

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

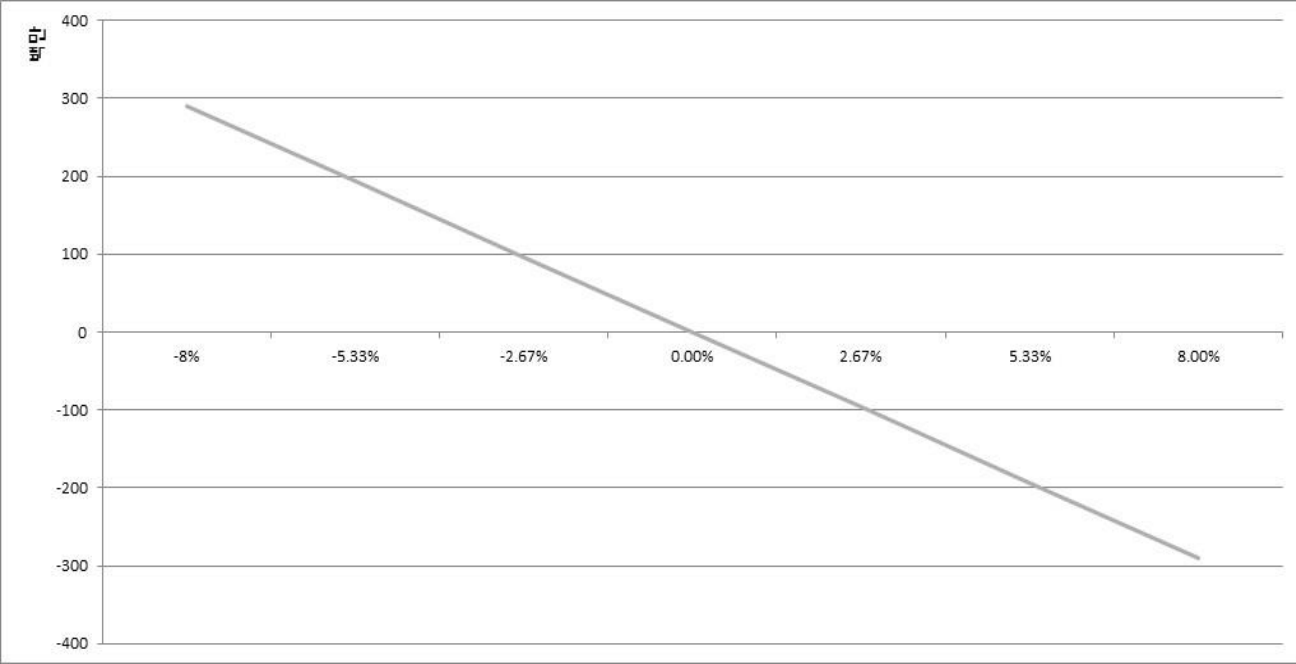
공시일: 2025-12-03

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     | 3,629 | -3,629    | 장내 |
| 합계 |      |      | 0     | 3,629 | -3,629    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

290

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,862

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

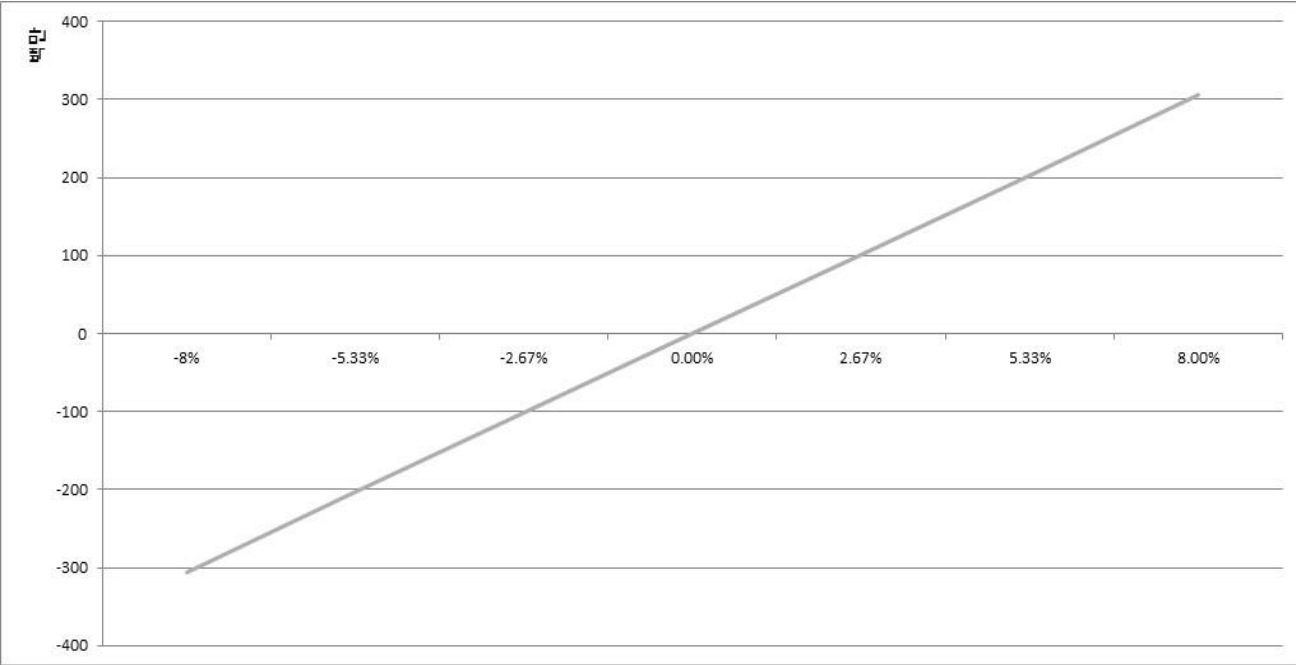
공시일: 2025-12-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0     | 141   | -141      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 3,819 | 0     | 3,819     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 78    | 0     | 78        | 장내 |
| 합계 |      |      | 3,897 | 0     | 3,897     |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

305

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,114

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

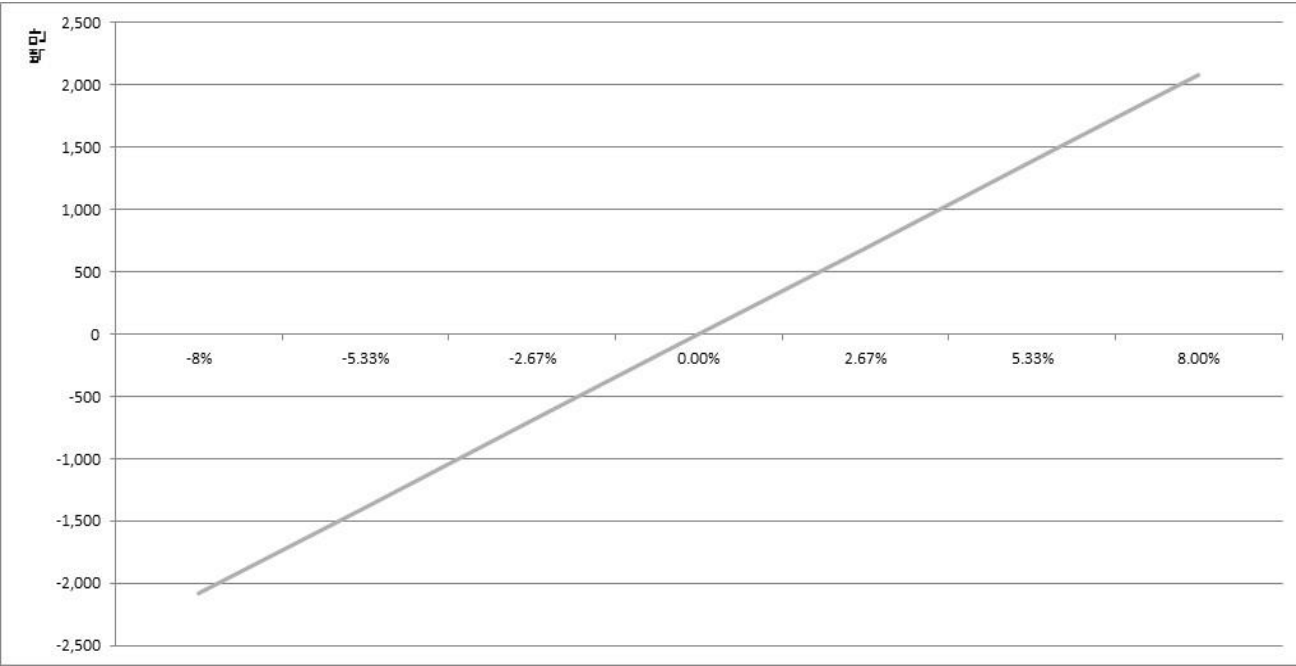
공시일: 2025-12-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 424    | 0     | 424       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 26,023 | 0     | 26,023    | 장내 |
| 합계 |      |      | 26,023 | 0     | 26,023    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,081

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,797

## 펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

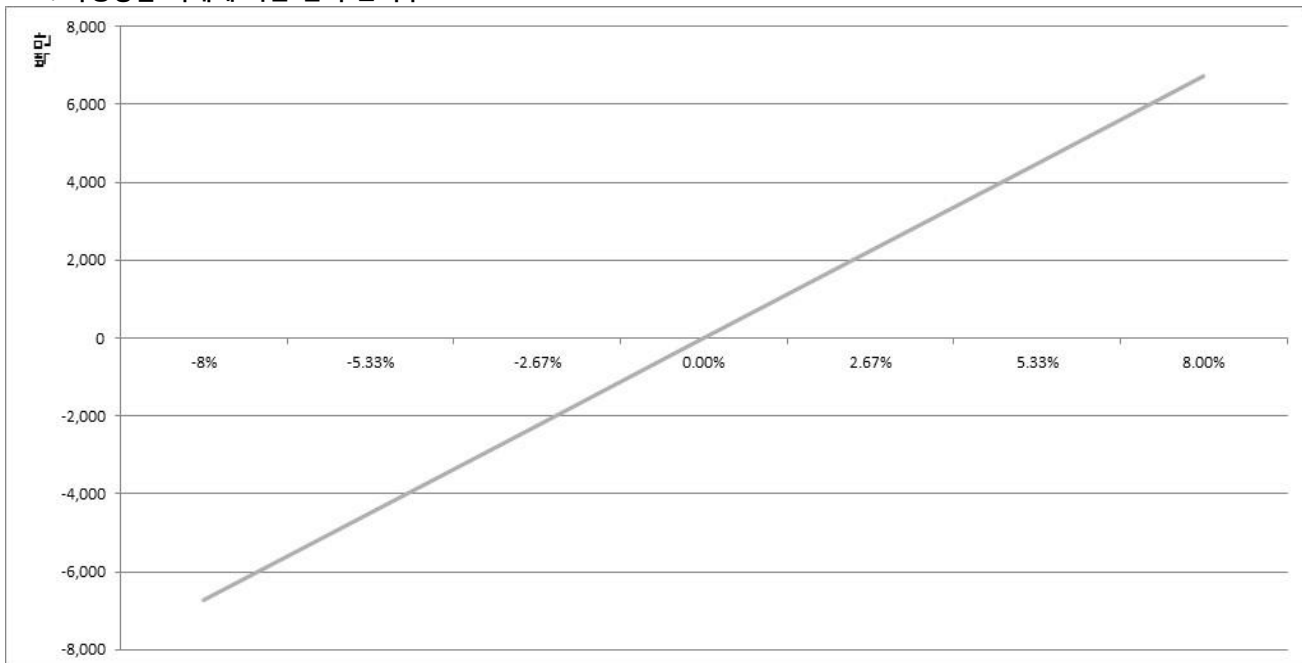
공시일: 2025-12-03

### 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   | 84,108 | 0     | 84,108    | 장외 |
| 합계 |      |      | 84,108 | 0     | 84,108    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,729

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52