

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

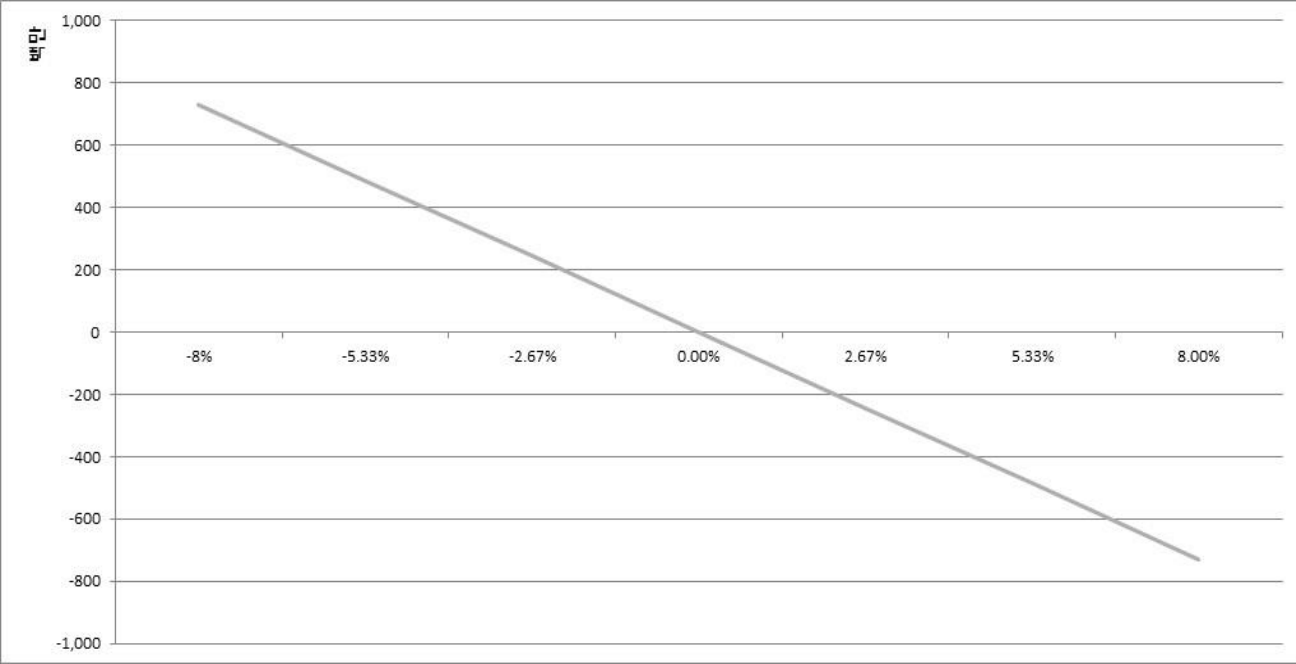
공시일: 2025-05-12

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	9,101	-9,101	장내
합계			0	9,101	-9,101	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

729

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,566

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

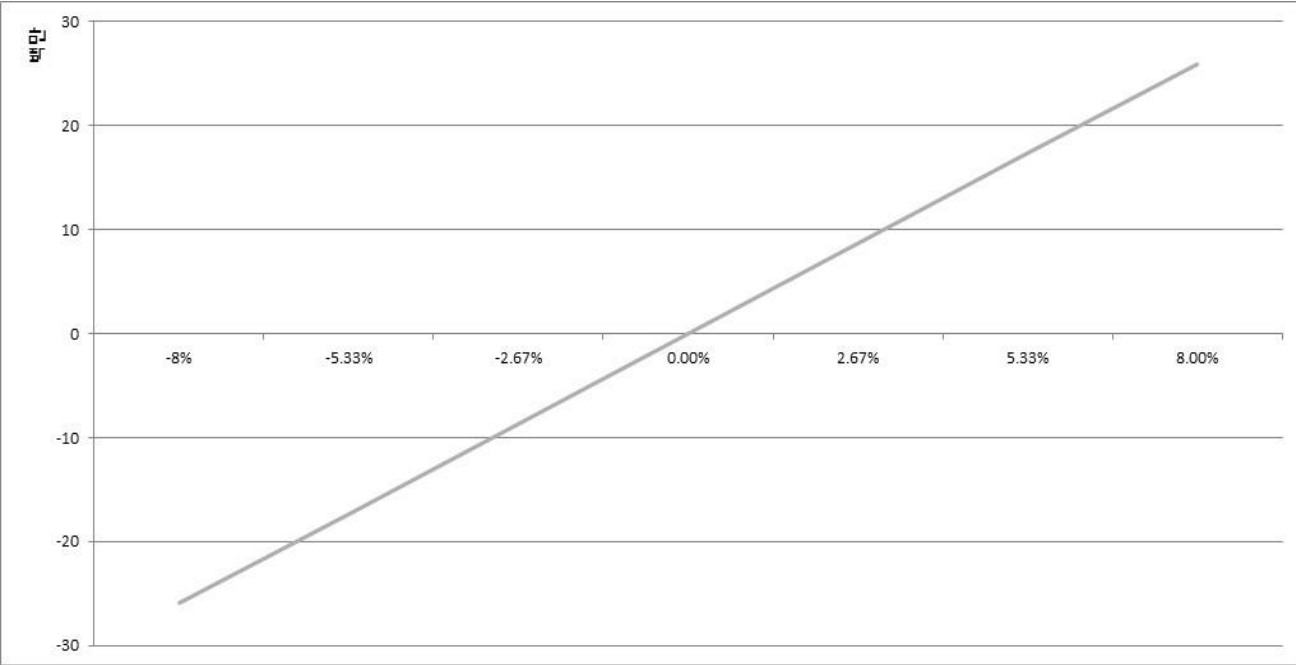
공시일: 2025-05-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	34	-34	장내
누계	주가지수	선물	341	17	324	장내
신규	유가증권	선물	12	0	12	장내
누계	유가증권	선물	22	0	22	장내
합계			364	17	347	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

684

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

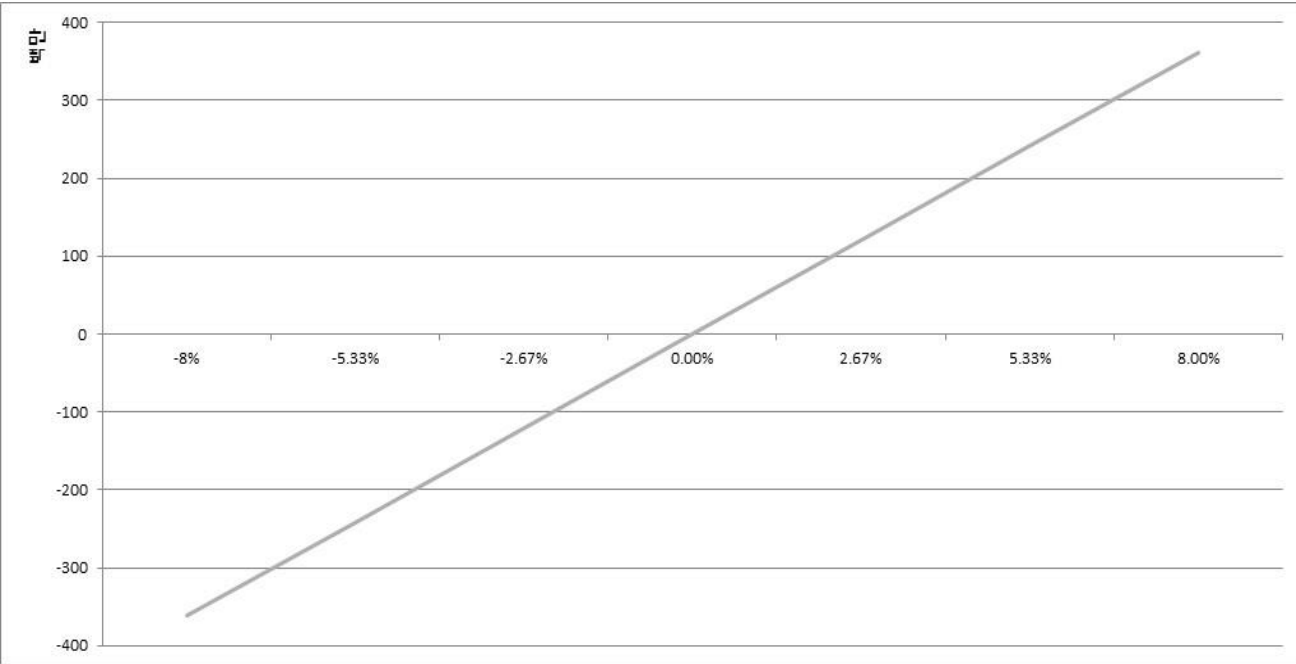
공시일: 2025-05-12

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	4,525	0	4,525	장내
합계			4,525	0	4,525	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

362

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

887

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

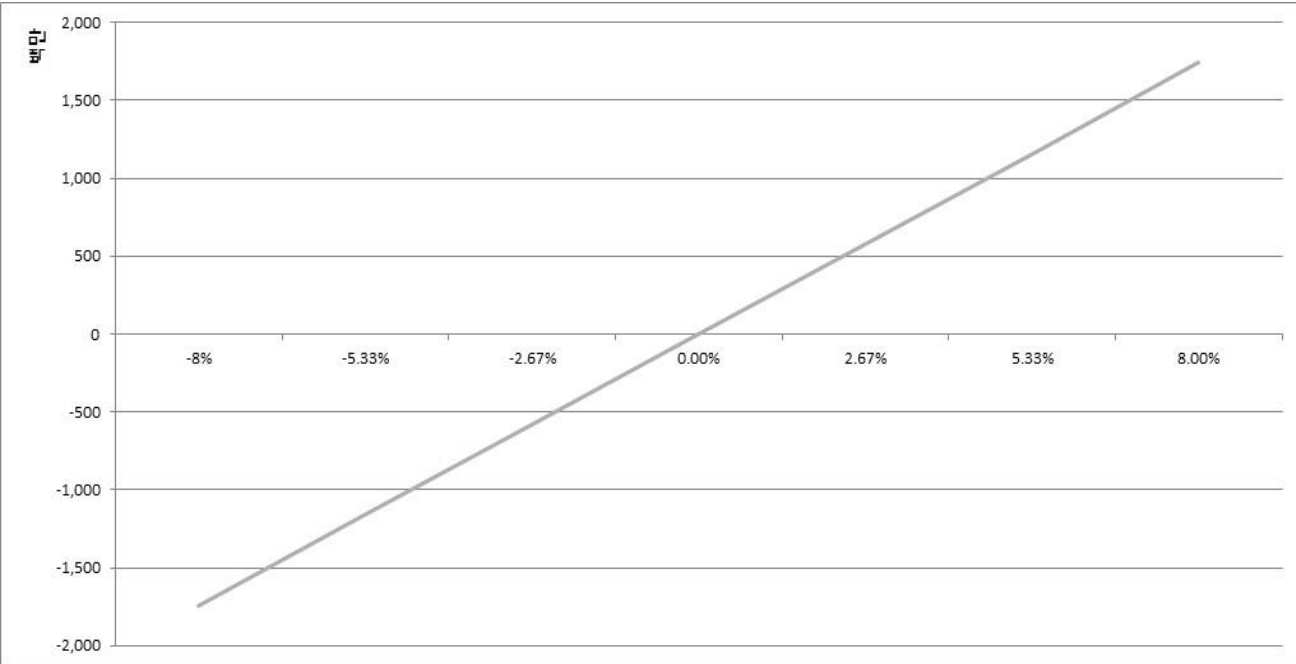
공시일: 2025-05-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	85	-85	장내
누계	주가지수	선물	21,770	0	21,770	장내
합계			21,770	0	21,770	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,741

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,379

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

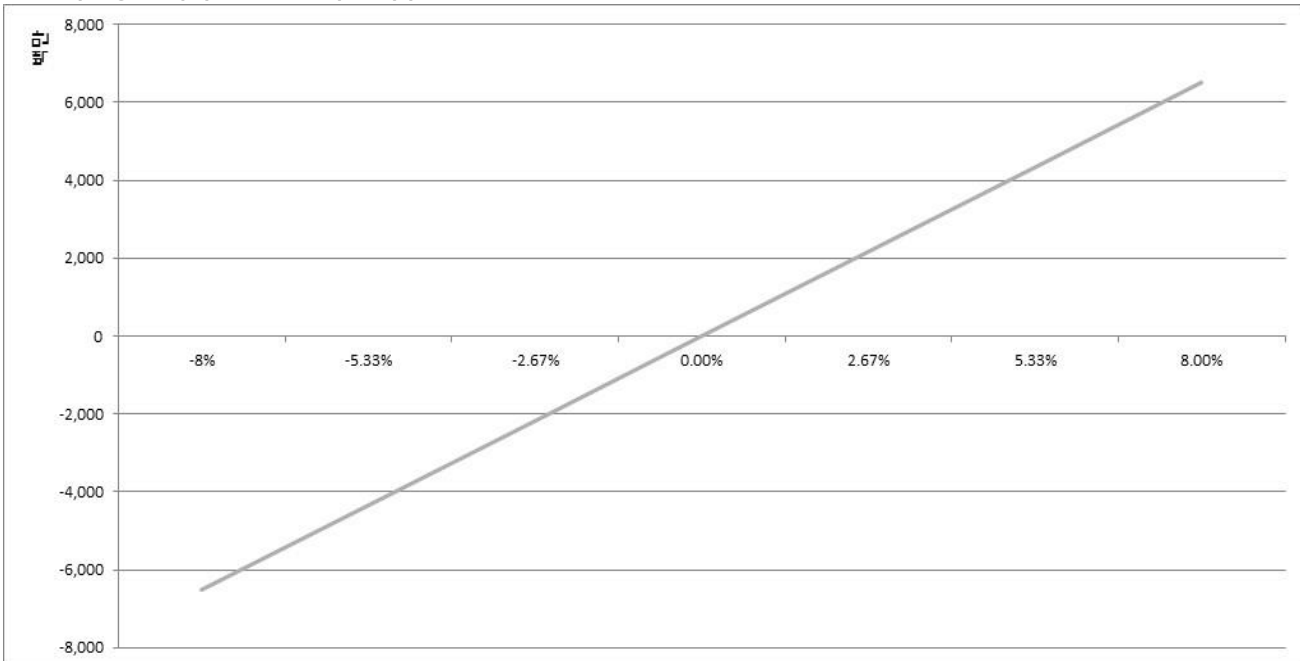
공시일: 2025-05-12

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	81,399	0	81,399	장외
합계			81,399	0	81,399	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,512

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

53