

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

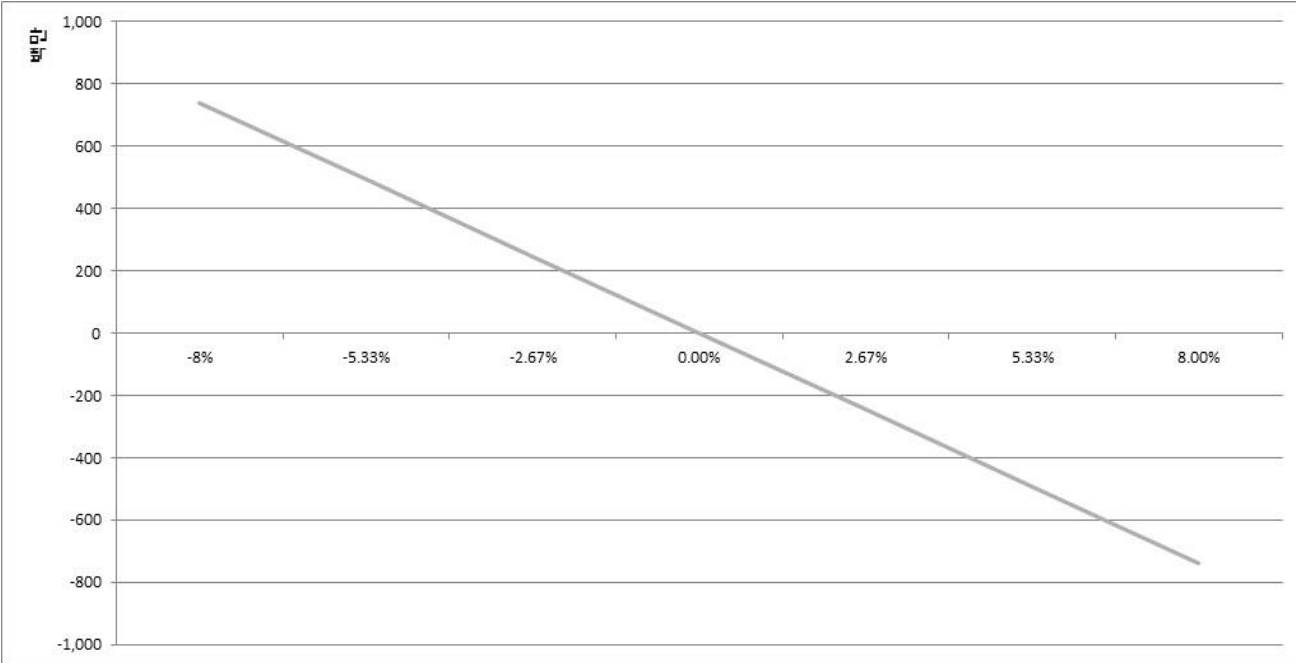
공시일: 2025-05-09

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	9,226	-9,226	장내
합계			0	9,226	-9,226	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

740

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,627

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

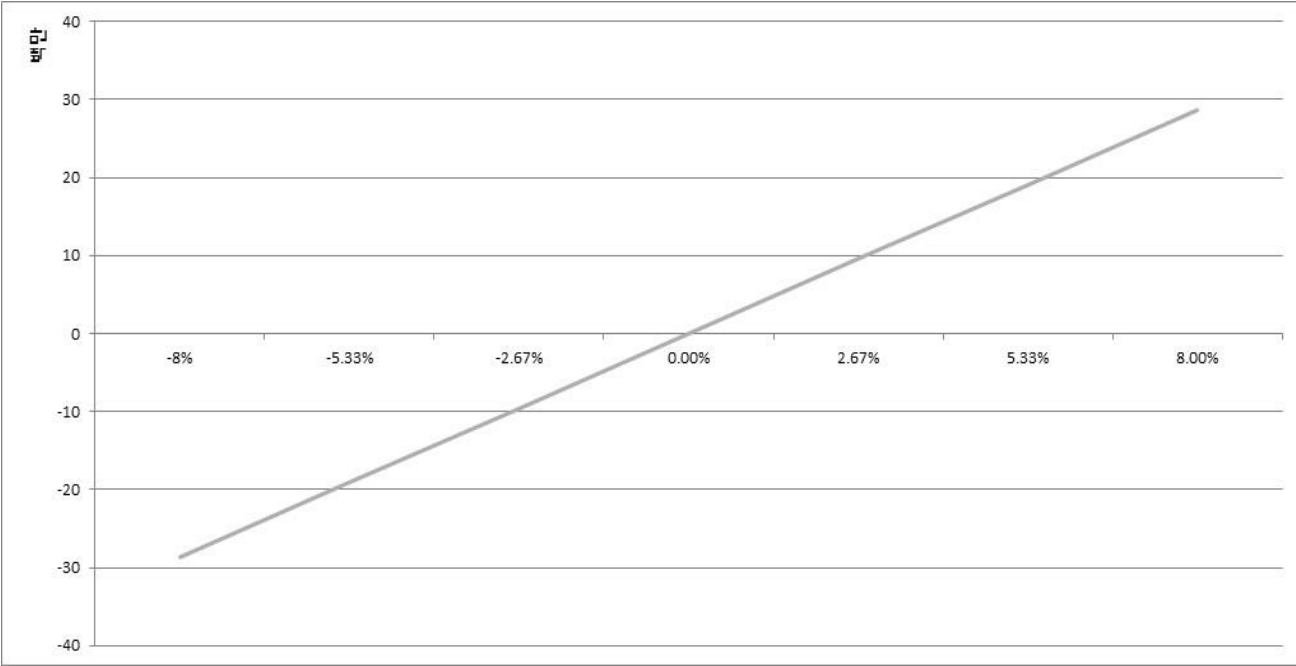
공시일: 2025-05-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	17	0	17	장내
누계	주가지수	선물	359	0	359	장내
신규	유가증권	선물	127	580	-453	장내
누계	유가증권	선물	10	0	10	장내
합계			369	0	369	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

712

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

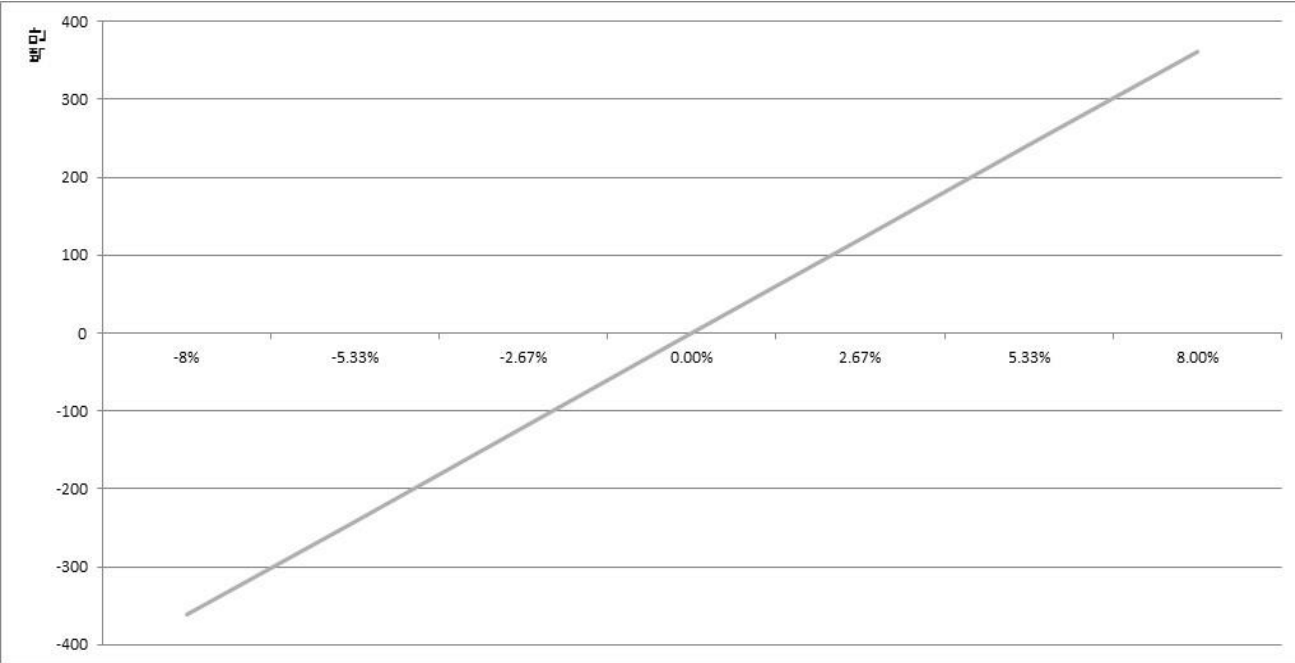
공시일: 2025-05-09

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	4,524	0	4,524	장내
합계			4,524	0	4,524	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

362

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

886

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

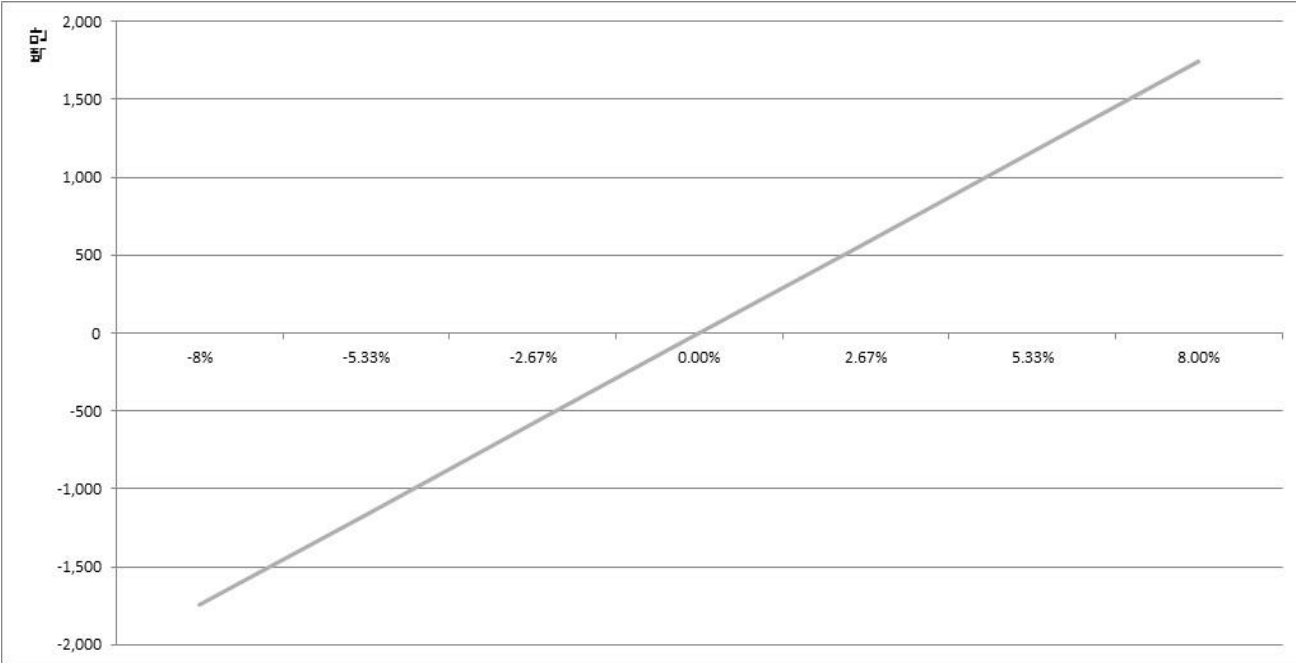
공시일: 2025-05-09

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	21,854	0	21,854	장내
합계			21,854	0	21,854	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,748

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,384

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

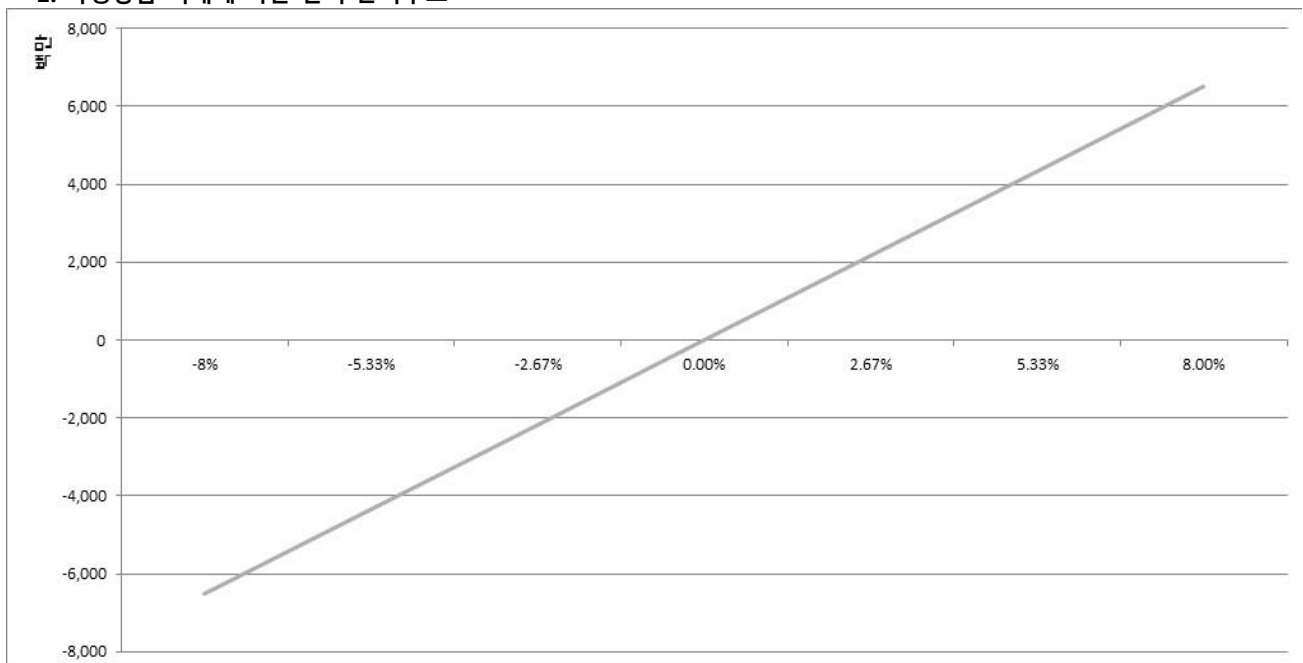
공시일: 2025-05-09

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	81,381	0	81,381	장외
합계			81,381	0	81,381	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

6,511

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52