

펀드명 : 프런티어뉴인덱스αF-1_주식파생

공시일: 2022-06-22

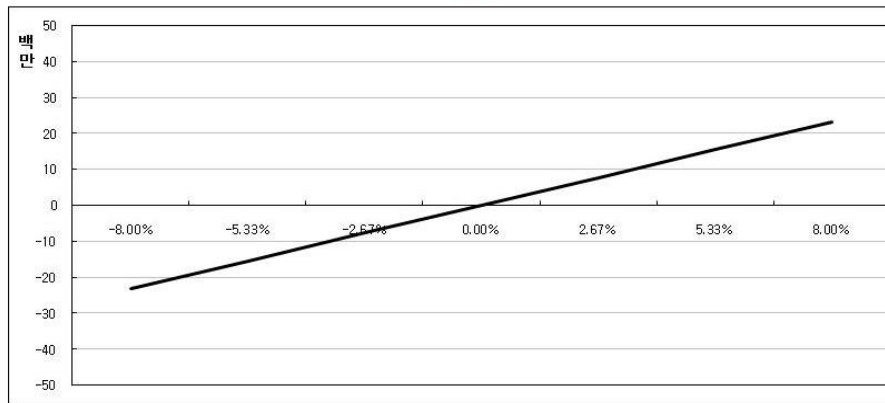
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	870	0	870	장내
합계			870	0	870	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

0728



KOSPI200 INDEX FUTURES 매수 포지션으로 KOSPI200 INDEX의 상승과 함께 POSITIVE PAYOFF를 얻는 구조임

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

70

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-69,674,000	-46,449,333	-23,224,667	0	23,224,667	46,449,333	69,674,000
16.67%	-69,674,000	-46,449,333	-23,224,667	0	23,224,667	46,449,333	69,674,000
8.33%	-69,674,000	-46,449,333	-23,224,667	0	23,224,667	46,449,333	69,674,000
0%	-69,674,000	-46,449,333	-23,224,667	0	23,224,667	46,449,333	69,674,000
-8.33%	-69,674,000	-46,449,333	-23,224,667	0	23,224,667	46,449,333	69,674,000
-16.67%	-69,674,000	-46,449,333	-23,224,667	0	23,224,667	46,449,333	69,674,000
-25%	-69,674,000	-46,449,333	-23,224,667	0	23,224,667	46,449,333	69,674,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

67

펀드명 : 중국인덱스모_주식파생재간접

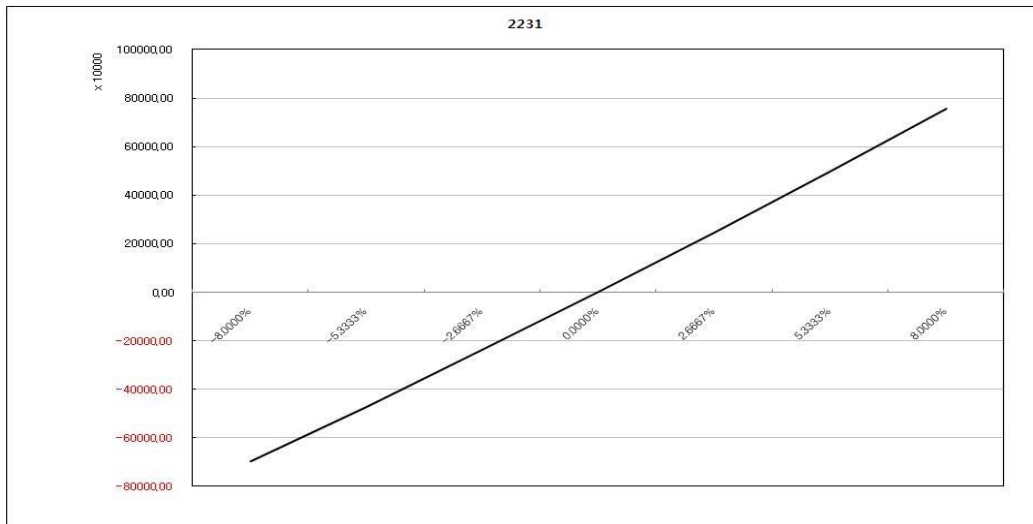
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	244	0	244	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	3,423	0	3,423	장외
합계			3,667	0	3,667	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

279

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테이름 상 수치 기재가 어려움

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

128

펀드명 : 마이블마켓1_주식파생형

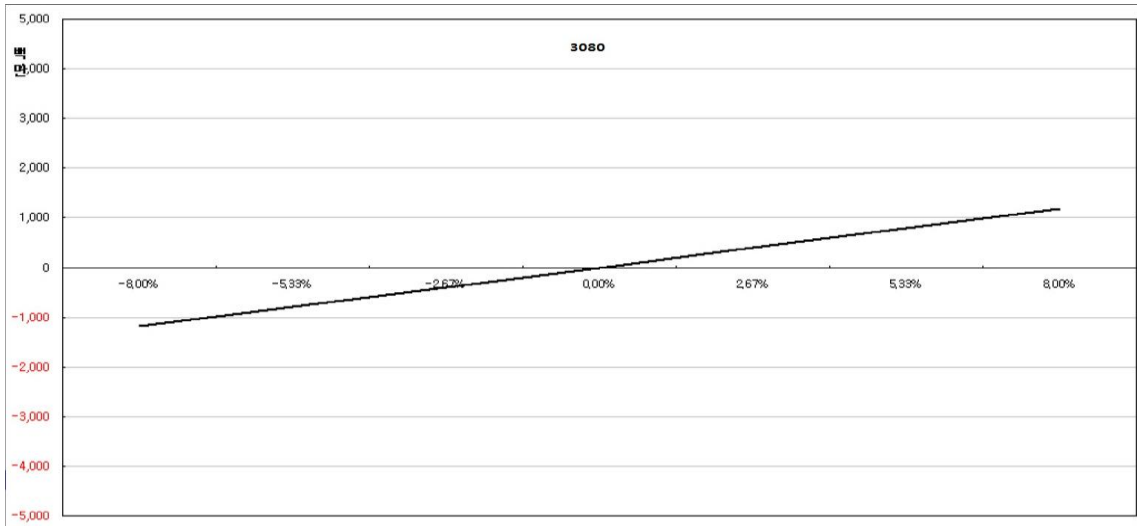
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	7,277	0	7,277	장내
합계			7,277	0	7,277	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

583

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-582,728,000	-388,485,333	-194,242,667	0	194,242,667	388,485,333	582,728,000
16.67%	-582,728,000	-388,485,333	-194,242,667	0	194,242,667	388,485,333	582,728,000
8.33%	-582,728,000	-388,485,333	-194,242,667	0	194,242,667	388,485,333	582,728,000
0%	-582,728,000	-388,485,333	-194,242,667	0	194,242,667	388,485,333	582,728,000
-8.33%	-582,728,000	-388,485,333	-194,242,667	0	194,242,667	388,485,333	582,728,000
-16.67%	-582,728,000	-388,485,333	-194,242,667	0	194,242,667	388,485,333	582,728,000
-25%	-582,728,000	-388,485,333	-194,242,667	0	194,242,667	388,485,333	582,728,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

564

펀드명 : 마이베어마켓1_주식파생

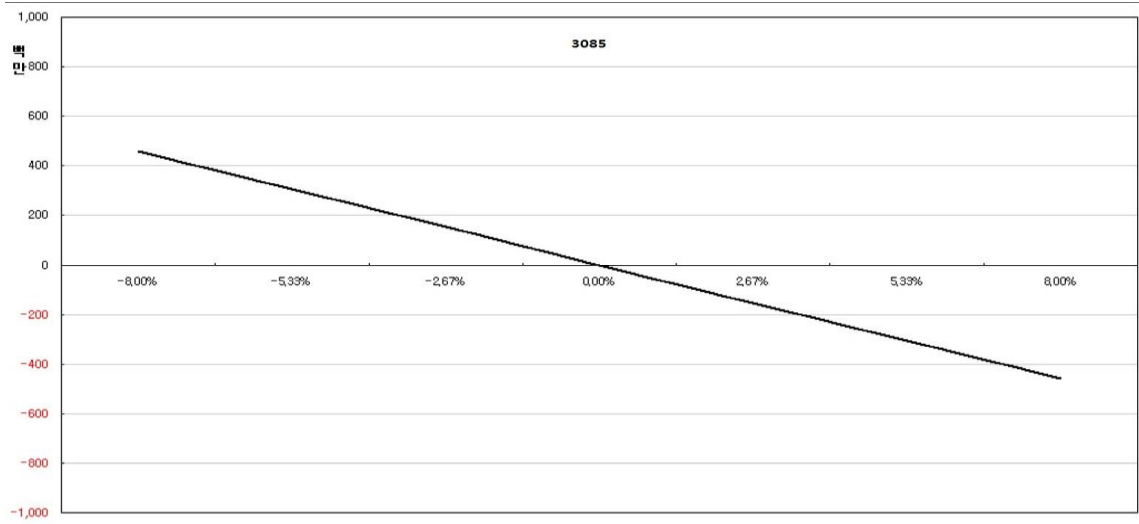
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	633	-633	장내
누계	주가지수	선물	0	3,085	-3,085	장내
합계			0	3,085	-3,085	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

247

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	247,026,000	164,684,000	82,342,000	0	-82,342,000	-164,684,000	-247,026,000
16.67%	247,026,000	164,684,000	82,342,000	0	-82,342,000	-164,684,000	-247,026,000
8.33%	247,026,000	164,684,000	82,342,000	0	-82,342,000	-164,684,000	-247,026,000
0%	247,026,000	164,684,000	82,342,000	0	-82,342,000	-164,684,000	-247,026,000
-8.33%	247,026,000	164,684,000	82,342,000	0	-82,342,000	-164,684,000	-247,026,000
-16.67%	247,026,000	164,684,000	82,342,000	0	-82,342,000	-164,684,000	-247,026,000
-25%	247,026,000	164,684,000	82,342,000	0	-82,342,000	-164,684,000	-247,026,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

239

펀드명 : 키움KOSF코스닥150선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

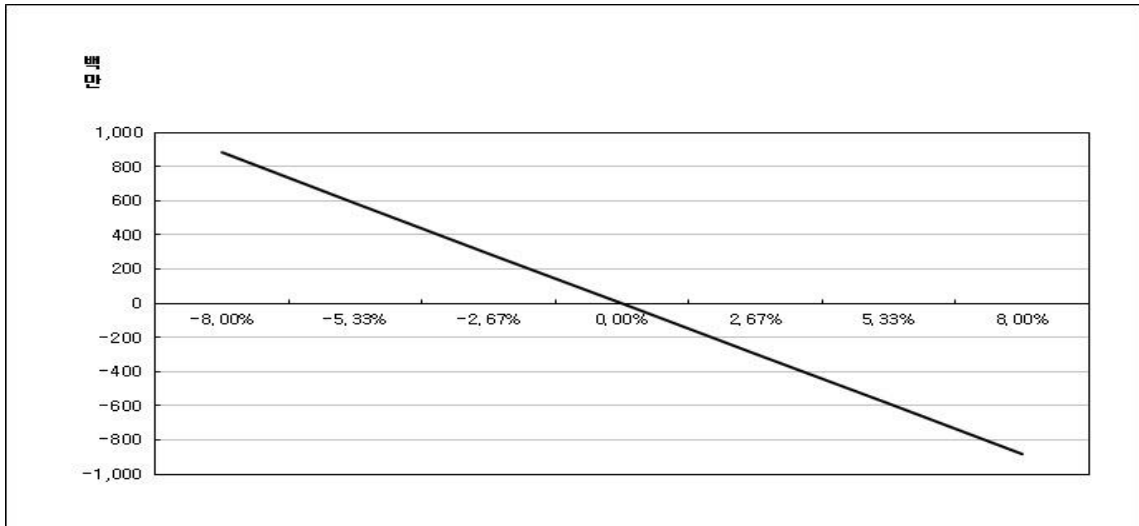
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	156	0	156	장내
누계	주가지수	선물	0	5,731	-5,731	장내
합계			0	5,731	-5,731	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

459

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	458,720,800	305,813,867	152,906,933	0	-152,906,933	-305,813,867	-458,720,800
16.67%	458,720,800	305,813,867	152,906,933	0	-152,906,933	-305,813,867	-458,720,800
8.33%	458,720,800	305,813,867	152,906,933	0	-152,906,933	-305,813,867	-458,720,800
0%	458,720,800	305,813,867	152,906,933	0	-152,906,933	-305,813,867	-458,720,800
-8.33%	458,720,800	305,813,867	152,906,933	0	-152,906,933	-305,813,867	-458,720,800
-16.67%	458,720,800	305,813,867	152,906,933	0	-152,906,933	-305,813,867	-458,720,800
-25%	458,720,800	305,813,867	152,906,933	0	-152,906,933	-305,813,867	-458,720,800

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

662

펀드명 : 키움KOSF코스닥150선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

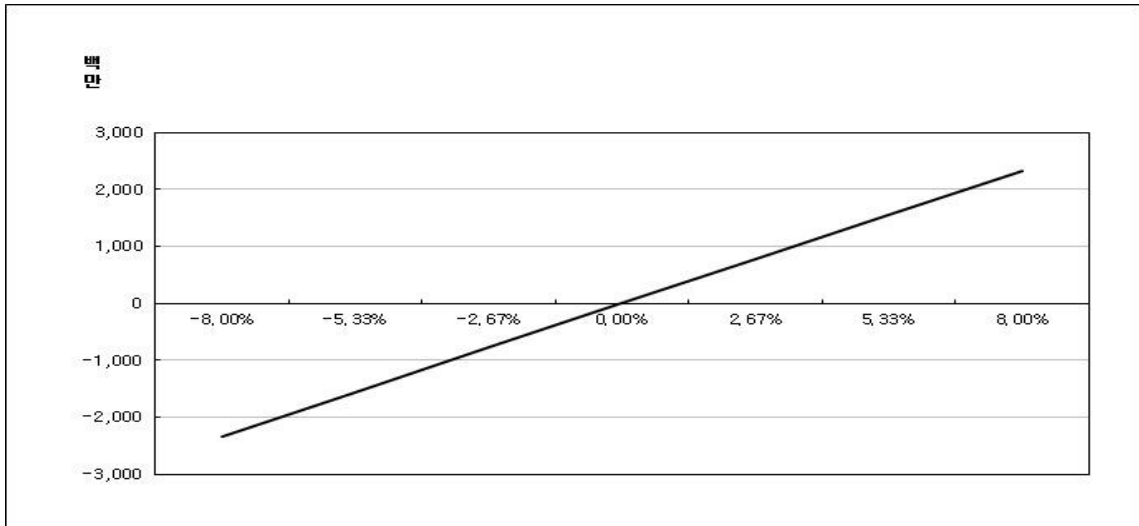
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	100	0	100	장내
누계	주가지수	선물	7,667	0	7,667	장내
합계			7,667	0	7,667	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

614

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-613,706,080	-409,137,387	-204,568,693	0	204,568,693	409,137,387	613,706,080
16.67%	-613,706,080	-409,137,387	-204,568,693	0	204,568,693	409,137,387	613,706,080
8.33%	-613,706,080	-409,137,387	-204,568,693	0	204,568,693	409,137,387	613,706,080
0%	-613,706,080	-409,137,387	-204,568,693	0	204,568,693	409,137,387	613,706,080
-8.33%	-613,706,080	-409,137,387	-204,568,693	0	204,568,693	409,137,387	613,706,080
-16.67%	-613,706,080	-409,137,387	-204,568,693	0	204,568,693	409,137,387	613,706,080
-25%	-613,706,080	-409,137,387	-204,568,693	0	204,568,693	409,137,387	613,706,080

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

885

펀드명 : 키움KOSEF 미국달러 ETF[미국달러-파생형]

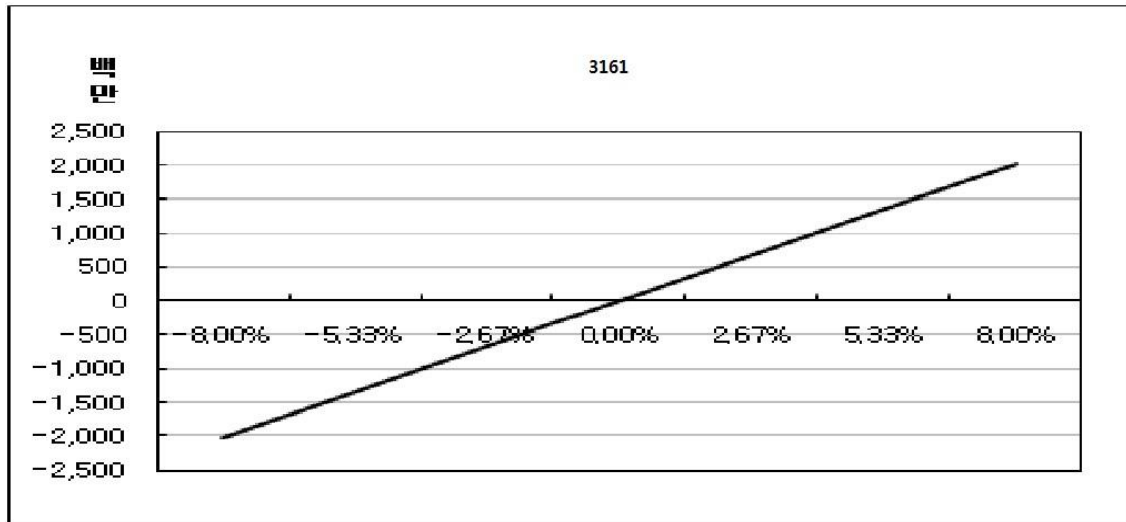
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	37,204	0	37,204	장내
합계			37,204	0	37,204	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,974

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,974,474,240	-1,982,982,827	-991,491,413	0	991,491,413	1,982,982,827	2,974,474,240
16.67%	-2,974,474,240	-1,982,982,827	-991,491,413	0	991,491,413	1,982,982,827	2,974,474,240
8.33%	-2,974,474,240	-1,982,982,827	-991,491,413	0	991,491,413	1,982,982,827	2,974,474,240
0%	-2,974,474,240	-1,982,982,827	-991,491,413	0	991,491,413	1,982,982,827	2,974,474,240
-8.33%	-2,974,474,240	-1,982,982,827	-991,491,413	0	991,491,413	1,982,982,827	2,974,474,240
-16.67%	-2,974,474,240	-1,982,982,827	-991,491,413	0	991,491,413	1,982,982,827	2,974,474,240
-25%	-2,974,474,240	-1,982,982,827	-991,491,413	0	991,491,413	1,982,982,827	2,974,474,240

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,254

펀드명 : 키움KOSEF 미국달러 인버스[미국달러-파생형]

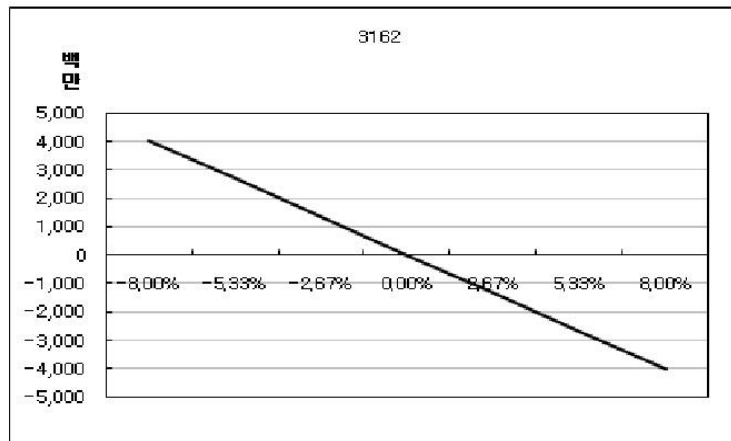
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	13	0	13	장내
누계	통화	선물	0	9,689	-9,689	장내
합계			0	9,689	-9,689	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

775

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	774,645,760	516,430,507	258,215,253	0	-258,215,253	-516,430,507	-774,645,760
16.67%	774,645,760	516,430,507	258,215,253	0	-258,215,253	-516,430,507	-774,645,760
8.33%	774,645,760	516,430,507	258,215,253	0	-258,215,253	-516,430,507	-774,645,760
0%	774,645,760	516,430,507	258,215,253	0	-258,215,253	-516,430,507	-774,645,760
-8.33%	774,645,760	516,430,507	258,215,253	0	-258,215,253	-516,430,507	-774,645,760
-16.67%	774,645,760	516,430,507	258,215,253	0	-258,215,253	-516,430,507	-774,645,760
-25%	774,645,760	516,430,507	258,215,253	0	-258,215,253	-516,430,507	-774,645,760

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

327

펀드명 : 키움KOSEF합성CNX NIFTY인디아[주식-파생형](합성)

공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	15,170	0	15,170	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	40,347	0	40,347	장외
합계			55,517	0	55,517	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

이 투자신탁은 "CNX Nifty Index(시장가격지수, Price Index)"의 성과에 연동하기 위하여 주식 관련 배당금이 포함된 총 수익지수(Total Return Index)인 "NSE CNX Nifty Index Total Returns"를 기초자산으로 하여 수익이 결정되는 장외파생상품에 주로 투자합니다. 투자한 자산의 가격변동에 따라 수익이 결정되나, 운용결과에 따라 실제 수익률은 달라 질 수 있습니다.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

3,228

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테이러 상 수치 기재가 어려움

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,445

명 : 키움 KOSEF 미국달러선물 레버리지 특별자산상장지수투자신탁[미국달러-파생형]

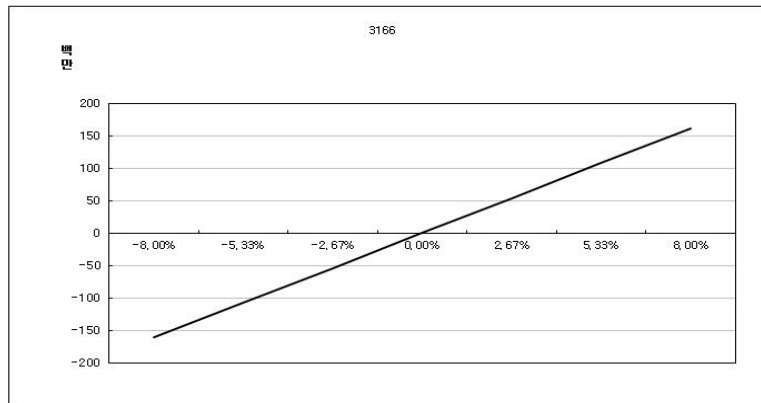
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	65	0	65	장내
누계	통화	선물	77,616	0	77,616	장내
합계			77,616	0	77,616	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,205

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-6,205,440,000	-4,136,960,000	-2,068,480,000	0	2,068,480,000	4,136,960,000	6,205,440,000
16.67%	-6,205,440,000	-4,136,960,000	-2,068,480,000	0	2,068,480,000	4,136,960,000	6,205,440,000
8.33%	-6,205,440,000	-4,136,960,000	-2,068,480,000	0	2,068,480,000	4,136,960,000	6,205,440,000
0%	-6,205,440,000	-4,136,960,000	-2,068,480,000	0	2,068,480,000	4,136,960,000	6,205,440,000
-8.33%	-6,205,440,000	-4,136,960,000	-2,068,480,000	0	2,068,480,000	4,136,960,000	6,205,440,000
-16.67%	-6,205,440,000	-4,136,960,000	-2,068,480,000	0	2,068,480,000	4,136,960,000	6,205,440,000
-25%	-6,205,440,000	-4,136,960,000	-2,068,480,000	0	2,068,480,000	4,136,960,000	6,205,440,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,616

명 : 키움KOSEF미국달러선물인버스2X특별자산상장지수투자신탁[미국달러-파생형](합)

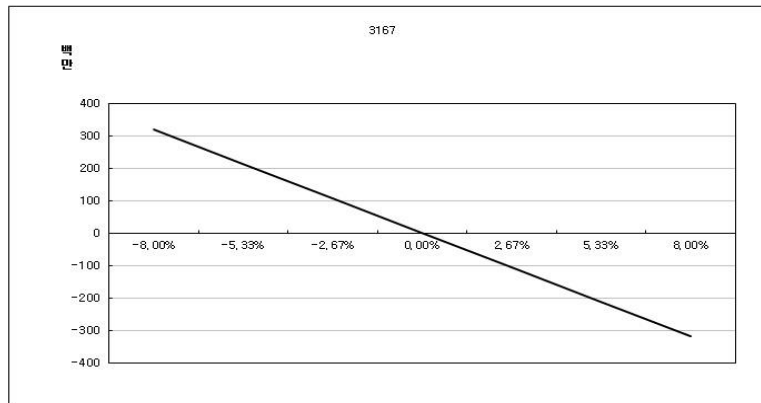
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	91	0	91	장내
누계	통화	선물	0	38,510	-38,510	장내
합계			0	38,510	-38,510	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,079

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	3,078,932,480	2,052,621,653	1,026,310,827	0	-1,026,310,827	-2,052,621,653	-3,078,932,480
16.67%	3,078,932,480	2,052,621,653	1,026,310,827	0	-1,026,310,827	-2,052,621,653	-3,078,932,480
8.33%	3,078,932,480	2,052,621,653	1,026,310,827	0	-1,026,310,827	-2,052,621,653	-3,078,932,480
0%	3,078,932,480	2,052,621,653	1,026,310,827	0	-1,026,310,827	-2,052,621,653	-3,078,932,480
-8.33%	3,078,932,480	2,052,621,653	1,026,310,827	0	-1,026,310,827	-2,052,621,653	-3,078,932,480
-16.67%	3,078,932,480	2,052,621,653	1,026,310,827	0	-1,026,310,827	-2,052,621,653	-3,078,932,480
-25%	3,078,932,480	2,052,621,653	1,026,310,827	0	-1,026,310,827	-2,052,621,653	-3,078,932,480

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,298

펀드명 : 키움KOSF10년국고채레버리지_채권파생형

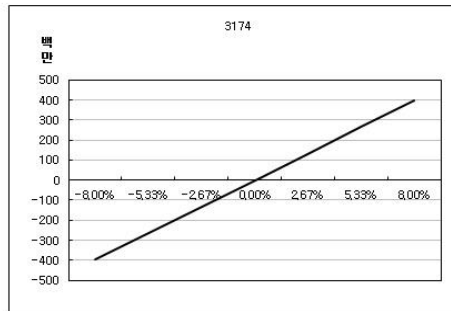
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,817	0	6,817	장내
합계			6,817	0	6,817	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

544

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-543,516,800	-362,344,533	-181,172,267	0	181,172,267	362,344,533	543,516,800
16.67%	-543,516,800	-362,344,533	-181,172,267	0	181,172,267	362,344,533	543,516,800
8.33%	-543,516,800	-362,344,533	-181,172,267	0	181,172,267	362,344,533	543,516,800
0%	-543,516,800	-362,344,533	-181,172,267	0	181,172,267	362,344,533	543,516,800
-8.33%	-543,516,800	-362,344,533	-181,172,267	0	181,172,267	362,344,533	543,516,800
-16.67%	-543,516,800	-362,344,533	-181,172,267	0	181,172,267	362,344,533	543,516,800
-25%	-543,516,800	-362,344,533	-181,172,267	0	181,172,267	362,344,533	543,516,800

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

187

펀드명 : 키움KOSF200선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

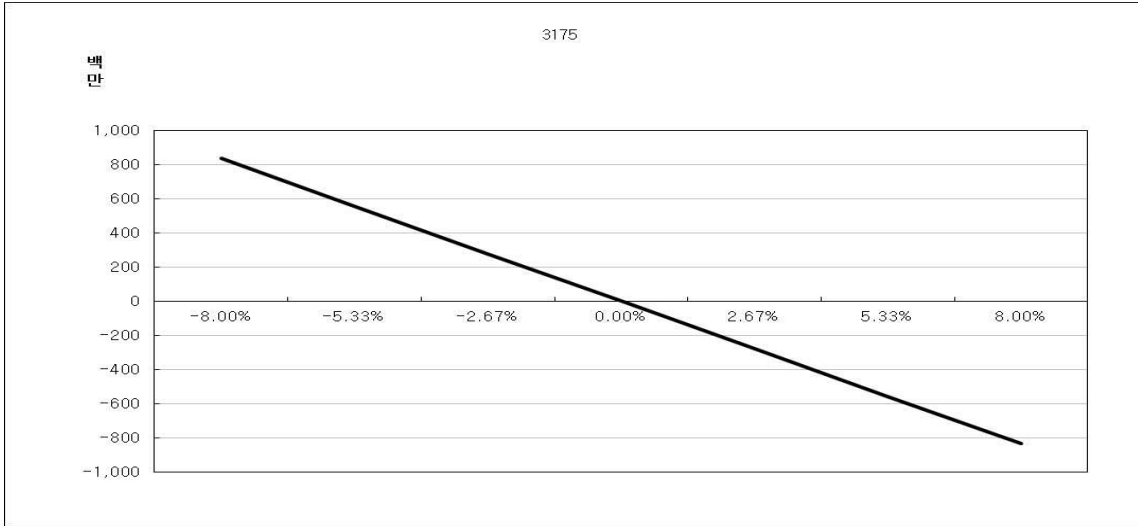
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	5,299	-5,299	장내
합계			0	5,299	-5,299	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

424

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	424,378,000	282,918,667	141,459,333	0	-141,459,333	-282,918,667	-424,378,000
16.67%	424,378,000	282,918,667	141,459,333	0	-141,459,333	-282,918,667	-424,378,000
8.33%	424,378,000	282,918,667	141,459,333	0	-141,459,333	-282,918,667	-424,378,000
0%	424,378,000	282,918,667	141,459,333	0	-141,459,333	-282,918,667	-424,378,000
-8.33%	424,378,000	282,918,667	141,459,333	0	-141,459,333	-282,918,667	-424,378,000
-16.67%	424,378,000	282,918,667	141,459,333	0	-141,459,333	-282,918,667	-424,378,000
-25%	424,378,000	282,918,667	141,459,333	0	-141,459,333	-282,918,667	-424,378,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

411

펀드명 : 키움KOSEF200선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

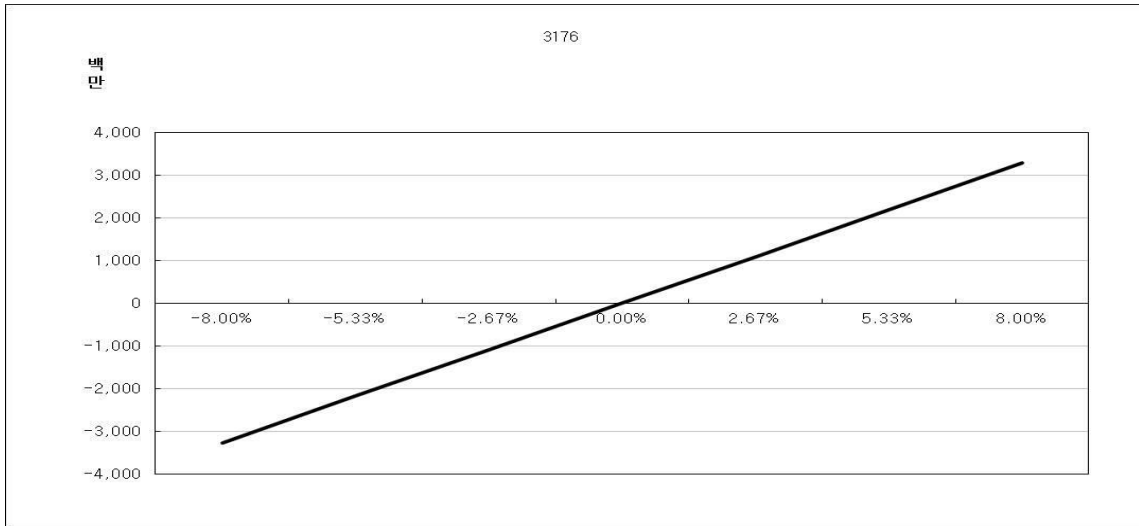
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	237	0	237	장내
누계	주가지수	선물	28,632	0	28,632	장내
합계			28,632	0	28,632	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,293

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,292,908,000	-1,528,605,333	-764,302,667	0	764,302,667	1,528,605,333	2,292,908,000
16.67%	-2,292,908,000	-1,528,605,333	-764,302,667	0	764,302,667	1,528,605,333	2,292,908,000
8.33%	-2,292,908,000	-1,528,605,333	-764,302,667	0	764,302,667	1,528,605,333	2,292,908,000
0%	-2,292,908,000	-1,528,605,333	-764,302,667	0	764,302,667	1,528,605,333	2,292,908,000
-8.33%	-2,292,908,000	-1,528,605,333	-764,302,667	0	764,302,667	1,528,605,333	2,292,908,000
-16.67%	-2,292,908,000	-1,528,605,333	-764,302,667	0	764,302,667	1,528,605,333	2,292,908,000
-25%	-2,292,908,000	-1,528,605,333	-764,302,667	0	764,302,667	1,528,605,333	2,292,908,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,218

펀드명 : 키움KOSF200선물인버스2X증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

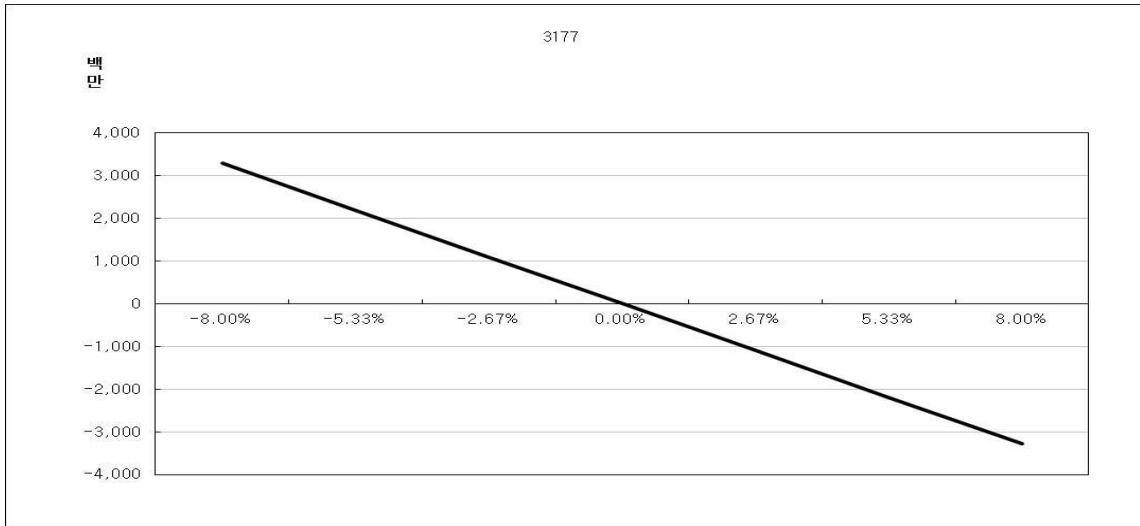
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	395	0	395	장내
누계	주가지수	선물	0	15,265	-15,265	장내
합계			0	15,265	-15,265	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,222

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,222,462,000	814,974,667	407,487,333	0	-407,487,333	-814,974,667	-1,222,462,000
16.67%	1,222,462,000	814,974,667	407,487,333	0	-407,487,333	-814,974,667	-1,222,462,000
8.33%	1,222,462,000	814,974,667	407,487,333	0	-407,487,333	-814,974,667	-1,222,462,000
0%	1,222,462,000	814,974,667	407,487,333	0	-407,487,333	-814,974,667	-1,222,462,000
-8.33%	1,222,462,000	814,974,667	407,487,333	0	-407,487,333	-814,974,667	-1,222,462,000
-16.67%	1,222,462,000	814,974,667	407,487,333	0	-407,487,333	-814,974,667	-1,222,462,000
-25%	1,222,462,000	814,974,667	407,487,333	0	-407,487,333	-814,974,667	-1,222,462,000

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,183

펀드명 : Commodity인덱스투자_모_상품파생

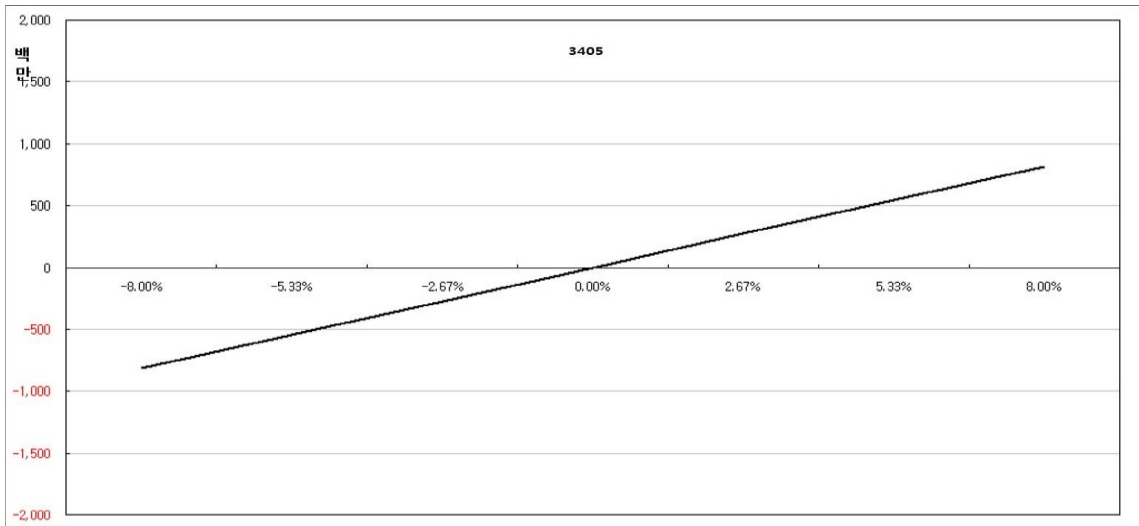
공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	2,225	-2,225	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	4,078	0	4,078	장내
합계			4,078	2,225	1,853	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

185

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테일러 상 수치 기제가 어려움

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

592

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제1호[파생형]

공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	스왑	0	0	0	장외
누계	통화	스왑	16,984	0	16,984	장외
합계			16,984	0	16,984	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

이 집합투자기구에 투자하는 집합투자자는 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,404

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,404,506,138	1,403,342,296	1,402,178,636	1,401,015,157	1,399,851,860	1,398,688,745	1,397,525,811
16.67%	937,437,704	936,294,990	935,152,457	934,010,104	932,867,932	931,725,941	930,584,130
8.33%	470,369,271	469,247,685	468,126,278	467,005,052	465,884,005	464,763,137	463,642,450
0%	3,300,837	2,200,379	1,100,100	-1	-1,099,923	-2,199,666	-3,299,231
-8.33%	-463,767,597	-464,846,927	-465,926,079	-467,005,054	-468,083,851	-469,162,470	-470,240,912
-16.67%	-930,836,030	-931,894,232	-932,952,258	-934,010,107	-935,067,779	-936,125,274	-937,182,593
-25%	-1,397,904,464	-1,398,941,538	-1,399,978,437	-1,401,015,159	-1,402,051,706	-1,403,088,078	-1,404,124,273

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제2호[파생형]

공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	스왑	0	0	0	장외
누계	통화	스왑	16,984	0	16,984	장외
합계			16,984	0	16,984	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

이 집합투자기구에 투자하는 집합투자자는 투자대상이 되는 자산가지의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,404

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,404,506,138	1,403,342,296	1,402,178,636	1,401,015,157	1,399,851,860	1,398,688,745	1,397,525,811
16.67%	937,437,704	936,294,990	935,152,457	934,010,104	932,867,932	931,725,941	930,584,130
8.33%	470,369,271	469,247,685	468,126,278	467,005,052	465,884,005	464,763,137	463,642,450
0%	3,300,837	2,200,379	1,100,100	-1	-1,099,923	-2,199,666	-3,299,231
-8.33%	-463,767,597	-464,846,927	-465,926,079	-467,005,054	-468,083,851	-469,162,470	-470,240,912
-16.67%	-930,836,030	-931,894,232	-932,952,258	-934,010,107	-935,067,779	-936,125,274	-937,182,593
-25%	-1,397,904,464	-1,398,941,538	-1,399,978,437	-1,401,015,159	-1,402,051,706	-1,403,088,078	-1,404,124,273

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제3호[파생형]

공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	스왑	0	0	0	장외
누계	통화	스왑	16,984	0	16,984	장외
합계			16,984	0	16,984	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

이 집합투자기구에 투자하는 집합투자자는 투자대상이 되는 자산가지의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,404

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,404,506,138	1,403,342,296	1,402,178,636	1,401,015,157	1,399,851,860	1,398,688,745	1,397,525,811
16.67%	937,437,704	936,294,990	935,152,457	934,010,104	932,867,932	931,725,941	930,584,130
8.33%	470,369,271	469,247,685	468,126,278	467,005,052	465,884,005	464,763,137	463,642,450
0%	3,300,837	2,200,379	1,100,100	-1	-1,099,923	-2,199,666	-3,299,231
-8.33%	-463,767,597	-464,846,927	-465,926,079	-467,005,054	-468,083,851	-469,162,470	-470,240,912
-16.67%	-930,836,030	-931,894,232	-932,952,258	-934,010,107	-935,067,779	-936,125,274	-937,182,593
-25%	-1,397,904,464	-1,398,941,538	-1,399,978,437	-1,401,015,159	-1,402,051,706	-1,403,088,078	-1,404,124,273

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제4호[파생형]

공시일: 2022-06-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	스왑	0	0	0	장외
누계	통화	스왑	16,984	0	16,984	장외
합계			16,984	0	16,984	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

이 집합투자기구에 투자하는 집합투자자는 투자대상이 되는 자산가지의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,404

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,404,506,138	1,403,342,296	1,402,178,636	1,401,015,157	1,399,851,860	1,398,688,745	1,397,525,811
16.67%	937,437,704	936,294,990	935,152,457	934,010,104	932,867,932	931,725,941	930,584,130
8.33%	470,369,271	469,247,685	468,126,278	467,005,052	465,884,005	464,763,137	463,642,450
0%	3,300,837	2,200,379	1,100,100	-1	-1,099,923	-2,199,666	-3,299,231
-8.33%	-463,767,597	-464,846,927	-465,926,079	-467,005,054	-468,083,851	-469,162,470	-470,240,912
-16.67%	-930,836,030	-931,894,232	-932,952,258	-934,010,107	-935,067,779	-936,125,274	-937,182,593
-25%	-1,397,904,464	-1,398,941,538	-1,399,978,437	-1,401,015,159	-1,402,051,706	-1,403,088,078	-1,404,124,273

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

34