

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

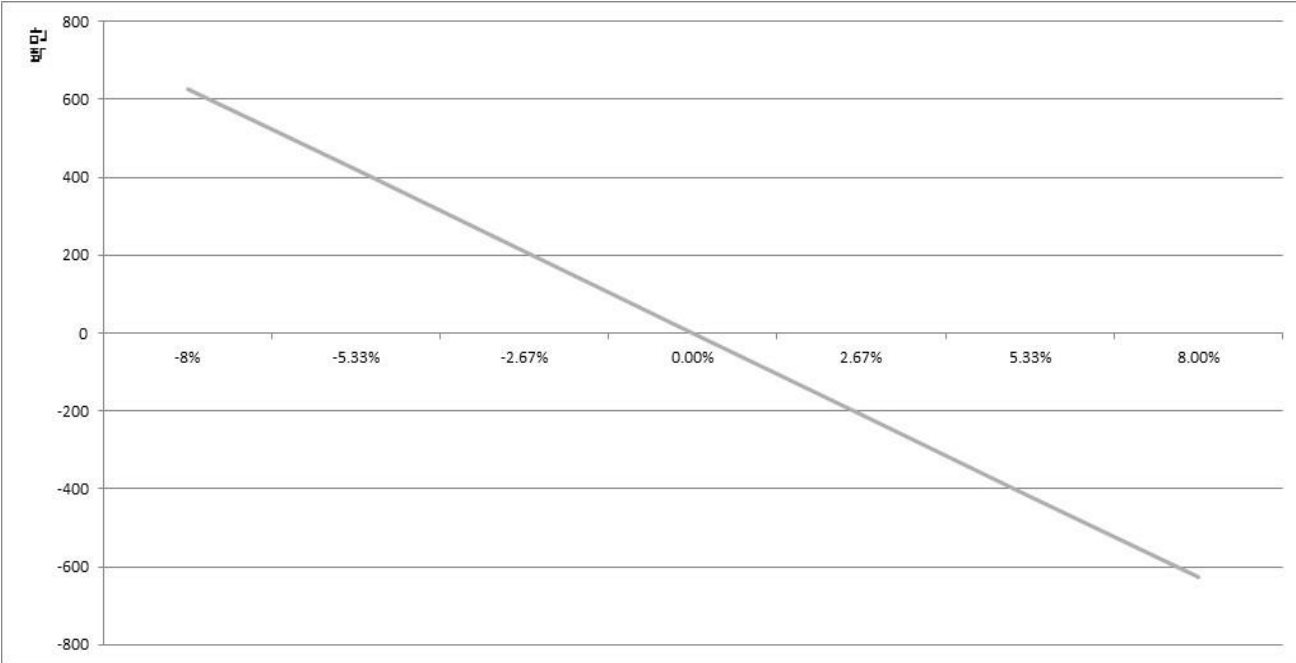
공시일: 2025-06-25

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	7,823	-7,823	장내
합계			0	7,823	-7,823	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

628

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,624

펀드명 : 피가로인덱스[주식-파생]

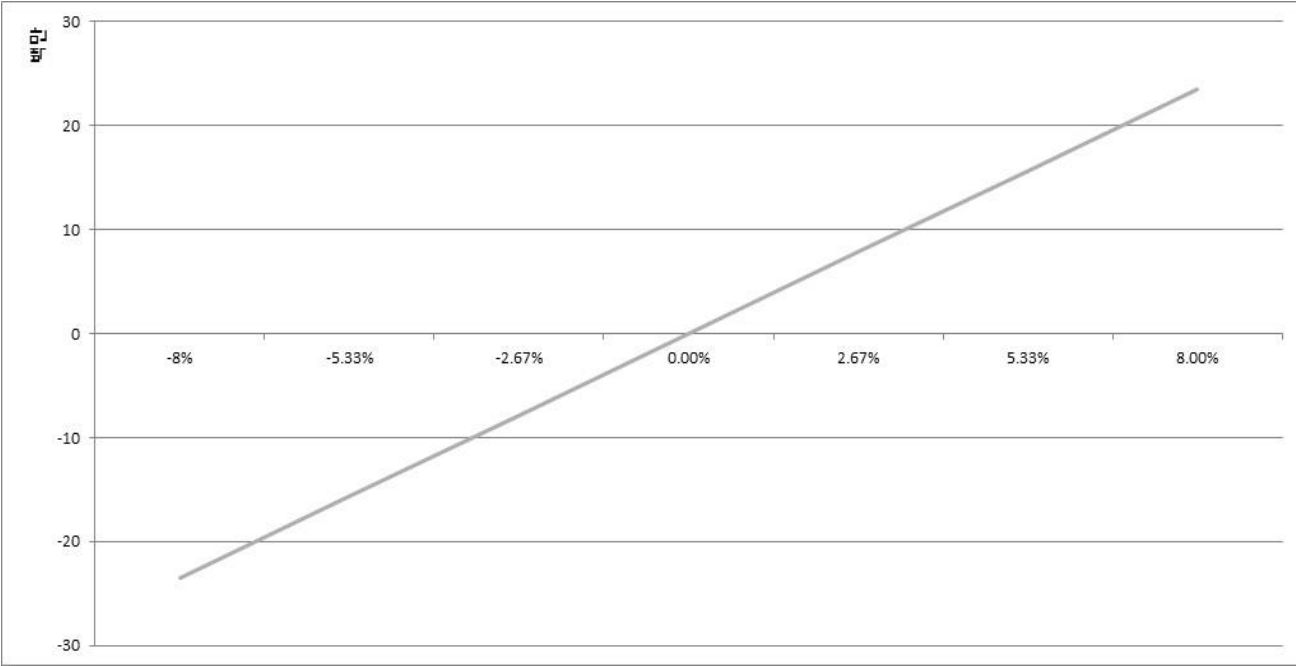
공시일: 2025-06-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	42	0	42	장내
누계	주가지수	선물	313	21	292	장내
신규	유가증권	선물	7	27	-20	장내
누계	유가증권	선물	87	45	42	장내
합계			400	66	334	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

734

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

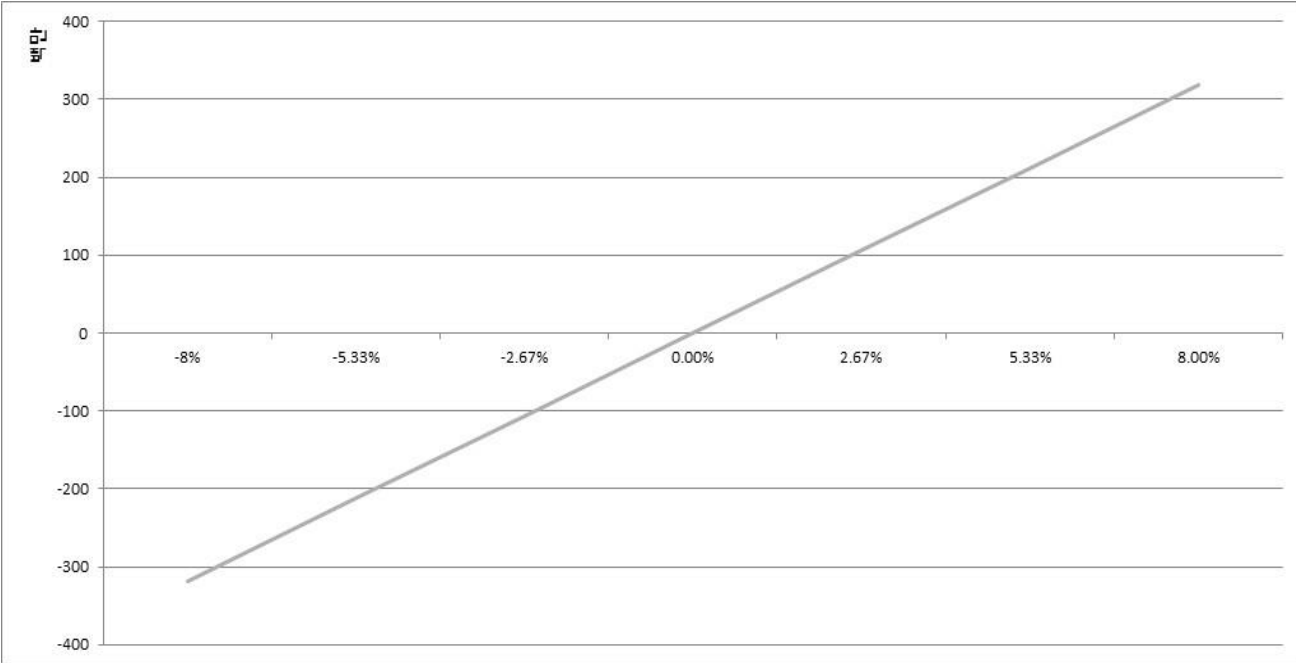
공시일: 2025-06-25

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	3,969	0	3,969	장내
합계			3,969	0	3,969	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

318

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

923

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

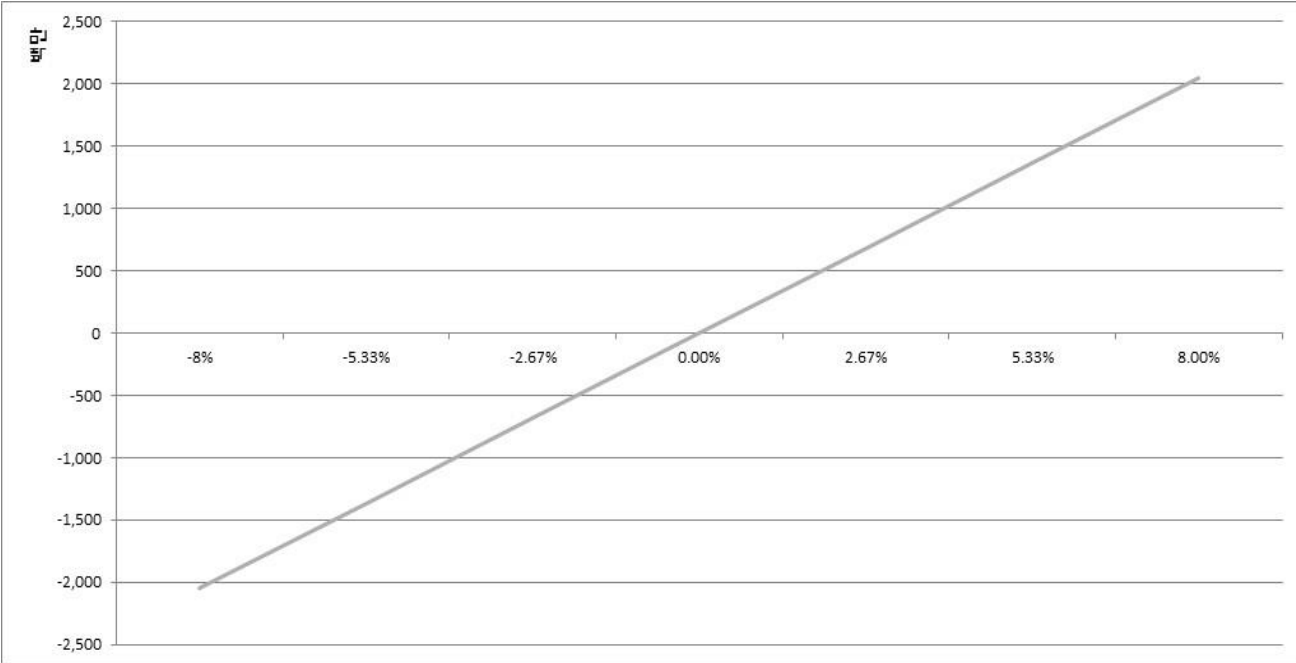
공시일: 2025-06-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	209	-209	장내
누계	주가지수	선물	25,588	0	25,588	장내
합계			25,588	0	25,588	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,052

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,940

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

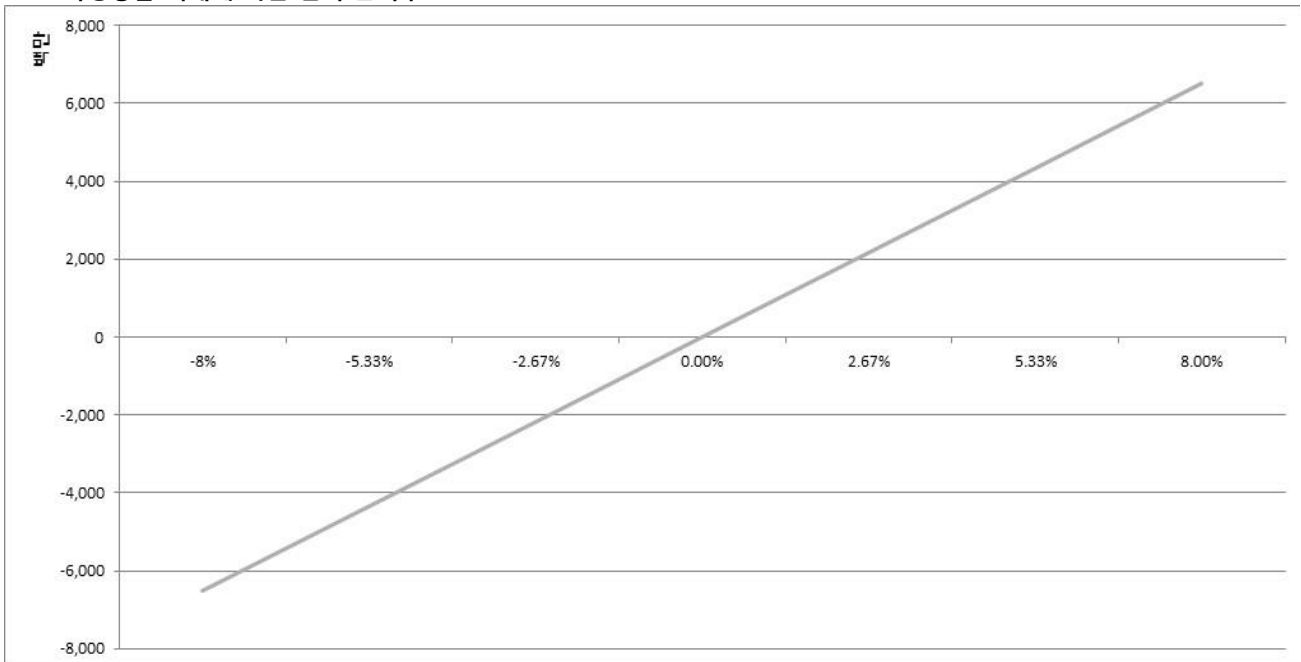
공시일: 2025-06-25

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	81,656	0	81,656	장외
합계			81,656	0	81,656	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,533

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

50