

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

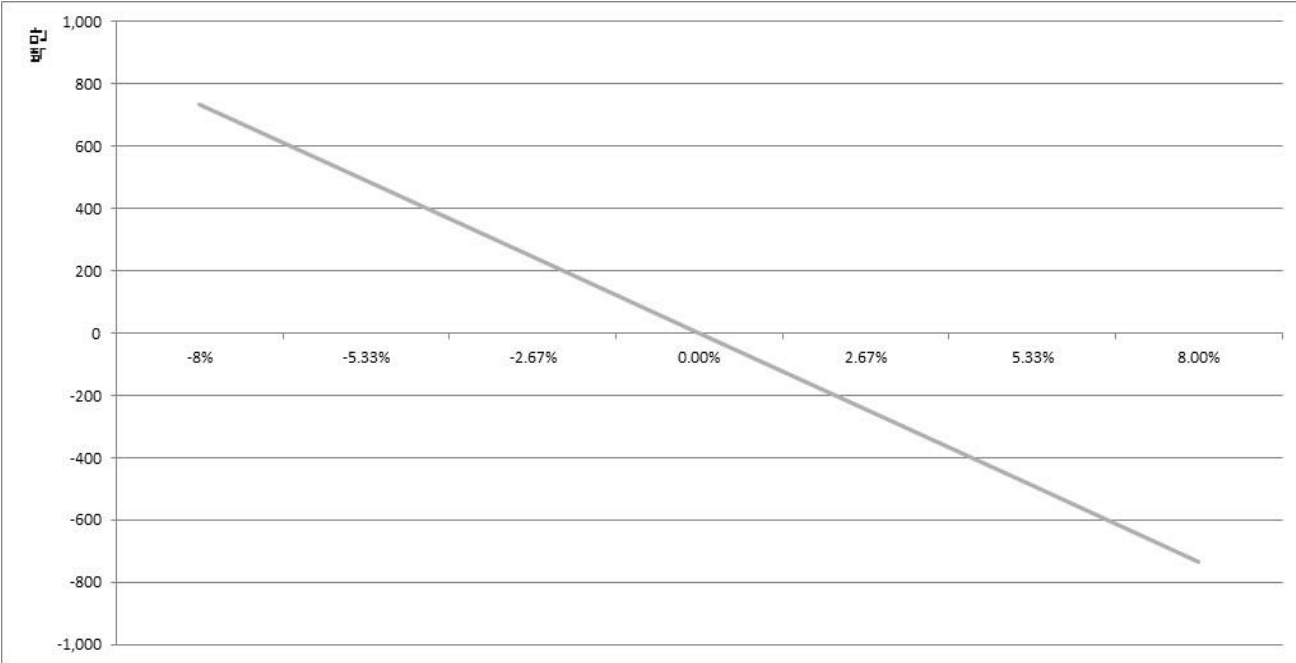
공시일: 2025-05-16

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	9,218	-9,218	장내
합계			0	9,218	-9,218	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

736

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,433

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

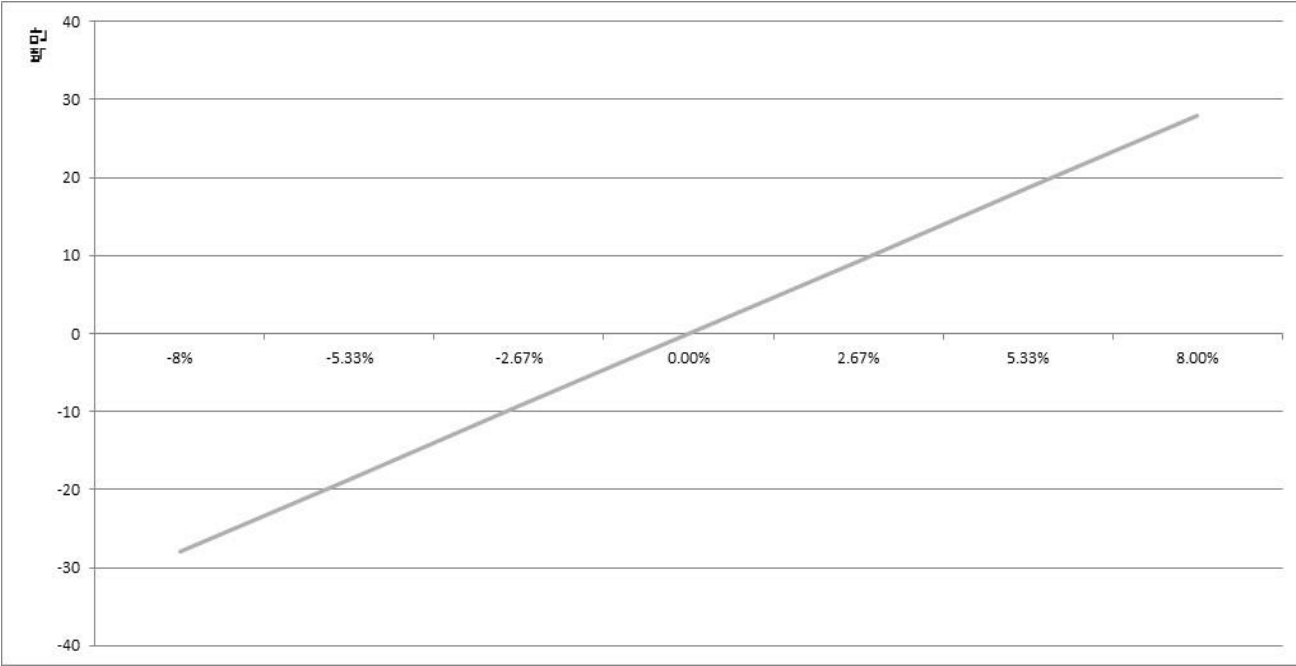
공시일: 2025-05-16

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	349	0	349	장내
신규	유가증권	선물	13	13	0	장내
누계	유가증권	선물	77	34	43	장내
합계			426	34	392	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

712

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

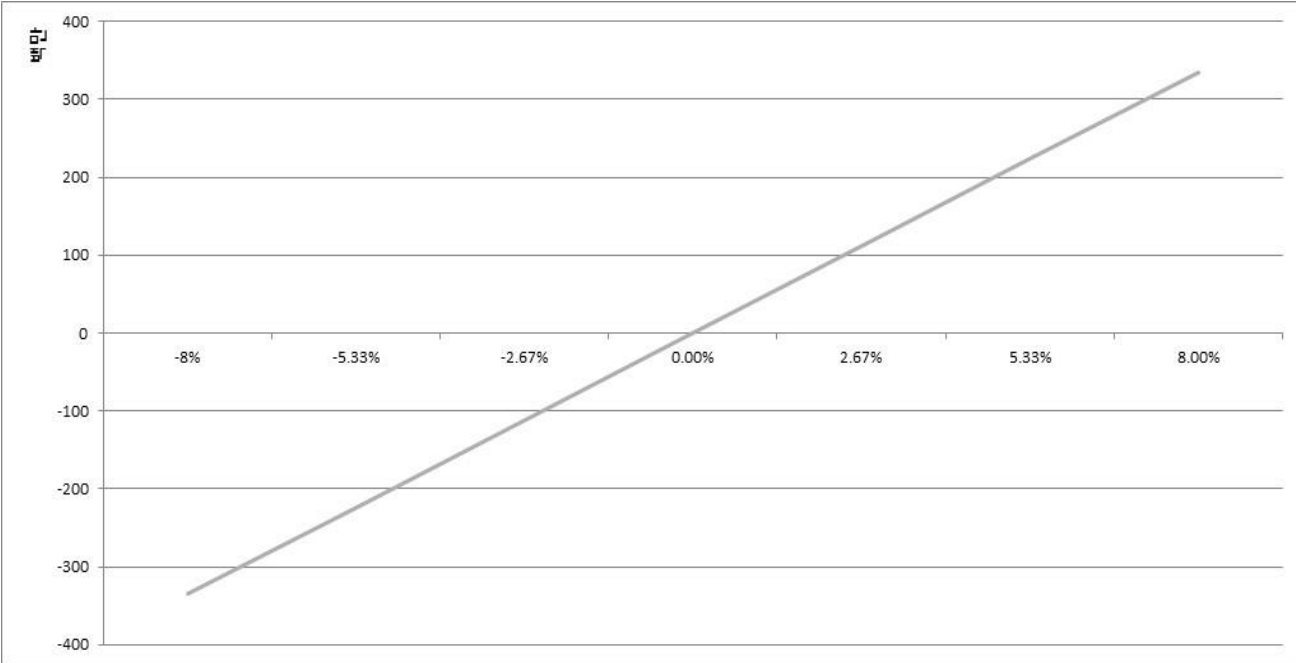
공시일: 2025-05-16

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	4,190	0	4,190	장내
합계			4,190	0	4,190	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

335

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

867

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

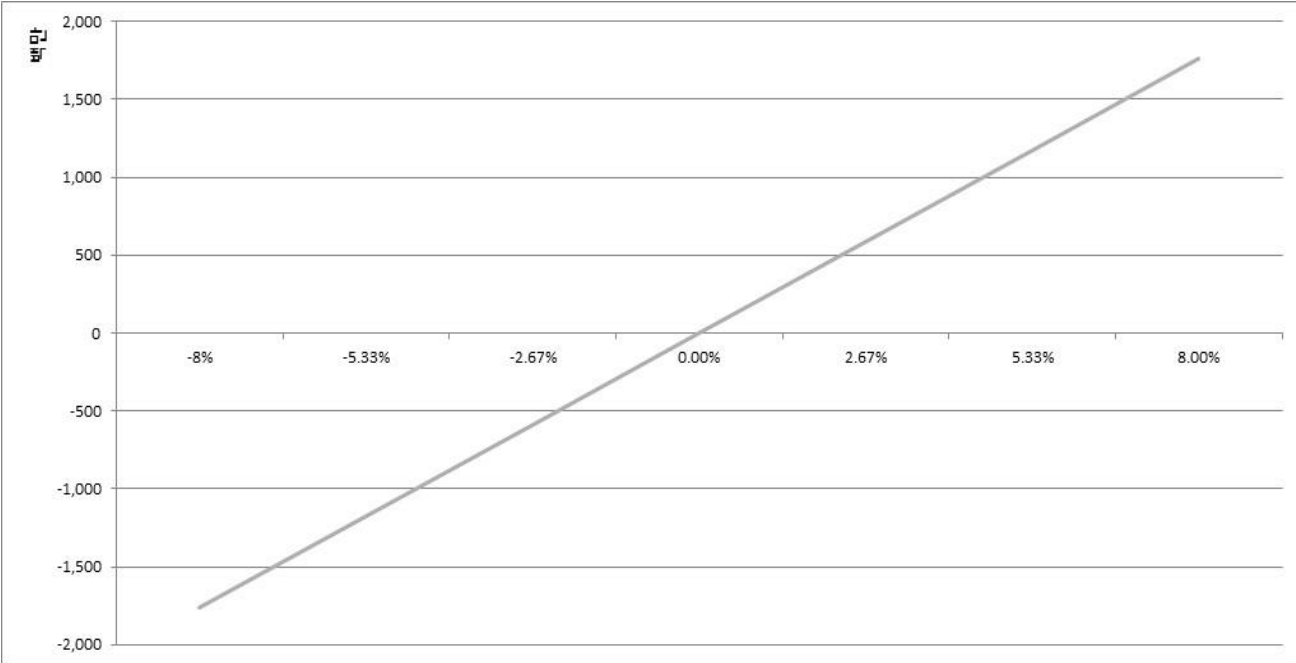
공시일: 2025-05-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	175	-175	장내
누계	주가지수	선물	21,997	0	21,997	장내
합계			21,997	0	21,997	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,761

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,349

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

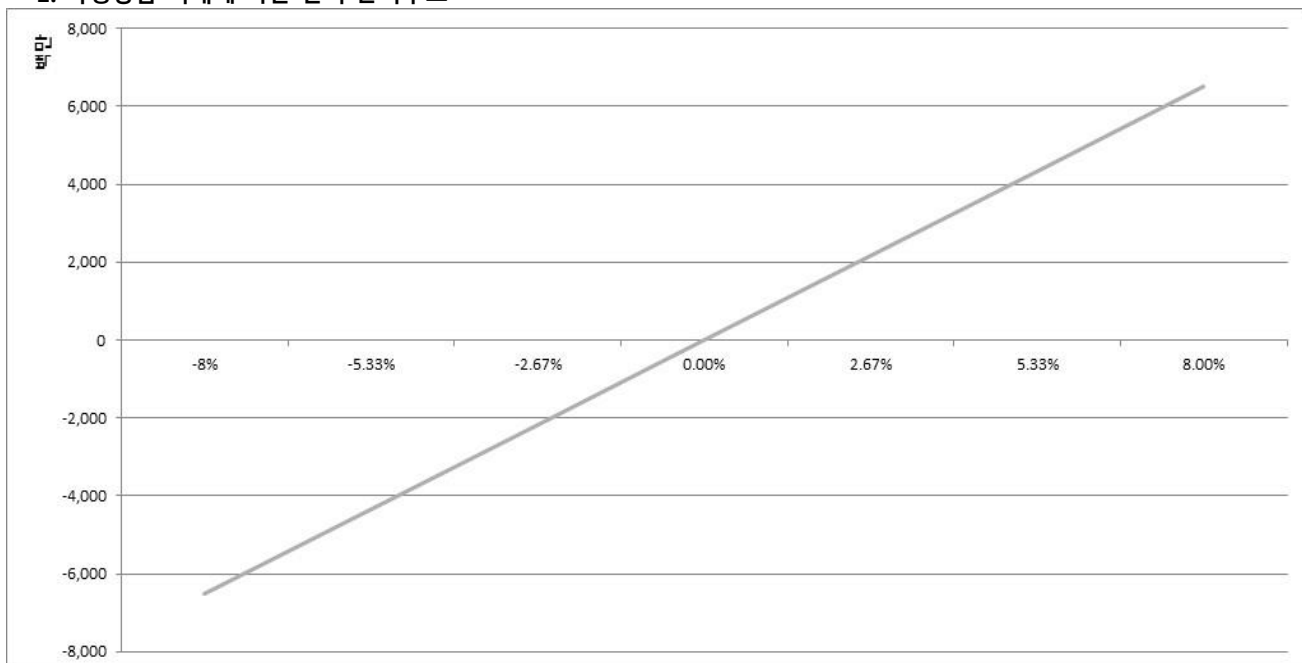
공시일: 2025-05-16

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	81,423	0	81,423	장외
합계			81,423	0	81,423	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,514

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52