

펀드명 : K200인덱스(주식-파생형)(모펀드)

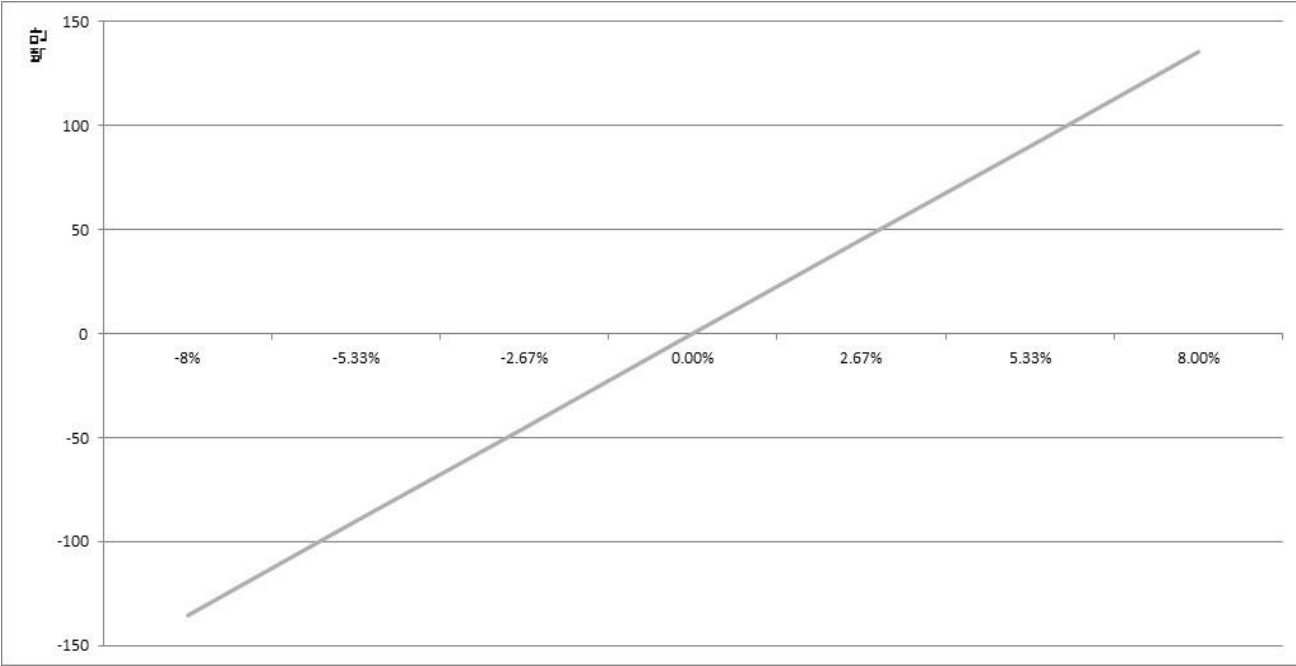
공시일: 2025-08-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 106   | 0     | 106       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 1,695 | 0     | 1,695     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 239   | 8     | 231       | 장내 |
| 합계 |      |      | 1,933 | 8     | 1,925     |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

136

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,944