

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

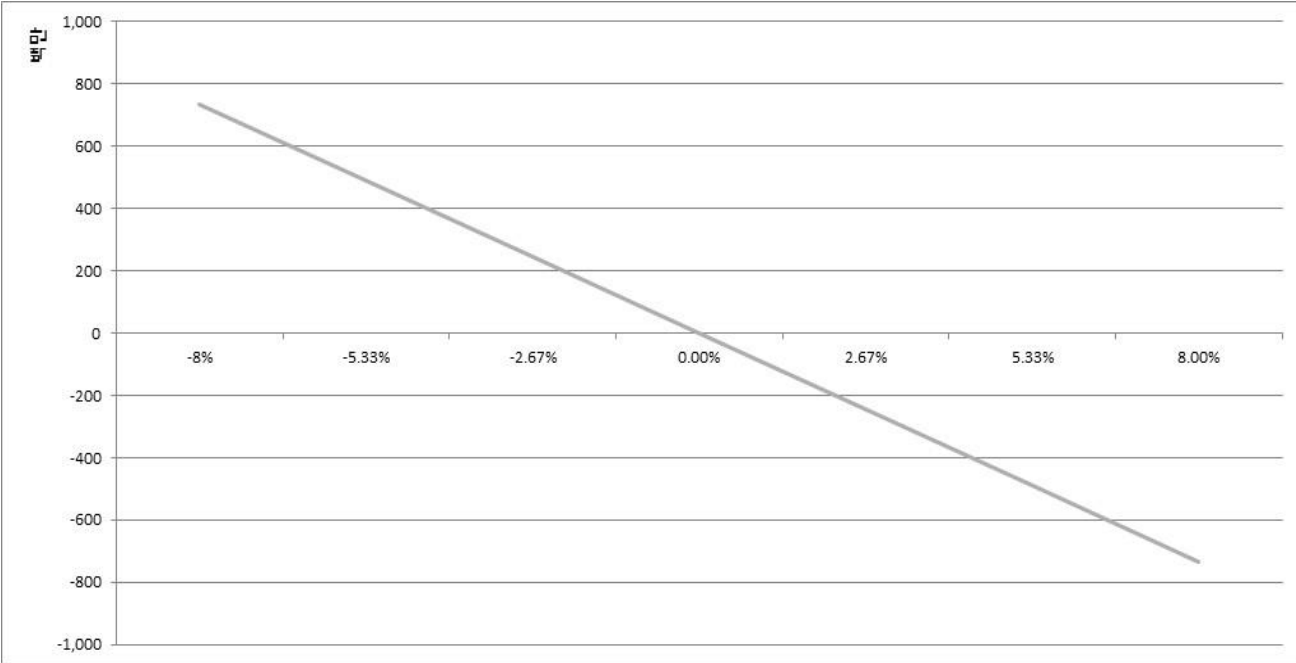
공시일: 2025-05-13

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	9,114	-9,114	장내
합계			0	9,114	-9,114	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

733

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,367

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

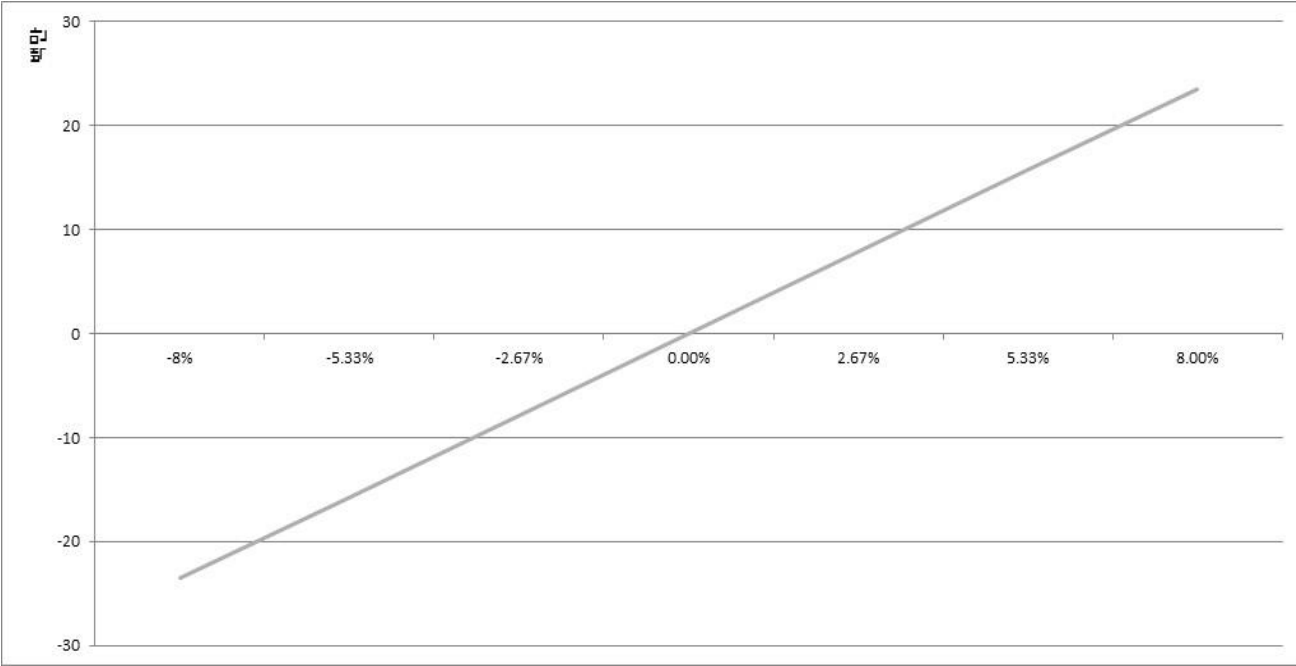
공시일: 2025-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	35	-35	장내
누계	주가지수	선물	347	52	295	장내
신규	유가증권	선물	0	37	-37	장내
누계	유가증권	선물	3	17	-14	장내
합계			350	69	281	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

694

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

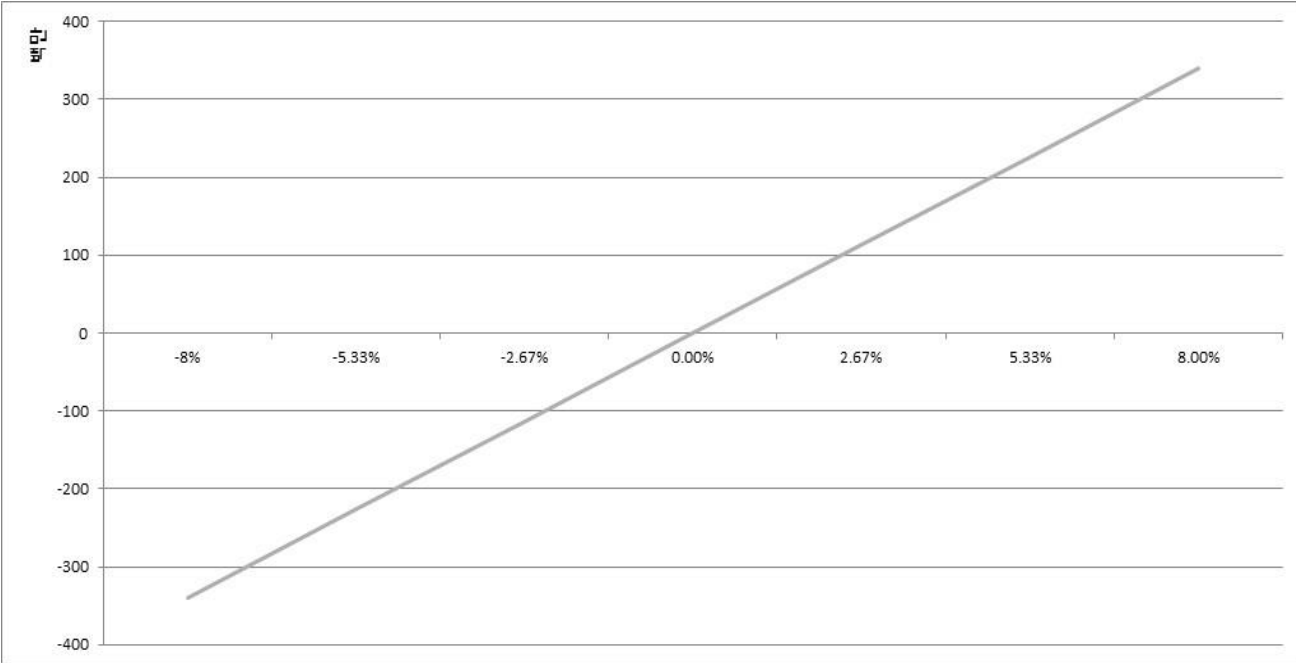
공시일: 2025-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	347	-347	장내
누계	주가지수	선물	4,252	0	4,252	장내
합계			4,252	0	4,252	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

339

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

874

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

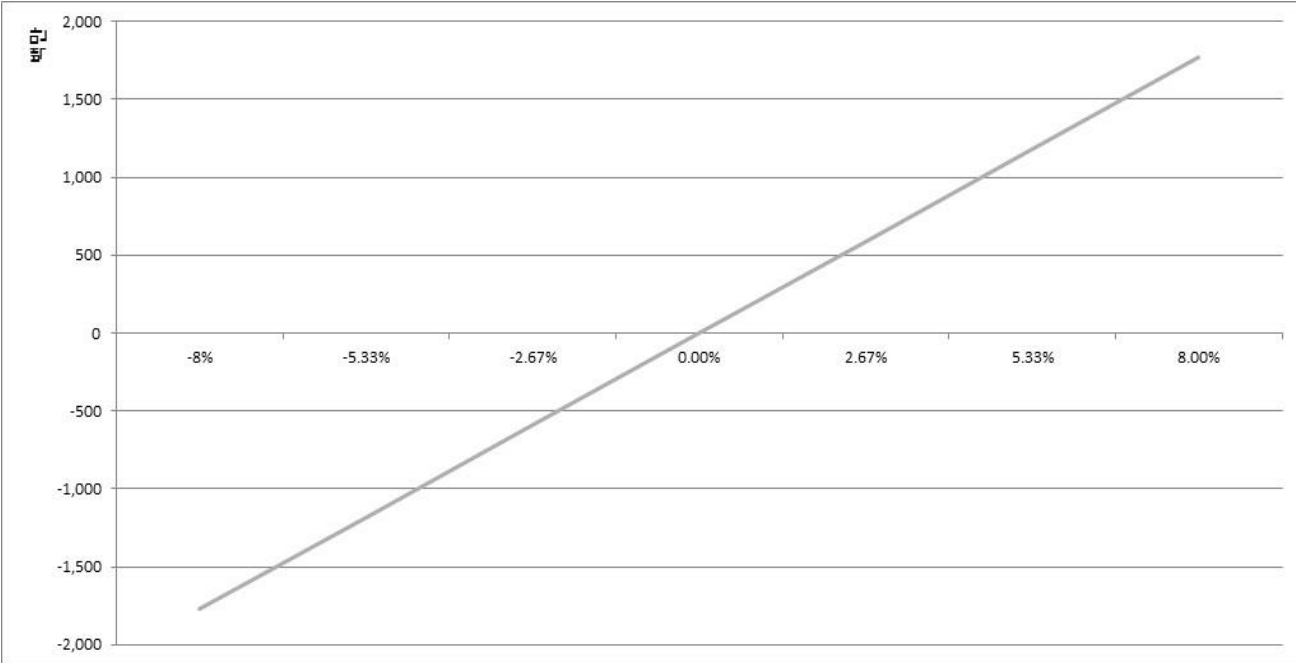
공시일: 2025-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	87	0	87	장내
누계	주가지수	선물	22,213	0	22,213	장내
합계			22,213	0	22,213	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,773

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,461

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

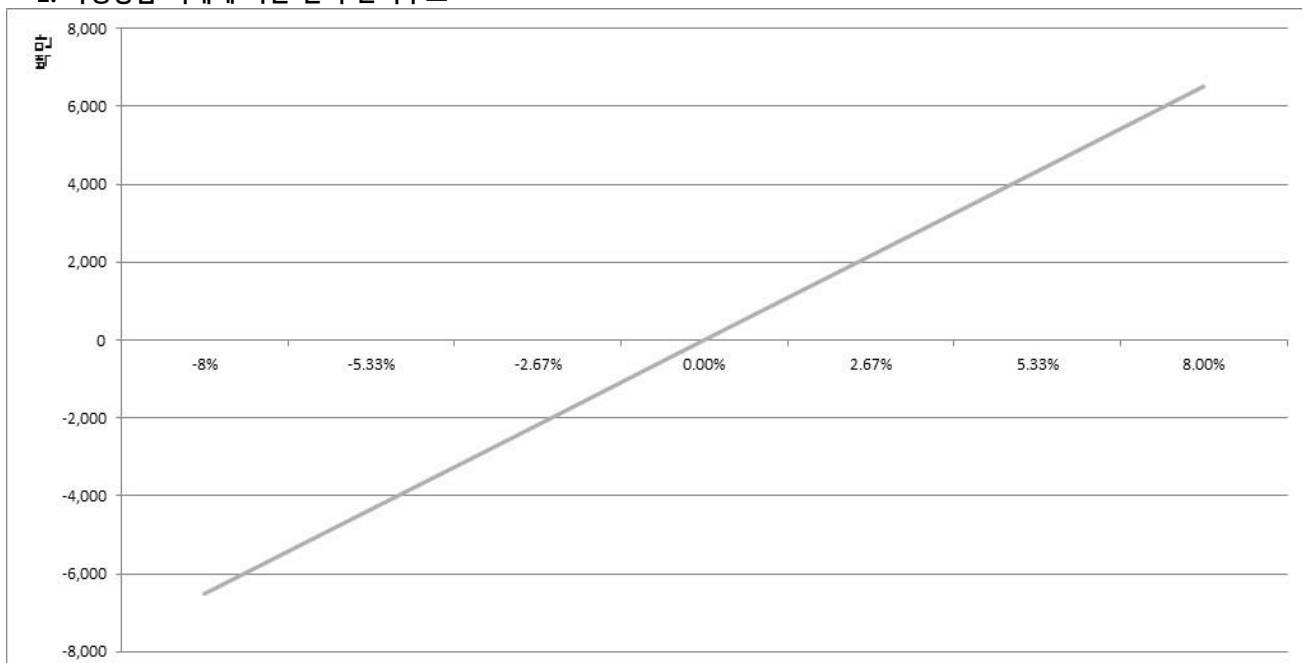
공시일: 2025-05-13

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	81,405	0	81,405	장외
합계			81,405	0	81,405	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,512

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

53