공시일	2026-01-15
기준일	2026-01-14

글로벌인덱스 리스크컨트롤형 펀드

1. 계약금액

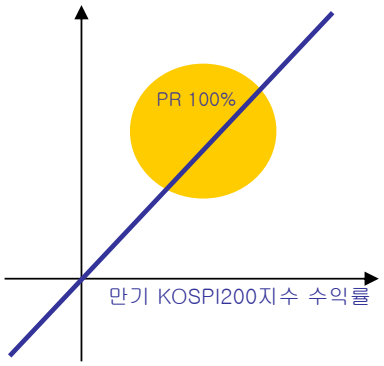
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
보유	지수	국내선물	75,299	0	75,299	장내
보유	지수	해외선물	235,468	0	235,468	장내
누계	지수	국내외선물	310,768	0	310,768	장내

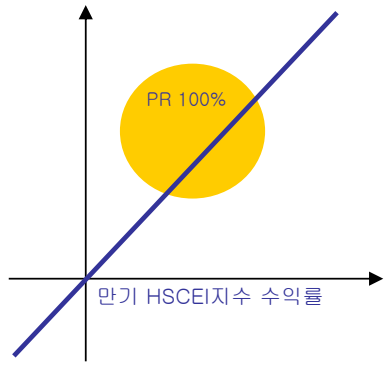
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액을 원화로 표시한 것으로써 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도 없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 손익구조

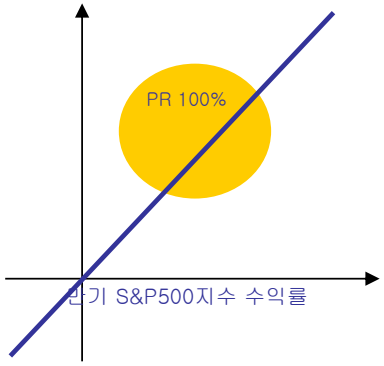
KOSPI200지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



HSCEI지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



S&P500 지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



※ 상기 도해는 거래상대방이 충실하게 의무이행할 것을 가정하며,
투자신탁의 수익구조가 아닌 편입된 파생상품의 수익구조에 관한 도해입니다.

3. 시나리오별 손익구조변동 (최대손실예상금액)

(단위:백만원)

24,861

주) 최대손실 예상금액은 각 포함종목의 최대손실예상금액의 합산 값입니다.
※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 카디안자산운용에서 관련법규에서 정한 산출방식으로 산출함

4. 파생상품의 최대손실예상금액 (VAR : 99%신뢰수준, 10일기준)

(단위:백만원)

33,046

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 카디안자산운용에서 관련법규에서 정한 산출방식으로 산출함