# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2019-12-04

## 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 | 1,450 | 0 | 1,450 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 3 | 0 | 3 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 9 | 0 | 9 | 장내 |
| 합계 | | | 1,459 | 0 | 1,459 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

31

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

140

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

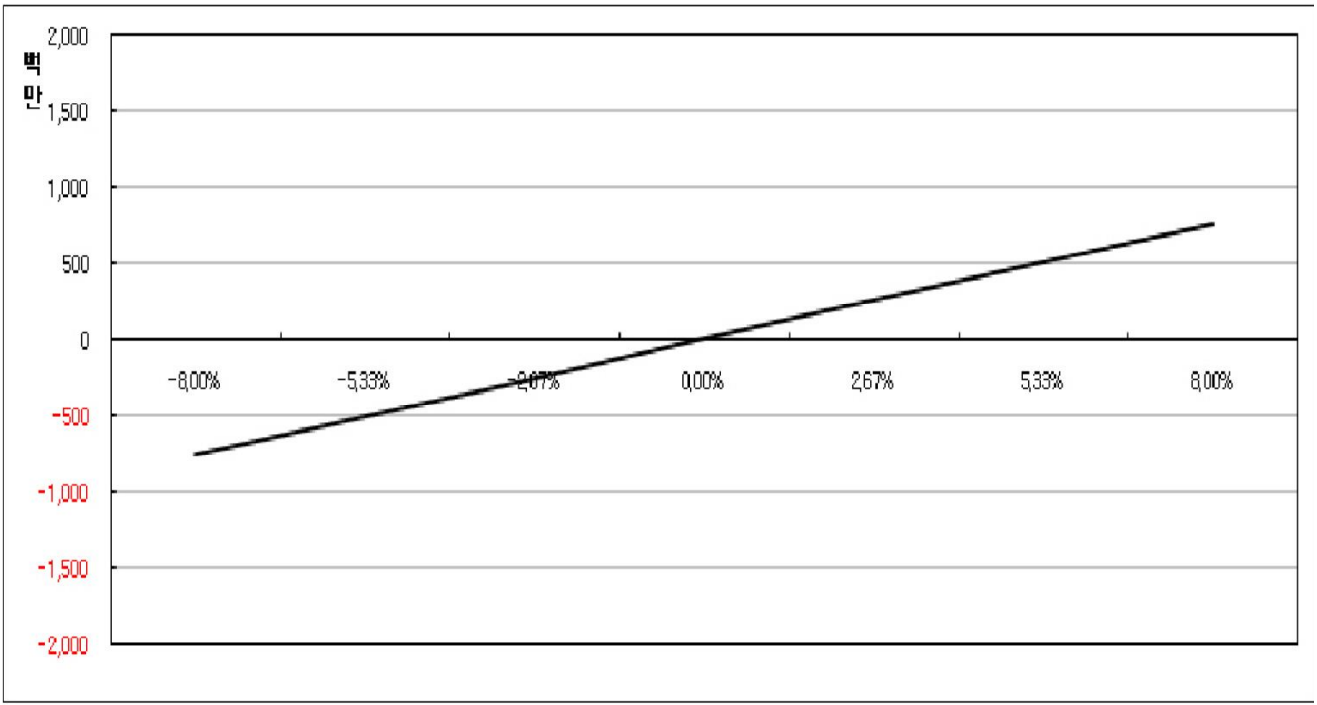
공시일: 2019-12-04

## 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 | 345 | 0 | 345 | 장내 |
| 합계 | | | 345 | 0 | 345 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

329

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

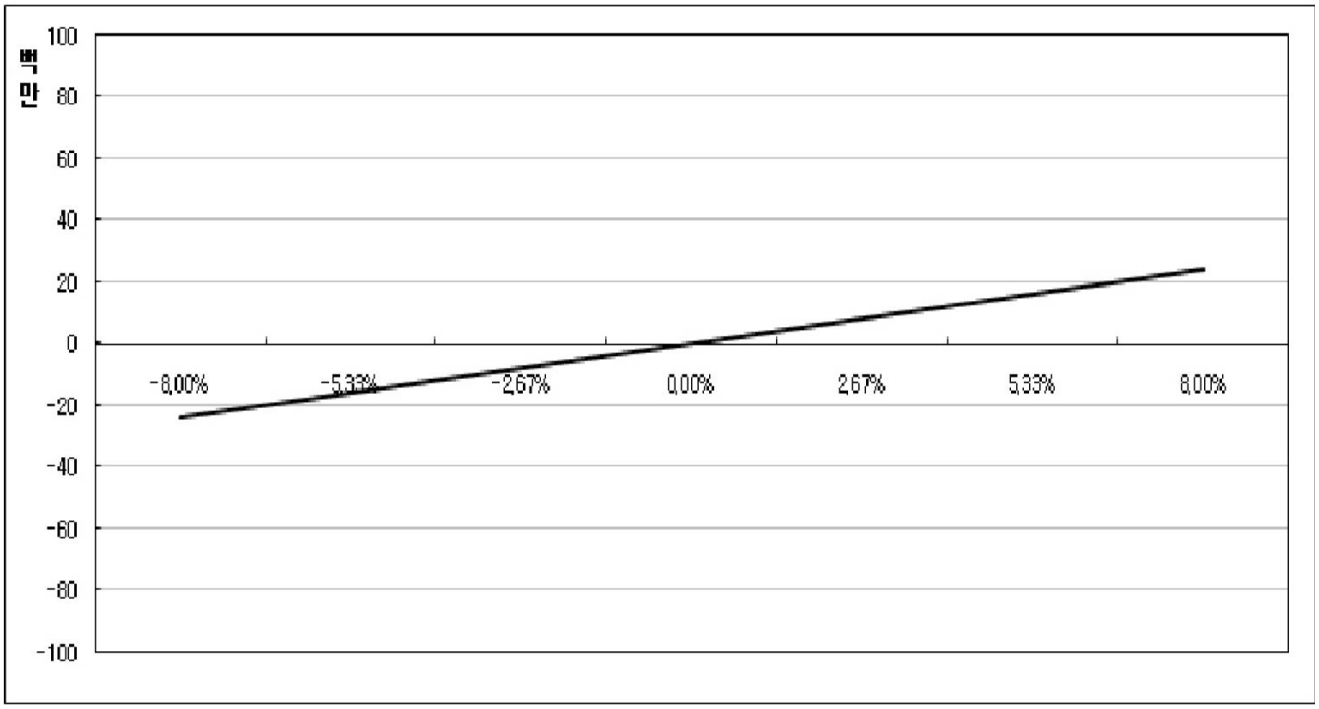
공시일: 2019-12-04

## 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 | 1,105 | 0 | 1,105 | 장내 |
| 합계 | | | 1,105 | 0 | 1,105 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

433

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

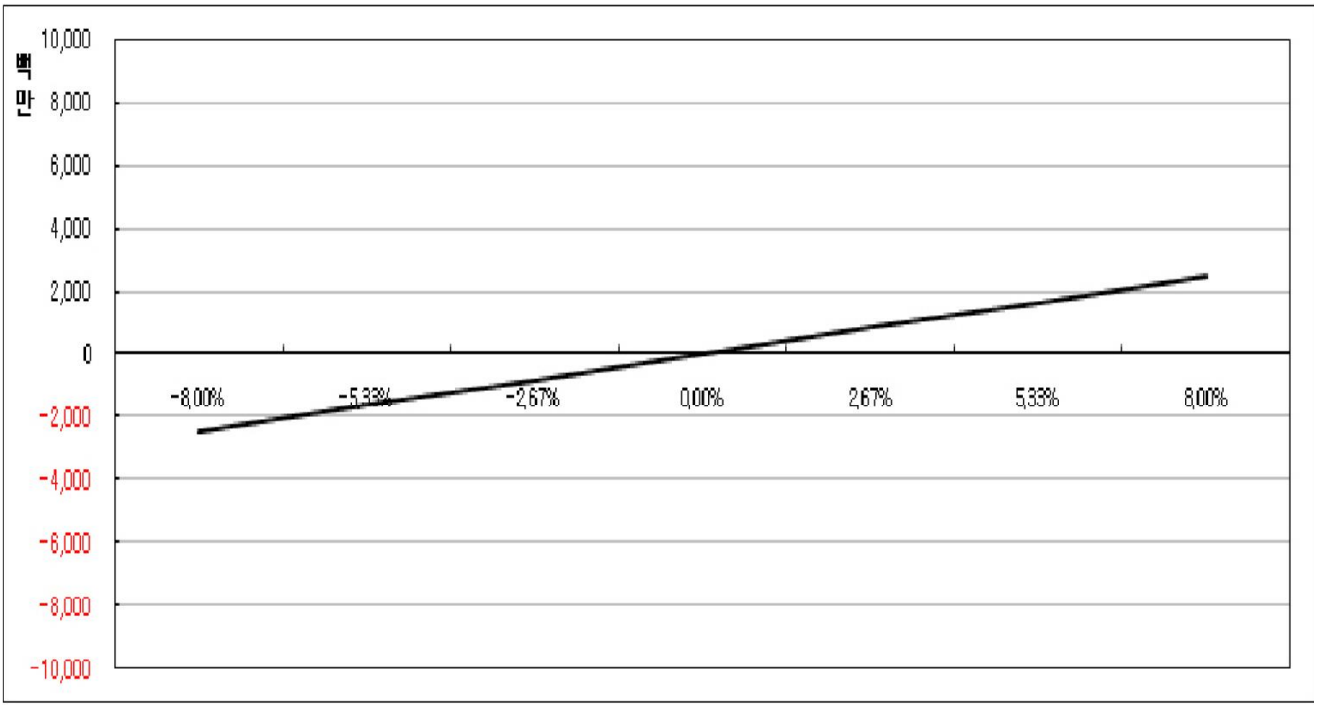
공시일: 2019-12-04

## 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 | 4,350 | 0 | 4,350 | 장내 |
| 합계 | | | 4,350 | 0 | 4,350 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

348

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

836

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

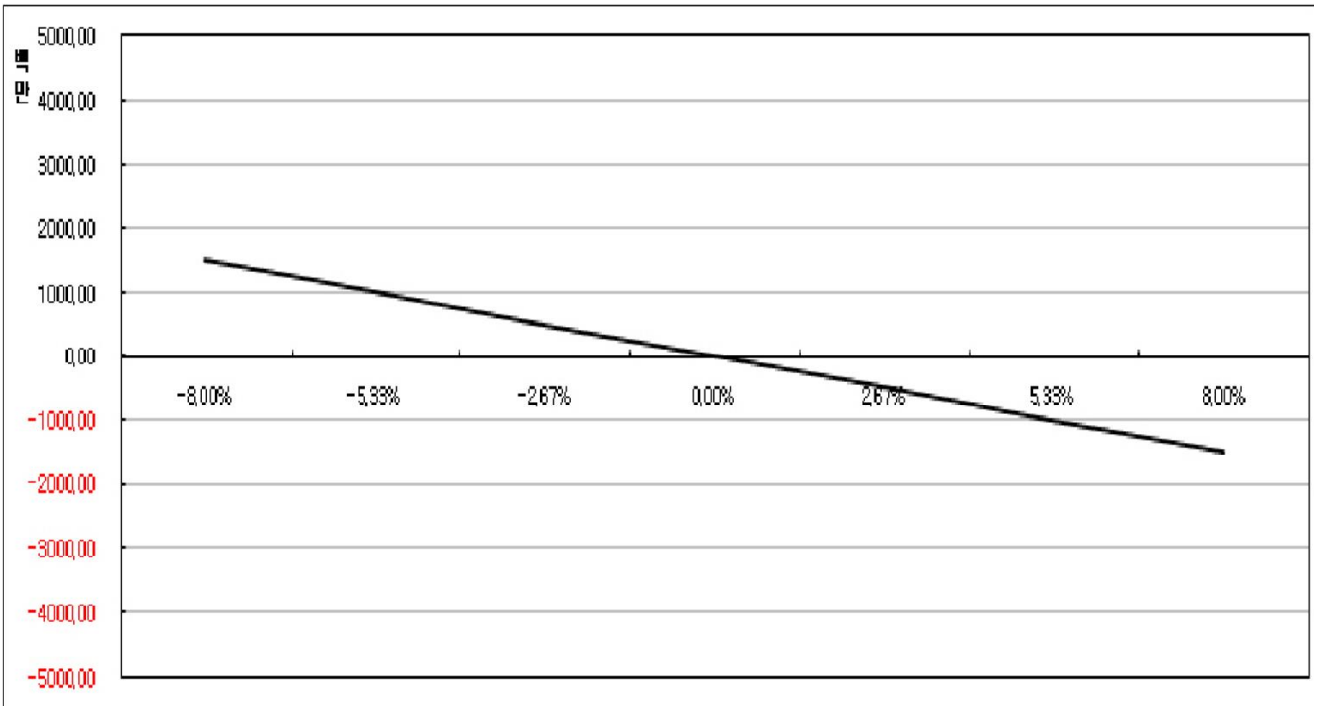
공시일: 2019-12-04

## 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 | 1,933 | -1,933 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,933 | -1,933 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

155

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

122

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

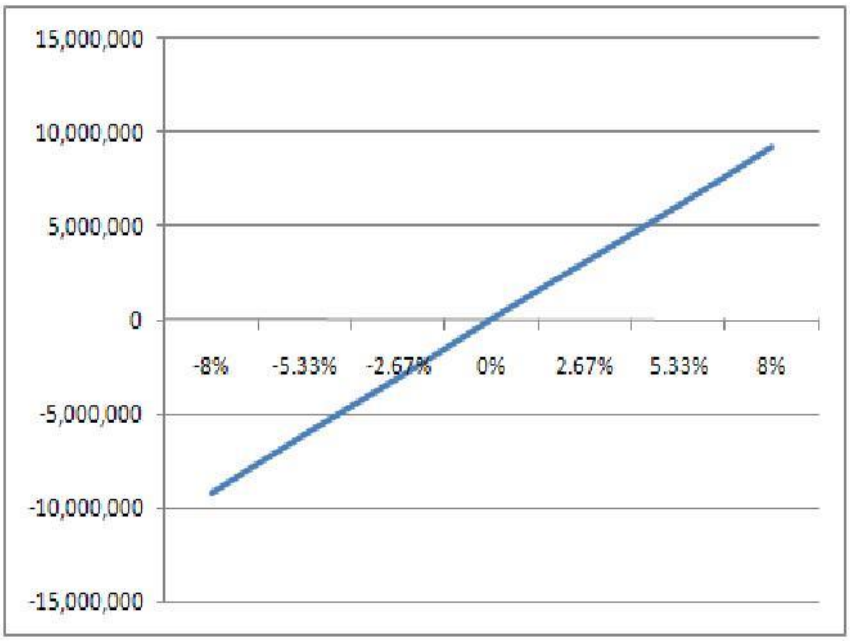
공시일: 2019-12-04

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 483 | 0 | 483 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 68,840 | 0 | 68,840 | 장내 |
| 합계 | | | 68,840 | 0 | 68,840 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,508

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,175