

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

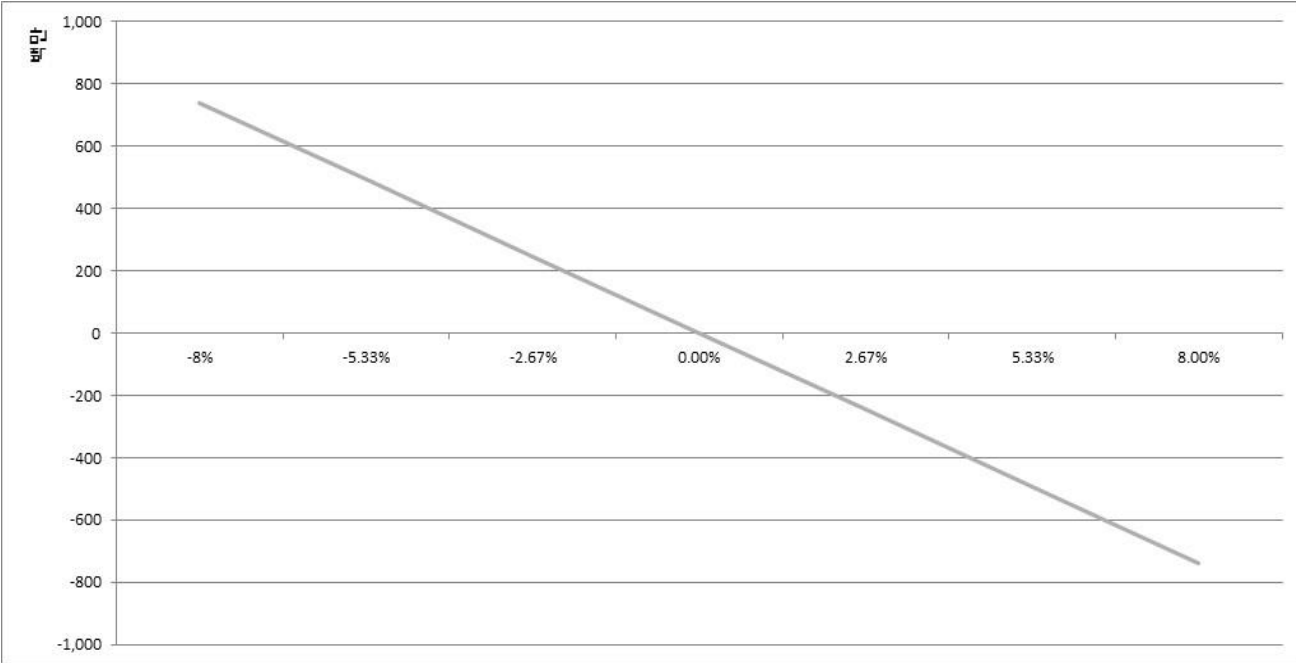
공시일: 2025-05-28

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     | 9,190 | -9,190    | 장내 |
| 합계 |      |      | 0     | 9,190 | -9,190    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

738

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,990

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

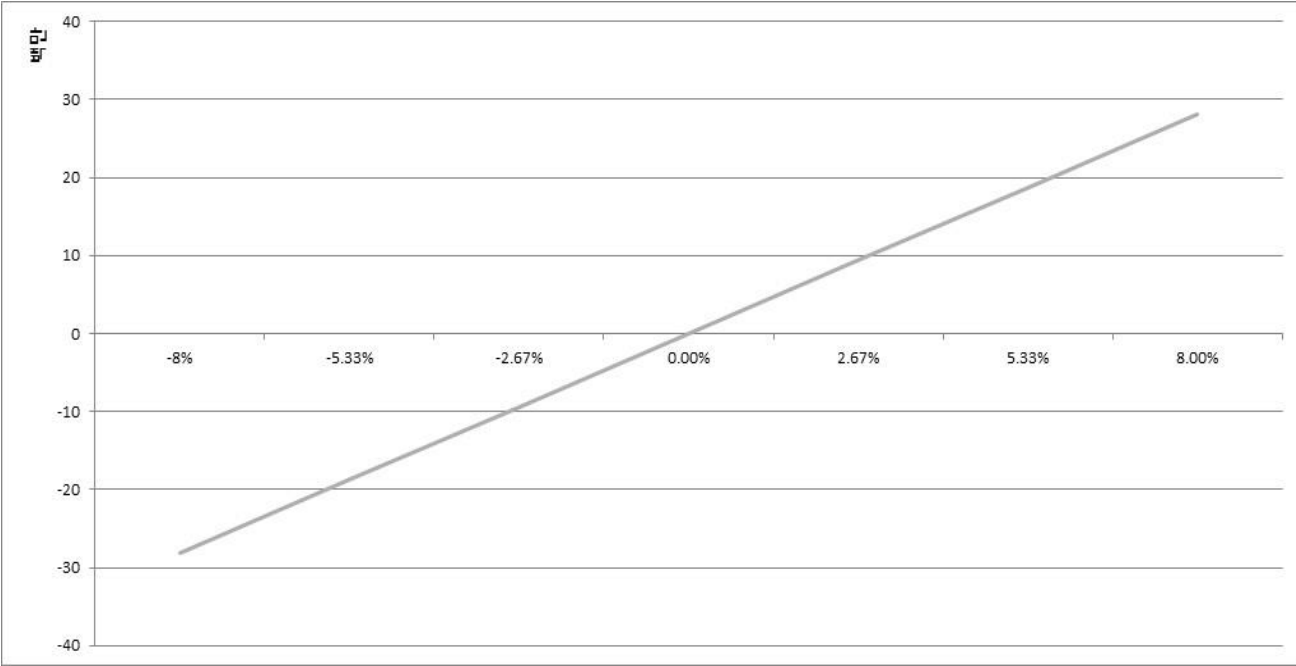
공시일: 2025-05-28

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   | 351   | 0     | 351       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 22    | 9     | 13        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 118   | 30    | 88        | 장내 |
| 합계 |      |      | 469   | 30    | 439       |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

725

## 펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

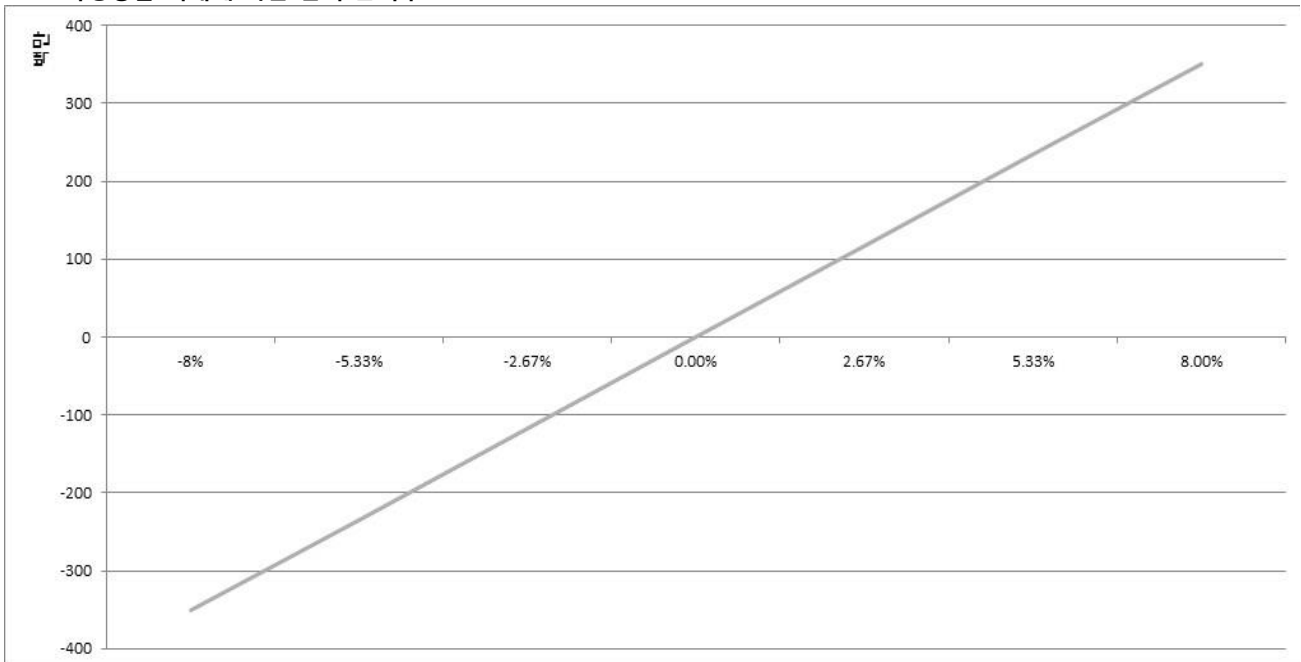
공시일: 2025-05-28

### 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   | 4,391 | 0     | 4,391     | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,391 | 0     | 4,391     |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

351

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

889

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

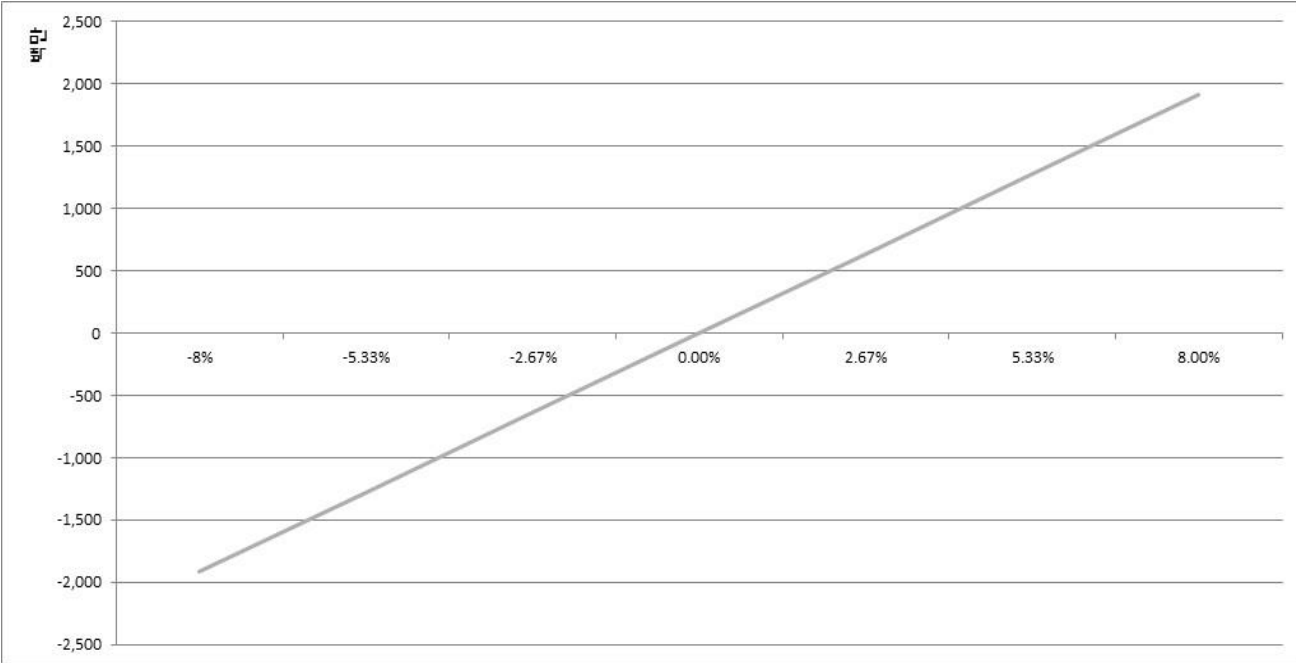
공시일: 2025-05-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 263    | 0     | 263       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 23,887 | 0     | 23,887    | 장내 |
| 합계 |      |      | 23,887 | 0     | 23,887    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,912

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,562

## 펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

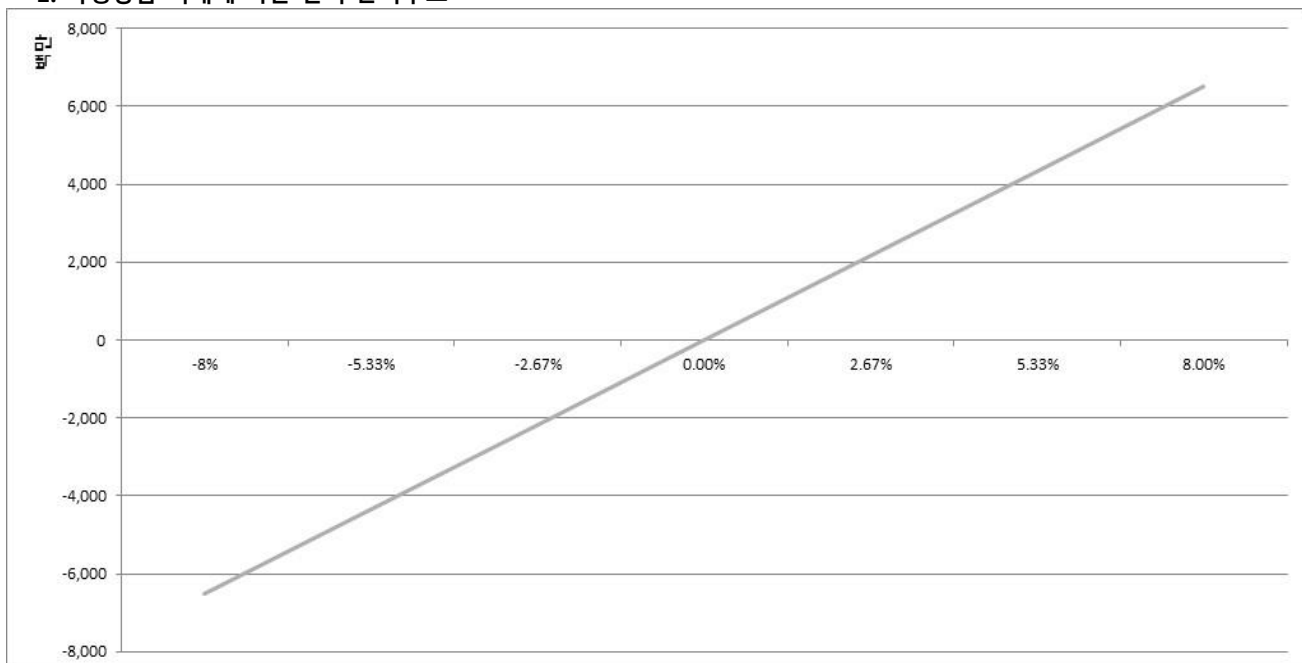
공시일: 2025-05-28

### 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   | 81,495 | 0     | 81,495    | 장외 |
| 합계 |      |      | 81,495 | 0     | 81,495    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,520

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52