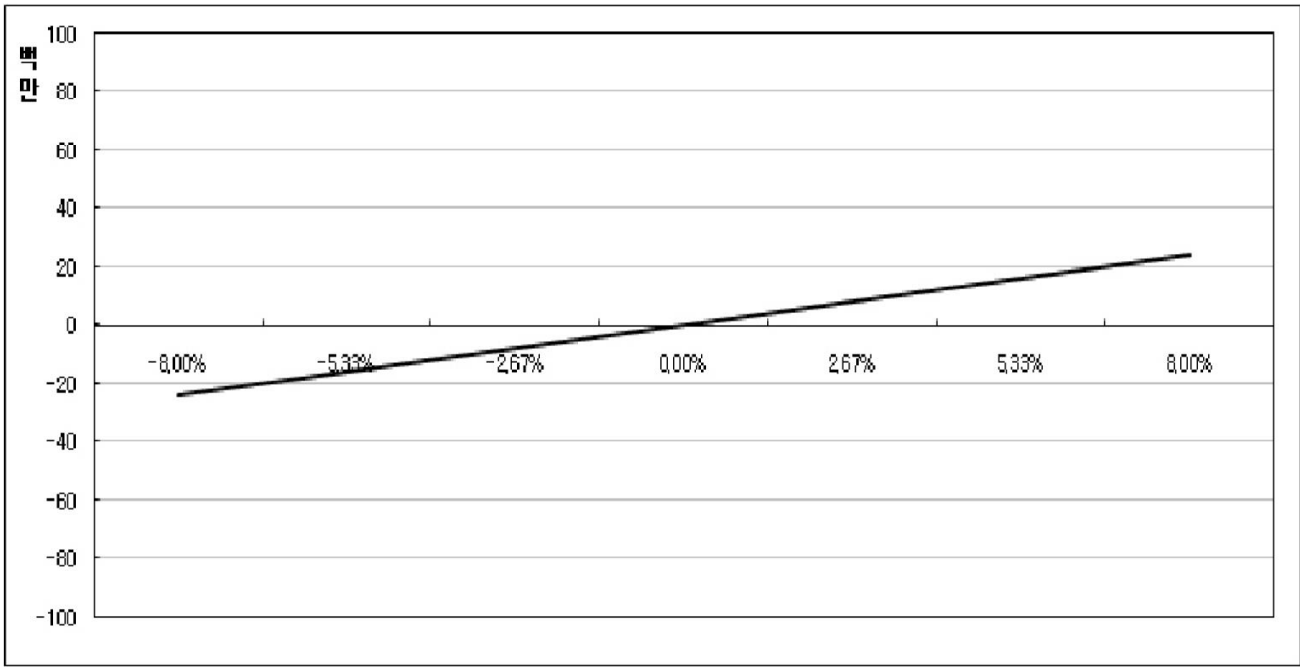
공시일: 2019-10-07

## 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 | 1,070 | 0 | 1,070 | 장내 |
| 합계 | | | 1,070 | 0 | 1,070 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

86

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

514

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

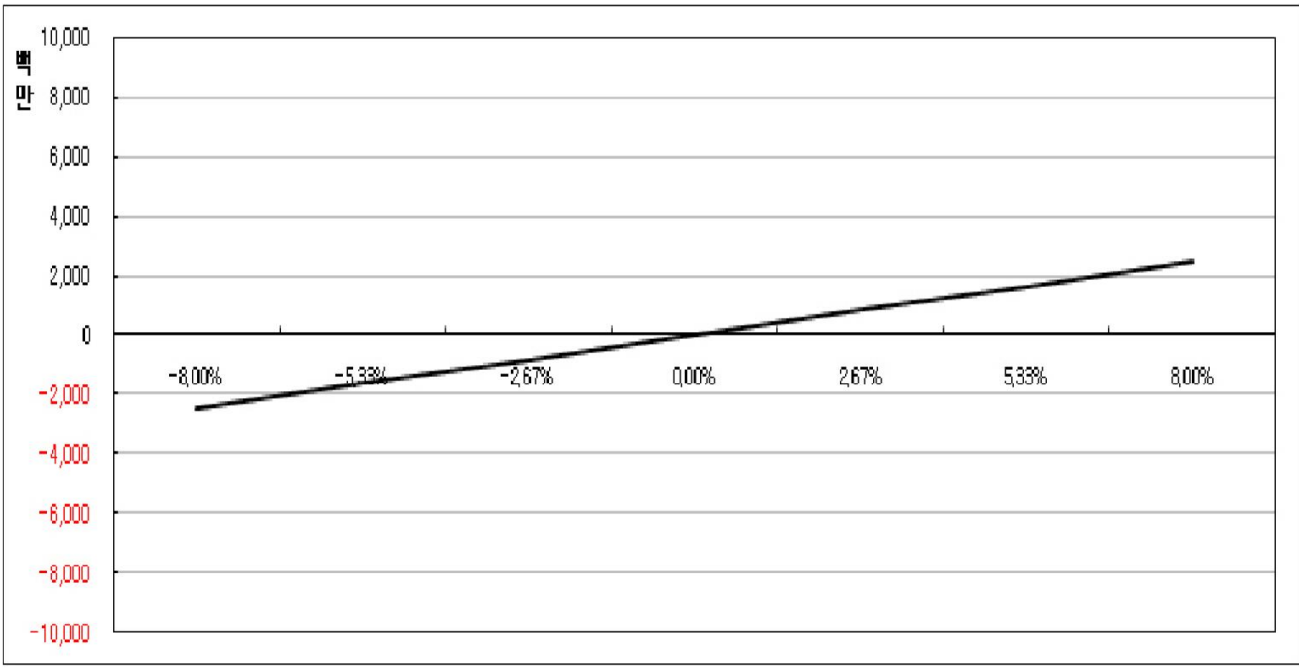
공시일: 2019-10-07

## 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 | 5,014 | 0 | 5,014 | 장내 |
| 합계 | | | 5,014 | 0 | 5,014 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

401

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,008

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

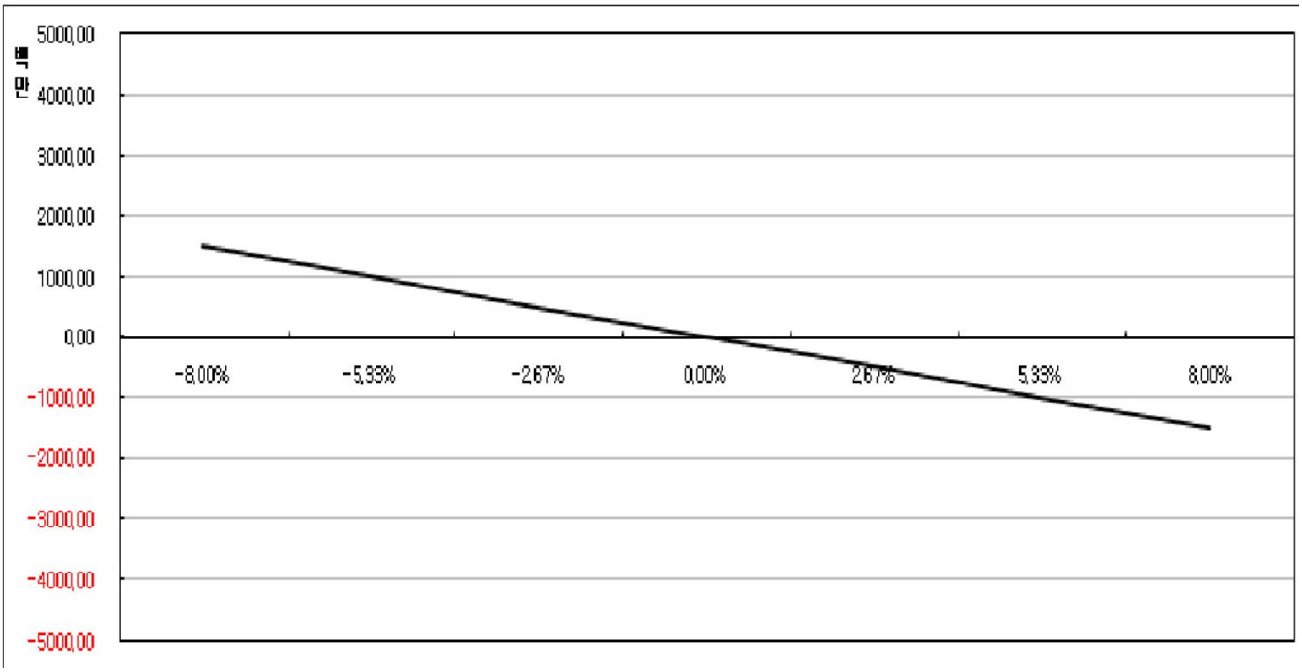
공시일: 2019-10-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 267 | -267 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 1,939 | -1,939 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,939 | -1,939 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

155

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

135

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

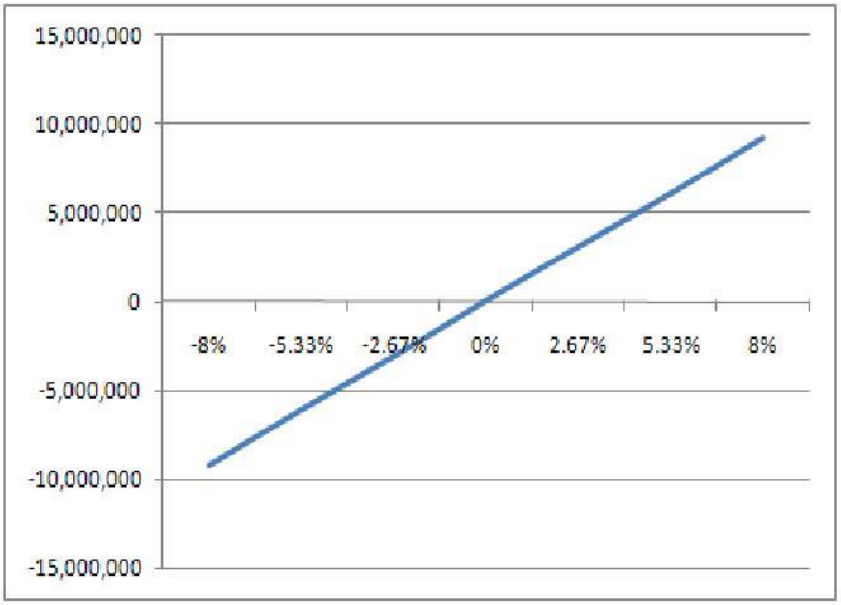
공시일: 2019-10-07

## 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 | 64,307 | 0 | 64,307 | 장내 |
| 합계 | | | 64,307 | 0 | 64,307 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,146

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9,393