# 펀드명 : K200인덱스(주식-파생형)(모펀드)

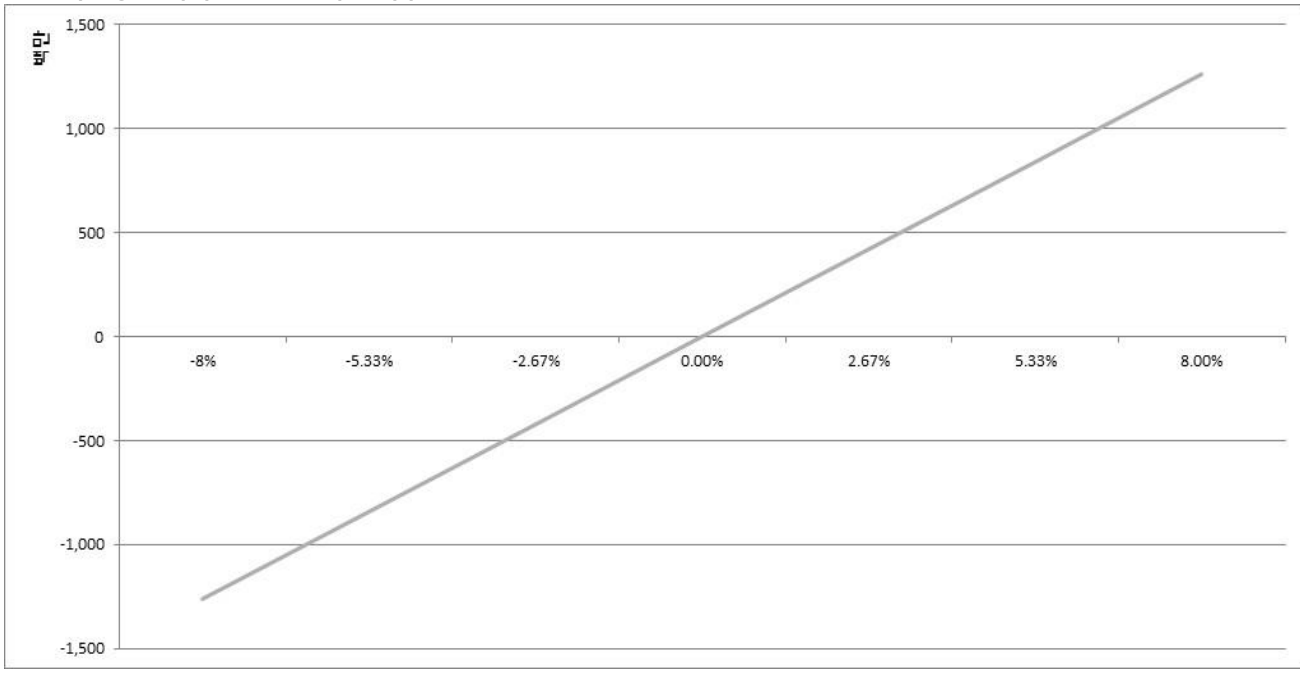
공시일: 2026-11-23

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 1,322 | 0 | 1,322 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 15,862 | 0 | 15,862 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 357 | -357 | 장내 |
| 합계 | | | 15,862 | 357 | 15,505 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,265

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38,206