# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-02-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 74 | -74 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 1,335 | 0 | 1,335 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 2 | 0 | 2 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 9 | 2,447 | -2,438 | 장내 |
| 합계 | | | 1,344 | 2,447 | -1,103 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 39 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 103 |
|---|---|

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

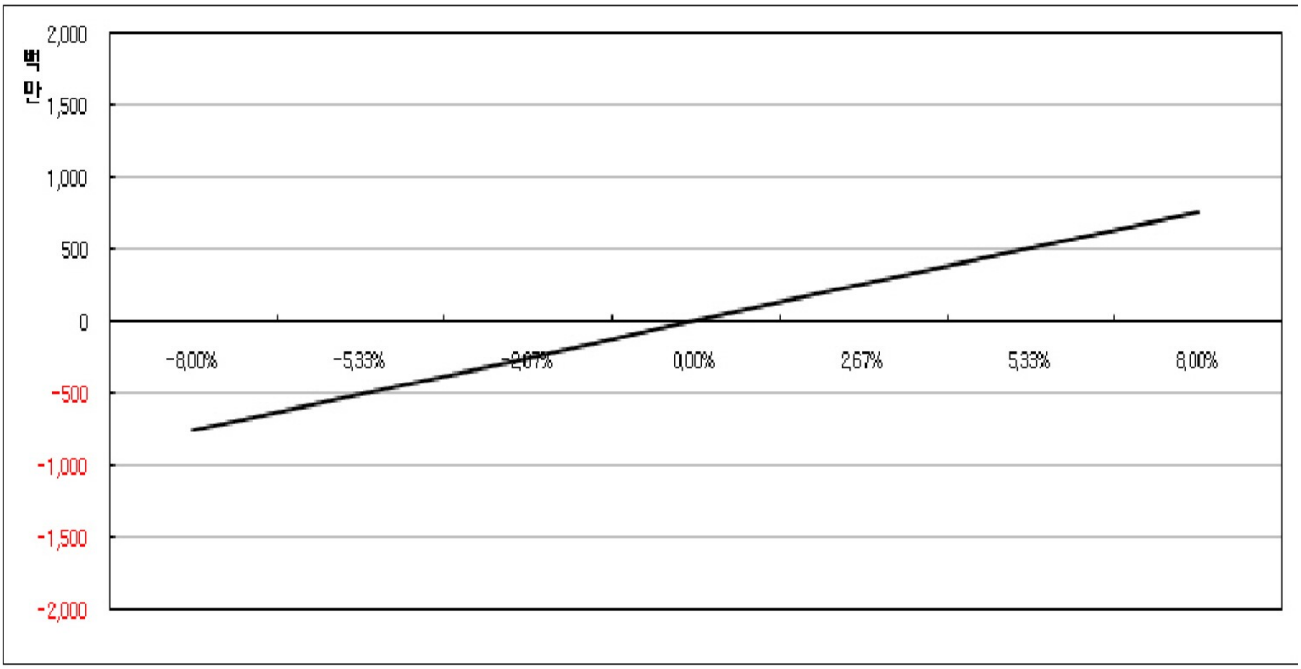
공시일: 2020-02-21

## 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 | 445 | 0 | 445 | 장내 |
| 합계 | | | 445 | 0 | 445 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

376

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

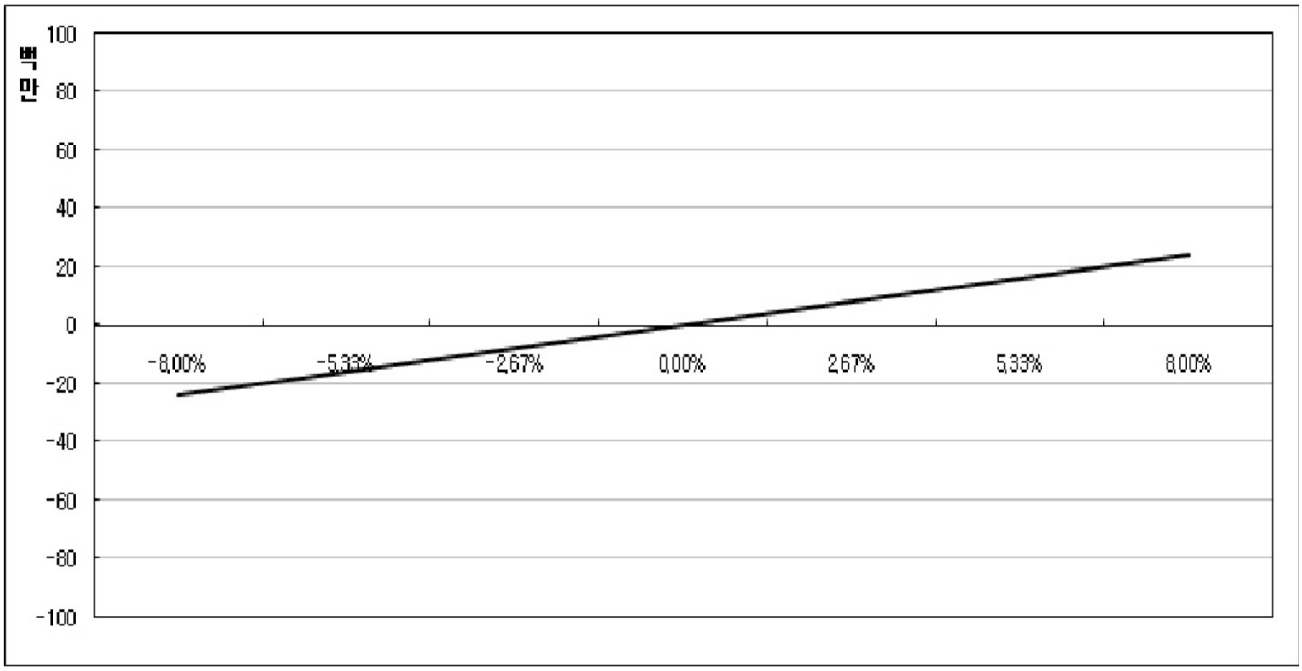
공시일: 2020-02-21

## 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 | 1,335 | 0 | 1,335 | 장내 |
| 합계 | | | 1,335 | 0 | 1,335 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

517

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

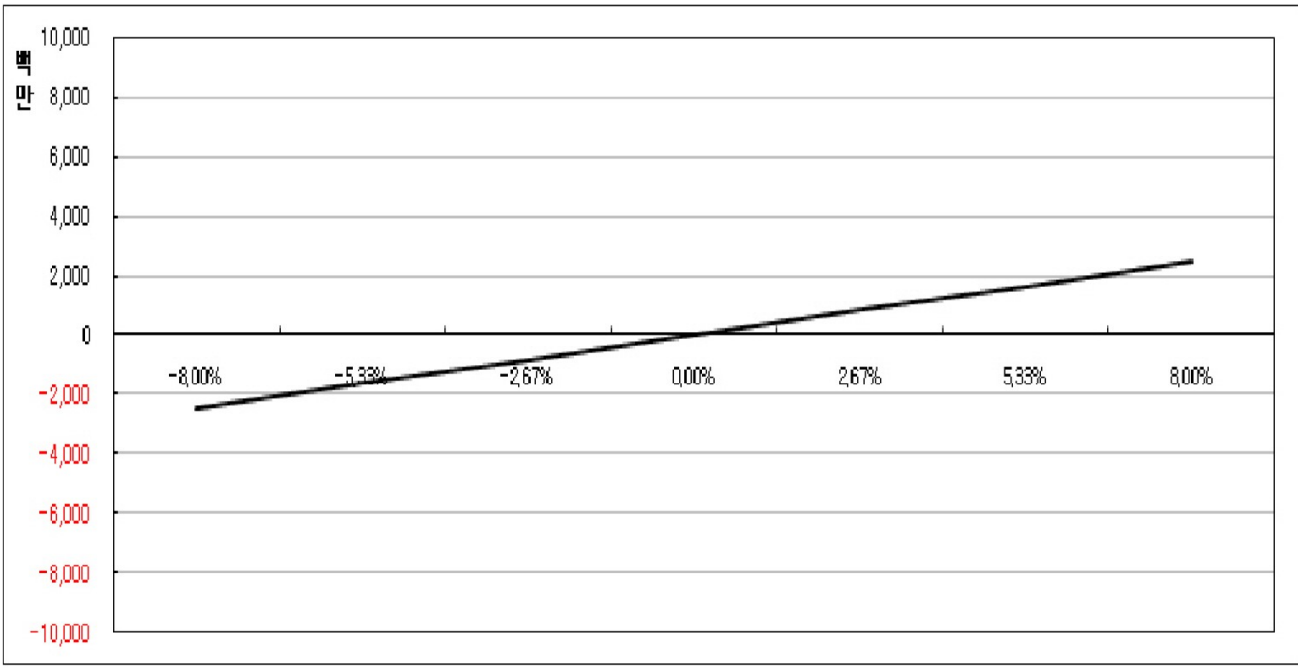
공시일: 2020-02-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 148 | 74 | 74 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 3,560 | 0 | 3,560 | 장내 |
| 합계 | | | 3,560 | 0 | 3,560 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

286

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

919

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

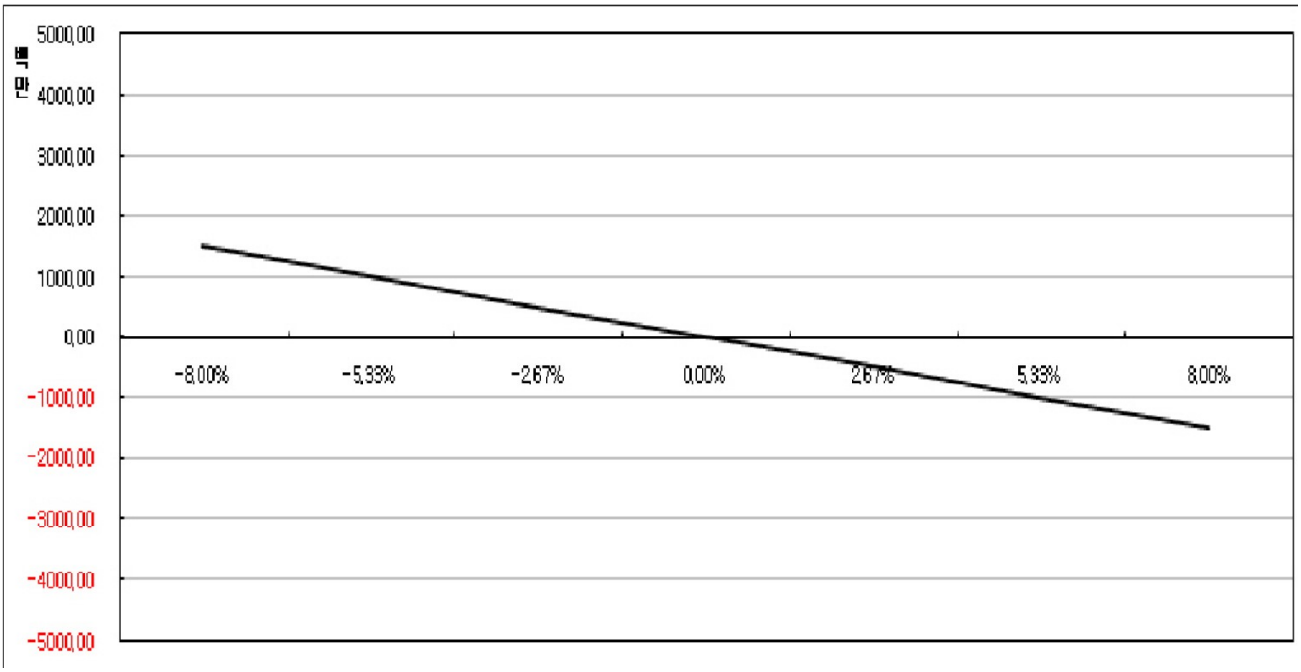
공시일: 2020-02-21

## 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 | 1,780 | -1,780 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,780 | -1,780 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

143

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

118

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

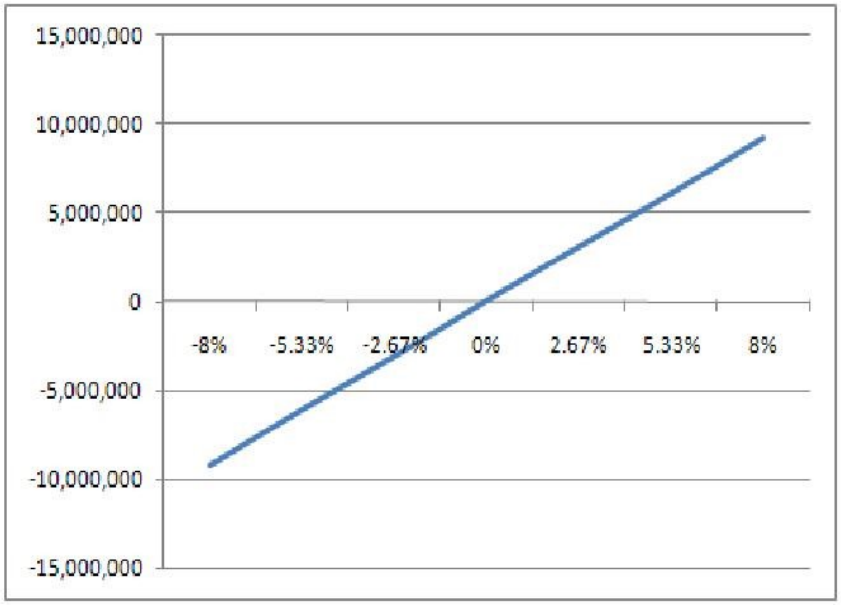
공시일: 2020-02-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 1,187 | 0 | 1,187 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 68,230 | 0 | 68,230 | 장내 |
| 합계 | | | 68,230 | 0 | 68,230 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,472

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,390