

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

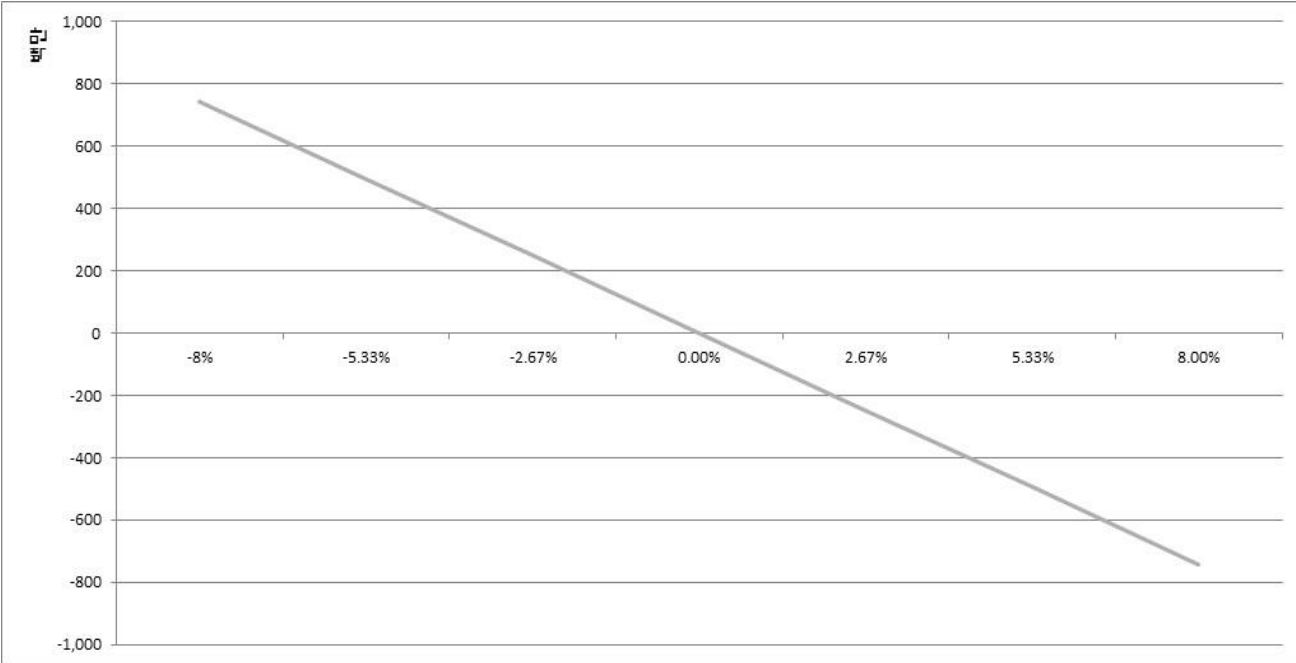
공시일: 2025-05-14

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     | 9,249 | -9,249    | 장내 |
| 합계 |      |      | 0     | 9,249 | -9,249    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

742

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,339

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

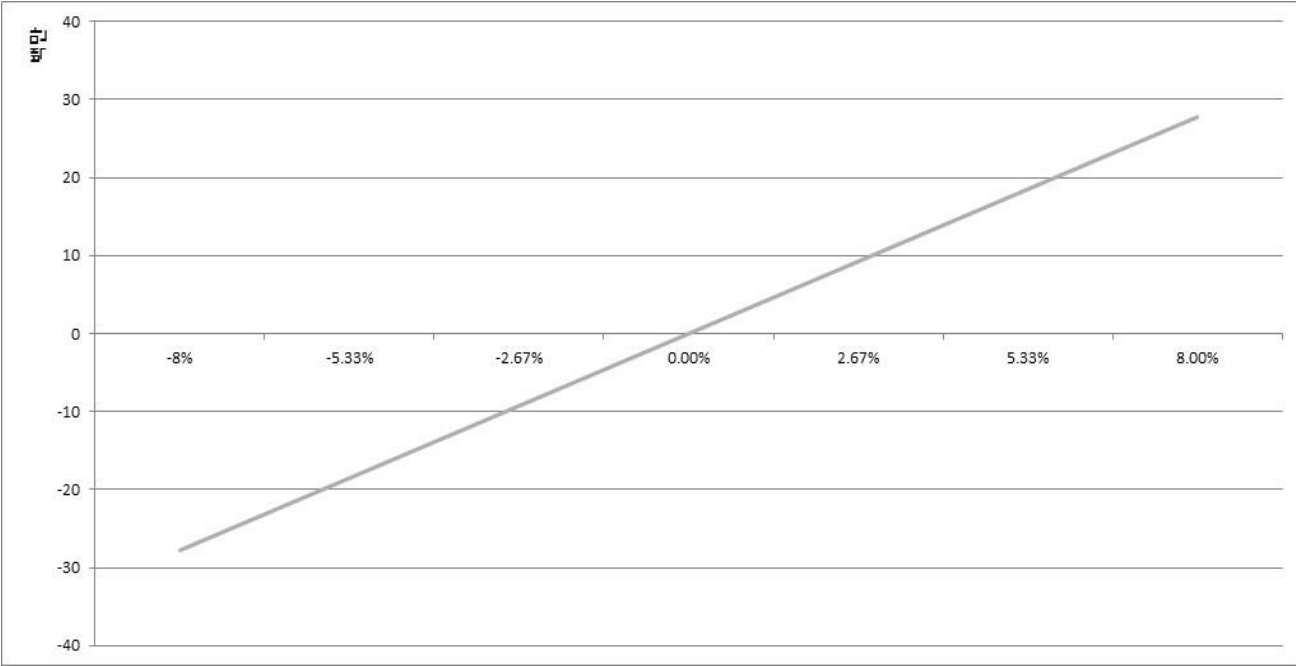
공시일: 2025-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 52    | 0     | 52        | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 347   | 0     | 347       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 49    | 24    | 25        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 44    | 33    | 11        | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 1     | 0     | 1         | 장외 |
| 합계 |      |      | 392   | 33    | 359       |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

702

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

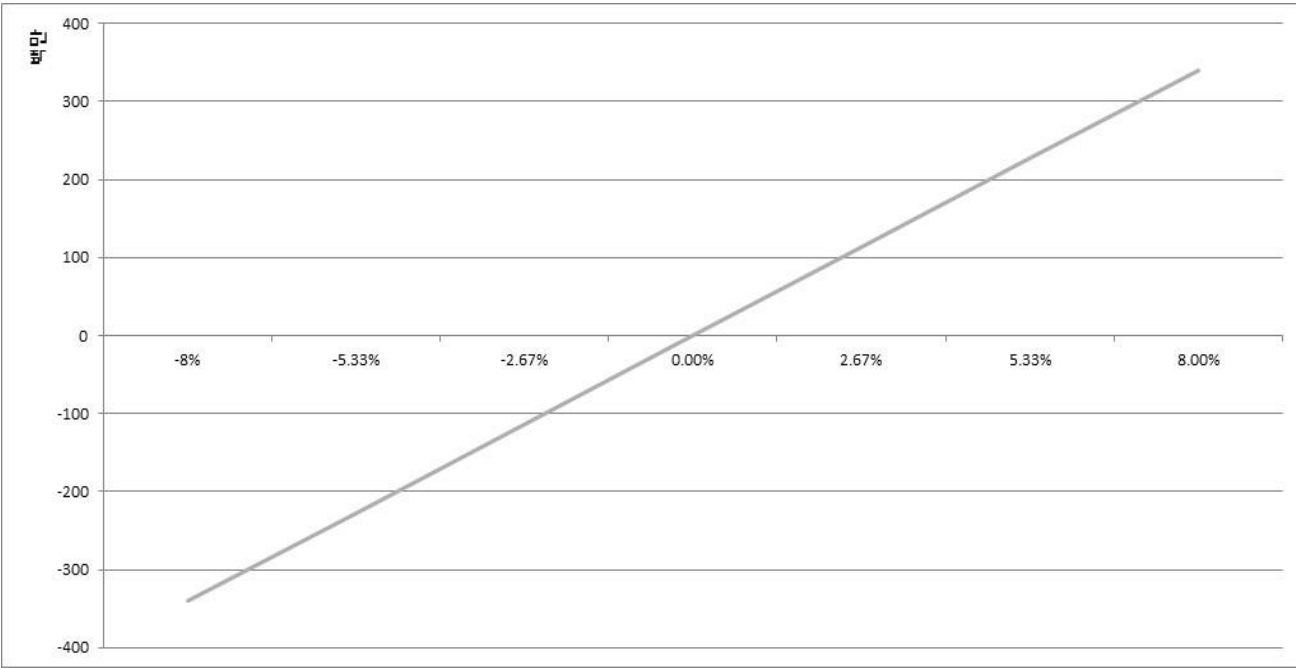
공시일: 2025-05-14

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   | 4,253 | 0     | 4,253     | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 1     | 0     | 1         | 장외 |
| 합계 |      |      | 4,254 | 0     | 4,254     |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

341

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

875

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

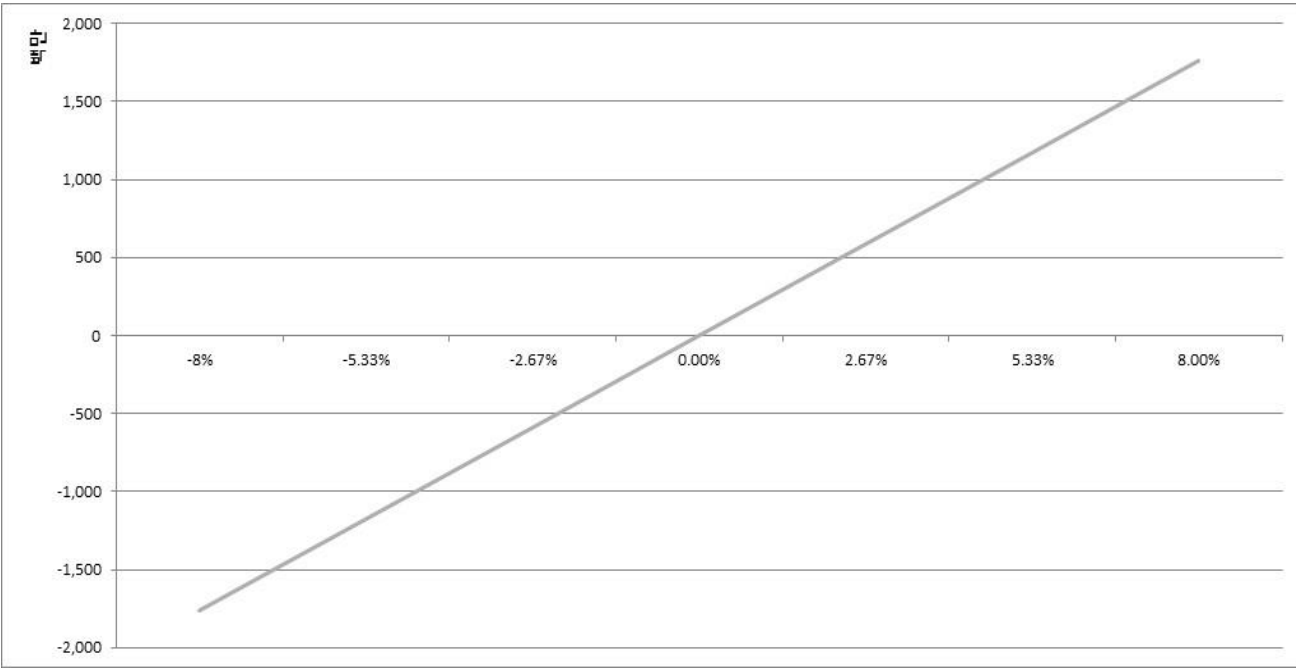
공시일: 2025-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0      | 174   | -174      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 22,045 | 0     | 22,045    | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 3      | 0     | 3         | 장외 |
| 합계 |      |      | 22,048 | 0     | 22,048    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,766

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,447

## 펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

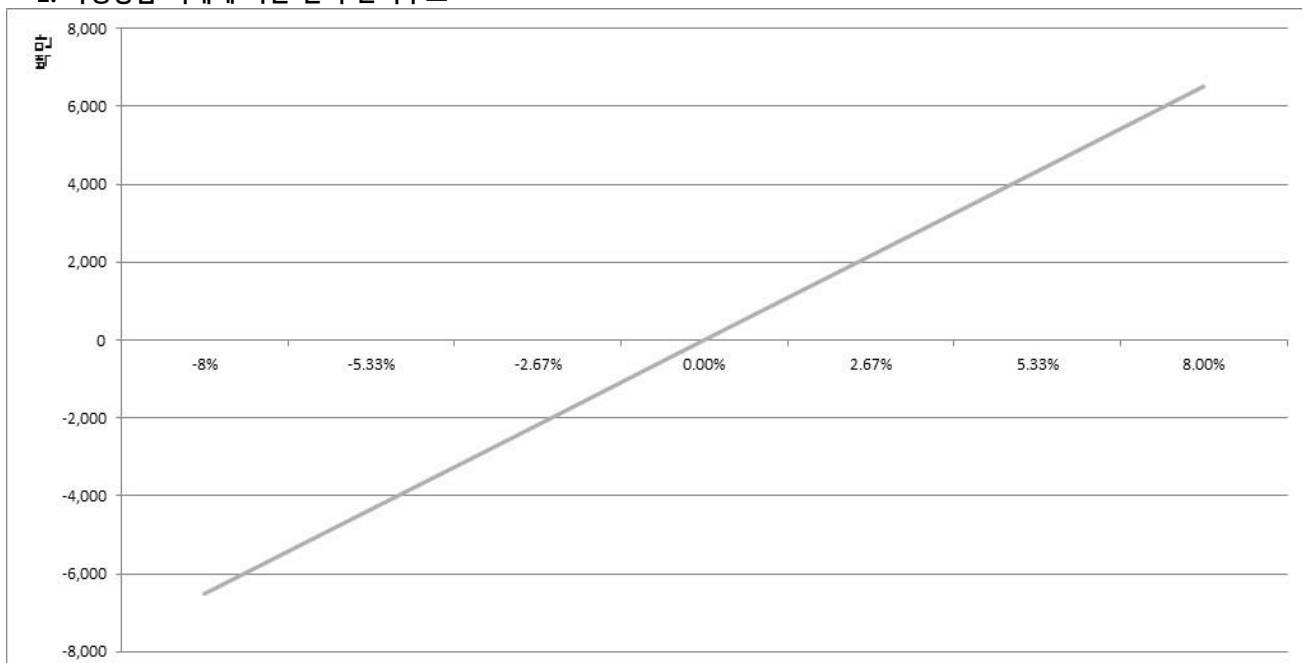
공시일: 2025-05-14

### 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   | 81,411 | 0     | 81,411    | 장외 |
| 합계 |      |      | 81,411 | 0     | 81,411    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,513

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52