

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

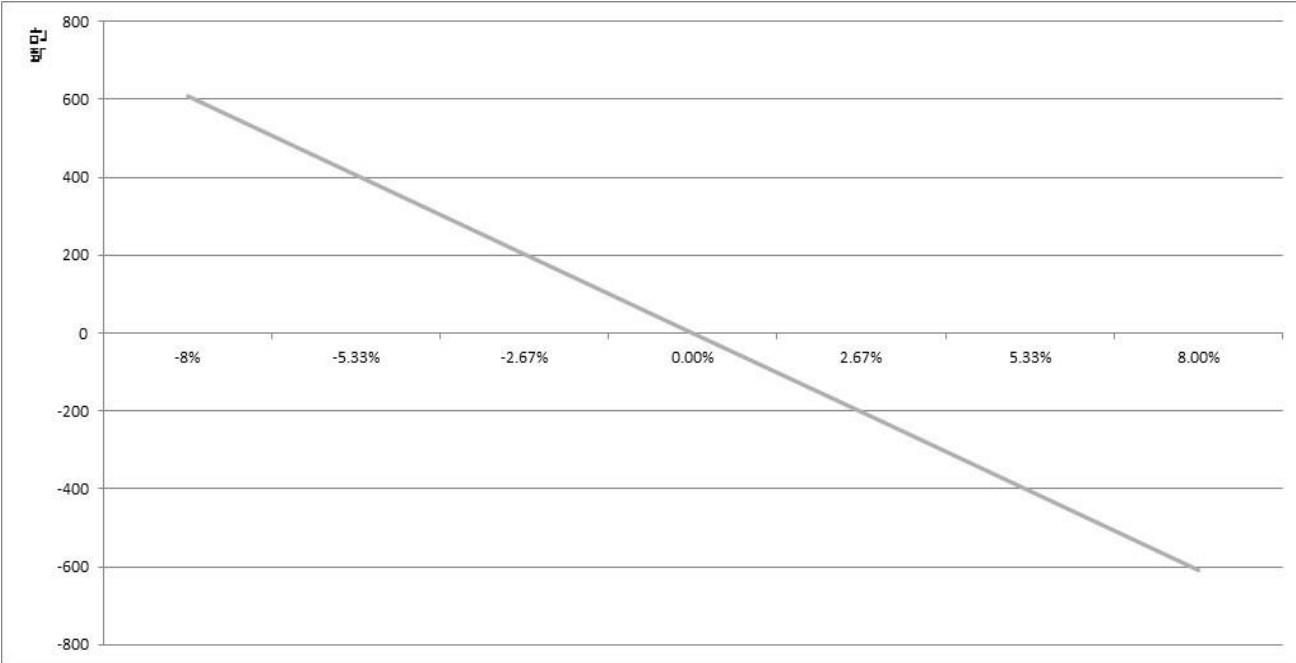
공시일: 2025-06-17

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	7,598	-7,598	장내
합계			0	7,598	-7,598	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

608

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5,817

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

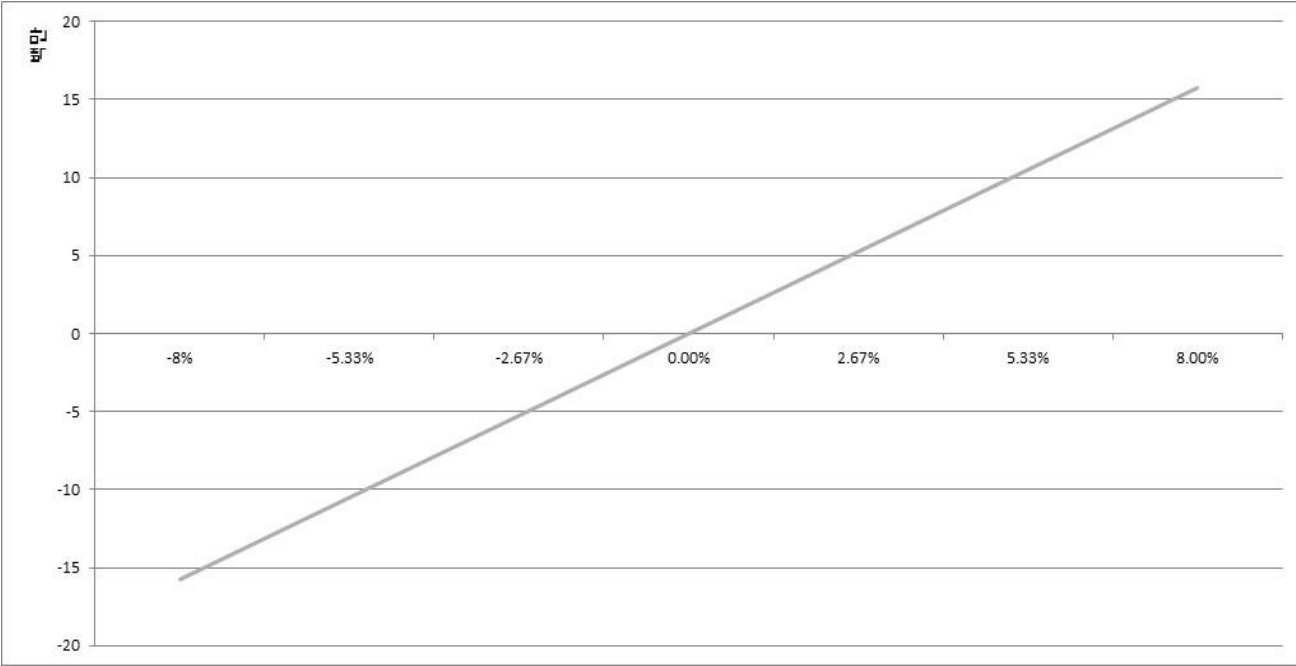
공시일: 2025-06-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	20	-20	장내
누계	주가지수	선물	296	99	197	장내
신규	유가증권	선물	11	0	11	장내
누계	유가증권	선물	23	0	23	장내
합계			318	99	220	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

715

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

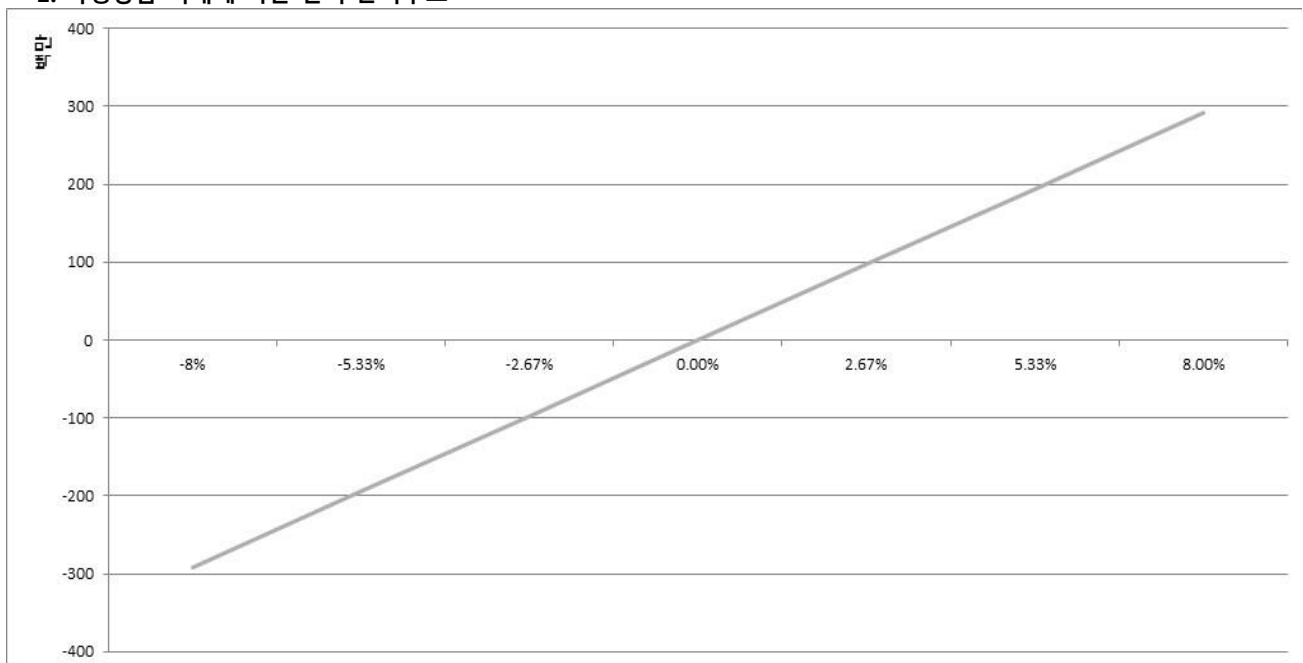
공시일: 2025-06-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	99	0	99	장내
누계	주가지수	선물	3,646	0	3,646	장내
합계			3,646	0	3,646	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

292

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

846

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

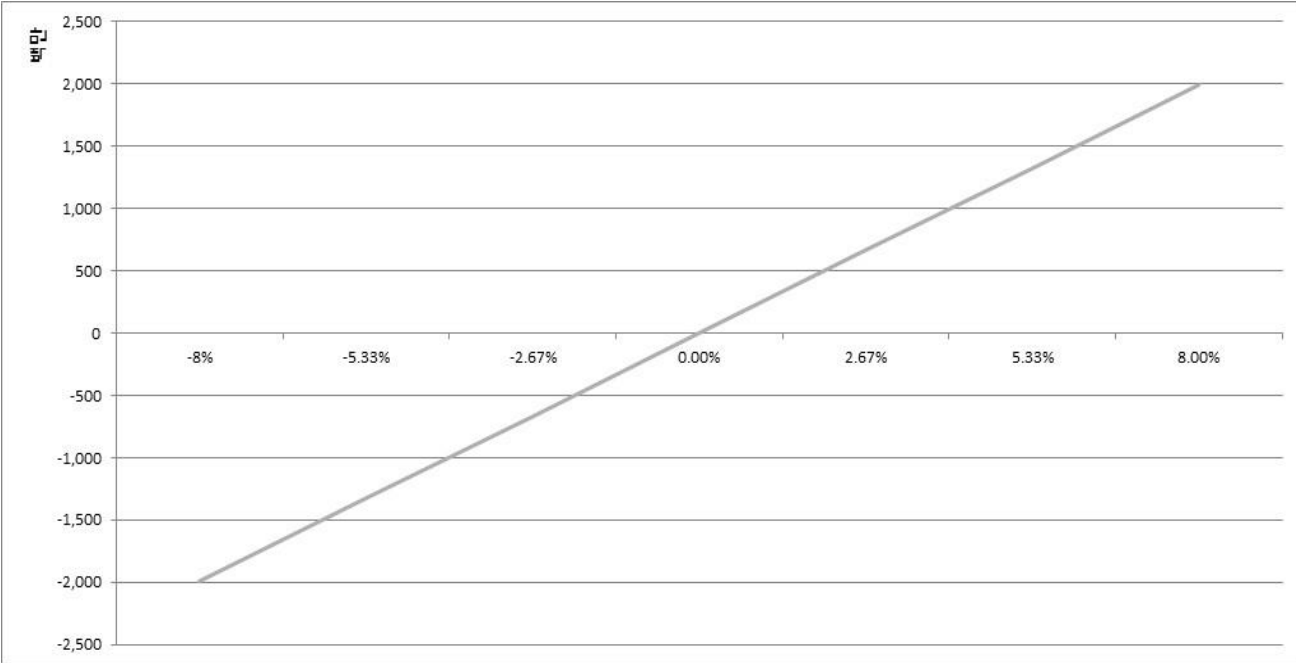
공시일: 2025-06-17

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	24,832	0	24,832	장내
합계			24,832	0	24,832	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,987

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,745

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

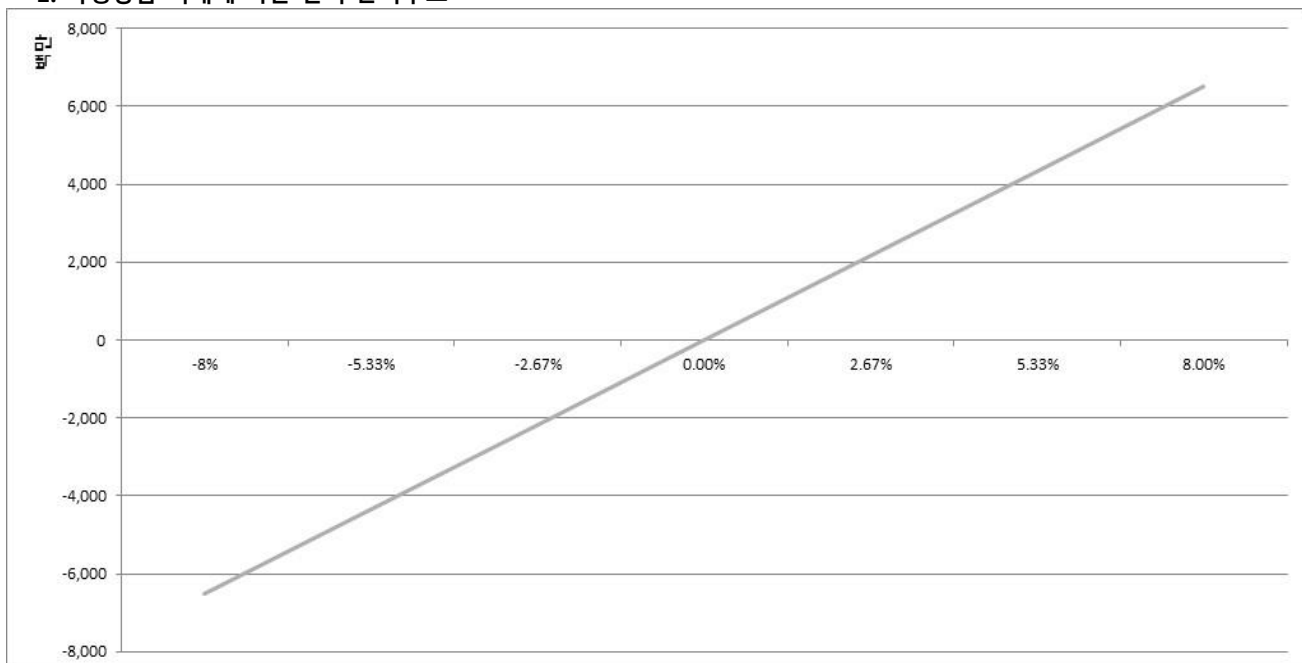
공시일: 2025-06-17

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	81,611	0	81,611	장외
합계			81,611	0	81,611	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,529

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

51