

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

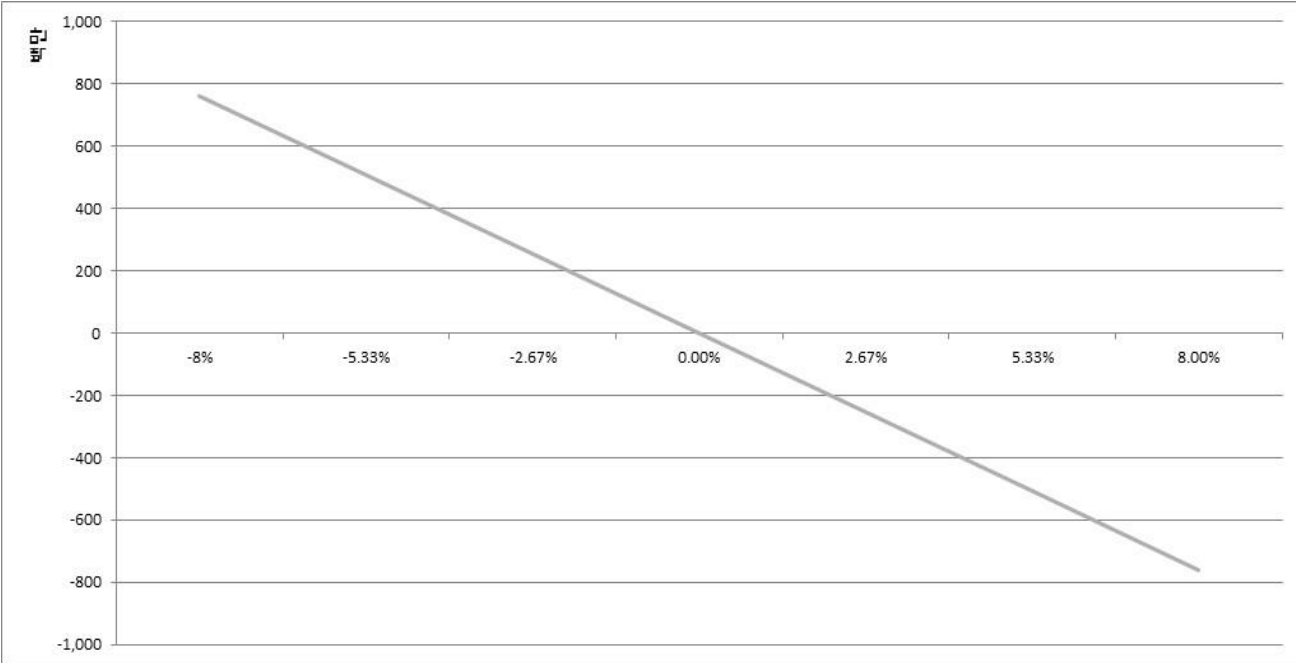
공시일: 2025-06-09

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	9,532	-9,532	장내
합계			0	9,532	-9,532	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

761

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,141

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

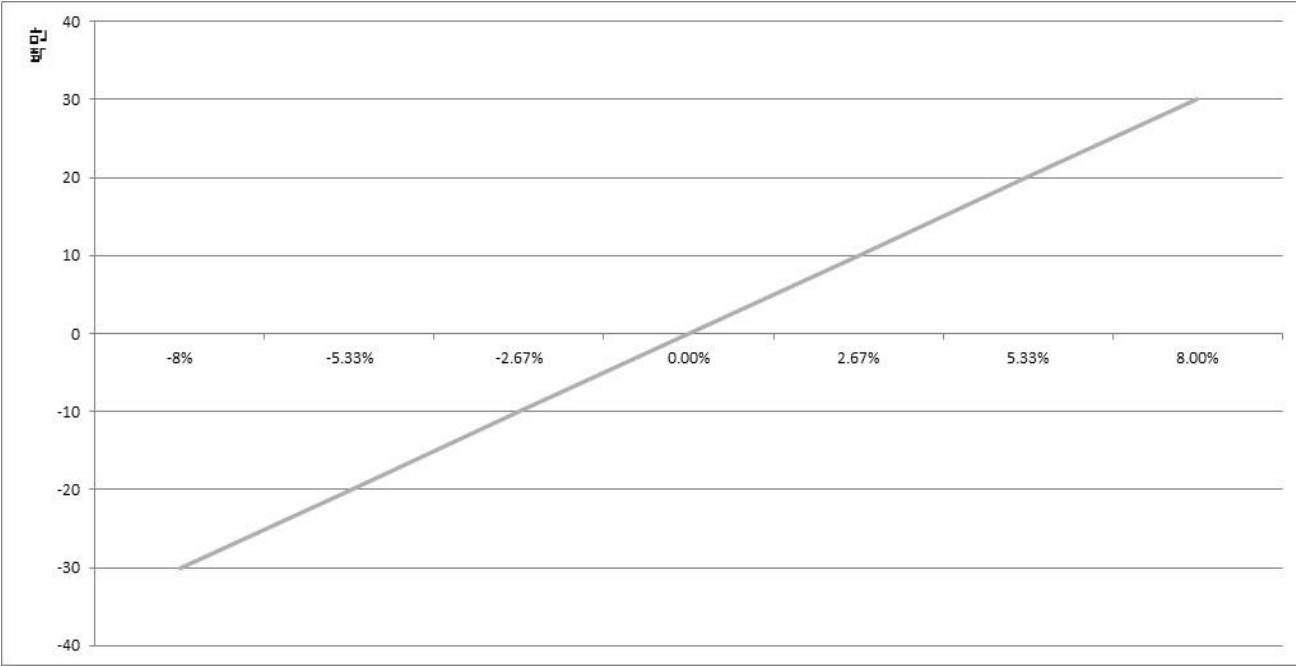
공시일: 2025-06-09

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	377	0	377	장내
신규	유가증권	선물	4	0	4	장내
누계	유가증권	선물	157	18	139	장내
합계			534	18	516	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

30

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

789

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

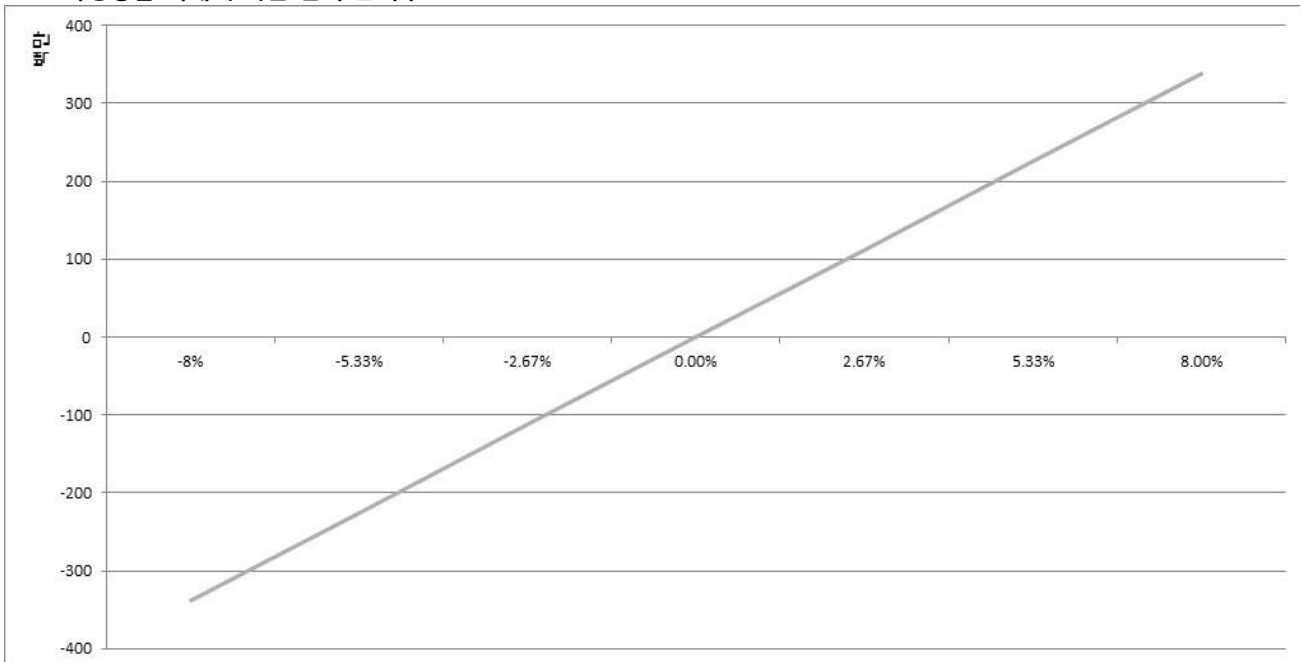
공시일: 2025-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	282	-282	장내
누계	주가지수	선물	4,236	0	4,236	장내
합계			4,236	0	4,236	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

338

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

931

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

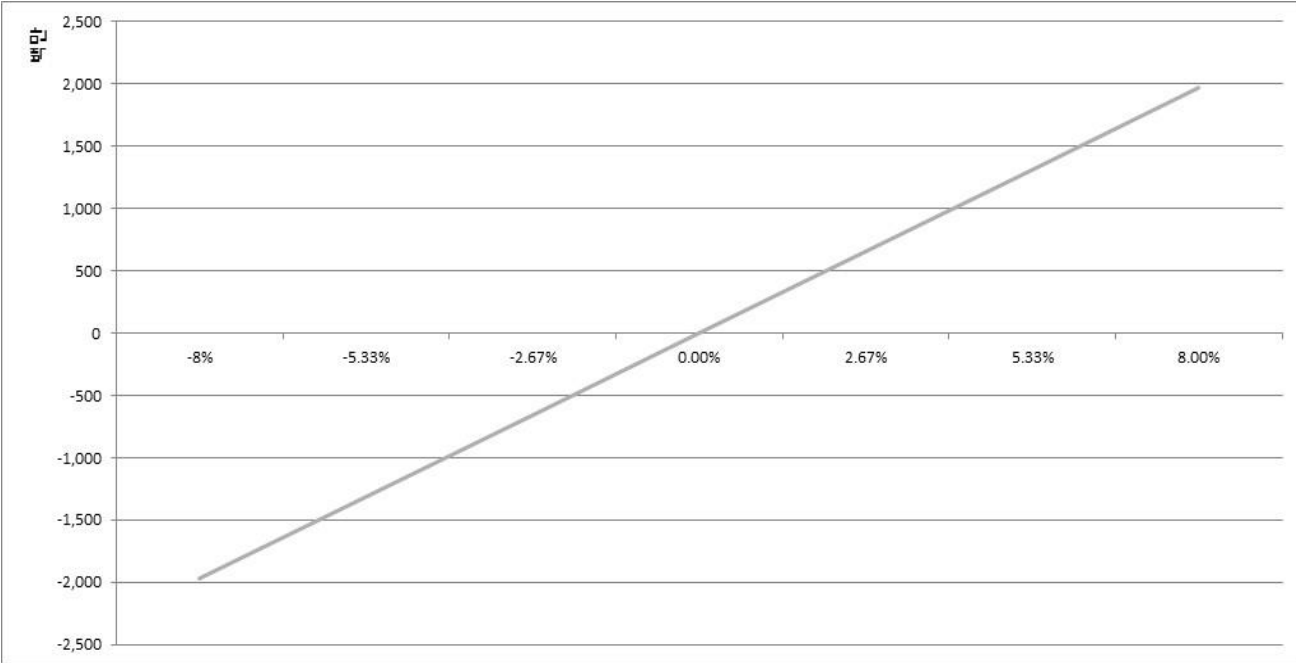
공시일: 2025-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	94	-94	장내
누계	주가지수	선물	24,663	0	24,663	장내
합계			24,663	0	24,663	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,971

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,798

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

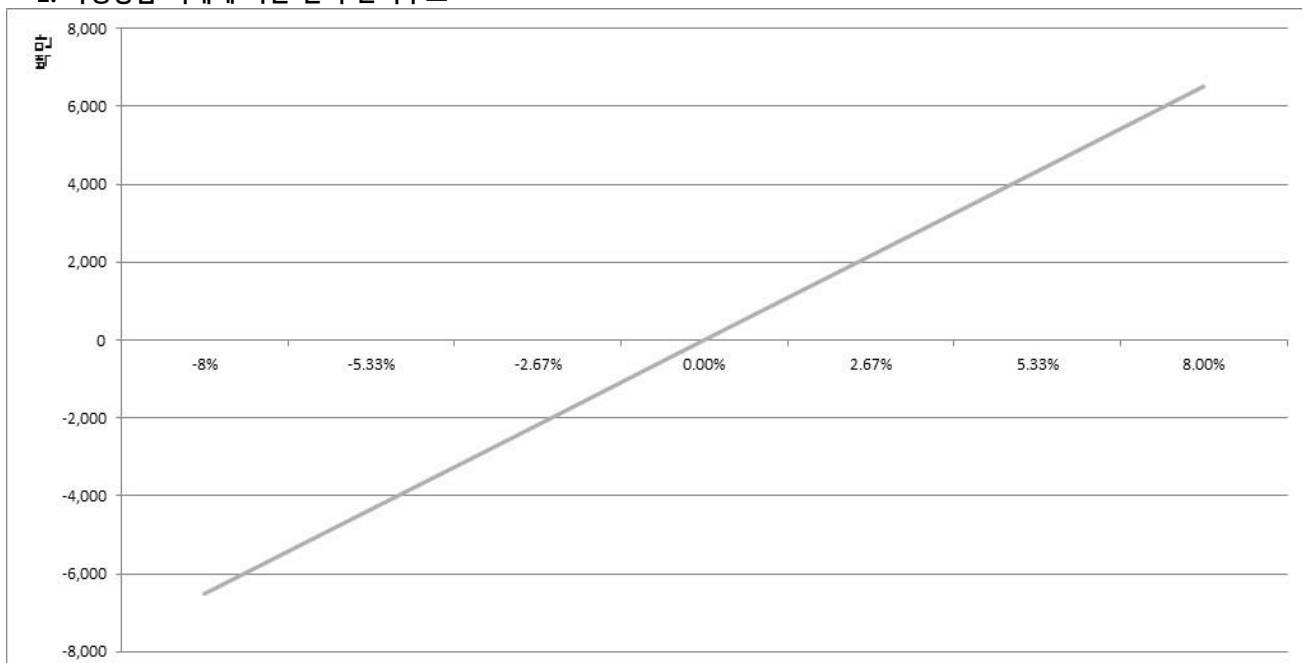
공시일: 2025-06-09

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	81,565	0	81,565	장외
합계			81,565	0	81,565	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,525

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

52