# 펀드명 : KRX300인덱스증권모[주식-파생형]

공시일: 2020-10-07

## 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 | 146 | 0 | 146 | 장내 |
| 합계 | | | 146 | 0 | 146 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

297

# 펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

공시일: 2020-10-07

## 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 | 19,427 | -19,427 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 19,427 | -19,427 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 1,534 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 1,748 |
|---|---|

# 펀드명 : 인덱스증권V1[주식-파생]

공시일: 2020-10-07

## 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 | 865 | 0 | 865 | 장내 |
| 합계 | | | 865 | 0 | 865 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 69 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 682 |
|---|---|

# 펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

공시일: 2020-10-07

## 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 | 1,101 | 0 | 1,101 | 장내 |
| 합계 | | | 1,101 | 0 | 1,101 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 88 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 1,033 |
|---|---|

# 펀드명 : 엄브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

공시일: 2020-10-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 236 | -236 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 4,324 | 0 | 4,324 | 장내 |
| 합계 | | | 4,324 | 0 | 4,324 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

346

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,594

# 펀드명 : 엄브렐러리버스인덱스K1[주식-파생]

공시일: 2020-10-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 314 | -314 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 1,729 | -1,729 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,729 | -1,729 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

138

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

226

# 펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

공시일: 2020-10-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 4,874 | -4,874 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 47,168 | 0 | 47,168 | 장내 |
| 합계 | | | 47,168 | 0 | 47,168 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

| 3. 시나리오법에 의한 손익변동 | 3,773 |
|---|---|

(단위: 백만원)

| 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) | 10,482 |
|---|---|