# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-03-26

## 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 | 990 | 0 | 990 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 28 | 1,863 | -1,836 | 장내 |
| 합계 | | | 1,017 | 1,863 | -846 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

133

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

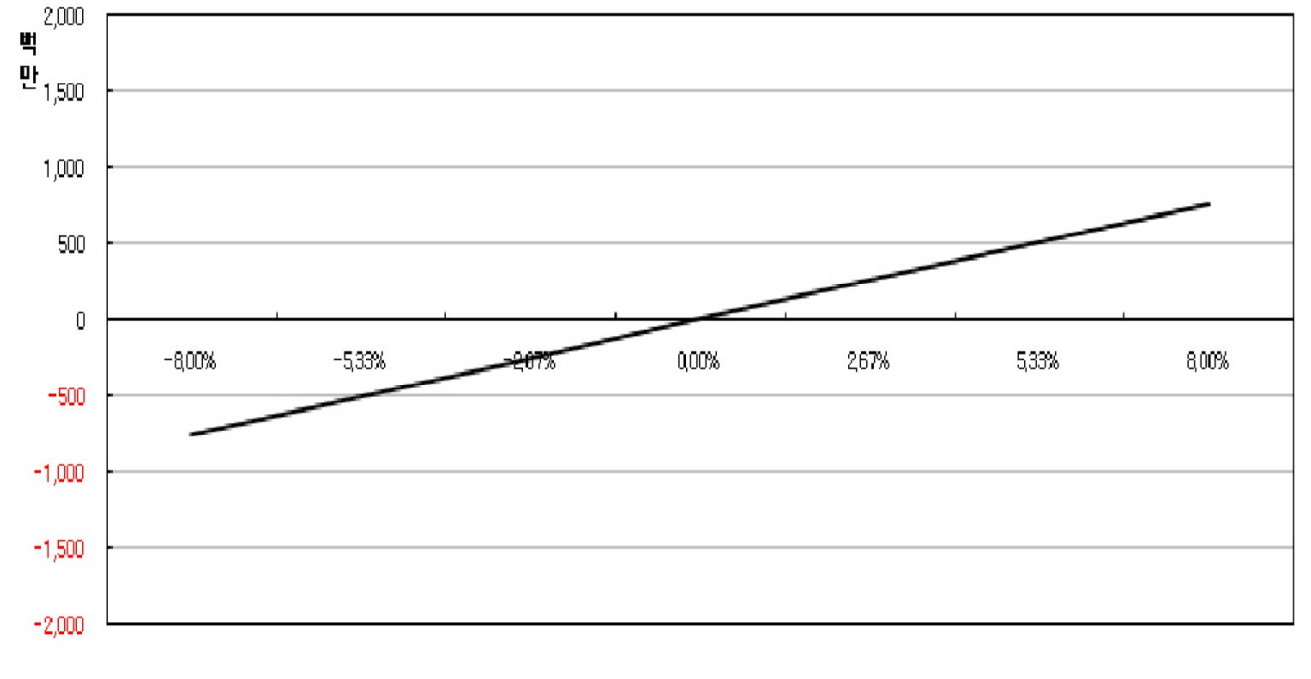
공시일: 2020-03-26

## 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 | 932 | 0 | 932 | 장내 |
| 합계 | | | 932 | 0 | 932 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

74

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

486

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

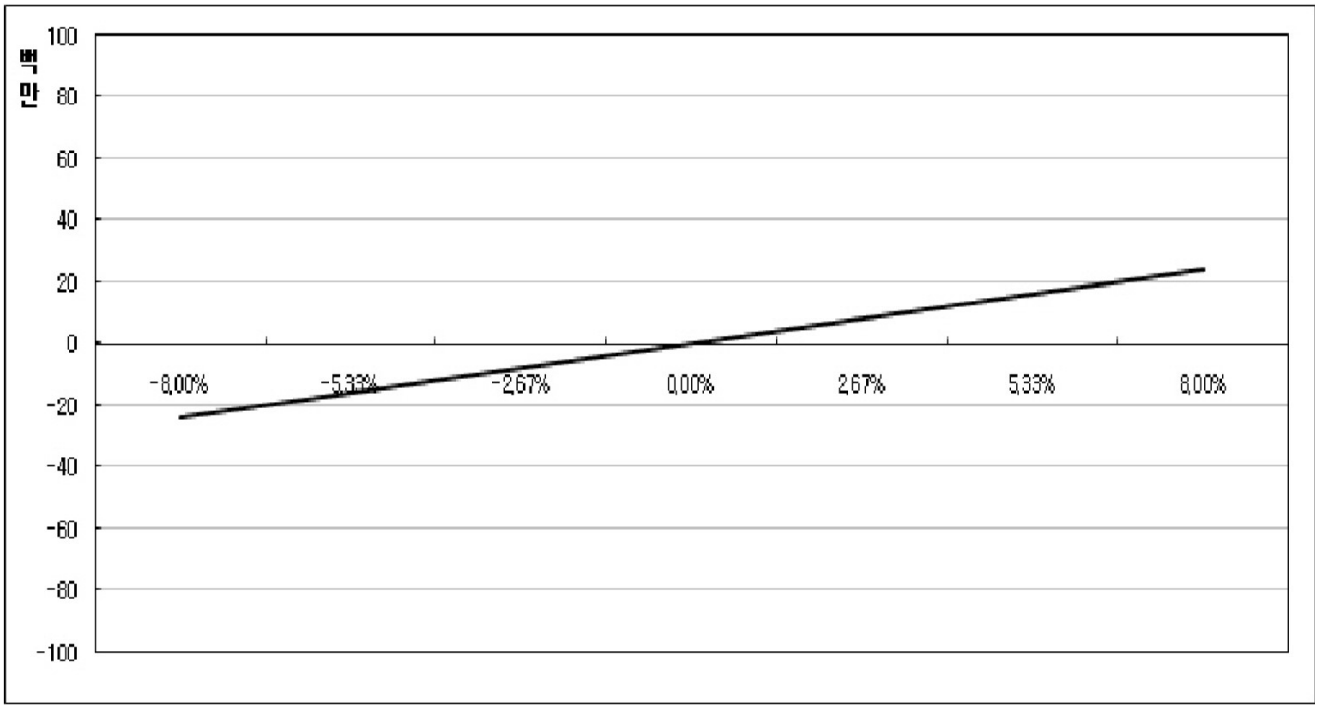
공시일: 2020-03-26

## 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 | 1,747 | 0 | 1,747 | 장내 |
| 합계 | | | 1,747 | 0 | 1,747 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

140

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

763

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

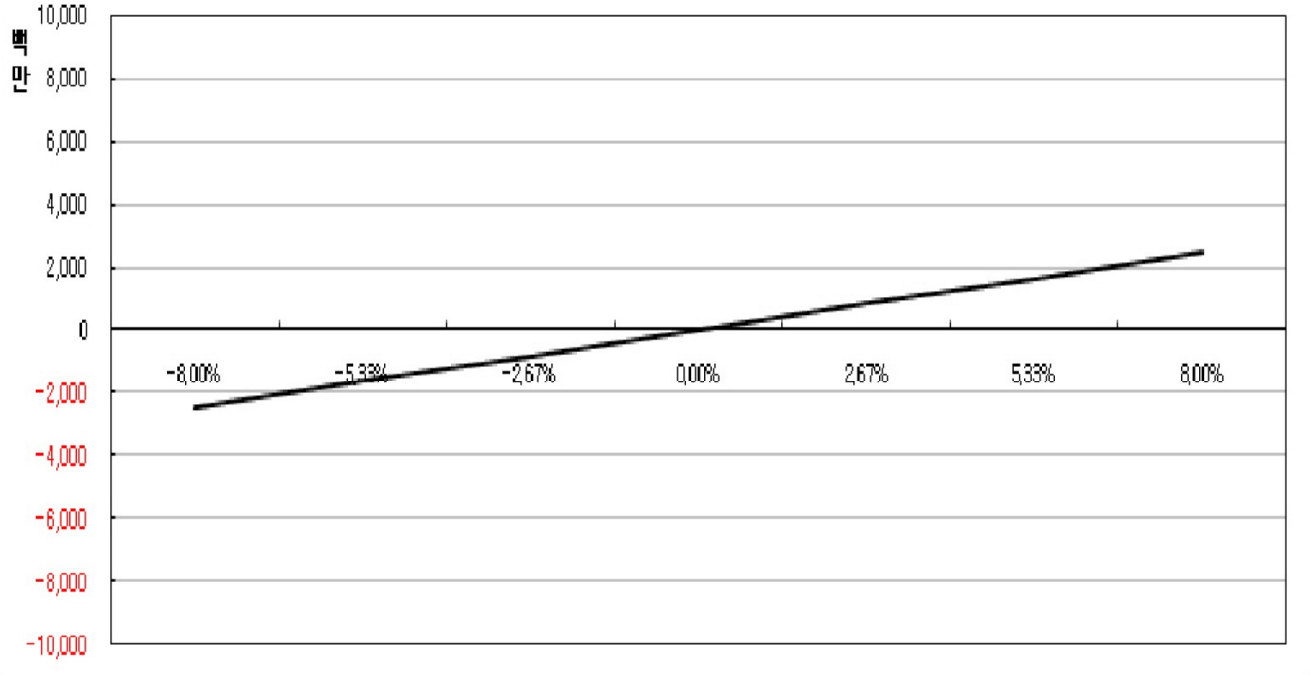
공시일: 2020-03-26

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 175 | -175 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 7,452 | 0 | 7,452 | 장내 |
| 합계 | | | 7,452 | 0 | 7,452 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

595

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,514

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

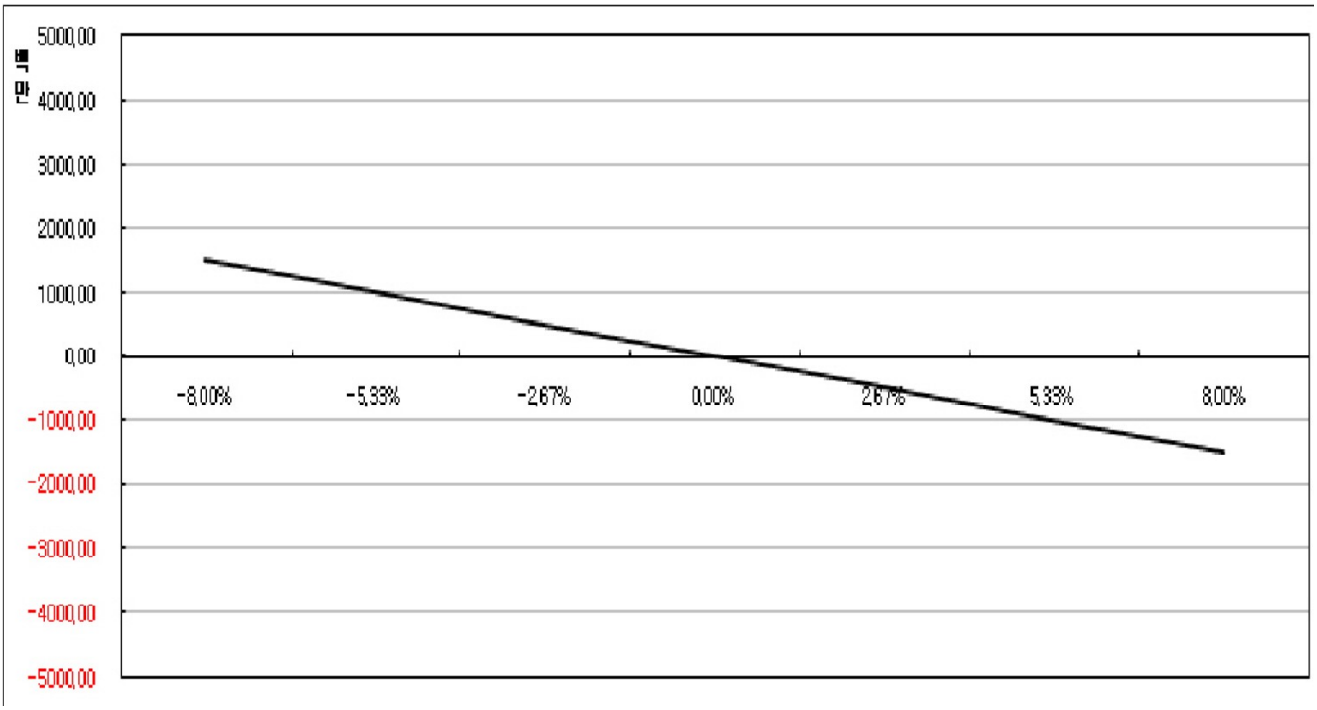
공시일: 2020-03-26

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 116 | 0 | 116 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 1,514 | -1,514 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,514 | -1,514 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

121

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

170

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

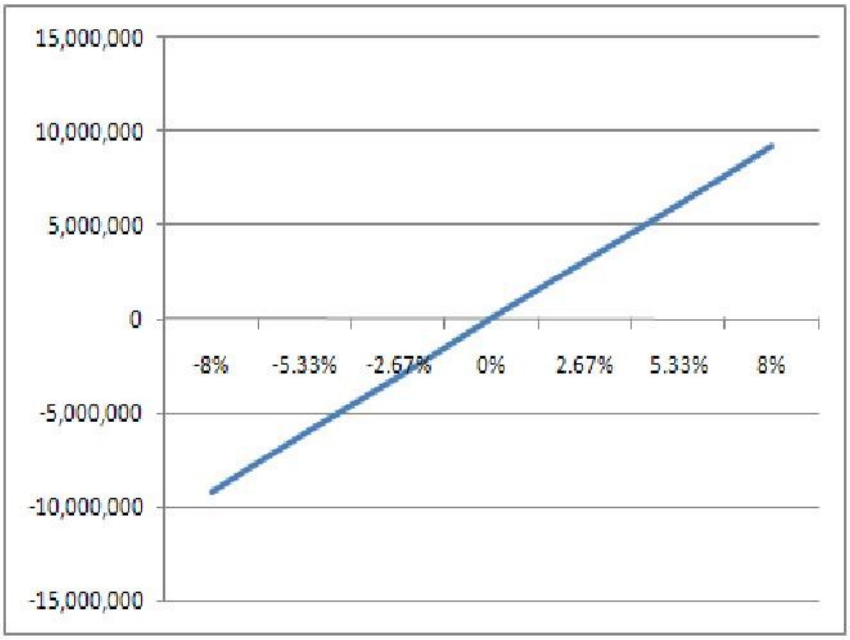
공시일: 2020-03-26

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 408 | 0 | 408 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 70,100 | 0 | 70,100 | 장내 |
| 합계 | | | 70,100 | 0 | 70,100 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,599

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13,360