

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

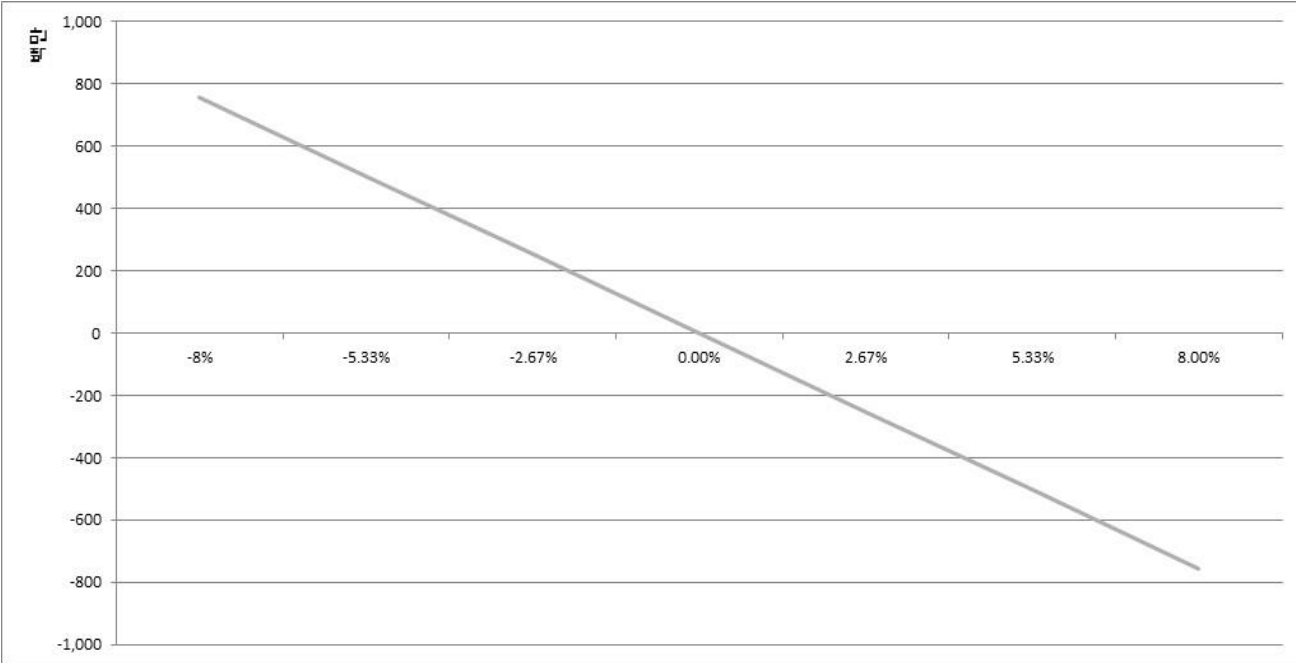
공시일: 2025-06-05

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	9,474	-9,474	장내
합계			0	9,474	-9,474	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

757

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,140

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

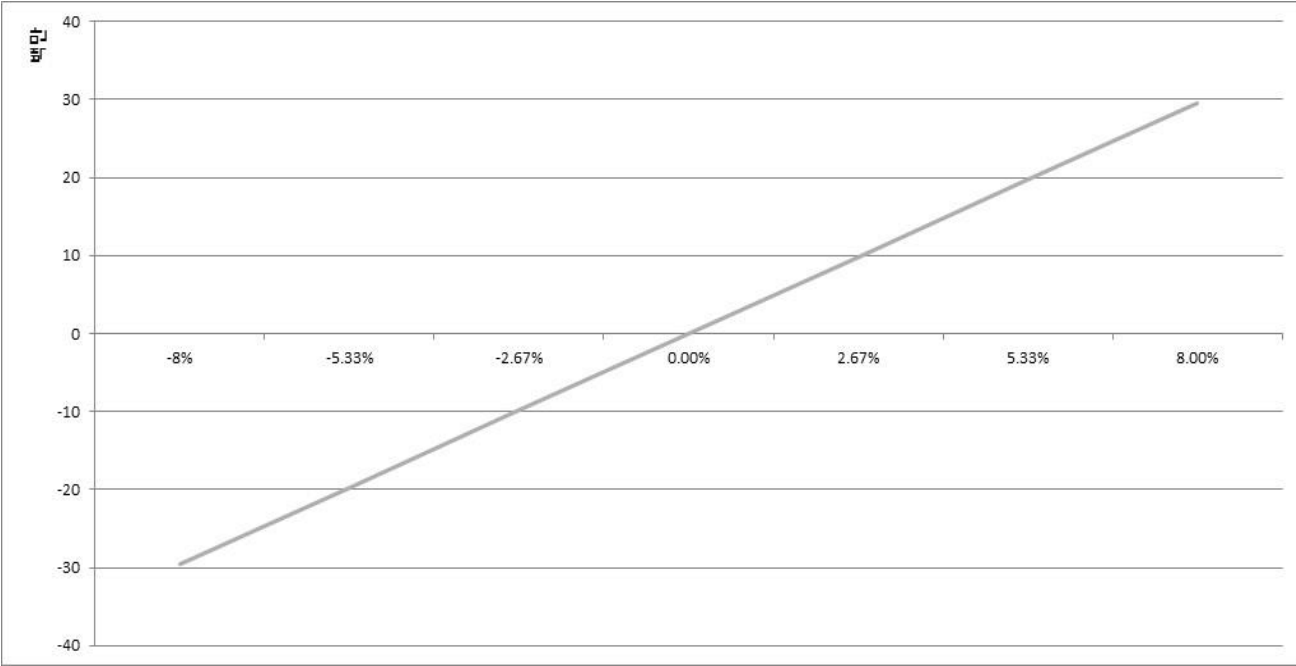
공시일: 2025-06-05

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	370	0	370	장내
신규	유가증권	선물	33	0	33	장내
누계	유가증권	선물	154	20	134	장내
합계			524	20	504	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

30

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

775

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

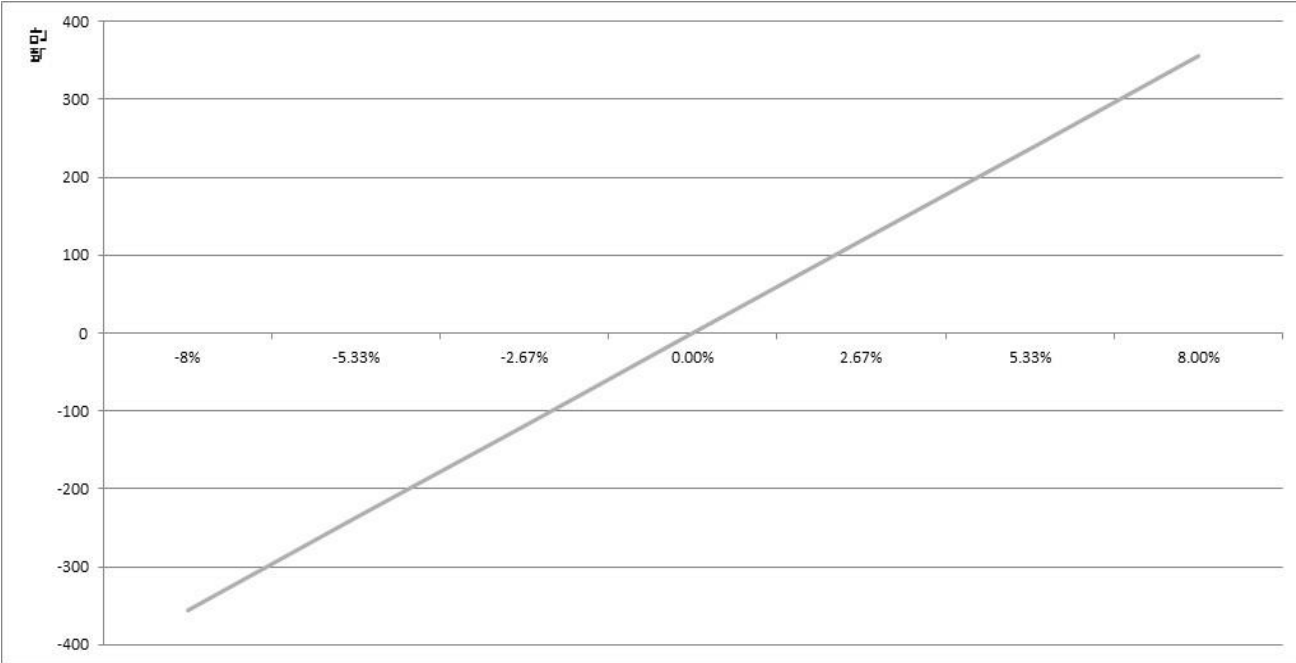
공시일: 2025-06-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	92	-92	장내
누계	주가지수	선물	4,439	0	4,439	장내
합계			4,439	0	4,439	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

355

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

940

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

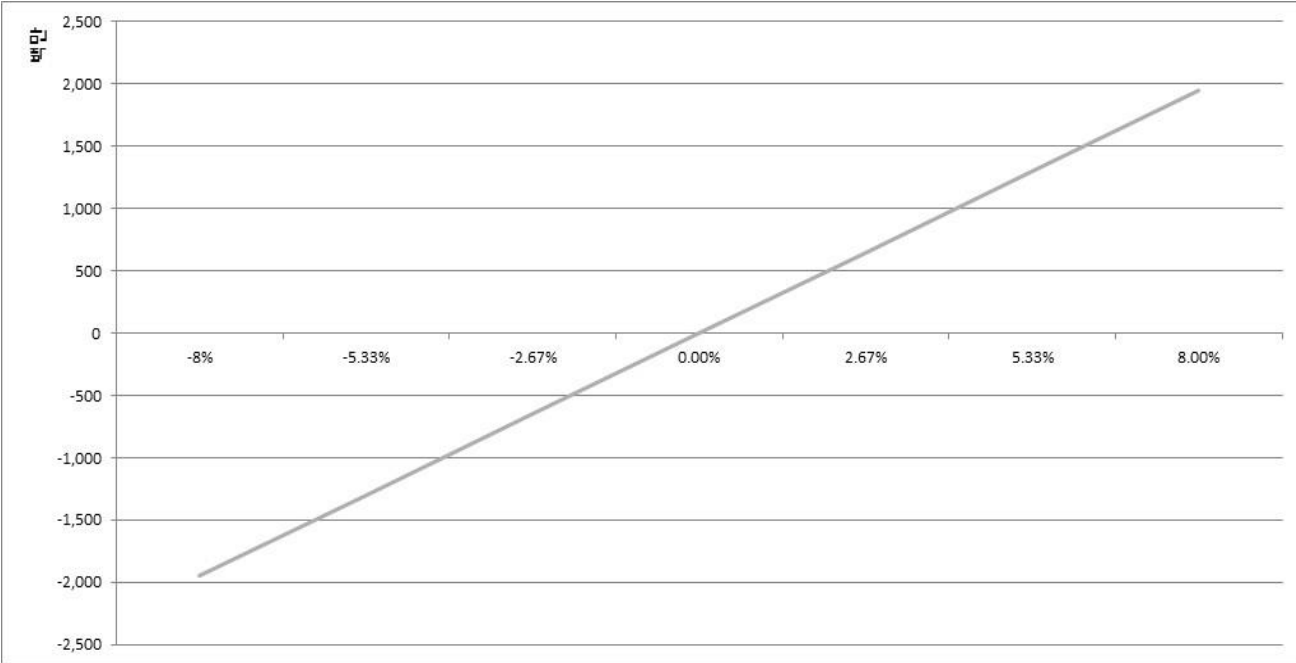
공시일: 2025-06-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,202	-1,202	장내
누계	주가지수	선물	24,321	0	24,321	장내
합계			24,321	0	24,321	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,946

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,734

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

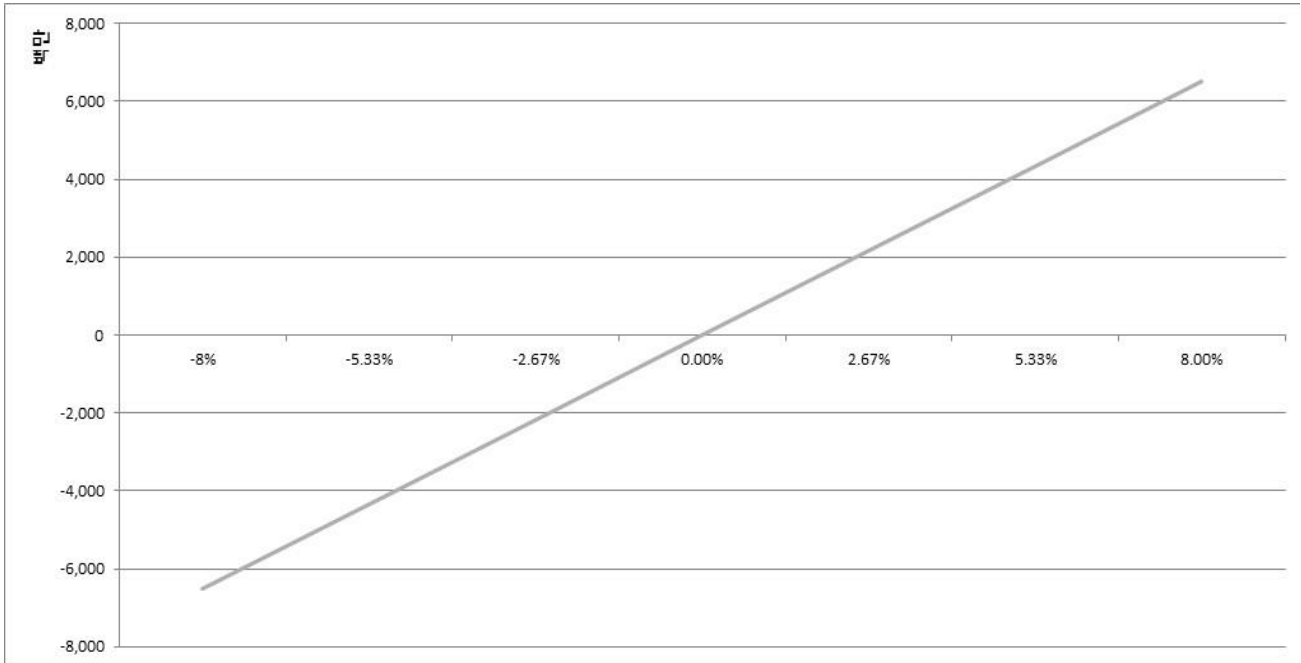
공시일: 2025-06-05

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	81,542	0	81,542	장외
합계			81,542	0	81,542	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,523

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51