# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-05-26

## 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 | 1,117 | 0 | 1,117 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 2 | 1,051 | -1,049 | 장내 |
| 합계 | | | 1,119 | 1,051 | 68 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 42 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 283 |
|---|---|

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

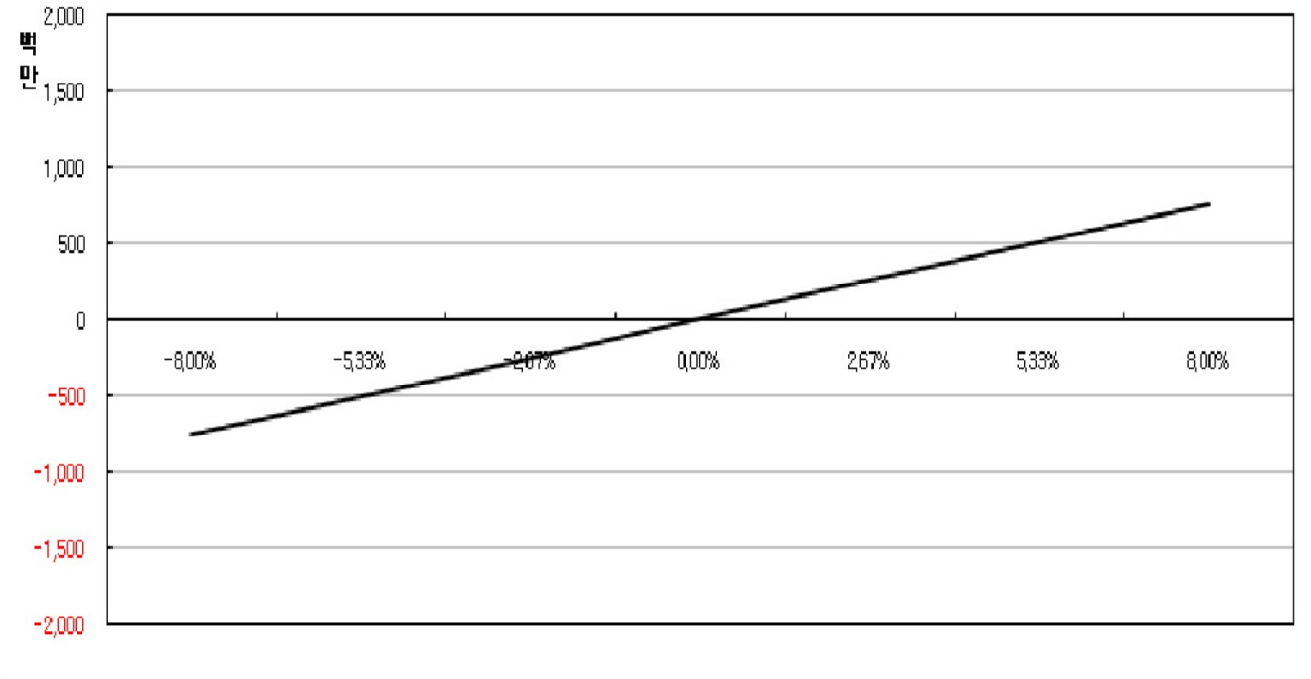
공시일: 2020-05-26

## 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 | 1,051 | 0 | 1,051 | 장내 |
| 합계 | | | 1,051 | 0 | 1,051 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

578

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

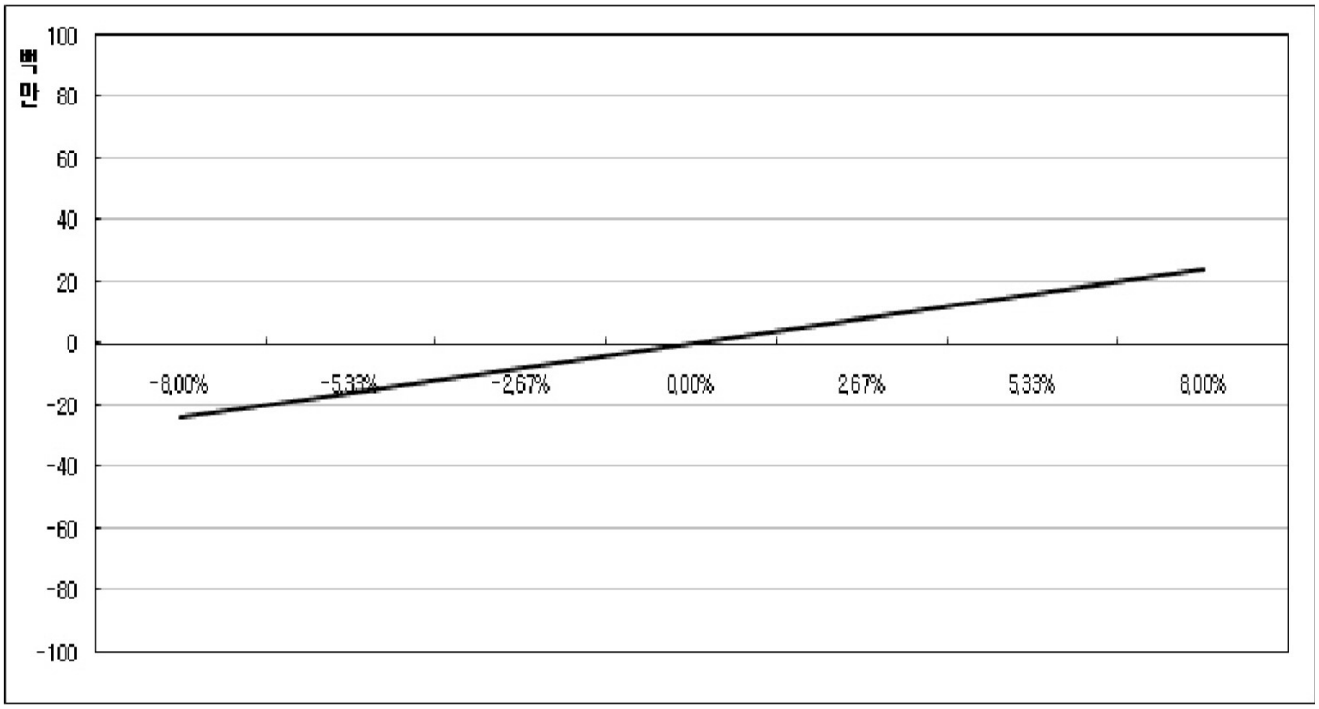
공시일: 2020-05-26

## 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 | 1,577 | 0 | 1,577 | 장내 |
| 합계 | | | 1,577 | 0 | 1,577 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

126

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

928

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

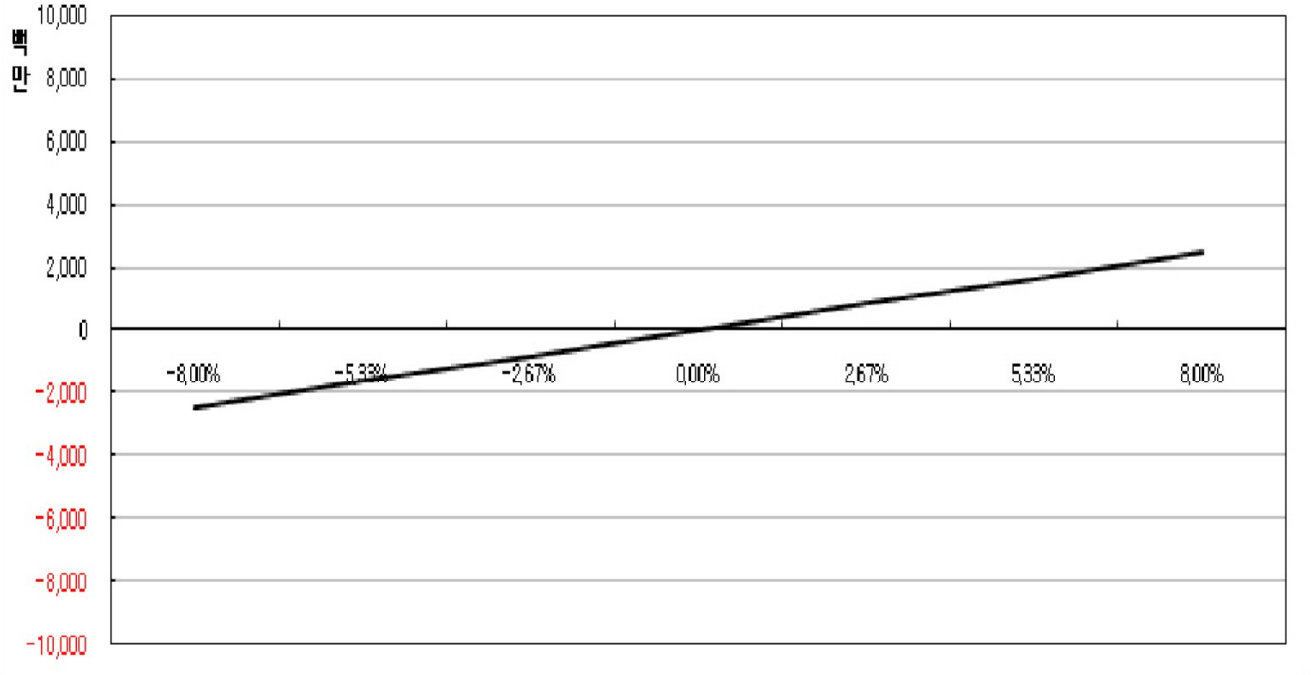
공시일: 2020-05-26

## 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 | 6,635 | 0 | 6,635 | 장내 |
| 합계 | | | 6,635 | 0 | 6,635 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

531

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,663

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

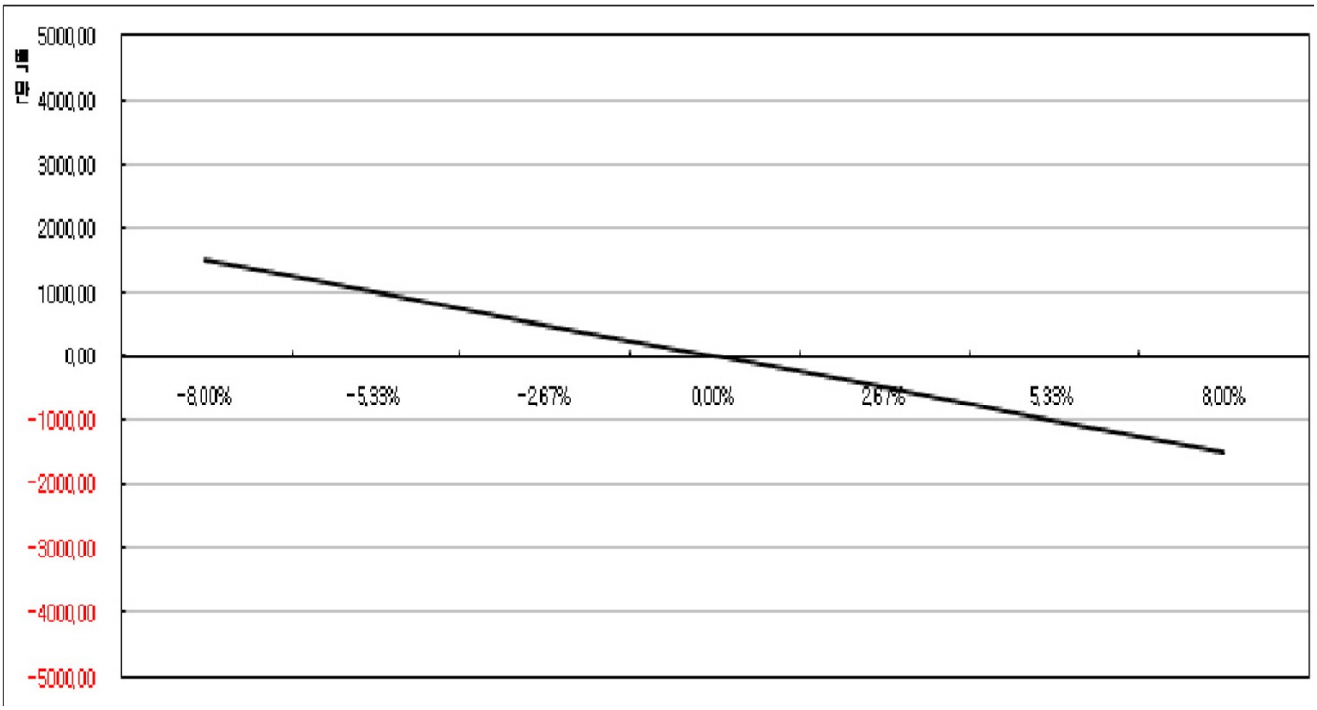
공시일: 2020-05-26

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 394 | 0 | 394 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 1,839 | -1,839 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,839 | -1,839 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

147

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

222

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

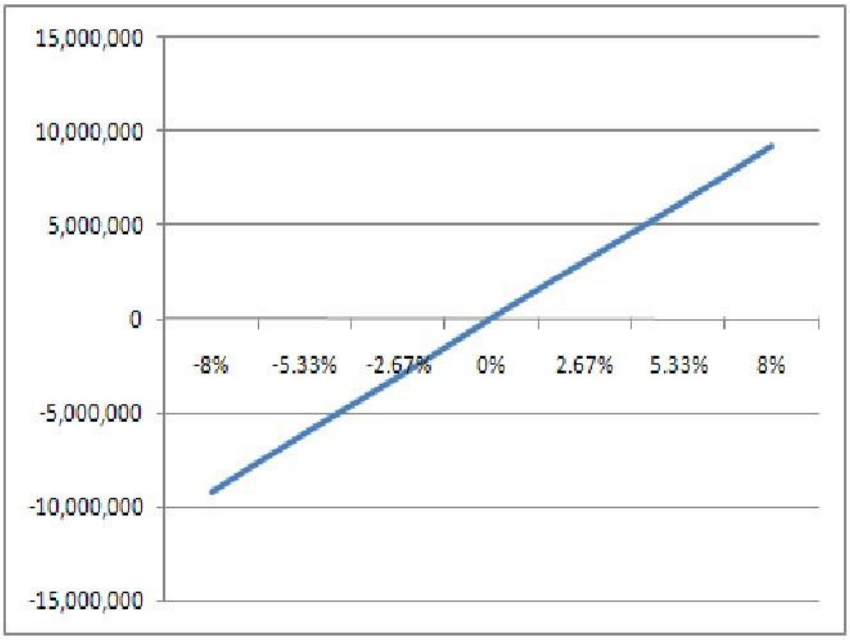
공시일: 2020-05-26

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 1,379 | 0 | 1,379 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 81,850 | 0 | 81,850 | 장내 |
| 합계 | | | 81,850 | 0 | 81,850 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,554

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

16,081