

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

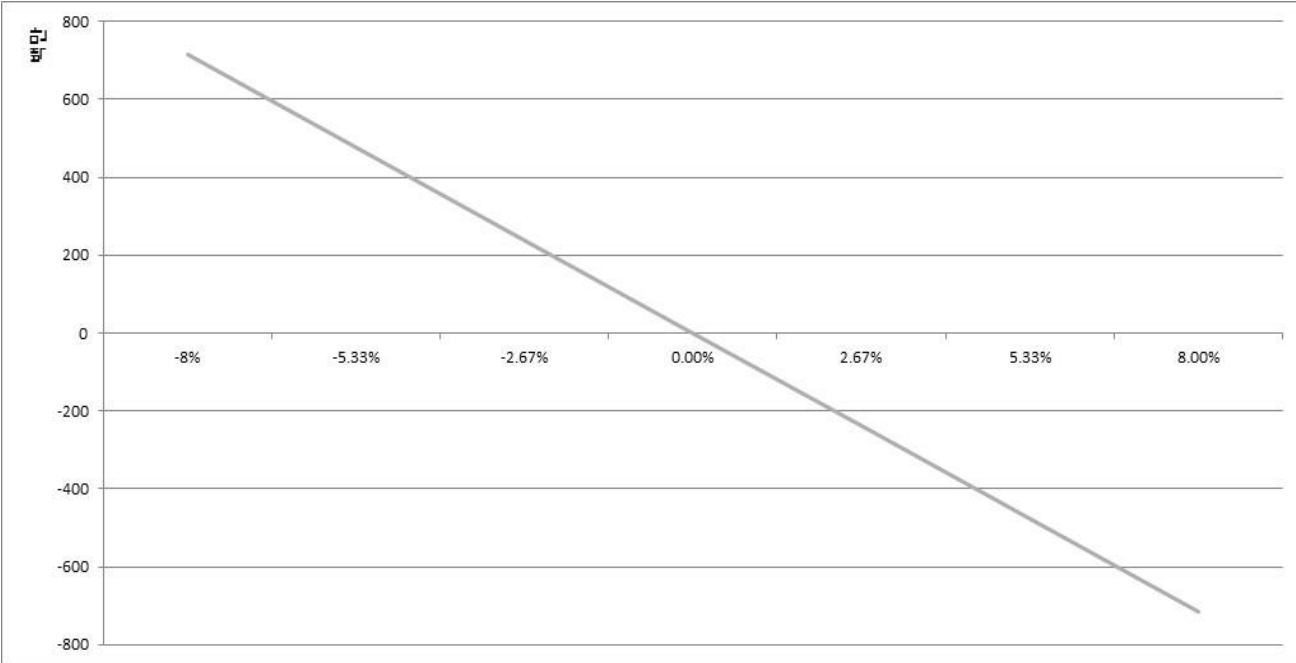
공시일: 2025-05-20

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	8,939	-8,939	장내
합계			0	8,939	-8,939	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

716

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,247

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

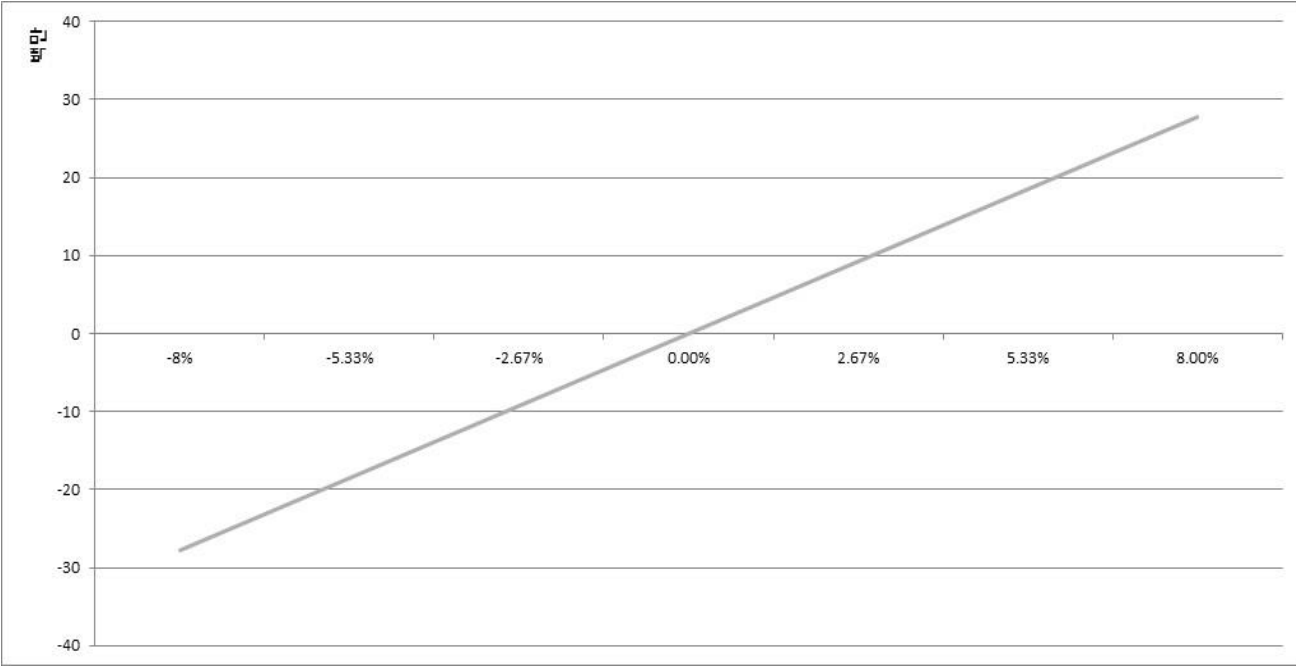
공시일: 2025-05-20

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	347	0	347	장내
신규	유가증권	선물	26	3	23	장내
누계	유가증권	선물	101	37	64	장내
합계			448	37	411	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

706

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

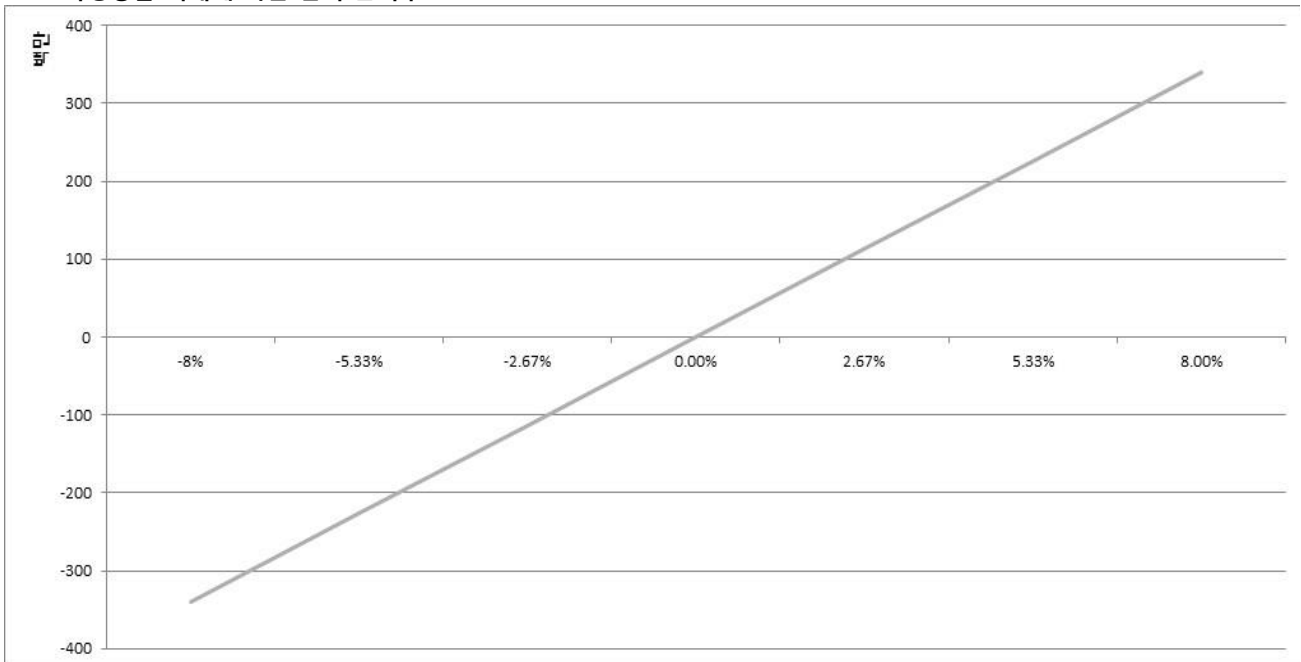
공시일: 2025-05-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	87	-87	장내
누계	주가지수	선물	4,245	0	4,245	장내
합계			4,245	0	4,245	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

339

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

868

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

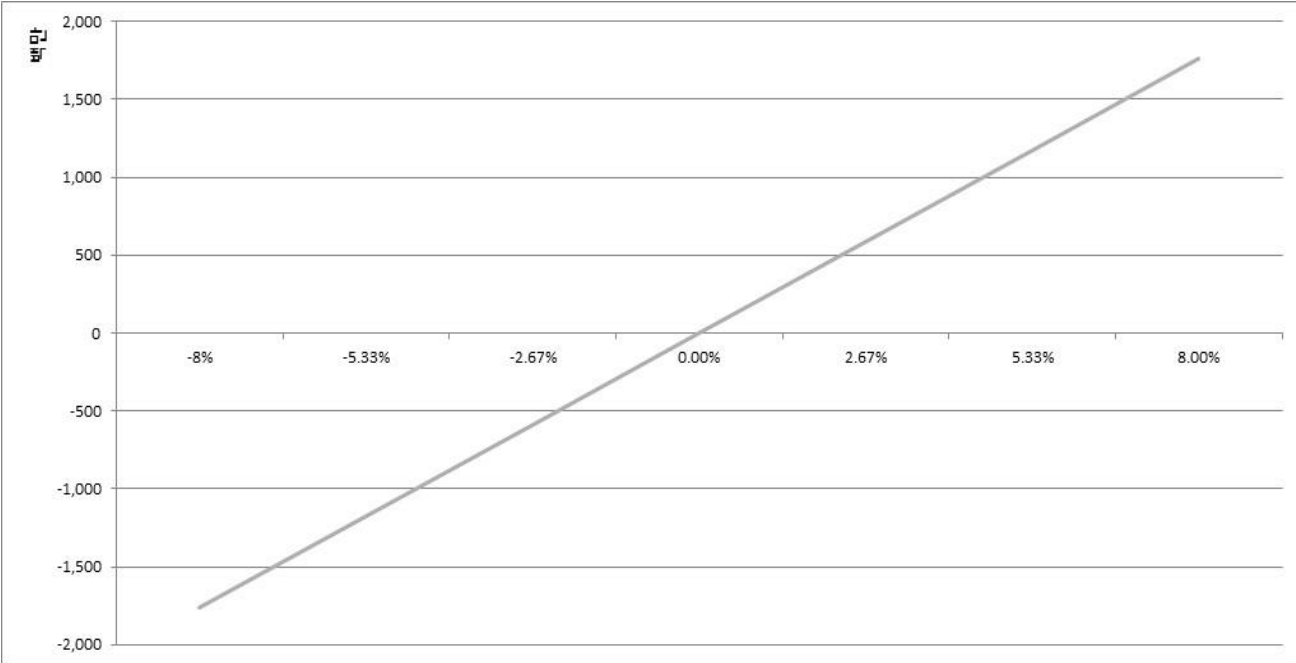
공시일: 2025-05-20

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	22,007	0	22,007	장내
합계			22,007	0	22,007	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,758

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,339

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

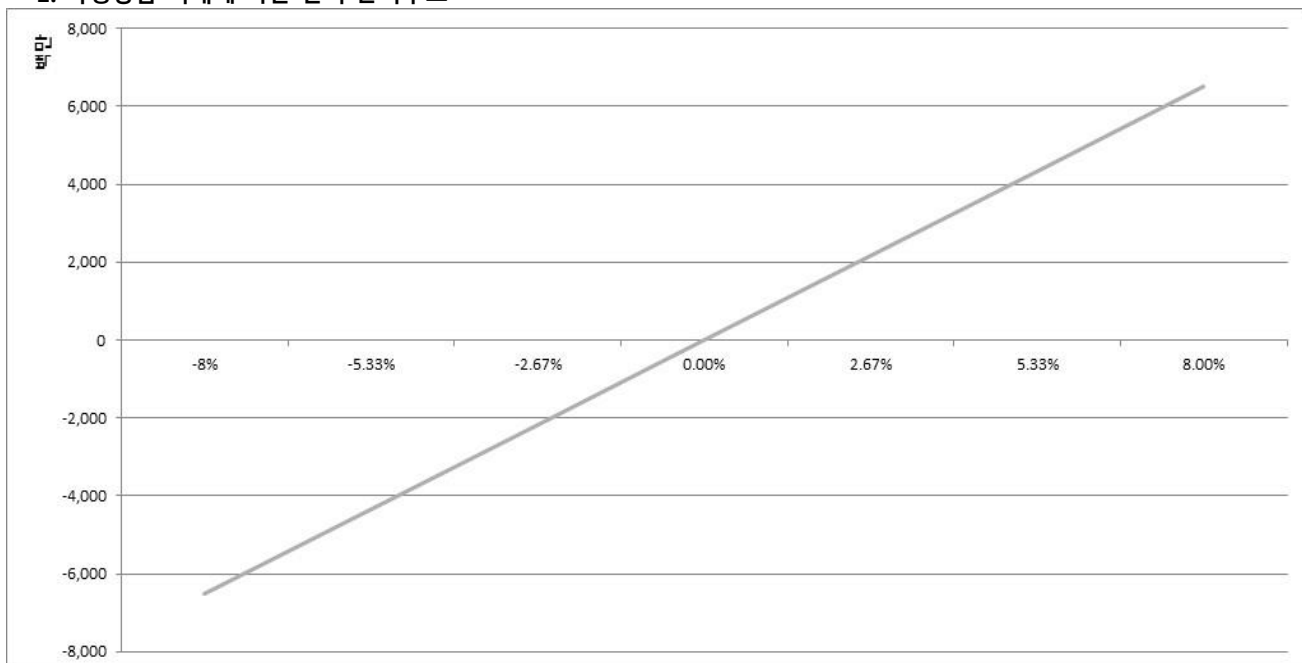
공시일: 2025-05-20

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	81,447	0	81,447	장외
합계			81,447	0	81,447	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,516

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52