

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

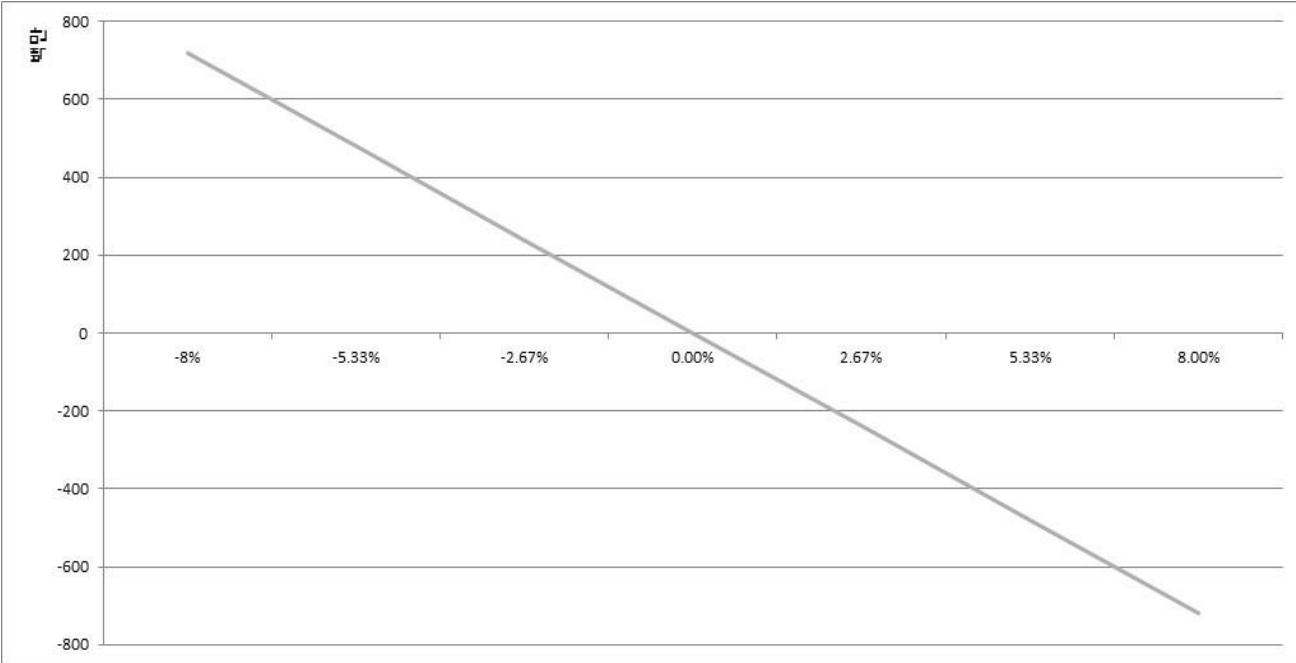
공시일: 2025-05-23

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	8,998	-8,998	장내
합계			0	8,998	-8,998	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

720

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,274

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

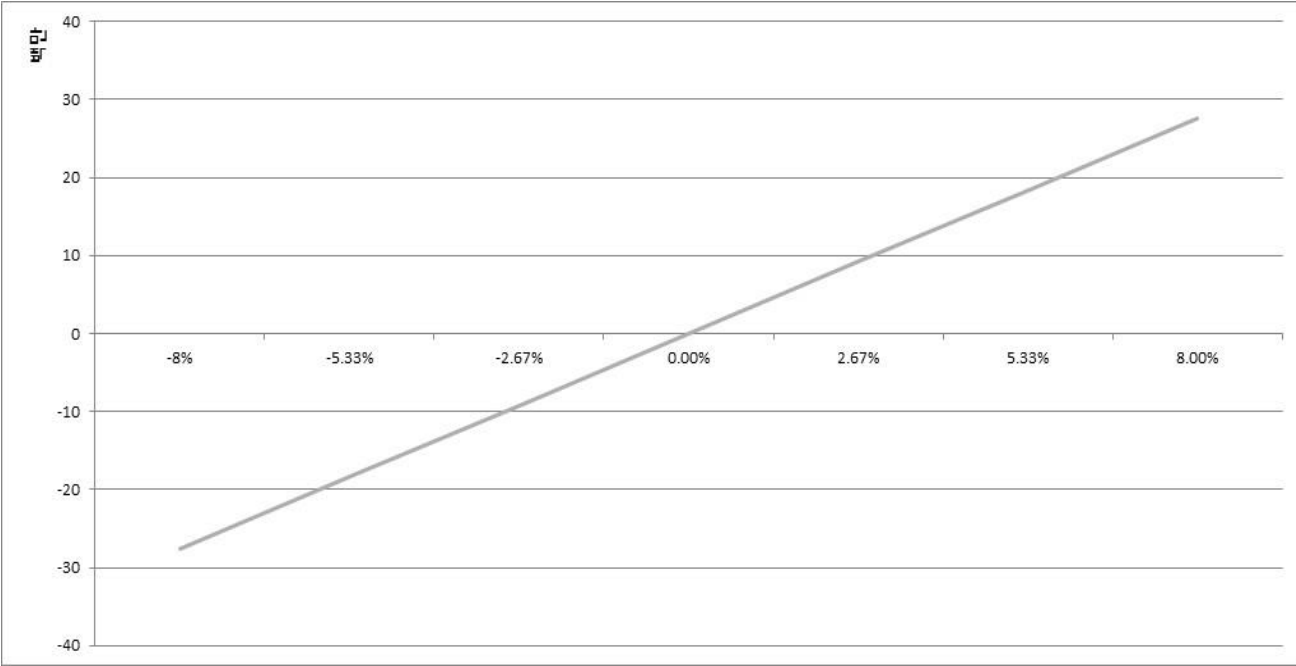
공시일: 2025-05-23

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	345	0	345	장내
신규	유가증권	선물	40	20	21	장내
누계	유가증권	선물	103	28	75	장내
합계			448	28	420	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

709

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

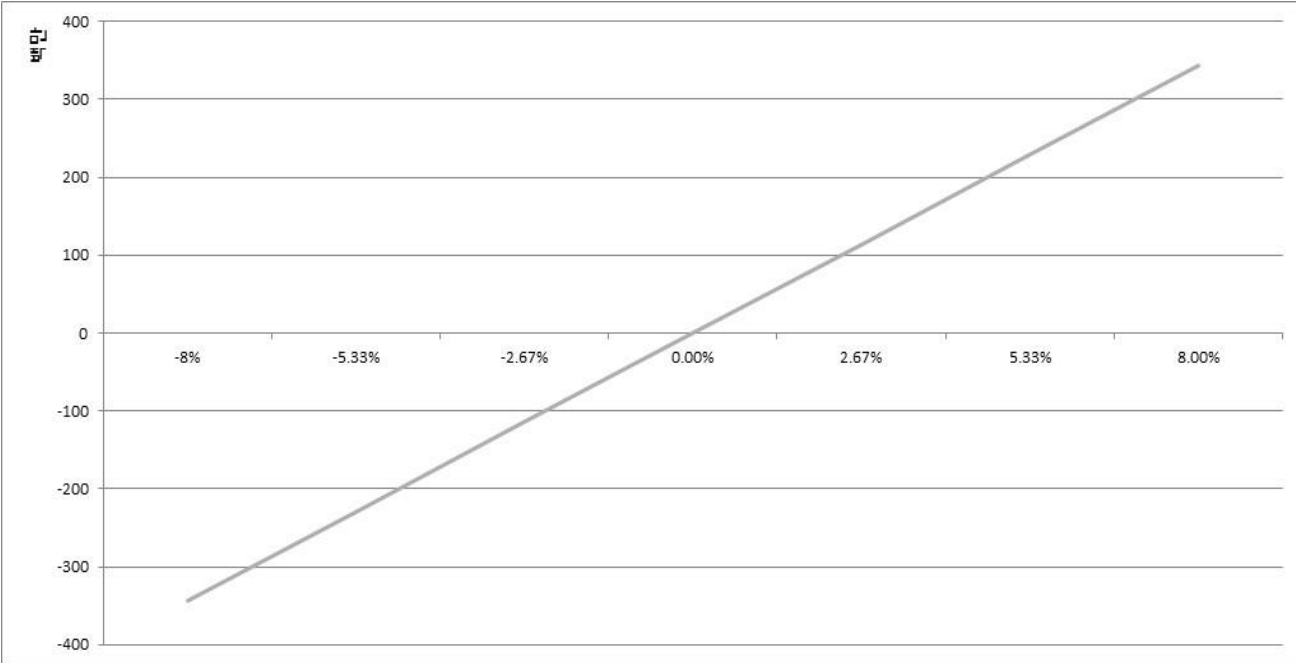
공시일: 2025-05-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	172	0	172	장내
누계	주가지수	선물	4,310	0	4,310	장내
합계			4,310	0	4,310	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

344

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

873

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

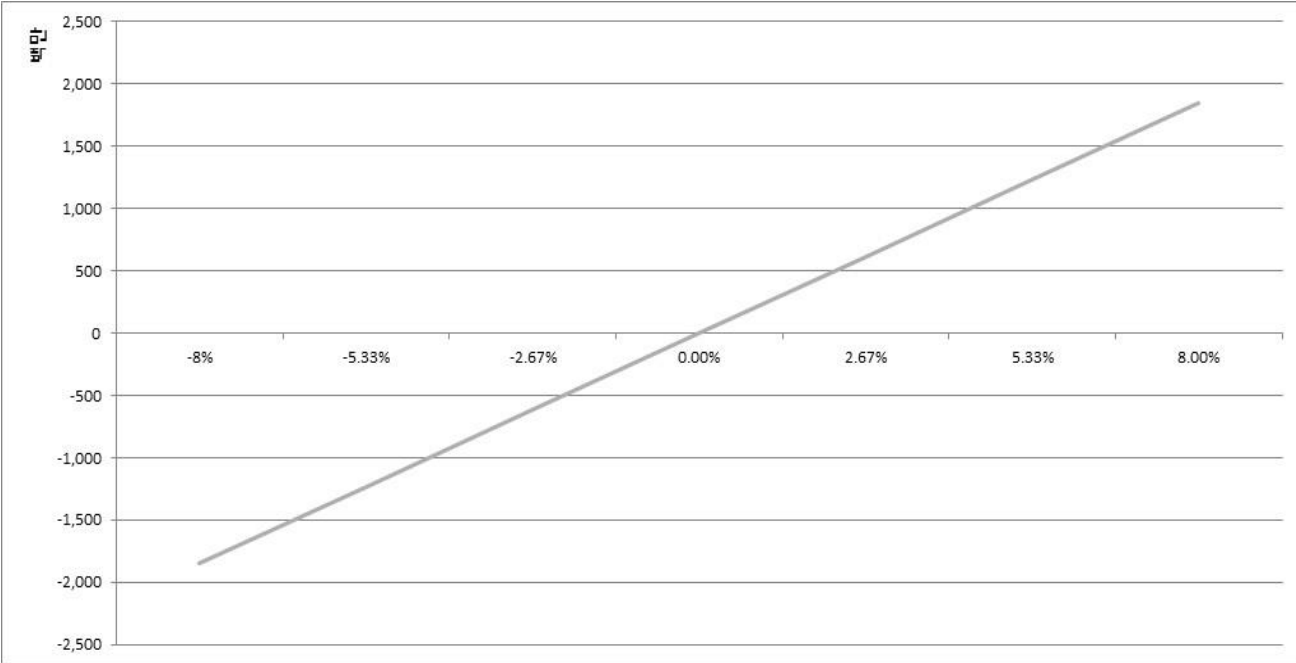
공시일: 2025-05-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	517	0	517	장내
누계	주가지수	선물	23,188	0	23,188	장내
합계			23,188	0	23,188	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,852

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,452

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

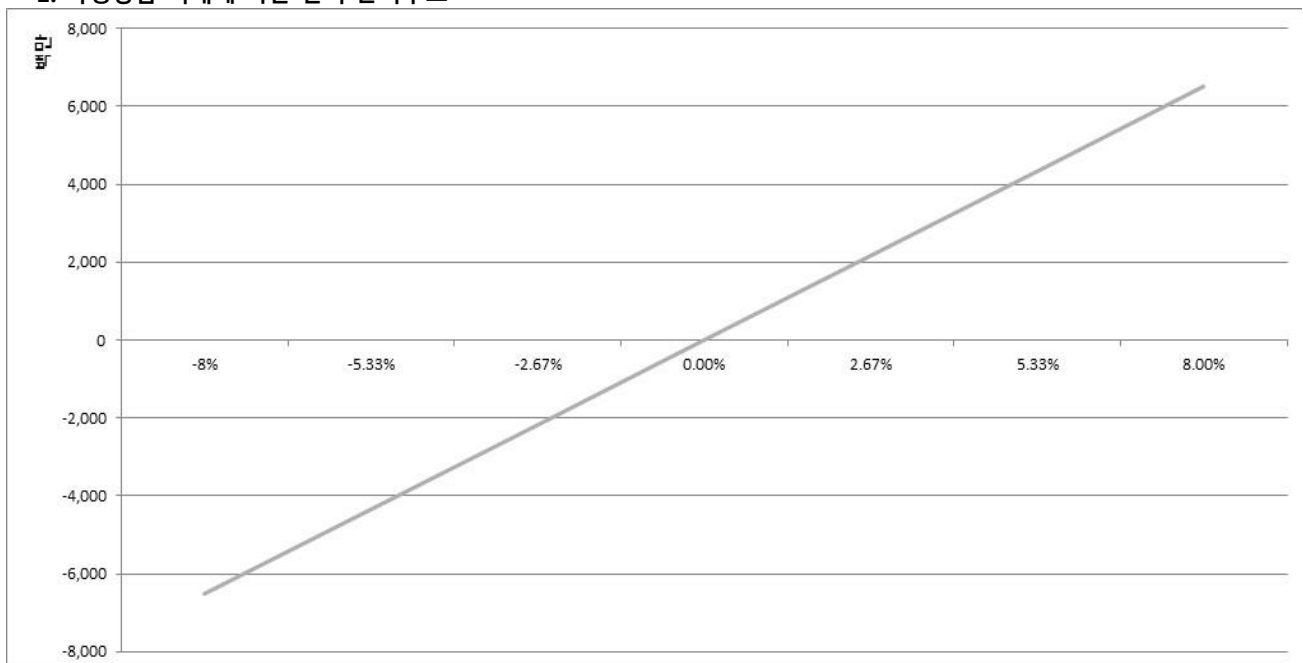
공시일: 2025-05-23

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	81,465	0	81,465	장외
합계			81,465	0	81,465	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,517

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52