

펀드명 : 프런티어뉴인덱스αF-1_주식파생

공시일: 2022-06-23

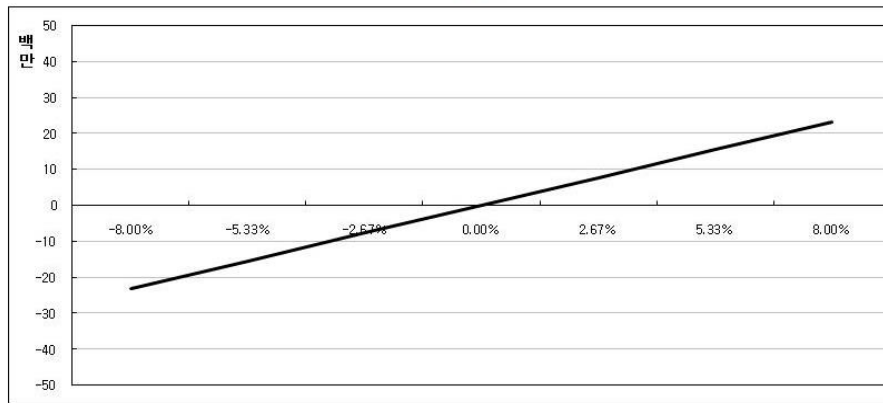
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	847	0	847	장내
합계			847	0	847	

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)

68

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-67,826,000	-45,217,333	-22,608,667	0	22,608,667	45,217,333	67,826,000
16.67%	-67,826,000	-45,217,333	-22,608,667	0	22,608,667	45,217,333	67,826,000
8.33%	-67,826,000	-45,217,333	-22,608,667	0	22,608,667	45,217,333	67,826,000
0%	-67,826,000	-45,217,333	-22,608,667	0	22,608,667	45,217,333	67,826,000
-8.33%	-67,826,000	-45,217,333	-22,608,667	0	22,608,667	45,217,333	67,826,000
-16.67%	-67,826,000	-45,217,333	-22,608,667	0	22,608,667	45,217,333	67,826,000
-25%	-67,826,000	-45,217,333	-22,608,667	0	22,608,667	45,217,333	67,826,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

66

펀드명 : 중국인덱스모_주식파생재간접

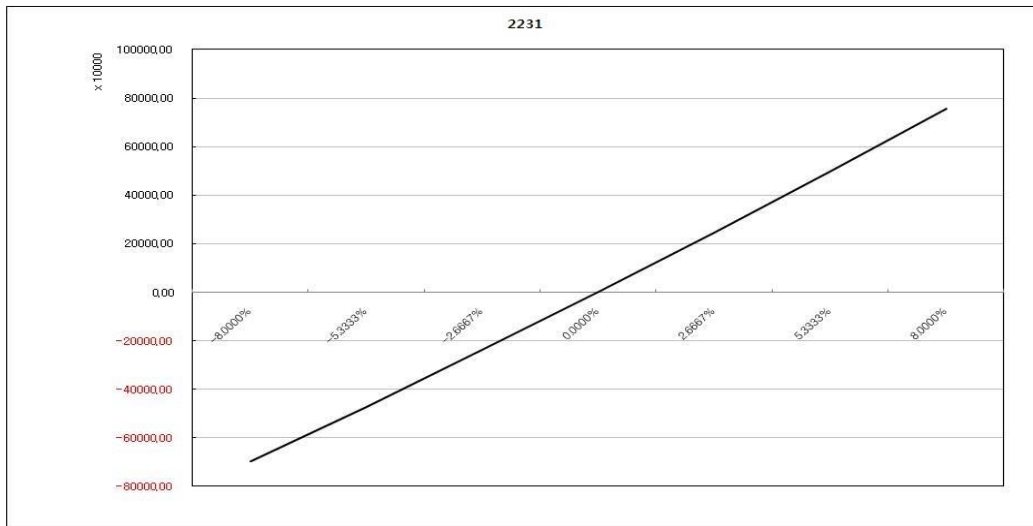
공시일: 2022-06-23

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	250	0	250	장내
신규	통화	선도	2,986	2,822	164	장외
누계	통화	선도	3,587	0	3,587	장외
합계			3,836	0	3,836	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

519

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 테이를 상 수치 기재가 어려움

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

225

펀드명 : 마이블마켓1_주식파생형

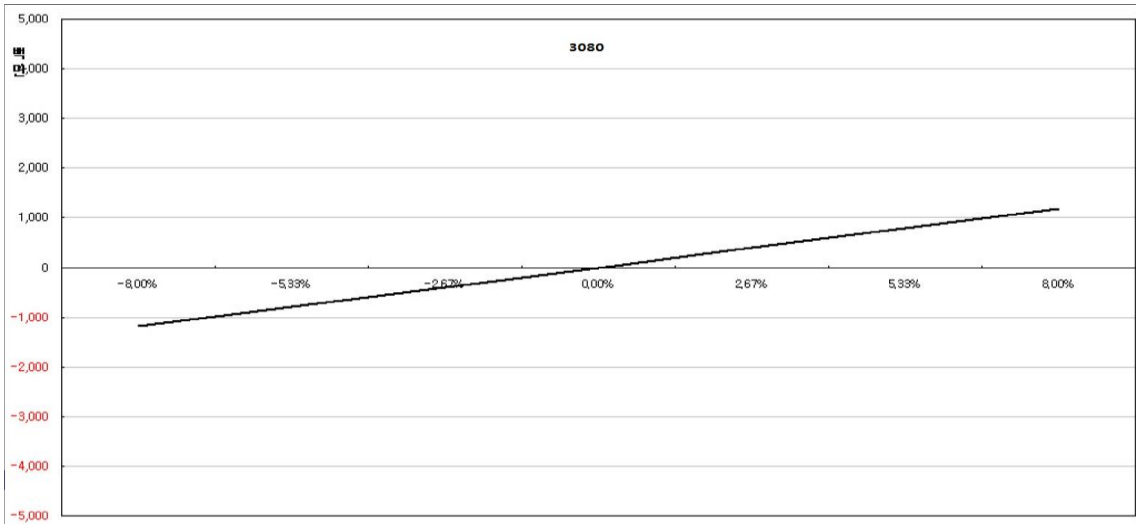
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	462	0	462	장내
누계	주가지수	선물	7,548	0	7,548	장내
합계			7,548	0	7,548	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

604

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-604,268,000	-402,845,333	-201,422,667	0	201,422,667	402,845,333	604,268,000
16.67%	-604,268,000	-402,845,333	-201,422,667	0	201,422,667	402,845,333	604,268,000
8.33%	-604,268,000	-402,845,333	-201,422,667	0	201,422,667	402,845,333	604,268,000
0%	-604,268,000	-402,845,333	-201,422,667	0	201,422,667	402,845,333	604,268,000
-8.33%	-604,268,000	-402,845,333	-201,422,667	0	201,422,667	402,845,333	604,268,000
-16.67%	-604,268,000	-402,845,333	-201,422,667	0	201,422,667	402,845,333	604,268,000
-25%	-604,268,000	-402,845,333	-201,422,667	0	201,422,667	402,845,333	604,268,000

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

591

펀드명 : 마이베어마켓1_주식파생

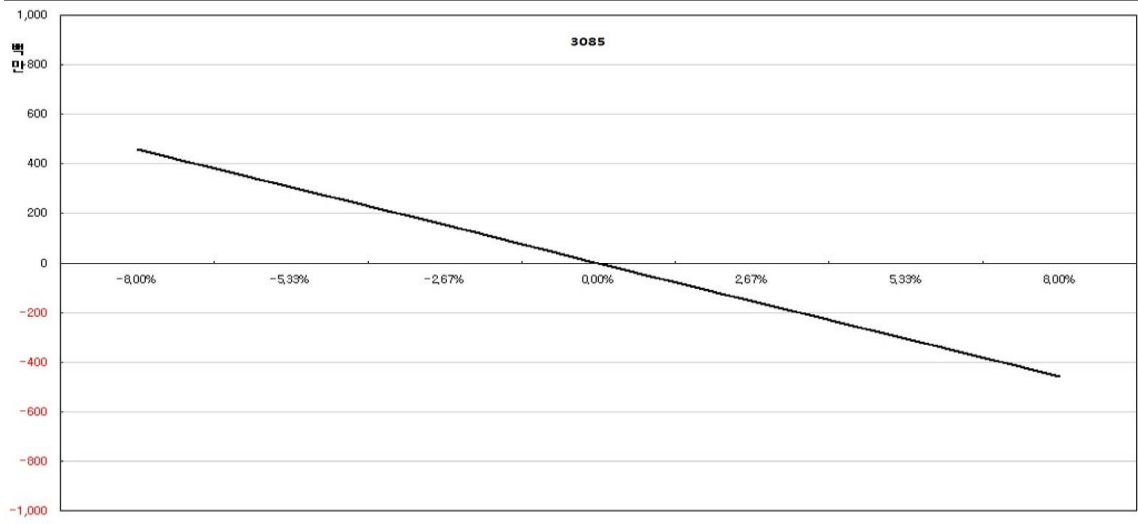
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	539	0	539	장내
누계	주가지수	선물	0	2,465	-2,465	장내
합계			0	2,465	-2,465	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

197

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	197,312,000	131,541,333	65,770,667	0	-65,770,667	-131,541,333	-197,312,000
16.67%	197,312,000	131,541,333	65,770,667	0	-65,770,667	-131,541,333	-197,312,000
8.33%	197,312,000	131,541,333	65,770,667	0	-65,770,667	-131,541,333	-197,312,000
0%	197,312,000	131,541,333	65,770,667	0	-65,770,667	-131,541,333	-197,312,000
-8.33%	197,312,000	131,541,333	65,770,667	0	-65,770,667	-131,541,333	-197,312,000
-16.67%	197,312,000	131,541,333	65,770,667	0	-65,770,667	-131,541,333	-197,312,000
-25%	197,312,000	131,541,333	65,770,667	0	-65,770,667	-131,541,333	-197,312,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

193

펀드명 : 키움KOSDAQ코스닥150선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

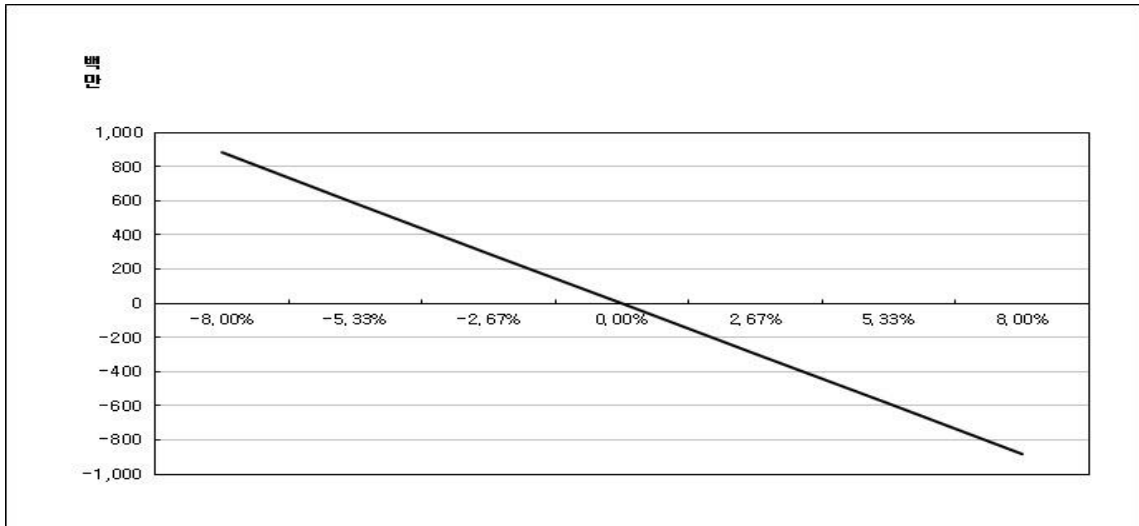
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	449	-449	장내
누계	주가지수	선물	0	5,959	-5,959	장내
합계			0	5,959	-5,959	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

477

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	476,702,880	317,801,920	158,900,960	0	-158,900,960	-317,801,920	-476,702,880
16.67%	476,702,880	317,801,920	158,900,960	0	-158,900,960	-317,801,920	-476,702,880
8.33%	476,702,880	317,801,920	158,900,960	0	-158,900,960	-317,801,920	-476,702,880
0%	476,702,880	317,801,920	158,900,960	0	-158,900,960	-317,801,920	-476,702,880
-8.33%	476,702,880	317,801,920	158,900,960	0	-158,900,960	-317,801,920	-476,702,880
-16.67%	476,702,880	317,801,920	158,900,960	0	-158,900,960	-317,801,920	-476,702,880
-25%	476,702,880	317,801,920	158,900,960	0	-158,900,960	-317,801,920	-476,702,880

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

696

펀드명 : 키움KOSF코스닥150선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

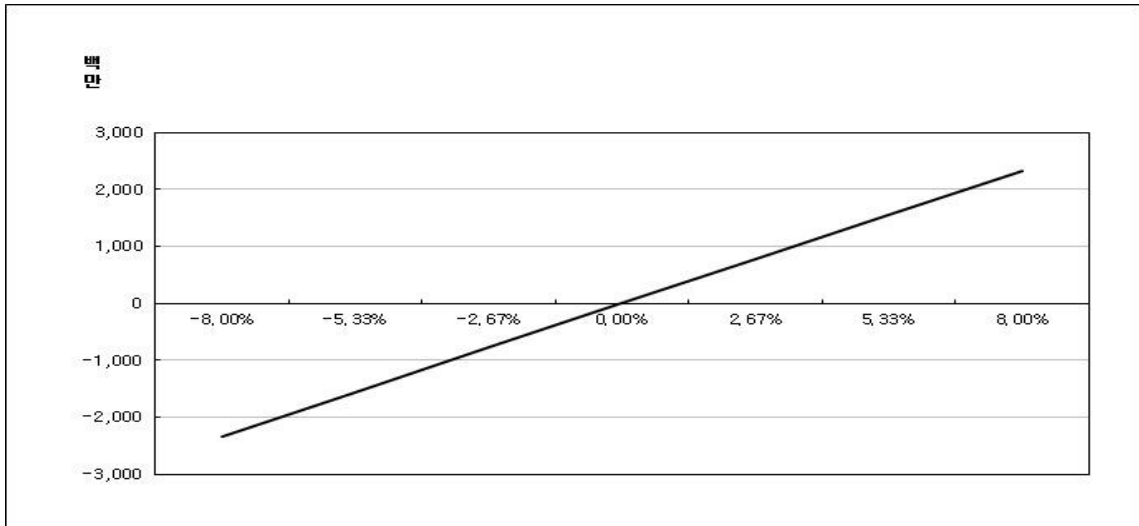
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	289	-289	장내
누계	주가지수	선물	7,082	0	7,082	장내
합계			7,082	0	7,082	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

567

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-566,566,080	-377,710,720	-188,855,360	0	188,855,360	377,710,720	566,566,080
16.67%	-566,566,080	-377,710,720	-188,855,360	0	188,855,360	377,710,720	566,566,080
8.33%	-566,566,080	-377,710,720	-188,855,360	0	188,855,360	377,710,720	566,566,080
0%	-566,566,080	-377,710,720	-188,855,360	0	188,855,360	377,710,720	566,566,080
-8.33%	-566,566,080	-377,710,720	-188,855,360	0	188,855,360	377,710,720	566,566,080
-16.67%	-566,566,080	-377,710,720	-188,855,360	0	188,855,360	377,710,720	566,566,080
-25%	-566,566,080	-377,710,720	-188,855,360	0	188,855,360	377,710,720	566,566,080

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

827

펀드명 : 키움KOSEF 미국달러 ETF[미국달러-파생형]

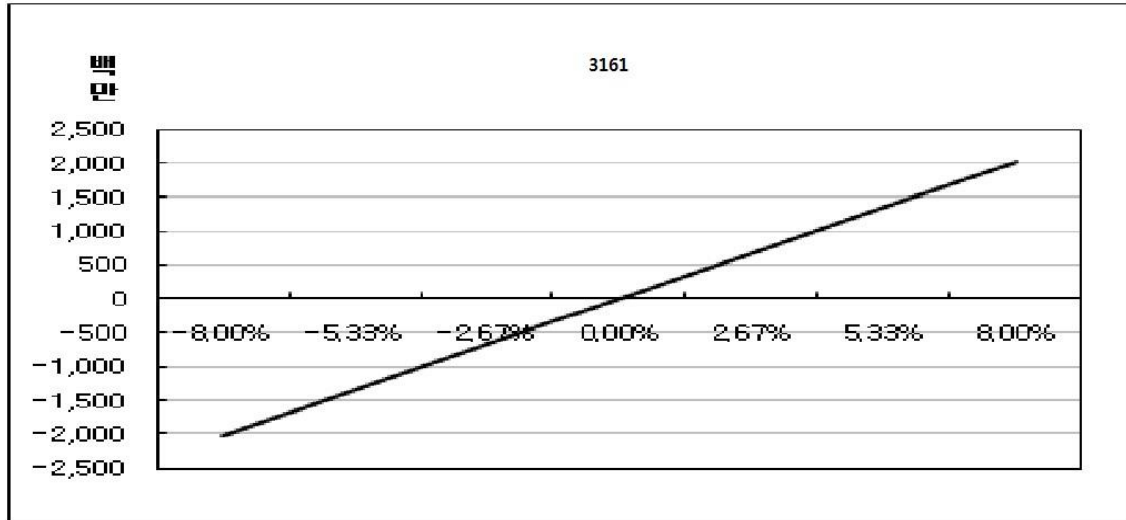
공시일: 2022-06-23

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	37,310	0	37,310	장내
합계			37,310	0	37,310	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

2,989

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,988,739,200	-1,992,492,800	-996,246,400	0	996,246,400	1,992,492,800	2,988,739,200
16.67%	-2,988,739,200	-1,992,492,800	-996,246,400	0	996,246,400	1,992,492,800	2,988,739,200
8.33%	-2,988,739,200	-1,992,492,800	-996,246,400	0	996,246,400	1,992,492,800	2,988,739,200
0%	-2,988,739,200	-1,992,492,800	-996,246,400	0	996,246,400	1,992,492,800	2,988,739,200
-8.33%	-2,988,739,200	-1,992,492,800	-996,246,400	0	996,246,400	1,992,492,800	2,988,739,200
-16.67%	-2,988,739,200	-1,992,492,800	-996,246,400	0	996,246,400	1,992,492,800	2,988,739,200
-25%	-2,988,739,200	-1,992,492,800	-996,246,400	0	996,246,400	1,992,492,800	2,988,739,200

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,260

펀드명 : 키움KOSEF 미국달러 인버스[미국달러-파생형]

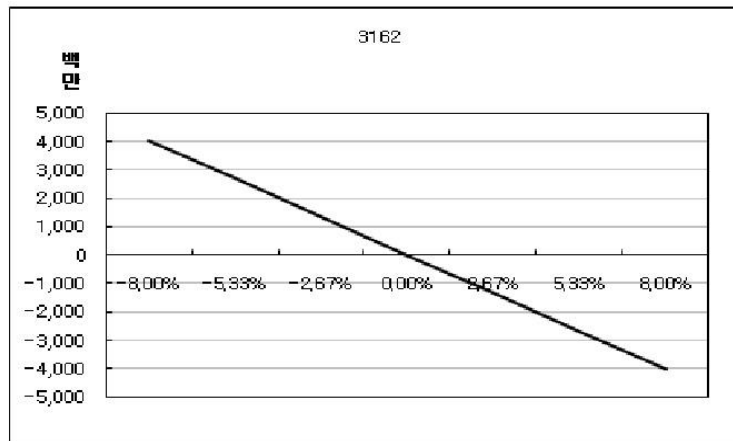
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	78	0	78	장내
누계	통화	선물	0	9,639	-9,639	장내
합계			0	9,639	-9,639	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

772

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	772,125,600	514,750,400	257,375,200	0	-257,375,200	-514,750,400	-772,125,600
16.67%	772,125,600	514,750,400	257,375,200	0	-257,375,200	-514,750,400	-772,125,600
8.33%	772,125,600	514,750,400	257,375,200	0	-257,375,200	-514,750,400	-772,125,600
0%	772,125,600	514,750,400	257,375,200	0	-257,375,200	-514,750,400	-772,125,600
-8.33%	772,125,600	514,750,400	257,375,200	0	-257,375,200	-514,750,400	-772,125,600
-16.67%	772,125,600	514,750,400	257,375,200	0	-257,375,200	-514,750,400	-772,125,600
-25%	772,125,600	514,750,400	257,375,200	0	-257,375,200	-514,750,400	-772,125,600

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

325

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

공시일: 2022-06-23

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	15,502	0	15,502	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	41,127	0	41,127	장외
합계			56,629	0	56,629	

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)

3,290

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 테일을 상 수치 기제가 어려움

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,557

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

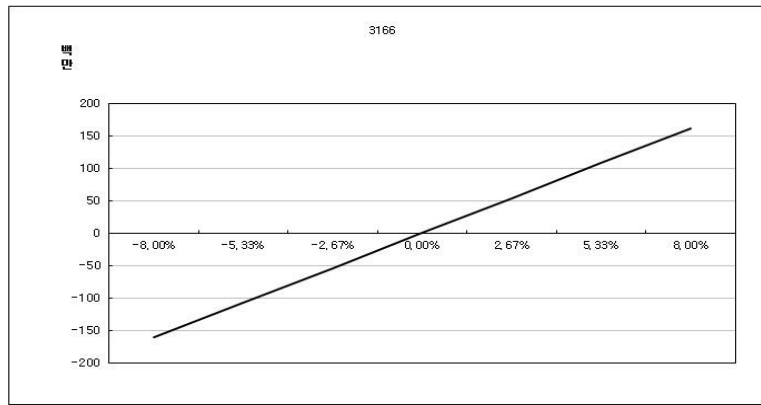
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	324	0	324	장내
누계	통화	선물	78,162	0	78,162	장내
합계			78,162	0	78,162	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,261

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-6,261,180,000	-4,174,120,000	-2,087,060,000	0	2,087,060,000	4,174,120,000	6,261,180,000
16.67%	-6,261,180,000	-4,174,120,000	-2,087,060,000	0	2,087,060,000	4,174,120,000	6,261,180,000
8.33%	-6,261,180,000	-4,174,120,000	-2,087,060,000	0	2,087,060,000	4,174,120,000	6,261,180,000
0%	-6,261,180,000	-4,174,120,000	-2,087,060,000	0	2,087,060,000	4,174,120,000	6,261,180,000
-8.33%	-6,261,180,000	-4,174,120,000	-2,087,060,000	0	2,087,060,000	4,174,120,000	6,261,180,000
-16.67%	-6,261,180,000	-4,174,120,000	-2,087,060,000	0	2,087,060,000	4,174,120,000	6,261,180,000
-25%	-6,261,180,000	-4,174,120,000	-2,087,060,000	0	2,087,060,000	4,174,120,000	6,261,180,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,639

명 : 키움KOSEF미국달러선물인버스2X특별자산상장지수투자신탁[미국달러-파생형](합)

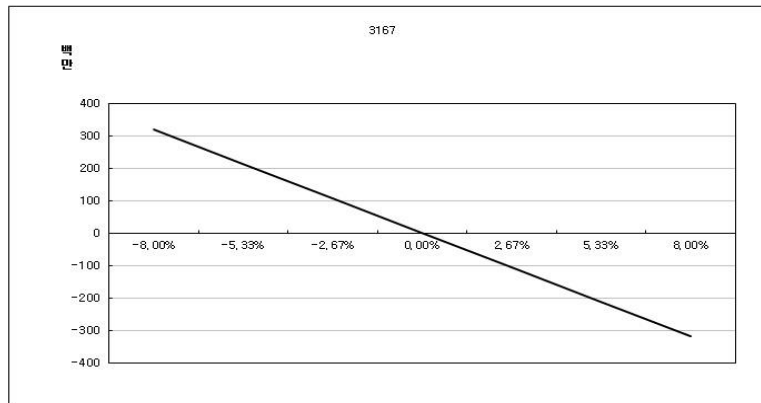
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	467	0	467	장내
누계	통화	선물	0	38,154	-38,154	장내
합계			0	38,154	-38,154	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

3,056

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	3,056,287,200	2,037,524,800	1,018,762,400	0	-1,018,762,400	-2,037,524,800	-3,056,287,200
16.67%	3,056,287,200	2,037,524,800	1,018,762,400	0	-1,018,762,400	-2,037,524,800	-3,056,287,200
8.33%	3,056,287,200	2,037,524,800	1,018,762,400	0	-1,018,762,400	-2,037,524,800	-3,056,287,200
0%	3,056,287,200	2,037,524,800	1,018,762,400	0	-1,018,762,400	-2,037,524,800	-3,056,287,200
-8.33%	3,056,287,200	2,037,524,800	1,018,762,400	0	-1,018,762,400	-2,037,524,800	-3,056,287,200
-16.67%	3,056,287,200	2,037,524,800	1,018,762,400	0	-1,018,762,400	-2,037,524,800	-3,056,287,200
-25%	3,056,287,200	2,037,524,800	1,018,762,400	0	-1,018,762,400	-2,037,524,800	-3,056,287,200

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,288

펀드명 : 키움KOSF10년국고채레버리지_채권파생형

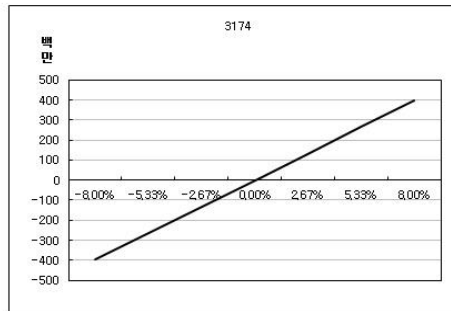
공시일: 2022-06-23

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	6,814	0	6,814	장내
합계			6,814	0	6,814	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

548

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-547,534,400	-365,022,933	-182,511,467	0	182,511,467	365,022,933	547,534,400
16.67%	-547,534,400	-365,022,933	-182,511,467	0	182,511,467	365,022,933	547,534,400
8.33%	-547,534,400	-365,022,933	-182,511,467	0	182,511,467	365,022,933	547,534,400
0%	-547,534,400	-365,022,933	-182,511,467	0	182,511,467	365,022,933	547,534,400
-8.33%	-547,534,400	-365,022,933	-182,511,467	0	182,511,467	365,022,933	547,534,400
-16.67%	-547,534,400	-365,022,933	-182,511,467	0	182,511,467	365,022,933	547,534,400
-25%	-547,534,400	-365,022,933	-182,511,467	0	182,511,467	365,022,933	547,534,400

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

189

펀드명 : 키움KOSF200선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

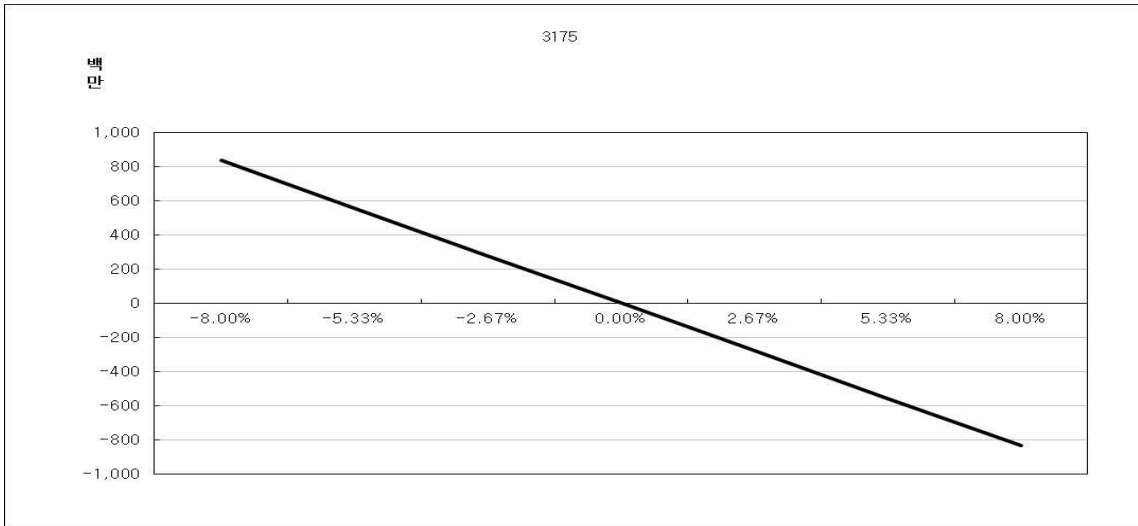
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	231	-231	장내
누계	주가지수	선물	0	5,391	-5,391	장내
합계			0	5,391	-5,391	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

432

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	431,620,000	287,746,667	143,873,333	0	-143,873,333	-287,746,667	-431,620,000
16.67%	431,620,000	287,746,667	143,873,333	0	-143,873,333	-287,746,667	-431,620,000
8.33%	431,620,000	287,746,667	143,873,333	0	-143,873,333	-287,746,667	-431,620,000
0%	431,620,000	287,746,667	143,873,333	0	-143,873,333	-287,746,667	-431,620,000
-8.33%	431,620,000	287,746,667	143,873,333	0	-143,873,333	-287,746,667	-431,620,000
-16.67%	431,620,000	287,746,667	143,873,333	0	-143,873,333	-287,746,667	-431,620,000
-25%	431,620,000	287,746,667	143,873,333	0	-143,873,333	-287,746,667	-431,620,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

422

펀드명 : 키움KOSF200선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

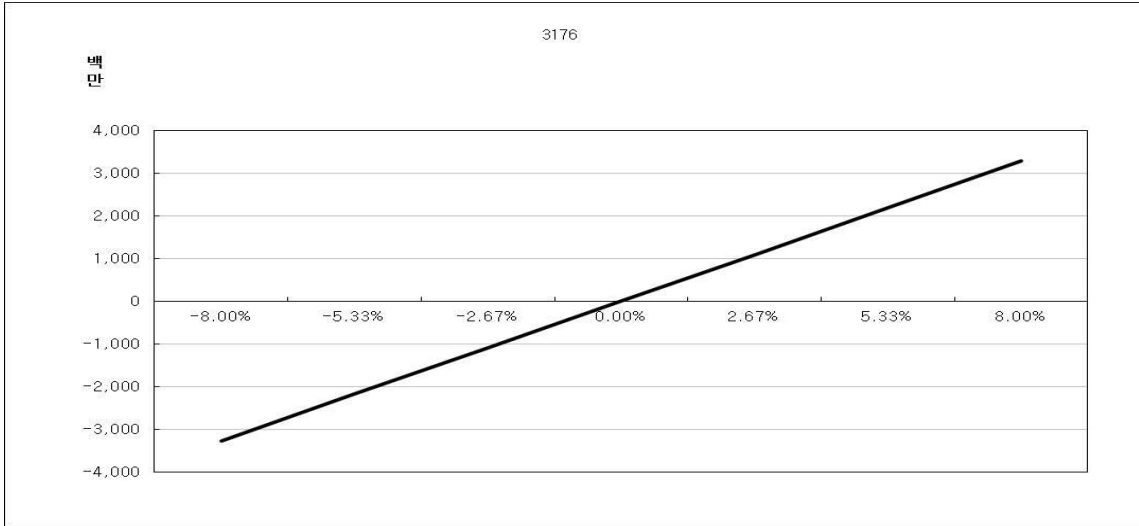
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	924	-924	장내
누계	주가지수	선물	26,957	0	26,957	장내
합계			26,957	0	26,957	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

2,158

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,158,100,000	-1,438,733,333	-719,366,667	0	719,366,667	1,438,733,333	2,158,100,000
16.67%	-2,158,100,000	-1,438,733,333	-719,366,667	0	719,366,667	1,438,733,333	2,158,100,000
8.33%	-2,158,100,000	-1,438,733,333	-719,366,667	0	719,366,667	1,438,733,333	2,158,100,000
0%	-2,158,100,000	-1,438,733,333	-719,366,667	0	719,366,667	1,438,733,333	2,158,100,000
-8.33%	-2,158,100,000	-1,438,733,333	-719,366,667	0	719,366,667	1,438,733,333	2,158,100,000
-16.67%	-2,158,100,000	-1,438,733,333	-719,366,667	0	719,366,667	1,438,733,333	2,158,100,000
-25%	-2,158,100,000	-1,438,733,333	-719,366,667	0	719,366,667	1,438,733,333	2,158,100,000

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,110

펀드명 : 키움KOSEF200선물인버스2X증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

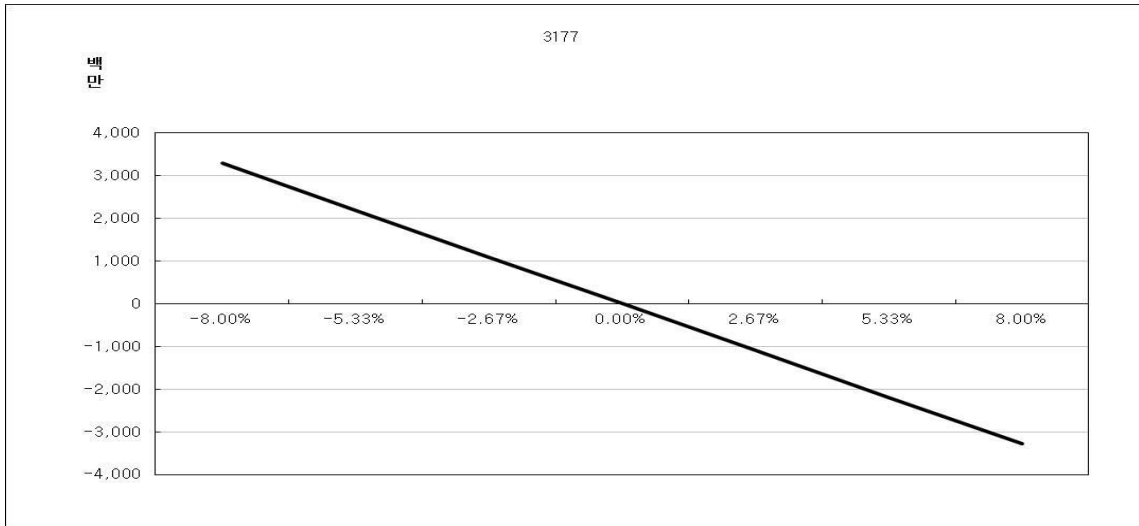
공시일: 2022-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,309	-1,309	장내
누계	주가지수	선물	0	16,174	-16,174	장내
합계			0	16,174	-16,174	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,295

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,294,860,000	863,240,000	431,620,000	0	-431,620,000	-863,240,000	-1,294,860,000
16.67%	1,294,860,000	863,240,000	431,620,000	0	-431,620,000	-863,240,000	-1,294,860,000
8.33%	1,294,860,000	863,240,000	431,620,000	0	-431,620,000	-863,240,000	-1,294,860,000
0%	1,294,860,000	863,240,000	431,620,000	0	-431,620,000	-863,240,000	-1,294,860,000
-8.33%	1,294,860,000	863,240,000	431,620,000	0	-431,620,000	-863,240,000	-1,294,860,000
-16.67%	1,294,860,000	863,240,000	431,620,000	0	-431,620,000	-863,240,000	-1,294,860,000
-25%	1,294,860,000	863,240,000	431,620,000	0	-431,620,000	-863,240,000	-1,294,860,000

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,266

펀드명 : Commodity인덱스투자_모_상품파생

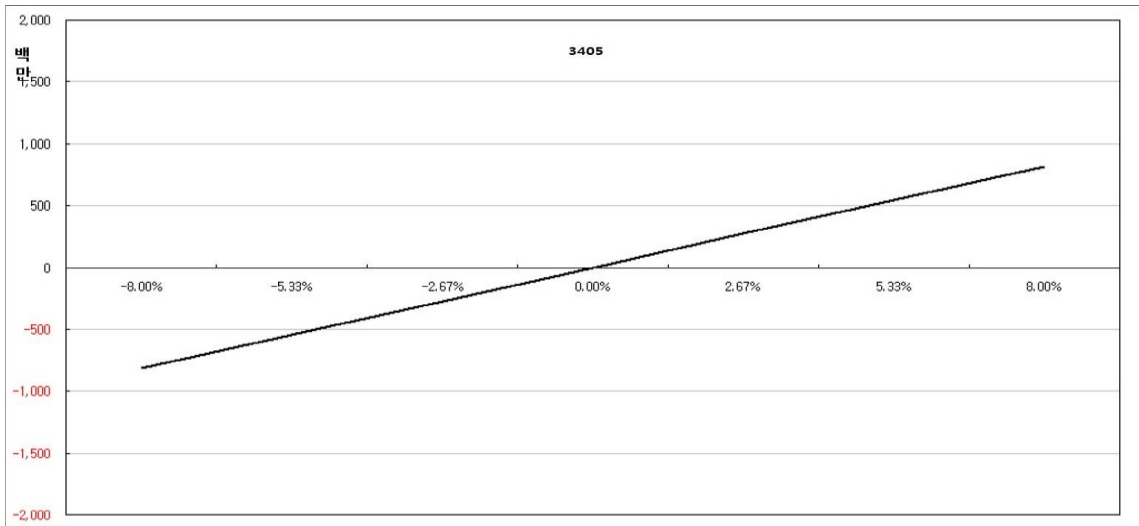
공시일: 2022-06-23

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	2,231	-2,231	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	4,089	0	4,089	장내
합계			4,089	2,231	1,858	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

188

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 테이블 상 수치 기재가 어려움

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

597

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제1호[파생형]

공시일: 2022-06-23

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	16,985	0	16,985	장외
합계			16,985	0	16,985	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

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

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,403

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,403,794,809	1,402,671,985	1,401,549,330	1,400,426,843	1,399,304,526	1,398,182,376	1,397,060,396
16.67%	936,924,769	935,822,310	934,720,019	933,617,896	932,515,940	931,414,152	930,312,532
8.33%	470,054,729	468,972,635	467,890,708	466,808,948	465,727,355	464,645,929	463,564,669
0%	3,184,688	2,122,960	1,061,397	0	-1,061,230	-2,122,295	-3,183,194
-8.33%	-463,685,352	-464,726,715	-465,767,914	-466,808,947	-467,849,816	-468,890,519	-469,931,057
-16.67%	-930,555,392	-931,576,391	-932,597,225	-933,617,895	-934,638,401	-935,658,743	-936,678,921
-25%	-1,397,425,433	-1,398,426,066	-1,399,426,536	-1,400,426,843	-1,401,426,986	-1,402,426,967	-1,403,426,784

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제2호[파생형]

공시일: 2022-06-23

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	16,985	0	16,985	장외
합계			16,985	0	16,985	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

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

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,403

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,403,794,809	1,402,671,985	1,401,549,330	1,400,426,843	1,399,304,526	1,398,182,376	1,397,060,396
16.67%	936,924,769	935,822,310	934,720,019	933,617,896	932,515,940	931,414,152	930,312,532
8.33%	470,054,729	468,972,635	467,890,708	466,808,948	465,727,355	464,645,929	463,564,669
0%	3,184,688	2,122,960	1,061,397	0	-1,061,230	-2,122,295	-3,183,194
-8.33%	-463,685,352	-464,726,715	-465,767,914	-466,808,947	-467,849,816	-468,890,519	-469,931,057
-16.67%	-930,555,392	-931,576,391	-932,597,225	-933,617,895	-934,638,401	-935,658,743	-936,678,921
-25%	-1,397,425,433	-1,398,426,066	-1,399,426,536	-1,400,426,843	-1,401,426,986	-1,402,426,967	-1,403,426,784

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제3호[파생형]

공시일: 2022-06-23

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	16,985	0	16,985	장외
합계			16,985	0	16,985	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

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

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,403

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,403,794,809	1,402,671,985	1,401,549,330	1,400,426,843	1,399,304,526	1,398,182,376	1,397,060,396
16.67%	936,924,769	935,822,310	934,720,019	933,617,896	932,515,940	931,414,152	930,312,532
8.33%	470,054,729	468,972,635	467,890,708	466,808,948	465,727,355	464,645,929	463,564,669
0%	3,184,688	2,122,960	1,061,397	0	-1,061,230	-2,122,295	-3,183,194
-8.33%	-463,685,352	-464,726,715	-465,767,914	-466,808,947	-467,849,816	-468,890,519	-469,931,057
-16.67%	-930,555,392	-931,576,391	-932,597,225	-933,617,895	-934,638,401	-935,658,743	-936,678,921
-25%	-1,397,425,433	-1,398,426,066	-1,399,426,536	-1,400,426,843	-1,401,426,986	-1,402,426,967	-1,403,426,784

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제4호[파생형]

공시일: 2022-06-23

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	16,985	0	16,985	장외
합계			16,985	0	16,985	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

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

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,403

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,403,794,809	1,402,671,985	1,401,549,330	1,400,426,843	1,399,304,526	1,398,182,376	1,397,060,396
16.67%	936,924,769	935,822,310	934,720,019	933,617,896	932,515,940	931,414,152	930,312,532
8.33%	470,054,729	468,972,635	467,890,708	466,808,948	465,727,355	464,645,929	463,564,669
0%	3,184,688	2,122,960	1,061,397	0	-1,061,230	-2,122,295	-3,183,194
-8.33%	-463,685,352	-464,726,715	-465,767,914	-466,808,947	-467,849,816	-468,890,519	-469,931,057
-16.67%	-930,555,392	-931,576,391	-932,597,225	-933,617,895	-934,638,401	-935,658,743	-936,678,921
-25%	-1,397,425,433	-1,398,426,066	-1,399,426,536	-1,400,426,843	-1,401,426,986	-1,402,426,967	-1,403,426,784

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34