

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

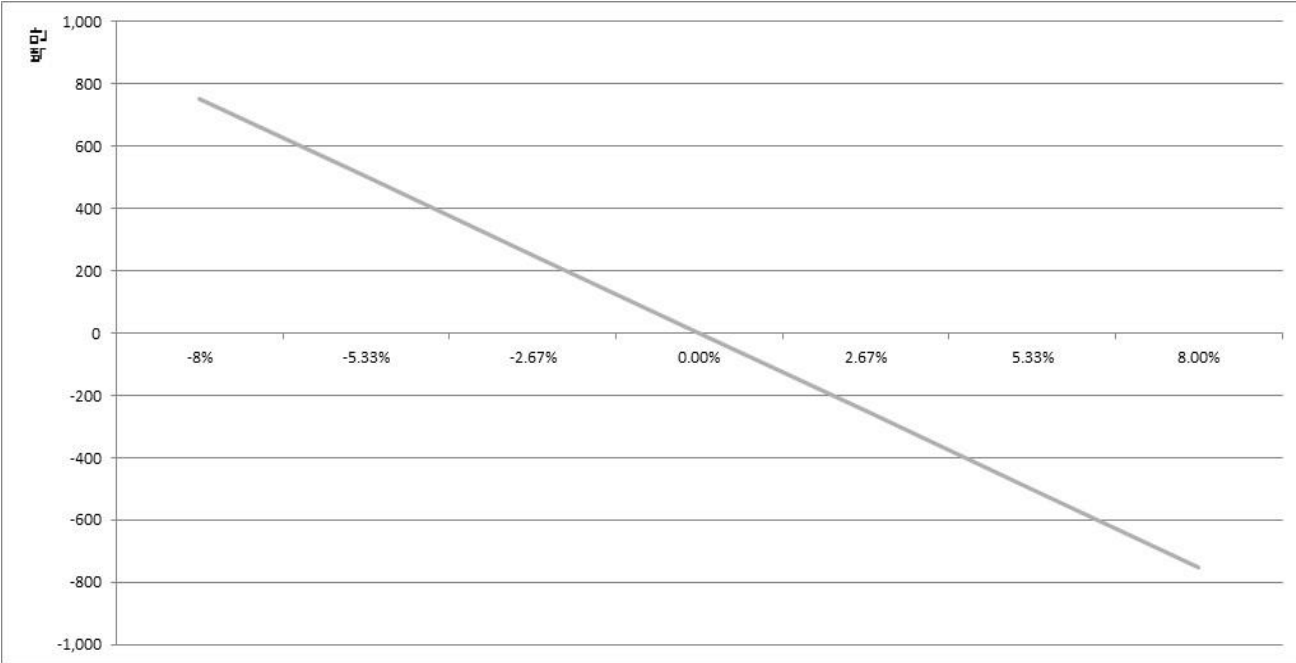
공시일: 2025-06-04

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	9,402	-9,402	장내
합계			0	9,402	-9,402	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

753

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,977

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

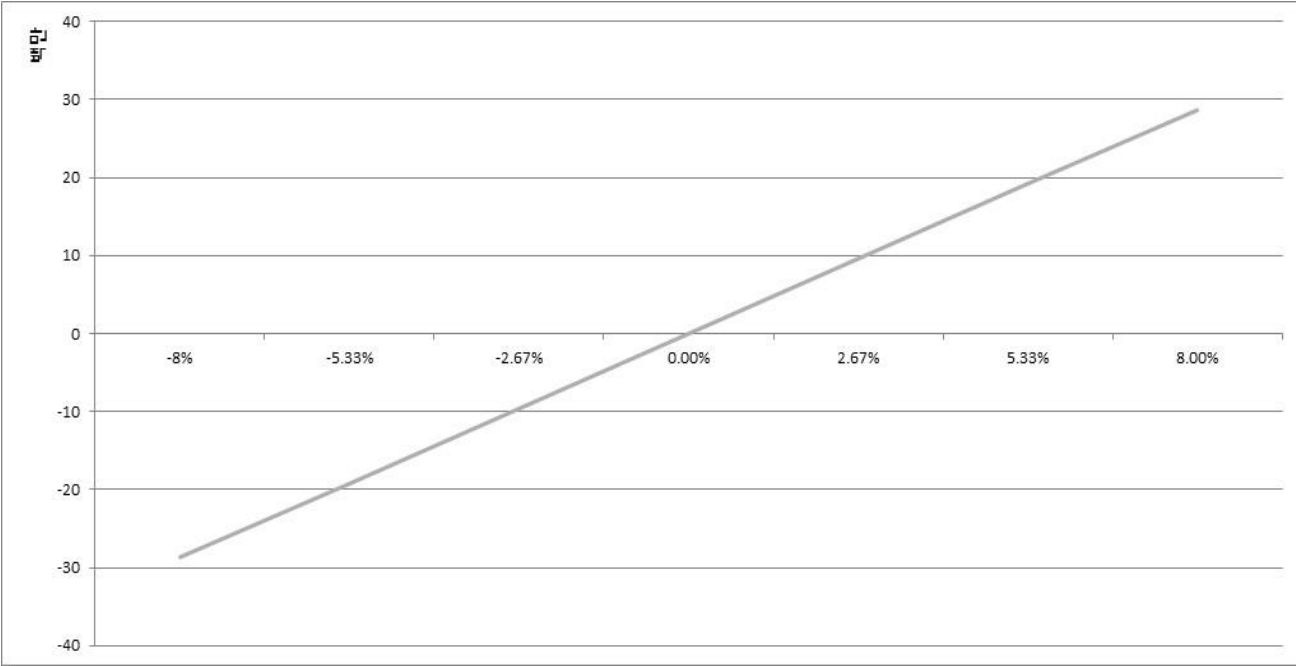
공시일: 2025-06-04

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	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	146	47	100	장내
합계			506	47	460	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

743

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

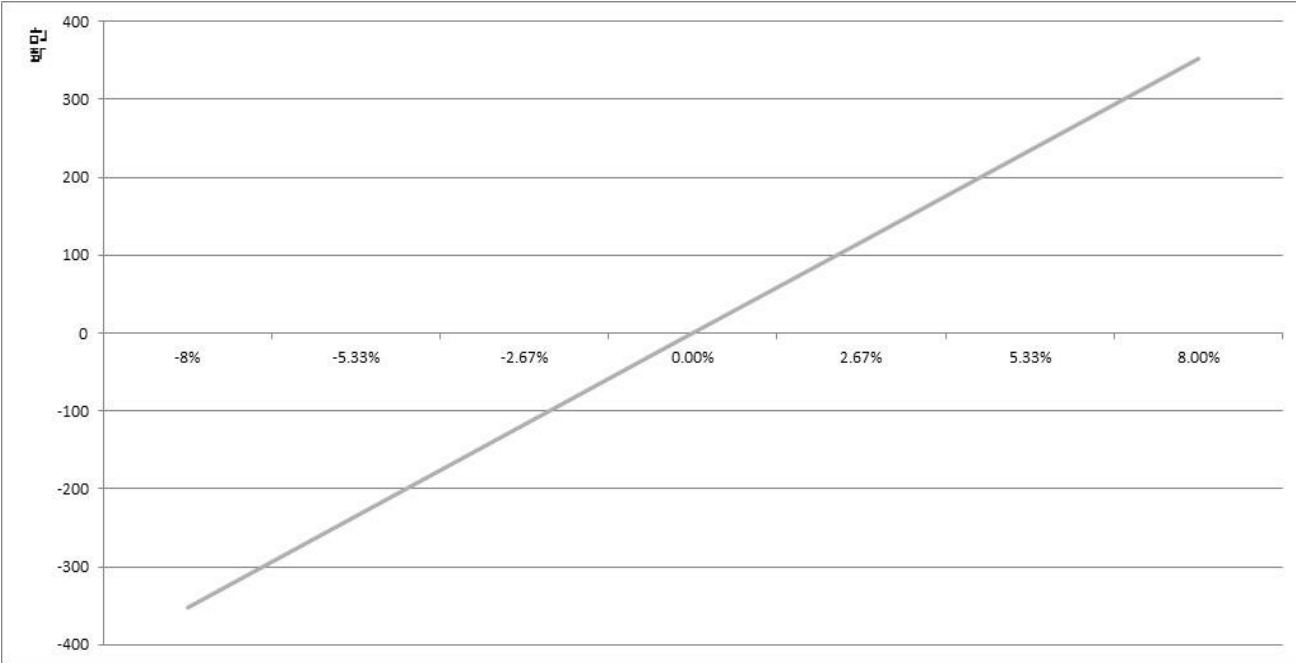
공시일: 2025-06-04

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	4,406	0	4,406	장내
합계			4,406	0	4,406	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

352

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

913

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

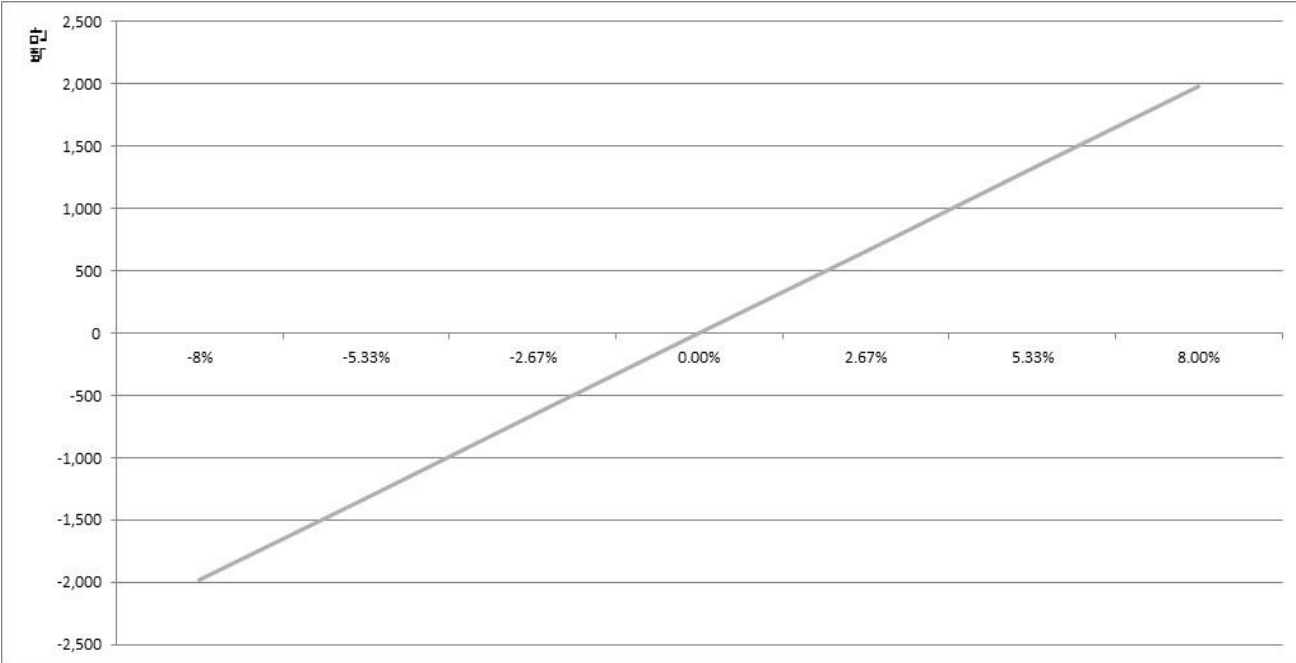
공시일: 2025-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,619	0	1,619	장내
누계	주가지수	선물	24,819	0	24,819	장내
합계			24,819	0	24,819	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,983

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,704

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

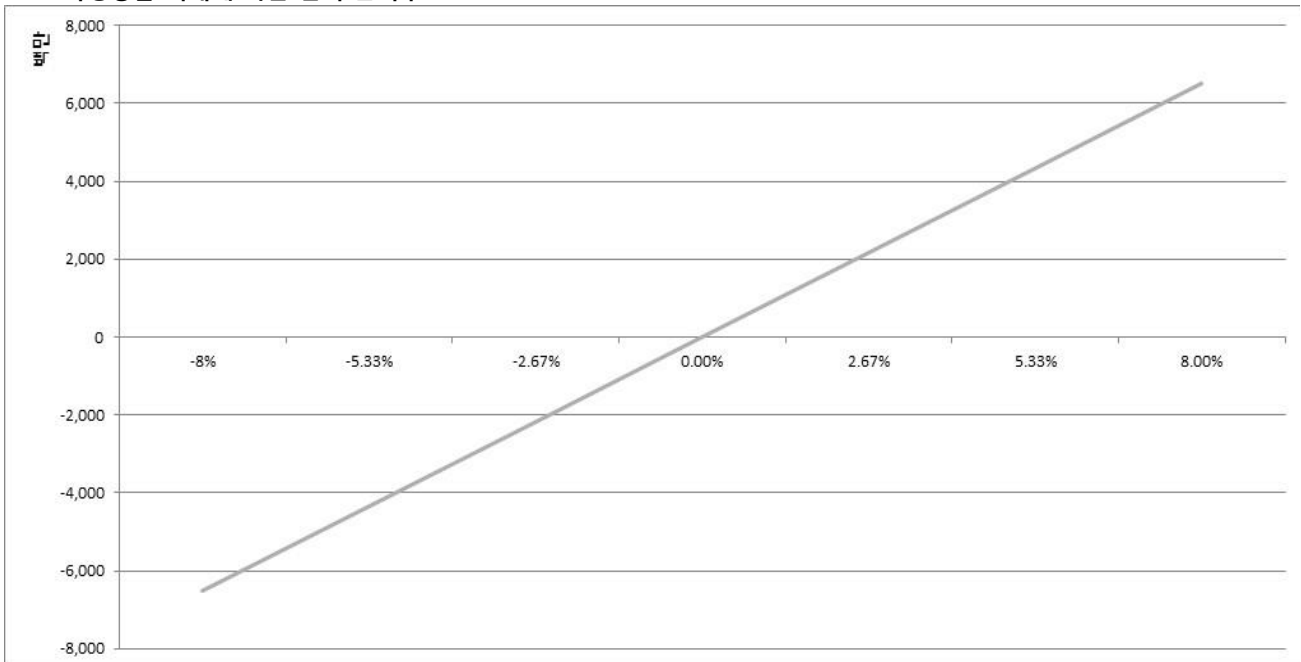
공시일: 2025-06-04

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	81,536	0	81,536	장외
합계			81,536	0	81,536	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

6,523

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51