| 공시일 | 2025-12-08 |
|---|---|
| 기준일 | 2025-12-07 |

# 인공지능팀챌린지자산배분형 펀드

## 1. 계약금액

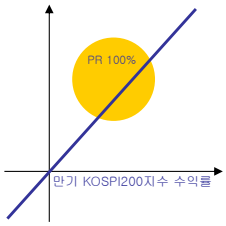
(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 보유 | 지수 | 국내선물 | 871 | 0 | 871 | 장내 |
| 보유 | 지수 | 해외선물 | 38,607 | 0 | 38,607 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 국내외선물 | 39,478 | 0 | 39,478 | 장내 |

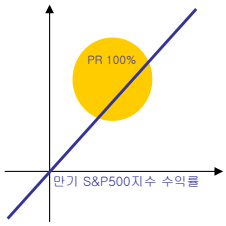
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액을 원화로 표시한 것으로써 해당 파생상품이 외화표시일 경우
추가 매입매도 없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

## 2. 만기시점의 손익구조

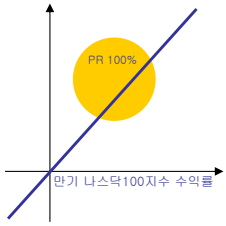
KOSPI200지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



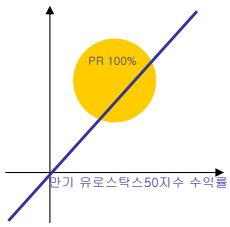

미국S&P500지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



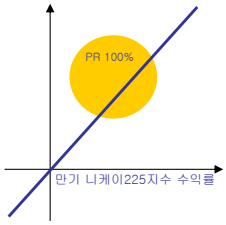

미국나스닥100 지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



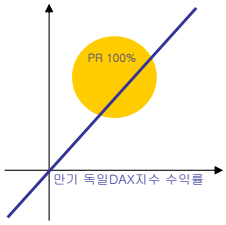

유로스탁스50지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



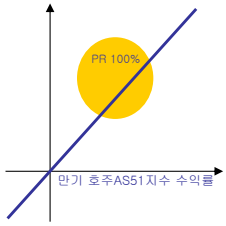

일본니케이225지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



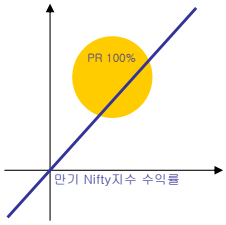

독일DAX지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



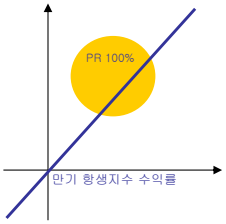

호주AS51 지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



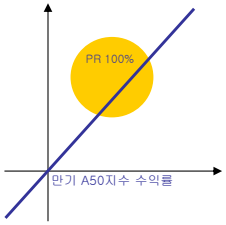

인도 Nifty지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



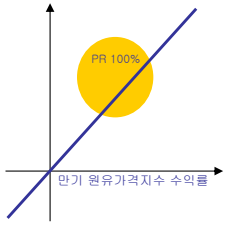

홍콩항생지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



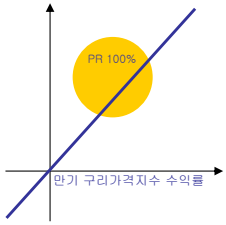

중국 A50지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



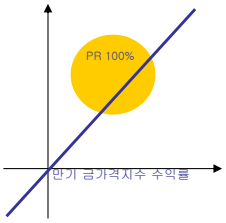

CME 원유가격지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off




CME 구리가격지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off




CME 금가격지수 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)

| 3,089 |
|---|

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)

| 3,920 |
|---|

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