

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

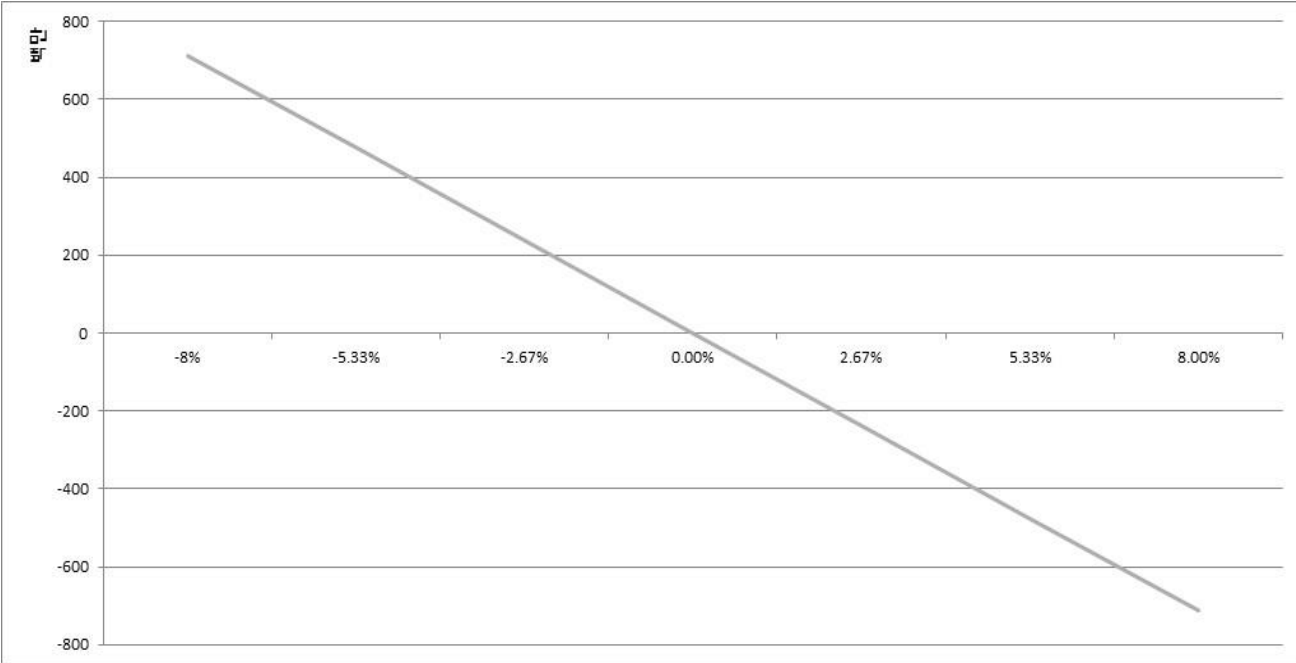
공시일: 2025-05-21

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	8,912	-8,912	장내
합계			0	8,912	-8,912	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

713

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,273

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

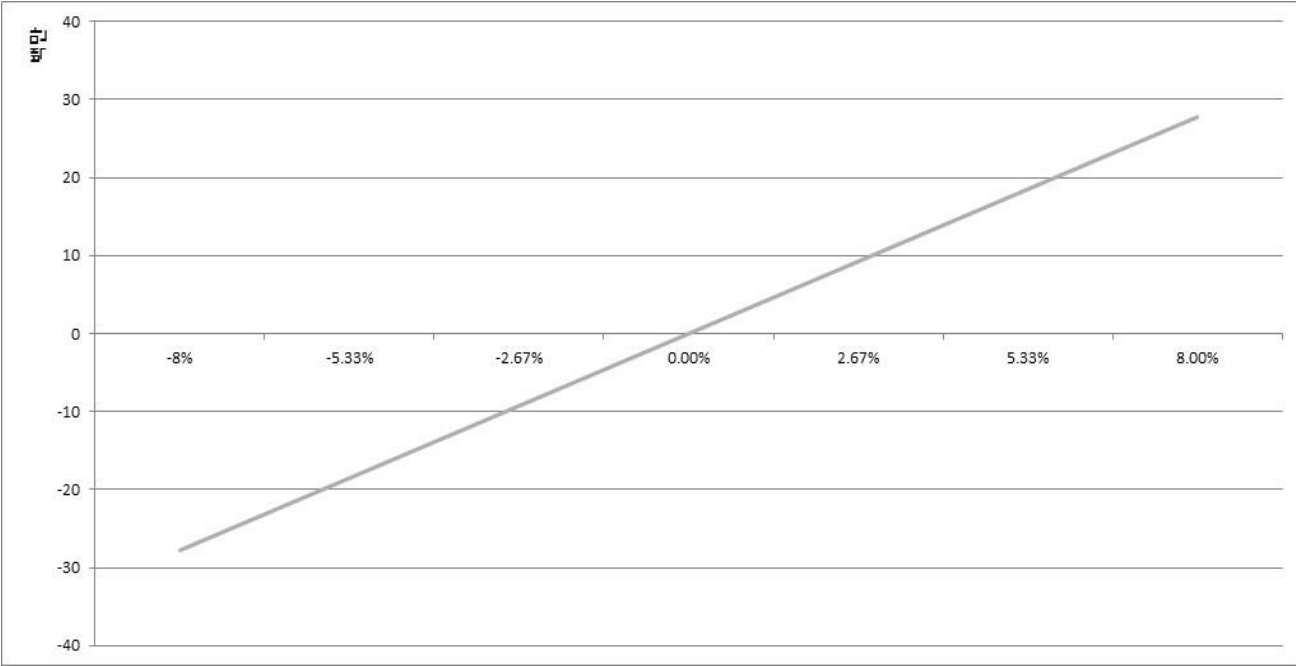
공시일: 2025-05-21

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	0	8	-8	장내
누계	유가증권	선물	89	36	53	장내
합계			436	36	400	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

701

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

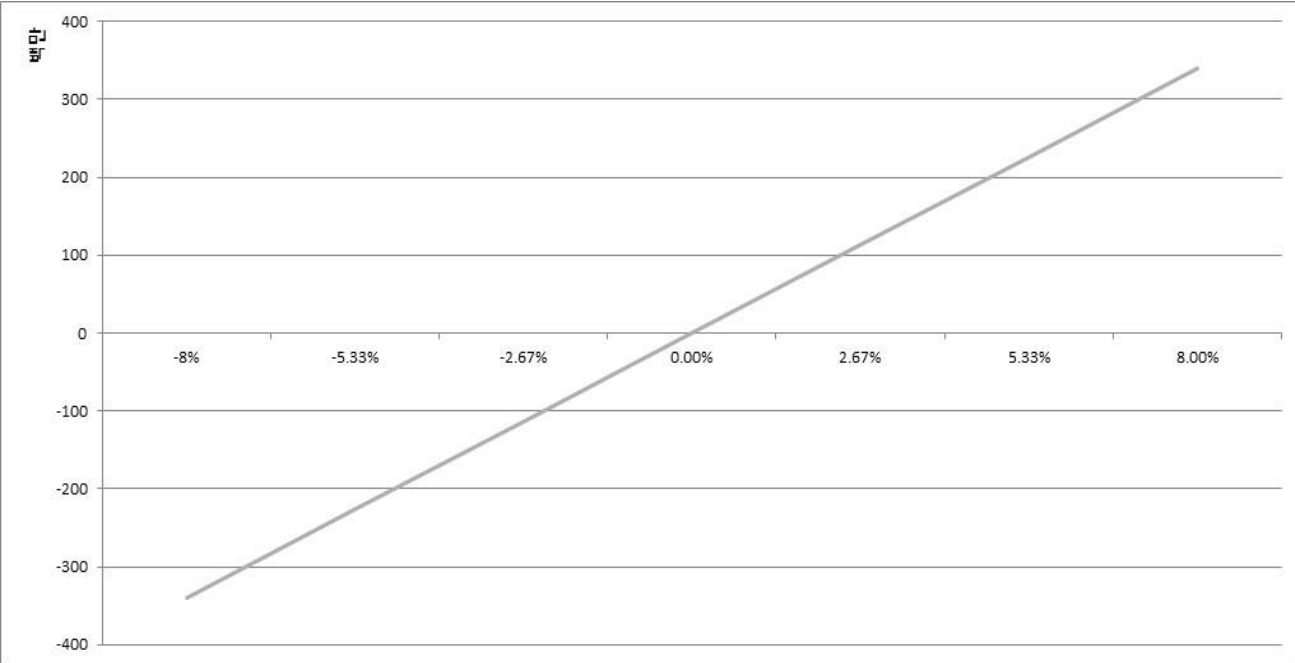
공시일: 2025-05-21

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	4,251	0	4,251	장내
합계			4,251	0	4,251	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

340

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

872

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

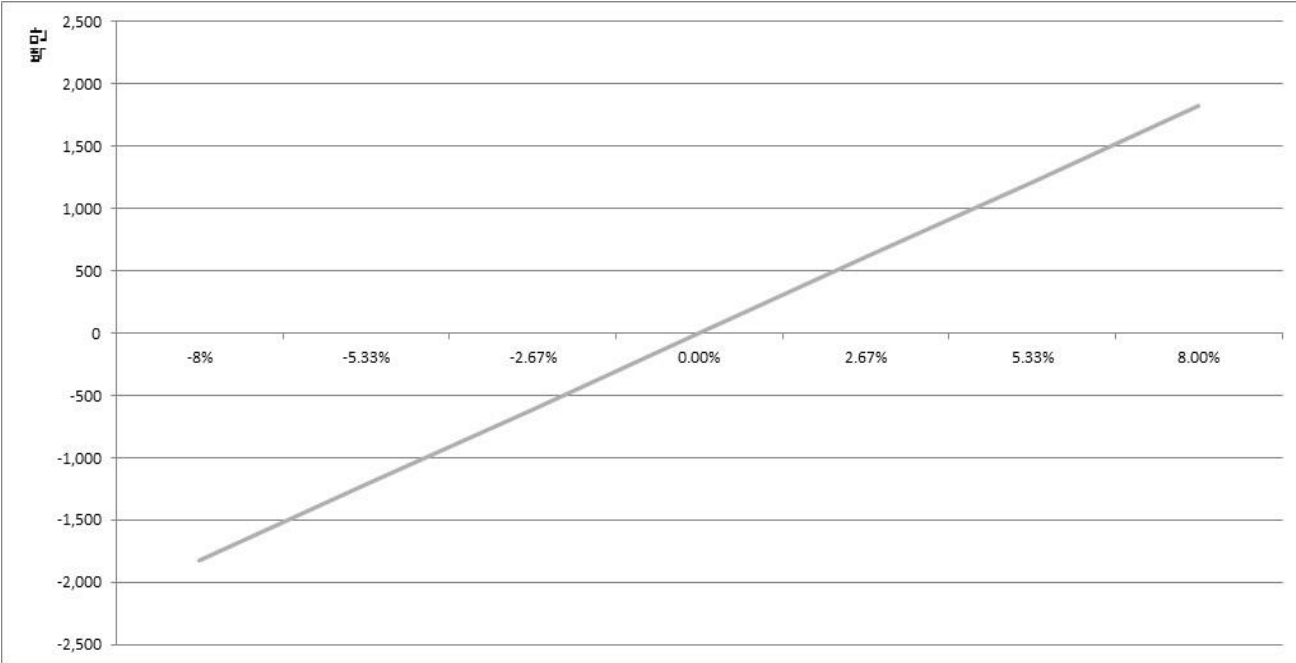
공시일: 2025-05-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	781	0	781	장내
누계	주가지수	선물	22,817	0	22,817	장내
합계			22,817	0	22,817	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,827

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,437

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

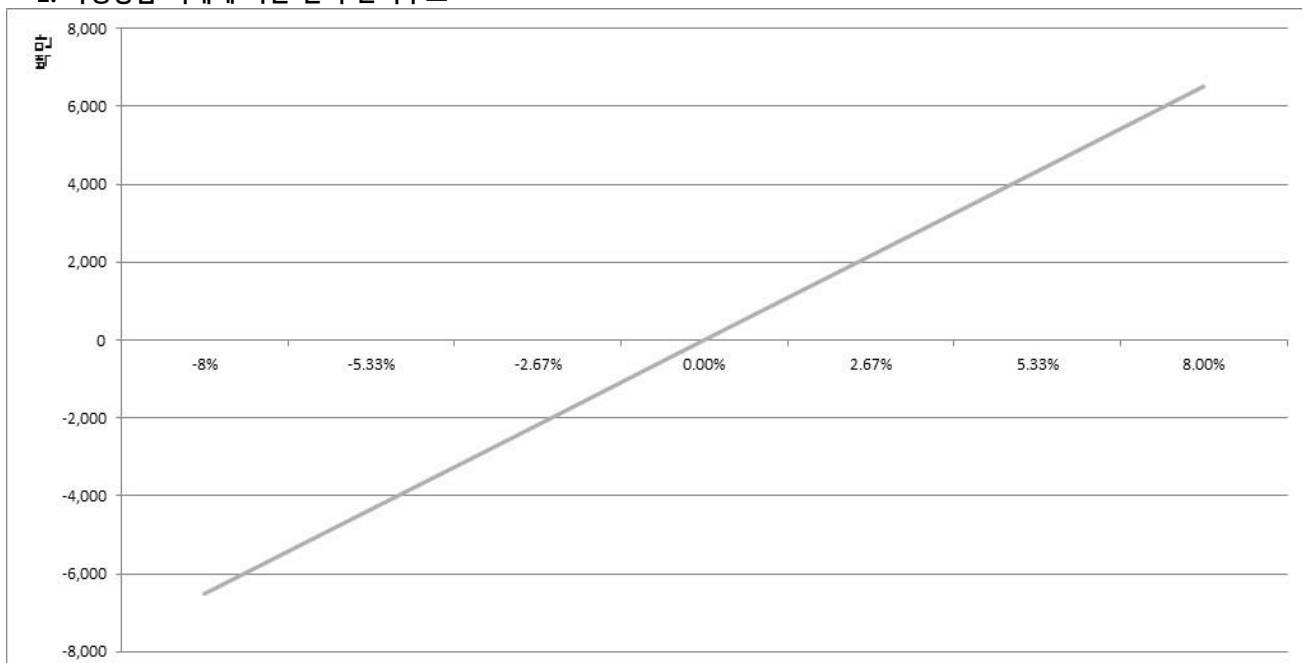
공시일: 2025-05-21

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	81,453	0	81,453	장외
합계			81,453	0	81,453	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,516

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52