

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

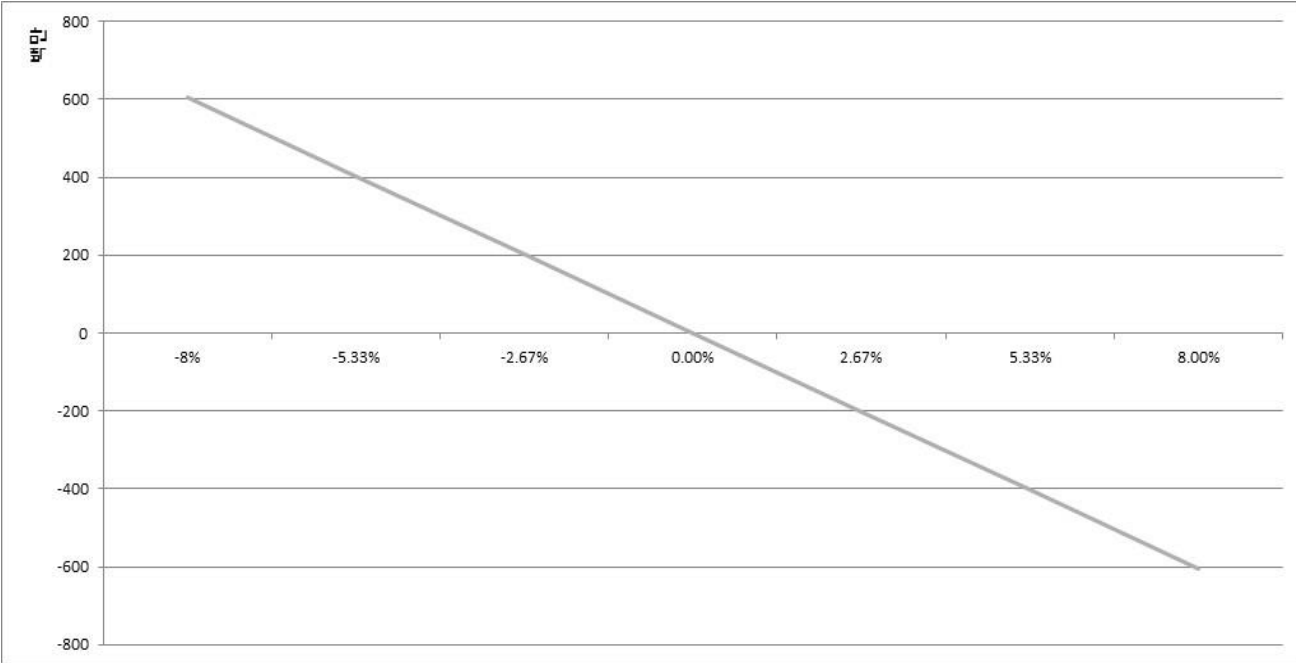
공시일: 2025-06-16

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     | 7,544 | -7,544    | 장내 |
| 합계 |      |      | 0     | 7,544 | -7,544    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

604

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5,627

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

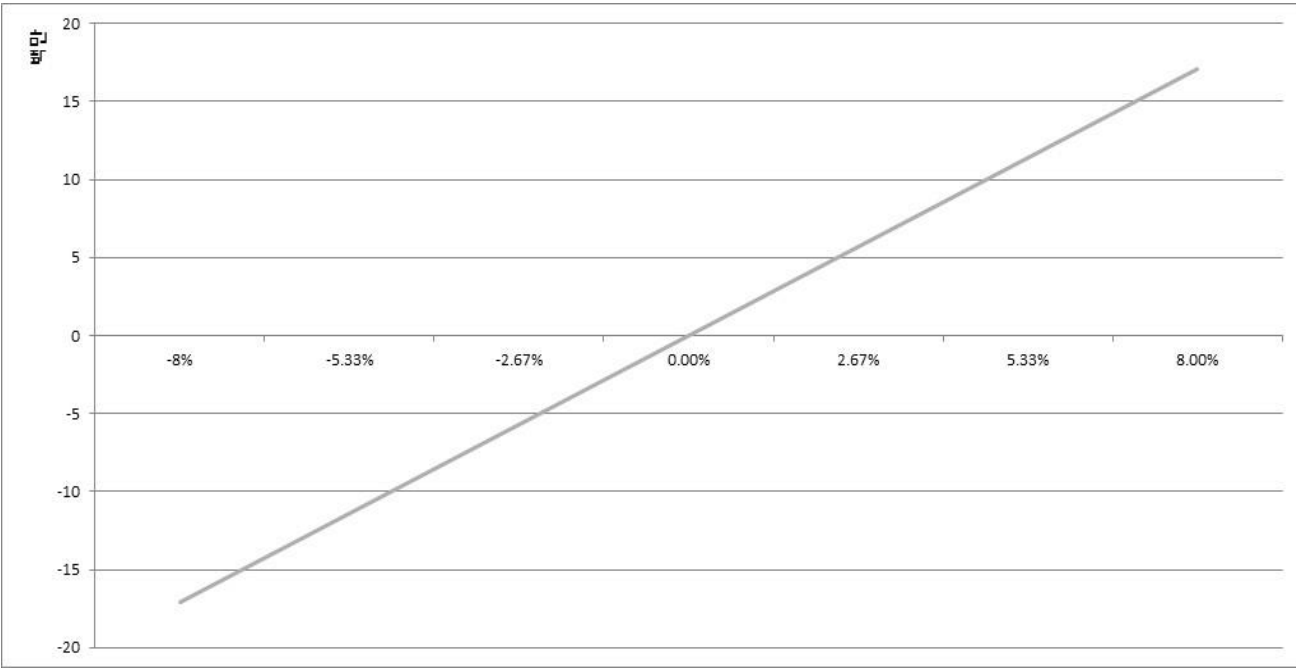
공시일: 2025-06-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 39    | 116   | -77       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 290   | 77    | 213       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 4     | 27    | -23       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11    | 0     | 11        | 장내 |
| 합계 |      |      | 302   | 77    | 224       |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

699

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

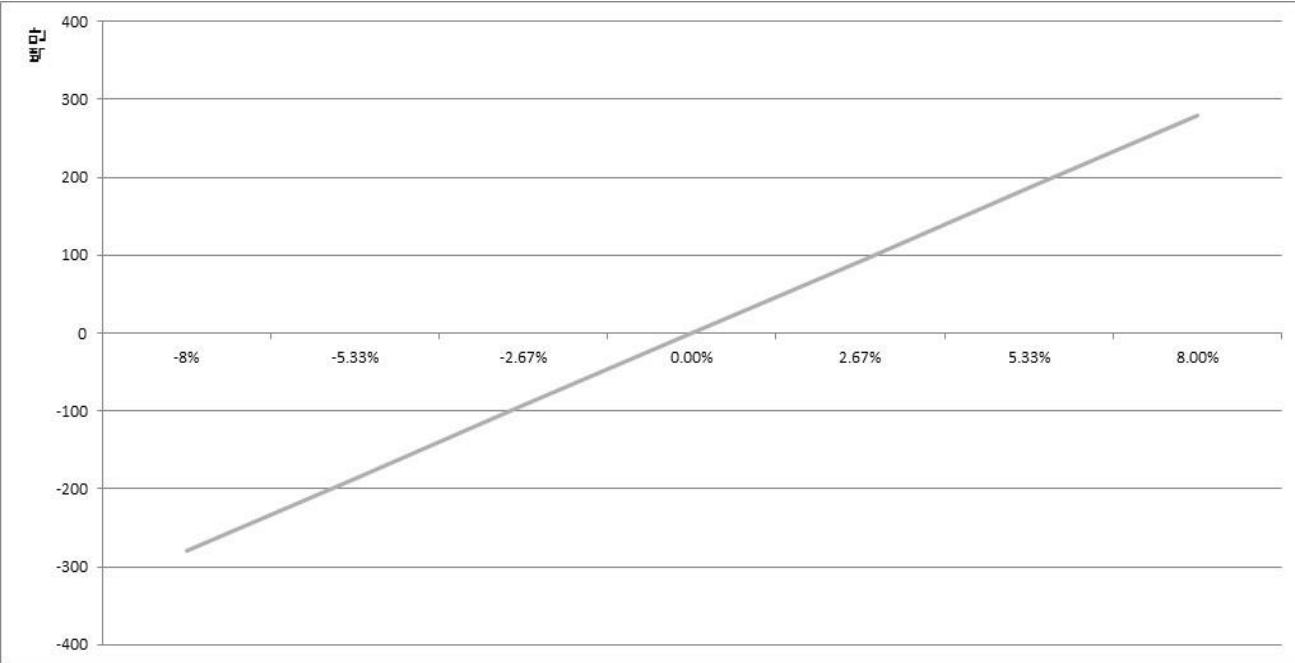
공시일: 2025-06-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0     | 581   | -581      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 3,486 | 0     | 3,486     | 장내 |
| 합계 |      |      | 3,486 | 0     | 3,486     |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

279

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

824

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

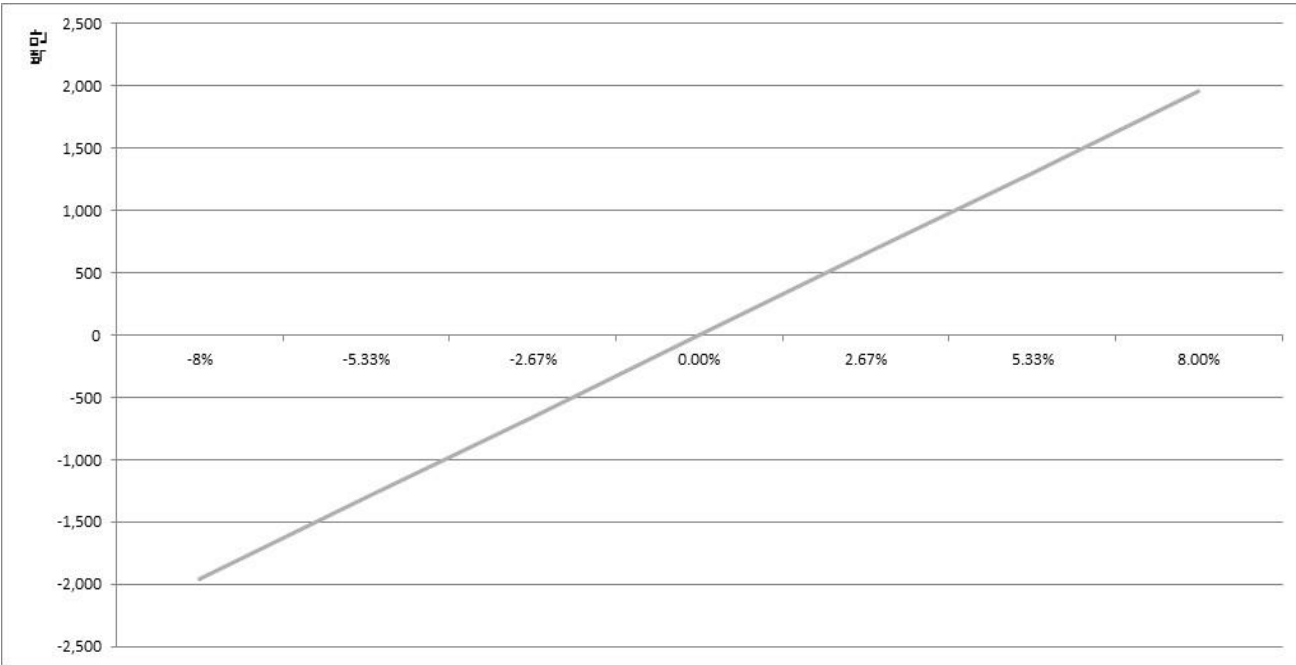
공시일: 2025-06-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0      | 775   | -775      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 24,400 | 0     | 24,400    | 장내 |
| 합계 |      |      | 24,400 | 0     | 24,400    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,955

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,698

## 펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

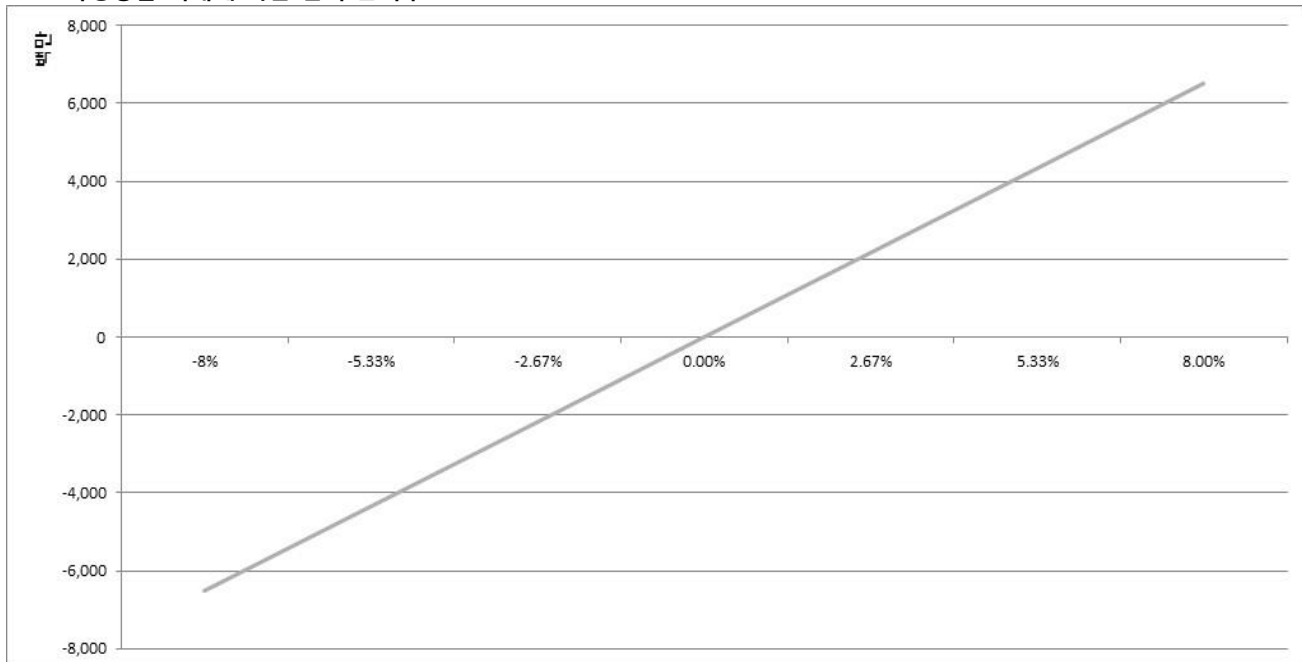
공시일: 2025-06-16

### 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   | 81,605 | 0     | 81,605    | 장외 |
| 합계 |      |      | 81,605 | 0     | 81,605    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,528

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51