

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

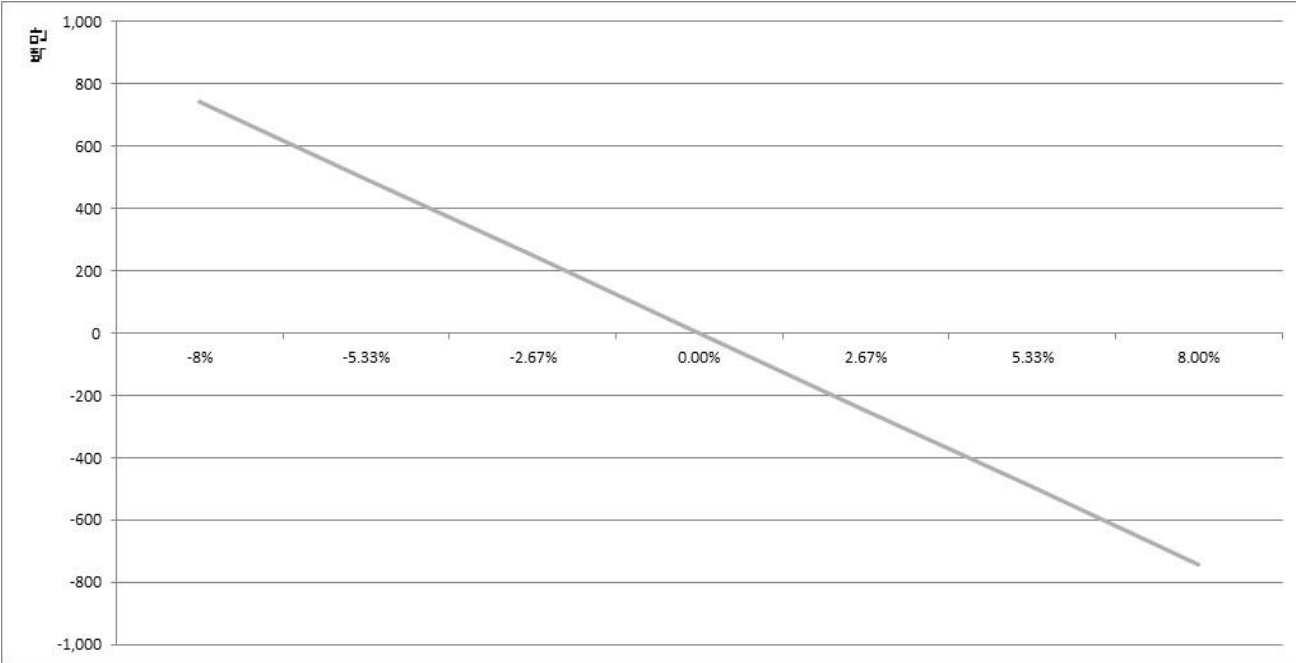
공시일: 2025-05-15

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	9,288	-9,288	장내
합계			0	9,288	-9,288	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

744

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,467

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

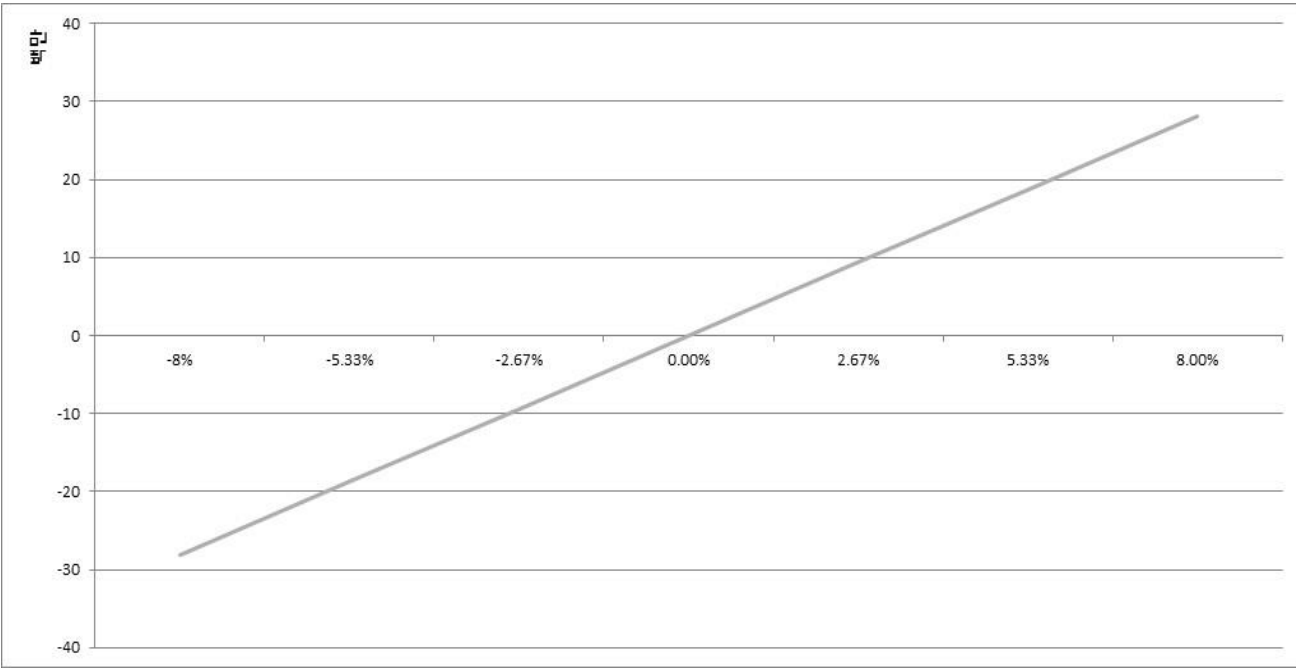
공시일: 2025-05-15

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	352	0	352	장내
신규	유가증권	선물	34	0	34	장내
누계	유가증권	선물	77	34	44	장내
합계			429	34	396	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

718

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

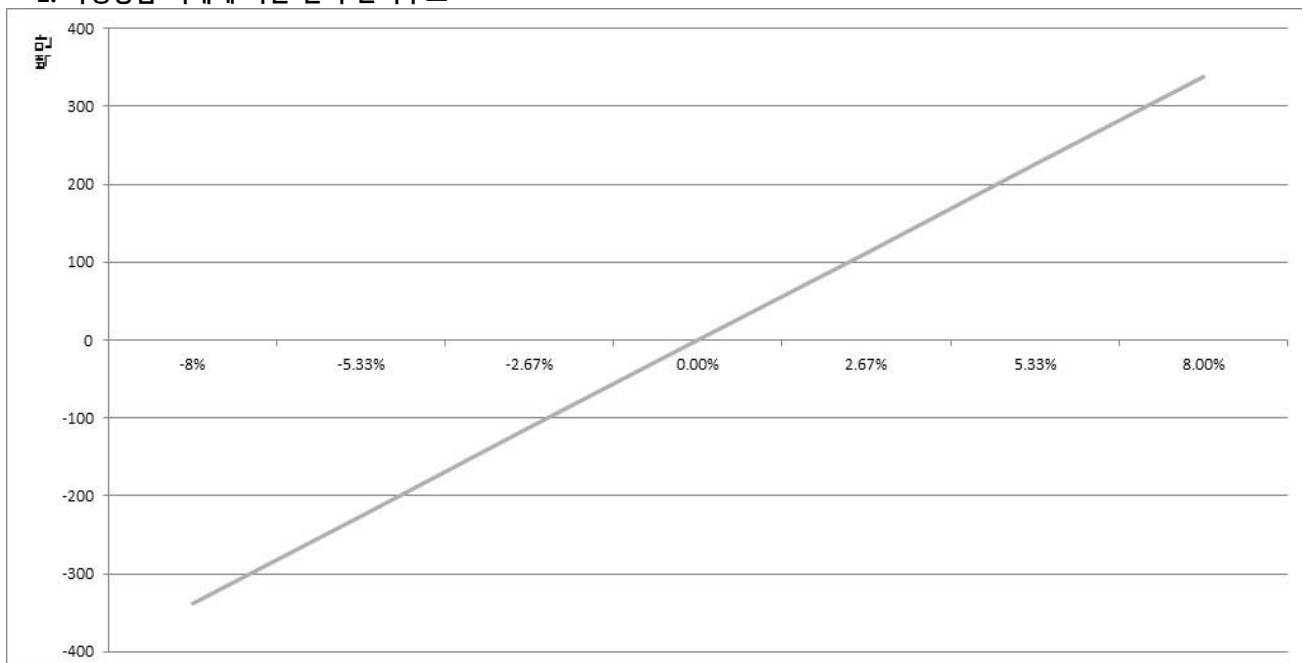
공시일: 2025-05-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	88	-88	장내
누계	주가지수	선물	4,221	0	4,221	장내
합계			4,221	0	4,221	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

338

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

874

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

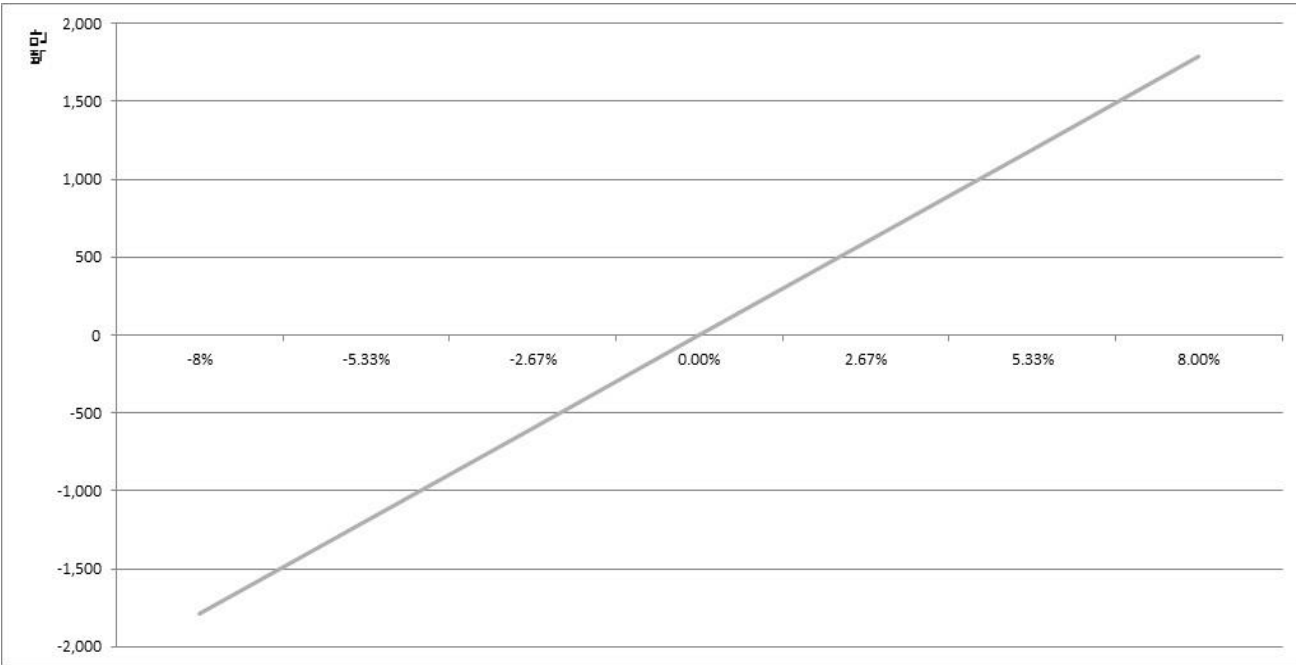
공시일: 2025-05-15

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	22,339	0	22,339	장내
합계			22,339	0	22,339	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,788

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,400

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

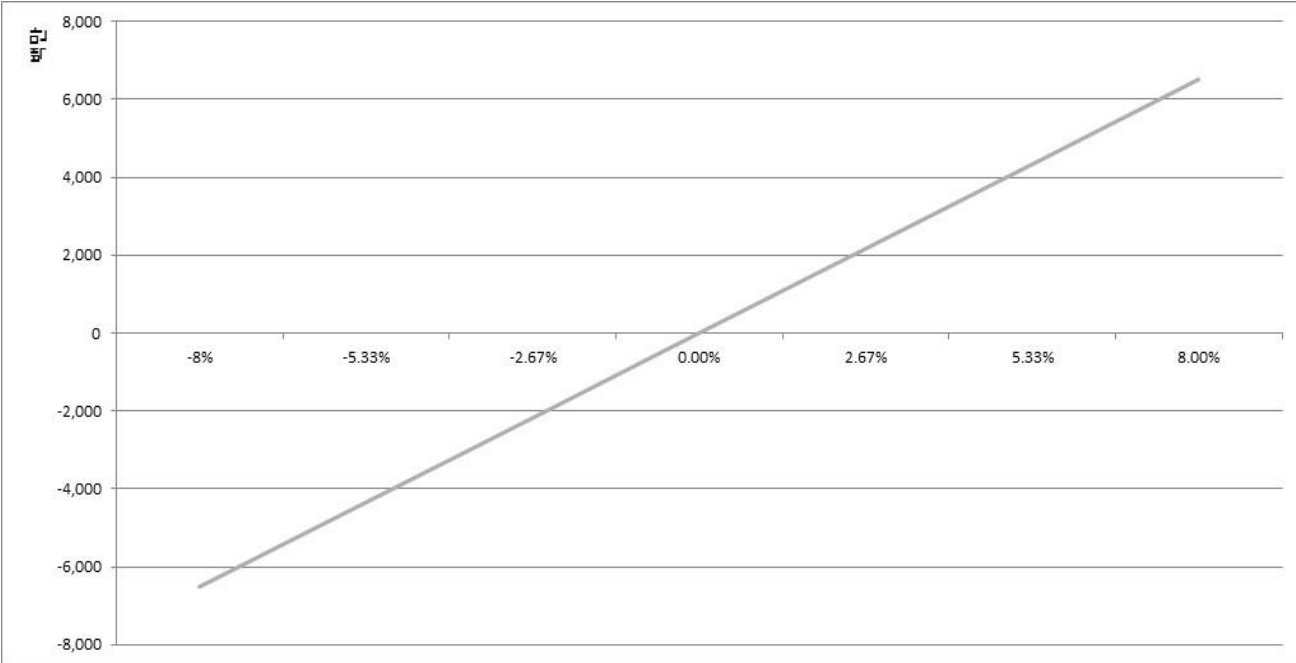
공시일: 2025-05-15

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	81,417	0	81,417	장외
합계			81,417	0	81,417	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,513

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

52