

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

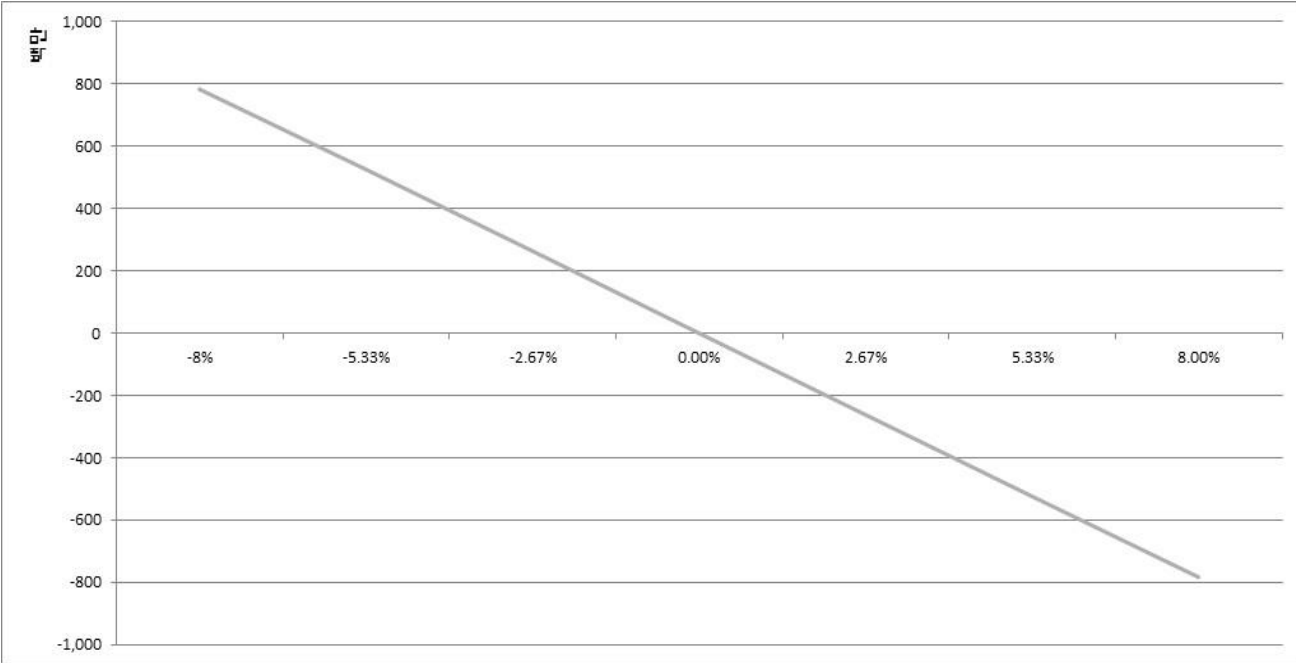
공시일: 2025-06-11

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	9,802	-9,802	장내
합계			0	9,802	-9,802	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

785

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,400

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

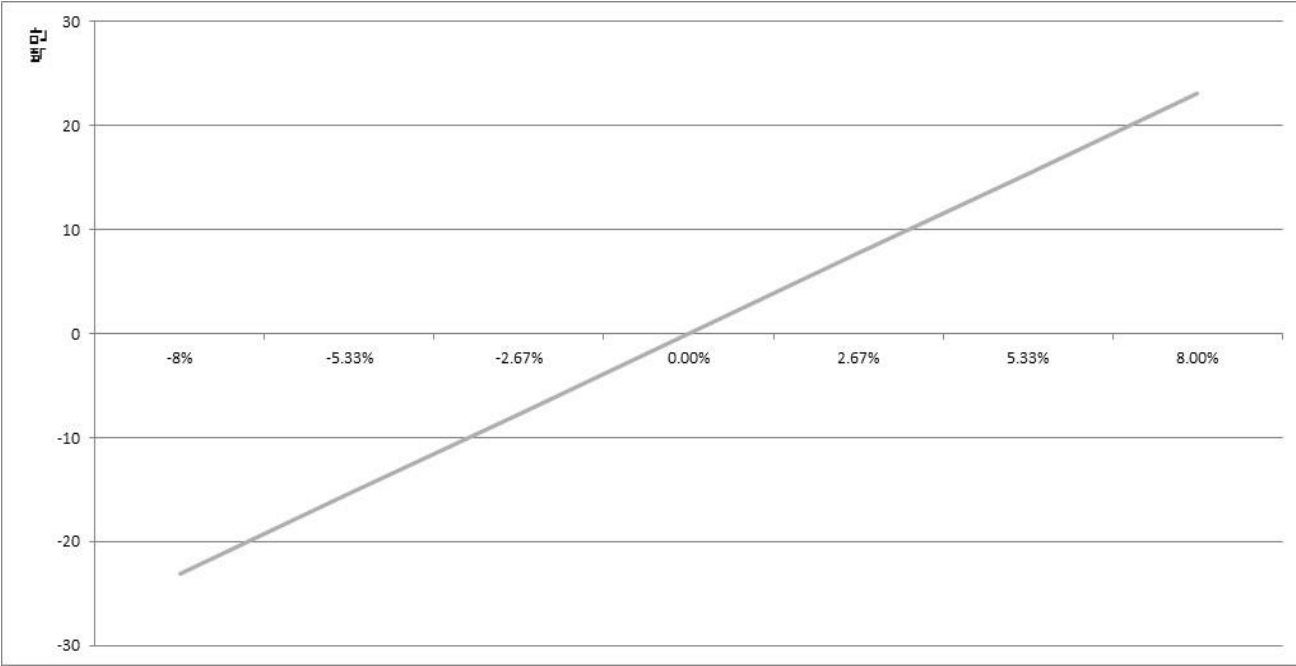
공시일: 2025-06-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	96	192	-96	장내
누계	주가지수	선물	289	0	289	장내
신규	유가증권	선물	22	14	7	장내
누계	유가증권	선물	154	0	154	장내
합계			442	0	442	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

804

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

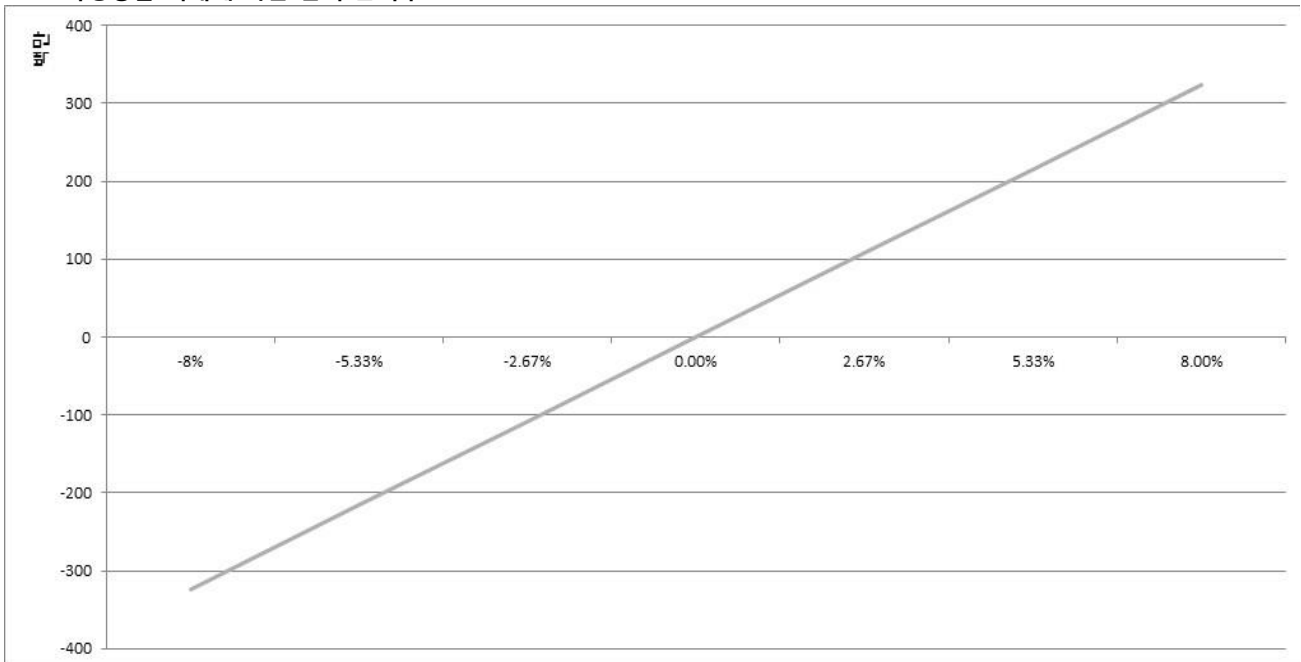
공시일: 2025-06-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,347	1,443	-96	장내
누계	주가지수	선물	4,040	0	4,040	장내
합계			4,040	0	4,040	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

323

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

926

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

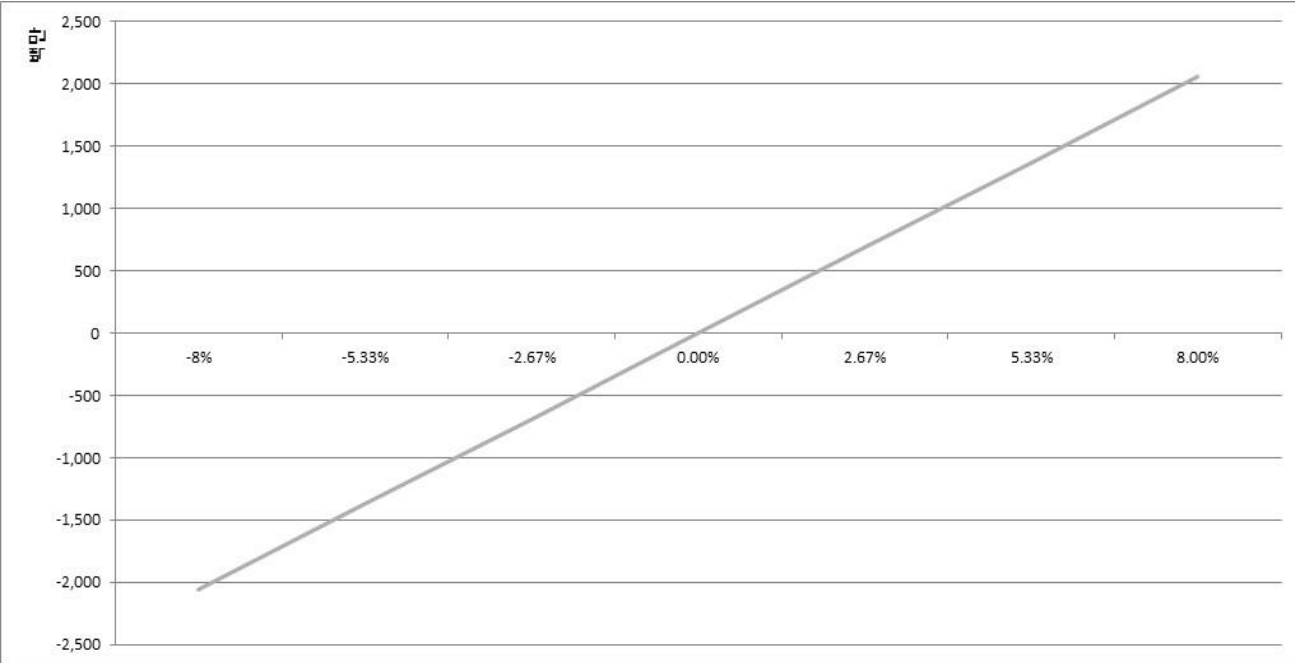
공시일: 2025-06-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	9,331	9,331	0	장내
누계	주가지수	선물	25,685	0	25,685	장내
합계			25,685	0	25,685	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,055

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,933

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

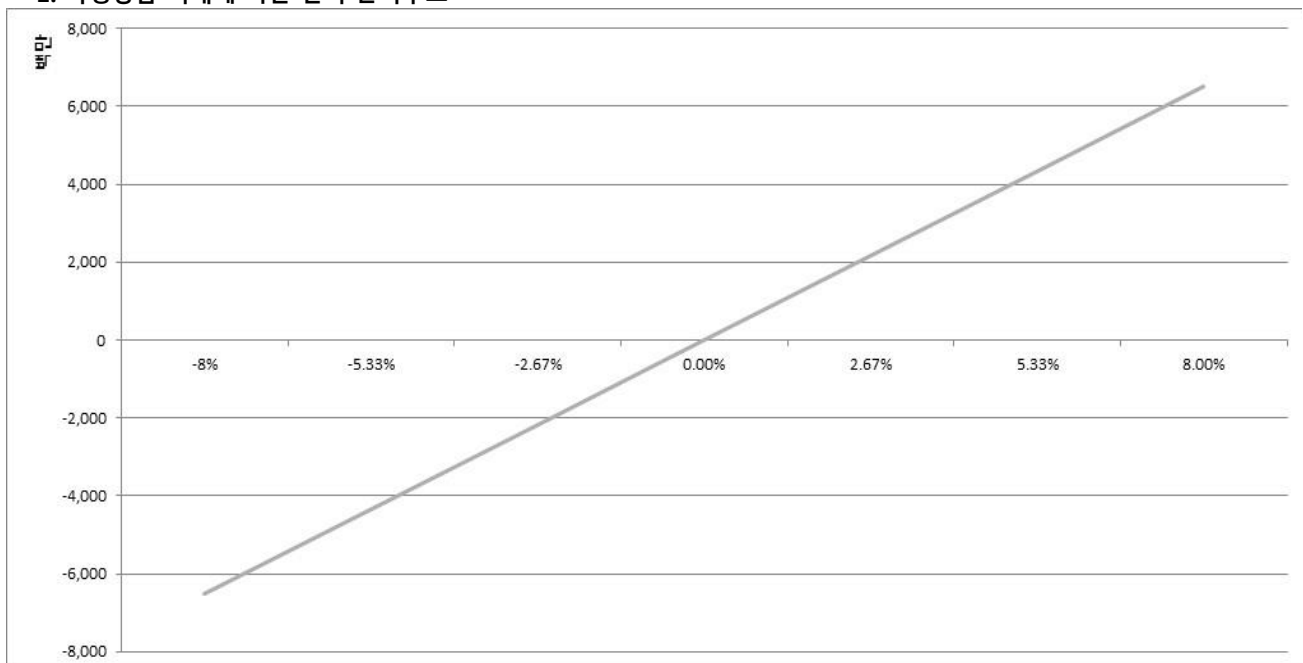
공시일: 2025-06-11

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	81,576	0	81,576	장외
합계			81,576	0	81,576	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,526

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51