

# 펀드명 : KB스타 베트남 VN30 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

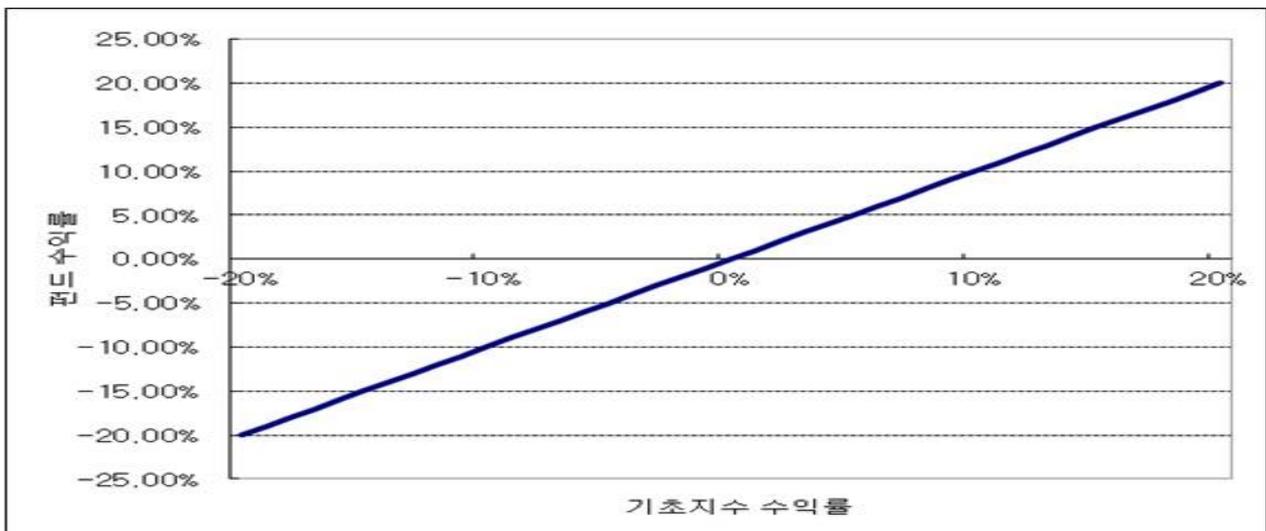
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	16,445	-16,445	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	9,077	0	9,077	장내
합계			9,077	16,445	-7,367	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB스타 베트남 VN30 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)



본 펀드는 기초지수(VN30지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,394

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,170

# 펀드명 : KB스타 KRX300 인덱스 증권 투자신탁(주식-파생형)(운용)

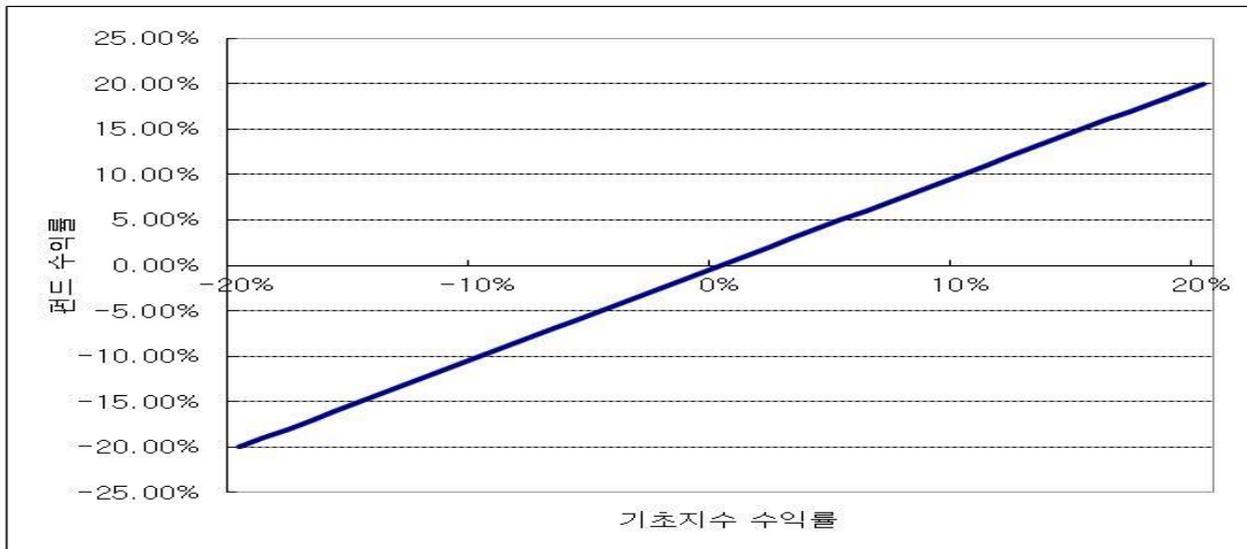
공시일: 2020-10-20

## 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	934	0	934	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	44	0	44	장내
합계			978	0	978	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KRX 300 index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

69

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

125

# 펀드명 : KB 액티브 인베스터 증권 모투자신탁(주식혼합-파생형)

공시일: 2020-10-20

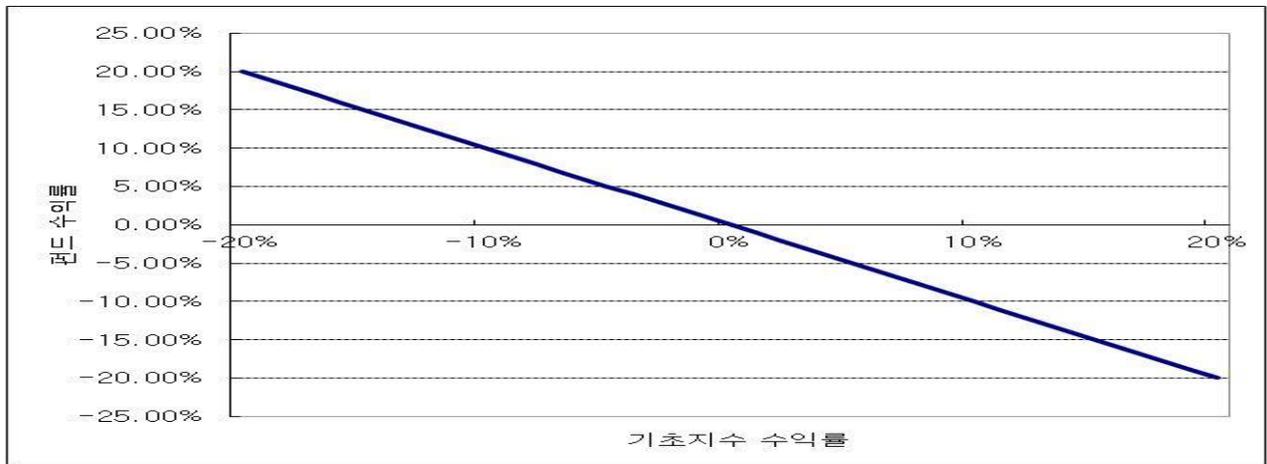
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	313	-313	장내
누계	주가지수	선물	0	2,579	-2,579	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	92	-92	장내
합계			0	2,671	-2,671	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB 액티브 인베스터 증권 모투자신탁(주식혼합-파생형)(코드-26A0)



본 펀드는 주식 시황에 따라 주식편입비율을 탄력적으로 조정하는 전략을 수행하는 펀드로 파생상품을 활용한 주요전략은 지수 선물 및 개별주식 선물 매도이며, 기초지수(지수 및 개별주식)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

206

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

346

# 펀드명 : KB스타차이나H인덱스증권 모[주식-파생형]

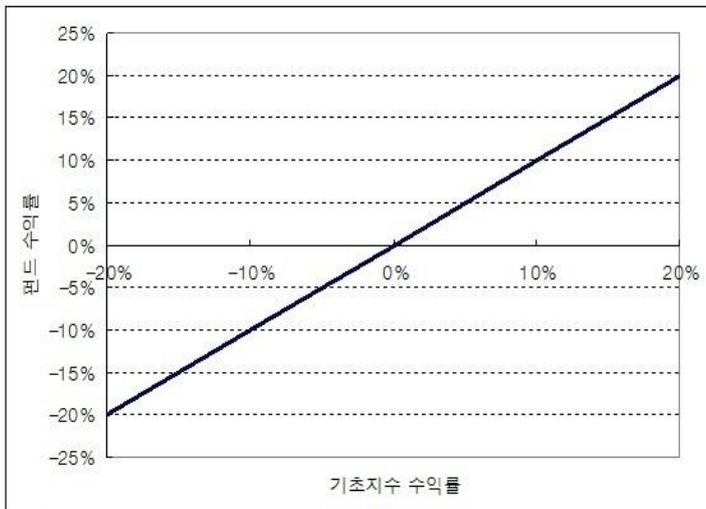
공시일: 2020-10-20

## 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	61,312	0	61,312	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	26,391	0	26,391	장외
합계			87,703	0	87,703	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(HSCEI지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

9,407

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5,748

# 펀드명 : KB스타 미국S&P500인덱스모[주식파생형]

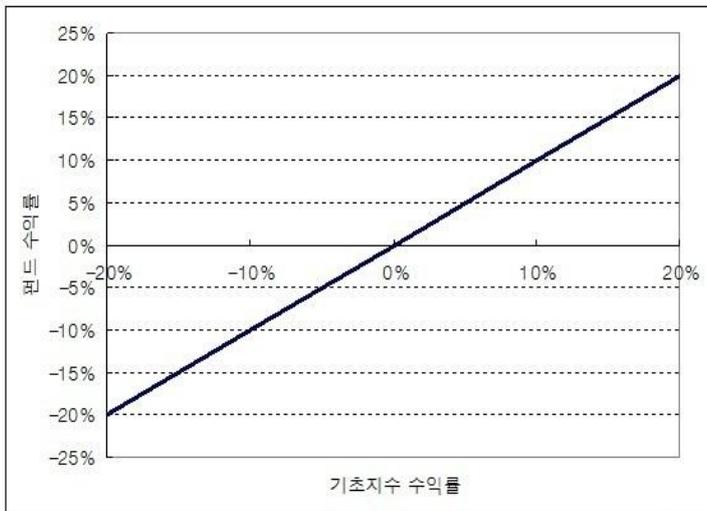
공시일: 2020-10-20

## 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	34,500	-34,500	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	82,184	0	82,184	장내
합계			82,184	34,500	47,685	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(미국S&P500지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

12,608

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13,012

# 펀드명 : KB스타 코리아리버스인덱스(주식파생형)(운용)

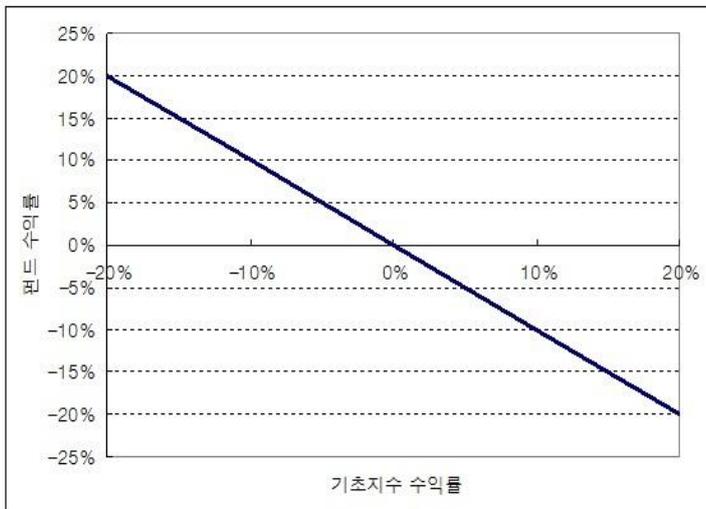
공시일: 2020-10-20

## 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	46,967	-46,967	장내
합계			0	46,967	-46,967	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KOSPI200지수)의 등락률에 따라 일간으로 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제 수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

3,756

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6,138

# 펀드명 : KB스타 중국본토 CSI300 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)

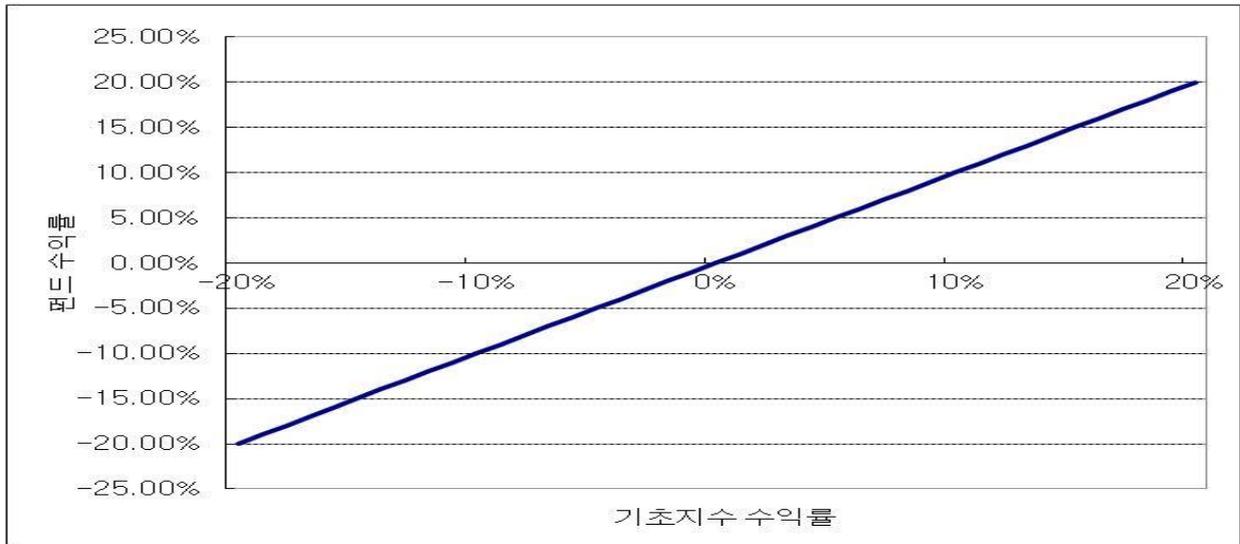
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	17,017	16,656	360	장내
누계	주가지수	선물	17,017	0	17,017	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	30,211	0	30,211	장외
합계			47,227	0	47,227	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(CSI300 index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

2,598

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,715

# 펀드명 : KB 중국본토 A주 레버리지 모(주식-파생재간접)

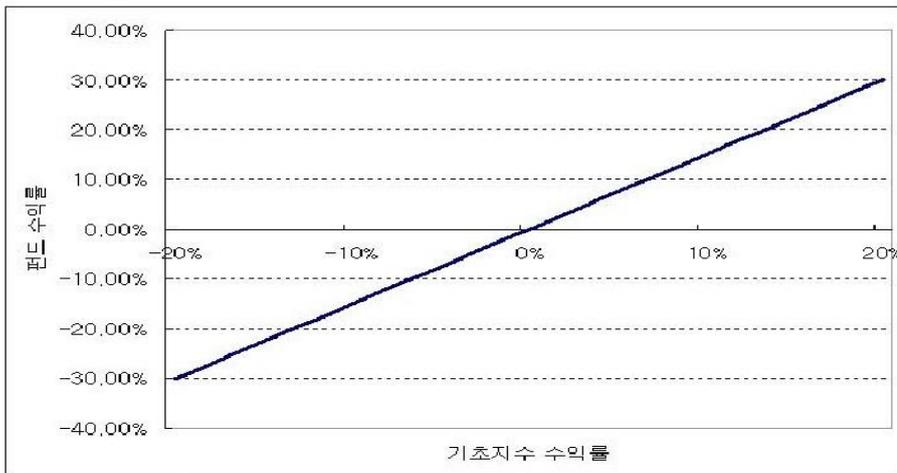
공시일: 2020-10-20

## 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	71,843	-71,843	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	79,752	0	79,752	장내
합계			79,752	71,843	7,909	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(FTSE China A50지수)의 등락률에 따라 일간으로 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

12,226

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7,785

# 펀드명 : KB스타 코리아 레버리지1.5 증권(주식-파생형)(운용)

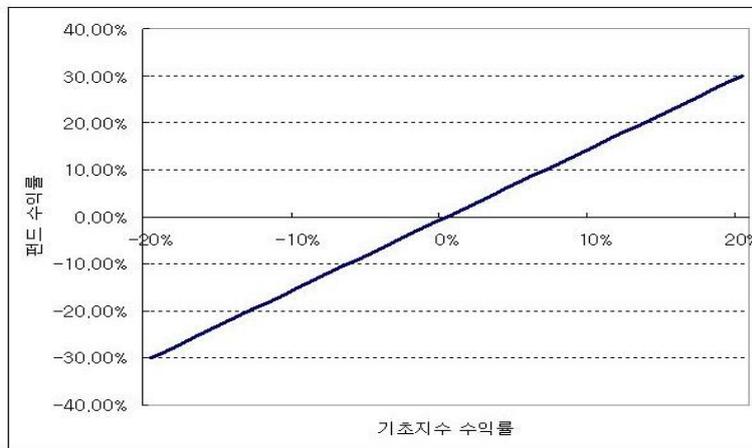
공시일: 2020-10-20

## 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	5,627	0	5,627	장내
합계			5,627	0	5,627	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KOSPI200지수)의 등락률에 따라 일간으로 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

450

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

735

# 펀드명 : KB스타 코리아 레버리지2.0 증권(주식-파생형)(운용)

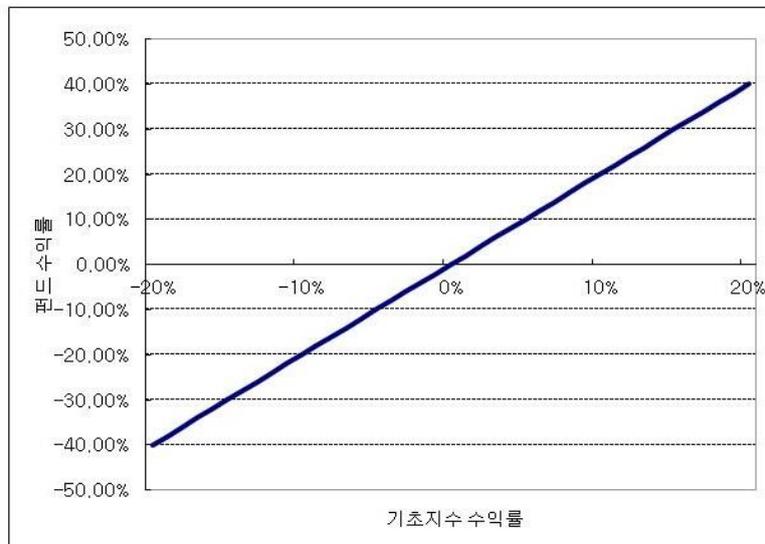
공시일: 2020-10-20

## 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	158,483	0	158,483	장내
합계			158,483	0	158,483	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KOSPI200지수)의 등락률에 따라 일간으로 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

12,673

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

20,713

# 펀드명 : KB 고배당 커버드콜 증권 투자신탁(주식혼합-파생형)(운용)

공시일: 2020-10-20

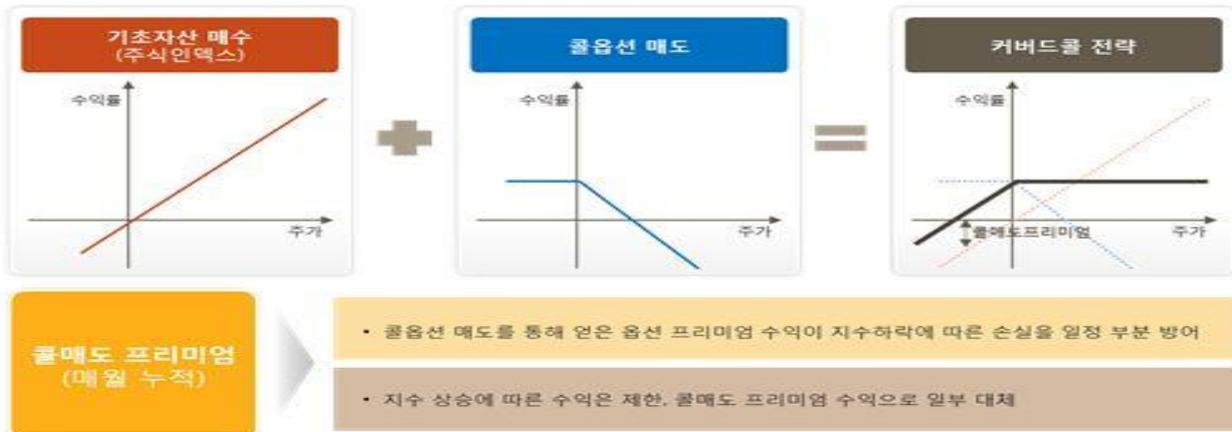
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	625	0	625	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	180	0	180	장내
합계			805	0	805	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB 고배당 커버드콜 증권 투자신탁(주식혼합-파생형)(운용) 수익구조



본 펀드는 고배당주 포트폴리오를 매수하고 KOSPI200지수 콜옵션을 매도하여 위의 커버드콜 전략을 수행함에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, KOSPI200 포트폴리오를 매수하는 대신 고배당주 포트폴리오에 투자하므로 실제 수익률은 두 포트폴리오의 차이로 인해 위 그래프와 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

50

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

106

# 펀드명 : KB 유로 커버드콜 증권 투자신탁(주식혼합-파생형)(운용)

공시일: 2020-10-20

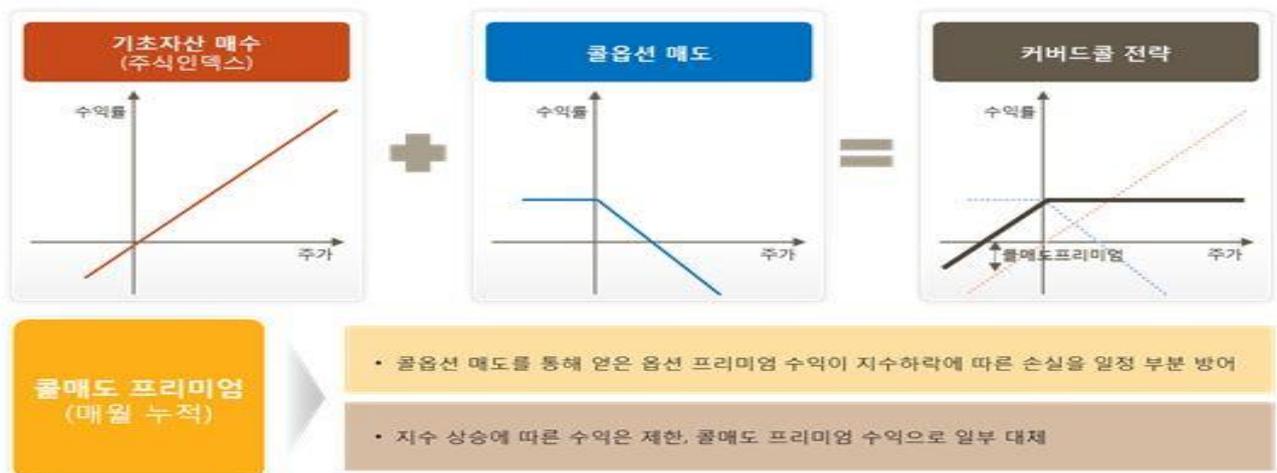
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	608	0	608	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	549	0	549	장외
합계			1,157	0	1,157	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB 유로 커버드콜 증권 투자신탁(주식혼합-파생형)(운용) 수익구조



본 펀드는 EURO STOXX 50지수 선물을 매수하고 EURO STOXX 50지수 콜옵션을 매도하여 위의 커버드콜 전략을 수행함에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

93

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

88

# 펀드명 : KB스타 코스닥150 인덱스 증권 모(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

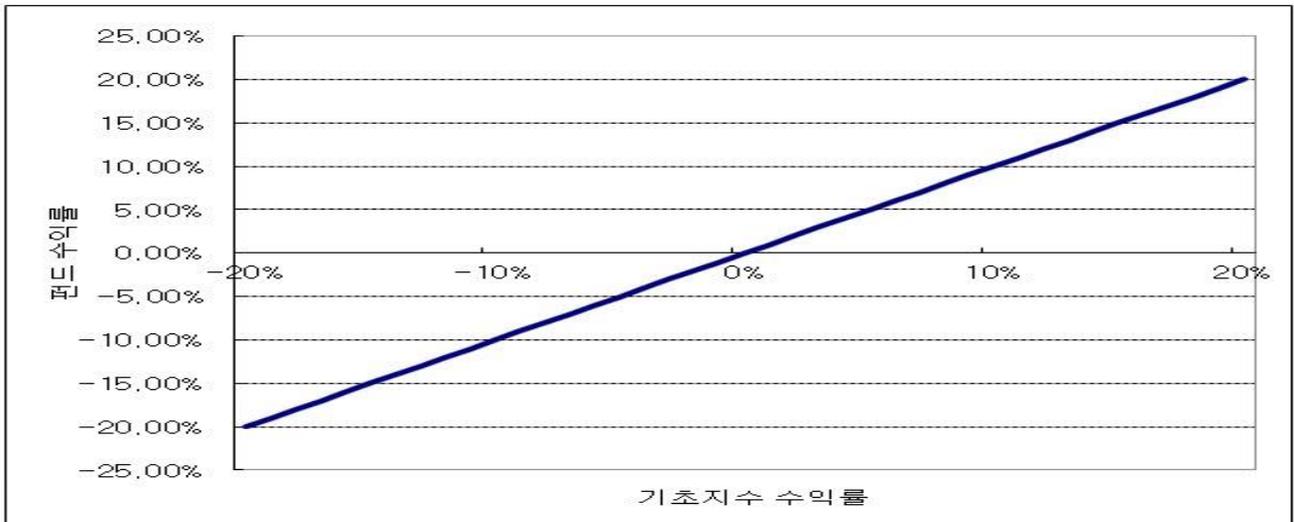
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	97,833	0	97,833	장내
합계			97,833	0	97,833	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB스타 코스닥150 인덱스 증권 모투자신탁 수익구조



본 펀드는 기초지수(코스닥150 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

7,691

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15,892

# 펀드명 : KB 코리아 인버스 2배 레버리지 증권(주식-파생재간접형)(운용)

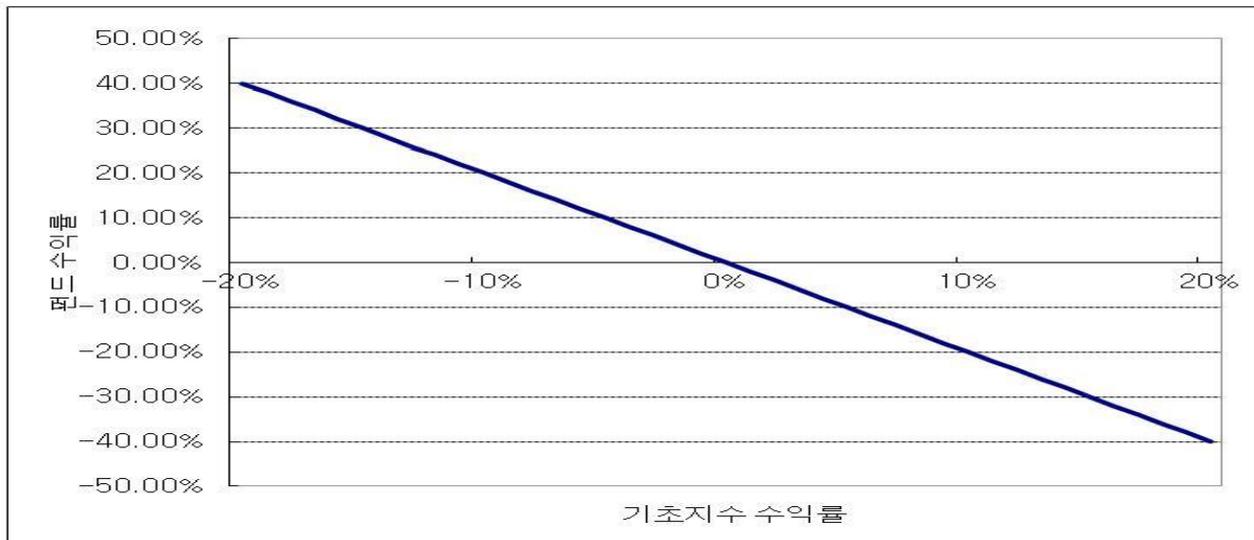
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,048	0	3,048	장내
누계	주가지수	선물	0	30,712	-30,712	장내
합계			0	30,712	-30,712	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(F-KOSPI200 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

2,456

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,014

# 펀드명 : KB 차이나 H 인버스 인덱스 증권(주식-파생형)(운용)

공시일: 2020-10-20

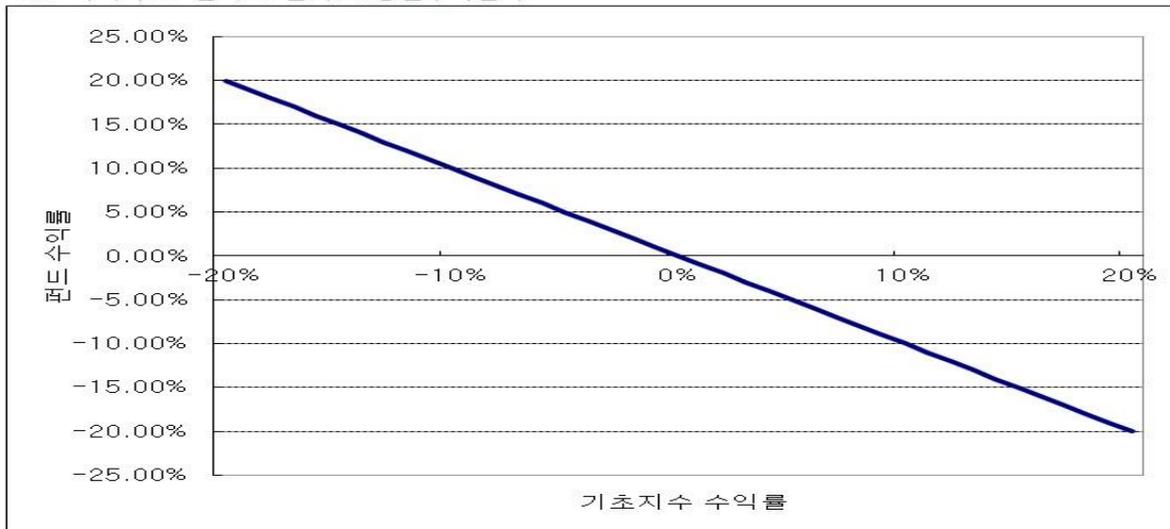
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	1,470	0	1,470	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	575	0	575	장외
합계			2,046	0	2,046	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB 차이나 H 인버스 인덱스 증권투자신탁



본 펀드는 기초지수(HSCEI 선물지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

226

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

143

# 펀드명 : KB스타 이머징 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

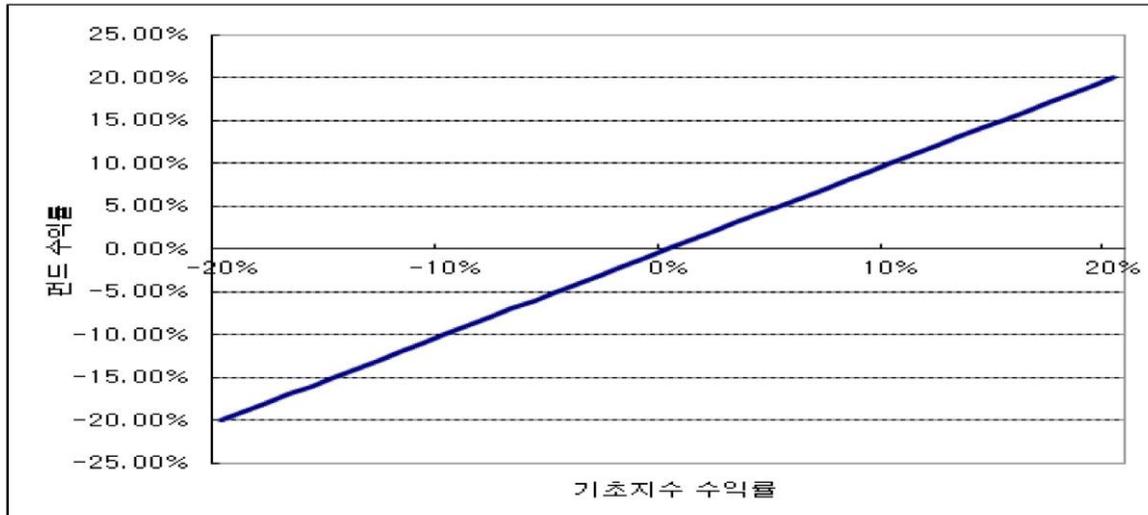
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	2,170	-2,170	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	5,343	0	5,343	장내
합계			5,343	2,170	3,173	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB스타 이머징 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)



본 펀드는 기초지수(MSCI Emerging Markets Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

816

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

517

# 펀드명 : KB스타 미국 나스닥 100 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

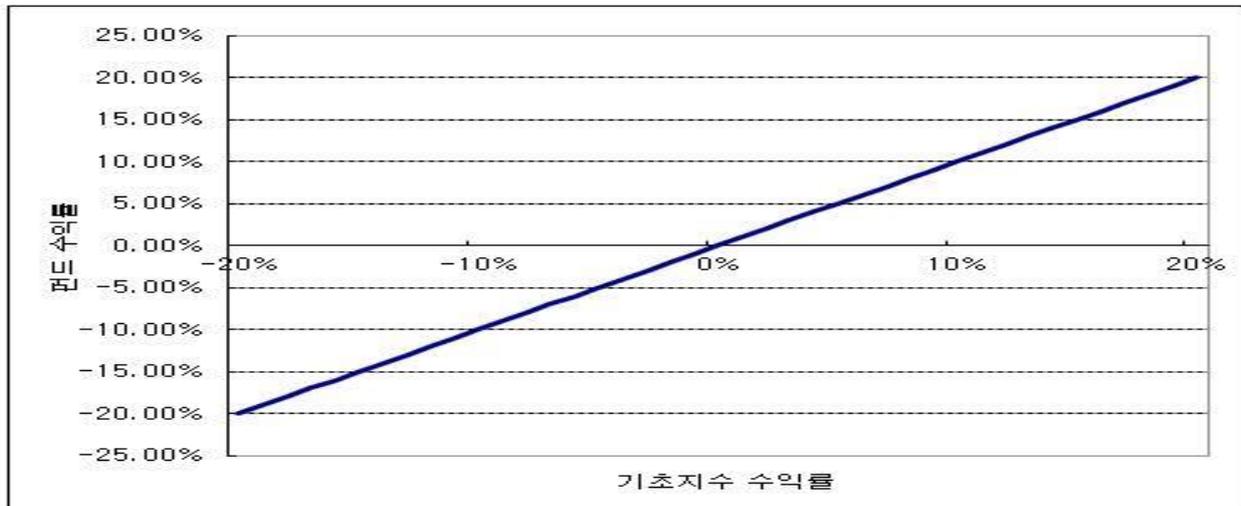
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	17,918	-17,918	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	43,314	0	43,314	장내
합계			43,314	17,918	25,396	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB스타 미국 나스닥 100 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)



본 펀드는 기초지수(Nasdaq 100 Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,662

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7,201

# 펀드명 : KB스타 파워 한국 인덱스 증권 투자신탁(주식-파생형)(운용)

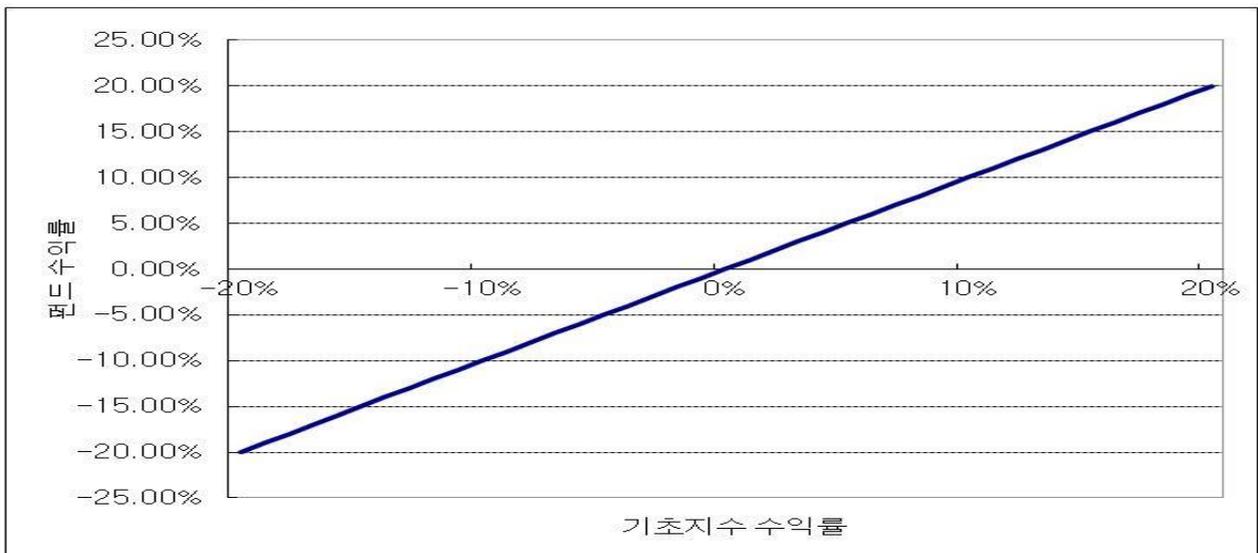
공시일: 2020-10-20

## 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	78	0	78	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	174	0	174	장내
합계			252	0	252	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KOSPI200 index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

# 펀드명 : KB스타코리아인덱스(주식-파생형)(운용)

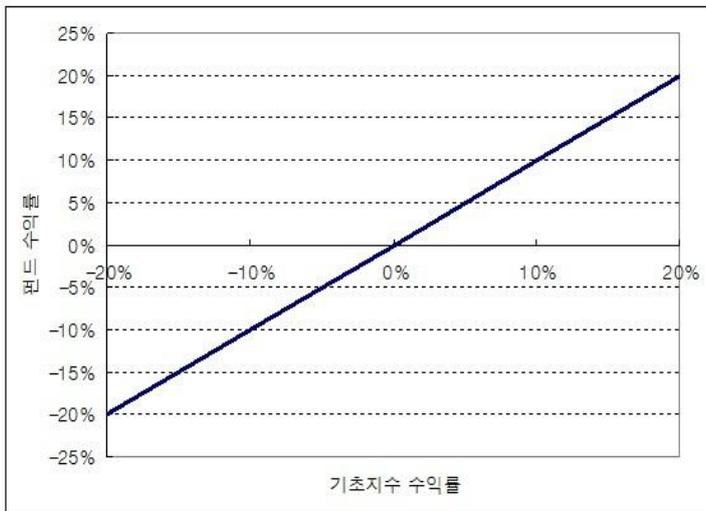
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	391	0	391	장내
누계	주가지수	선물	5,627	499	5,128	장내
합계			5,627	499	5,128	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(KOSPI200지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용 결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

450

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

671

# 펀드명 : KB스타 재팬 인덱스 증권 모(주식-파생형)

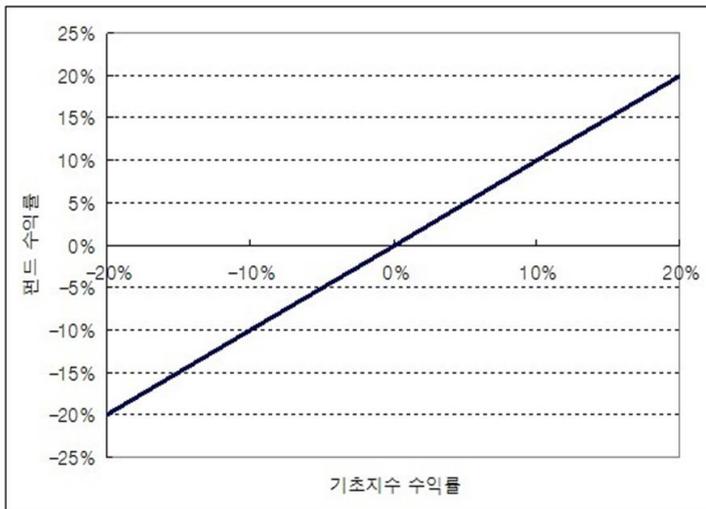
공시일: 2020-10-20

## 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	10,644	0	10,644	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	9,145	0	9,145	장외
합계			19,789	0	19,789	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(Nikkei225지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,633

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,043

# 펀드명 : KB스타 골드(금-파생형)(운용)

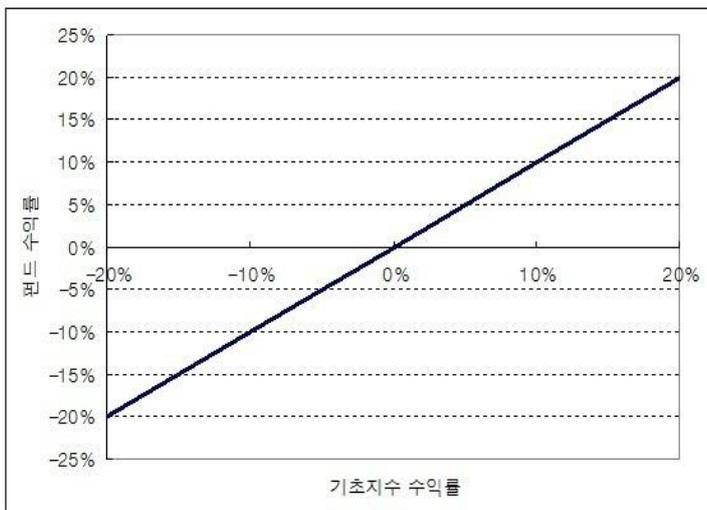
공시일: 2020-10-20

## 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	5,025	-5,025	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	60,673	0	60,673	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	11,166	0	11,166	장외
합계			71,840	5,025	66,815	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(S&P GSCI Gold 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

9,356

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,399

# 펀드명 : KB스타 유로 인덱스 증권 모(주식-파생형)

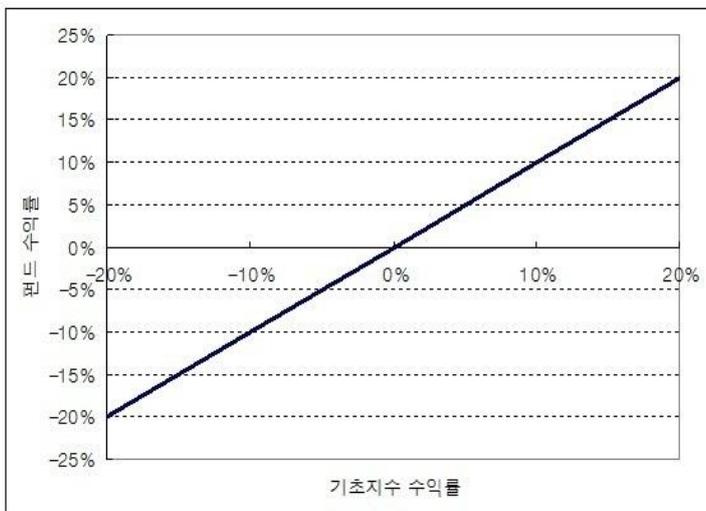
공시일: 2020-10-20

## 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	20,140	0	20,140	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	10,602	0	10,602	장외
합계			30,742	0	30,742	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(DJ Euro Stoxx50 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

3,087

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,860

# 펀드명 : KB 원자재 특별자산 모투자신탁[상품파생형]

공시일: 2020-10-20

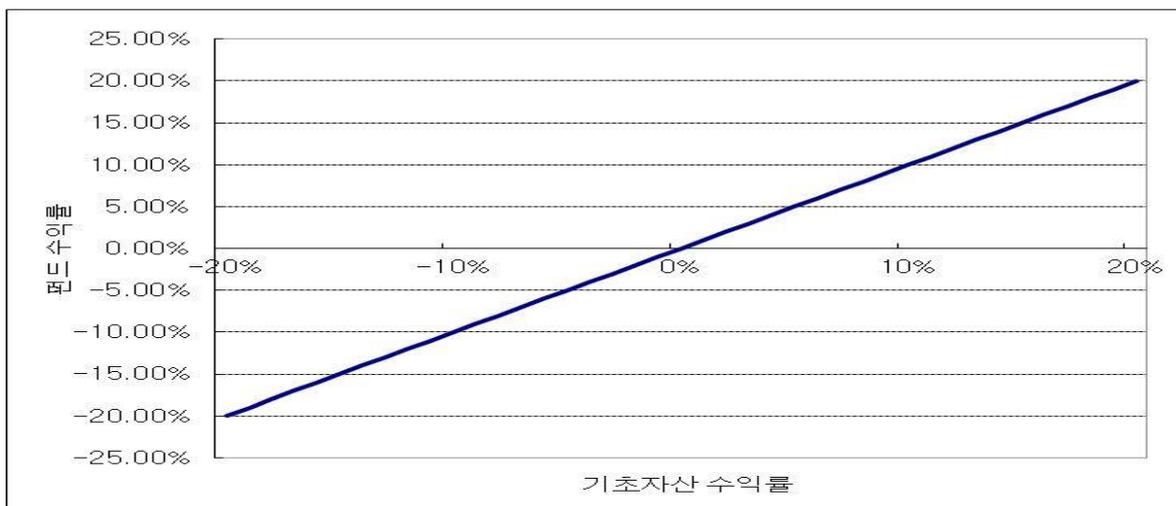
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	1,245	-1,245	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	3,026	0	3,026	장내
합계			3,026	1,245	1,781	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB 원자재 특별자산 모투자신탁(상품파생형)(코드-3C31)



본 펀드는 기초자산(금, 구리 등 Commodity)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

101

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

428

# 펀드명 : KB KStar 주식혼합 증권 ETF

공시일: 2020-10-20

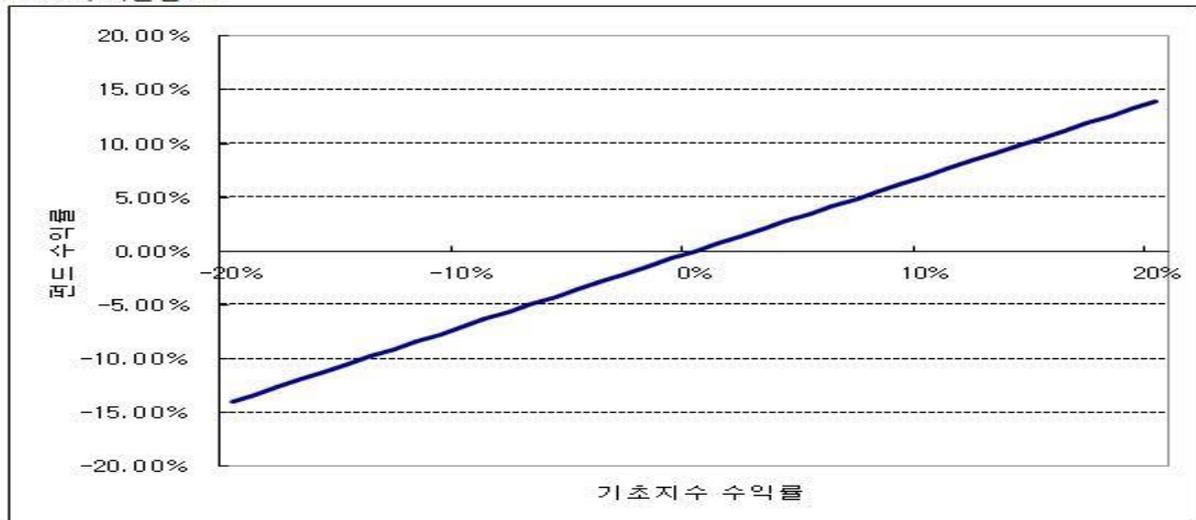
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	224	0	224	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	300	0	300	장내
합계			524	0	524	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KStar 주식혼합ETF



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(KOSPI200)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44

# 펀드명 : KB KStar 채권혼합 증권 ETF

공시일: 2020-10-20

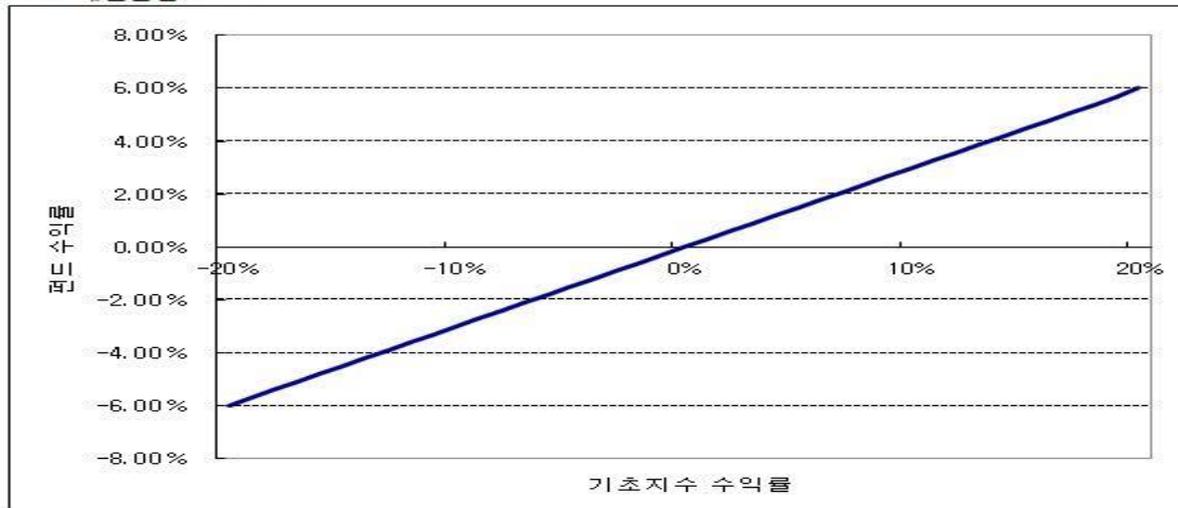
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	224	0	224	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	180	0	180	장내
합계			404	0	404	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KStar 채권혼합 ETF



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(KOSPI200)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

27

# 펀드명 : KB KStar 미국원유생산기업 ETF(주식-파생형)(합성H)

공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	40,610	0	40,610	장외
합계			40,610	0	40,610	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 수익자의 가입시점 이후 기초지수(S&P Oil & Gas Exploration & Production Select Industry Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 같은 수익구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제 수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

3,249

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13,309

# 펀드명 : KB KBSTAR 차이나H주 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)(H)

공시일: 2020-10-20

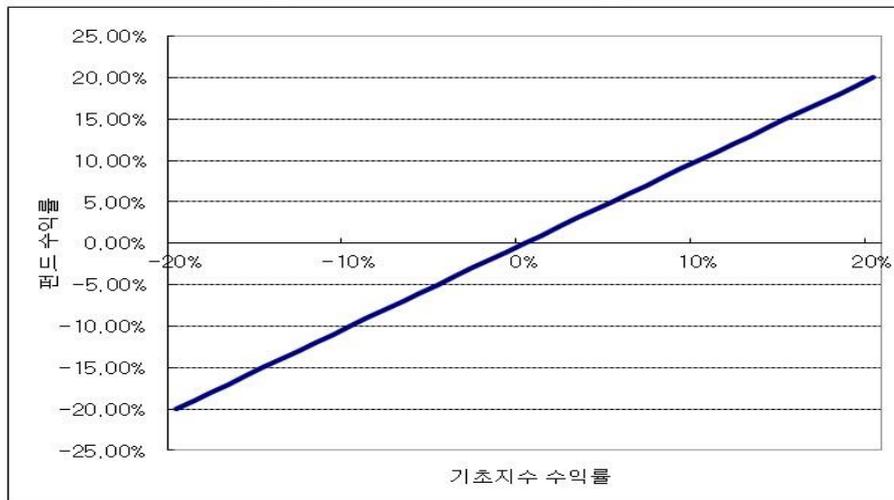
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	735	0	735	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	6,189	0	6,189	장외
합계			6,924	0	6,924	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR 차이나H주 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)(H) 수익구조



본 펀드는 기초지수(HSCEI Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

113

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

294

# 펀드명 : KB KBSTAR 200선물레버리지 증권상장지수(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

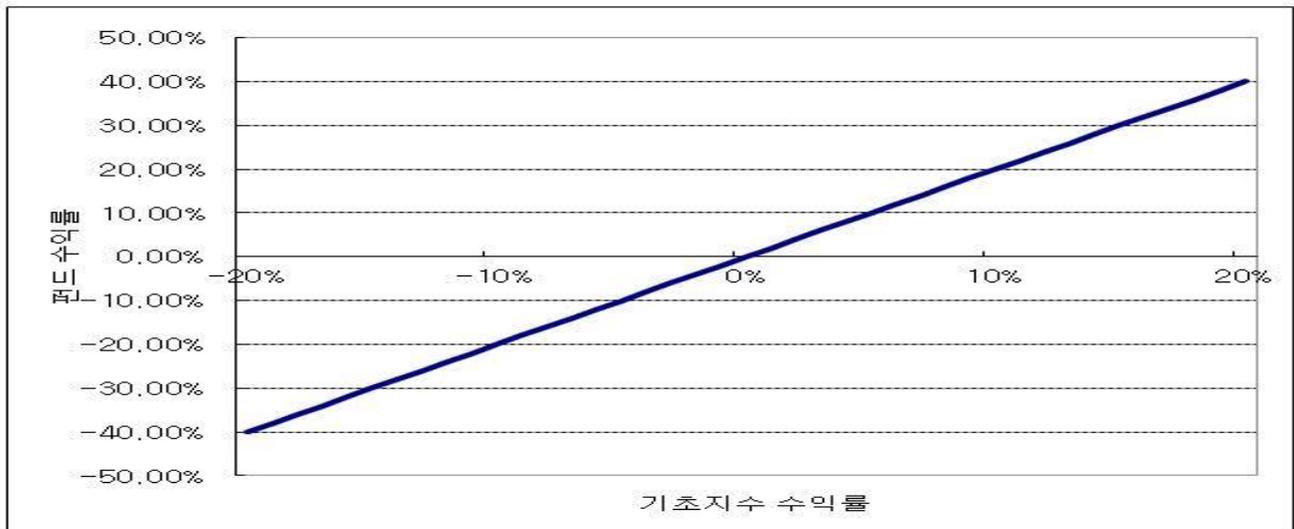
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	78	0	78	장내
누계	주가지수	선물	80,101	0	80,101	장내
합계			80,101	0	80,101	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR 200선물레버리지 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)



본 펀드는 기초지수(F-KOSPI200)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

6,405

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10,469

# 펀드명 : KB KBSTAR 200선물인버스 증권 상장지수(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

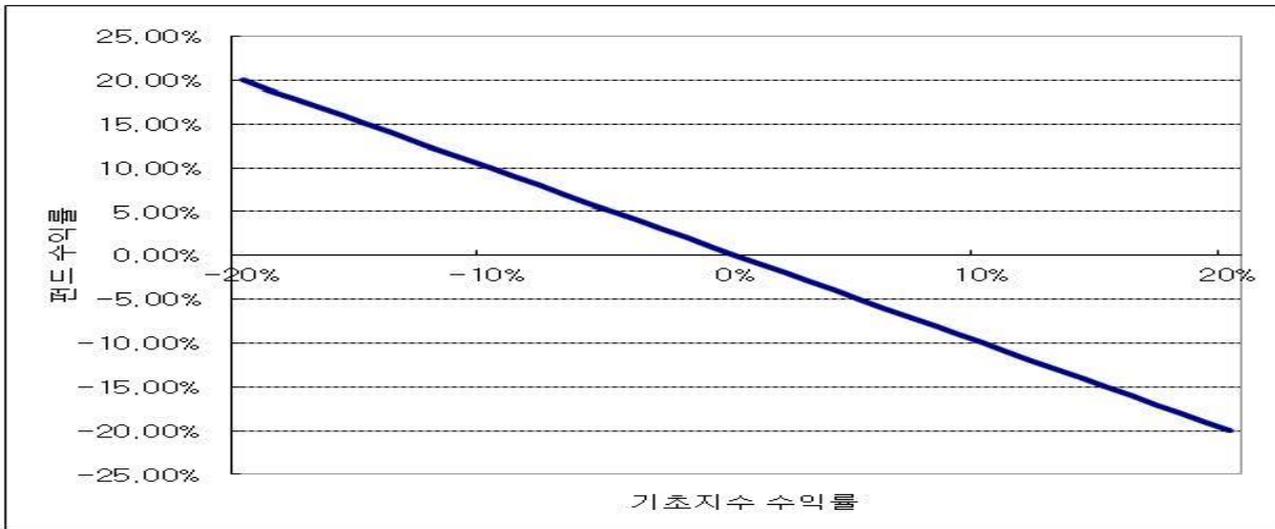
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	4,689	-4,689	장내
합계			0	4,689	-4,689	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR 200선물인버스 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)



본 펀드는 기초지수(F-KOSPI200)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

375

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

613

# 펀드명 : KB KBSTAR 200선물인버스2X 증권상장지수(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

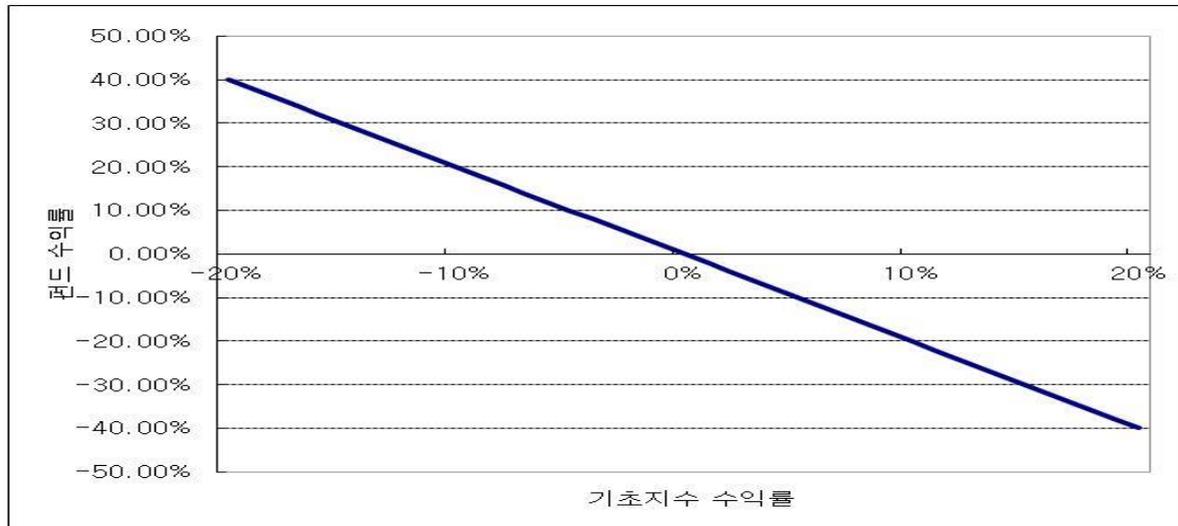
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	234	0	234	장내
누계	주가지수	선물	0	67,910	-67,910	장내
합계			0	67,910	-67,910	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR 200선물인버스2X 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)



본 펀드는 기초지수(F-KOSPI200)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

5,430

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8,876

펀드명 : KB KBSTAR 미국장기국채선물 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생형)(H

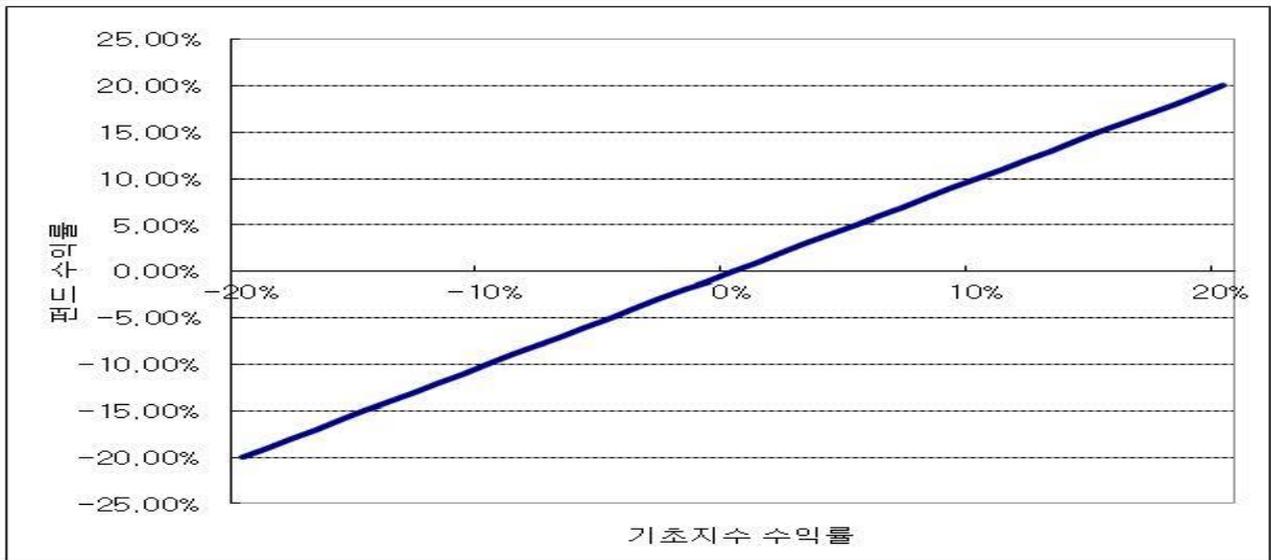
공시일: 2020-10-20

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	5,381	0	5,381	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	3,083	0	3,083	장외
합계			8,464	0	8,464	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(S&P 30Y US TBOND FUT ER INDEX)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

826

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

353

# 명 : KB KBSTAR 미국장기국채선물 인버스 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생형)

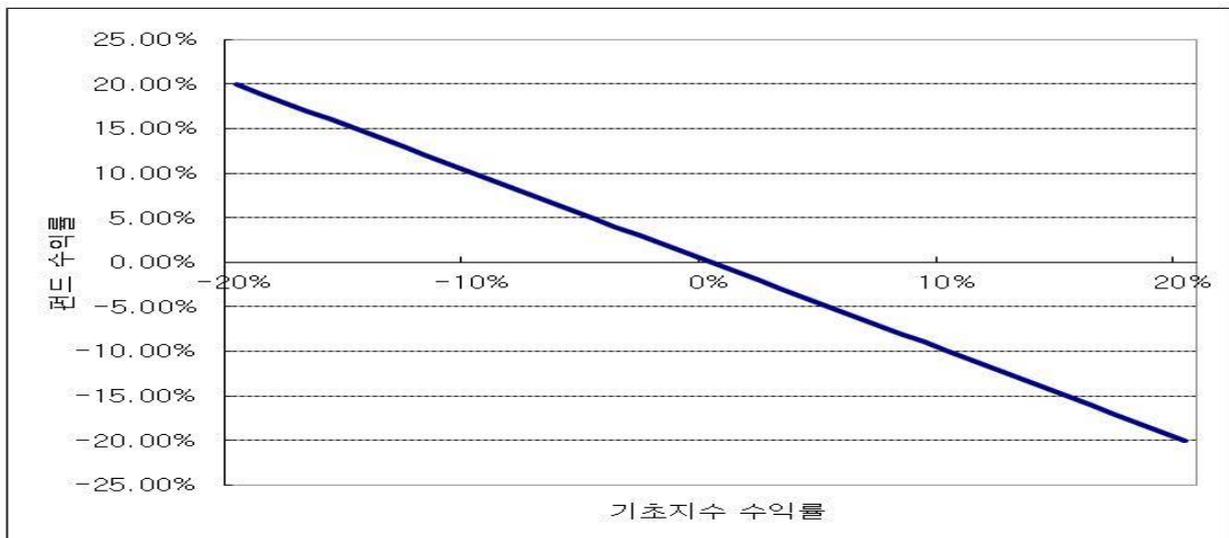
공시일: 2020-10-20

## 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	3,188	0	3,188	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	1,827	0	1,827	장외
합계			5,016	0	5,016	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(S&P US TBOND FUT ER INDEX)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

490

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

209

# 형 : KB KBSTAR 미국장기국채선물 레버리지 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생)

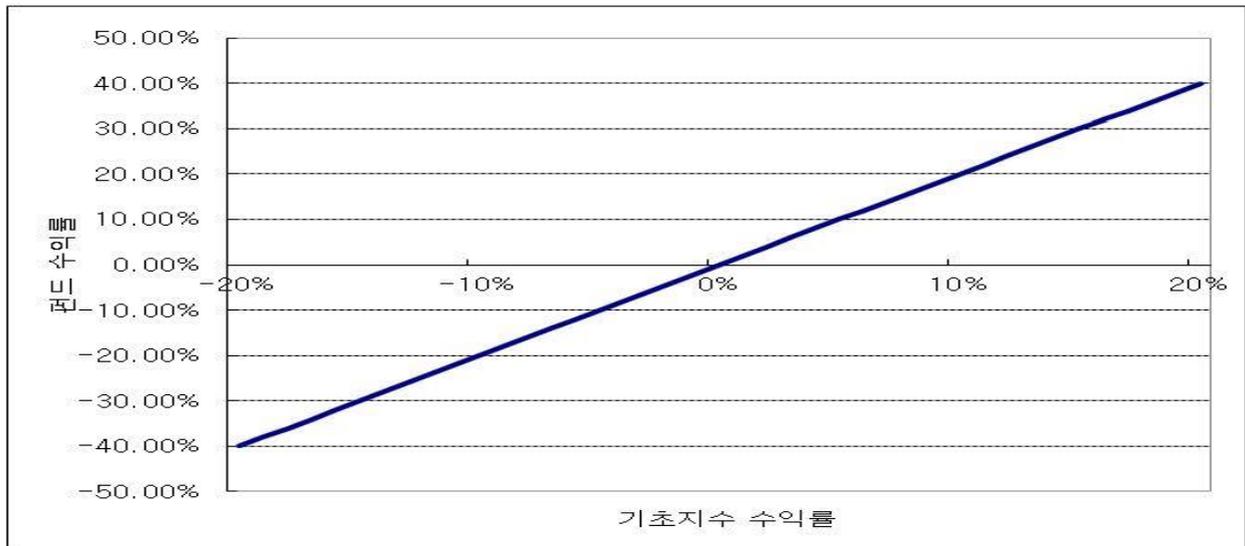
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	7,150	0	7,150	장외
합계			7,150	0	7,150	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(S&P US TBOND FUT ER INDEX)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

572

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

975

# KB KBSTAR 미국장기국채선물 인버스2X 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생

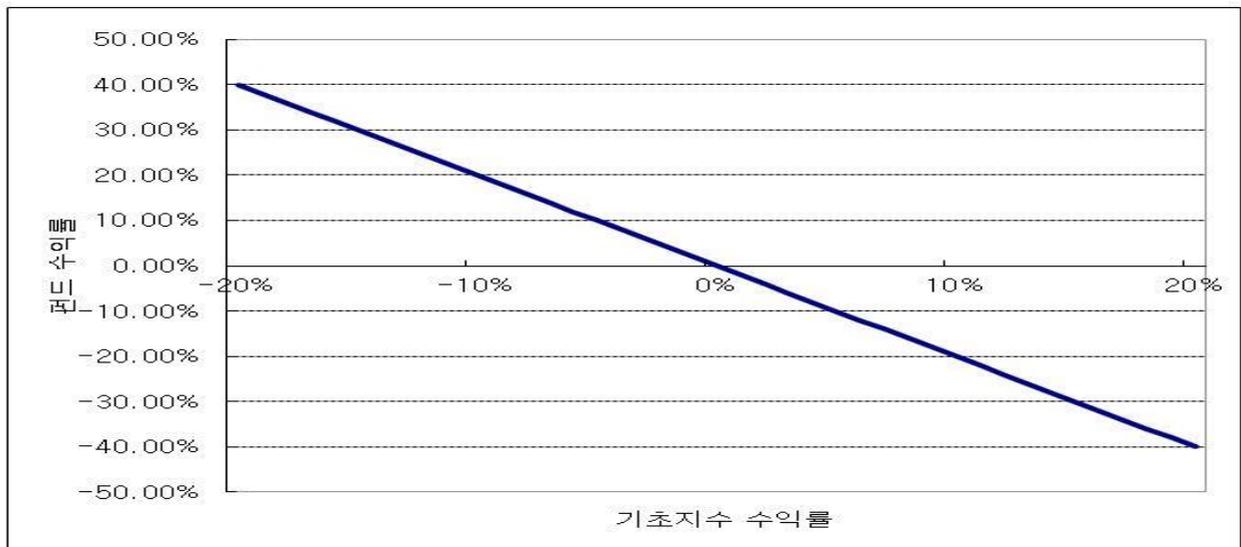
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	2,686	0	2,686	장외
합계			2,686	0	2,686	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(S&P US TBOND FUT ER INDEX)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

215

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

320

# 펀드명 : KB KBSTAR 코스닥150선물인버스증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)

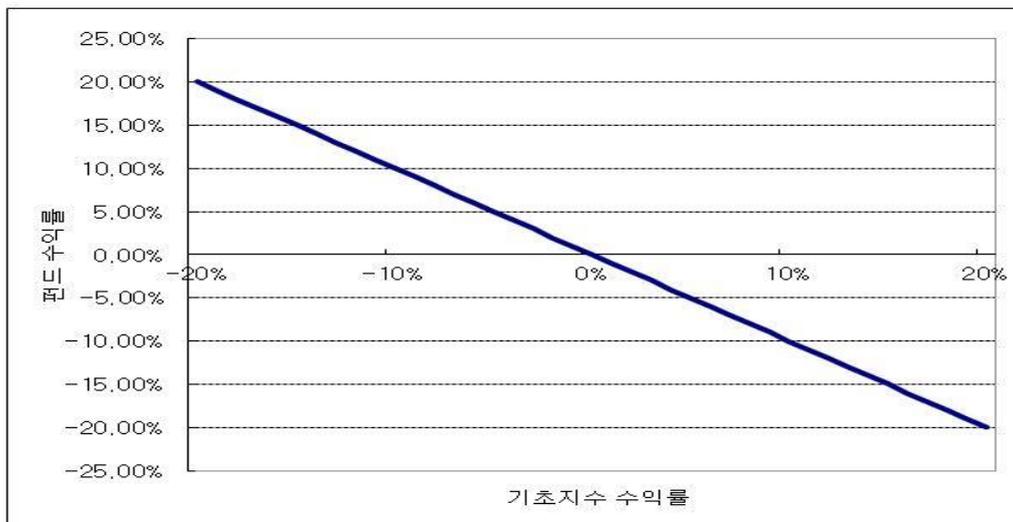
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	162	-162	장내
누계	주가지수	선물	0	6,258	-6,258	장내
합계			0	6,258	-6,258	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(F-코스닥 150 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

492

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,017

# 상품명 : KB KBSTAR 글로벌 4차산업 IT 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)(합성)

공시일: 2020-10-20

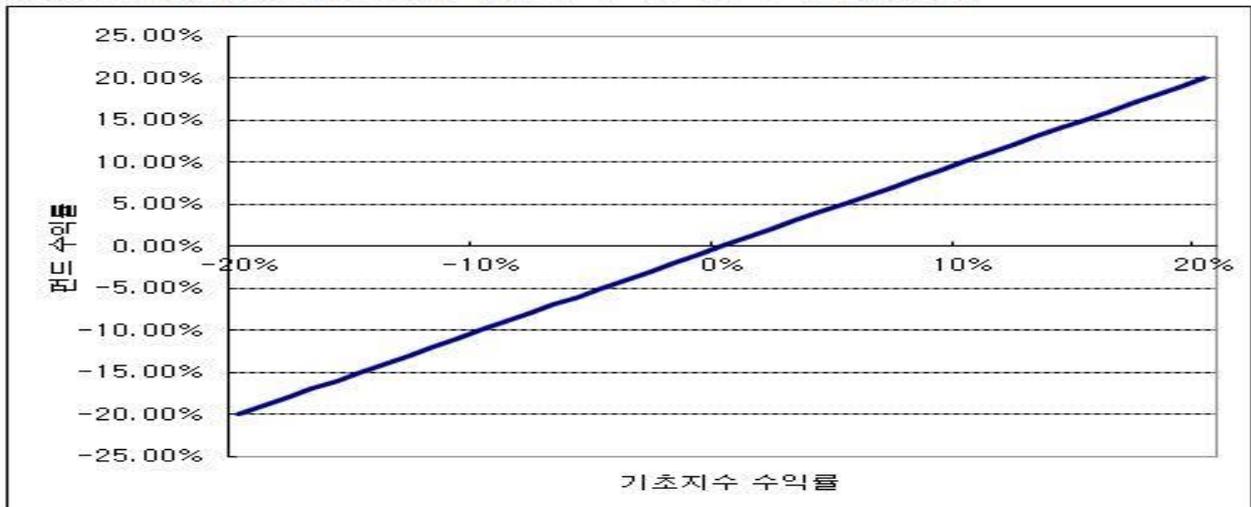
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	8,101	0	8,101	장외
합계			8,101	0	8,101	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR 글로벌 4차산업 IT 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형) (합성H)



본 펀드는 목표전환 전까지 기초지수(S&P Global 1200 Information Technology Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

648

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,273

# 펀드명 : KB KBSTAR 코스닥150선물레버리지 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생)

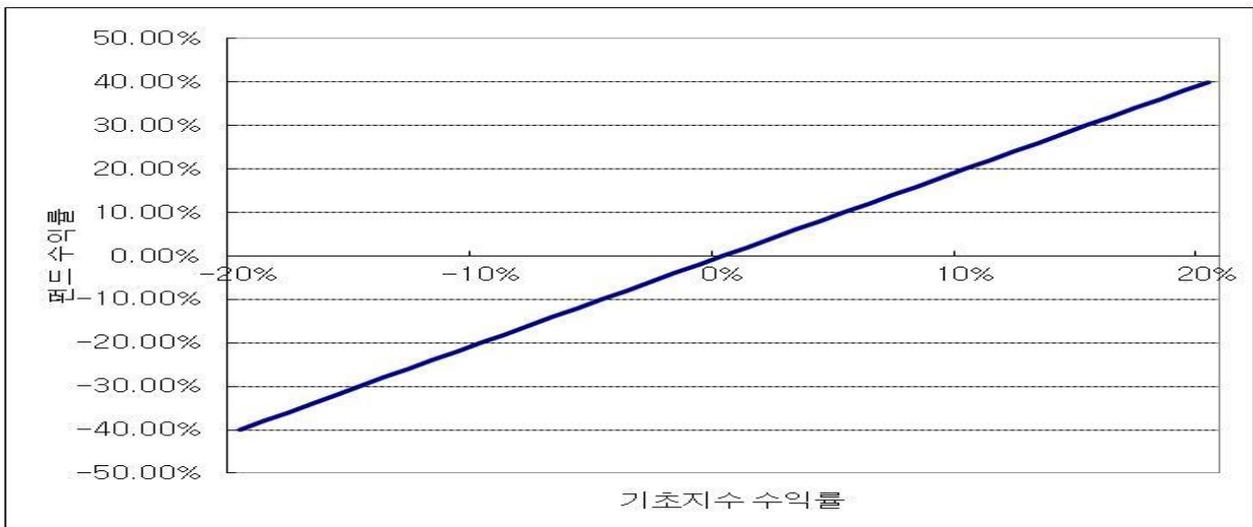
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	3,989	-3,989	장내
누계	주가지수	선물	301,017	0	301,017	장내
합계			301,017	0	301,017	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(F-코스닥 150 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

23,664

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

48,898

# 펀드명 : KB KBSTAR 국고채3년선물 인버스 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생형)

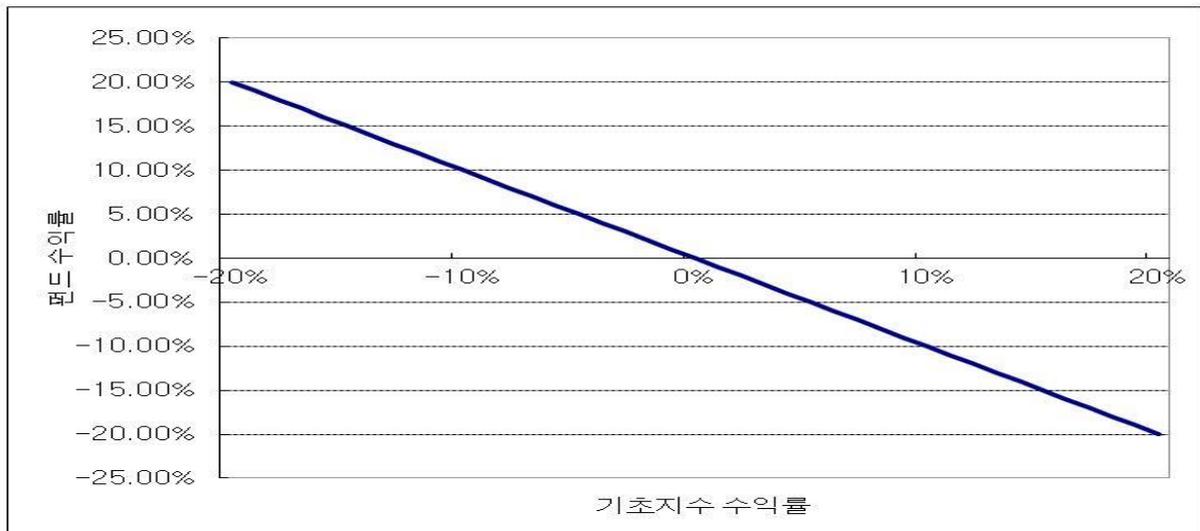
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	99,797	-99,797	장내
누계	유가증권	선물	0	282,049	-282,049	장내
합계			0	282,049	-282,049	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(F-KTB Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

22,580

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,913

# 펀드명 : KB KBSTAR 200 고배당 커버드콜 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)

공시일: 2020-10-20

## 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	313	0	313	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	188	0	188	장내
합계			501	0	501	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



\* 코스피200고배당커버드콜ATM지수는 ATM 콜옵션 매도로 OTM 콜옵션 매도 보다 높은 프리미엄 수익과 고배당 포트폴리오를 보유하여 코스피200 대비 높은 배당수익률을 추구합니다.  
 \* 일반적으로 ATM에 가까울수록 OTM보다 옵션 프리미엄을 높일 수 있는 장점이 있는 반면, 추가 상승시 수익률 상승효과에 따른 참여율이 떨어진다는 단점이 있습니다.  
 \* 따라서, OTM 콜옵션 매도 보다 추가 상승시 수익률은 다소 낮을 수 있으며, 대신 높은 배당수익과 옵션매도 프리미엄으로 시장지수 대비 낮은 변동성으로 안정적인 인컴 수익을 추구합니다.

본 펀드는 고배당주 포트폴리오를 매수하고 KOSPI 200지수 콜옵션을 매도하여 위의 커버드콜 전략을 수행함에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 이 투자신탁은 주식 매수(국내 고배당주)와 콜옵션 매도(KOSPI200 지수) 부문의 기초지수가 서로 다르므로 상기 예상 수익구조와 이 투자신탁의 성과 간에 차이가 크게 발생할 수 있으며 옵션 롤오버 및 시장상황 등에 따라 상기 예상 수익구조와 이 투자신탁의 성과 간에 차이가 크게 발생할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

66

# 드명 : KB KBSTAR 차이나H선물인버스 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형)(K)

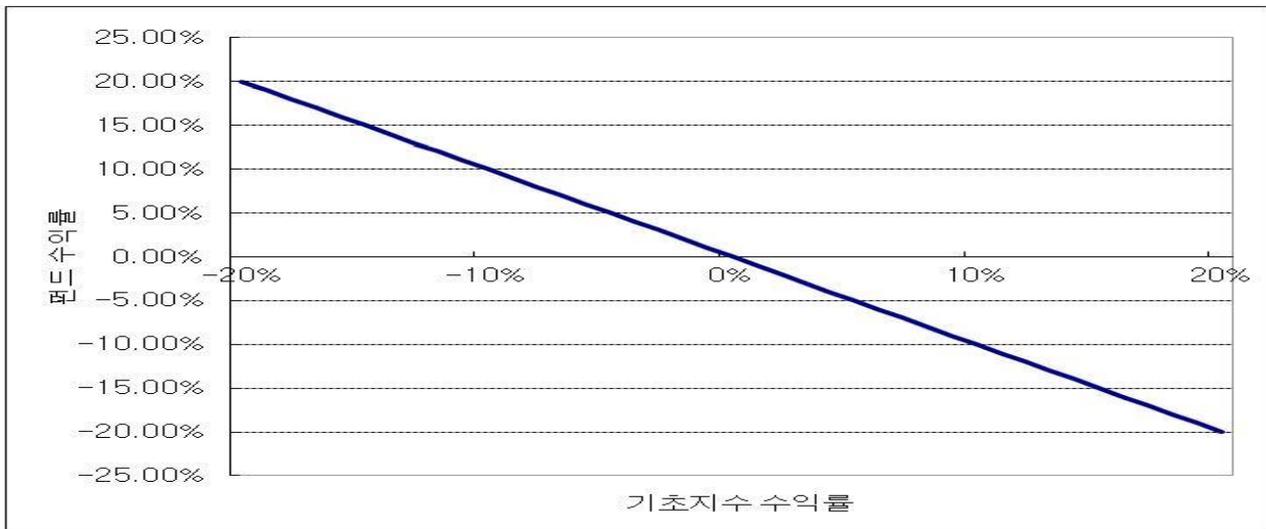
공시일: 2020-10-20

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	147	-147	장내
누계	주가지수	선물	4,926	0	4,926	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	1,768	0	1,768	장외
합계			6,694	0	6,694	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(Hang Seng China enterprises futures index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

756

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

475

# 펀드명 : KB KBSTAR 국채선물10년 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생형)

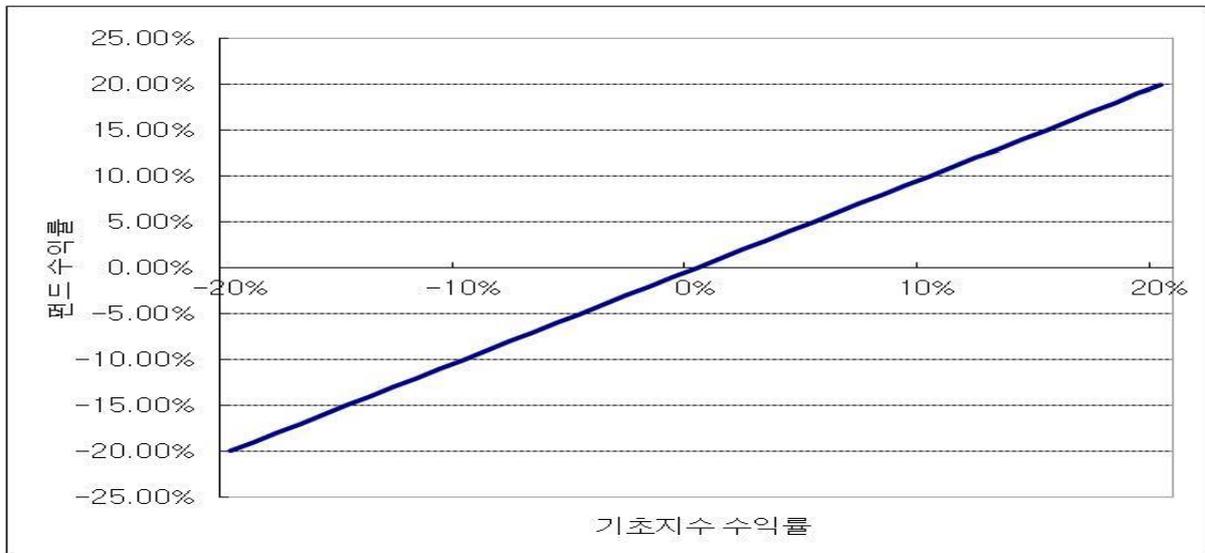
공시일: 2020-10-20

## 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	17,736	0	17,736	장내
합계			17,736	0	17,736	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(10년 국채선물지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,427

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

439

펀드명 : KB KBSTAR 국채선물10년 인버스 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생형)

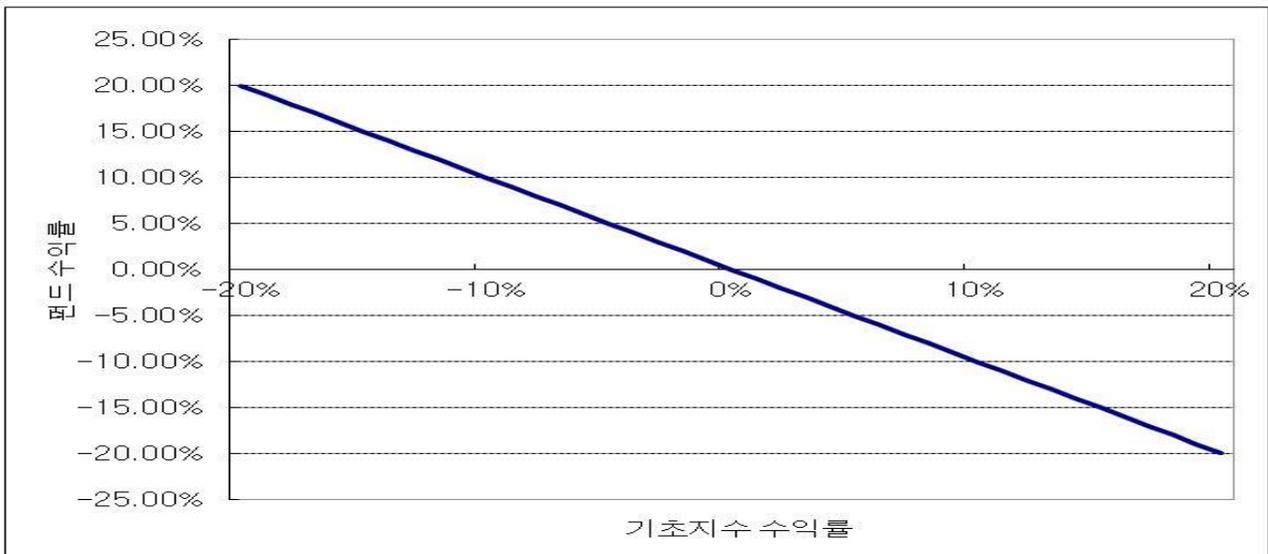
공시일: 2020-10-20

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	0	3,706	-3,706	장내
합계			0	3,706	-3,706	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(10년 국채선물지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

298

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

92

펀드명 : KB KBSTAR KRX300레버리지 증권 상장지수 투자신탁(주식-주식파생형)

공시일: 2020-10-20

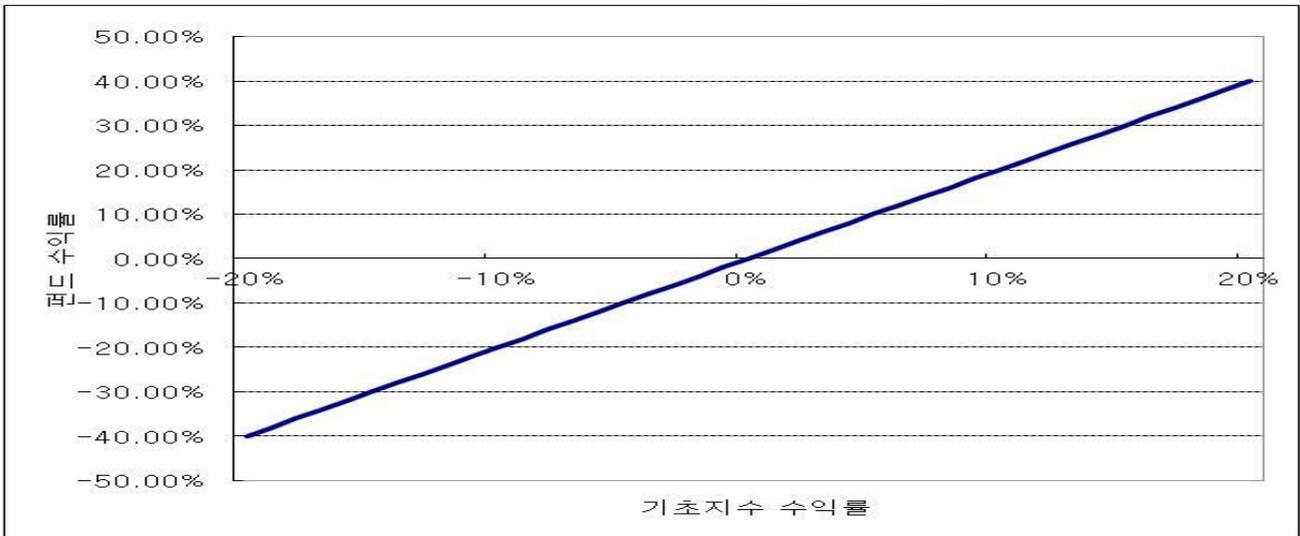
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	7,722	0	7,722	장내
합계			7,722	0	7,722	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR KRX 300레버리지 증권 상장지수 투자신탁(주식-주식파생형)



본 펀드는 기초지수(KRX 300 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

618

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,010

# 펀드명 : KB KBSTAR KRX300선물 인버스 증권 상장지수 투자신탁(주식-주식파생

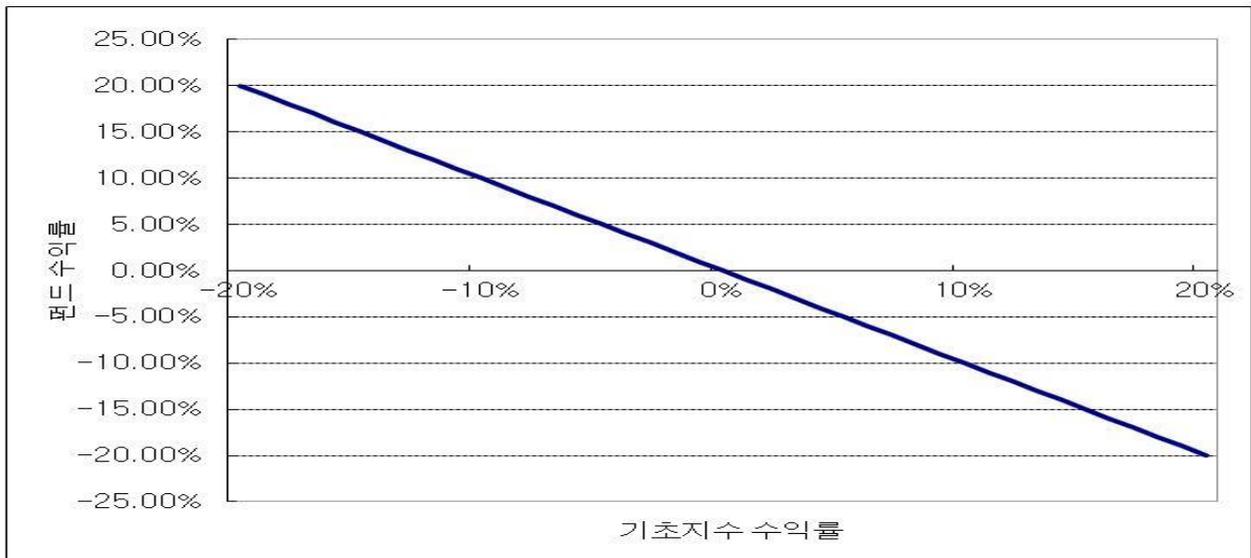
공시일: 2020-10-20

## 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	3,753	-3,753	장내
합계			0	3,753	-3,753	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(F-KRX 300 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

300

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

491

# 펀드명 : KB KBSTAR 중국 MSCI China 증권상장지수투자신탁(주식-파생형)(H)

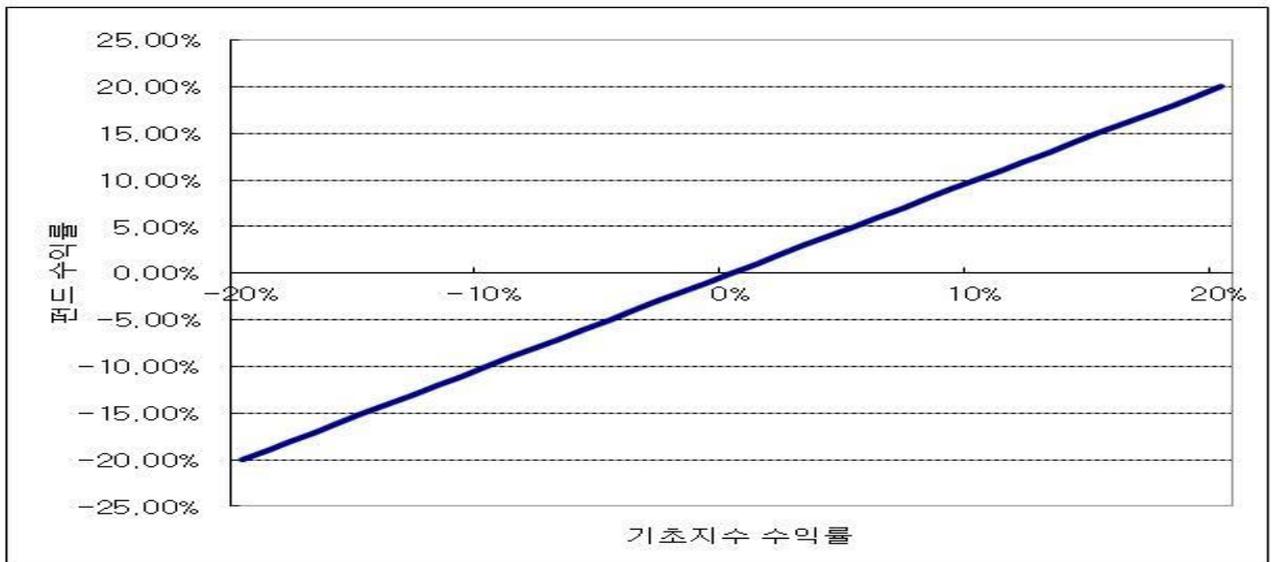
공시일: 2020-10-20

## 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	12,441	0	12,441	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	4,111	0	4,111	장외
합계			16,553	0	16,553	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(MSCI China NTR 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다. ↗

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

0

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

178

# 펀드명 : KB KBSTAR KRX300미국달러선물 혼합자산 상장지수 투자신탁(혼합-파생)

공시일: 2020-10-20

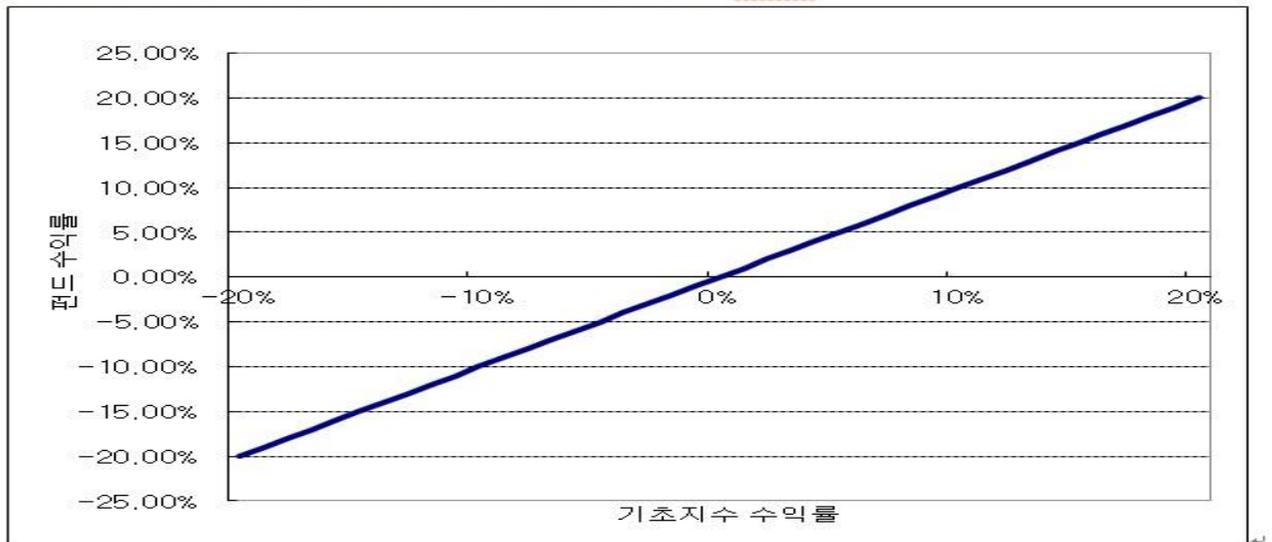
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	7,289	0	7,289	장내
신규	통화	선물	0	34	-34	장내
누계	통화	선물	8,108	0	8,108	장내
합계			15,397	0	15,397	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR KRX300 미국달러선물혼합자산 상장지수(혼합-파생형)



본 펀드는 기초지수(KRX300 미국달러 선물혼합 지수)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

649

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

729

# 펀드명 : KB KBSTAR 팔라듐선물 특별자산 상장지수 투자신탁(파생형)(H)

공시일: 2020-10-20

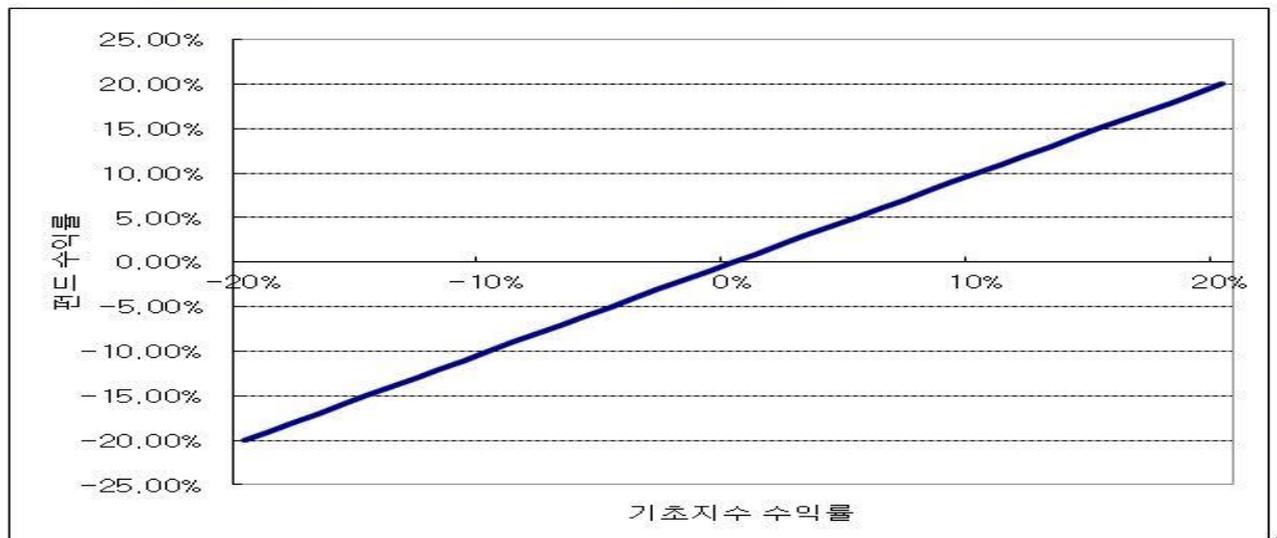
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	3,255	-3,255	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	5,632	0	5,632	장내
합계			5,632	3,255	2,377	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR 팔라듐선물 특별자산 상장지수 투자신탁(파생형)(H)\*



본 펀드는 기초지수(S&P GSCI Palladium Excess Return Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다. \*

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

868

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,430

# 펀드명 : KB KBSTAR 팔라듐선물인버스 특별자산 상장지수 투자신탁(파생형)(H)

공시일: 2020-10-20

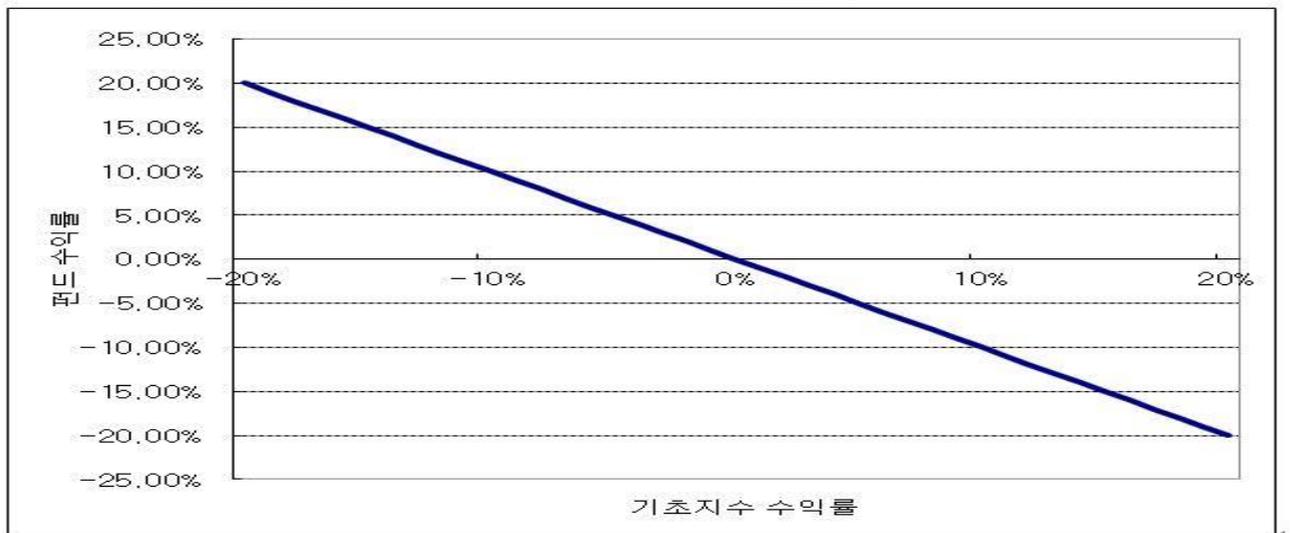
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	742	-742	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	4,023	0	4,023	장내
합계			4,023	742	3,280	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

KB KBSTAR 팔라듐선물인버스 특별자산 상장지수 투자신탁(파생형)(H)



본 펀드는 기초지수(S&P GSCI Palladium Excess Return Index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

620

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,016

# : KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 스티프너 증권 상장지수 투자신탁(채권-고

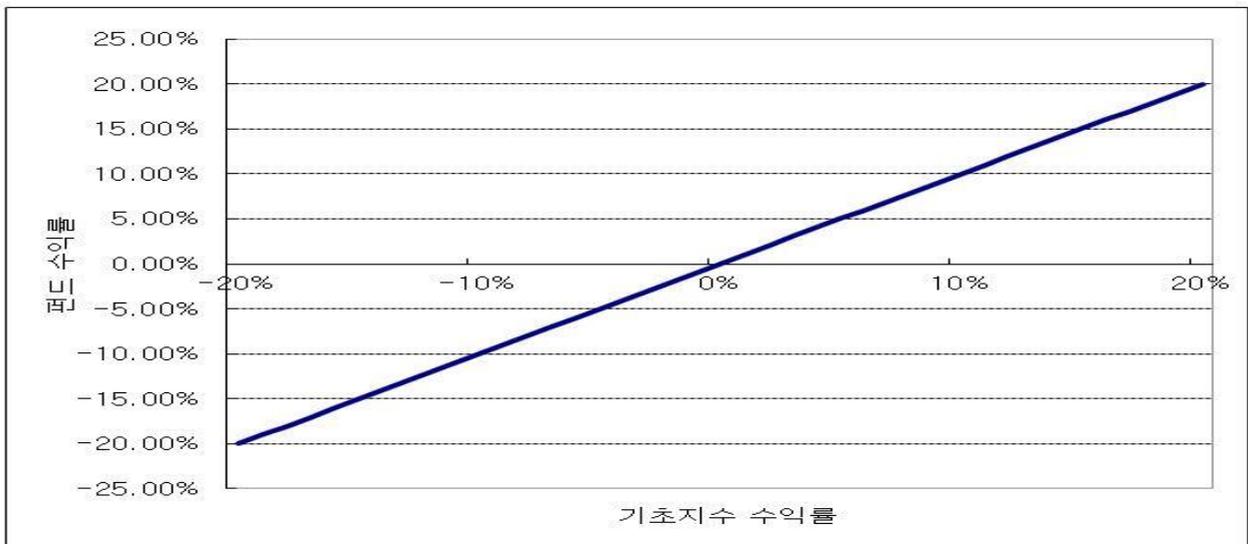
공시일: 2020-10-20

## 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	6,042	1,985	4,056	장내
합계			6,042	1,985	4,056	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KTB 3Y/10Y Yield Curve steepening index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

484

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

23

# KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 스티프너 2X 증권 상장지수 투자신탁(채권)

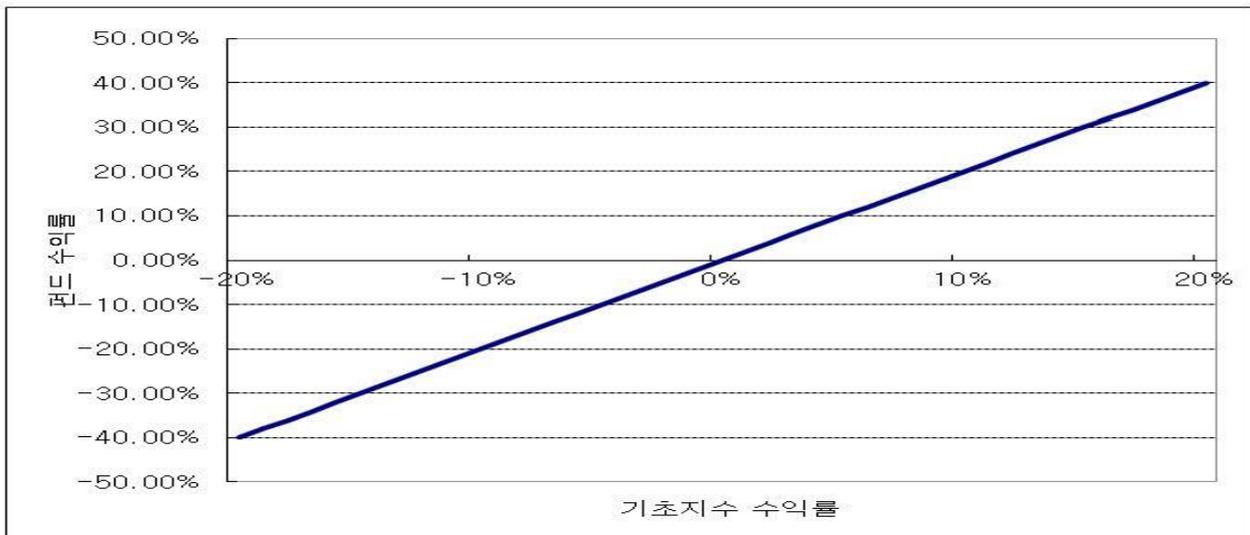
공시일: 2020-10-20

## 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	7,720	4,103	3,617	장내
합계			7,720	4,103	3,617	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KTB 3Y/10Y Yield Curve steepening index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

618

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

60

# : KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 플래트너 증권 상장지수 투자신탁(채권-고

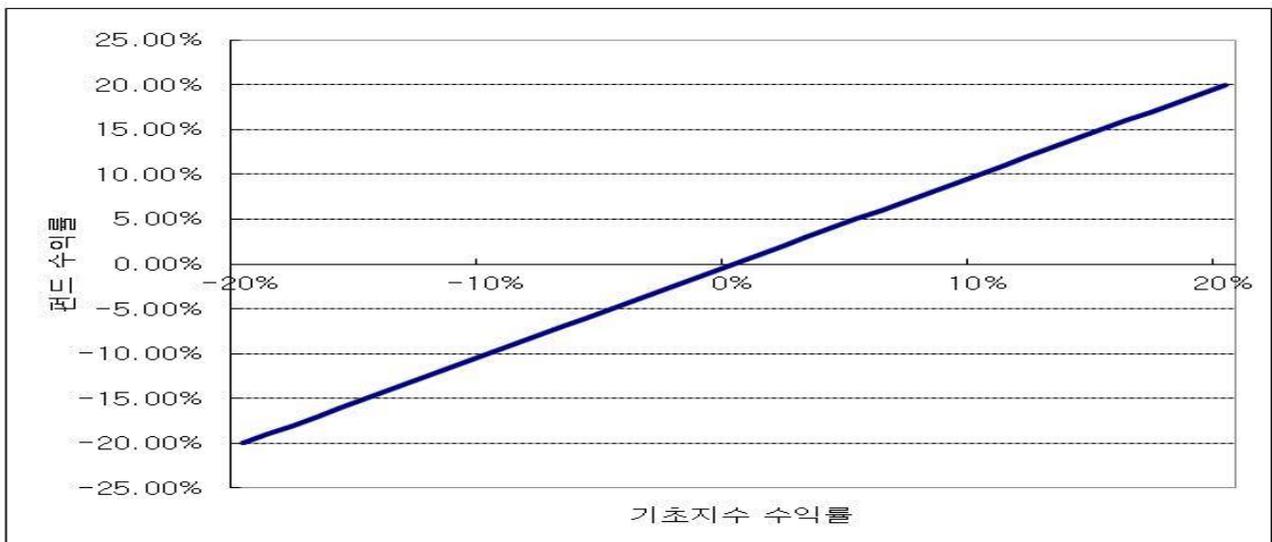
공시일: 2020-10-20

## 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	1,985	5,930	-3,944	장내
합계			1,985	5,930	-3,944	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KTB 3Y/10Y Yield Curve flattening index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

475

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

23

# KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 플래트너 2X 증권 상장지수 투자신탁(채권)

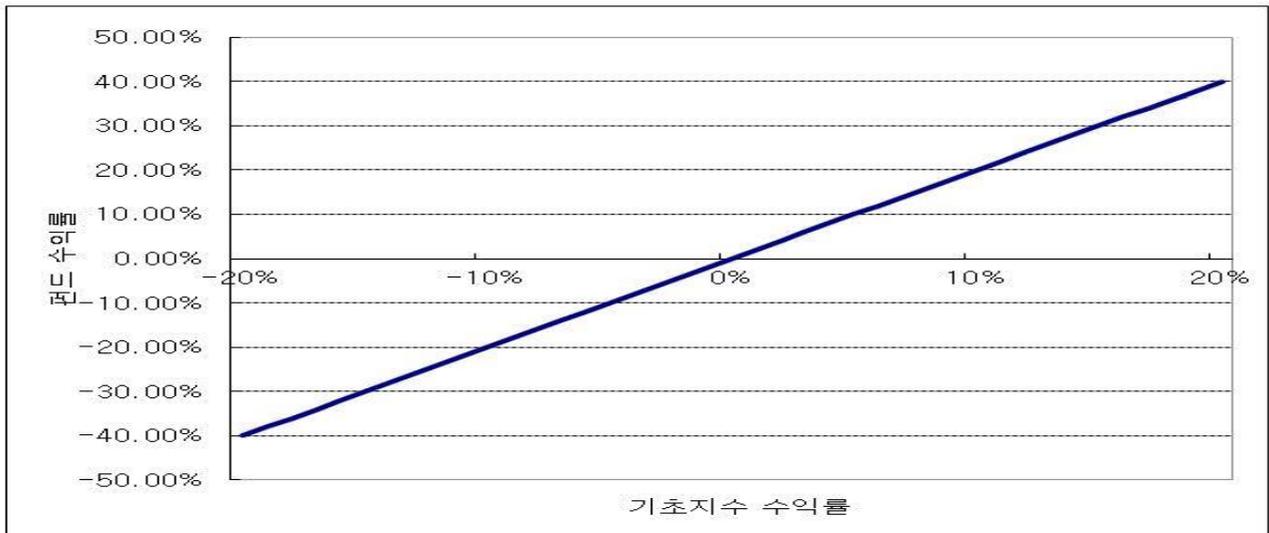
공시일: 2020-10-20

## 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	0	10,985	-10,985	장내
합계			0	10,985	-10,985	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



본 펀드는 기초지수(KTB 3Y/10Y Yield Curve flattening index)의 등락률에 따라 위 그래프와 유사한 수익률 구조를 갖습니다. 다만, 운용결과에 따라 실제수익률은 달라질 수 있습니다.

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

869

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

77