

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

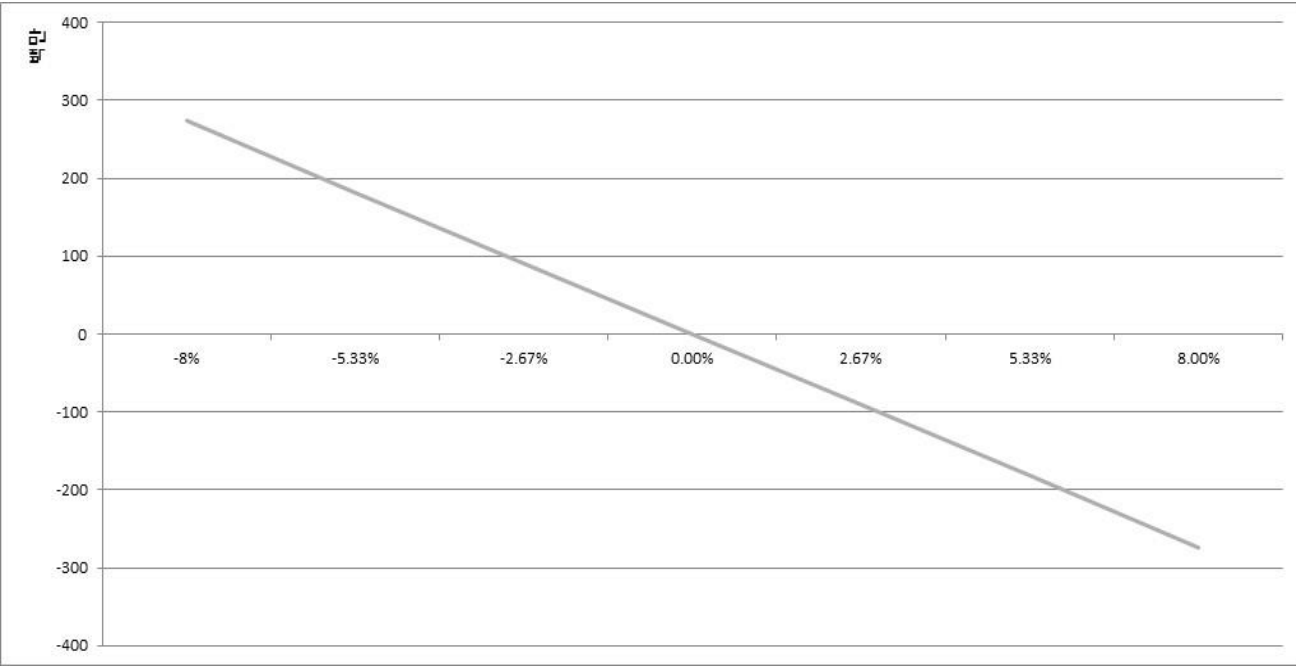
공시일: 2025-11-27

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	3,416	-3,416	장내
합계			0	3,416	-3,416	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

273

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,362

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

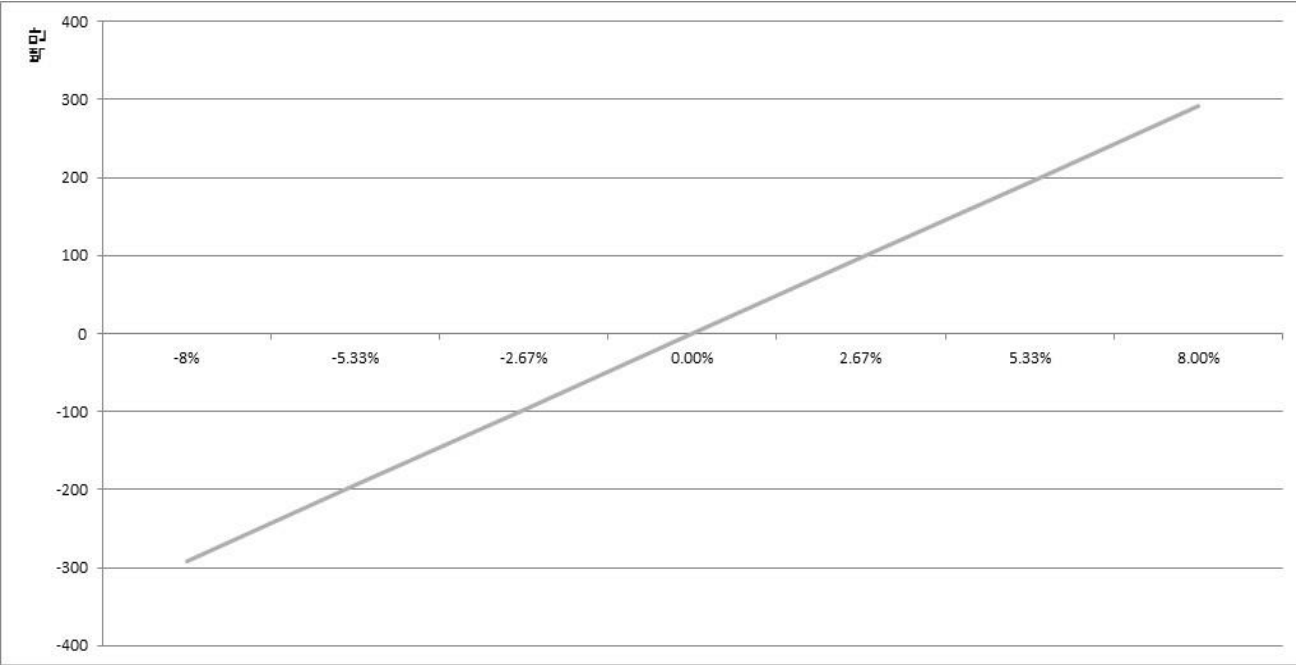
공시일: 2025-11-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	280	-280	장내
누계	주가지수	선물	3,636	0	3,636	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	73	0	73	장내
합계			3,709	0	3,709	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

291

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,094

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

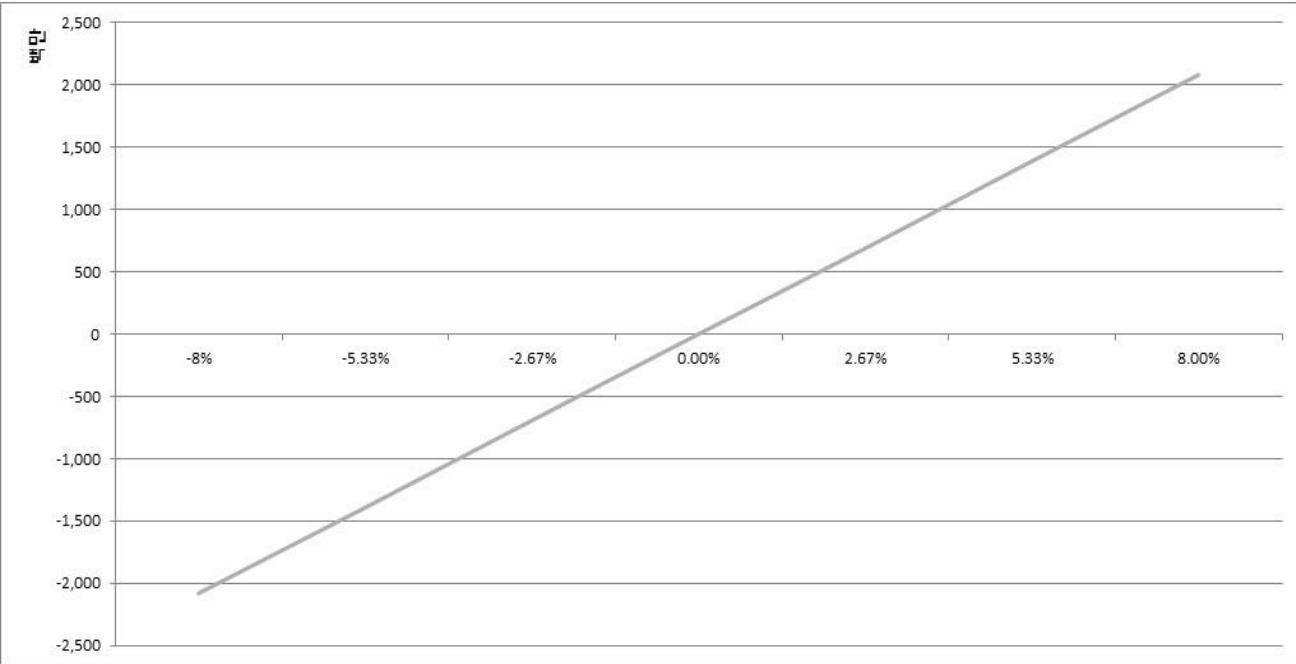
공시일: 2025-11-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	420	0	420	장내
누계	주가지수	선물	26,011	0	26,011	장내
합계			26,011	0	26,011	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,082

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,787

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

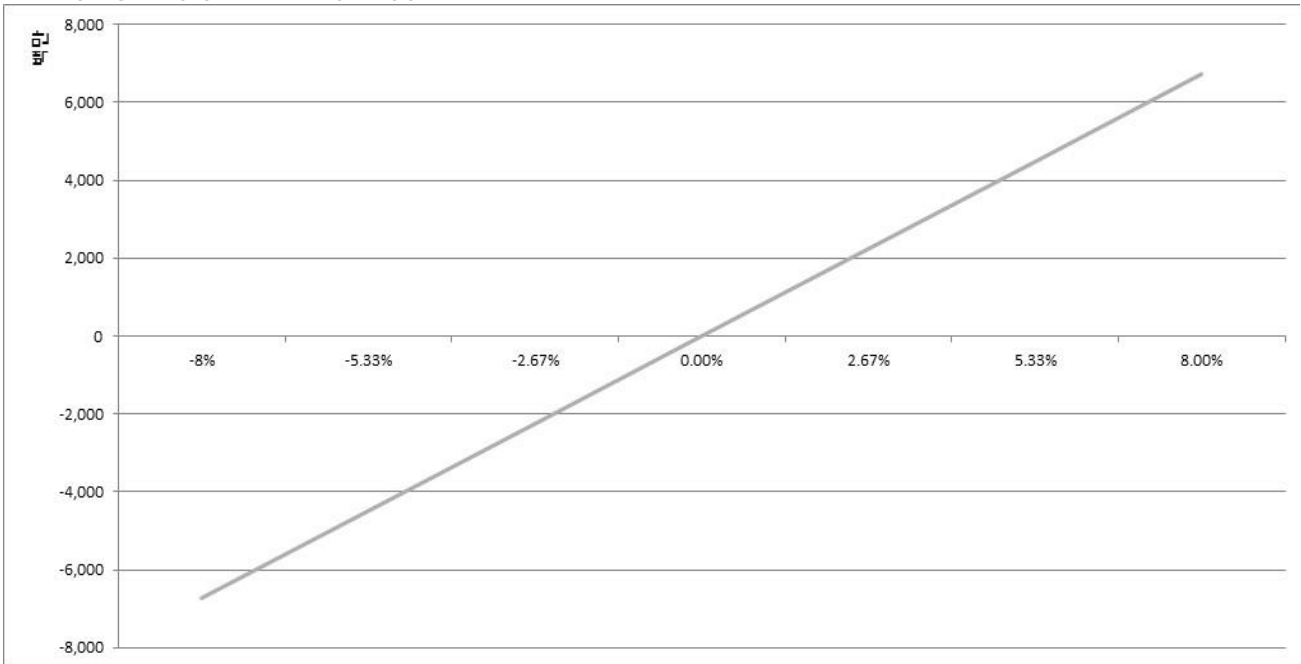
공시일: 2025-11-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	금리지수	스왑	0	0	0	장외
누계	금리지수	스왑	84,070	0	84,070	장외
합계			84,070	0	84,070	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,726

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52