

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

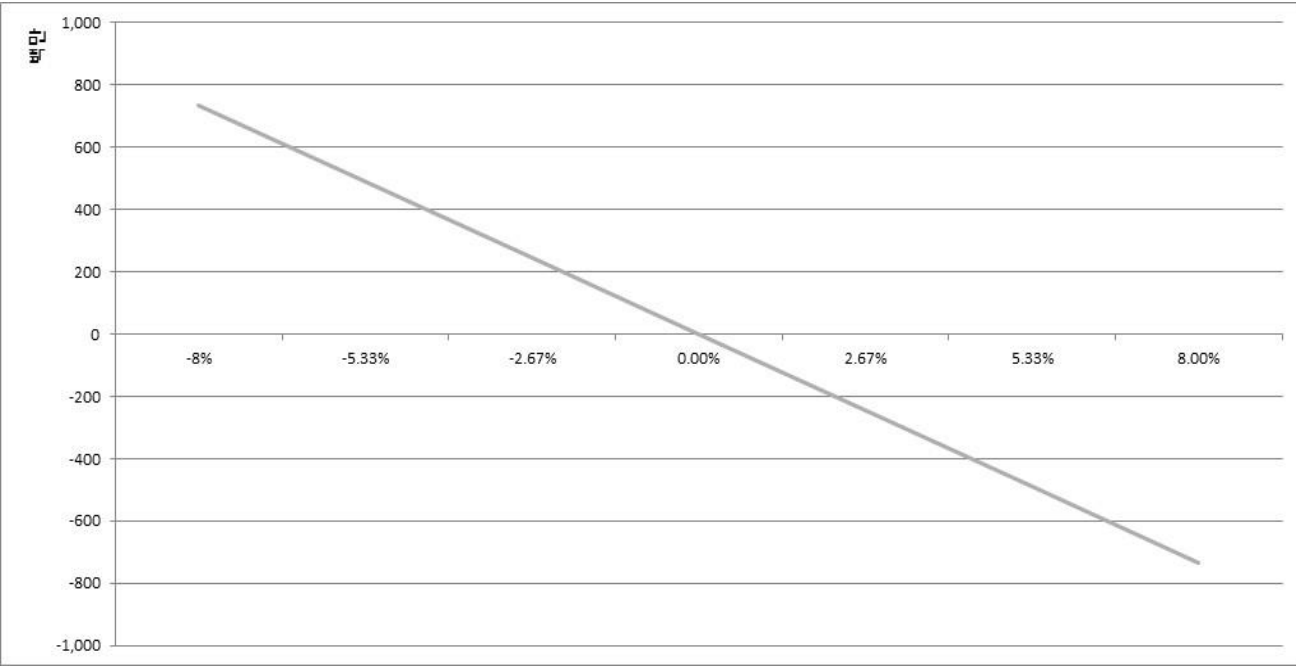
공시일: 2025-05-08

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	9,158	-9,158	장내
합계			0	9,158	-9,158	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

735

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,600

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

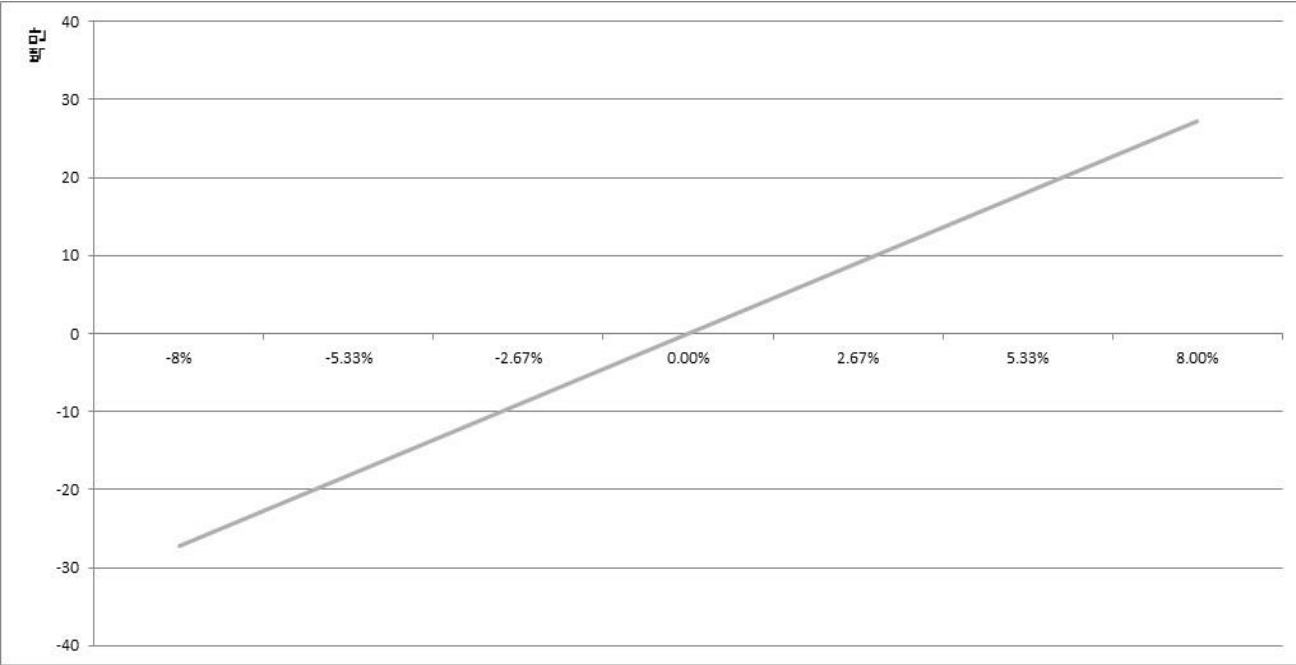
공시일: 2025-05-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	17	17	0	장내
누계	주가지수	선물	341	0	341	장내
신규	유가증권	선물	7	8	-1	장내
누계	유가증권	선물	460	0	460	장내
합계			802	0	802	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

27

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

713

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

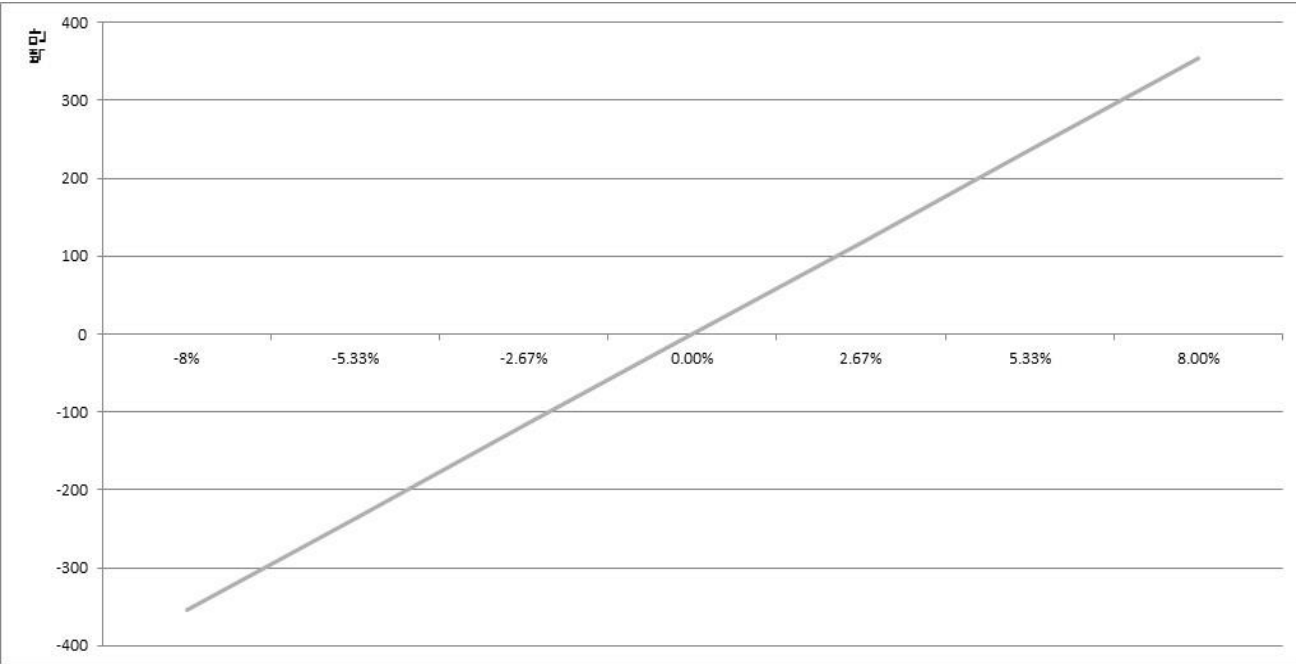
공시일: 2025-05-08

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	4,437	0	4,437	장내
합계			4,437	0	4,437	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

355

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

879

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

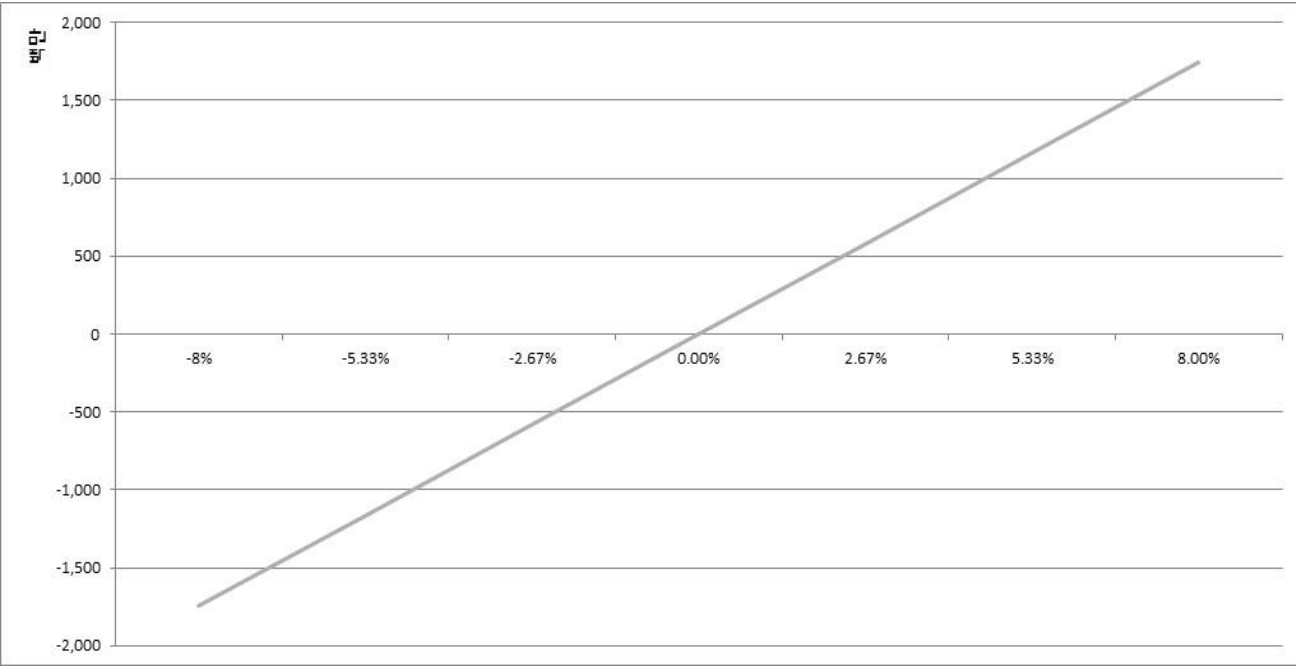
공시일: 2025-05-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	85	0	85	장내
누계	주가지수	선물	21,844	0	21,844	장내
합계			21,844	0	21,844	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,746

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,385

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

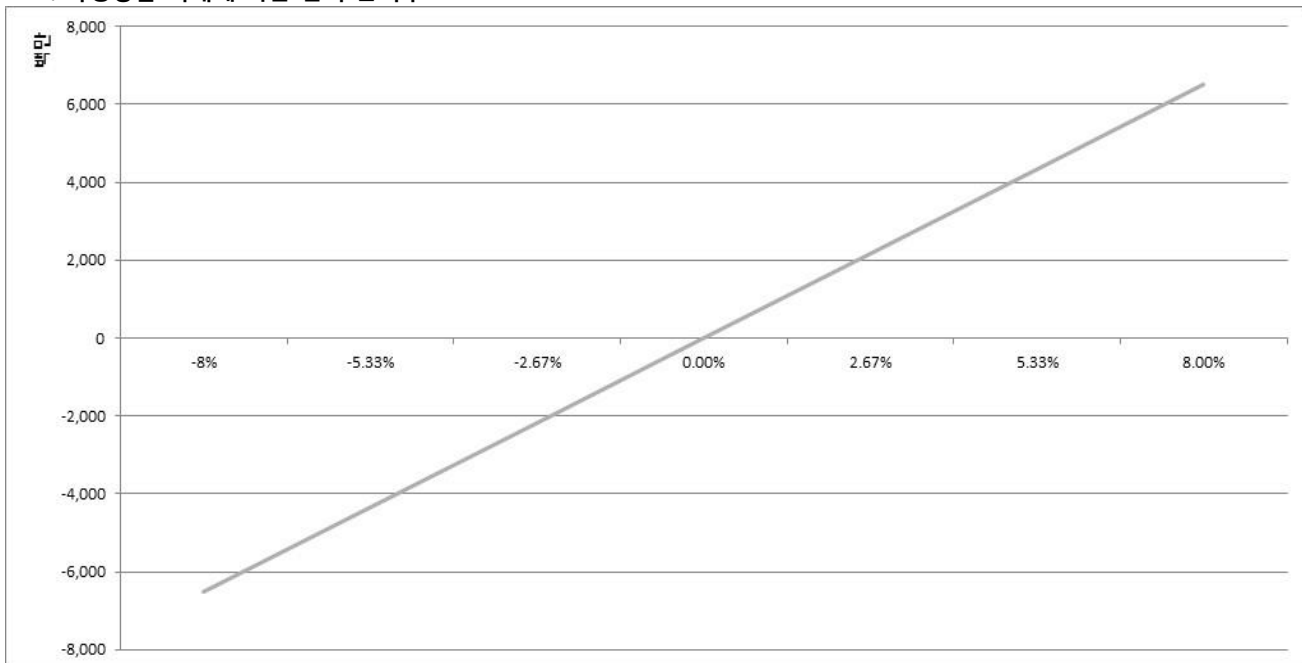
공시일: 2025-05-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	81,375	0	81,375	장외
합계			81,375	0	81,375	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,510

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52