

## 펀드명 : K200인덱스(주식-파생형)(모펀드)

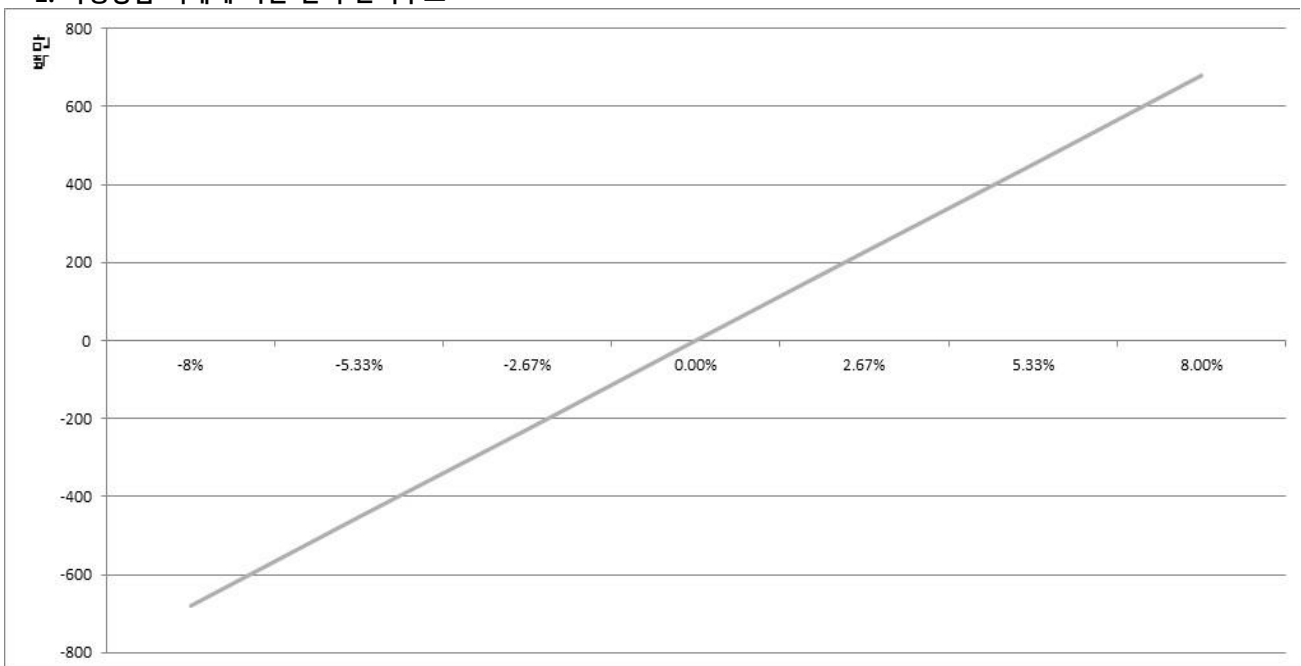
공시일: 2026-09-03

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 1,032 | 0     | 1,032     | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 8,510 | 0     | 8,510     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 33    | 529   | -496      | 장내 |
| 합계 |      |      | 8,543 | 529   | 8,014     |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

679

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

49,552