

펀드명 : 프런티어뉴인덱스αF-1_주식파생

공시일: 2022-07-04

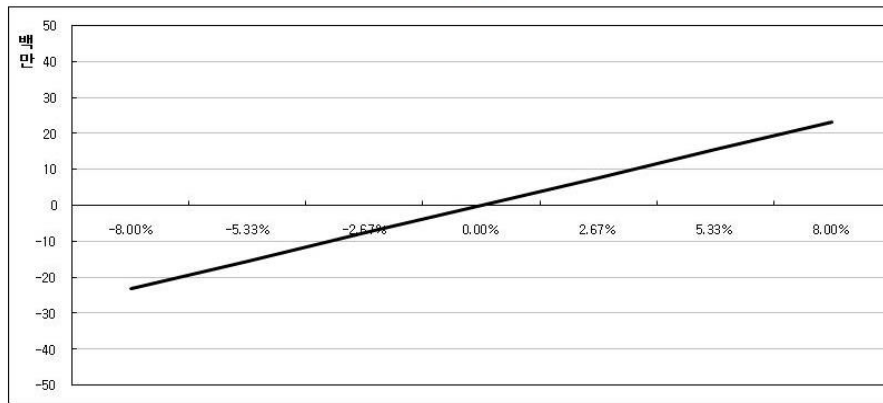
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	836	0	836	장내
합계			836	0	836	

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)

67

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-67,089,000	-44,726,000	-22,363,000	0	22,363,000	44,726,000	67,089,000
16.67%	-67,089,000	-44,726,000	-22,363,000	0	22,363,000	44,726,000	67,089,000
8.33%	-67,089,000	-44,726,000	-22,363,000	0	22,363,000	44,726,000	67,089,000
0%	-67,089,000	-44,726,000	-22,363,000	0	22,363,000	44,726,000	67,089,000
-8.33%	-67,089,000	-44,726,000	-22,363,000	0	22,363,000	44,726,000	67,089,000
-16.67%	-67,089,000	-44,726,000	-22,363,000	0	22,363,000	44,726,000	67,089,000
-25%	-67,089,000	-44,726,000	-22,363,000	0	22,363,000	44,726,000	67,089,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

67

펀드명 : 중국인덱스모_주식파생재간접

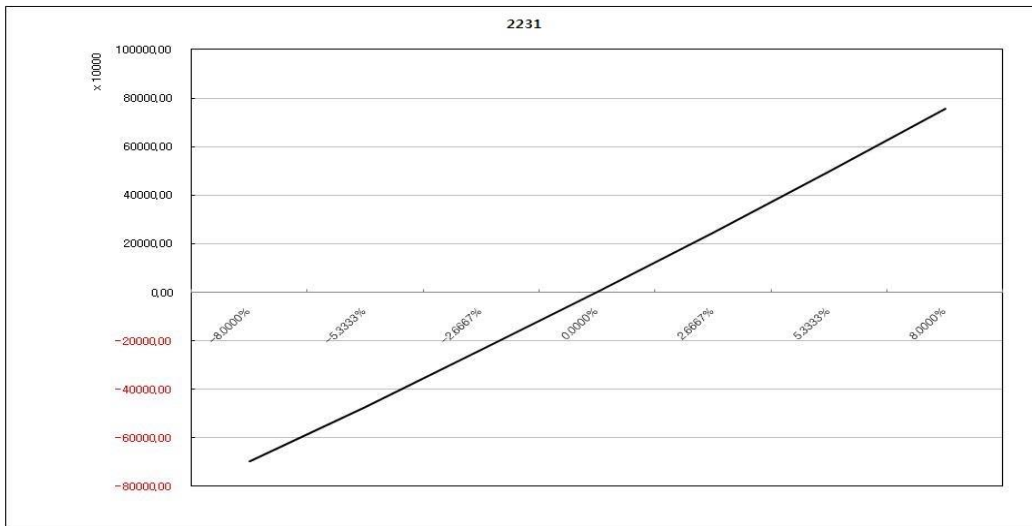
공시일: 2022-07-04

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	253	0	253	장내
신규	통화	선도	99	95	4	장외
누계	통화	선도	3,594	0	3,594	장외
합계			3,848	0	3,848	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

296

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)

138

펀드명 : 마이블마켓1_주식파생형

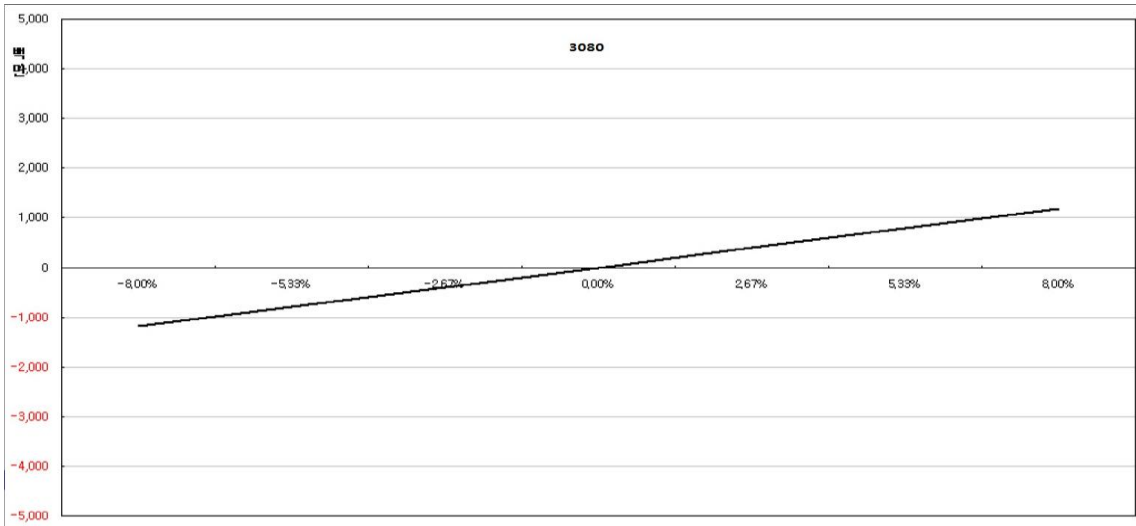
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	228	0	228	장내
누계	주가지수	선물	7,144	0	7,144	장내
합계			7,144	0	7,144	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

573

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-573,306,000	-382,204,000	-191,102,000	0	191,102,000	382,204,000	573,306,000
16.67%	-573,306,000	-382,204,000	-191,102,000	0	191,102,000	382,204,000	573,306,000
8.33%	-573,306,000	-382,204,000	-191,102,000	0	191,102,000	382,204,000	573,306,000
0%	-573,306,000	-382,204,000	-191,102,000	0	191,102,000	382,204,000	573,306,000
-8.33%	-573,306,000	-382,204,000	-191,102,000	0	191,102,000	382,204,000	573,306,000
-16.67%	-573,306,000	-382,204,000	-191,102,000	0	191,102,000	382,204,000	573,306,000
-25%	-573,306,000	-382,204,000	-191,102,000	0	191,102,000	382,204,000	573,306,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

574

펀드명 : 마이베어마켓1_주식파생

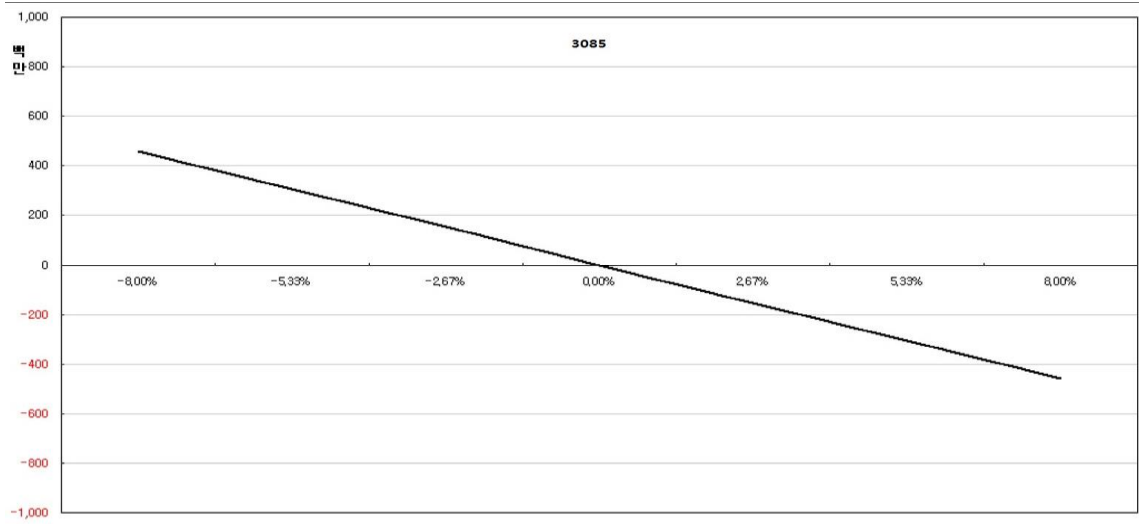
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	76	0	76	장내
누계	주가지수	선물	0	2,812	-2,812	장내
합계			0	2,812	-2,812	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

226

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	225,663,000	150,442,000	75,221,000	0	-75,221,000	-150,442,000	-225,663,000
16.67%	225,663,000	150,442,000	75,221,000	0	-75,221,000	-150,442,000	-225,663,000
8.33%	225,663,000	150,442,000	75,221,000	0	-75,221,000	-150,442,000	-225,663,000
0%	225,663,000	150,442,000	75,221,000	0	-75,221,000	-150,442,000	-225,663,000
-8.33%	225,663,000	150,442,000	75,221,000	0	-75,221,000	-150,442,000	-225,663,000
-16.67%	225,663,000	150,442,000	75,221,000	0	-75,221,000	-150,442,000	-225,663,000
-25%	225,663,000	150,442,000	75,221,000	0	-75,221,000	-150,442,000	-225,663,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

226

펀드명 : 키움KOSDAQ코스닥150선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

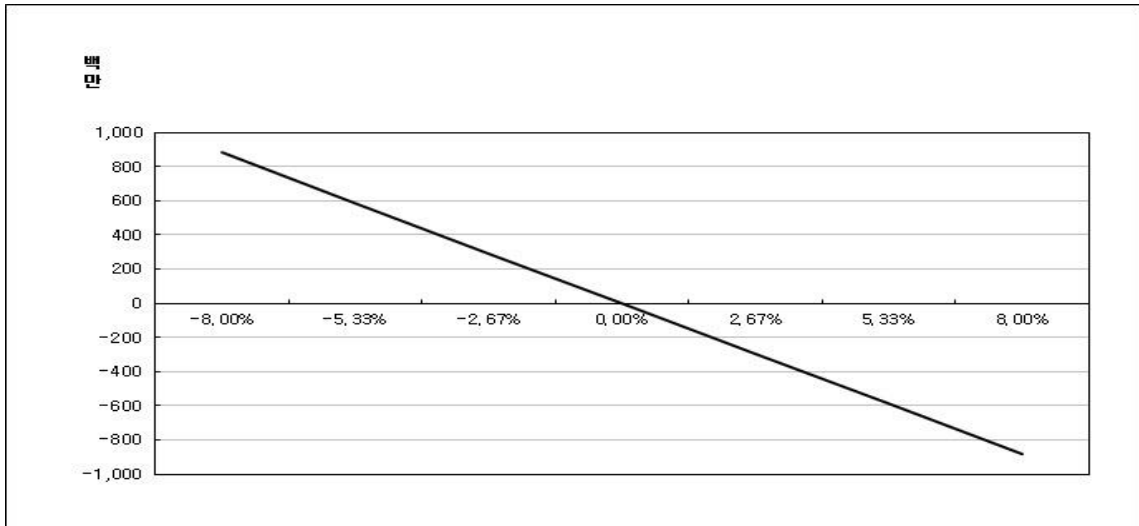
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	248	-248	장내
누계	주가지수	선물	0	6,170	-6,170	장내
합계			0	6,170	-6,170	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

493

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	492,512,800	328,341,867	164,170,933	0	-164,170,933	-328,341,867	-492,512,800
16.67%	492,512,800	328,341,867	164,170,933	0	-164,170,933	-328,341,867	-492,512,800
8.33%	492,512,800	328,341,867	164,170,933	0	-164,170,933	-328,341,867	-492,512,800
0%	492,512,800	328,341,867	164,170,933	0	-164,170,933	-328,341,867	-492,512,800
-8.33%	492,512,800	328,341,867	164,170,933	0	-164,170,933	-328,341,867	-492,512,800
-16.67%	492,512,800	328,341,867	164,170,933	0	-164,170,933	-328,341,867	-492,512,800
-25%	492,512,800	328,341,867	164,170,933	0	-164,170,933	-328,341,867	-492,512,800

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

752

펀드명 : 키움KOSF코스닥150선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

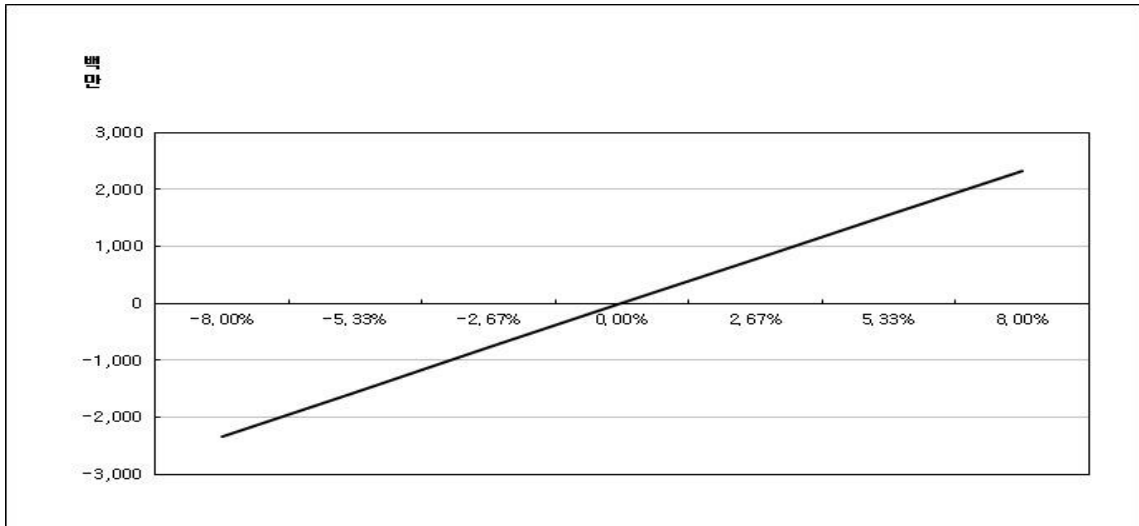
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	206	-206	장내
누계	주가지수	선물	8,553	0	8,553	장내
합계			8,553	0	8,553	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

683

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-682,764,400	-455,176,267	-227,588,133	0	227,588,133	455,176,267	682,764,400
16.67%	-682,764,400	-455,176,267	-227,588,133	0	227,588,133	455,176,267	682,764,400
8.33%	-682,764,400	-455,176,267	-227,588,133	0	227,588,133	455,176,267	682,764,400
0%	-682,764,400	-455,176,267	-227,588,133	0	227,588,133	455,176,267	682,764,400
-8.33%	-682,764,400	-455,176,267	-227,588,133	0	227,588,133	455,176,267	682,764,400
-16.67%	-682,764,400	-455,176,267	-227,588,133	0	227,588,133	455,176,267	682,764,400
-25%	-682,764,400	-455,176,267	-227,588,133	0	227,588,133	455,176,267	682,764,400

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,043

펀드명 : 키움KOSEF 미국달러 ETF[미국달러-파생형]

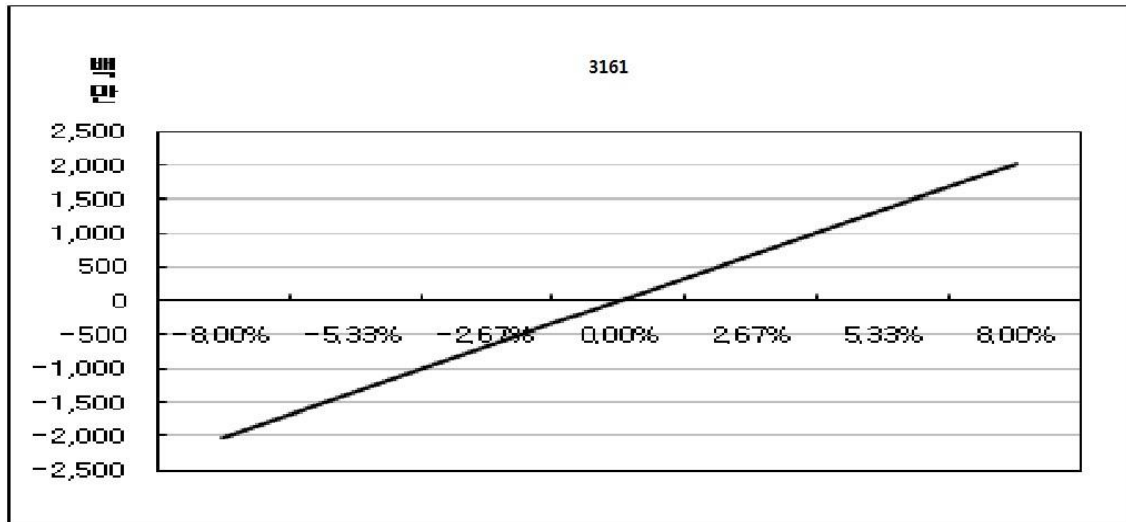
공시일: 2022-07-04

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	37,323	0	37,323	장내
합계			37,323	0	37,323	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

2,988

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,988,167,280	-1,992,111,520	-996,055,760	0	996,055,760	1,992,111,520	2,988,167,280
16.67%	-2,988,167,280	-1,992,111,520	-996,055,760	0	996,055,760	1,992,111,520	2,988,167,280
8.33%	-2,988,167,280	-1,992,111,520	-996,055,760	0	996,055,760	1,992,111,520	2,988,167,280
0%	-2,988,167,280	-1,992,111,520	-996,055,760	0	996,055,760	1,992,111,520	2,988,167,280
-8.33%	-2,988,167,280	-1,992,111,520	-996,055,760	0	996,055,760	1,992,111,520	2,988,167,280
-16.67%	-2,988,167,280	-1,992,111,520	-996,055,760	0	996,055,760	1,992,111,520	2,988,167,280
-25%	-2,988,167,280	-1,992,111,520	-996,055,760	0	996,055,760	1,992,111,520	2,988,167,280

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,276

펀드명 : 키움KOSF 미국달러 인버스[미국달러-파생형]

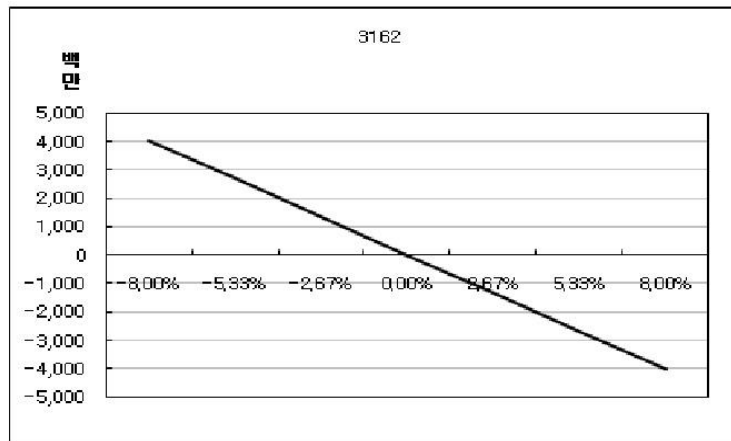
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	13	-13	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%	771,709,520	514,473,013	257,236,507	0	-257,236,507	-514,473,013	-771,709,520
16.67%	771,709,520	514,473,013	257,236,507	0	-257,236,507	-514,473,013	-771,709,520
8.33%	771,709,520	514,473,013	257,236,507	0	-257,236,507	-514,473,013	-771,709,520
0%	771,709,520	514,473,013	257,236,507	0	-257,236,507	-514,473,013	-771,709,520
-8.33%	771,709,520	514,473,013	257,236,507	0	-257,236,507	-514,473,013	-771,709,520
-16.67%	771,709,520	514,473,013	257,236,507	0	-257,236,507	-514,473,013	-771,709,520
-25%	771,709,520	514,473,013	257,236,507	0	-257,236,507	-514,473,013	-771,709,520

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

330

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

공시일: 2022-07-04

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	15,641	0	15,641	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	41,072	0	41,072	장외
합계			56,713	0	56,713	

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)

3,286

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)

4,579

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

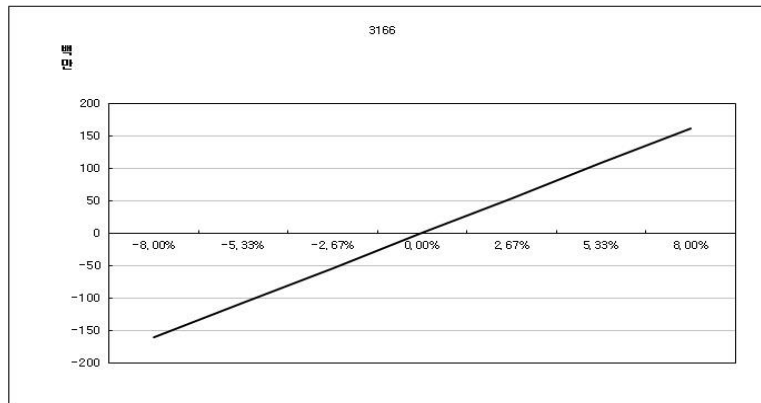
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	78	-78	장내
누계	통화	선물	78,149	0	78,149	장내
합계			78,149	0	78,149	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,257

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-6,256,767,360	-4,171,178,240	-2,085,589,120	0	2,085,589,120	4,171,178,240	6,256,767,360
16.67%	-6,256,767,360	-4,171,178,240	-2,085,589,120	0	2,085,589,120	4,171,178,240	6,256,767,360
8.33%	-6,256,767,360	-4,171,178,240	-2,085,589,120	0	2,085,589,120	4,171,178,240	6,256,767,360
0%	-6,256,767,360	-4,171,178,240	-2,085,589,120	0	2,085,589,120	4,171,178,240	6,256,767,360
-8.33%	-6,256,767,360	-4,171,178,240	-2,085,589,120	0	2,085,589,120	4,171,178,240	6,256,767,360
-16.67%	-6,256,767,360	-4,171,178,240	-2,085,589,120	0	2,085,589,120	4,171,178,240	6,256,767,360
-25%	-6,256,767,360	-4,171,178,240	-2,085,589,120	0	2,085,589,120	4,171,178,240	6,256,767,360

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,672

명 : 키움KOSEF미국달러선물인버스2X특별자산상장지수투자신탁[미국달러-파생형](합)

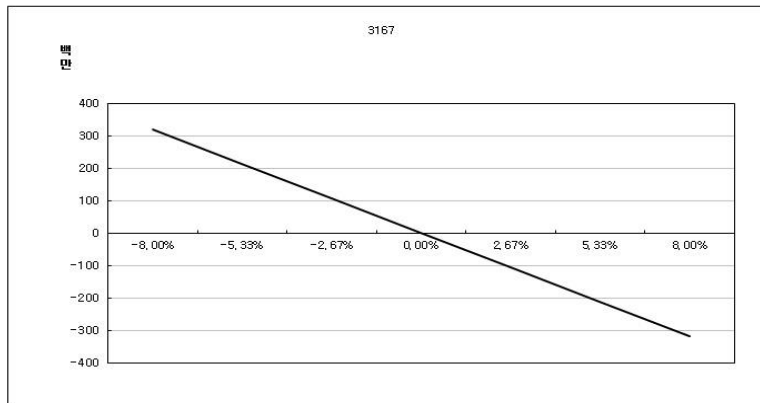
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	117	-117	장내
누계	통화	선물	0	38,115	-38,115	장내
합계			0	38,115	-38,115	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,052

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	3,051,524,320	2,034,349,547	1,017,174,773	0	-1,017,174,773	-2,034,349,547	-3,051,524,320
16.67%	3,051,524,320	2,034,349,547	1,017,174,773	0	-1,017,174,773	-2,034,349,547	-3,051,524,320
8.33%	3,051,524,320	2,034,349,547	1,017,174,773	0	-1,017,174,773	-2,034,349,547	-3,051,524,320
0%	3,051,524,320	2,034,349,547	1,017,174,773	0	-1,017,174,773	-2,034,349,547	-3,051,524,320
-8.33%	3,051,524,320	2,034,349,547	1,017,174,773	0	-1,017,174,773	-2,034,349,547	-3,051,524,320
-16.67%	3,051,524,320	2,034,349,547	1,017,174,773	0	-1,017,174,773	-2,034,349,547	-3,051,524,320
-25%	3,051,524,320	2,034,349,547	1,017,174,773	0	-1,017,174,773	-2,034,349,547	-3,051,524,320

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,303

펀드명 : 키움KOSF10년국고채레버리지_채권파생형

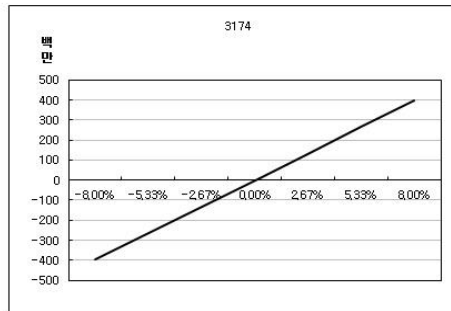
공시일: 2022-07-04

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	6,949	0	6,949	장내
합계			6,949	0	6,949	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

555

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-555,073,600	-370,049,067	-185,024,533	0	185,024,533	370,049,067	555,073,600
16.67%	-555,073,600	-370,049,067	-185,024,533	0	185,024,533	370,049,067	555,073,600
8.33%	-555,073,600	-370,049,067	-185,024,533	0	185,024,533	370,049,067	555,073,600
0%	-555,073,600	-370,049,067	-185,024,533	0	185,024,533	370,049,067	555,073,600
-8.33%	-555,073,600	-370,049,067	-185,024,533	0	185,024,533	370,049,067	555,073,600
-16.67%	-555,073,600	-370,049,067	-185,024,533	0	185,024,533	370,049,067	555,073,600
-25%	-555,073,600	-370,049,067	-185,024,533	0	185,024,533	370,049,067	555,073,600

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

196

펀드명 : 키움KOSF200선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

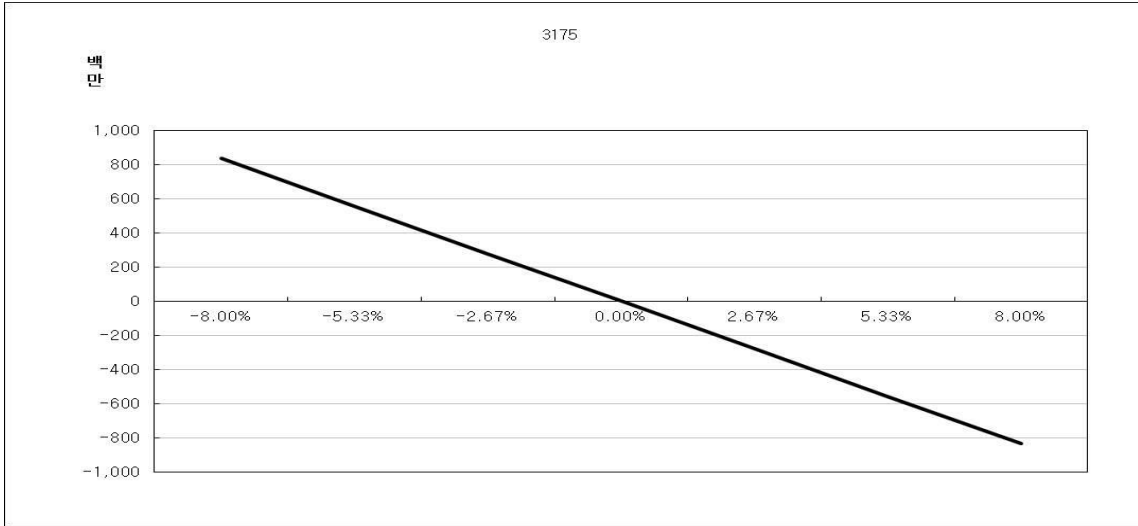
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	76	-76	장내
누계	주가지수	선물	0	5,396	-5,396	장내
합계			0	5,396	-5,396	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

433

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	433,029,000	288,686,000	144,343,000	0	-144,343,000	-288,686,000	-433,029,000
16.67%	433,029,000	288,686,000	144,343,000	0	-144,343,000	-288,686,000	-433,029,000
8.33%	433,029,000	288,686,000	144,343,000	0	-144,343,000	-288,686,000	-433,029,000
0%	433,029,000	288,686,000	144,343,000	0	-144,343,000	-288,686,000	-433,029,000
-8.33%	433,029,000	288,686,000	144,343,000	0	-144,343,000	-288,686,000	-433,029,000
-16.67%	433,029,000	288,686,000	144,343,000	0	-144,343,000	-288,686,000	-433,029,000
-25%	433,029,000	288,686,000	144,343,000	0	-144,343,000	-288,686,000	-433,029,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

433

펀드명 : 키움KOSEF200선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

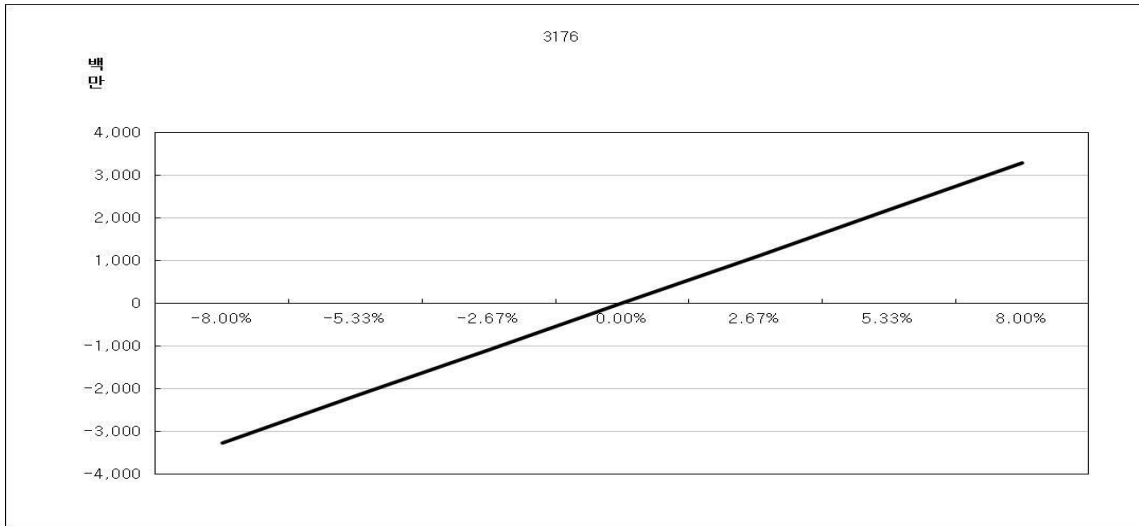
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	228	-228	장내
누계	주가지수	선물	26,374	0	26,374	장내
합계			26,374	0	26,374	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

2,116

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,116,353,000	-1,410,902,000	-705,451,000	0	705,451,000	1,410,902,000	2,116,353,000
16.67%	-2,116,353,000	-1,410,902,000	-705,451,000	0	705,451,000	1,410,902,000	2,116,353,000
8.33%	-2,116,353,000	-1,410,902,000	-705,451,000	0	705,451,000	1,410,902,000	2,116,353,000
0%	-2,116,353,000	-1,410,902,000	-705,451,000	0	705,451,000	1,410,902,000	2,116,353,000
-8.33%	-2,116,353,000	-1,410,902,000	-705,451,000	0	705,451,000	1,410,902,000	2,116,353,000
-16.67%	-2,116,353,000	-1,410,902,000	-705,451,000	0	705,451,000	1,410,902,000	2,116,353,000
-25%	-2,116,353,000	-1,410,902,000	-705,451,000	0	705,451,000	1,410,902,000	2,116,353,000

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,118

펀드명 : 키움KOSEF200선물인버스2X증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

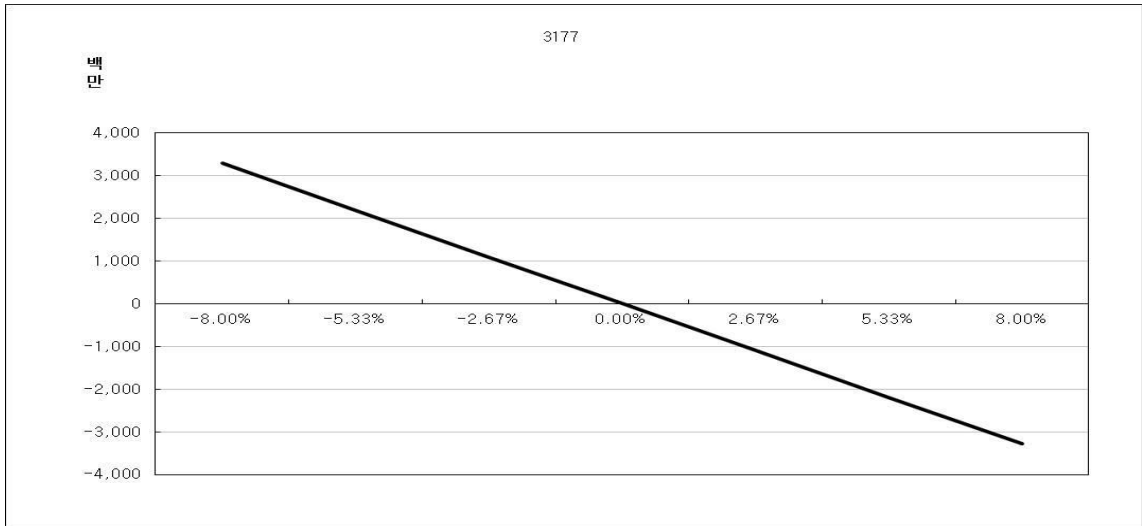
공시일: 2022-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	76	-76	장내
누계	주가지수	선물	0	15,125	-15,125	장내
합계			0	15,125	-15,125	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,214

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,213,701,000	809,134,000	404,567,000	0	-404,567,000	-809,134,000	-1,213,701,000
16.67%	1,213,701,000	809,134,000	404,567,000	0	-404,567,000	-809,134,000	-1,213,701,000
8.33%	1,213,701,000	809,134,000	404,567,000	0	-404,567,000	-809,134,000	-1,213,701,000
0%	1,213,701,000	809,134,000	404,567,000	0	-404,567,000	-809,134,000	-1,213,701,000
-8.33%	1,213,701,000	809,134,000	404,567,000	0	-404,567,000	-809,134,000	-1,213,701,000
-16.67%	1,213,701,000	809,134,000	404,567,000	0	-404,567,000	-809,134,000	-1,213,701,000
-25%	1,213,701,000	809,134,000	404,567,000	0	-404,567,000	-809,134,000	-1,213,701,000

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,215

펀드명 : Commodity인덱스투자_모_상품파생

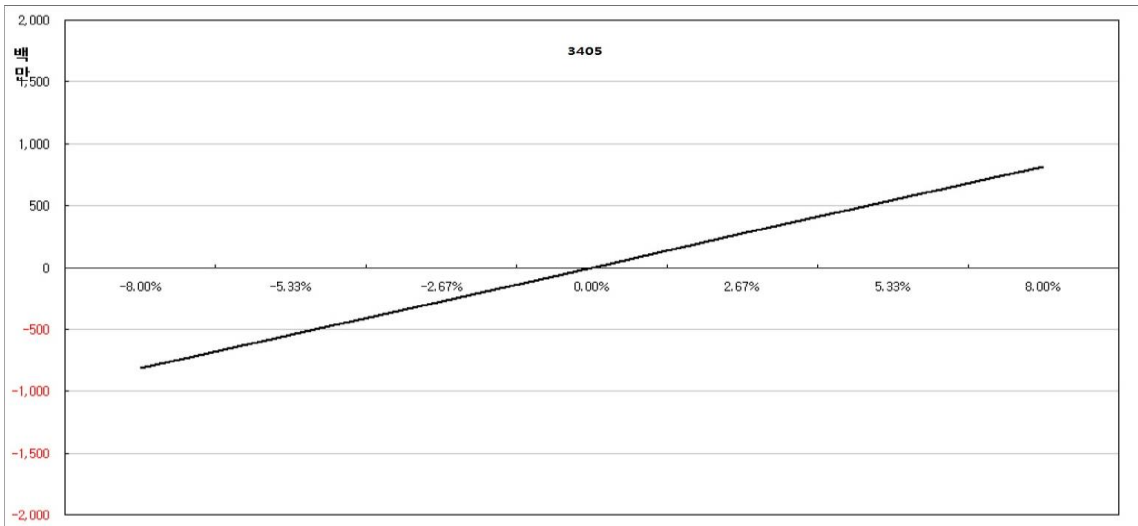
공시일: 2022-07-04

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	2,024	-2,024	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	3,963	0	3,963	장내
합계			3,963	2,024	1,939	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

180

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 수지 기제가 어려움

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

567

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제1호[파생형]

공시일: 2022-07-04

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%	1,403,615,392	1,402,377,331	1,401,139,434	1,399,901,699	1,398,664,127	1,397,426,718	1,396,189,472
16.67%	936,939,401	935,715,372	934,491,504	933,267,799	932,044,257	930,820,876	929,597,658
8.33%	470,263,411	469,053,412	467,843,575	466,633,899	465,424,386	464,215,035	463,005,845
0%	3,587,421	2,391,452	1,195,645	0	-1,195,484	-2,390,807	-3,585,968
-8.33%	-463,088,569	-464,270,507	-465,452,284	-466,633,900	-467,815,355	-468,996,648	-470,177,781
-16.67%	-929,764,560	-930,932,467	-932,100,214	-933,267,800	-934,435,225	-935,602,490	-936,769,594
-25%	-1,396,440,550	-1,397,594,427	-1,398,748,143	-1,399,901,699	-1,401,055,096	-1,402,208,331	-1,403,361,407

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제2호[파생형]

공시일: 2022-07-04

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%	1,403,615,392	1,402,377,331	1,401,139,434	1,399,901,699	1,398,664,127	1,397,426,718	1,396,189,472
16.67%	936,939,401	935,715,372	934,491,504	933,267,799	932,044,257	930,820,876	929,597,658
8.33%	470,263,411	469,053,412	467,843,575	466,633,899	465,424,386	464,215,035	463,005,845
0%	3,587,421	2,391,452	1,195,645	0	-1,195,484	-2,390,807	-3,585,968
-8.33%	-463,088,569	-464,270,507	-465,452,284	-466,633,900	-467,815,355	-468,996,648	-470,177,781
-16.67%	-929,764,560	-930,932,467	-932,100,214	-933,267,800	-934,435,225	-935,602,490	-936,769,594
-25%	-1,396,440,550	-1,397,594,427	-1,398,748,143	-1,399,901,699	-1,401,055,096	-1,402,208,331	-1,403,361,407

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제3호[파생형]

공시일: 2022-07-04

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%	1,403,615,392	1,402,377,331	1,401,139,434	1,399,901,699	1,398,664,127	1,397,426,718	1,396,189,472
16.67%	936,939,401	935,715,372	934,491,504	933,267,799	932,044,257	930,820,876	929,597,658
8.33%	470,263,411	469,053,412	467,843,575	466,633,899	465,424,386	464,215,035	463,005,845
0%	3,587,421	2,391,452	1,195,645	0	-1,195,484	-2,390,807	-3,585,968
-8.33%	-463,088,569	-464,270,507	-465,452,284	-466,633,900	-467,815,355	-468,996,648	-470,177,781
-16.67%	-929,764,560	-930,932,467	-932,100,214	-933,267,800	-934,435,225	-935,602,490	-936,769,594
-25%	-1,396,440,550	-1,397,594,427	-1,398,748,143	-1,399,901,699	-1,401,055,096	-1,402,208,331	-1,403,361,407

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : 키움이어로즈유럽오피스부동산투자신탁제4호[파생형]

공시일: 2022-07-04

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%	1,403,615,392	1,402,377,331	1,401,139,434	1,399,901,699	1,398,664,127	1,397,426,718	1,396,189,472
16.67%	936,939,401	935,715,372	934,491,504	933,267,799	932,044,257	930,820,876	929,597,658
8.33%	470,263,411	469,053,412	467,843,575	466,633,899	465,424,386	464,215,035	463,005,845
0%	3,587,421	2,391,452	1,195,645	0	-1,195,484	-2,390,807	-3,585,968
-8.33%	-463,088,569	-464,270,507	-465,452,284	-466,633,900	-467,815,355	-468,996,648	-470,177,781
-16.67%	-929,764,560	-930,932,467	-932,100,214	-933,267,800	-934,435,225	-935,602,490	-936,769,594
-25%	-1,396,440,550	-1,397,594,427	-1,398,748,143	-1,399,901,699	-1,401,055,096	-1,402,208,331	-1,403,361,407

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34