

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

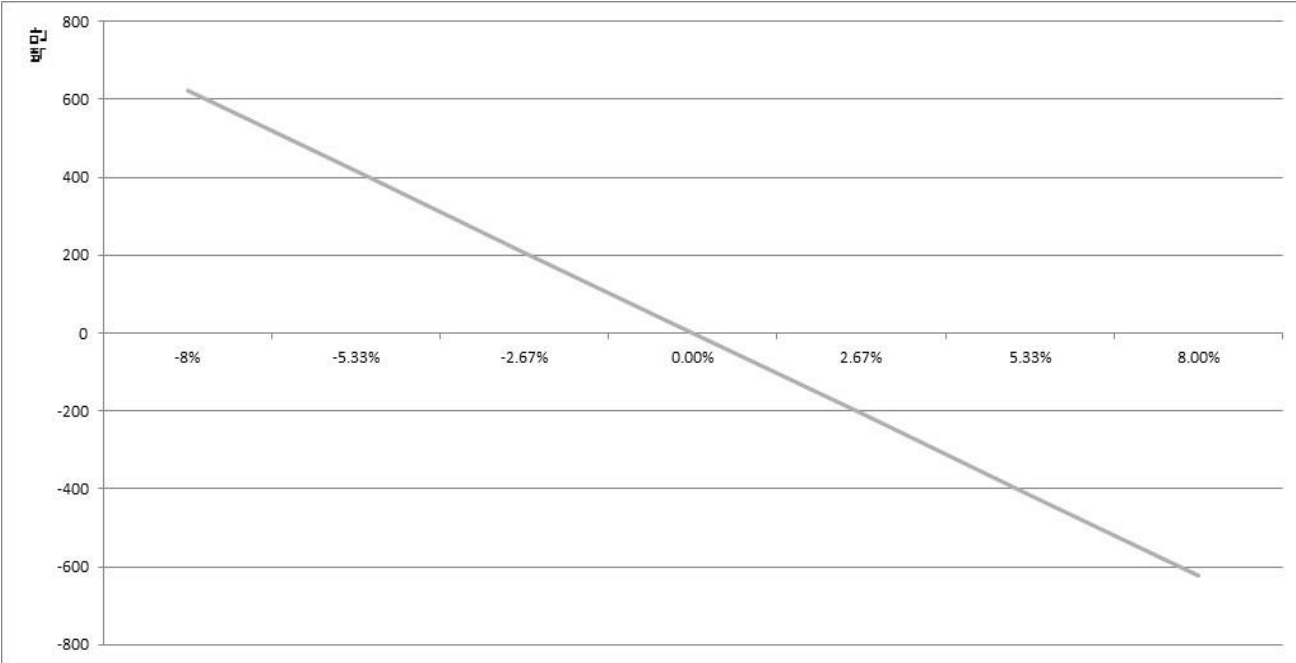
공시일: 2025-06-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,783	1,490	2,293	장내
누계	주가지수	선물	0	7,799	-7,799	장내
합계			0	7,799	-7,799	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

623

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,865

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

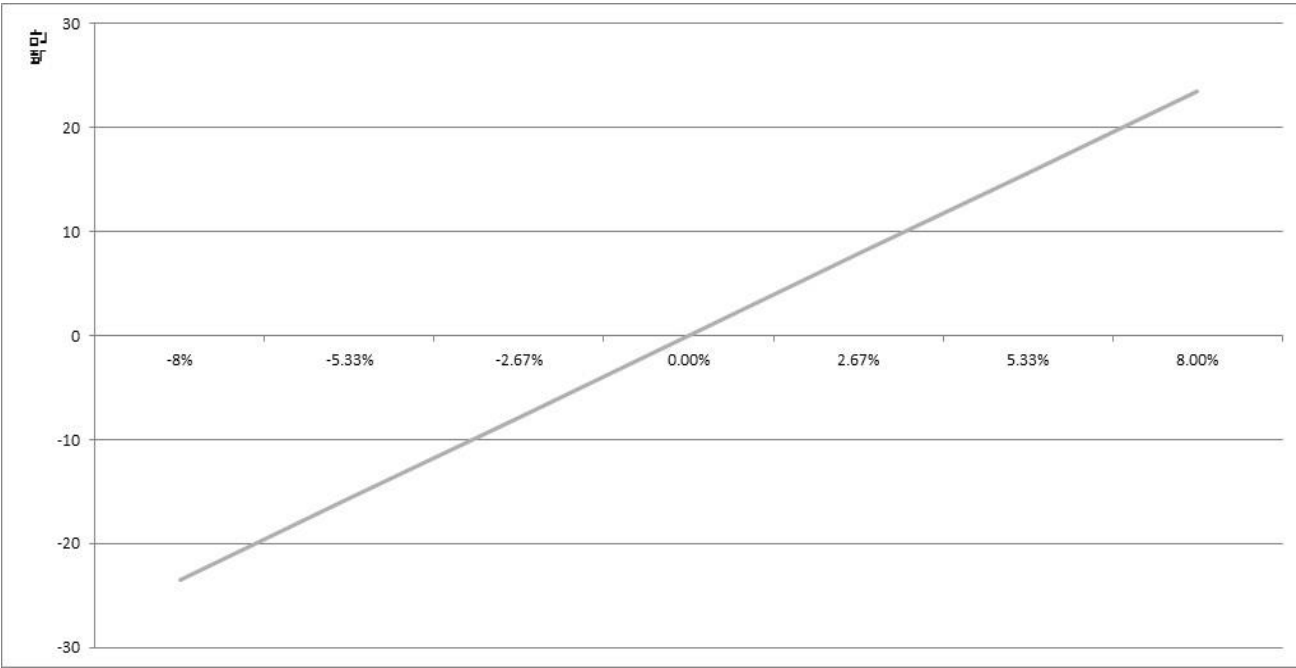
공시일: 2025-06-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	98	98	0	장내
누계	주가지수	선물	293	0	293	장내
신규	유가증권	선물	185	311	-126	장내
누계	유가증권	선물	35	0	35	장내
합계			328	0	328	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

742

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

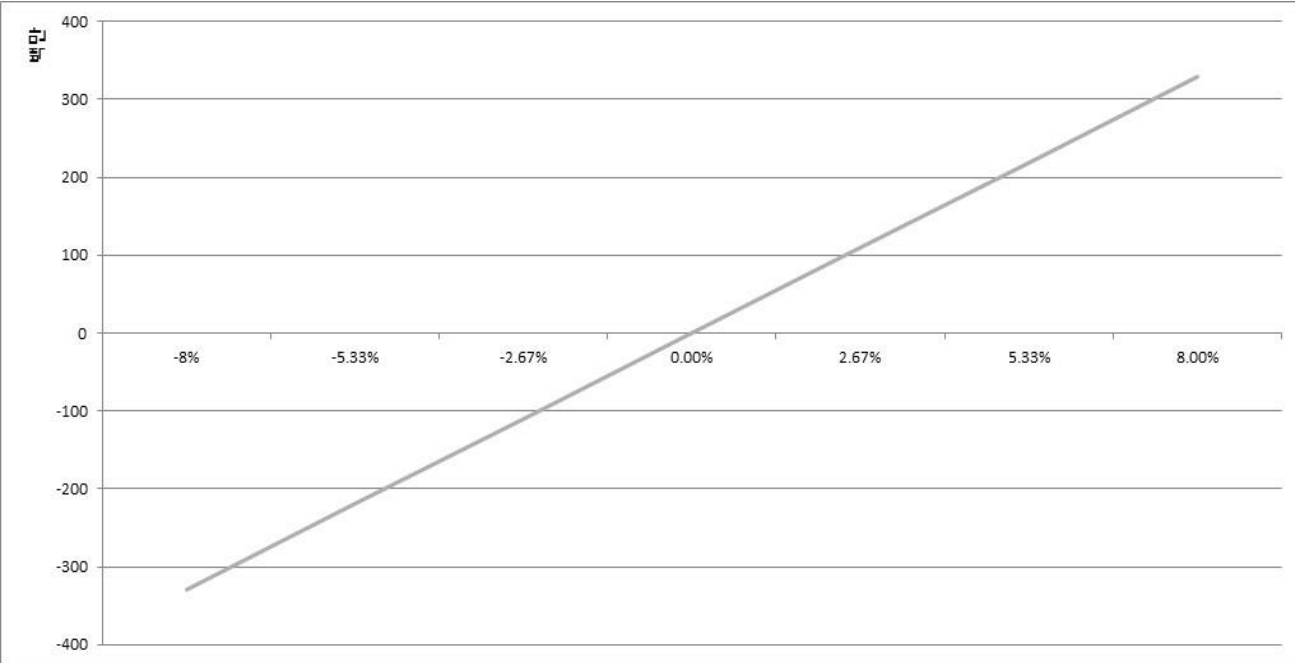
공시일: 2025-06-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,367	1,367	0	장내
누계	주가지수	선물	4,102	0	4,102	장내
합계			4,102	0	4,102	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

329

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

885

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

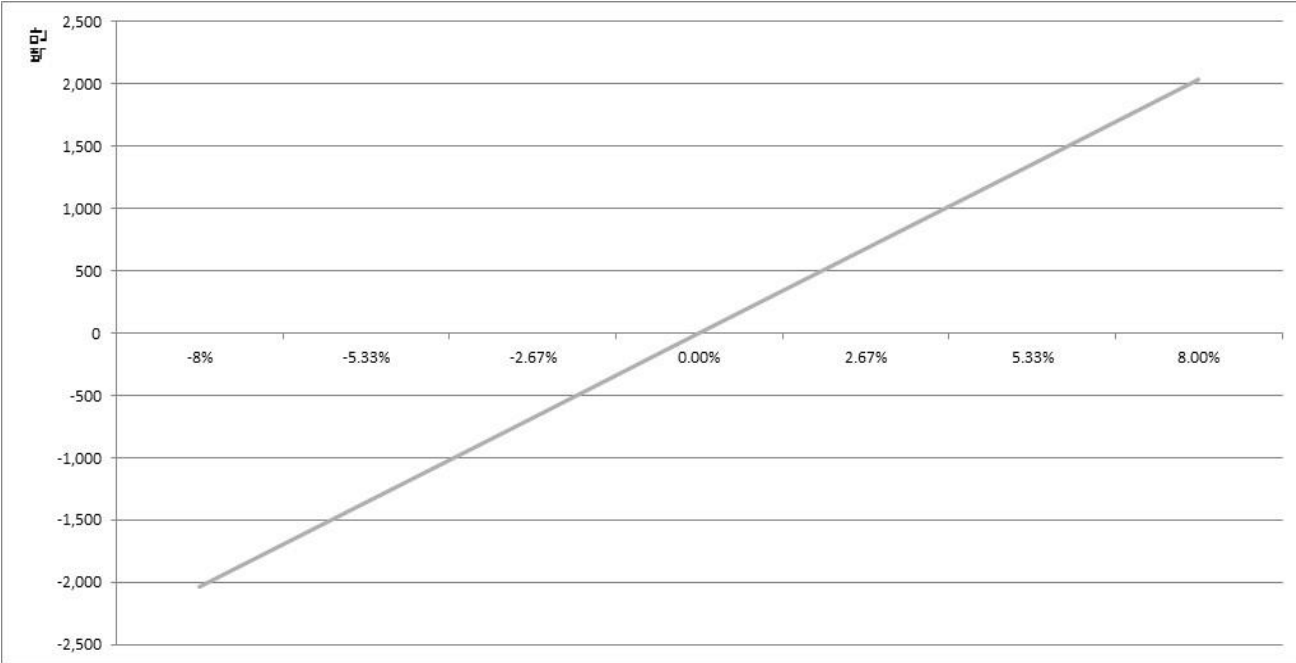
공시일: 2025-06-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	7,422	7,422	0	장내
누계	주가지수	선물	25,390	0	25,390	장내
합계			25,390	0	25,390	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,036

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,816

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

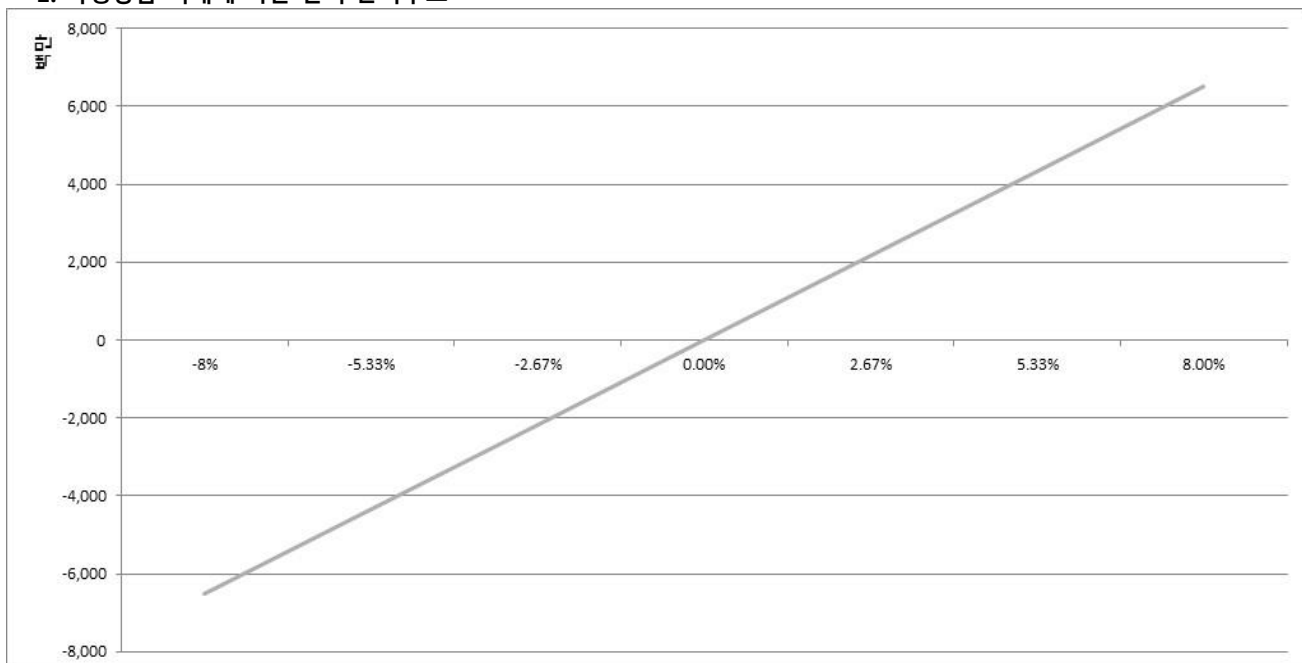
공시일: 2025-06-13

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	81,588	0	81,588	장외
합계			81,588	0	81,588	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,527

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

51