

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

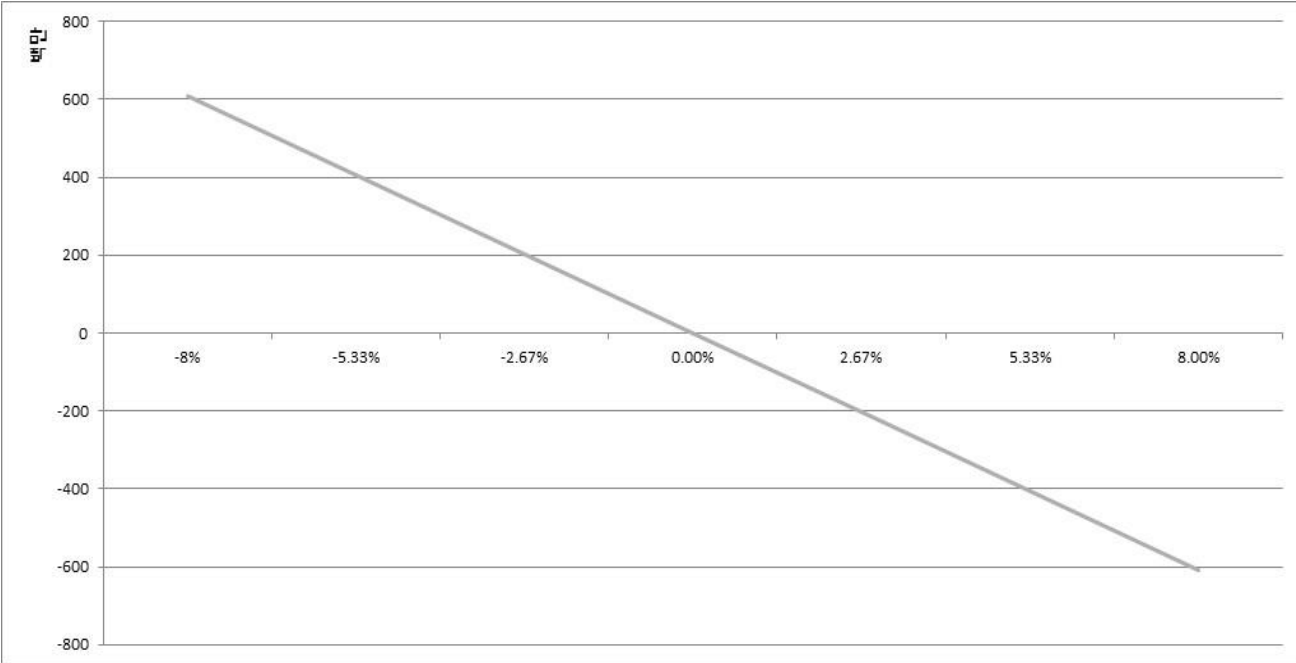
공시일: 2025-06-19

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	7,581	-7,581	장내
합계			0	7,581	-7,581	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

609

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,979

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

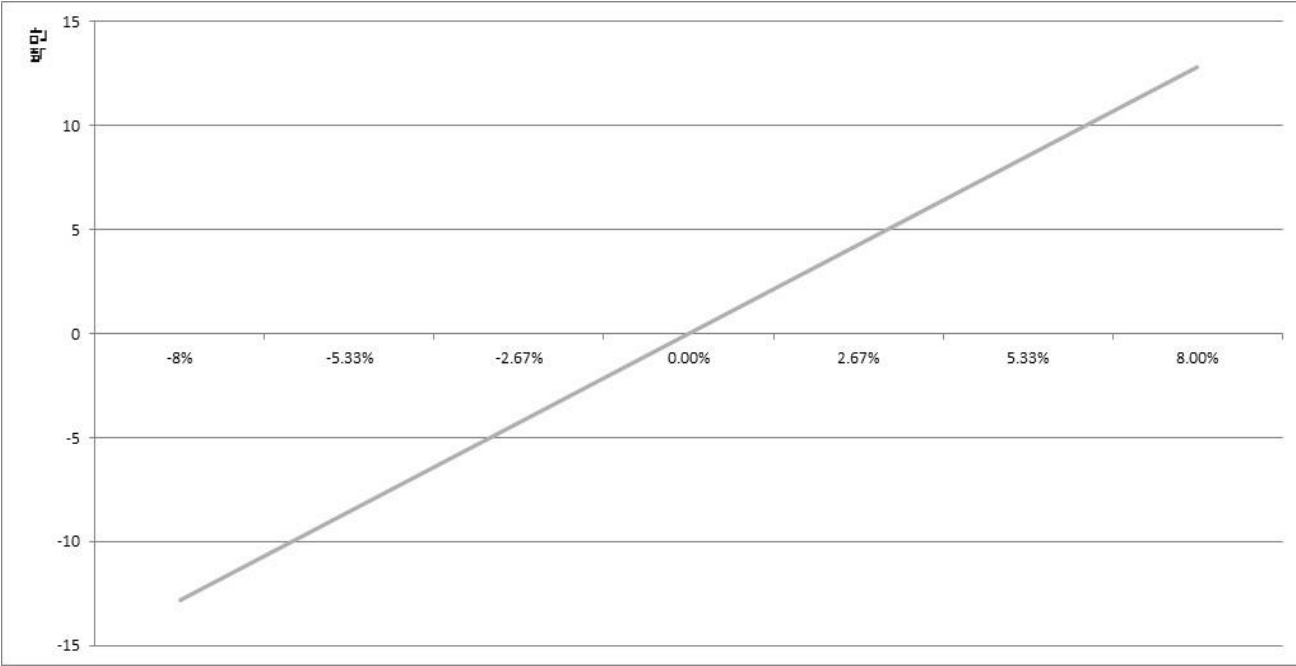
공시일: 2025-06-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	20	60	-40	장내
누계	주가지수	선물	299	140	160	장내
신규	유가증권	선물	46	150	-105	장내
누계	유가증권	선물	23	59	-36	장내
합계			322	198	124	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

713

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

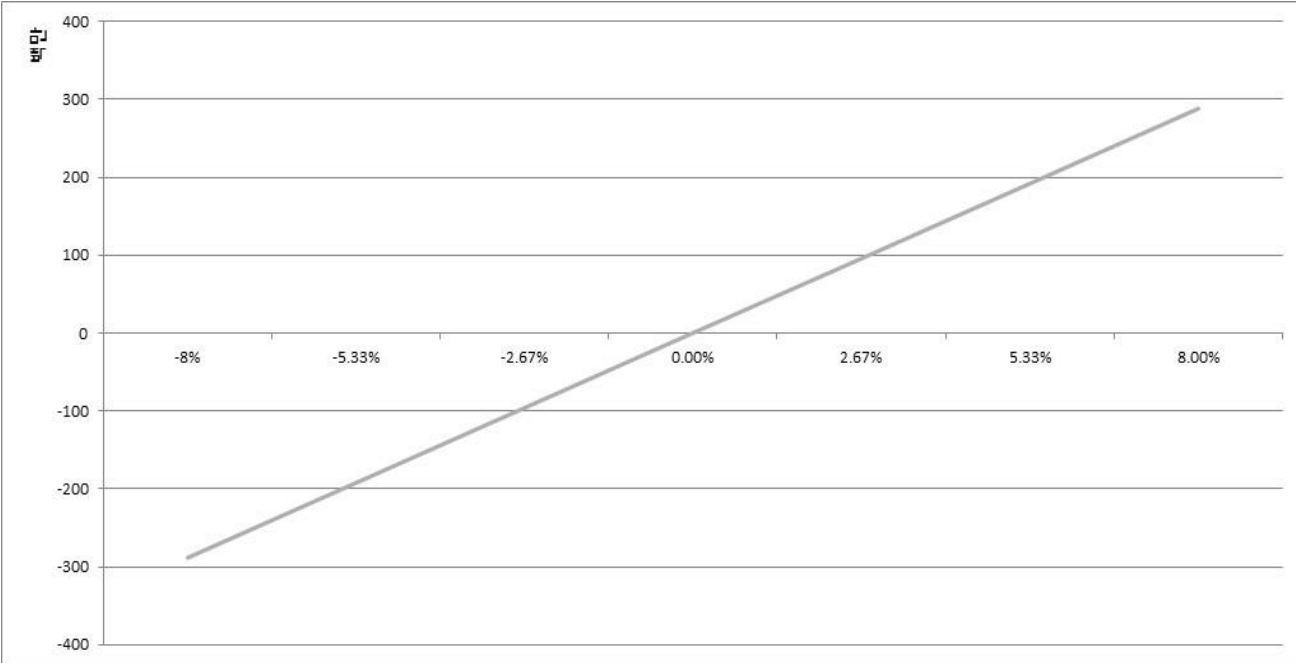
공시일: 2025-06-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	100	-100	장내
누계	주가지수	선물	3,590	0	3,590	장내
합계			3,590	0	3,590	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

288

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

849

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

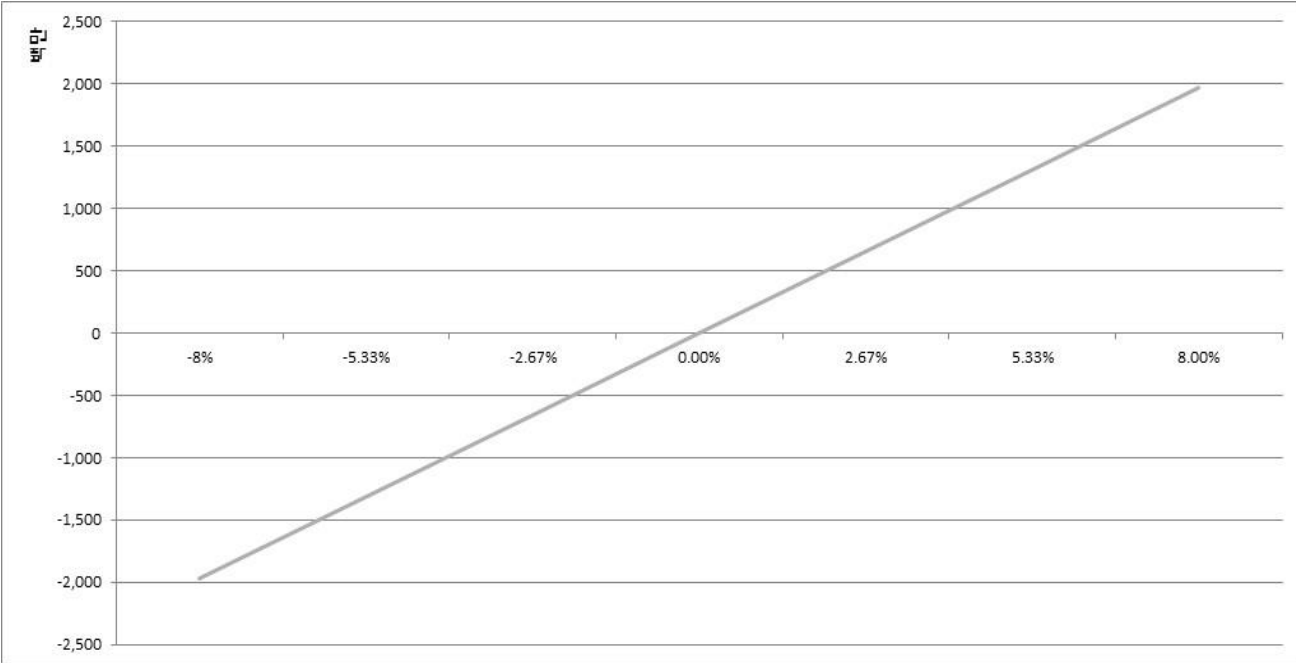
공시일: 2025-06-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	499	-499	장내
누계	주가지수	선물	24,630	0	24,630	장내
합계			24,630	0	24,630	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,973

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,741

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

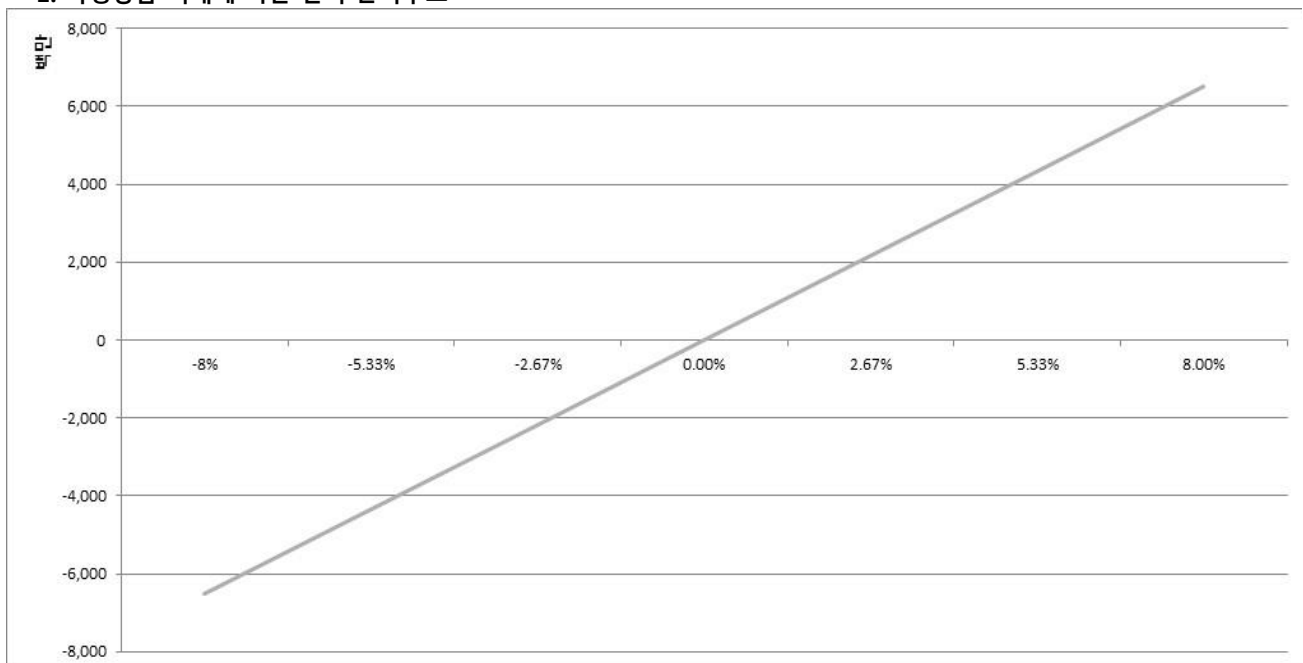
공시일: 2025-06-19

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	81,622	0	81,622	장외
합계			81,622	0	81,622	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,530

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

50