# 펀드명 : 1.5스마트커버드콜[주식-파생]

공시일: 2020-08-06

## 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 | 230 | 0 | 230 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 537 | -537 | 장내 |
| 합계 | | | 230 | 537 | -307 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 24 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 82 |
|---|---|

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

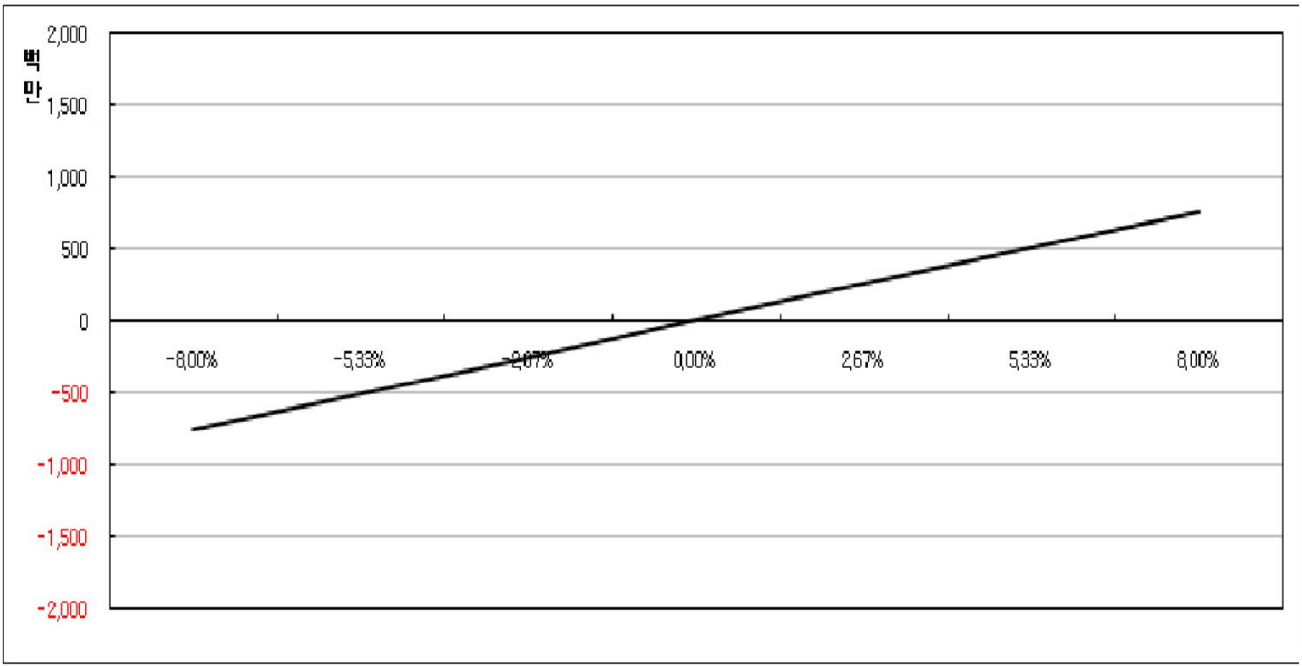
공시일: 2020-08-06

## 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 | 1,150 | 0 | 1,150 | 장내 |
| 합계 | | | 1,150 | 0 | 1,150 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

92

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

673

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

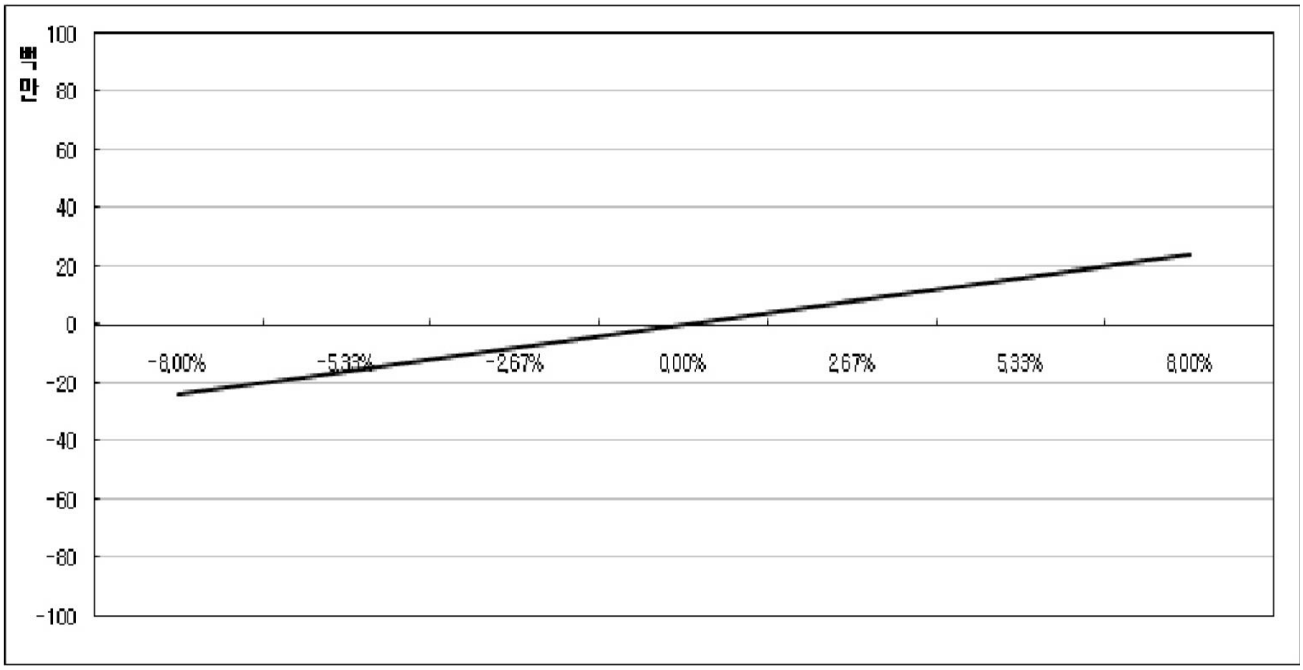
공시일: 2020-08-06

## 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 | 1,227 | 0 | 1,227 | 장내 |
| 합계 | | | 1,227 | 0 | 1,227 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 98 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 982 |
|---|---|

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

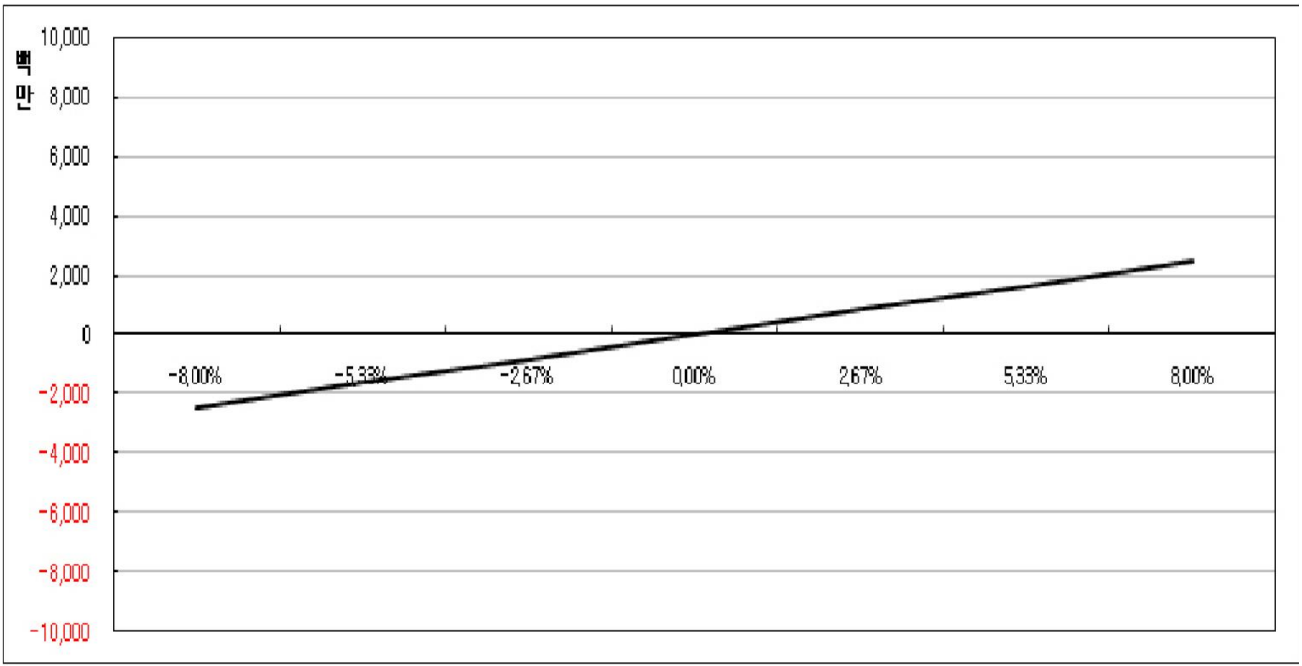
공시일: 2020-08-06

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 383 | -383 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 3,296 | 0 | 3,296 | 장내 |
| 합계 | | | 3,296 | 0 | 3,296 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

264

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,623

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

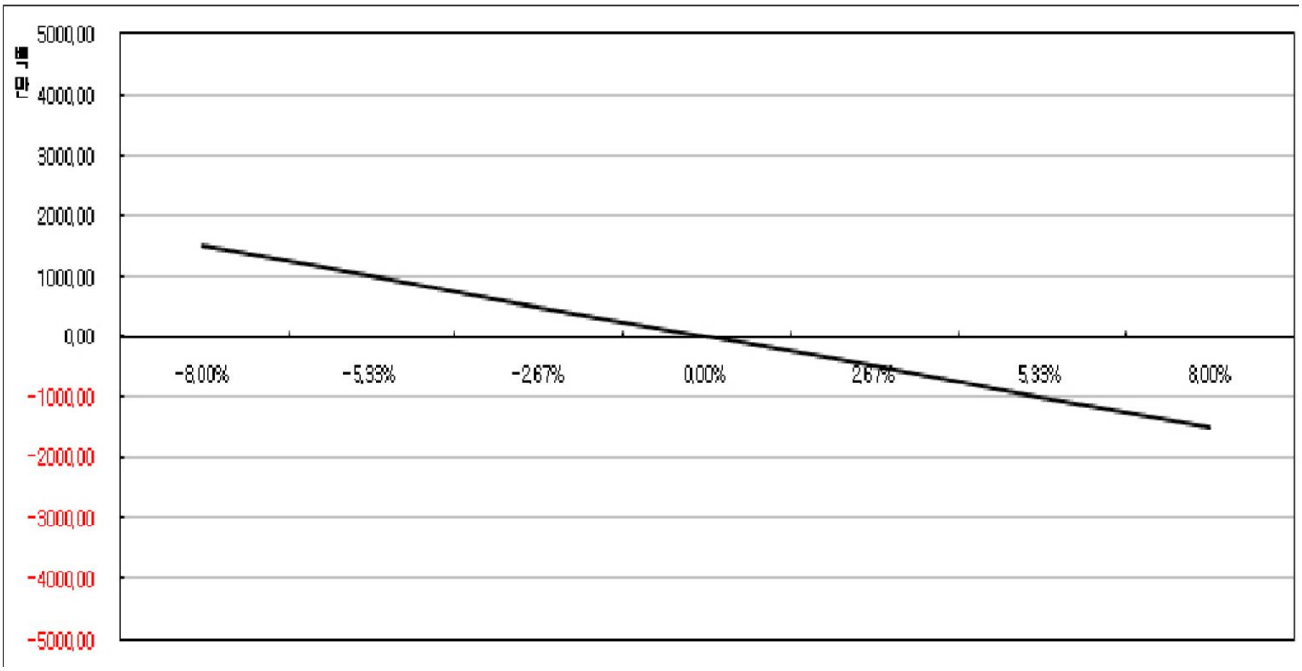
공시일: 2020-08-06

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 77 | 0 | 77 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 1,763 | -1,763 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,763 | -1,763 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

141

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

225

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

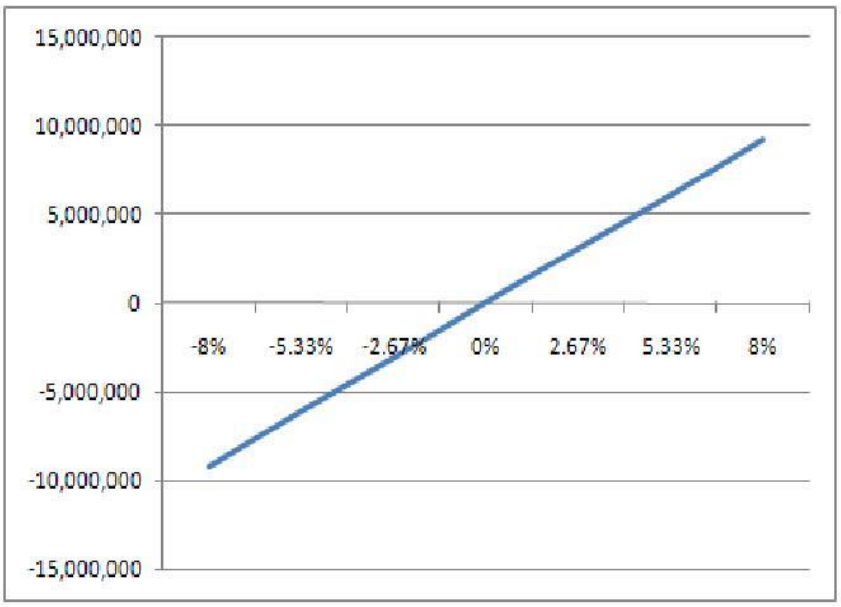
공시일: 2020-08-06

## 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 | 49,906 | 0 | 49,906 | 장내 |
| 합계 | | | 49,906 | 0 | 49,906 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,993

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

14,203