

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

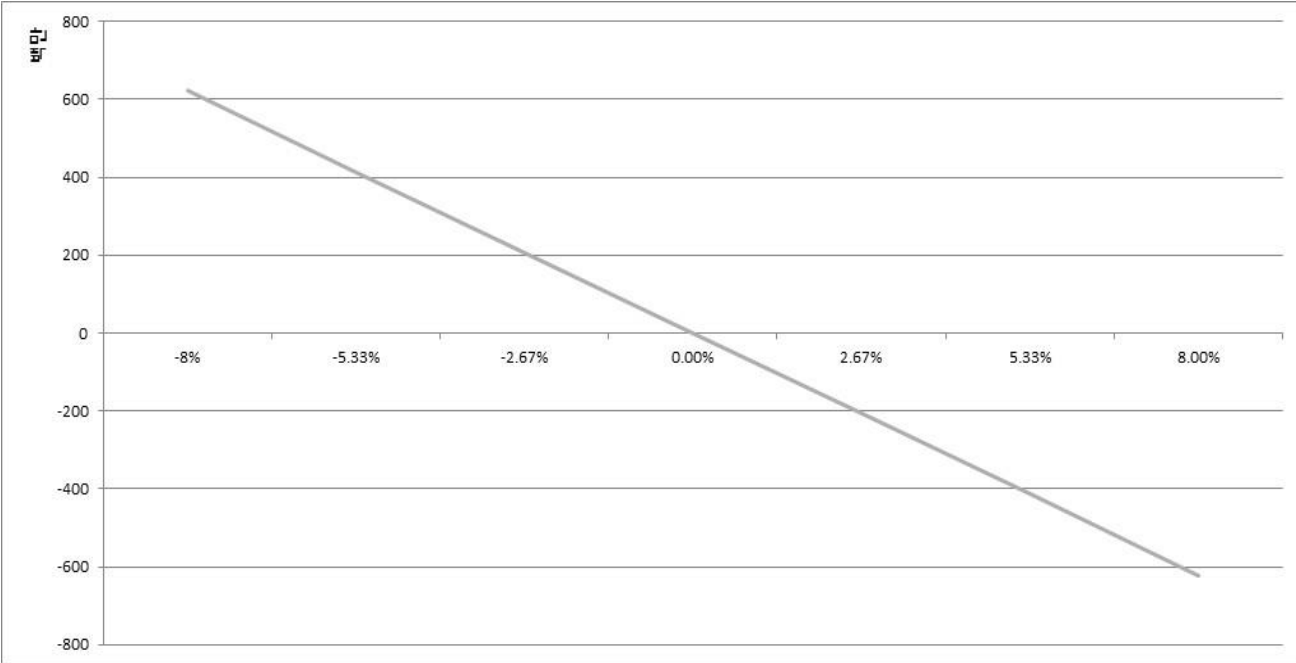
공시일: 2025-06-23

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     | 7,755 | -7,755    | 장내 |
| 합계 |      |      | 0     | 7,755 | -7,755    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

622

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,593

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

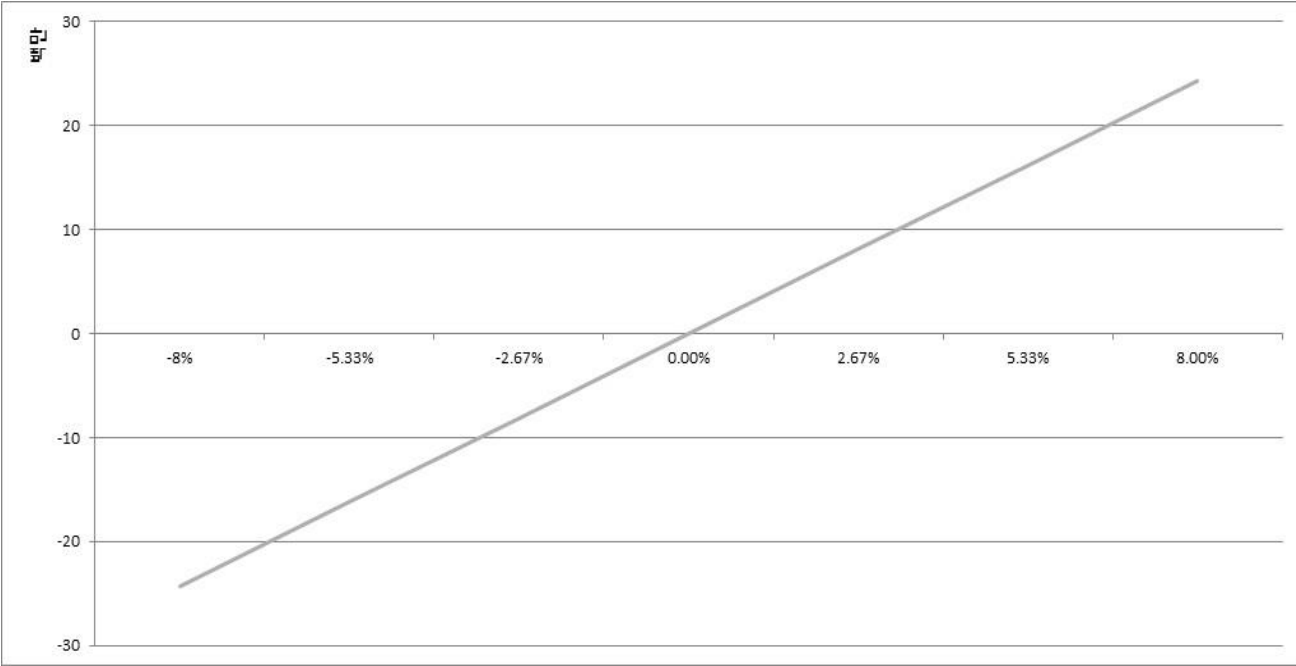
공시일: 2025-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 20    | 0     | 20        | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 304   | 0     | 304       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 21    | 7     | 13        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 28    | 18    | 10        | 장내 |
| 합계 |      |      | 332   | 18    | 314       |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

705

## 펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

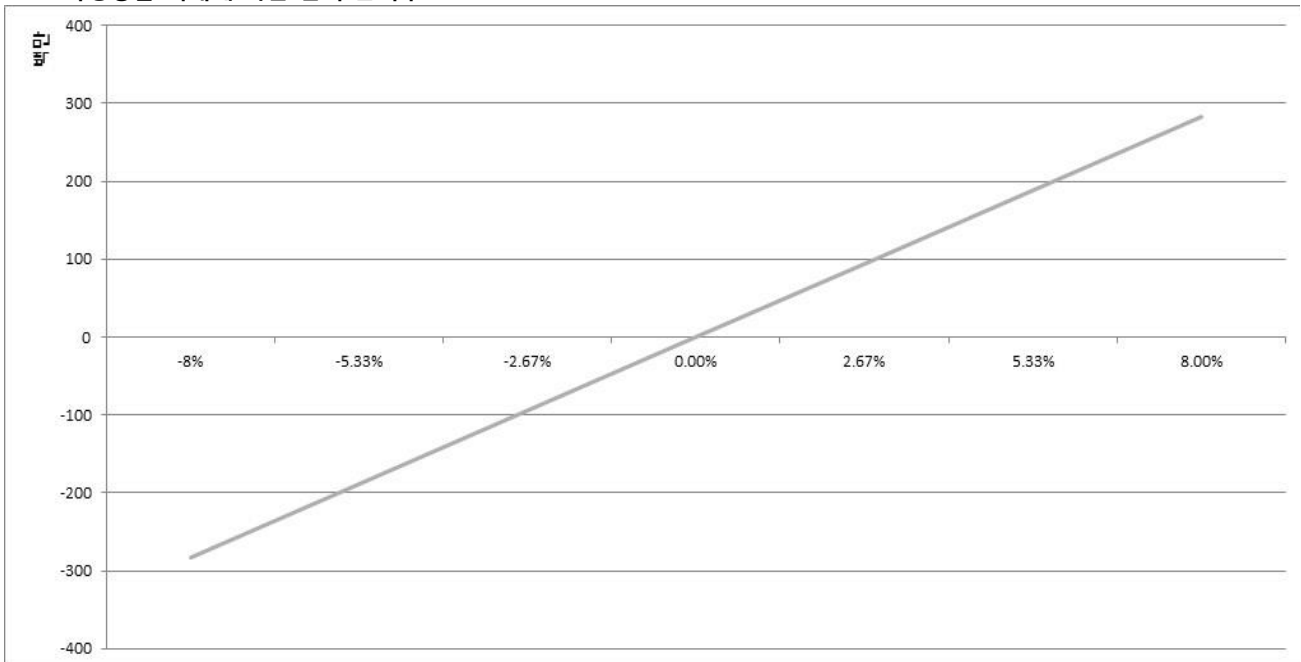
공시일: 2025-06-23

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0     | 101   | -101      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 3,547 | 0     | 3,547     | 장내 |
| 합계 |      |      | 3,547 | 0     | 3,547     |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

284

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

856

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

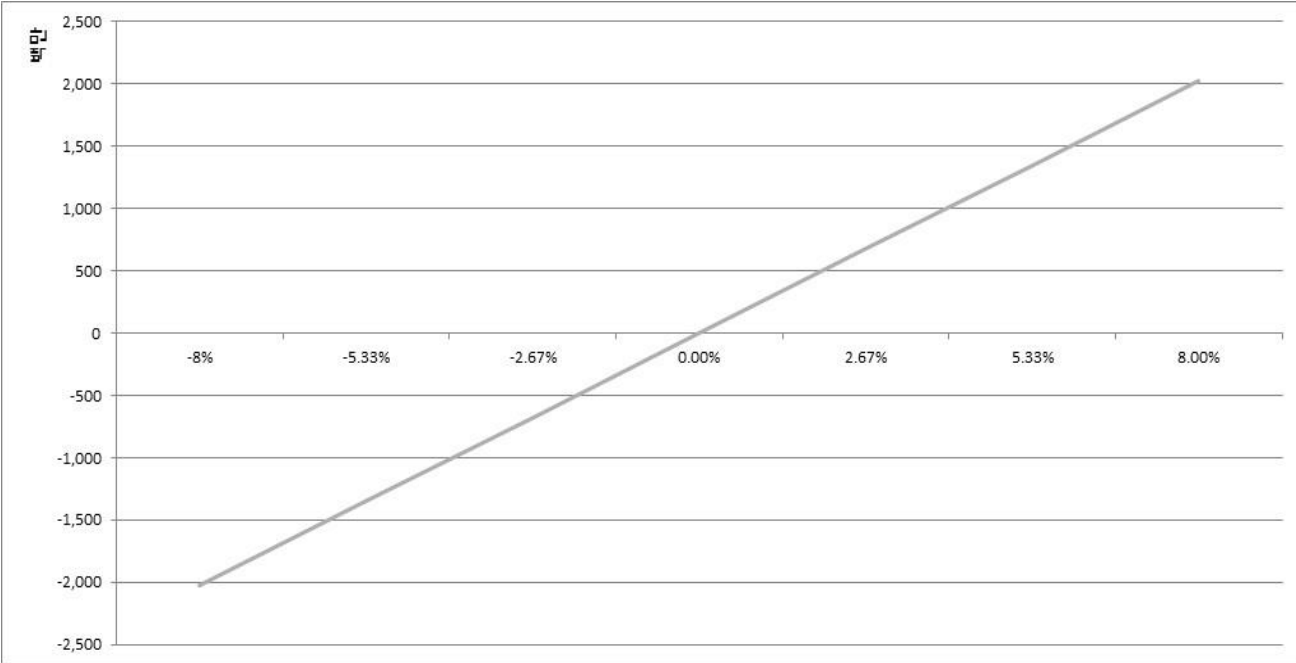
공시일: 2025-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 304    | 0     | 304       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 25,333 | 0     | 25,333    | 장내 |
| 합계 |      |      | 25,333 | 0     | 25,333    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,026

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,831

## 펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

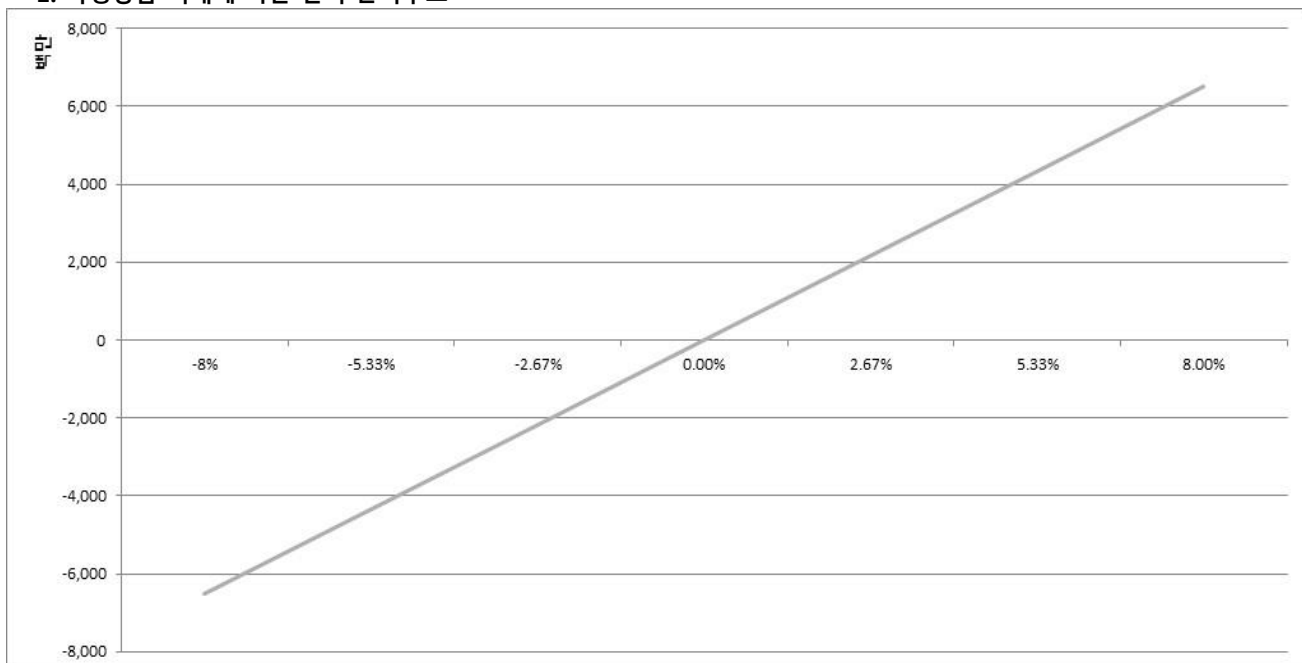
공시일: 2025-06-23

### 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   | 81,645 | 0     | 81,645    | 장외 |
| 합계 |      |      | 81,645 | 0     | 81,645    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,532

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

50