

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

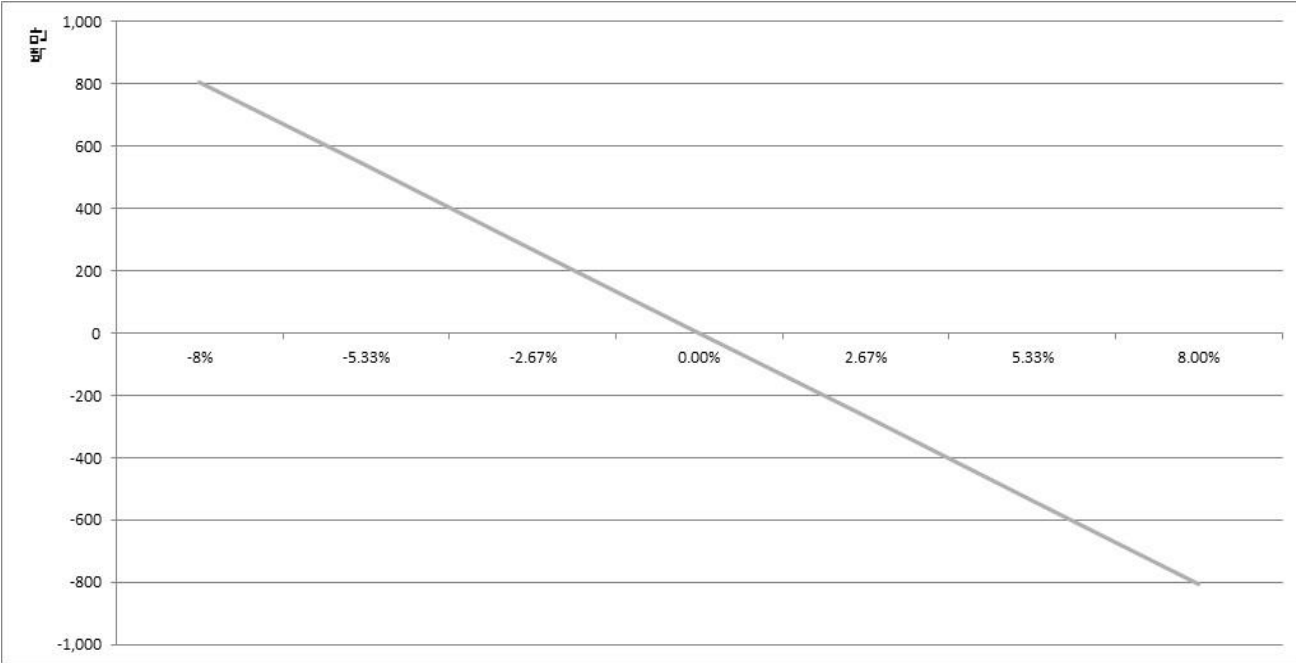
공시일: 2025-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,763	3,763	0	장내
누계	주가지수	선물	0	10,039	-10,039	장내
합계			0	10,039	-10,039	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

805

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,857

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

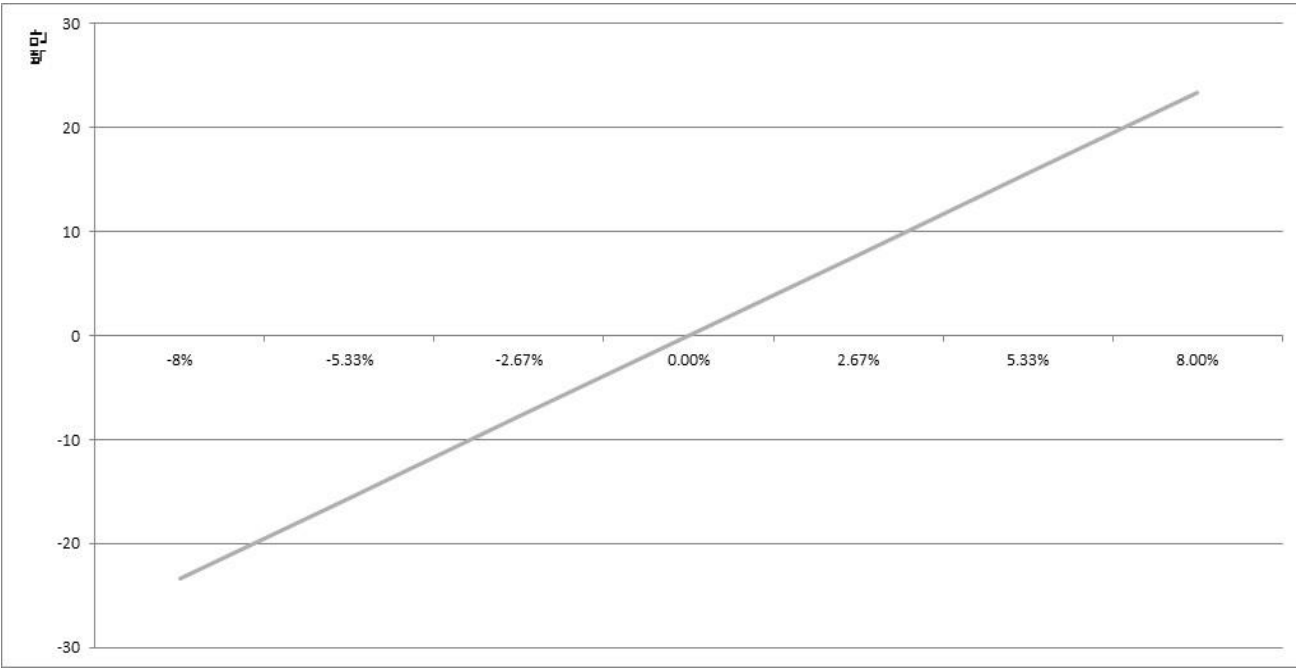
공시일: 2025-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	97	97	0	장내
누계	주가지수	선물	292	0	292	장내
신규	유가증권	선물	7	6	2	장내
누계	유가증권	선물	157	0	157	장내
합계			450	0	450	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

816

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

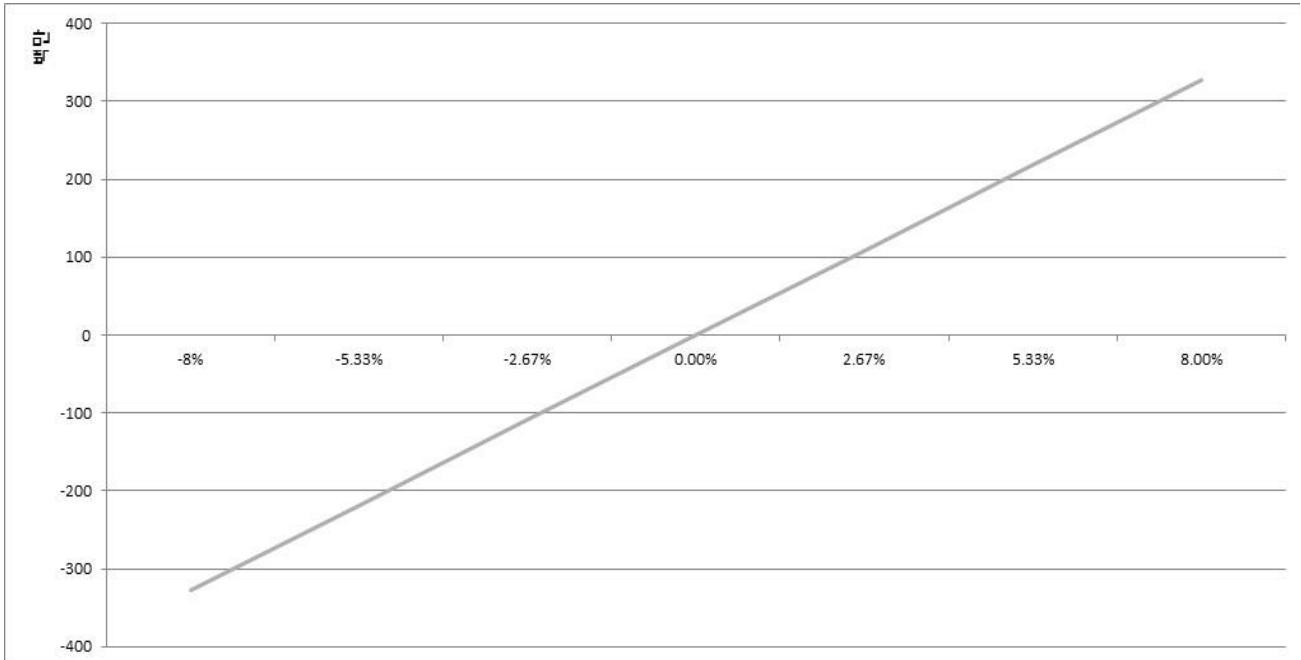
공시일: 2025-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,364	1,364	0	장내
누계	주가지수	선물	4,093	0	4,093	장내
합계			4,093	0	4,093	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

328

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

940

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

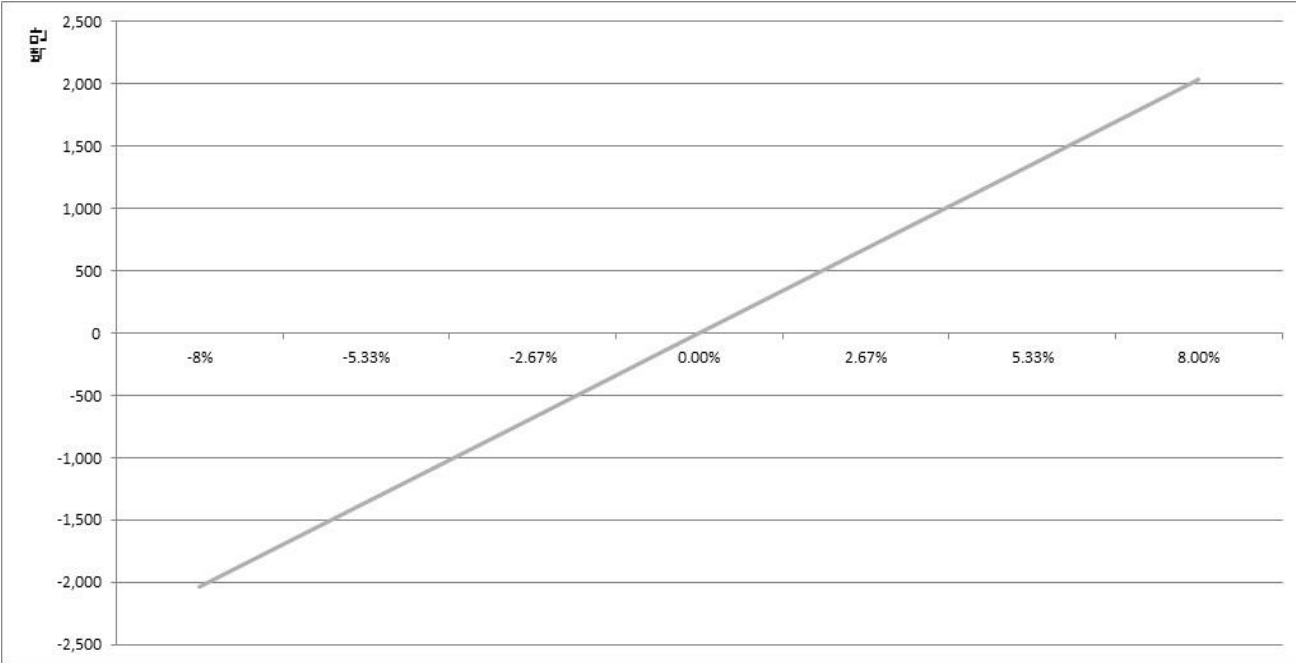
공시일: 2025-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	7,991	8,673	-682	장내
누계	주가지수	선물	25,336	0	25,336	장내
합계			25,336	0	25,336	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,031

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,925

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

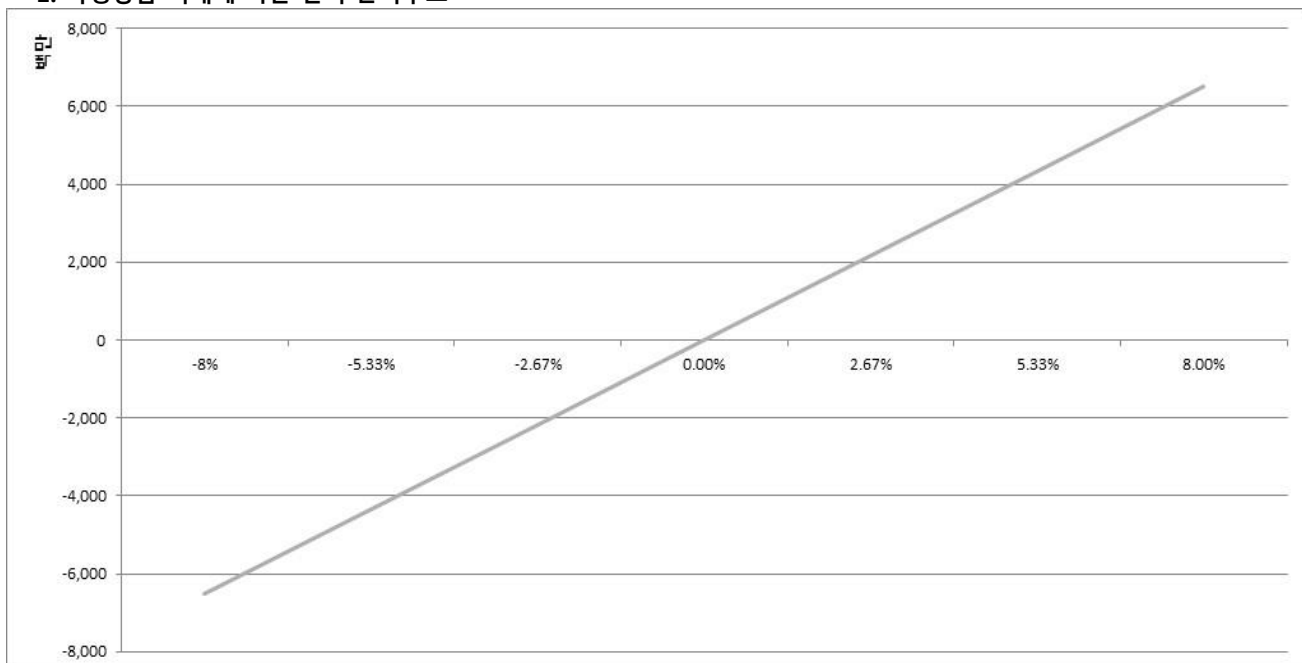
공시일: 2025-06-12

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	81,582	0	81,582	장외
합계			81,582	0	81,582	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,527

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51