

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

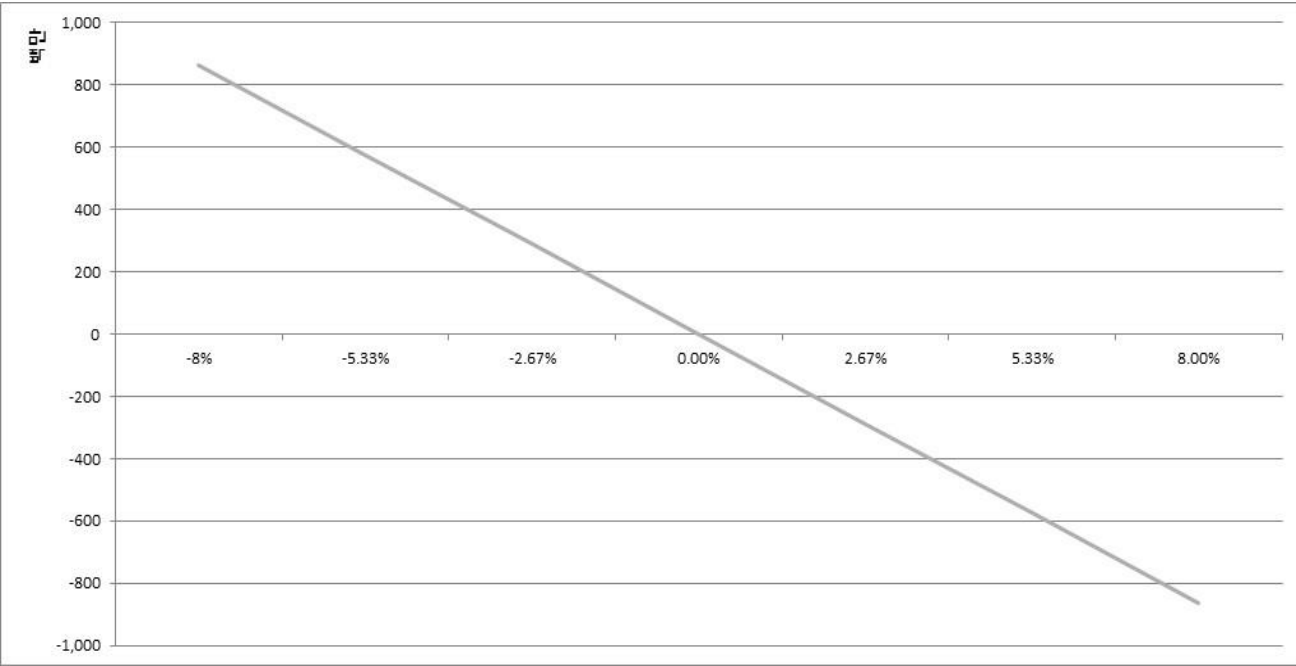
공시일: 2024-09-27

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	10,738	-10,738	장내
합계			0	10,738	-10,738	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

862

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,019

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

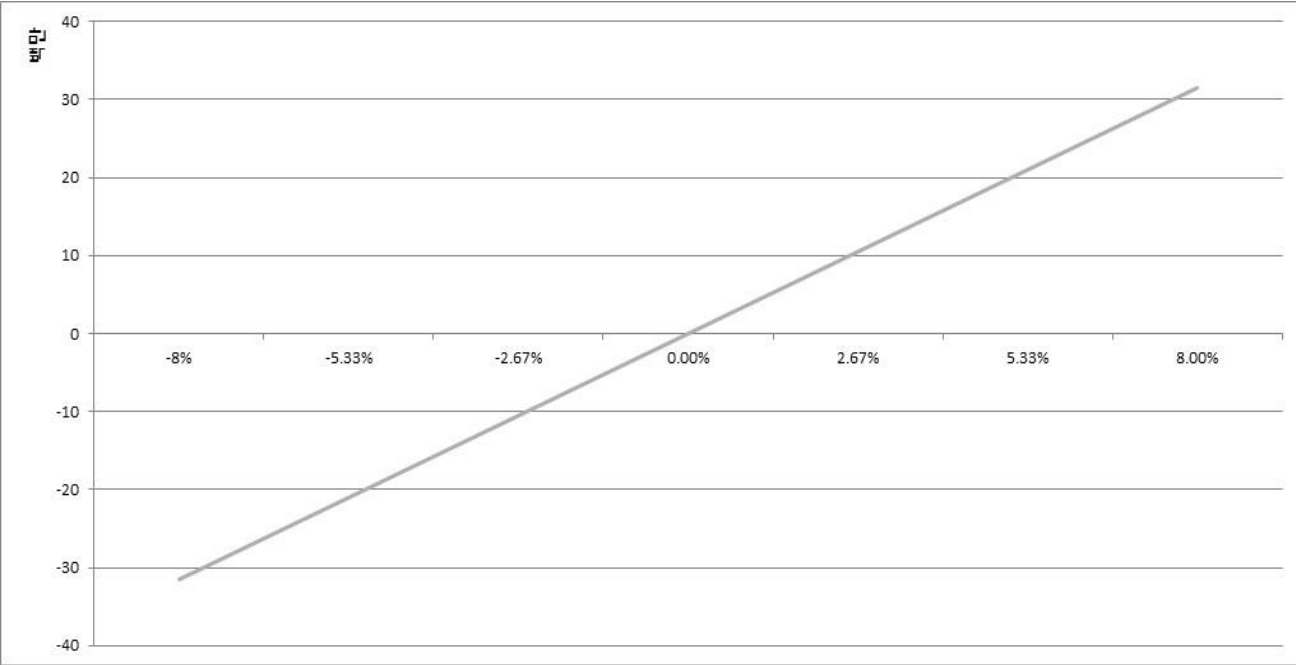
공시일: 2024-09-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	18	-18	장내
누계	주가지수	선물	392	0	392	장내
신규	유가증권	선물	7	15	-8	장내
누계	유가증권	선물	126	0	126	장내
합계			518	0	518	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

629

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

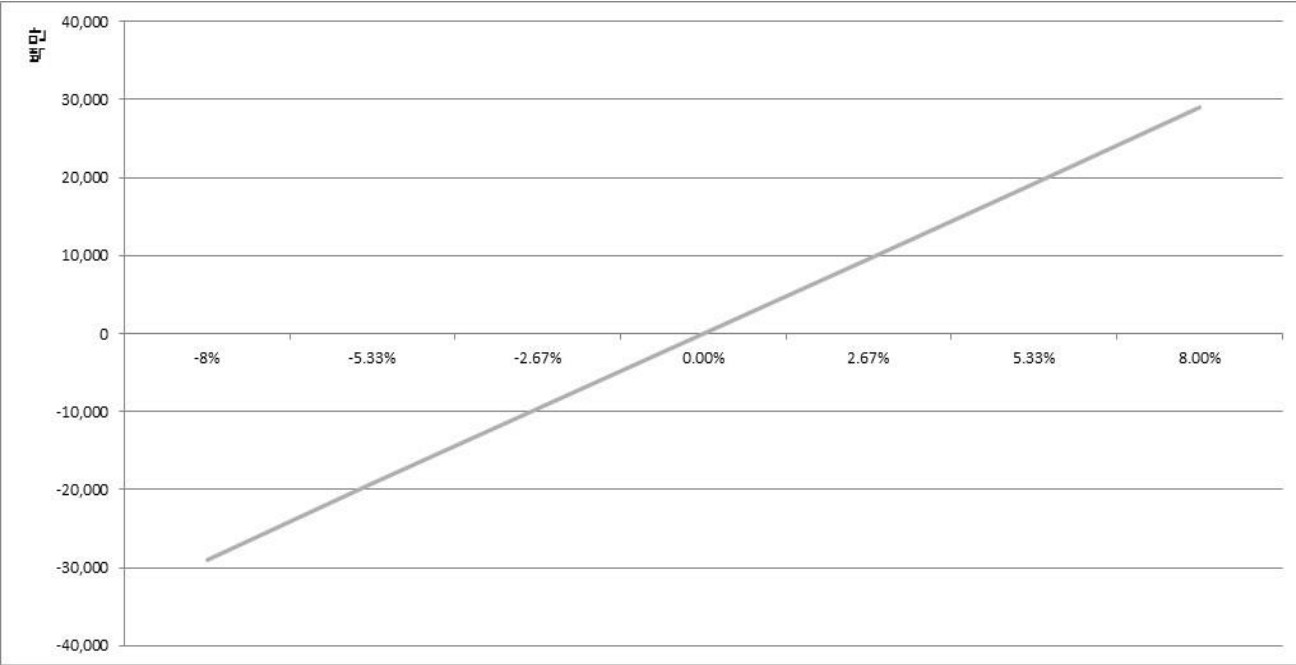
공시일: 2024-09-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	89	-89	장내
누계	주가지수	선물	3,921	0	3,921	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	361,677	0	361,677	장외
합계			365,597	0	365,597	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28,934

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

31,445

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

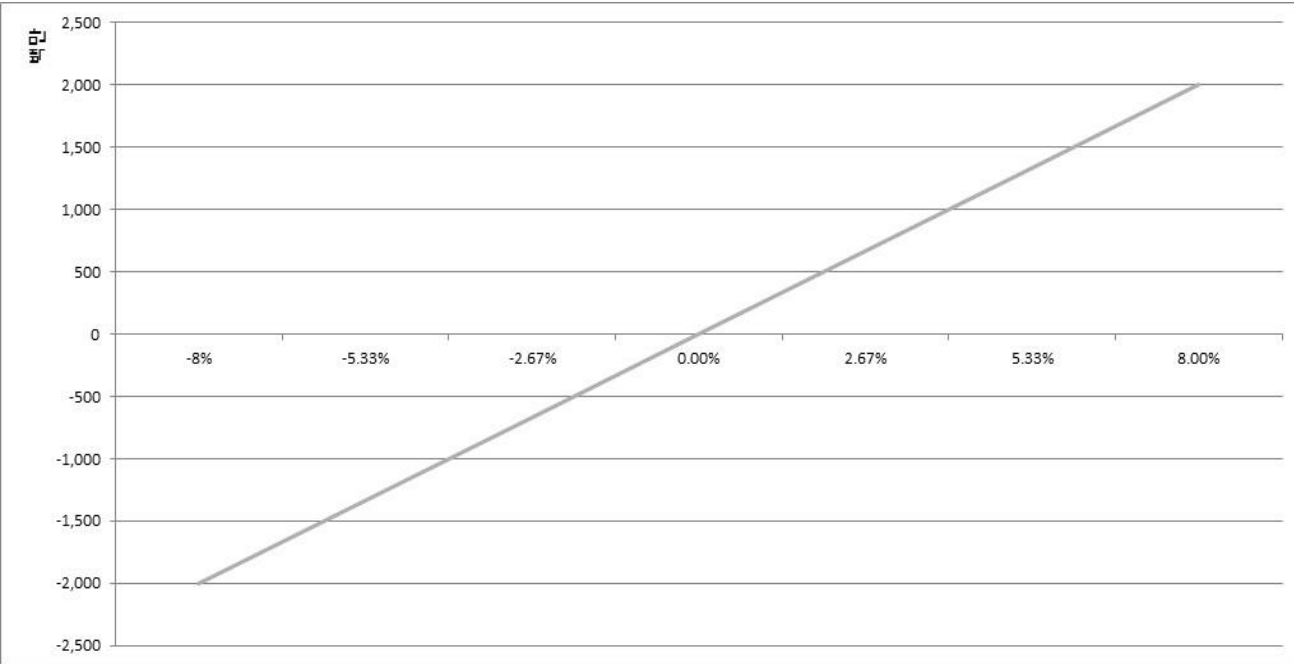
공시일: 2024-09-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	446	0	446	장내
누계	주가지수	선물	24,862	0	24,862	장내
합계			24,862	0	24,862	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,427