# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-01-29

## 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 | 1,391 | 0 | 1,391 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 7 | 2,635 | -2,628 | 장내 |
| 합계 | | | 1,398 | 2,635 | -1,237 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

66

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

153

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

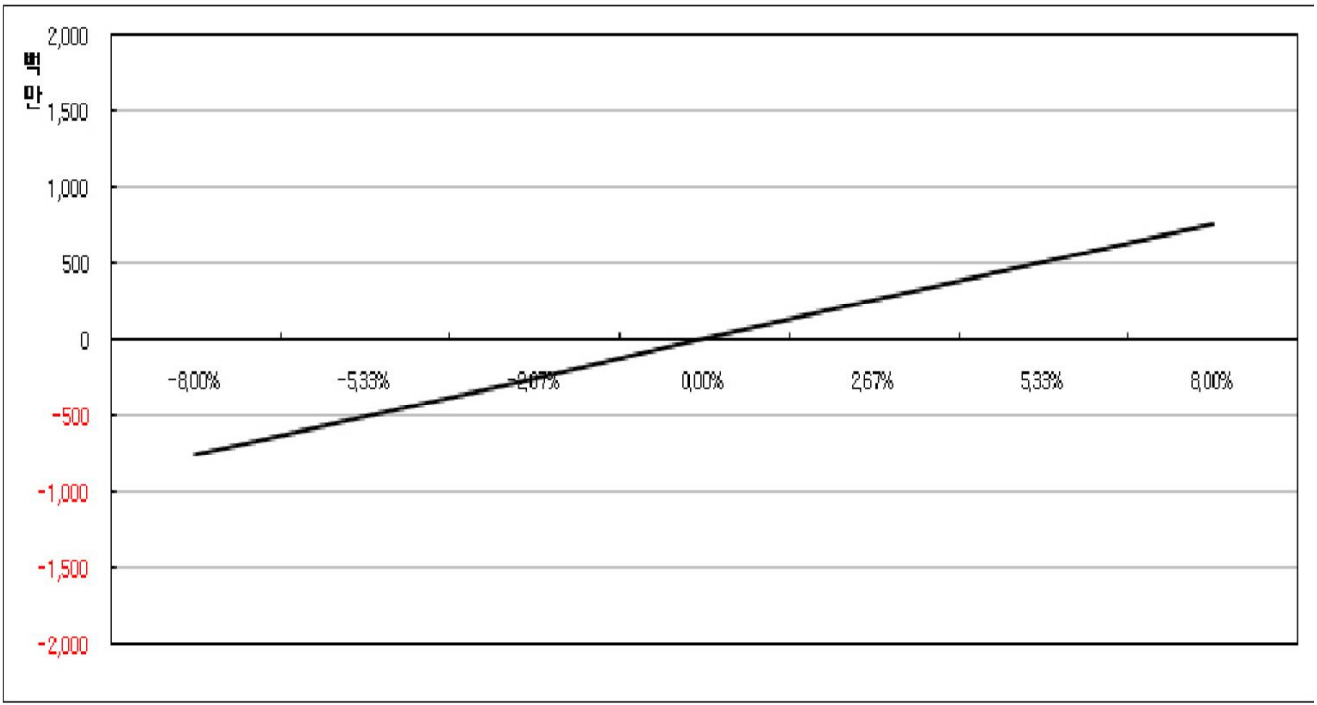
공시일: 2020-01-29

## 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 | 293 | 0 | 293 | 장내 |
| 합계 | | | 293 | 0 | 293 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

365

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

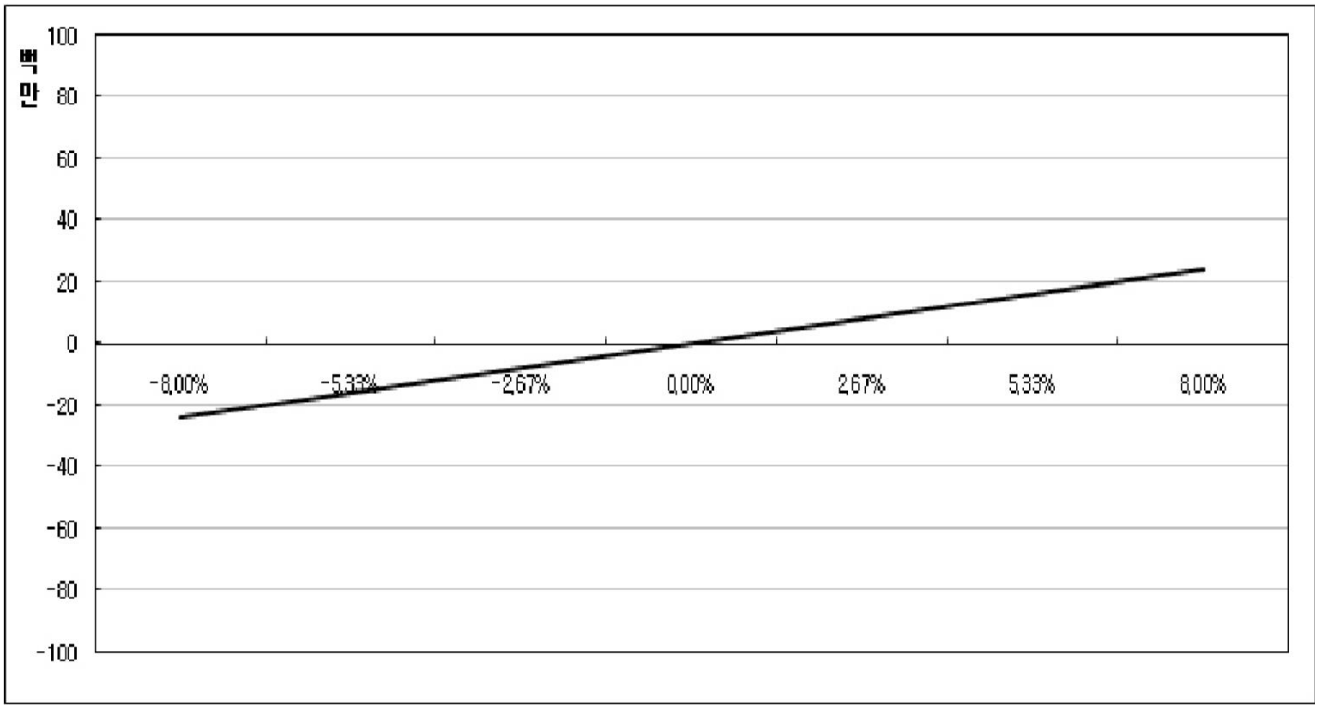
공시일: 2020-01-29

## 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 | 1,317 | 0 | 1,317 | 장내 |
| 합계 | | | 1,317 | 0 | 1,317 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

491

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

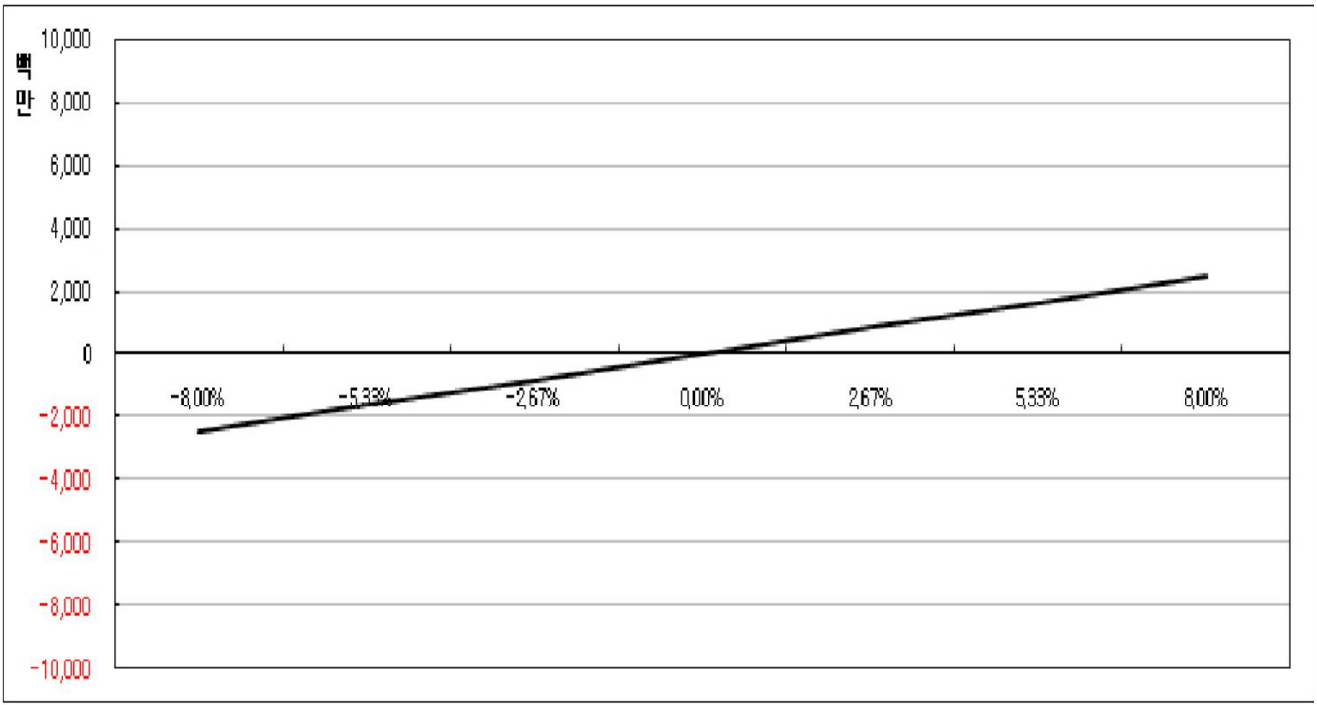
공시일: 2020-01-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 146 | 146 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 3,001 | 0 | 3,001 | 장내 |
| 합계 | | | 3,001 | 0 | 3,001 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

240

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

852

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

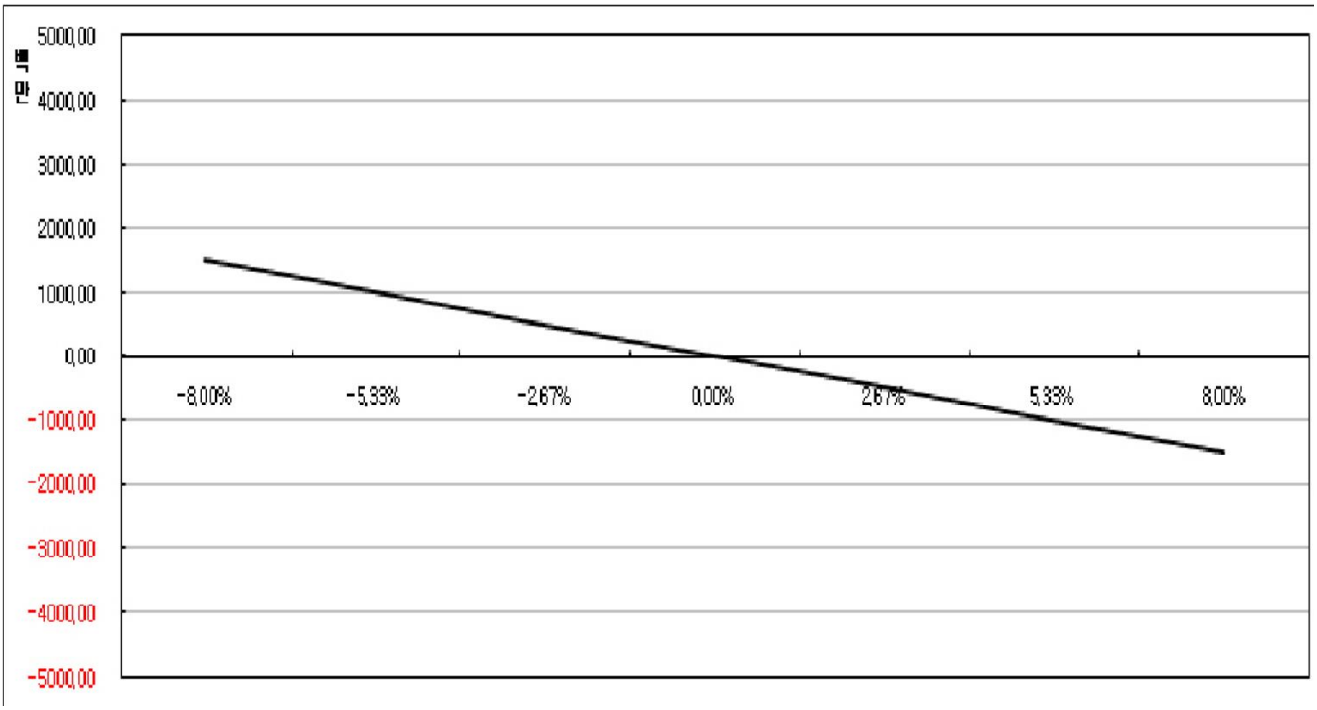
공시일: 2020-01-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 73 | -73 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 2,342 | -2,342 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 2,342 | -2,342 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

188

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

150

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

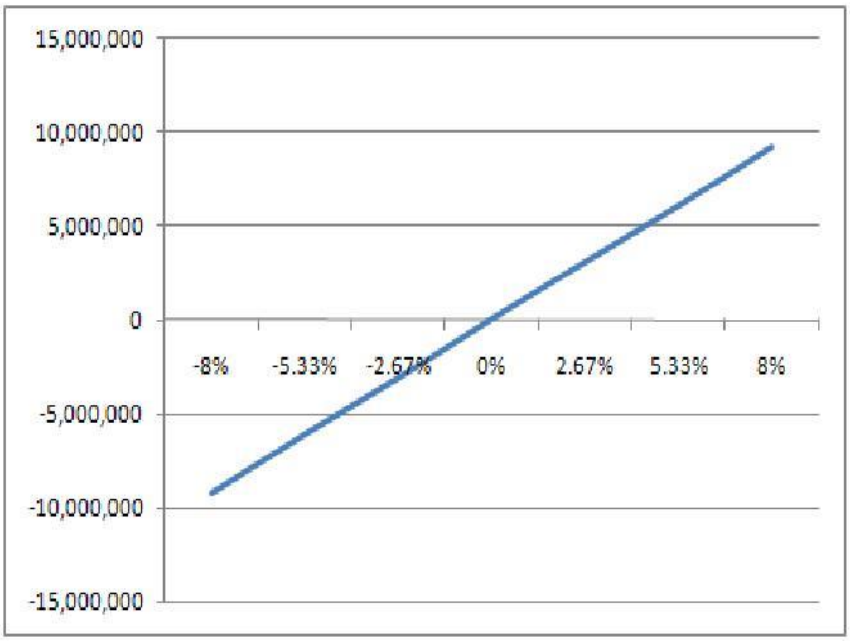
공시일: 2020-01-29

## 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 | 57,676 | 0 | 57,676 | 장내 |
| 합계 | | | 57,676 | 0 | 57,676 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,618

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,637