

# 펀드명 : 프런티어뉴인덱스 $\alpha$ F-1\_주식파생

공시일: 2021-07-21

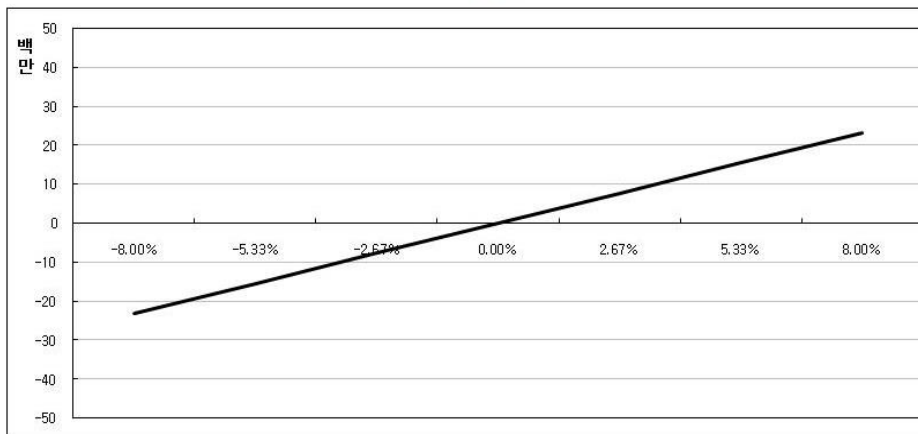
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	1,179	0	1,179	장내
합계			1,179	0	1,179	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

0728



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

94

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-94,270,000	-62,846,667	-31,423,333	0	31,423,333	62,846,667	94,270,000
16.67%	-94,270,000	-62,846,667	-31,423,333	0	31,423,333	62,846,667	94,270,000
8.33%	-94,270,000	-62,846,667	-31,423,333	0	31,423,333	62,846,667	94,270,000
0%	-94,270,000	-62,846,667	-31,423,333	0	31,423,333	62,846,667	94,270,000
-8.33%	-94,270,000	-62,846,667	-31,423,333	0	31,423,333	62,846,667	94,270,000
-16.67%	-94,270,000	-62,846,667	-31,423,333	0	31,423,333	62,846,667	94,270,000
-25%	-94,270,000	-62,846,667	-31,423,333	0	31,423,333	62,846,667	94,270,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

102

# 펀드명 : 중국인덱스모\_주식파생재간접

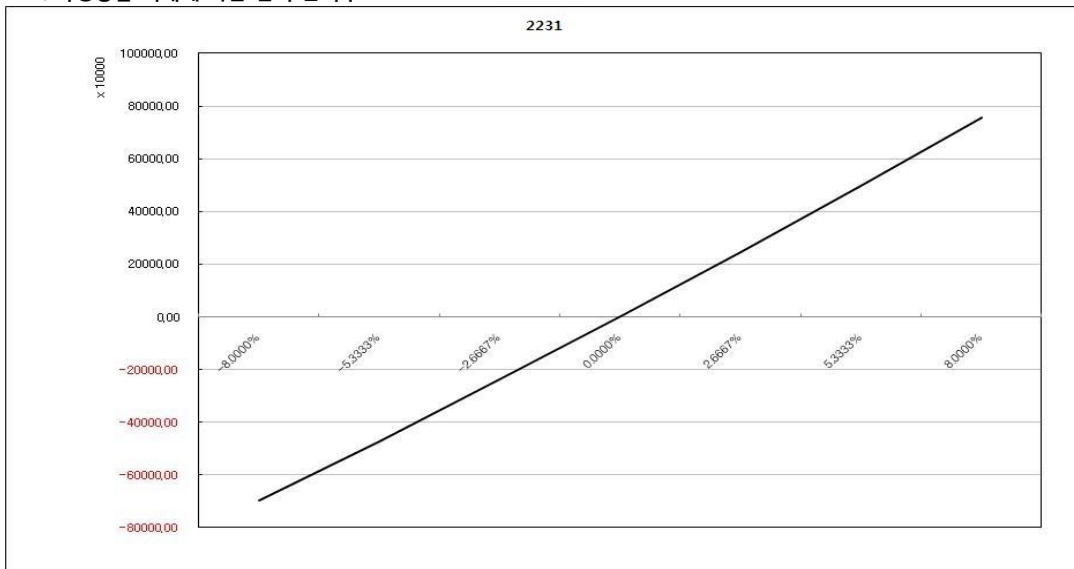
공시일: 2021-07-21

## 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	438	0	438	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	644,430	0	644,430	장외
합계			644,868	0	644,868	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

404

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

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

155

# 펀드명 : 마이볼마켓1\_주식파생형

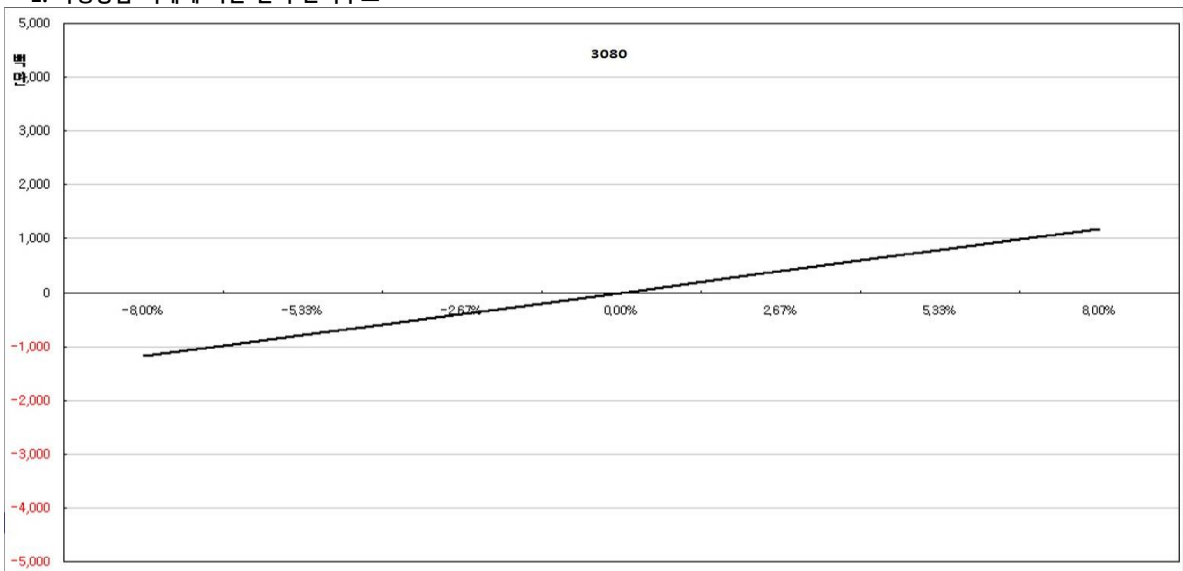
공시일: 2021-07-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	536	0	536	장내
누계	주가지수	선물	7,607	0	7,607	장내
합계			7,607	0	7,607	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

608

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-608,470,000	-405,646,667	-202,823,333	0	202,823,333	405,646,667	608,470,000
16.67%	-608,470,000	-405,646,667	-202,823,333	0	202,823,333	405,646,667	608,470,000
8.33%	-608,470,000	-405,646,667	-202,823,333	0	202,823,333	405,646,667	608,470,000
0%	-608,470,000	-405,646,667	-202,823,333	0	202,823,333	405,646,667	608,470,000
-8.33%	-608,470,000	-405,646,667	-202,823,333	0	202,823,333	405,646,667	608,470,000
-16.67%	-608,470,000	-405,646,667	-202,823,333	0	202,823,333	405,646,667	608,470,000
-25%	-608,470,000	-405,646,667	-202,823,333	0	202,823,333	405,646,667	608,470,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

657

# 펀드명 : 마이베어마켓1\_주식파생

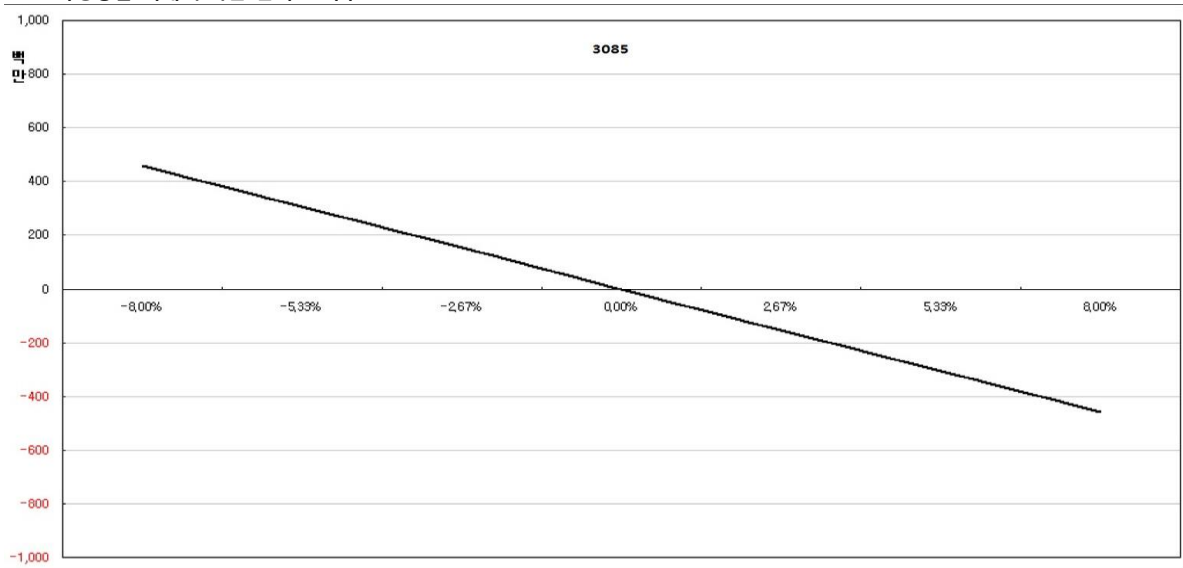
공시일: 2021-07-21

## 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	4,286	-4,286	장내
합계			0	4,286	-4,286	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

343

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	342,800,000	228,533,333	114,266,667	0	-114,266,667	-228,533,333	-342,800,000
16.67%	342,800,000	228,533,333	114,266,667	0	-114,266,667	-228,533,333	-342,800,000
8.33%	342,800,000	228,533,333	114,266,667	0	-114,266,667	-228,533,333	-342,800,000
0%	342,800,000	228,533,333	114,266,667	0	-114,266,667	-228,533,333	-342,800,000
-8.33%	342,800,000	228,533,333	114,266,667	0	-114,266,667	-228,533,333	-342,800,000
-16.67%	342,800,000	228,533,333	114,266,667	0	-114,266,667	-228,533,333	-342,800,000
-25%	342,800,000	228,533,333	114,266,667	0	-114,266,667	-228,533,333	-342,800,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

370

# 펀드명 : 키움KOSEF코스닥150선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

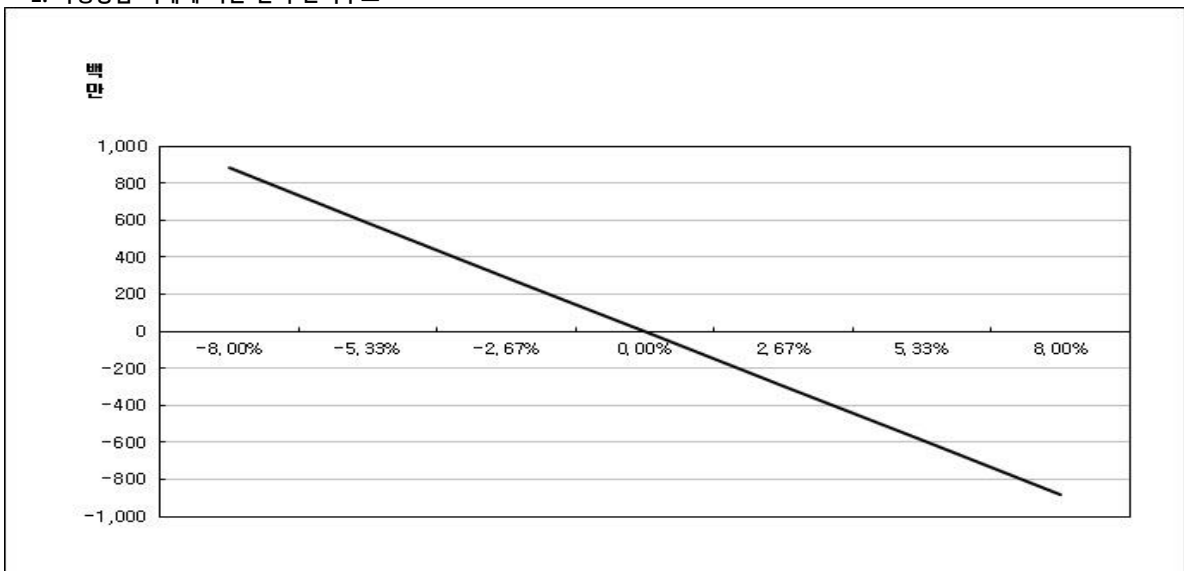
공시일: 2021-07-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	30	-30	장내
누계	주가지수	선물	0	4,197	-4,197	장내
합계			0	4,197	-4,197	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

333

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	332,853,280	221,902,187	110,951,093	0	-110,951,093	-221,902,187	-332,853,280
16.67%	332,853,280	221,902,187	110,951,093	0	-110,951,093	-221,902,187	-332,853,280
8.33%	332,853,280	221,902,187	110,951,093	0	-110,951,093	-221,902,187	-332,853,280
0%	332,853,280	221,902,187	110,951,093	0	-110,951,093	-221,902,187	-332,853,280
-8.33%	332,853,280	221,902,187	110,951,093	0	-110,951,093	-221,902,187	-332,853,280
-16.67%	332,853,280	221,902,187	110,951,093	0	-110,951,093	-221,902,187	-332,853,280
-25%	332,853,280	221,902,187	110,951,093	0	-110,951,093	-221,902,187	-332,853,280

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

458

# 펀드명 : 키움KOSDAQ코스닥150선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

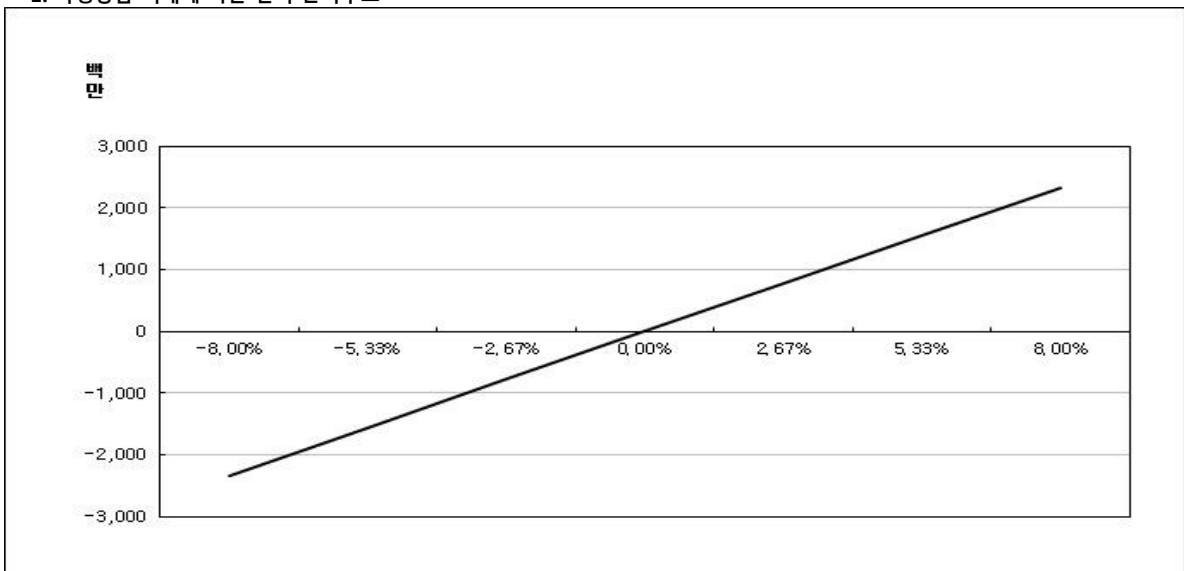
공시일: 2021-07-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	59	-59	장내
누계	주가지수	선물	16,269	0	16,269	장내
합계			16,269	0	16,269	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,290

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-1,290,247,520	-860,165,013	-430,082,507	0	430,082,507	860,165,013	1,290,247,520
16.67%	-1,290,247,520	-860,165,013	-430,082,507	0	430,082,507	860,165,013	1,290,247,520
8.33%	-1,290,247,520	-860,165,013	-430,082,507	0	430,082,507	860,165,013	1,290,247,520
0%	-1,290,247,520	-860,165,013	-430,082,507	0	430,082,507	860,165,013	1,290,247,520
-8.33%	-1,290,247,520	-860,165,013	-430,082,507	0	430,082,507	860,165,013	1,290,247,520
-16.67%	-1,290,247,520	-860,165,013	-430,082,507	0	430,082,507	860,165,013	1,290,247,520
-25%	-1,290,247,520	-860,165,013	-430,082,507	0	430,082,507	860,165,013	1,290,247,520

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,776

## 펀드명 : 키움KOSEF 미국달러 ETF[미국달러-파생형]

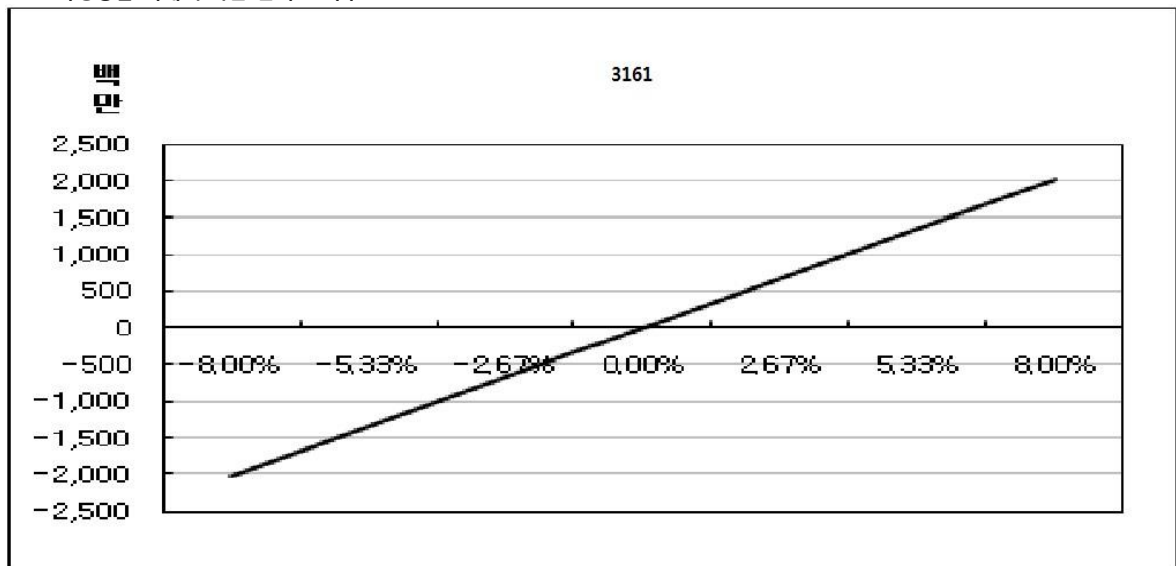
공시일: 2021-07-21

### 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	31,486	0	31,486	장내
합계			31,486	0	31,486	

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,520

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,519,791,680	-1,679,861,120	-839,930,560	0	839,930,560	1,679,861,120	2,519,791,680
16.67%	-2,519,791,680	-1,679,861,120	-839,930,560	0	839,930,560	1,679,861,120	2,519,791,680
8.33%	-2,519,791,680	-1,679,861,120	-839,930,560	0	839,930,560	1,679,861,120	2,519,791,680
0%	-2,519,791,680	-1,679,861,120	-839,930,560	0	839,930,560	1,679,861,120	2,519,791,680
-8.33%	-2,519,791,680	-1,679,861,120	-839,930,560	0	839,930,560	1,679,861,120	2,519,791,680
-16.67%	-2,519,791,680	-1,679,861,120	-839,930,560	0	839,930,560	1,679,861,120	2,519,791,680
-25%	-2,519,791,680	-1,679,861,120	-839,930,560	0	839,930,560	1,679,861,120	2,519,791,680

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

934

## 펀드명 : 키움KOSF 미국달러 인버스[미국달러-파생형]

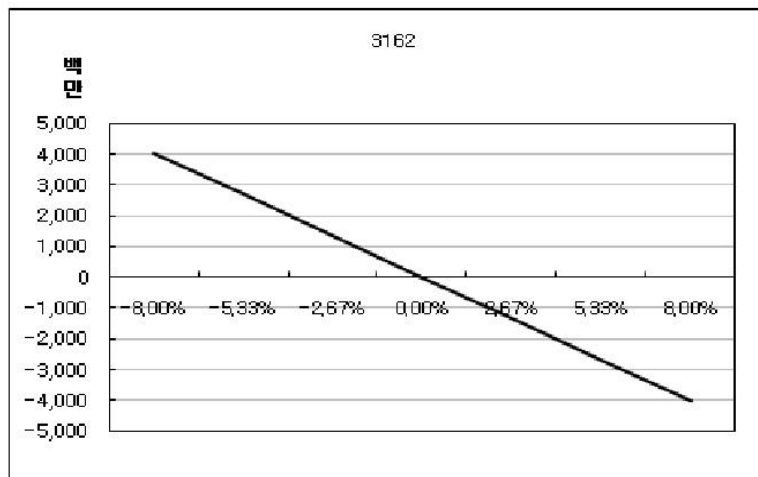
공시일: 2021-07-21

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	46	0	46	장내
누계	통화	선물	0	11,516	-11,516	장내
합계			0	11,516	-11,516	

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

922

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	921,560,640	614,373,760	307,186,880	0	-307,186,880	-614,373,760	-921,560,640
16.67%	921,560,640	614,373,760	307,186,880	0	-307,186,880	-614,373,760	-921,560,640
8.33%	921,560,640	614,373,760	307,186,880	0	-307,186,880	-614,373,760	-921,560,640
0%	921,560,640	614,373,760	307,186,880	0	-307,186,880	-614,373,760	-921,560,640
-8.33%	921,560,640	614,373,760	307,186,880	0	-307,186,880	-614,373,760	-921,560,640
-16.67%	921,560,640	614,373,760	307,186,880	0	-307,186,880	-614,373,760	-921,560,640
-25%	921,560,640	614,373,760	307,186,880	0	-307,186,880	-614,373,760	-921,560,640

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

342



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

공시일: 2021-07-21

## 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	1,367	0	1,367	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	27,755	0	27,755	장외
합계			29,122	0	29,122	

## 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.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,220

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

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,335

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

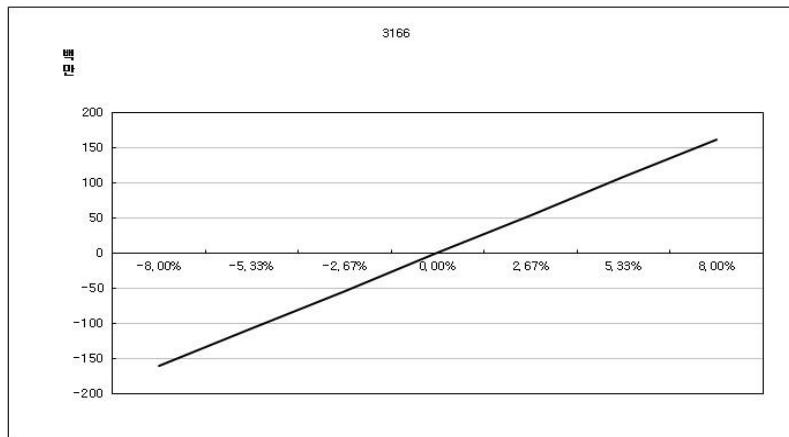
공시일: 2021-07-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	104	0	104	장내
누계	통화	선물	40,195	0	40,195	장내
합계			40,195	0	40,195	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,217

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-3,216,716,160	-2,144,477,440	-1,072,238,720	0	1,072,238,720	2,144,477,440	3,216,716,160
16.67%	-3,216,716,160	-2,144,477,440	-1,072,238,720	0	1,072,238,720	2,144,477,440	3,216,716,160
8.33%	-3,216,716,160	-2,144,477,440	-1,072,238,720	0	1,072,238,720	2,144,477,440	3,216,716,160
0%	-3,216,716,160	-2,144,477,440	-1,072,238,720	0	1,072,238,720	2,144,477,440	3,216,716,160
-8.33%	-3,216,716,160	-2,144,477,440	-1,072,238,720	0	1,072,238,720	2,144,477,440	3,216,716,160
-16.67%	-3,216,716,160	-2,144,477,440	-1,072,238,720	0	1,072,238,720	2,144,477,440	3,216,716,160
-25%	-3,216,716,160	-2,144,477,440	-1,072,238,720	0	1,072,238,720	2,144,477,440	3,216,716,160

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,192

# 명 : 키움KOSEF미국달러선물인버스2X특별자산상장지수투자신탁[미국달러-파생형](합)

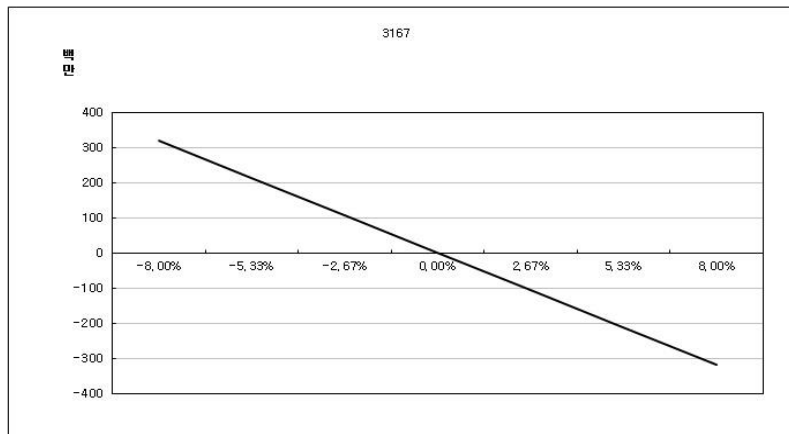
공시일: 2021-07-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	242	0	242	장내
누계	통화	선물	0	32,809	-32,809	장내
합계			0	32,809	-32,809	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,626

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	2,625,665,280	1,750,443,520	875,221,760	0	-875,221,760	-1,750,443,520	-2,625,665,280
16.67%	2,625,665,280	1,750,443,520	875,221,760	0	-875,221,760	-1,750,443,520	-2,625,665,280
8.33%	2,625,665,280	1,750,443,520	875,221,760	0	-875,221,760	-1,750,443,520	-2,625,665,280
0%	2,625,665,280	1,750,443,520	875,221,760	0	-875,221,760	-1,750,443,520	-2,625,665,280
-8.33%	2,625,665,280	1,750,443,520	875,221,760	0	-875,221,760	-1,750,443,520	-2,625,665,280
-16.67%	2,625,665,280	1,750,443,520	875,221,760	0	-875,221,760	-1,750,443,520	-2,625,665,280
-25%	2,625,665,280	1,750,443,520	875,221,760	0	-875,221,760	-1,750,443,520	-2,625,665,280

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

973

## 펀드명 : 키움KOSEF10년국고채레버리지\_채권파생형

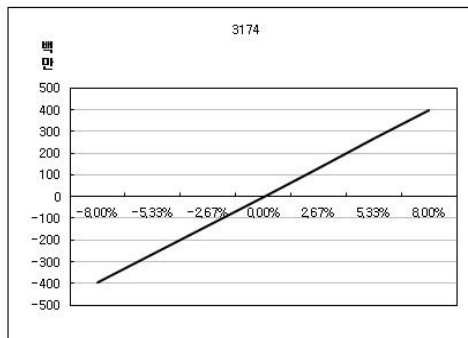
공시일: 2021-07-21

### 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	8,706	0	8,706	장내
합계			8,706	0	8,706	

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

696

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-696,048,000	-464,032,000	-232,016,000	0	232,016,000	464,032,000	696,048,000
16.67%	-696,048,000	-464,032,000	-232,016,000	0	232,016,000	464,032,000	696,048,000
8.33%	-696,048,000	-464,032,000	-232,016,000	0	232,016,000	464,032,000	696,048,000
0%	-696,048,000	-464,032,000	-232,016,000	0	232,016,000	464,032,000	696,048,000
-8.33%	-696,048,000	-464,032,000	-232,016,000	0	232,016,000	464,032,000	696,048,000
-16.67%	-696,048,000	-464,032,000	-232,016,000	0	232,016,000	464,032,000	696,048,000
-25%	-696,048,000	-464,032,000	-232,016,000	0	232,016,000	464,032,000	696,048,000

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

144

# 펀드명 : 키움KOSEF200선물인버스증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

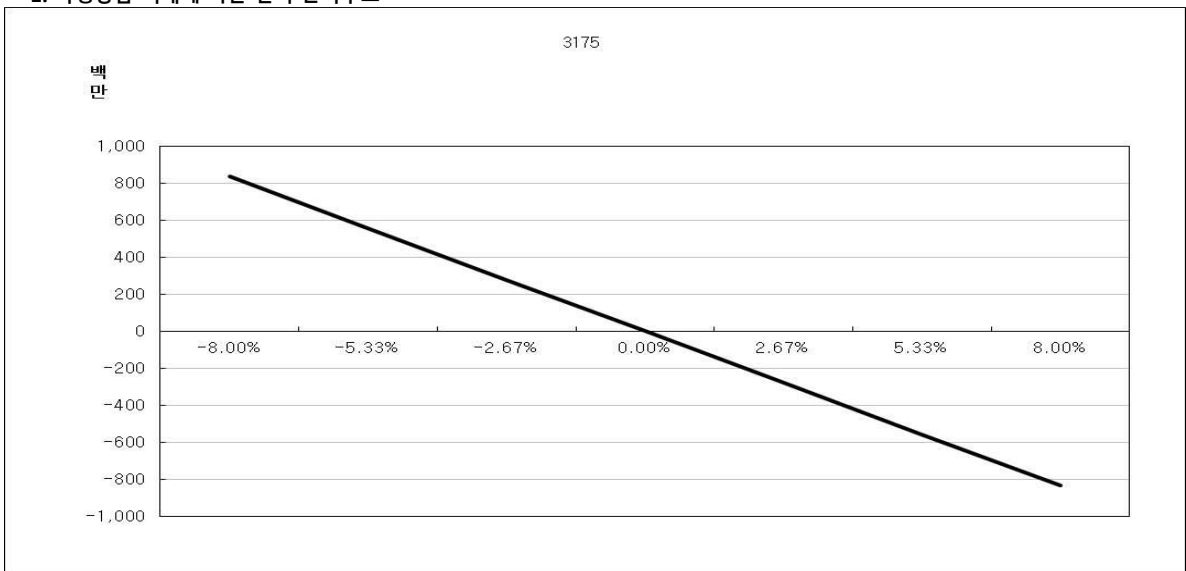
공시일: 2021-07-21

## 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	3,964	-3,964	장내
합계			0	3,964	-3,964	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

317

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	317,090,000	211,393,333	105,696,667	0	-105,696,667	-211,393,333	-317,090,000
16.67%	317,090,000	211,393,333	105,696,667	0	-105,696,667	-211,393,333	-317,090,000
8.33%	317,090,000	211,393,333	105,696,667	0	-105,696,667	-211,393,333	-317,090,000
0%	317,090,000	211,393,333	105,696,667	0	-105,696,667	-211,393,333	-317,090,000
-8.33%	317,090,000	211,393,333	105,696,667	0	-105,696,667	-211,393,333	-317,090,000
-16.67%	317,090,000	211,393,333	105,696,667	0	-105,696,667	-211,393,333	-317,090,000
-25%	317,090,000	211,393,333	105,696,667	0	-105,696,667	-211,393,333	-317,090,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

342

# 펀드명 : 키움KOSEF200선물레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

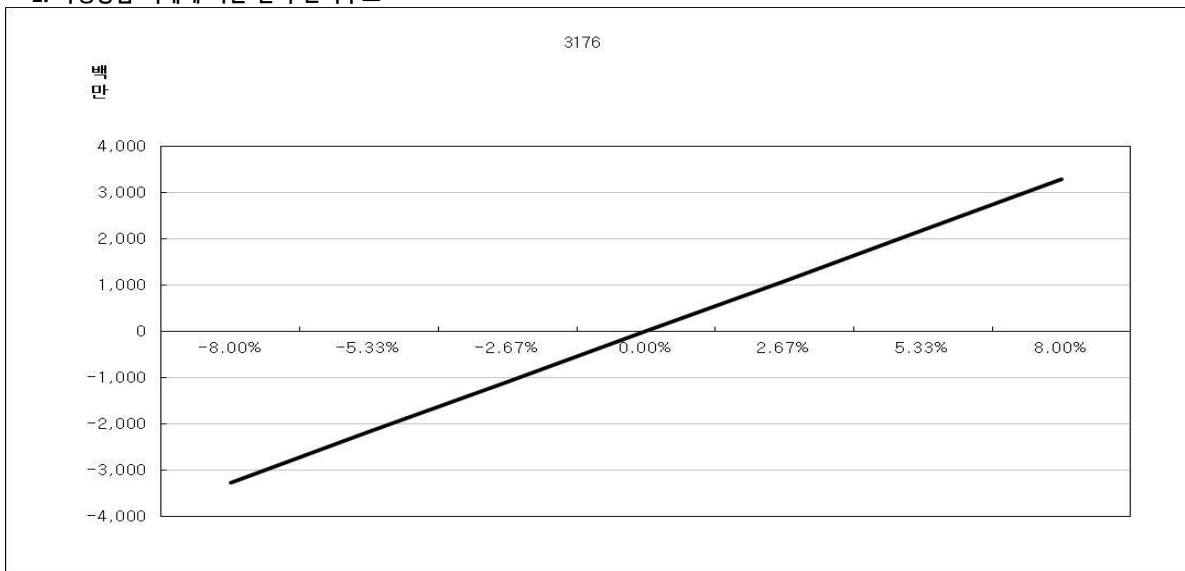
공시일: 2021-07-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	107	-107	장내
누계	주가지수	선물	52,283	0	52,283	장내
합계			52,283	0	52,283	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,182

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-4,182,160,000	-2,788,106,667	-1,394,053,333	0	1,394,053,333	2,788,106,667	4,182,160,000
16.67%	-4,182,160,000	-2,788,106,667	-1,394,053,333	0	1,394,053,333	2,788,106,667	4,182,160,000
8.33%	-4,182,160,000	-2,788,106,667	-1,394,053,333	0	1,394,053,333	2,788,106,667	4,182,160,000
0%	-4,182,160,000	-2,788,106,667	-1,394,053,333	0	1,394,053,333	2,788,106,667	4,182,160,000
-8.33%	-4,182,160,000	-2,788,106,667	-1,394,053,333	0	1,394,053,333	2,788,106,667	4,182,160,000
-16.67%	-4,182,160,000	-2,788,106,667	-1,394,053,333	0	1,394,053,333	2,788,106,667	4,182,160,000
-25%	-4,182,160,000	-2,788,106,667	-1,394,053,333	0	1,394,053,333	2,788,106,667	4,182,160,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,516

# 펀드명 : 키움KOSF200선물인버스2X증권상장지수투자신탁[주식-파생형]

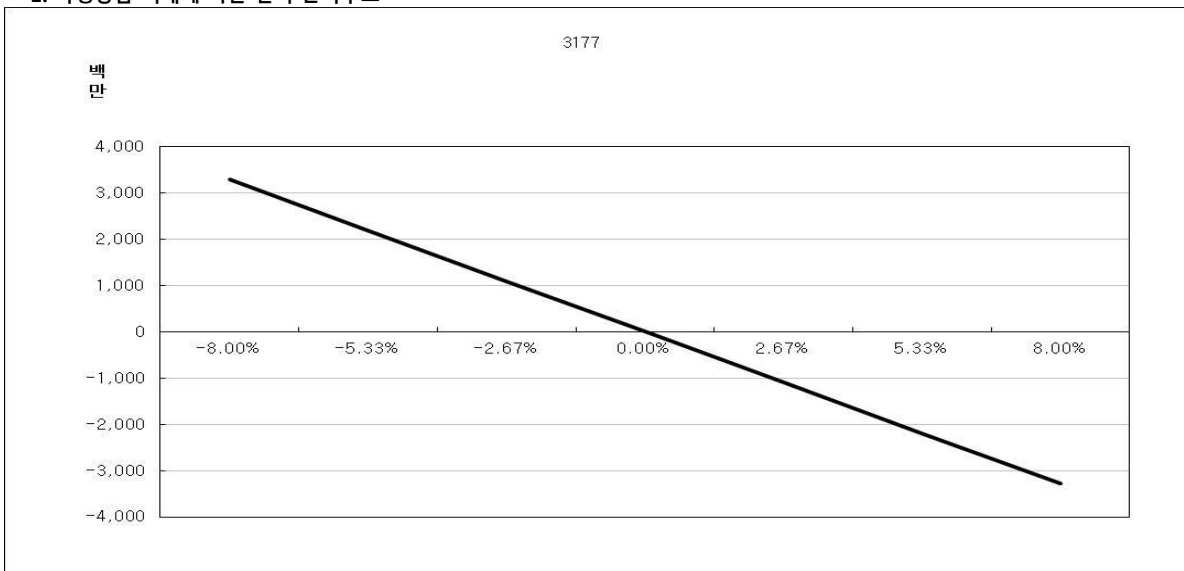
공시일: 2021-07-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	107	-107	장내
누계	주가지수	선물	0	18,749	-18,749	장내
합계			0	18,749	-18,749	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,500

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,499,750,000	999,833,333	499,916,667	0	-499,916,667	-999,833,333	-1,499,750,000
16.67%	1,499,750,000	999,833,333	499,916,667	0	-499,916,667	-999,833,333	-1,499,750,000
8.33%	1,499,750,000	999,833,333	499,916,667	0	-499,916,667	-999,833,333	-1,499,750,000
0%	1,499,750,000	999,833,333	499,916,667	0	-499,916,667	-999,833,333	-1,499,750,000
-8.33%	1,499,750,000	999,833,333	499,916,667	0	-499,916,667	-999,833,333	-1,499,750,000
-16.67%	1,499,750,000	999,833,333	499,916,667	0	-499,916,667	-999,833,333	-1,499,750,000
-25%	1,499,750,000	999,833,333	499,916,667	0	-499,916,667	-999,833,333	-1,499,750,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,619

# 펀드명 : Commodity인덱스특자\_모\_상품파생

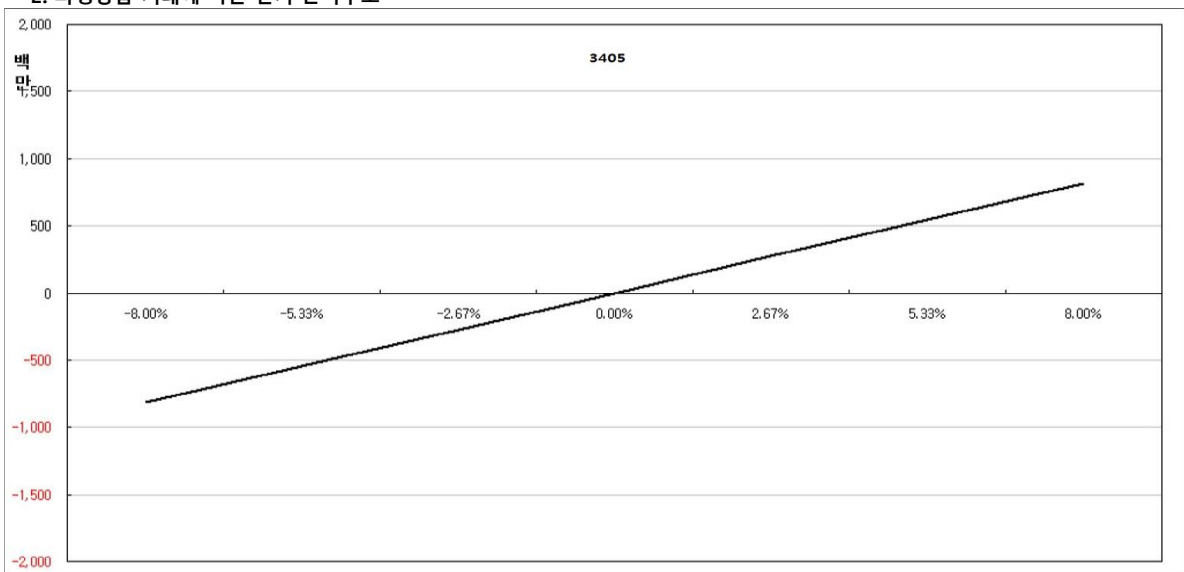
공시일: 2021-07-21

## 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	978	-978	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	2,818	0	2,818	장내
합계			2,818	978	1,840	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

129

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

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

314



## 펀드명 : 키움허어로즈유럽오피스부동산투자신탁제1호[파생형]

공시일: 2021-07-21

### 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)

1,504

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,503,604,411	1,501,539,292	1,499,474,135	1,497,408,940	1,495,343,706	1,493,278,434	1,491,213,124
16.67%	1,004,570,394	1,002,471,179	1,000,371,923	998,272,626	996,173,289	994,073,911	991,974,493
8.33%	505,536,376	503,403,065	501,269,711	499,136,313	497,002,873	494,869,389	492,735,862
0%	6,502,359	4,334,951	2,167,498	0	-2,167,544	-4,335,134	-6,502,769
-8.33%	-492,531,659	-494,733,162	-496,934,714	-499,136,313	-501,337,961	-503,539,656	-505,741,399
-16.67%	-991,565,676	-993,801,276	-996,036,926	-998,272,626	-1,000,508,377	-1,002,744,178	-1,004,980,030
-25%	-1,490,599,694	-1,492,869,390	-1,495,139,138	-1,497,408,940	-1,499,678,794	-1,501,948,701	-1,504,218,661

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

29

## 펀드명 : 키움하이로즈유럽오피스부동산투자신탁제2호[파생형]

공시일: 2021-07-21

### 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)

1,504

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,503,604,411	1,501,539,292	1,499,474,135	1,497,408,940	1,495,343,706	1,493,278,434	1,491,213,124
16.67%	1,004,570,394	1,002,471,179	1,000,371,923	998,272,626	996,173,289	994,073,911	991,974,493
8.33%	505,536,376	503,403,065	501,269,711	499,136,313	497,002,873	494,869,389	492,735,862
0%	6,502,359	4,334,951	2,167,498	0	-2,167,544	-4,335,134	-6,502,769
-8.33%	-492,531,659	-494,733,162	-496,934,714	-499,136,313	-501,337,961	-503,539,656	-505,741,399
-16.67%	-991,565,676	-993,801,276	-996,036,926	-998,272,626	-1,000,508,377	-1,002,744,178	-1,004,980,030
-25%	-1,490,599,694	-1,492,869,390	-1,495,139,138	-1,497,408,940	-1,499,678,794	-1,501,948,701	-1,504,218,661

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

29

## 펀드명 : 키움허어로즈유럽오피스부동산투자신탁제3호[파생형]

공시일: 2021-07-21

### 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)

1,504

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,503,604,411	1,501,539,292	1,499,474,135	1,497,408,940	1,495,343,706	1,493,278,434	1,491,213,124
16.67%	1,004,570,394	1,002,471,179	1,000,371,923	998,272,626	996,173,289	994,073,911	991,974,493
8.33%	505,536,376	503,403,065	501,269,711	499,136,313	497,002,873	494,869,389	492,735,862
0%	6,502,359	4,334,951	2,167,498	0	-2,167,544	-4,335,134	-6,502,769
-8.33%	-492,531,659	-494,733,162	-496,934,714	-499,136,313	-501,337,961	-503,539,656	-505,741,399
-16.67%	-991,565,676	-993,801,276	-996,036,926	-998,272,626	-1,000,508,377	-1,002,744,178	-1,004,980,030
-25%	-1,490,599,694	-1,492,869,390	-1,495,139,138	-1,497,408,940	-1,499,678,794	-1,501,948,701	-1,504,218,661

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

29

## 펀드명 : 키움하이로즈유럽오피스부동산투자신탁제4호[파생형]

공시일: 2021-07-21

### 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)

1,504

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	1,503,604,411	1,501,539,292	1,499,474,135	1,497,408,940	1,495,343,706	1,493,278,434	1,491,213,124
16.67%	1,004,570,394	1,002,471,179	1,000,371,923	998,272,626	996,173,289	994,073,911	991,974,493
8.33%	505,536,376	503,403,065	501,269,711	499,136,313	497,002,873	494,869,389	492,735,862
0%	6,502,359	4,334,951	2,167,498	0	-2,167,544	-4,335,134	-6,502,769
-8.33%	-492,531,659	-494,733,162	-496,934,714	-499,136,313	-501,337,961	-503,539,656	-505,741,399
-16.67%	-991,565,676	-993,801,276	-996,036,926	-998,272,626	-1,000,508,377	-1,002,744,178	-1,004,980,030
-25%	-1,490,599,694	-1,492,869,390	-1,495,139,138	-1,497,408,940	-1,499,678,794	-1,501,948,701	-1,504,218,661

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

29