

펀드명 : 코스닥벤처기업&공모주[주식혼합-파생형]

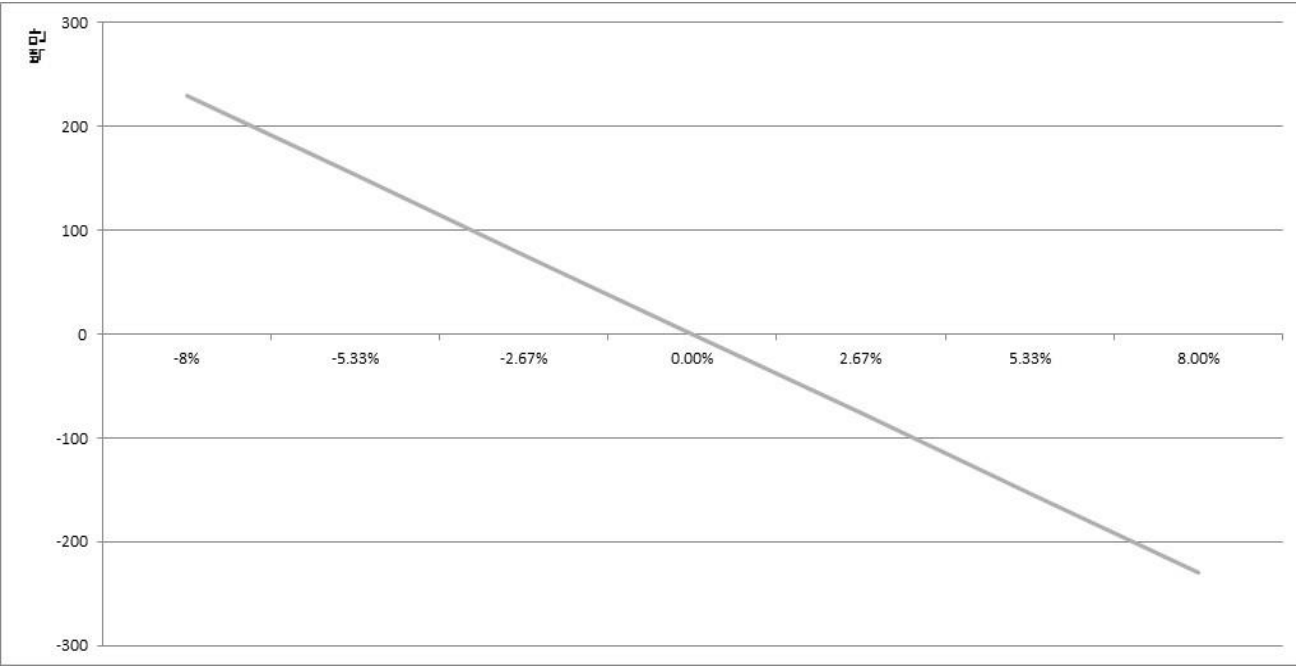
공시일: 2025-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,580	2,877	703	장내
누계	주가지수	선물	0	2,877	-2,877	장내
합계			0	2,877	-2,877	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

230

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,843

펀드명 : 엠브렐러뉴인덱스K1[주식-파생]

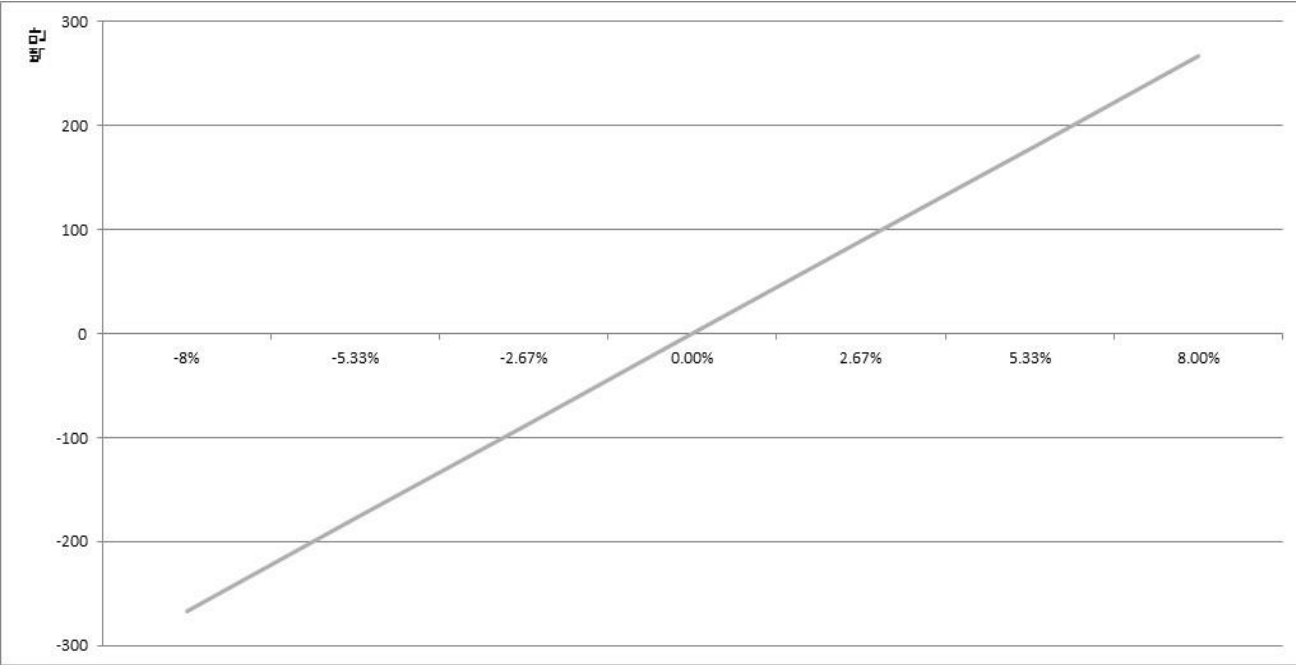
공시일: 2025-12-12

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	3,336	0	3,336	장내
신규	유가증권	선물	0	11	-11	장내
누계	유가증권	선물	68	0	68	장내
합계			3,404	0	3,404	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

267

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,083

펀드명 : 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형]

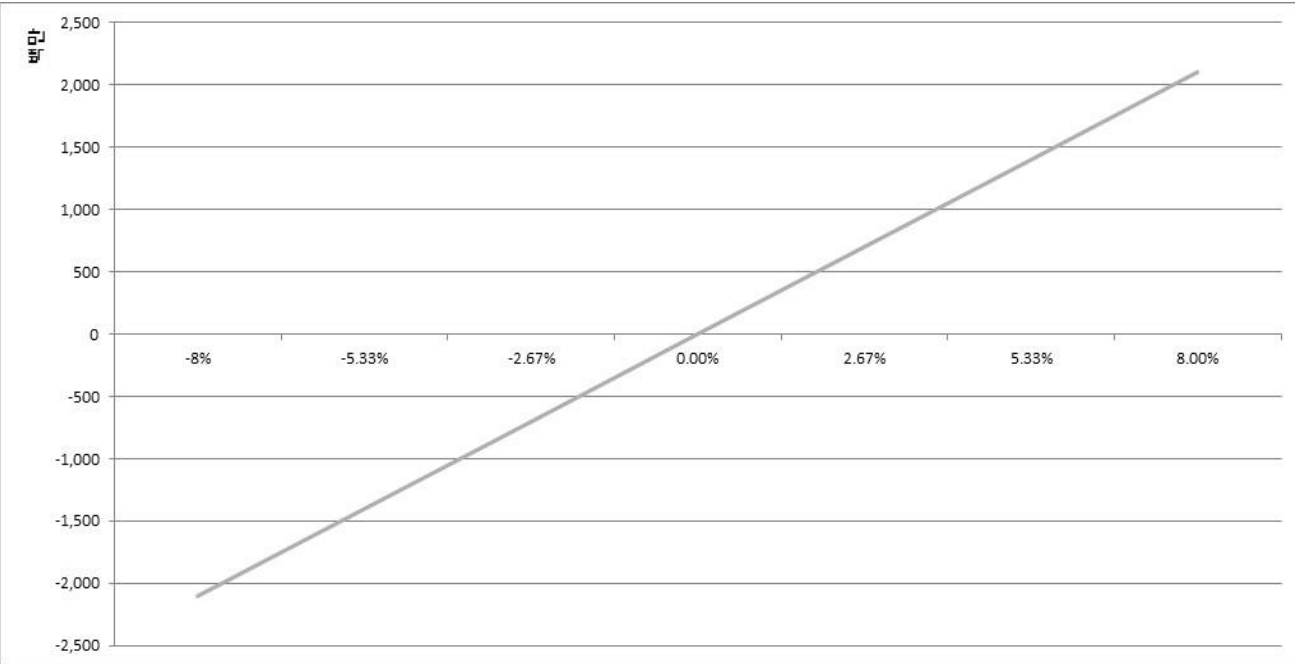
공시일: 2025-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	4,496	4,931	-435	장내
누계	주가지수	선물	26,252	0	26,252	장내
합계			26,252	0	26,252	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,099

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,840

펀드명 : 1Q CD금리액티브(합성)

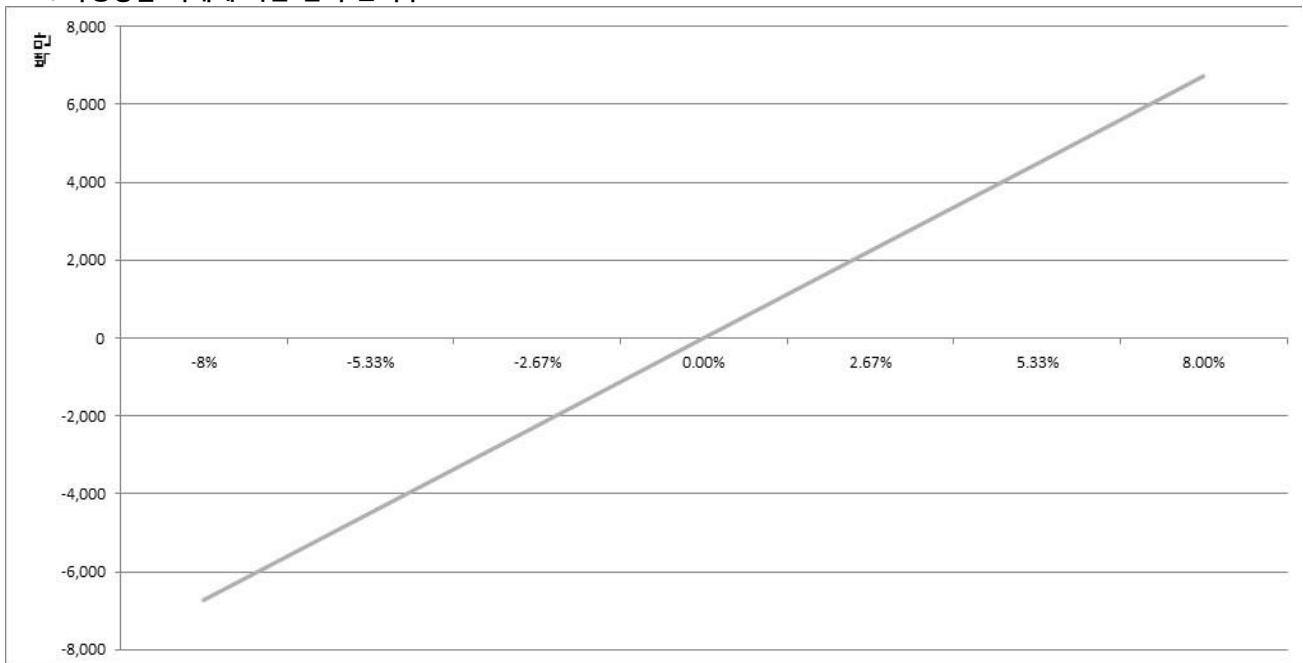
공시일: 2025-12-12

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	84,167	0	84,167	장외
합계			84,167	0	84,167	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,733

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51