# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-04-17

## 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 | 1,050 | 0 | 1,050 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 8 | 1,977 | -1,969 | 장내 |
| 합계 | | | 1,058 | 1,977 | -919 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 37 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 582 |
|---|---|

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

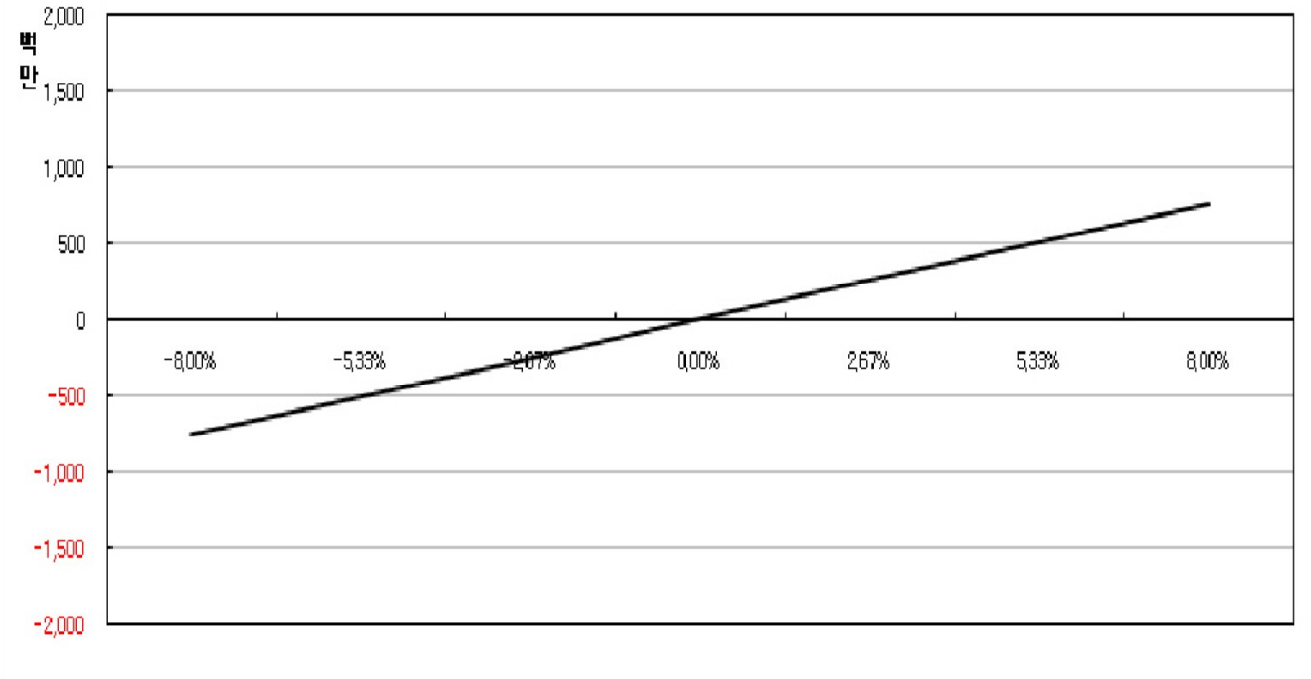
공시일: 2020-04-17

## 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 | 988 | 0 | 988 | 장내 |
| 합계 | | | 988 | 0 | 988 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

79

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

541

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

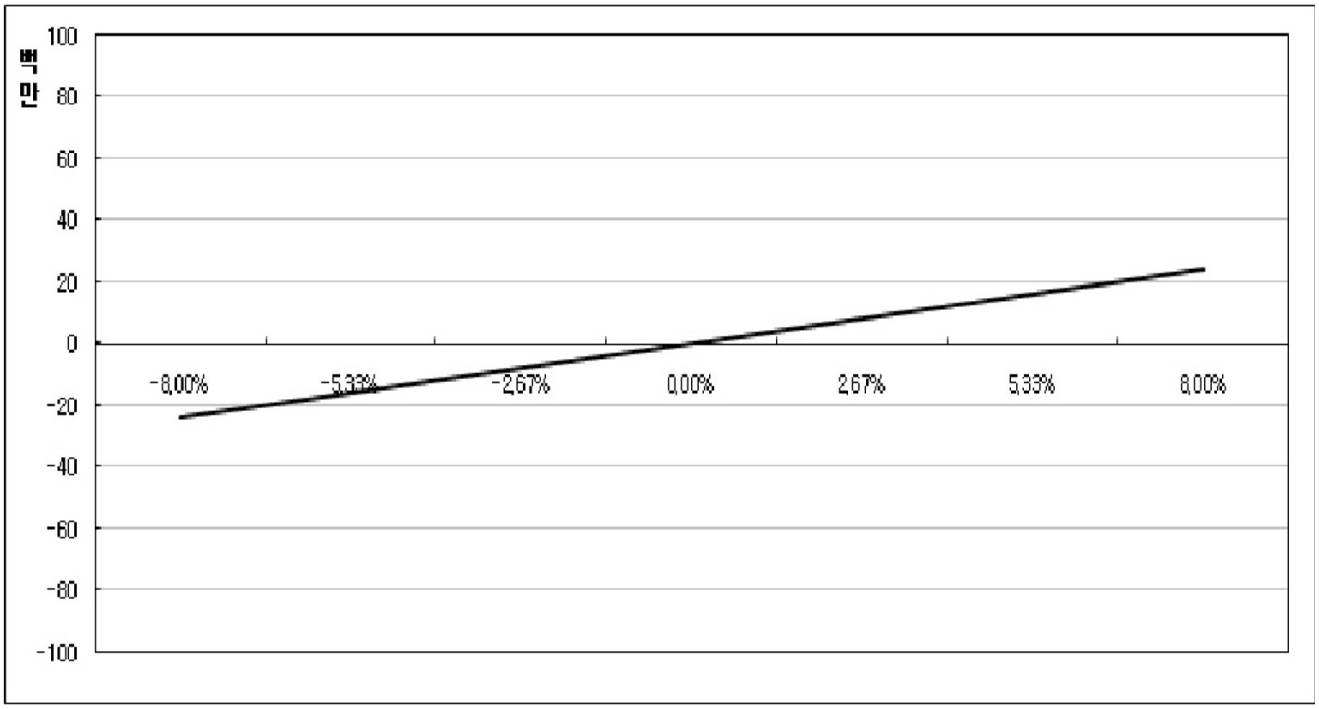
공시일: 2020-04-17

## 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 | 2,595 | 0 | 2,595 | 장내 |
| 합계 | | | 2,595 | 0 | 2,595 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

208

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

870

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

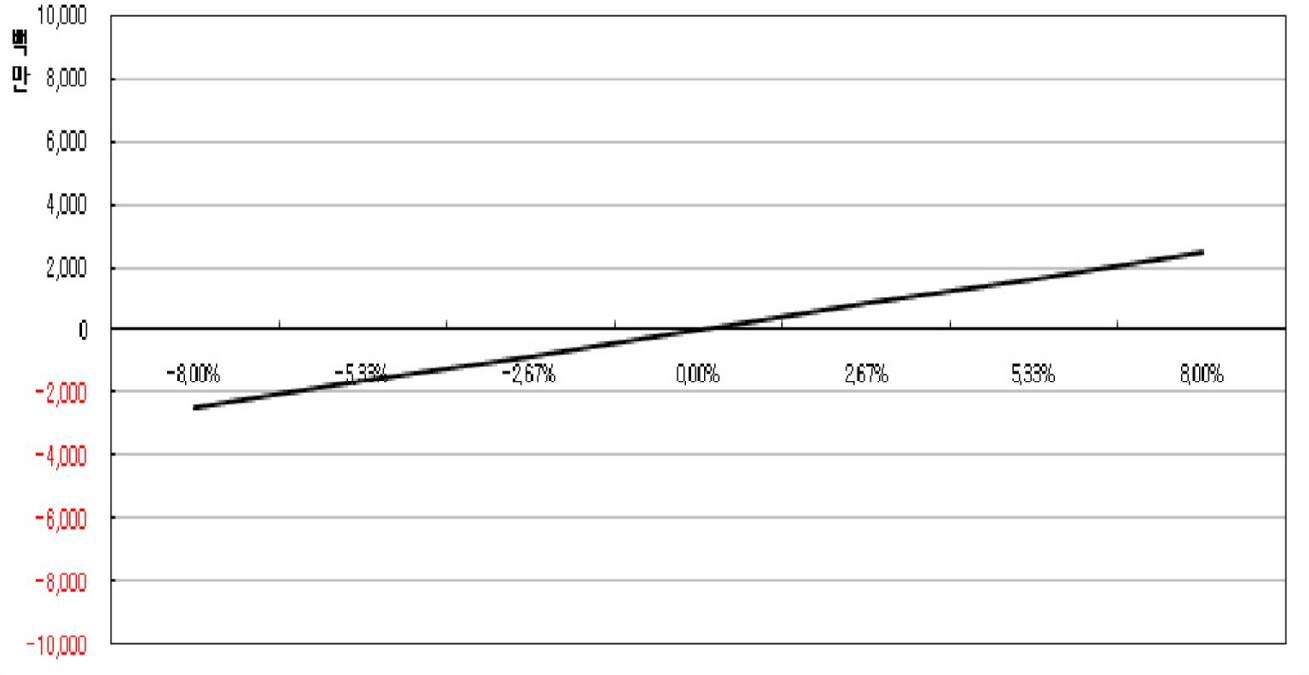
공시일: 2020-04-17

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 371 | 0 | 371 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 8,896 | 0 | 8,896 | 장내 |
| 합계 | | | 8,896 | 0 | 8,896 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

712

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,678

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

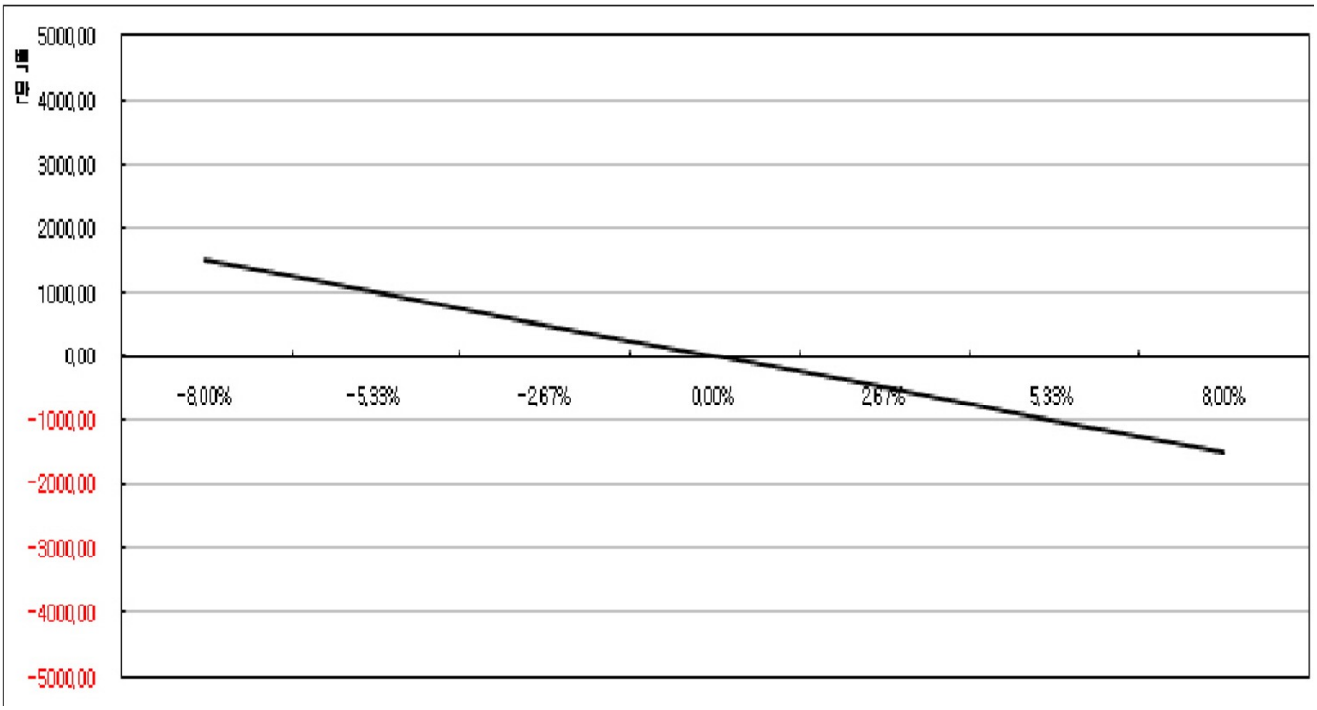
공시일: 2020-04-17

## 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 | 1,544 | -1,544 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,544 | -1,544 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

124

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

182

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

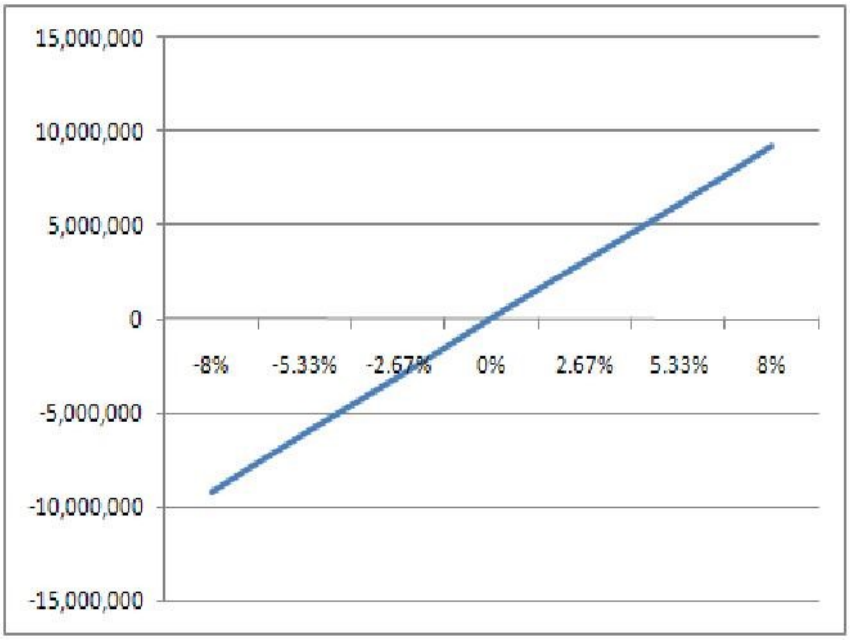
공시일: 2020-04-17

## 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 | 75,242 | 0 | 75,242 | 장내 |
| 합계 | | | 75,242 | 0 | 75,242 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,022

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

14,952