

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

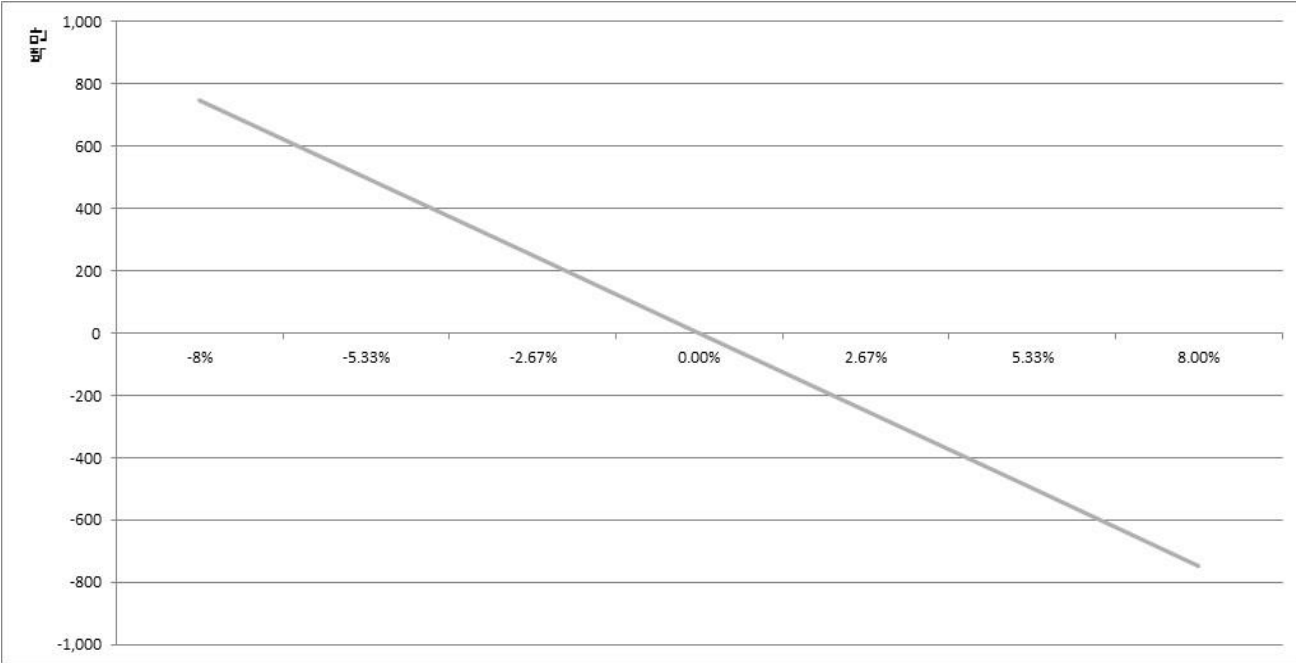
공시일: 2025-06-02

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	9,303	-9,303	장내
합계			0	9,303	-9,303	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

746

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,950

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

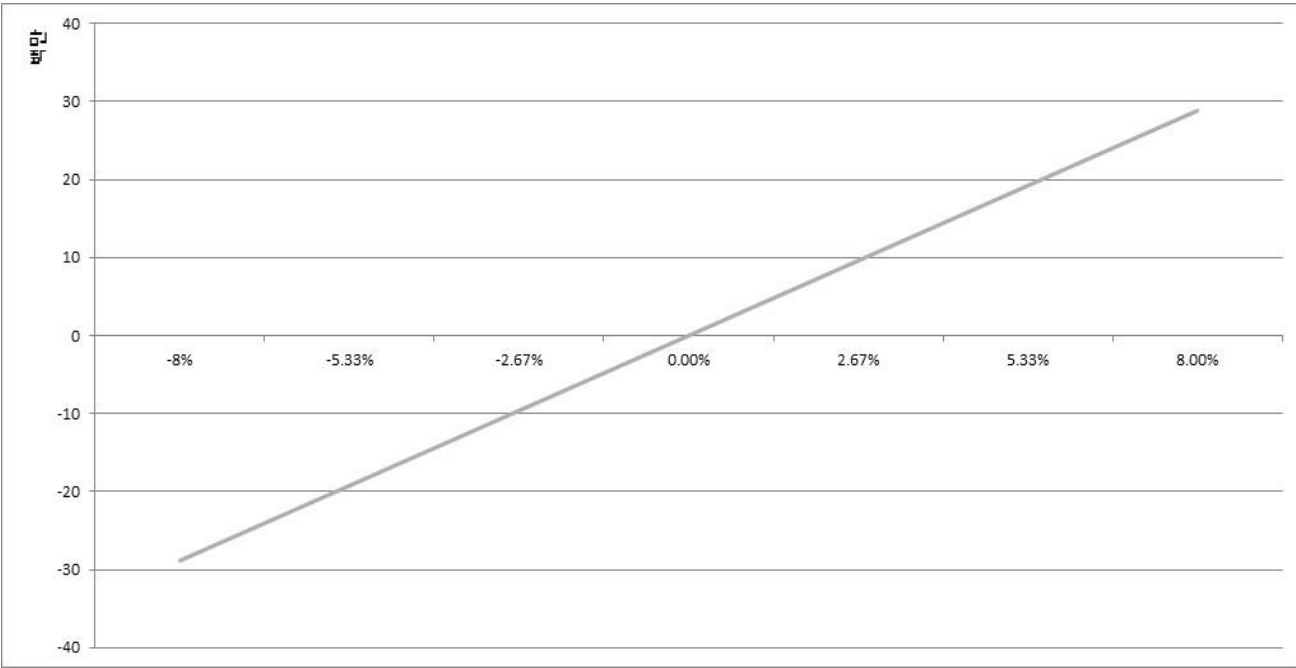
공시일: 2025-06-02

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	360	0	360	장내
신규	유가증권	선물	17	15	2	장내
누계	유가증권	선물	148	47	102	장내
합계			508	47	461	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

742

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

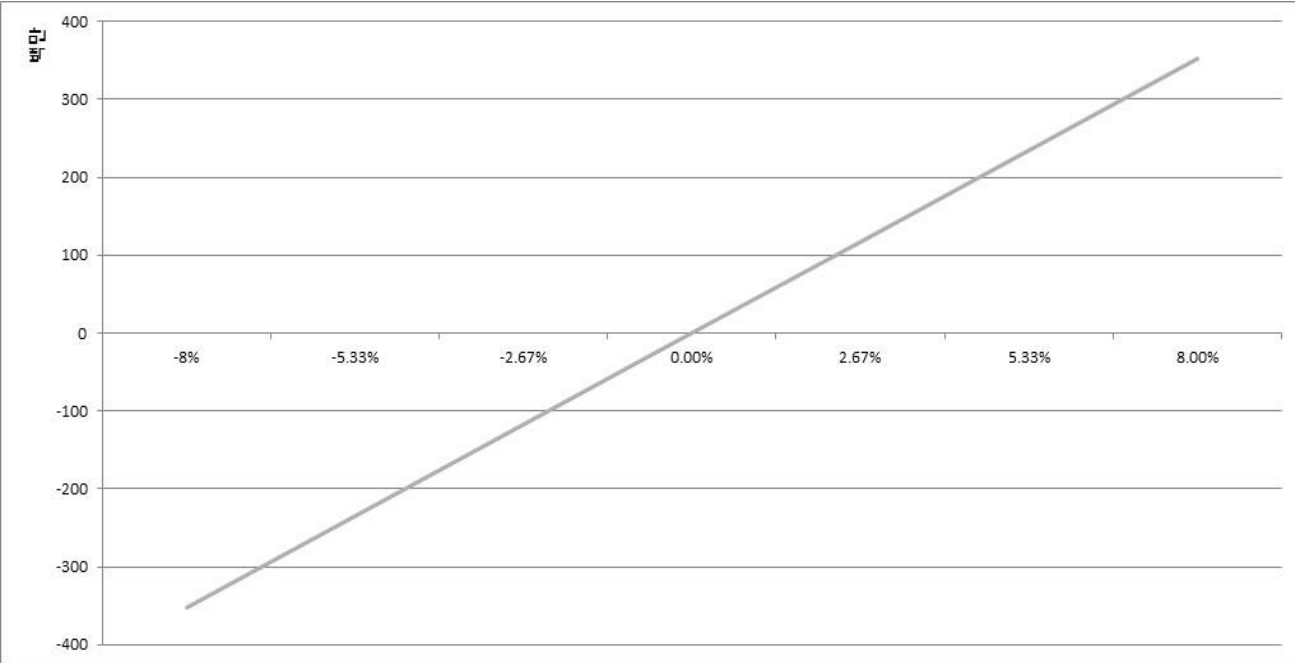
공시일: 2025-06-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	180	0	180	장내
누계	주가지수	선물	4,405	0	4,405	장내
합계			4,405	0	4,405	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

353

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

913

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

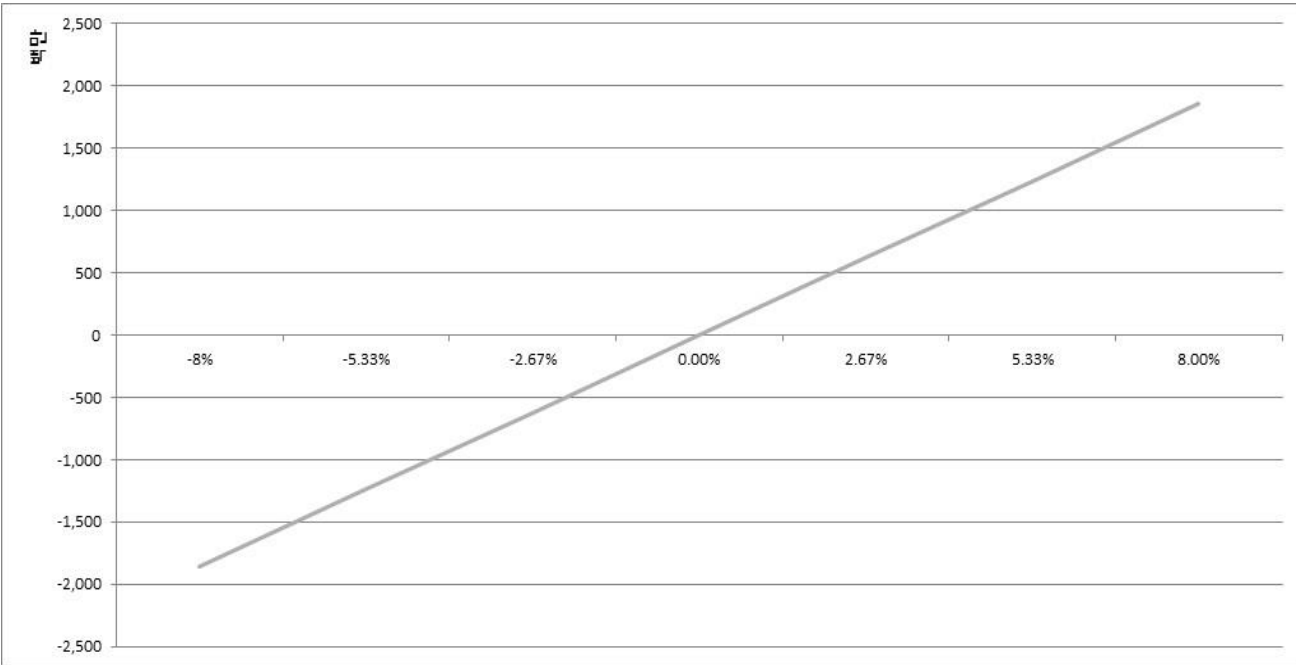
공시일: 2025-06-02

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	23,195	0	23,195	장내
합계			23,195	0	23,195	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,858

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,559

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

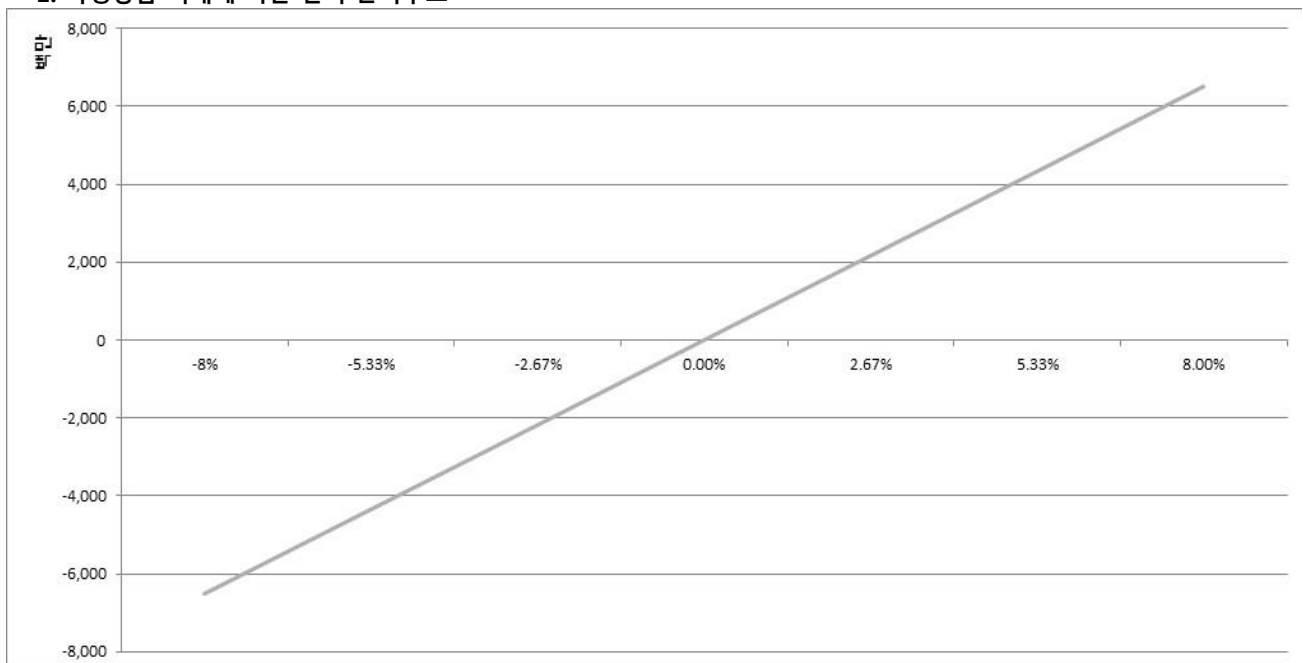
공시일: 2025-06-02

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	81,524	0	81,524	장외
합계			81,524	0	81,524	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,522

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51