

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

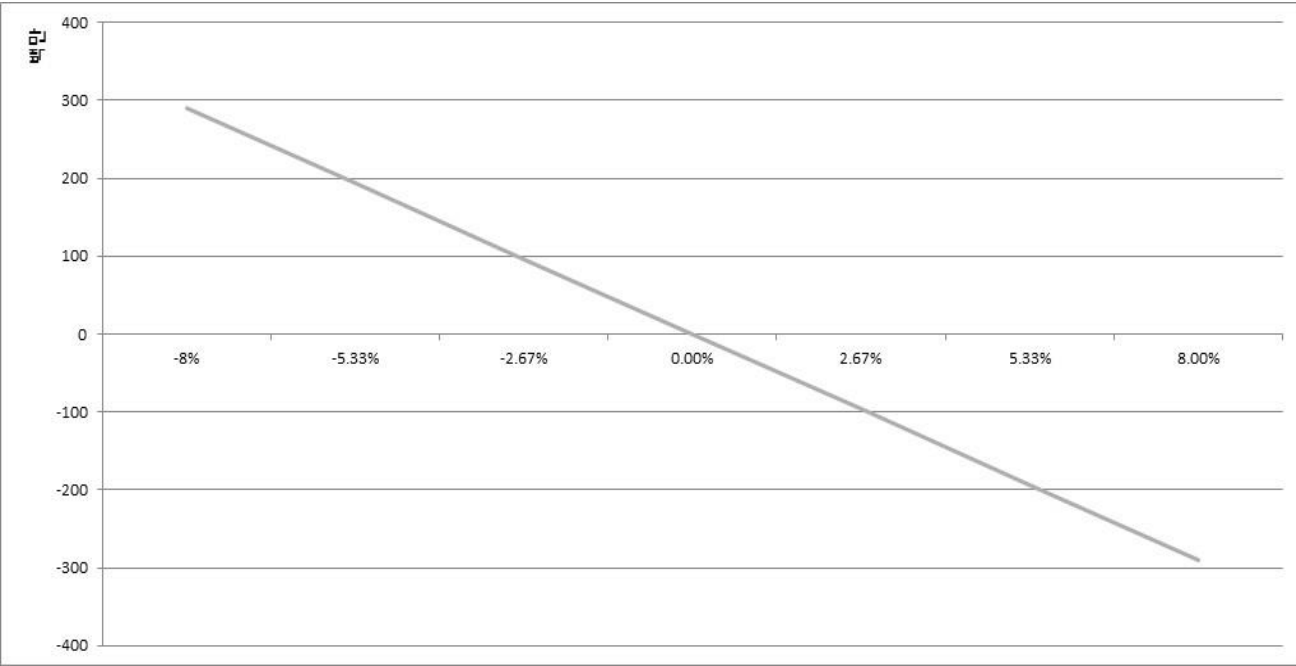
공시일: 2025-12-04

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	3,628	-3,628	장내
합계			0	3,628	-3,628	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

290

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,874

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

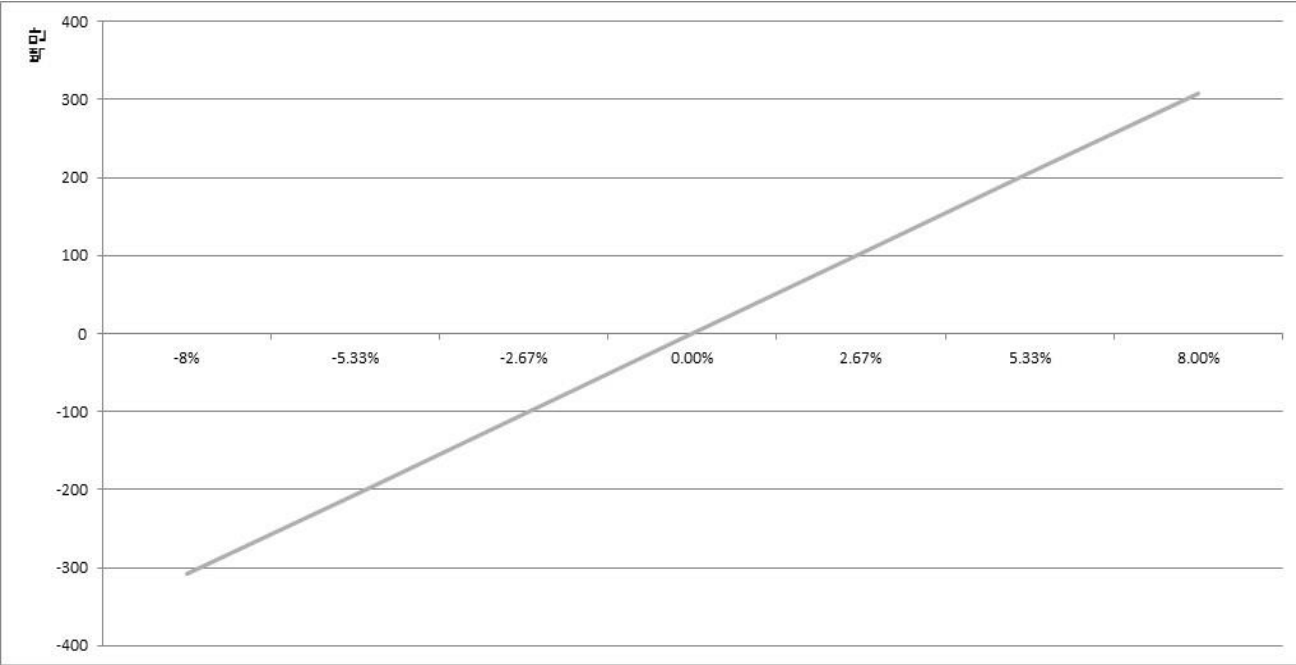
공시일: 2025-12-04

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	3,853	0	3,853	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	77	0	77	장내
합계			3,930	0	3,930	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

308

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,125

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

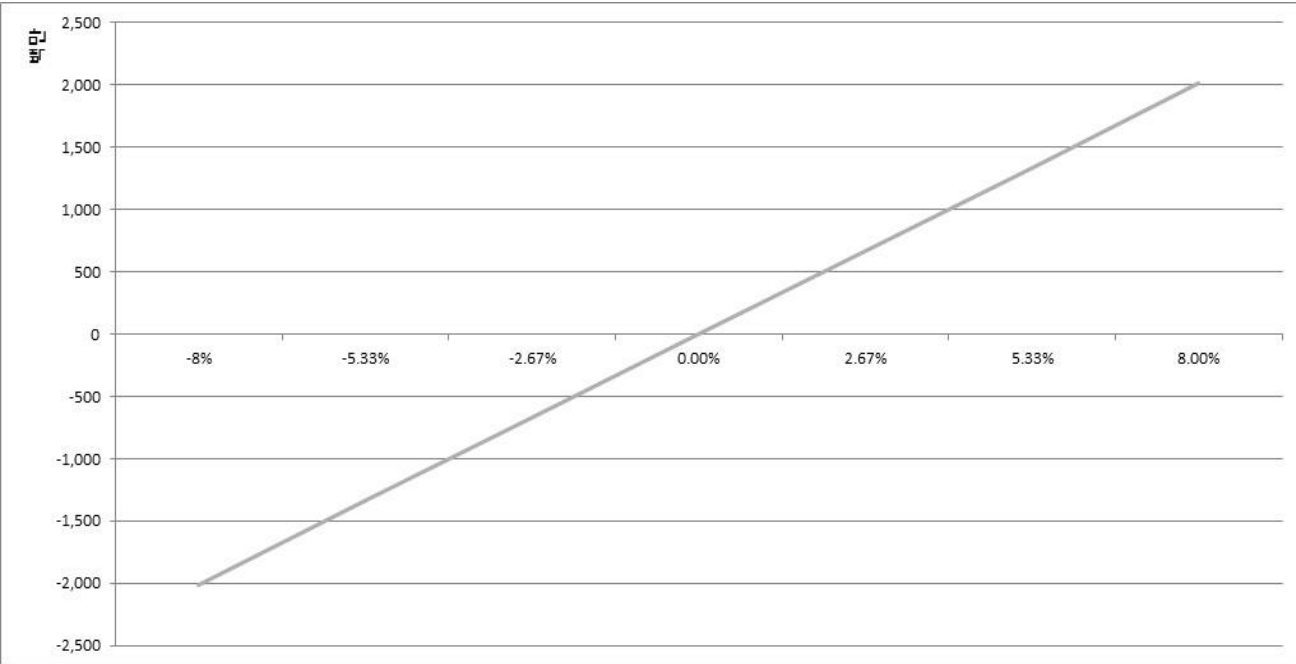
공시일: 2025-12-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,142	-1,142	장내
누계	주가지수	선물	25,115	0	25,115	장내
합계			25,115	0	25,115	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,011

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,729

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

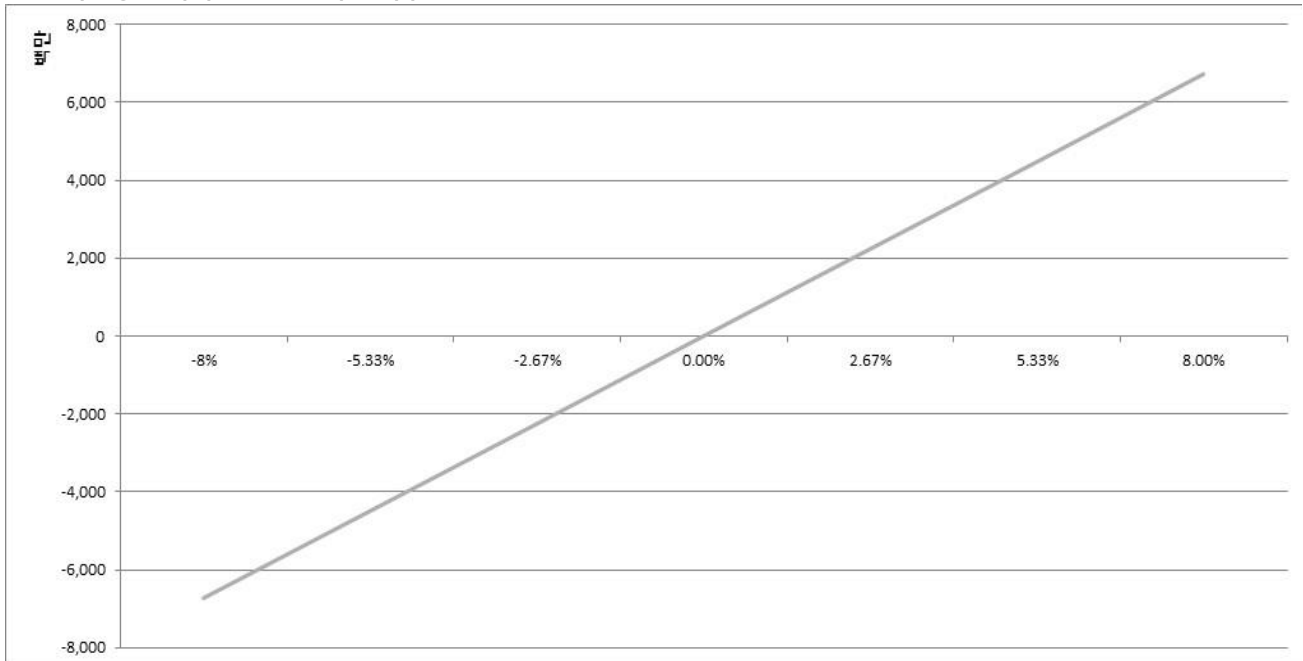
공시일: 2025-12-04

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	84,115	0	84,115	장외
합계			84,115	0	84,115	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,729

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52