# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-11-08

## 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 | 1,564 | 0 | 1,564 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 2,773 | -2,772 | 장내 |
| 합계 | | | 1,564 | 2,773 | -1,208 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

96

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

299

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

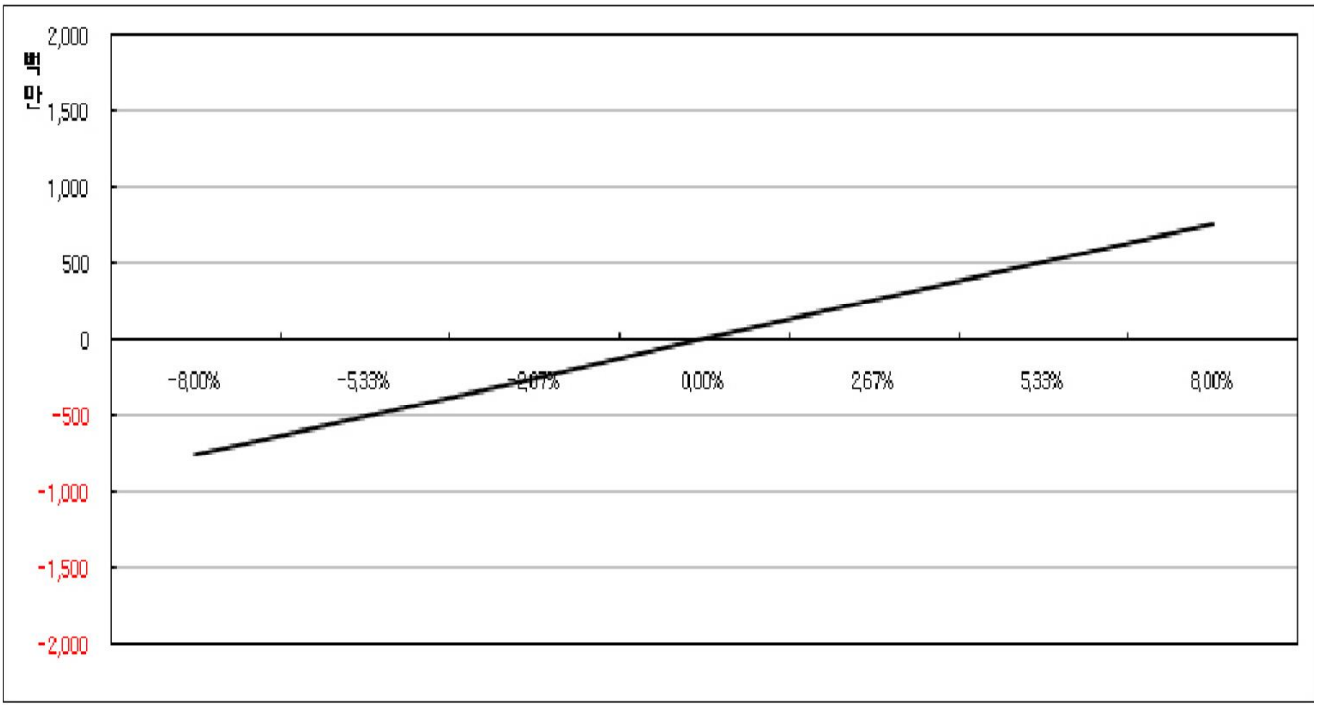
공시일: 2019-11-08

## 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 | 427 | 0 | 427 | 장내 |
| 합계 | | | 427 | 0 | 427 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

343

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

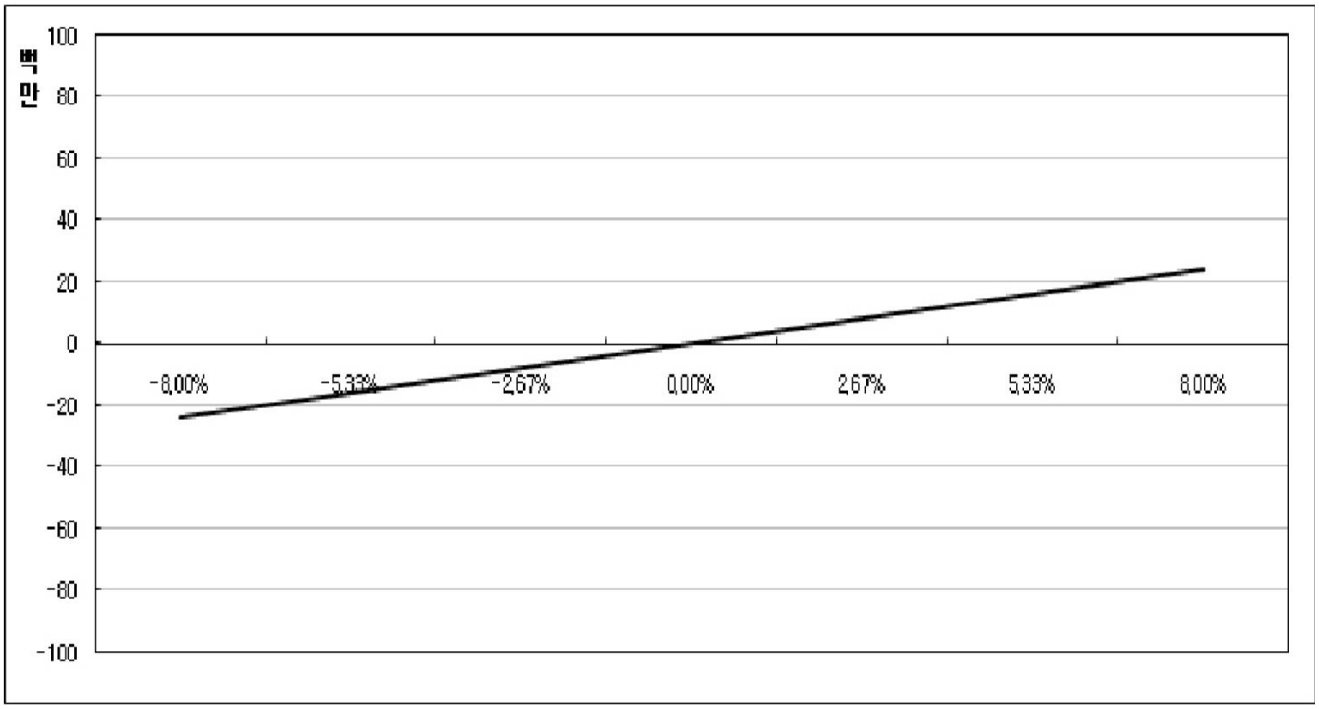
공시일: 2019-11-08

## 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 | 1,137 | 0 | 1,137 | 장내 |
| 합계 | | | 1,137 | 0 | 1,137 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

451

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

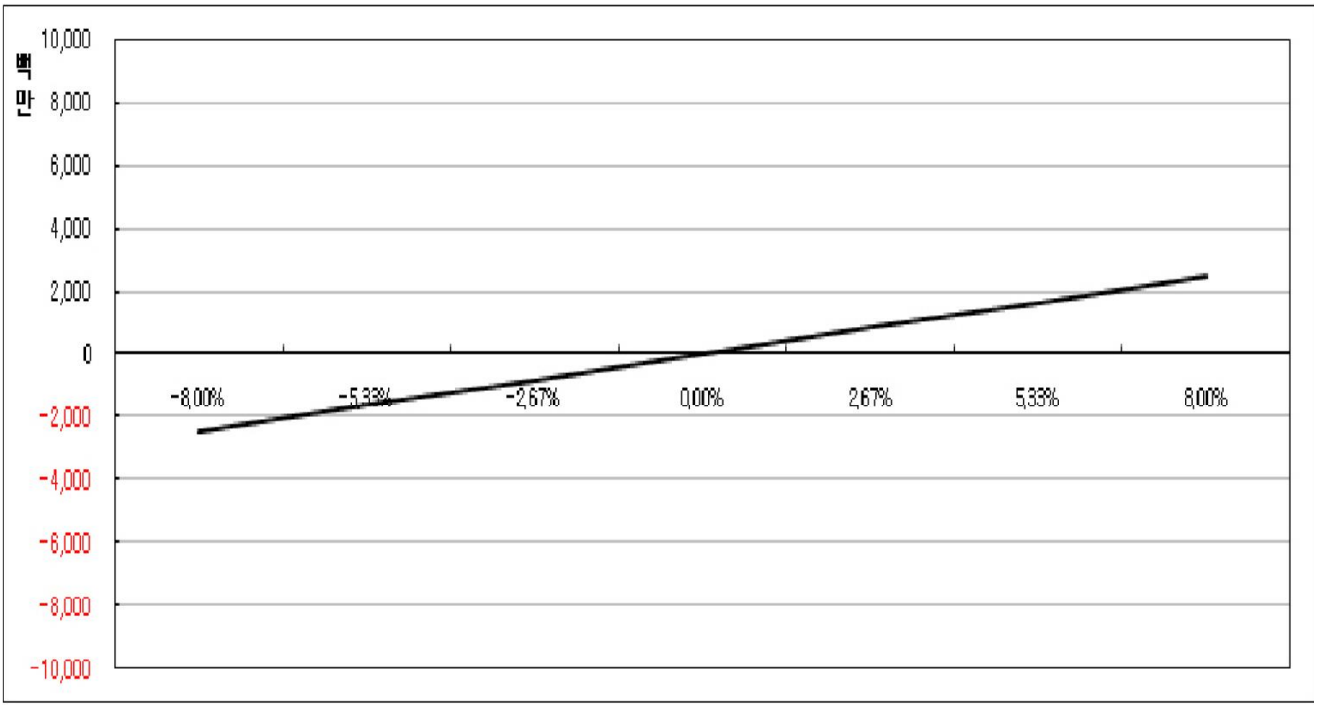
공시일: 2019-11-08

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 213 | -213 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 4,550 | 0 | 4,550 | 장내 |
| 합계 | | | 4,550 | 0 | 4,550 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

364

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

865

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

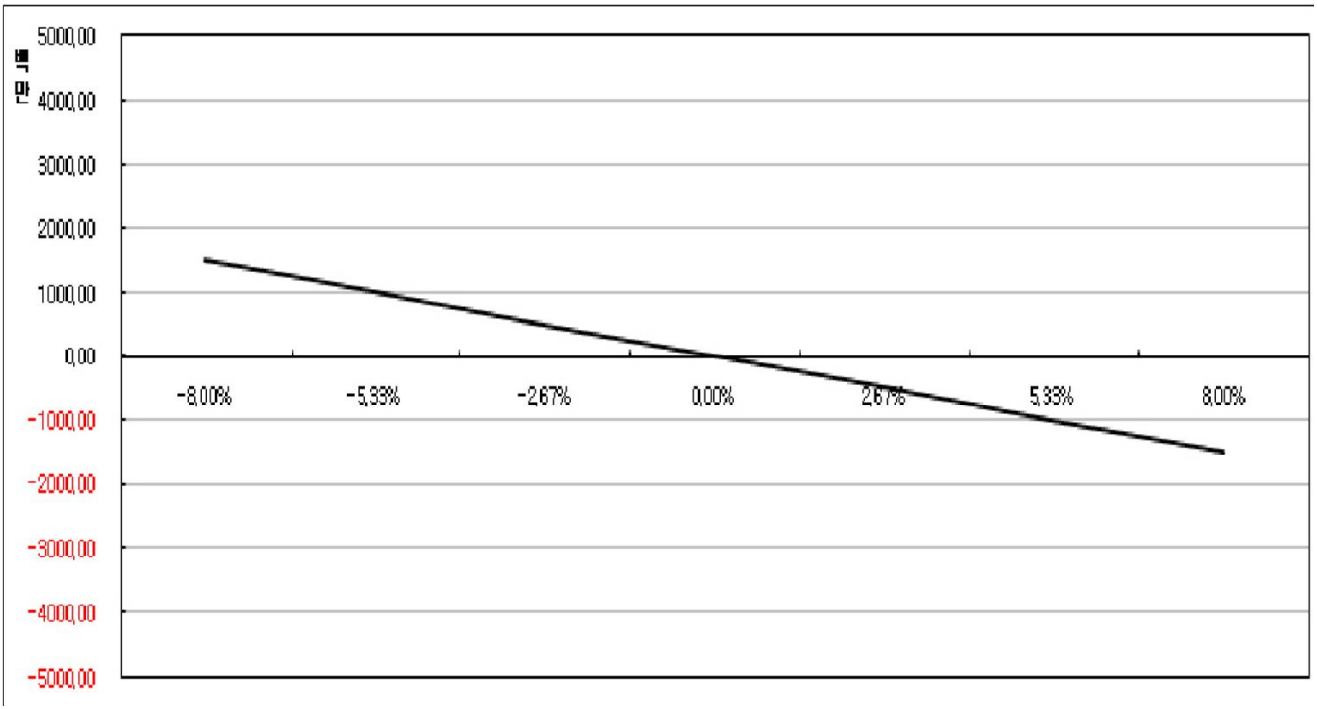
공시일: 2019-11-08

## 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 | 1,777 | -1,777 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,777 | -1,777 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

142

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

112

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

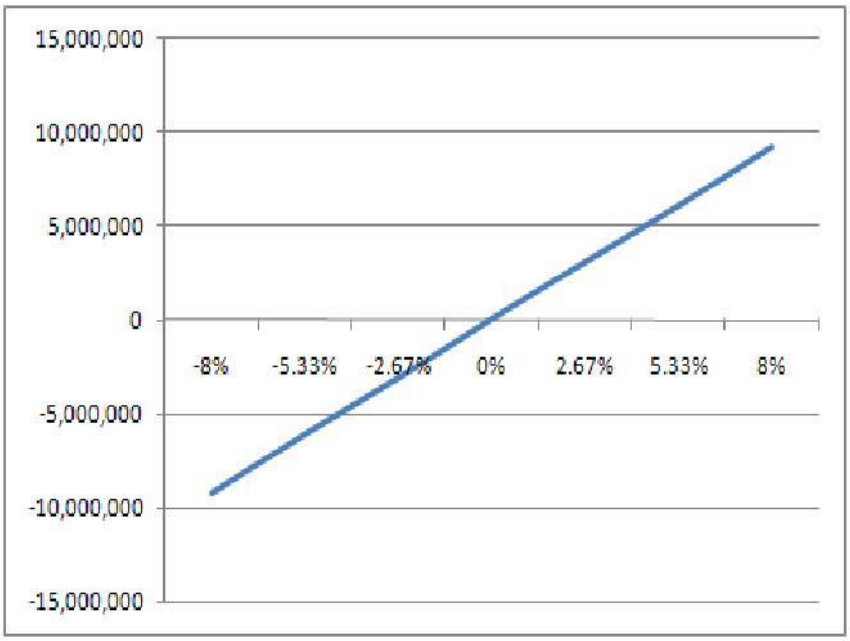
공시일: 2019-11-08

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 355 | -355 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 64,410 | 0 | 64,410 | 장내 |
| 합계 | | | 64,410 | 0 | 64,410 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,158

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,033