# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-11-27

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 70 | -70 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 1,480 | 0 | 1,480 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 4 | 2,748 | -2,744 | 장내 |
| 합계 | | | 1,484 | 2,748 | -1,264 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

166

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

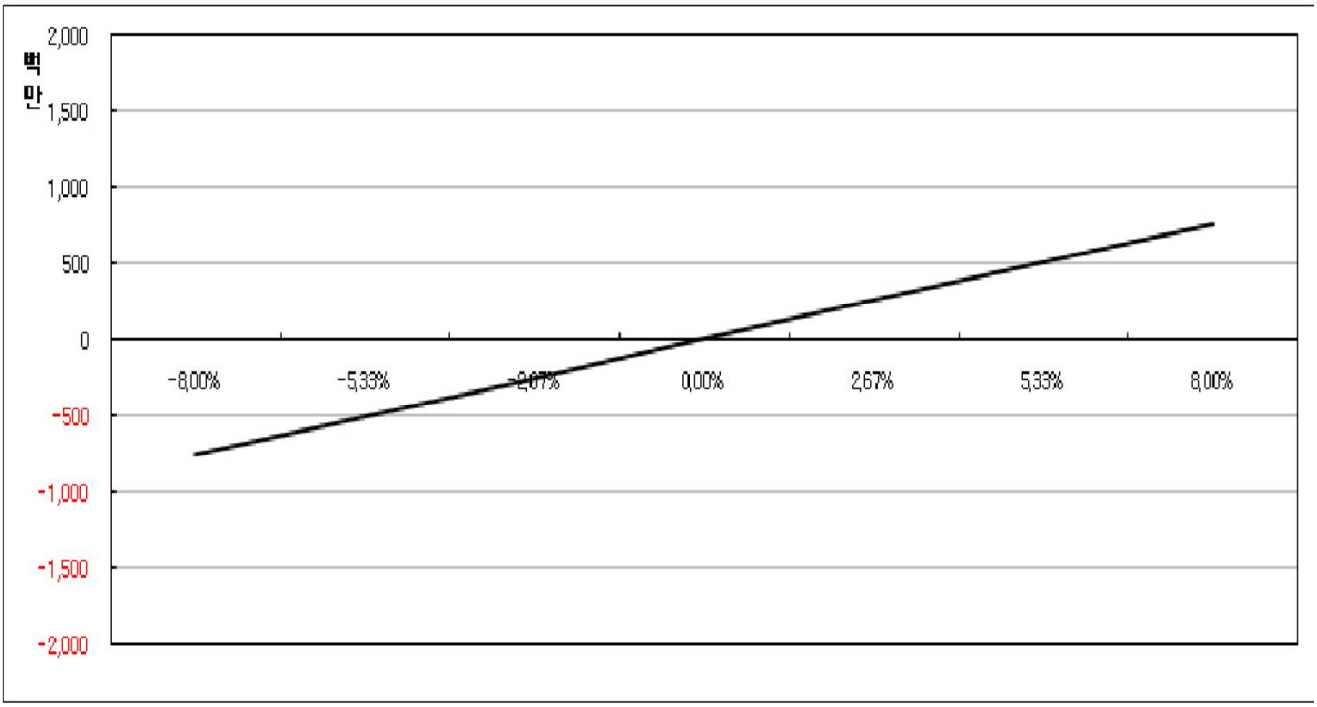
공시일: 2019-11-27

## 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 | 352 | 0 | 352 | 장내 |
| 합계 | | | 352 | 0 | 352 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

337

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

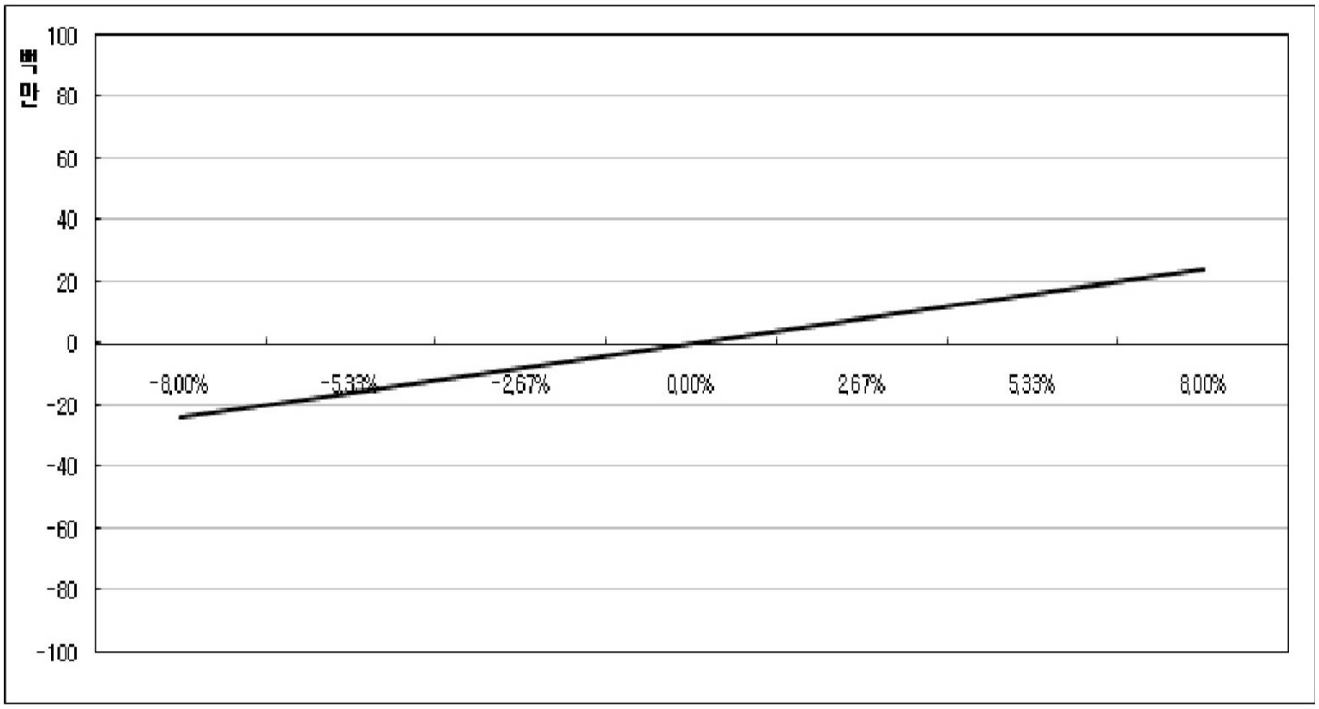
공시일: 2019-11-27

## 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 | 1,127 | 0 | 1,127 | 장내 |
| 합계 | | | 1,127 | 0 | 1,127 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

447

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

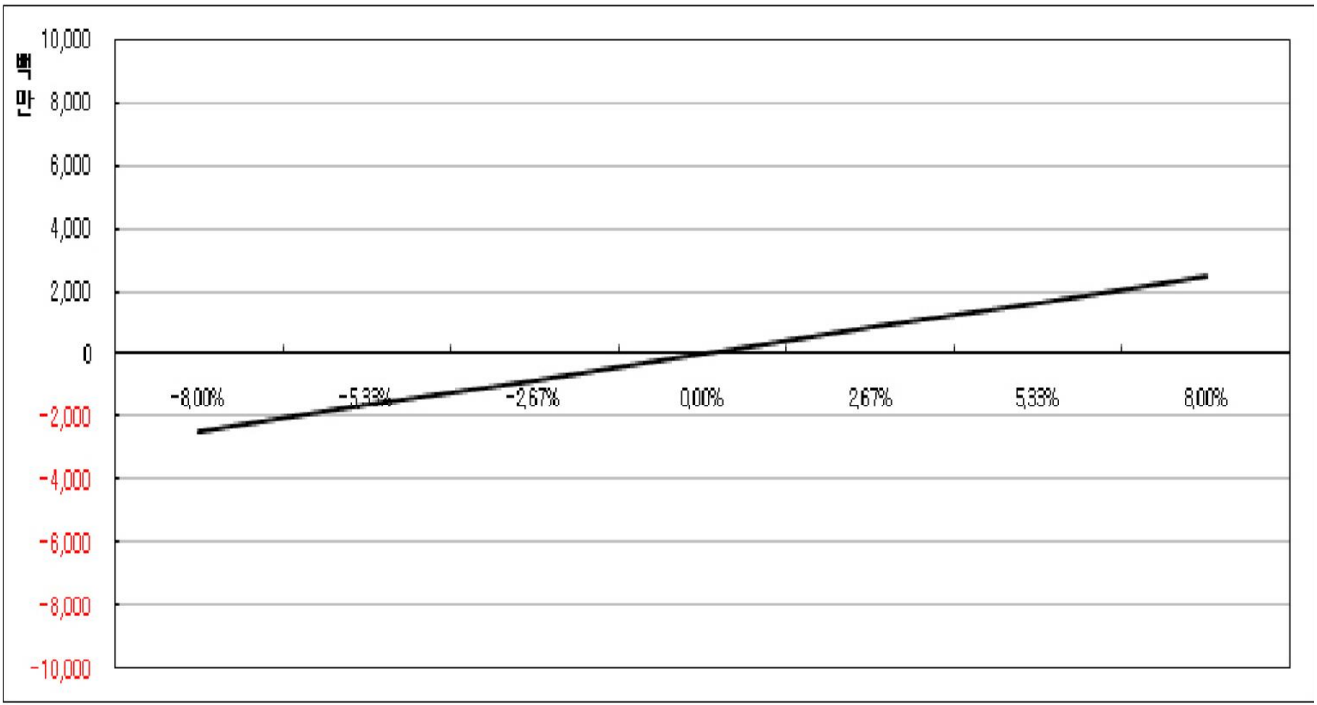
공시일: 2019-11-27

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 493 | -493 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 4,298 | 0 | 4,298 | 장내 |
| 합계 | | | 4,298 | 0 | 4,298 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

346

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

855

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

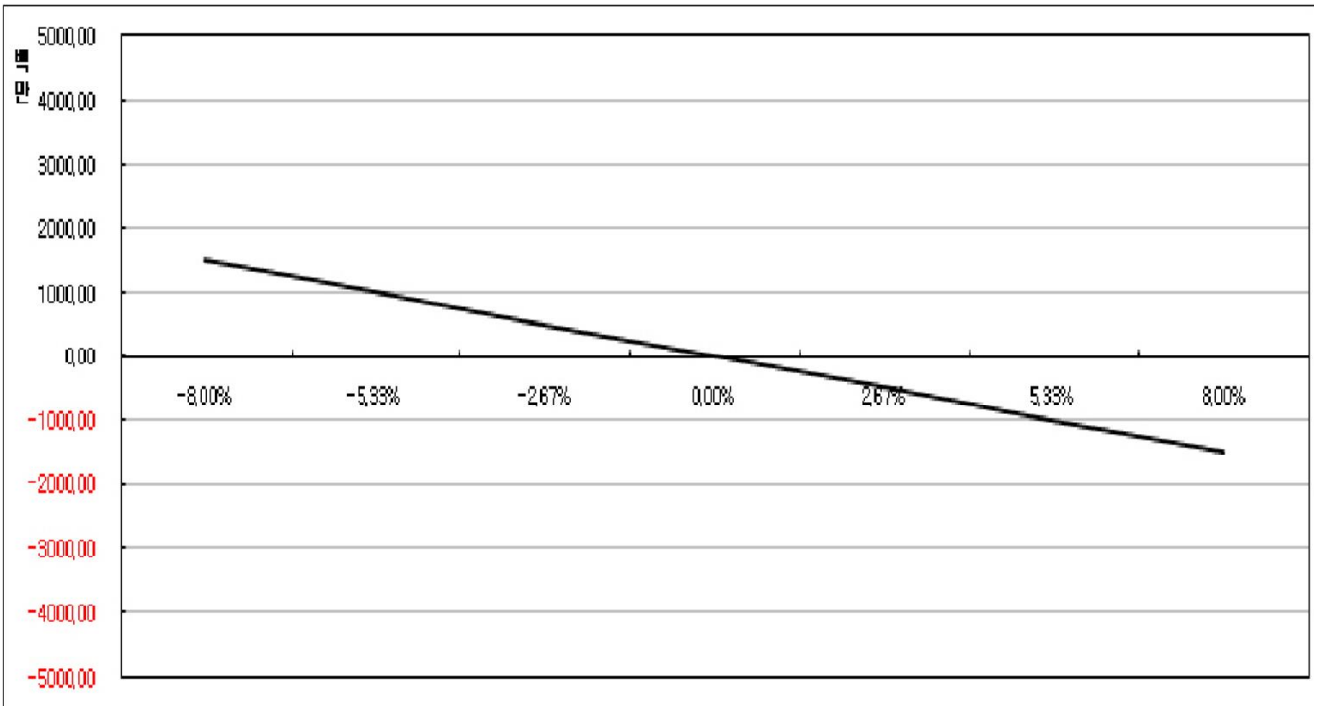
공시일: 2019-11-27

## 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 | 1,761 | -1,761 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,761 | -1,761 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

142

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

113

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

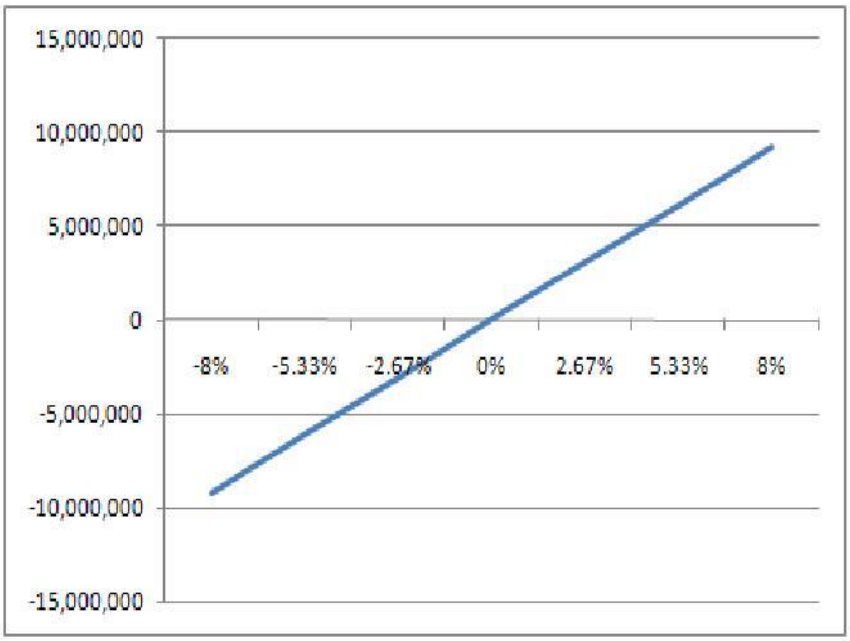
공시일: 2019-11-27

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 493 | -493 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 69,823 | 0 | 69,823 | 장내 |
| 합계 | | | 69,823 | 0 | 69,823 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,613

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,393