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

공시일: 2020-10-26

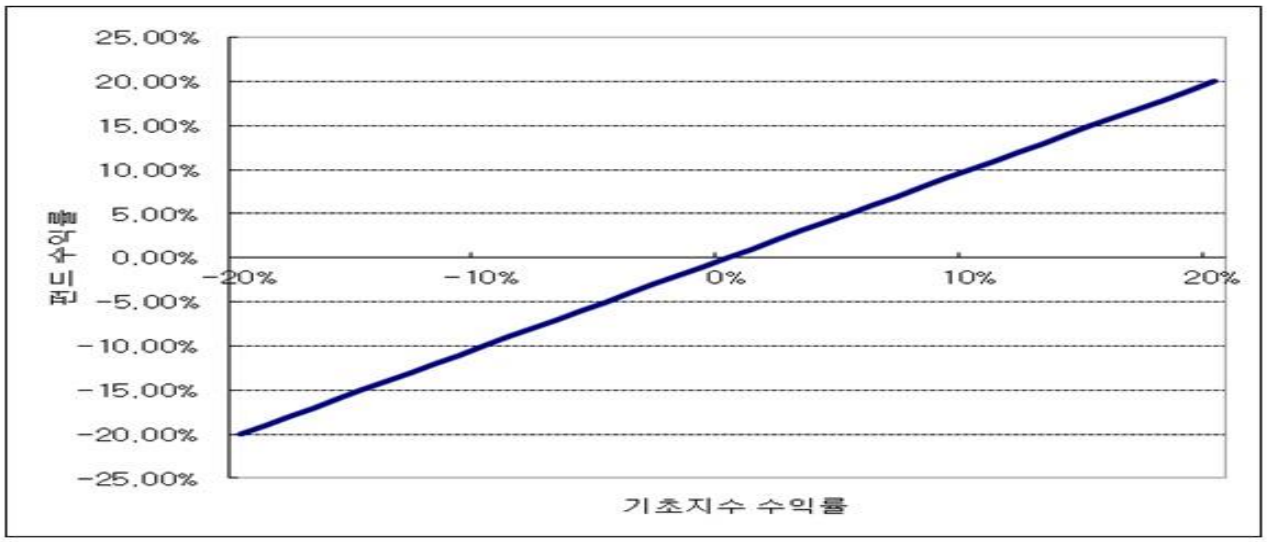
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	17,447	-17,447	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	8,591	0	8,591	장내
합계			8,591	17,447	-8,856	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	1,396

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,163

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

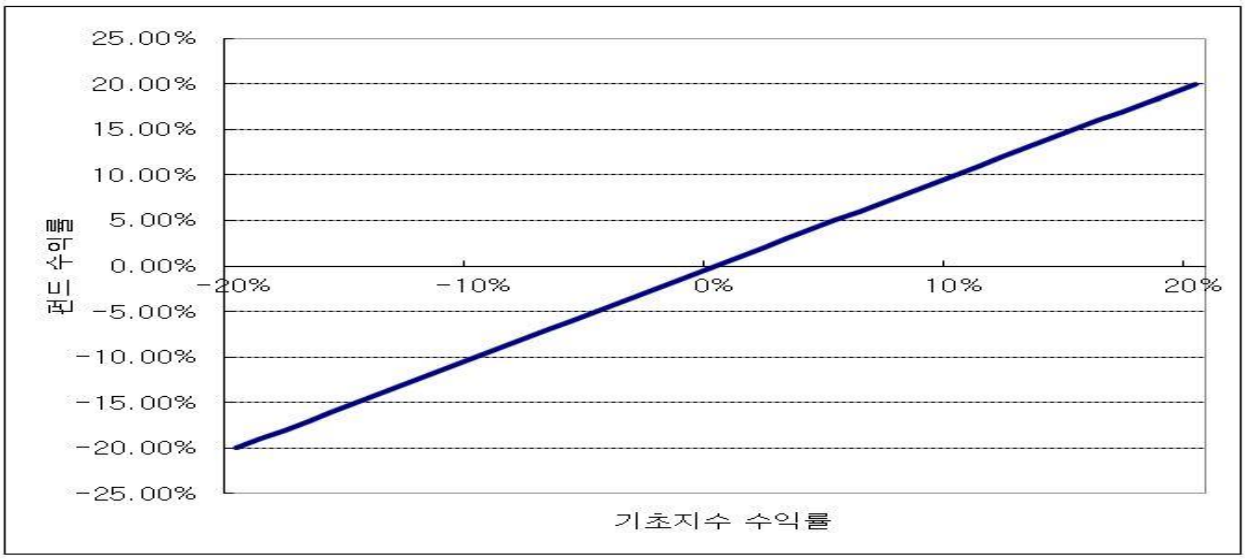
공시일: 2020-10-26

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	939	0	939	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	42	0	42	장내
합계			981	0	981	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

126

펀드명 : KB 액티브 인베스터 증권 모투자신탁(주식혼합-파생형)

공시일: 2020-10-26

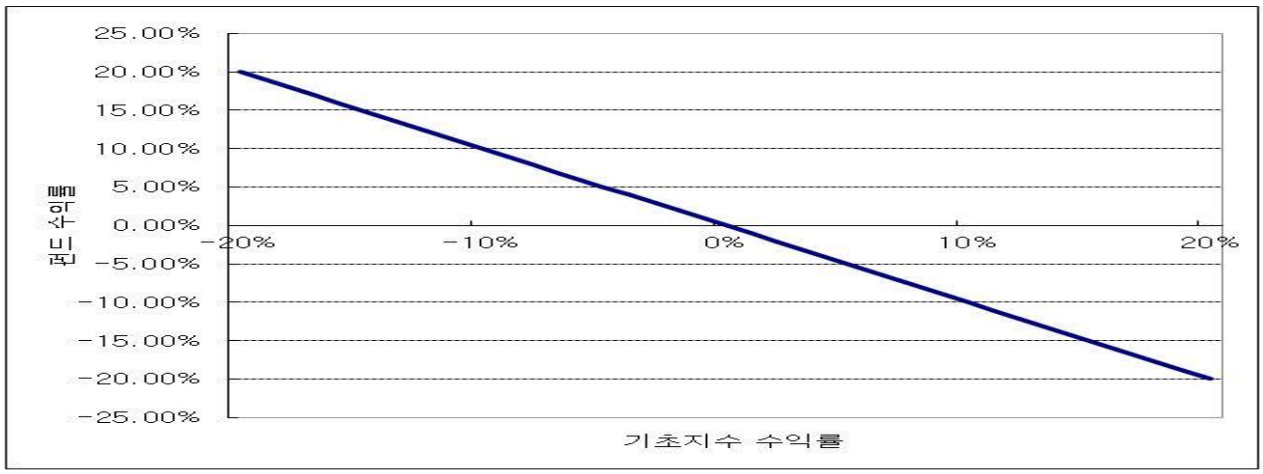
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	2,833	-2,833	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	93	-93	장내
합계			0	2,926	-2,926	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

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



본 펀드는 주식 시황에 따라 주식편입비중을 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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	227

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	380

펀드명 : KB스타차이나H인덱스증권 모[주식-파생형]

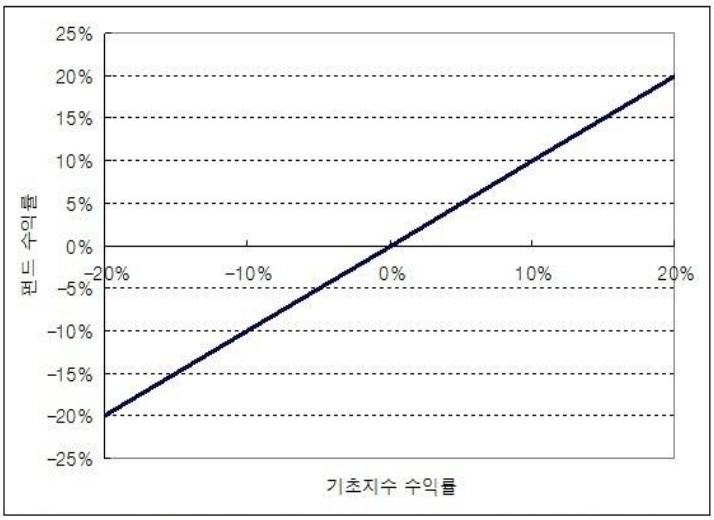
공시일: 2020-10-26

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	61,728	0	61,728	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	13,611	0	13,611	장외
합계			75,338	0	75,338	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9,476

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,785

펀드명 : KB스타 미국S&P500인덱스모[주식파생형]

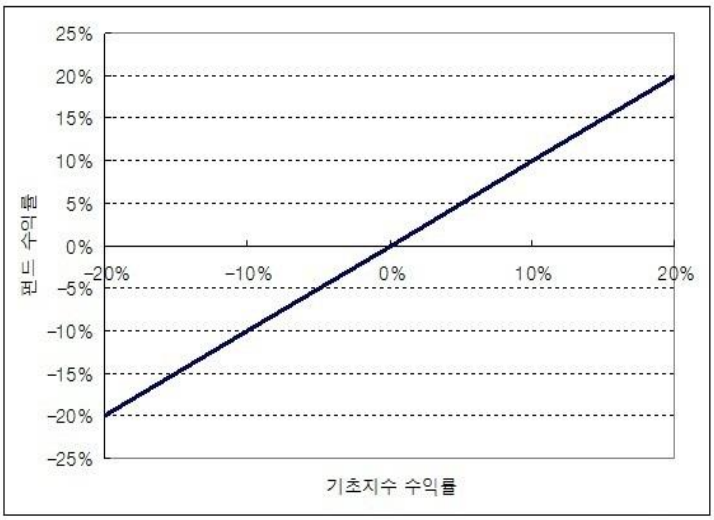
공시일: 2020-10-26

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	34,225	-34,225	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	80,489	0	80,489	장내
합계			80,489	34,225	46,264	

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

12,314

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12,735

펀드명 : KB스타 코리아리버스인덱스(주식파생형)(운용)

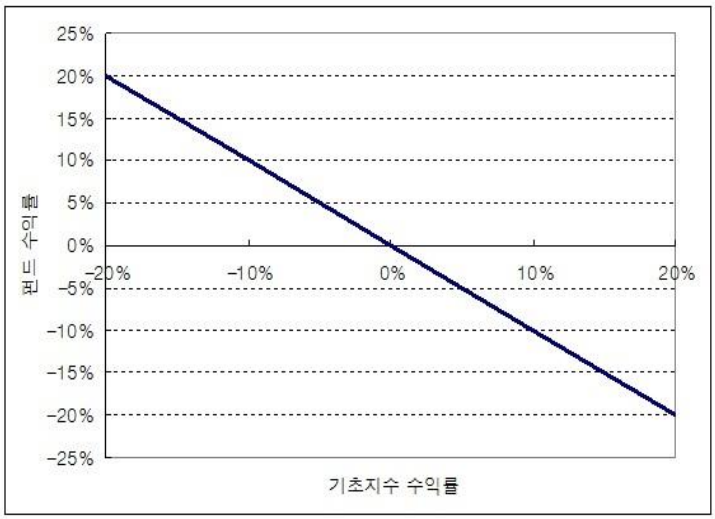
공시일: 2020-10-26

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	46,510	-46,510	장내
합계			0	46,510	-46,510	

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

3,727

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,100

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

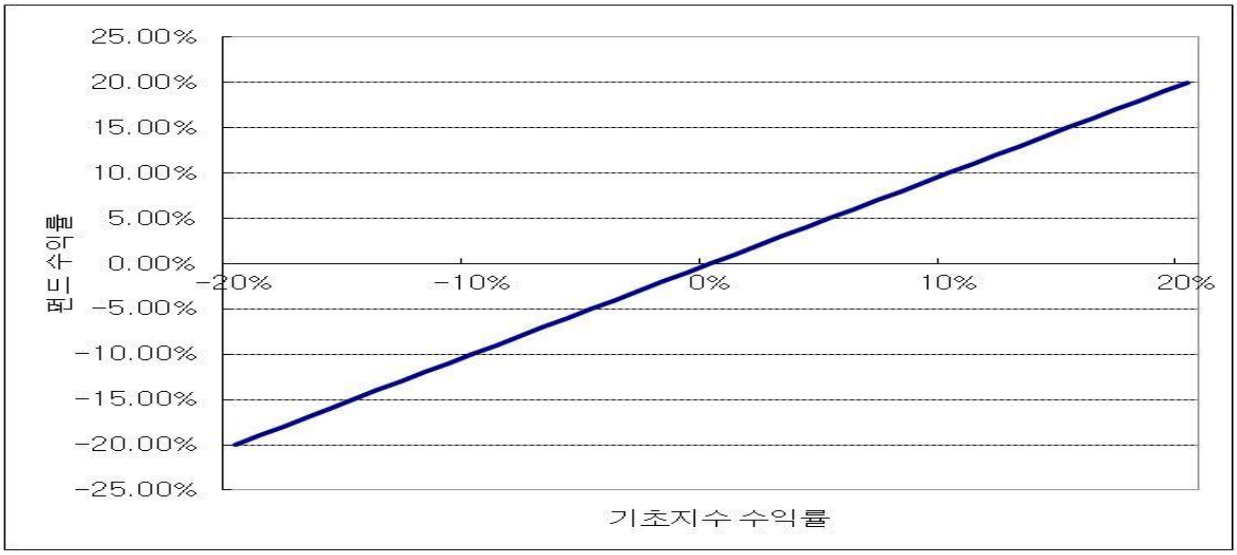
공시일: 2020-10-26

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	16,827	0	16,827	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	9,865	0	9,865	장외
합계			26,692	0	26,692	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	2,581

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,710

펀드명 : KB 중국본토 A주 레버리지 모(주식-파생재간접)

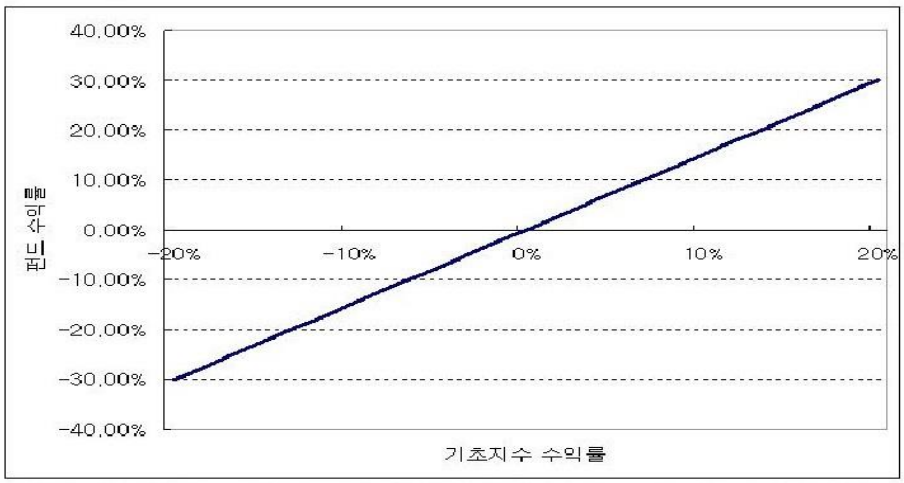
공시일: 2020-10-26

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	71,271	-71,271	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	82,883	0	82,883	장내
합계			82,883	71,271	11,613	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12,844

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,112

펀드명 : KB스타 코리아 레버리지1.5 증권(주식-파생형)(운용)

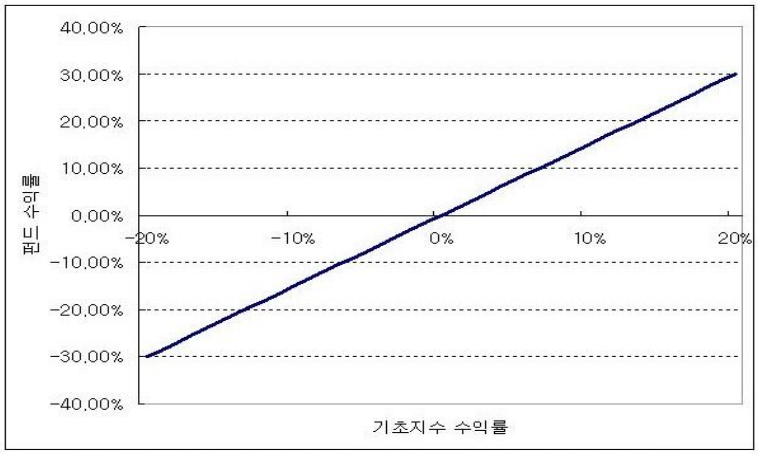
공시일: 2020-10-26

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	5,635	0	5,635	장내
합계			5,635	0	5,635	

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

452

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

739

펀드명 : KB스타 코리아 레버리지2.0 증권(주식-파생형)(운용)

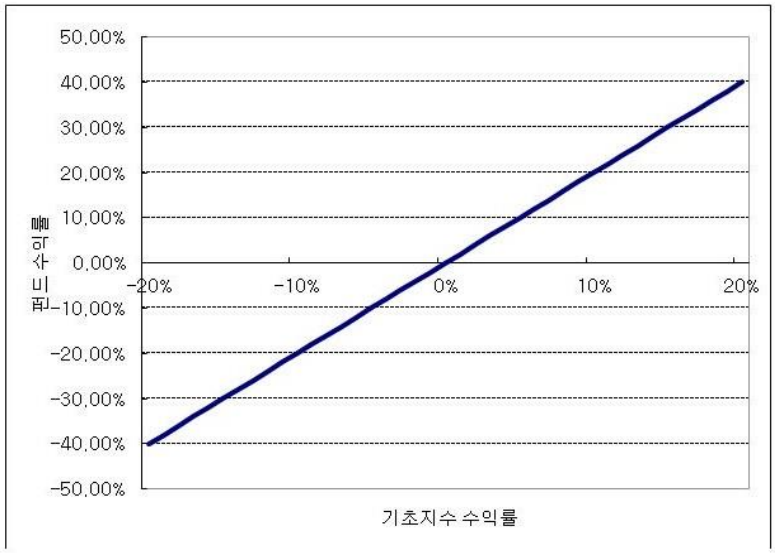
공시일: 2020-10-26

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	163,180	0	163,180	장내
합계			163,180	0	163,180	

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

12,978

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

21,405

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

공시일: 2020-10-26

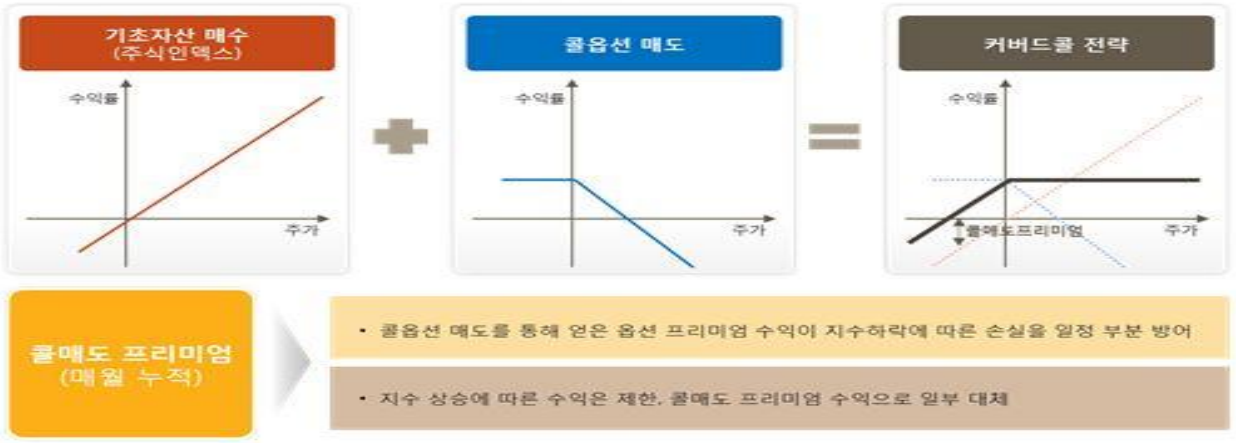
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	630	0	630	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	181	0	181	장내
합계			810	0	810	

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

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	107

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

공시일: 2020-10-26

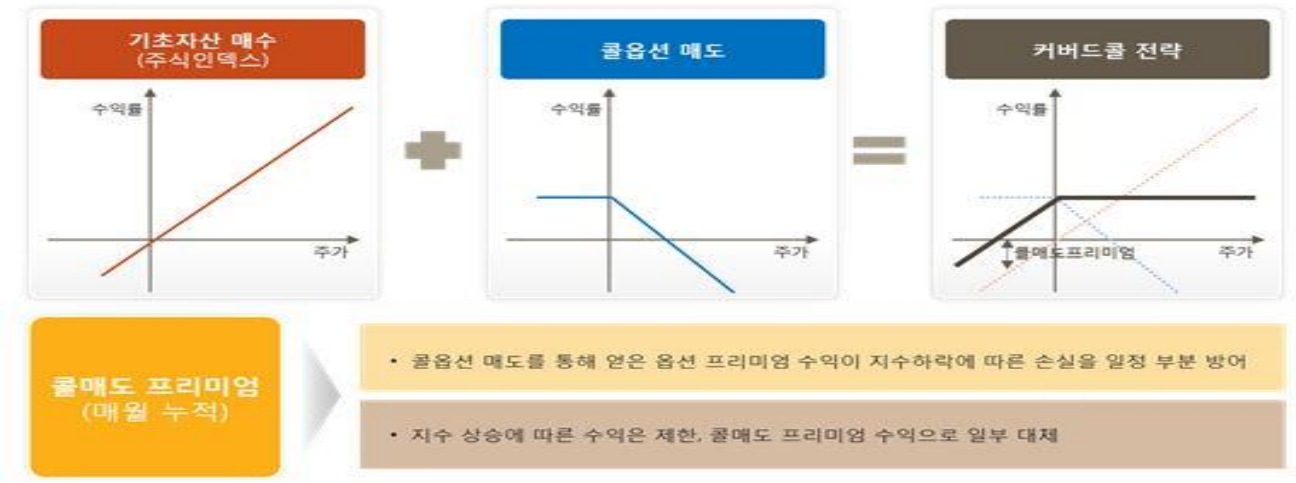
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	600	0	600	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	549	0	549	장외
합계			1,150	0	1,150	

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	92

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	87

펀드명 : KB스타 코스닥150 인덱스 증권 모(주식-파생형)

공시일: 2020-10-26

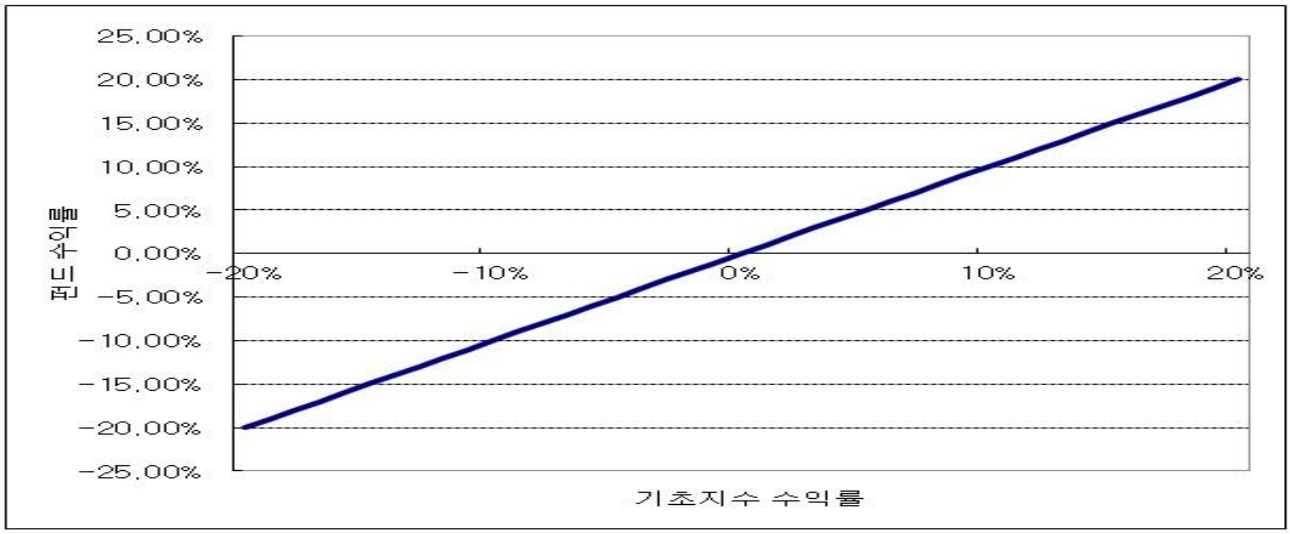
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	96,984	0	96,984	장내
합계			96,984	0	96,984	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

7,643

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,769

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

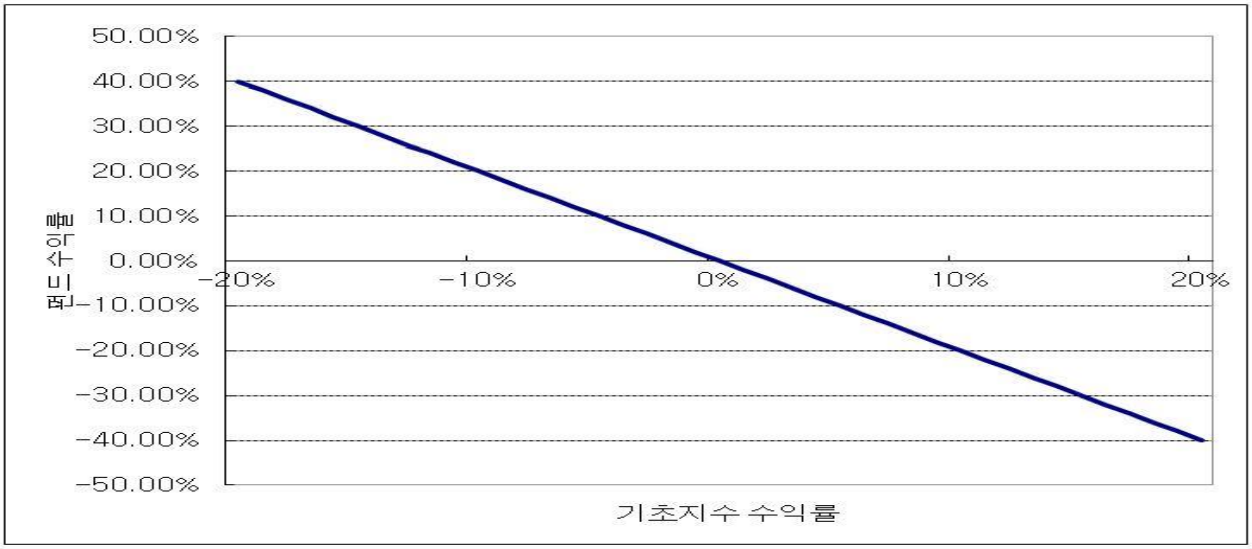
공시일: 2020-10-26

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	30,377	-30,377	장내
합계			0	30,377	-30,377	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,434

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,984

펀드명 : KB 차이나 H 인버스 인덱스 증권(주식-파생형)(운용)

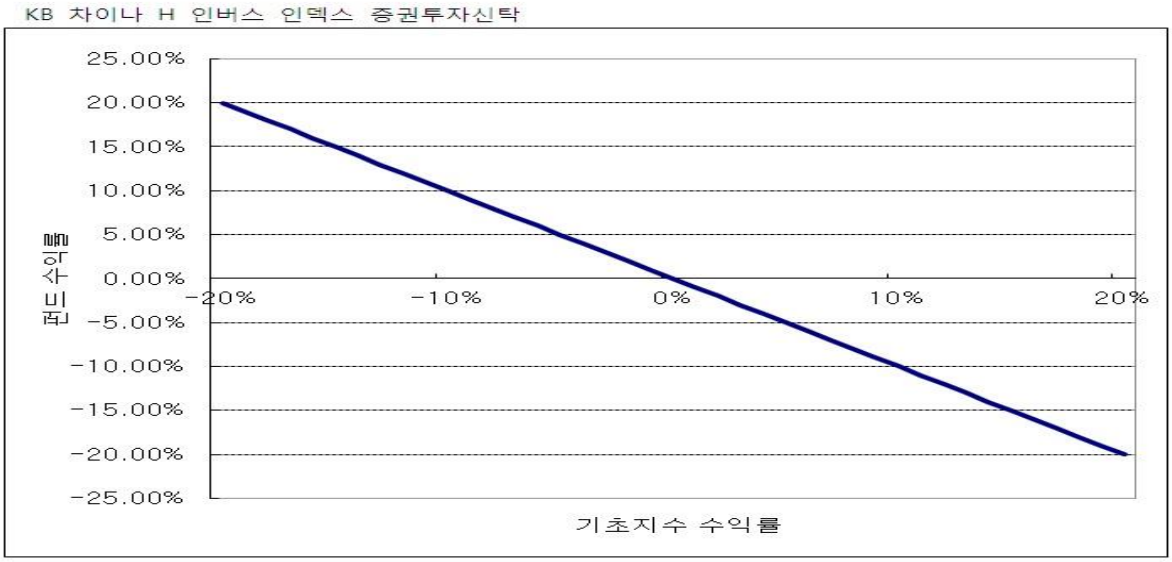
공시일: 2020-10-26

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	1,480	0	1,480	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	571	0	571	장외
합계			2,051	0	2,051	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

227

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

143

펀드명 : KB스타 이머징 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)

공시일: 2020-10-26

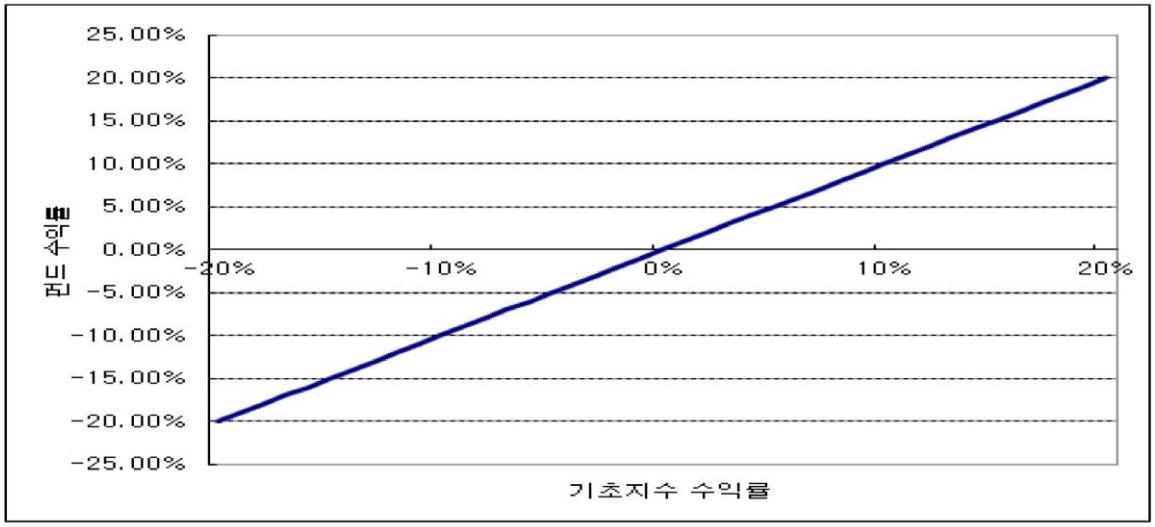
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	2,946	-2,946	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	5,344	0	5,344	장내
합계			5,344	2,946	2,398	

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	825

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	539

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

공시일: 2020-10-26

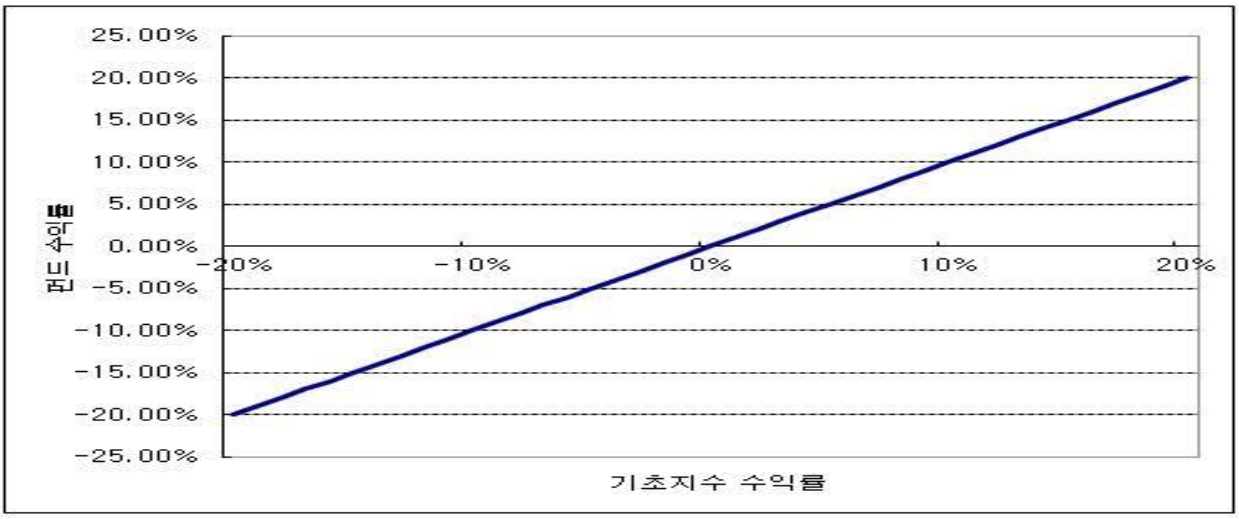
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	17,775	-17,775	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	42,658	0	42,658	장내
합계			42,658	17,775	24,882	

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	6,536

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	7,071

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

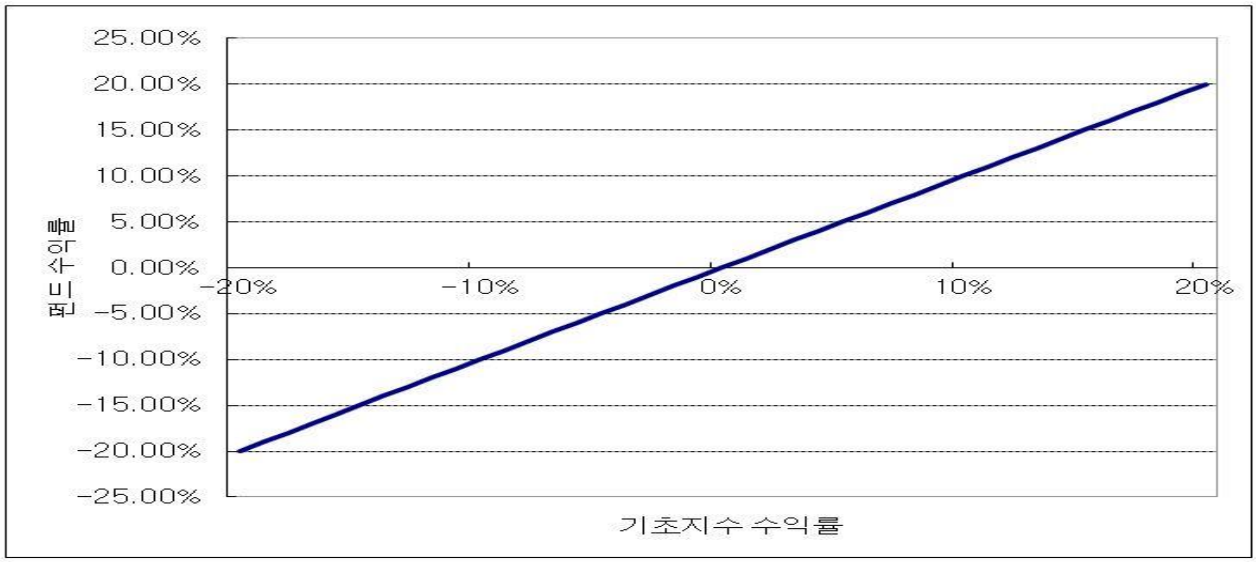
공시일: 2020-10-26

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	279	0	279	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	175	0	175	장내
합계			454	0	454	

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

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

62

펀드명 : KB스타코리아인덱스(주식-파생형)(운용)

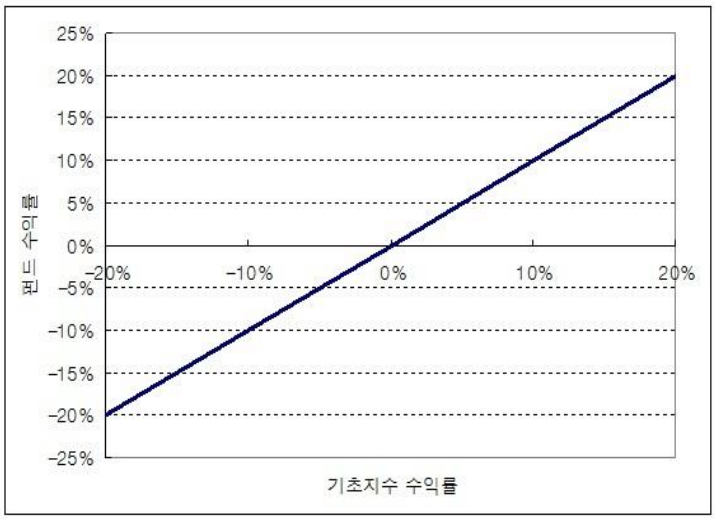
공시일: 2020-10-26

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	6,847	1,196	5,650	장내
합계			6,847	1,196	5,650	

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

493

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

743

펀드명 : KB스타 재팬 인덱스 증권 모(주식-파생형)

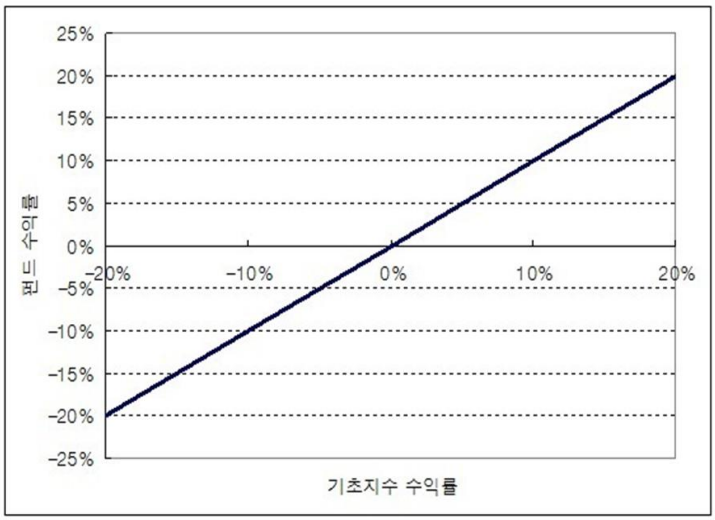
공시일: 2020-10-26

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	10,437	0	10,437	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	2,858	0	2,858	장외
합계			13,295	0	13,295	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,603

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,026

펀드명 : KB스타 골드(금-파생형)(운용)

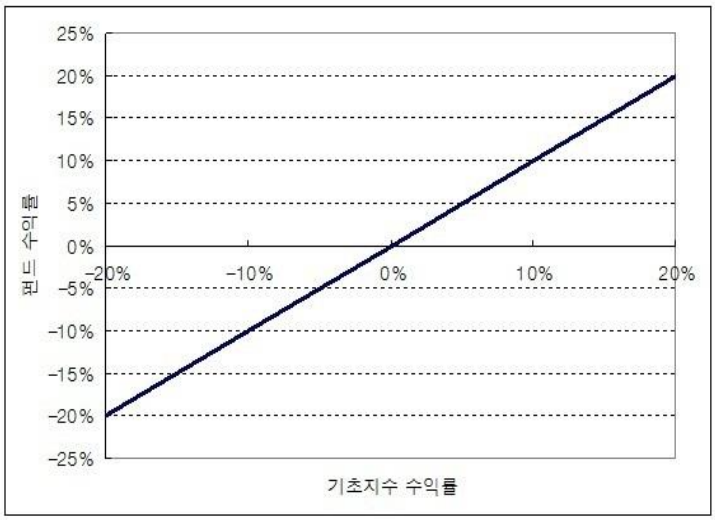
공시일: 2020-10-26

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	4,985	-4,985	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	61,162	0	61,162	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	11,078	0	11,078	장외
합계			72,241	4,985	67,256	

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

9,416

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,449

펀드명 : KB스타 유로 인덱스 증권 모(주식-파생형)

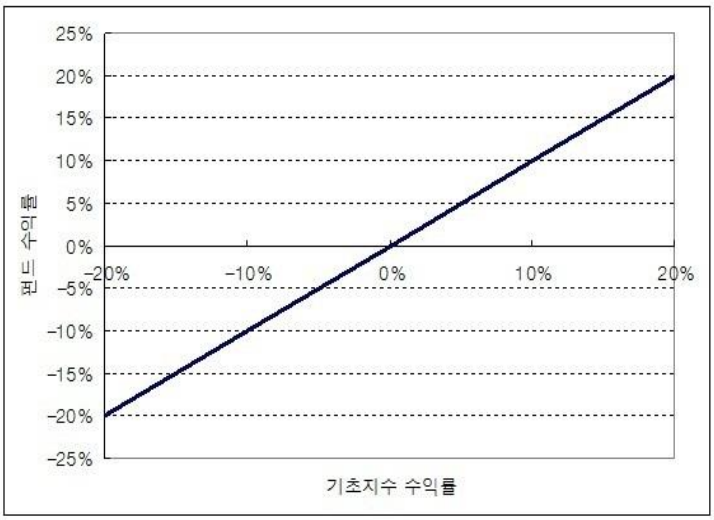
공시일: 2020-10-26

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	19,892	0	19,892	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	9,274	0	9,274	장외
합계			29,166	0	29,166	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	3,041

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	2,828

펀드명 : KB 원자재 특별자산 모투자신탁[상품파생형]

공시일: 2020-10-26

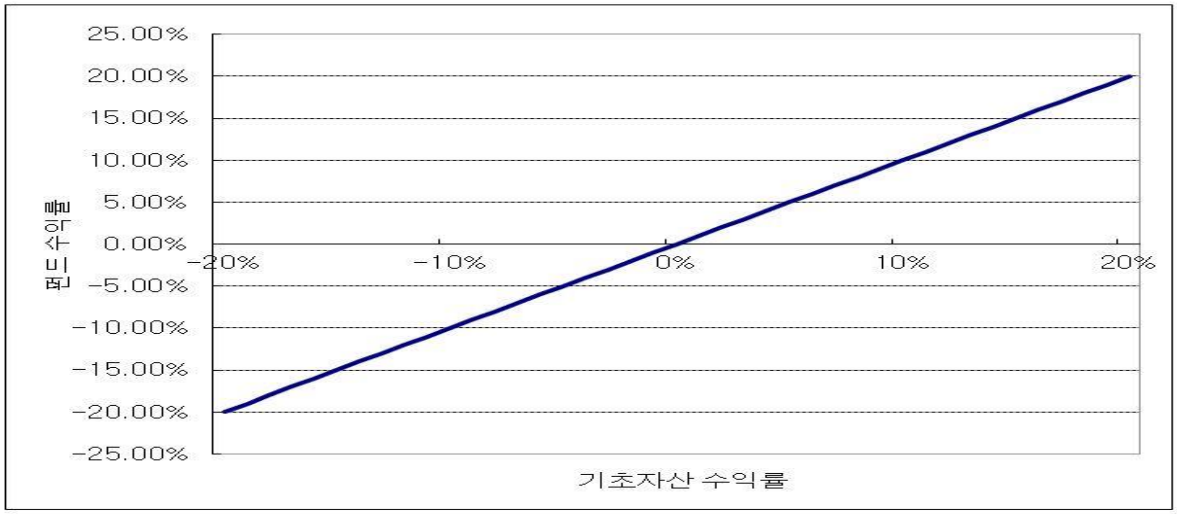
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	1,235	-1,235	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	3,015	0	3,015	장내
합계			3,015	1,235	1,780	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	99

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	419

펀드명 : KB KStar 주식혼합 증권 ETF

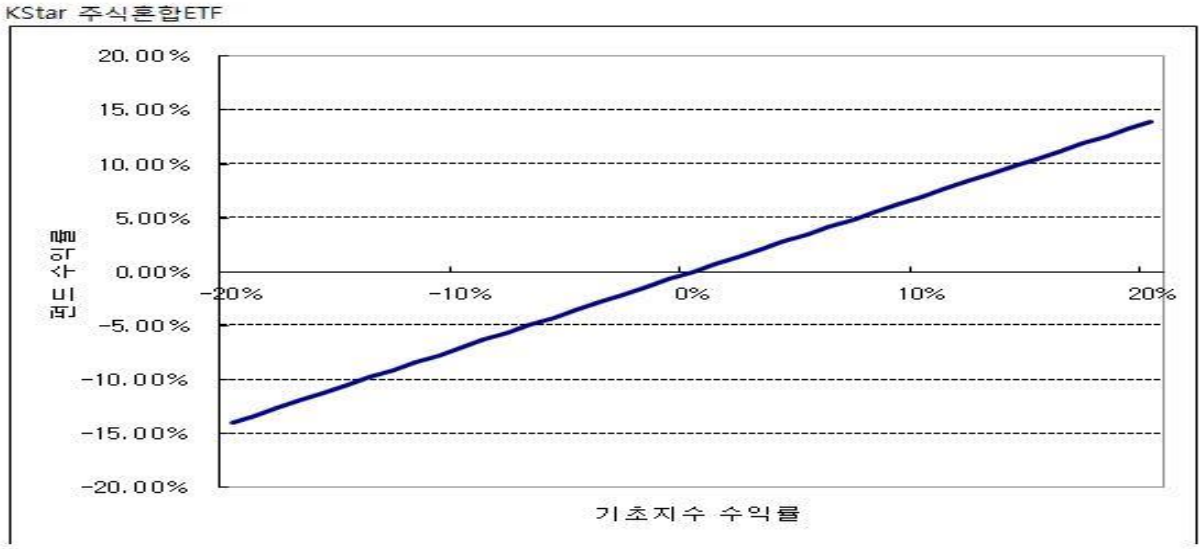
공시일: 2020-10-26

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	301	0	301	장내
합계			525	0	525	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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)

45

펀드명 : KB KStar 채권혼합 증권 ETF

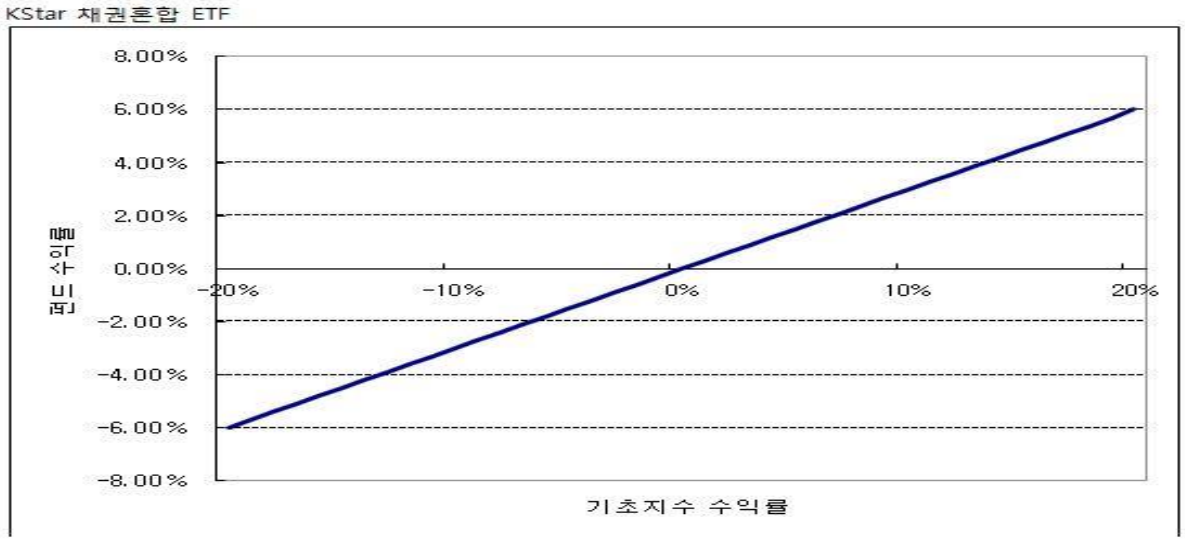
공시일: 2020-10-26

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	181	0	181	장내
합계			404	0	404	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	27

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

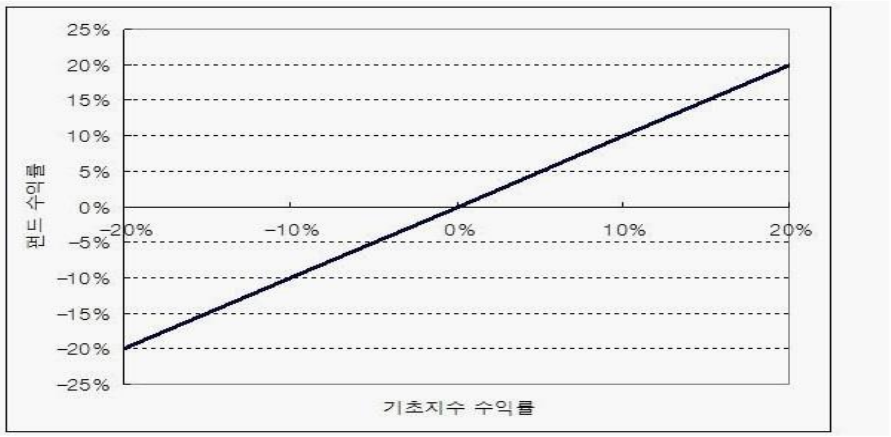
공시일: 2020-10-26

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	42,433	0	42,433	장외
합계			42,433	0	42,433	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,399

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13,977

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

공시일: 2020-10-26

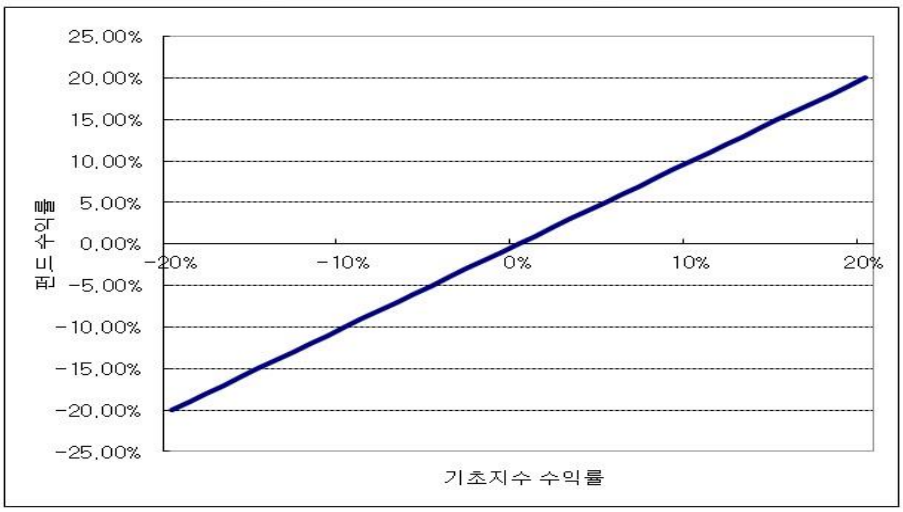
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	814	0	814	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	6,140	0	6,140	장외
합계			6,954	0	6,954	

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	125

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	296

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

공시일: 2020-10-26

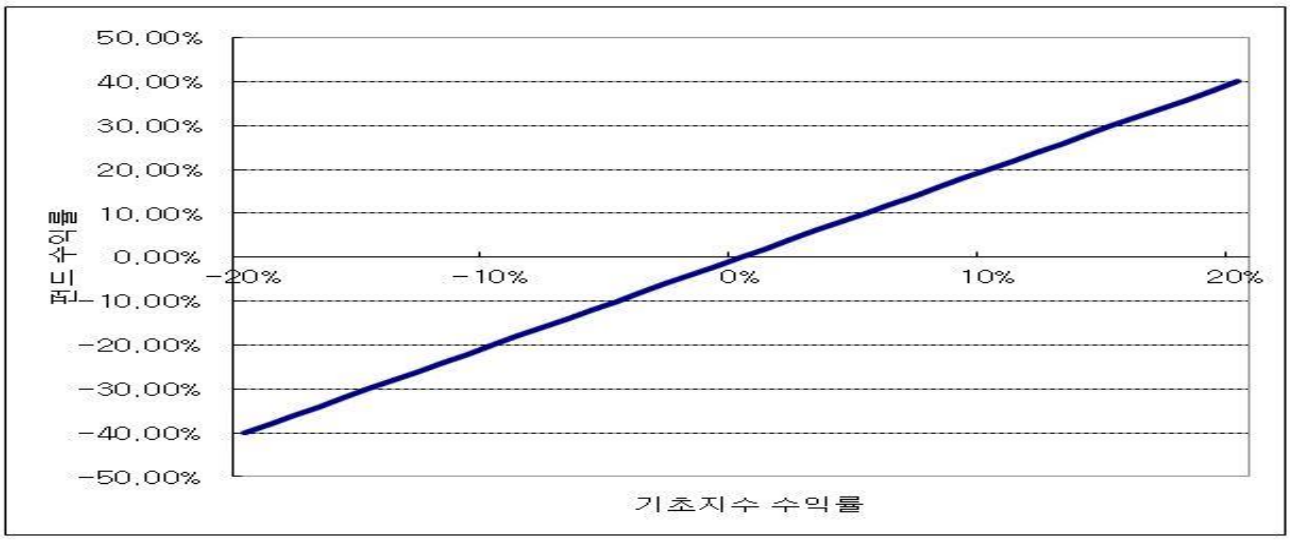
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	81,373	0	81,373	장내
합계			81,373	0	81,373	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,520

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

10,673

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

공시일: 2020-10-26

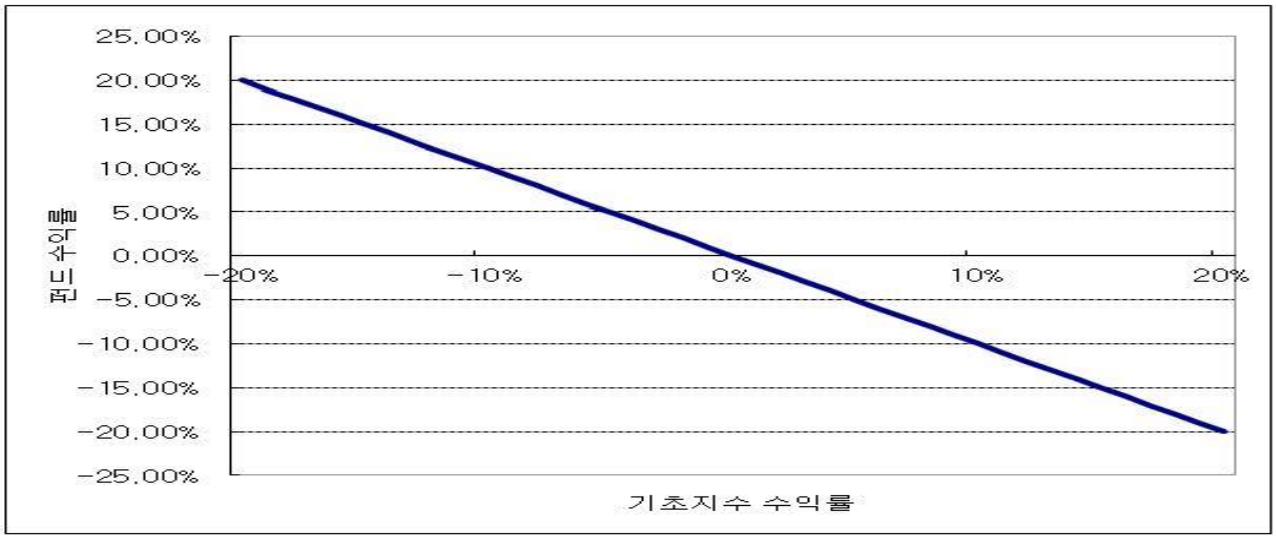
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	4,643	-4,643	장내
합계			0	4,643	-4,643	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

372

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

609

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

공시일: 2020-10-26

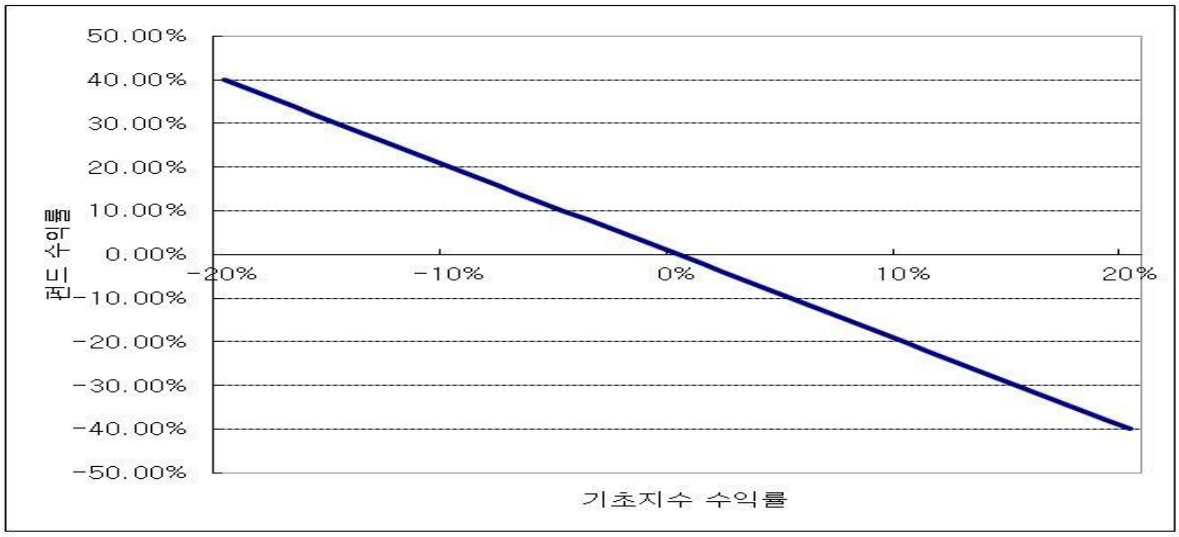
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	67,365	-67,365	장내
합계			0	67,365	-67,365	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,398

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,836

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

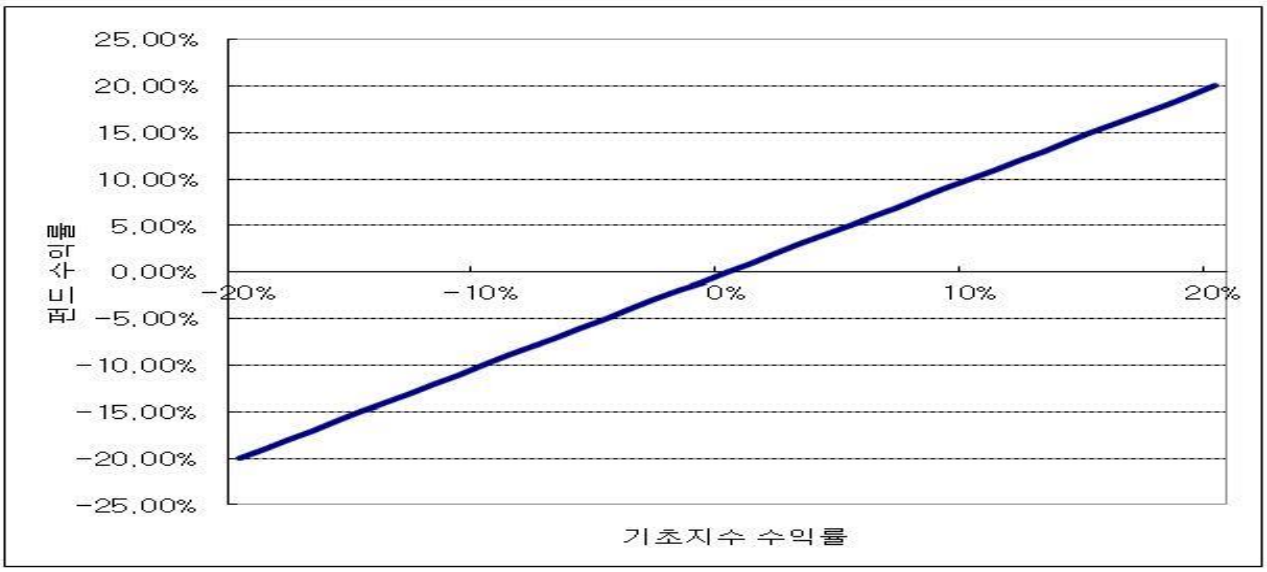
공시일: 2020-10-26

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	5,280	0	5,280	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	3,059	0	3,059	장외
합계			8,339	0	8,339	

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

811

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

347

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

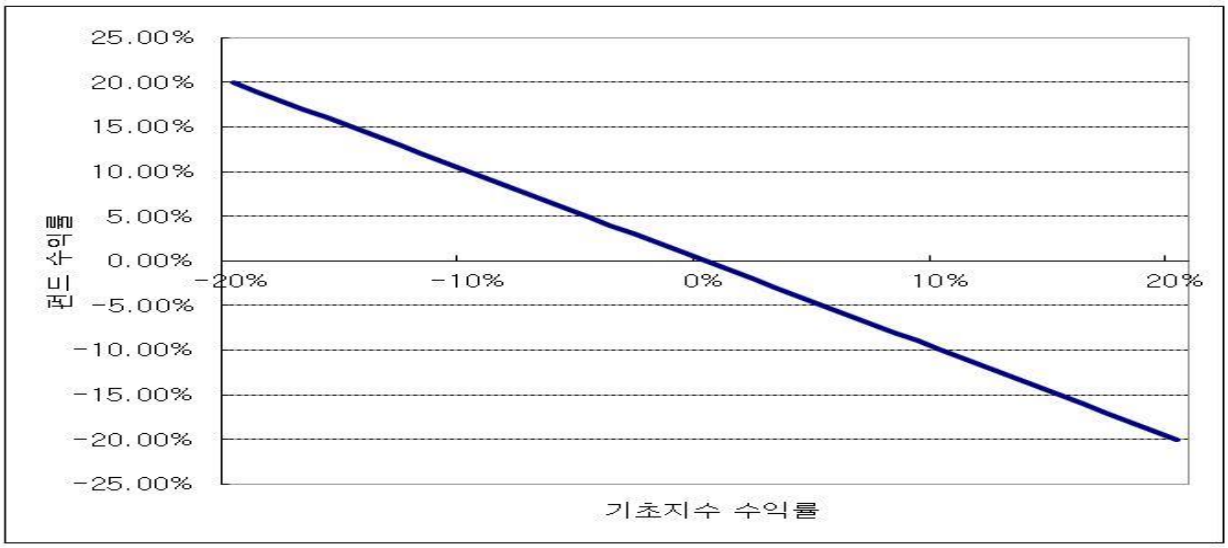
공시일: 2020-10-26

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	3,129	0	3,129	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	1,813	0	1,813	장외
합계			4,942	0	4,942	

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

481

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

206

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

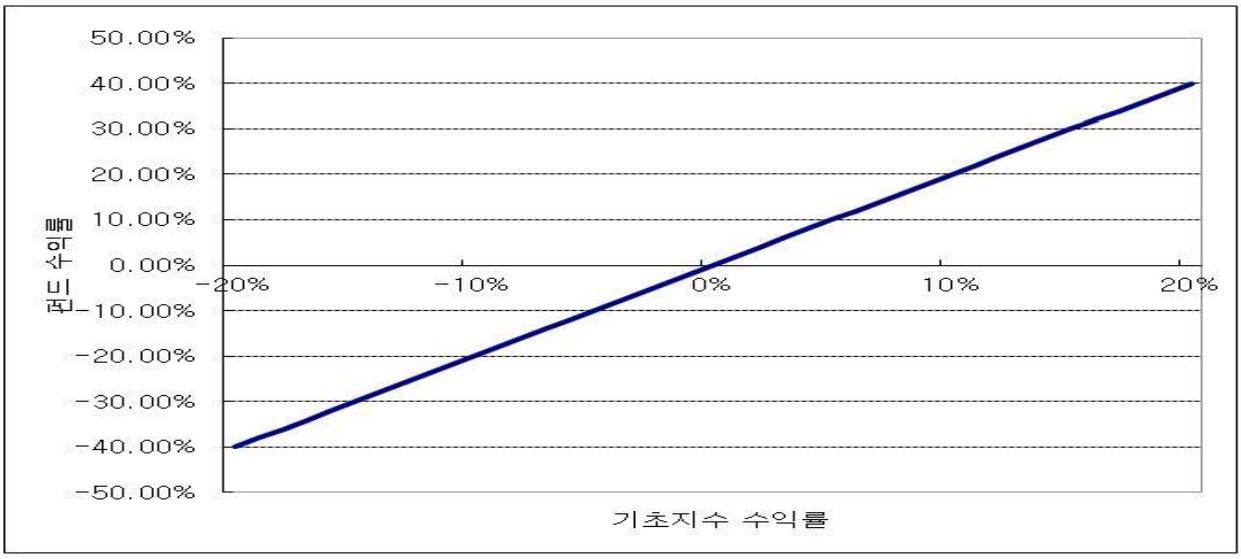
공시일: 2020-10-26

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	7,187	0	7,187	장외
합계			7,187	0	7,187	

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

576

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

983

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

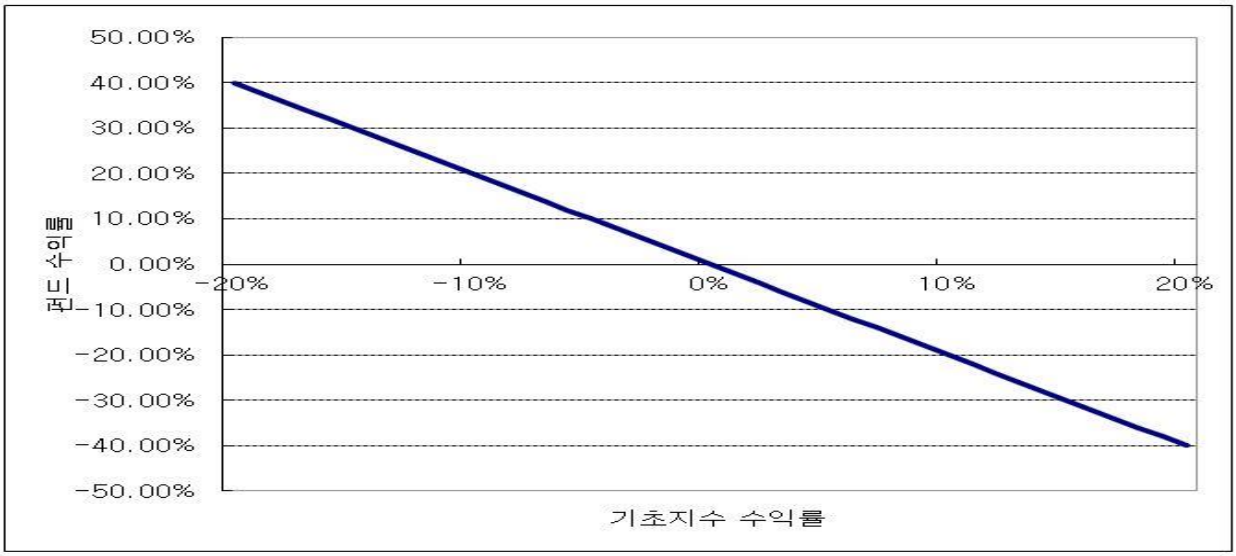
공시일: 2020-10-26

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	2,816	0	2,816	장외
합계			2,816	0	2,816	

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

226

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

336

펀드명 : KB KBSTAR 코스닥150선물인버스증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형

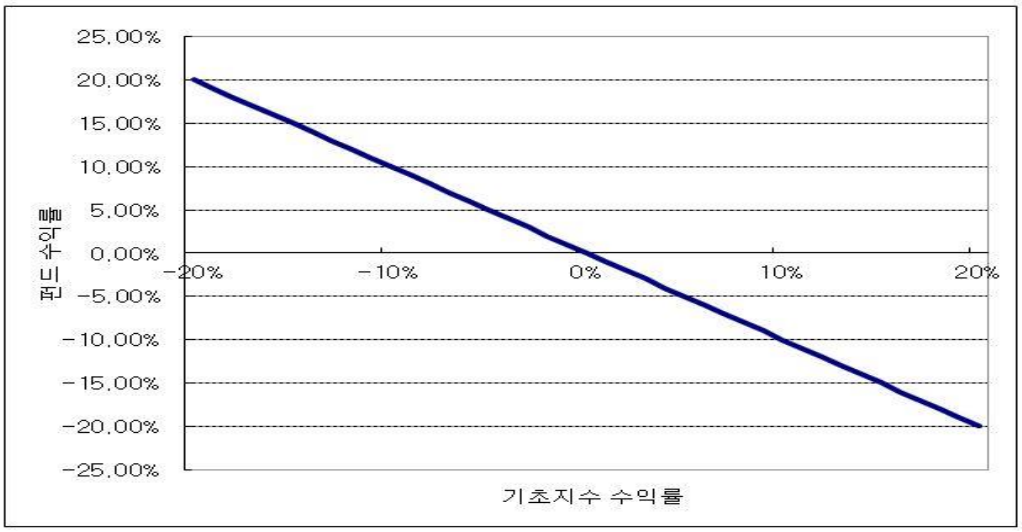
공시일: 2020-10-26

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	6,345	-6,345	장내
합계			0	6,345	-6,345	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

500

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,032

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

공시일: 2020-10-26

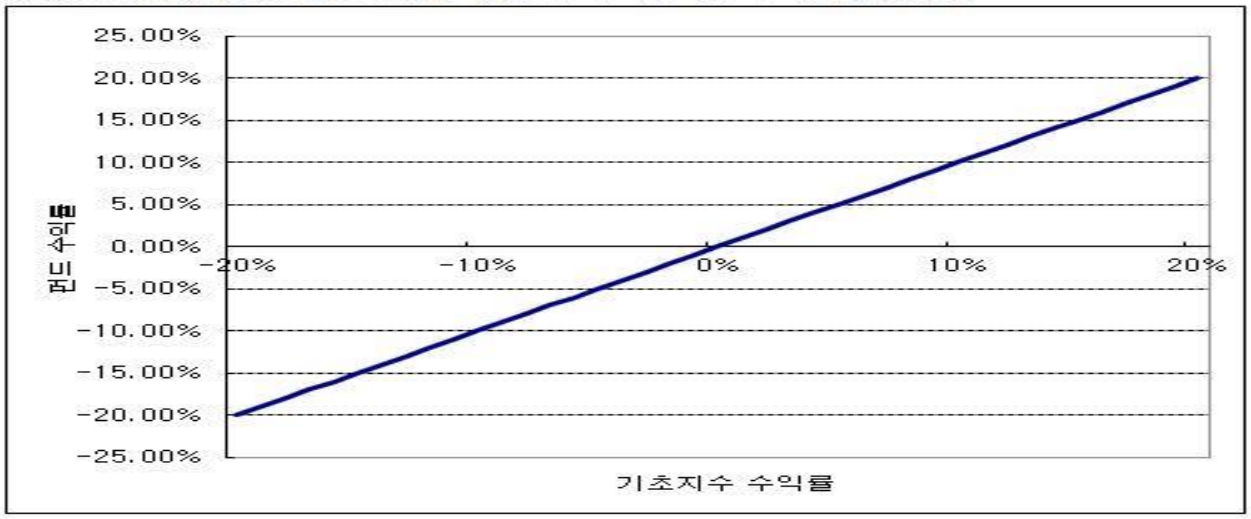
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	8,088	0	8,088	장외
합계			8,088	0	8,088	

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)	1,272

드명 : KB KBSTAR 코스닥150선물레버리지 증권 상장지수 투자신탁(주식-파생

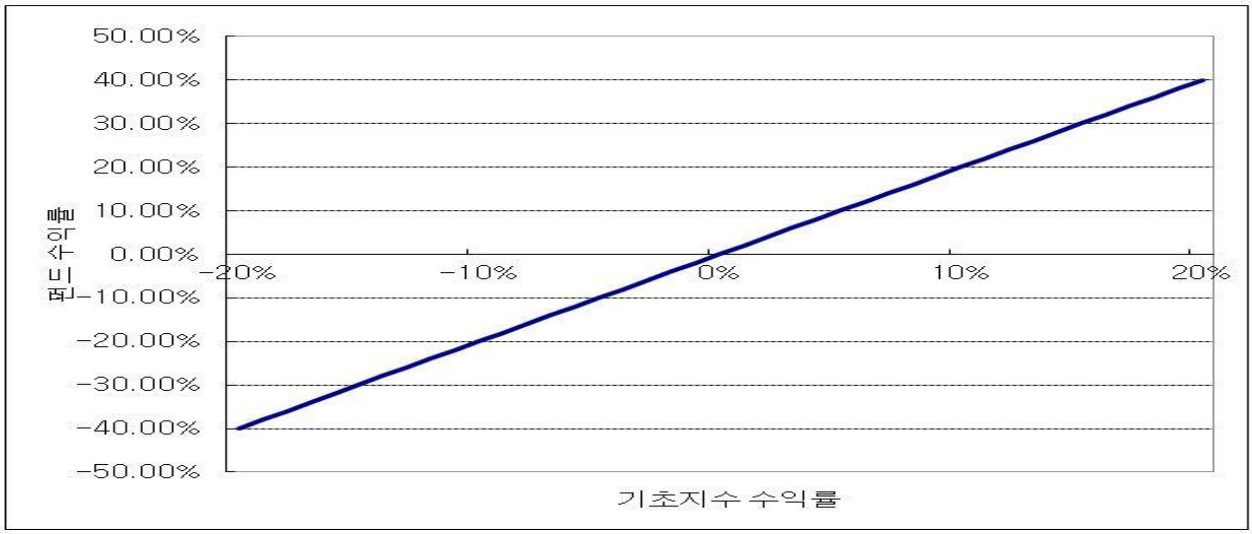
공시일: 2020-10-26

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	290,256	0	290,256	장내
합계			290,256	0	290,256	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22,875

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

47,195

드명 : KB KBSTAR 국고채3년선물 인버스 증권 상장지수 투자신탁(채권-파생형

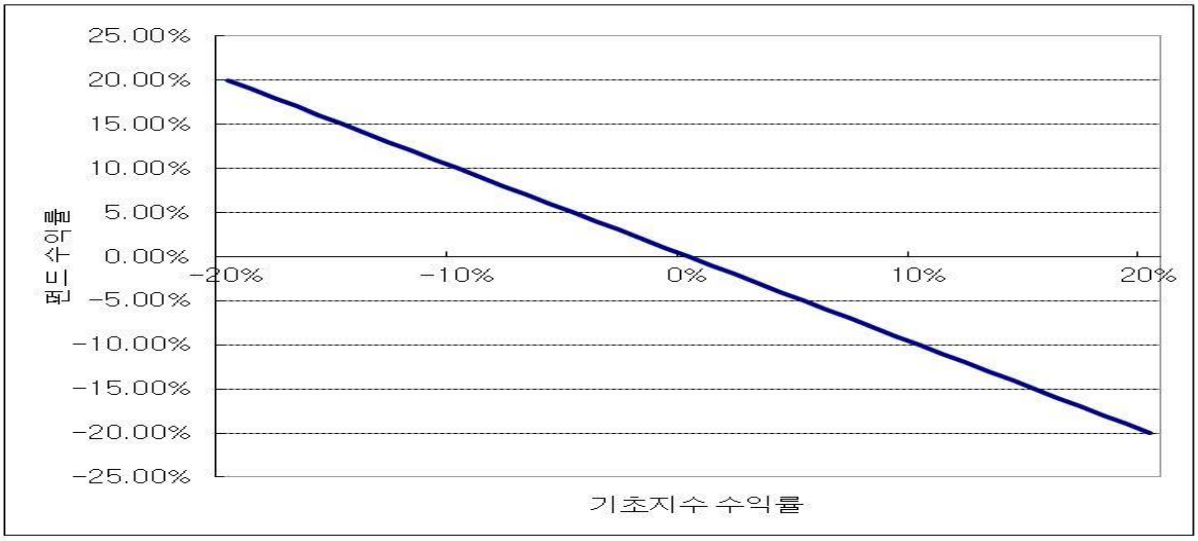
공시일: 2020-10-26

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	282,879	-282,879	장내
합계			0	282,879	-282,879	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22,636

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,889

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

공시일: 2020-10-26

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	315	0	315	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	195	0	195	장내
합계			510	0	510	

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 늘릴 수 있는 장점이 있는 반면, 주가 상승시 수익률 상승효과에 따른 참여율이 떨어진다는 단점이 있습니다.
* 따라서, OTM 콜옵션 매도 보다 주가 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

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	68

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

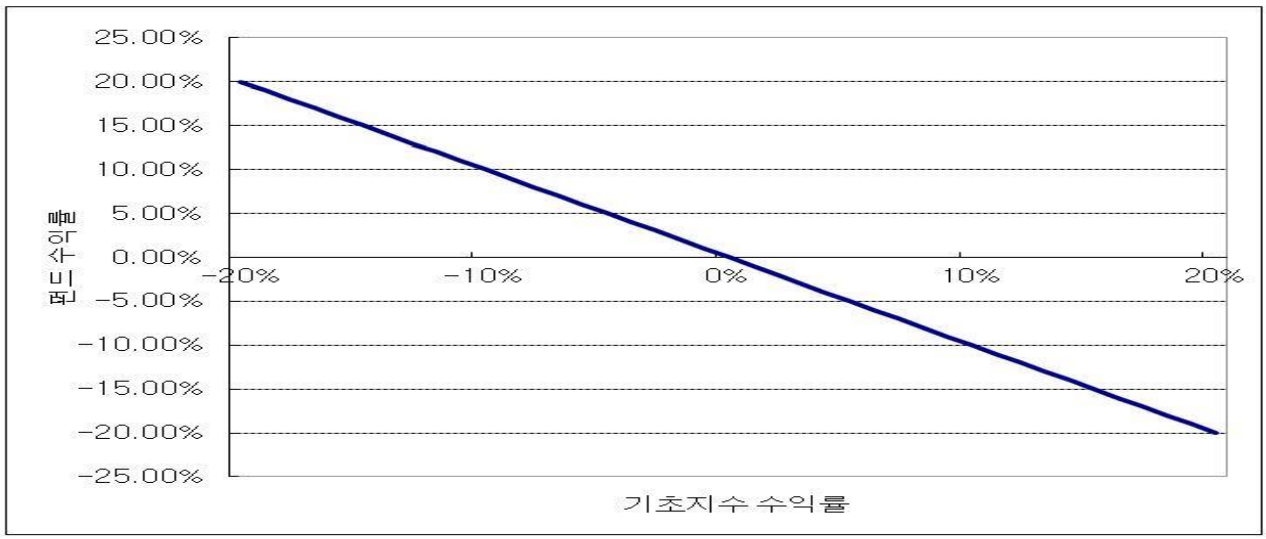
공시일: 2020-10-26

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	4,885	0	4,885	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	1,901	0	1,901	장외
합계			6,785	0	6,785	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	750

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	468

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

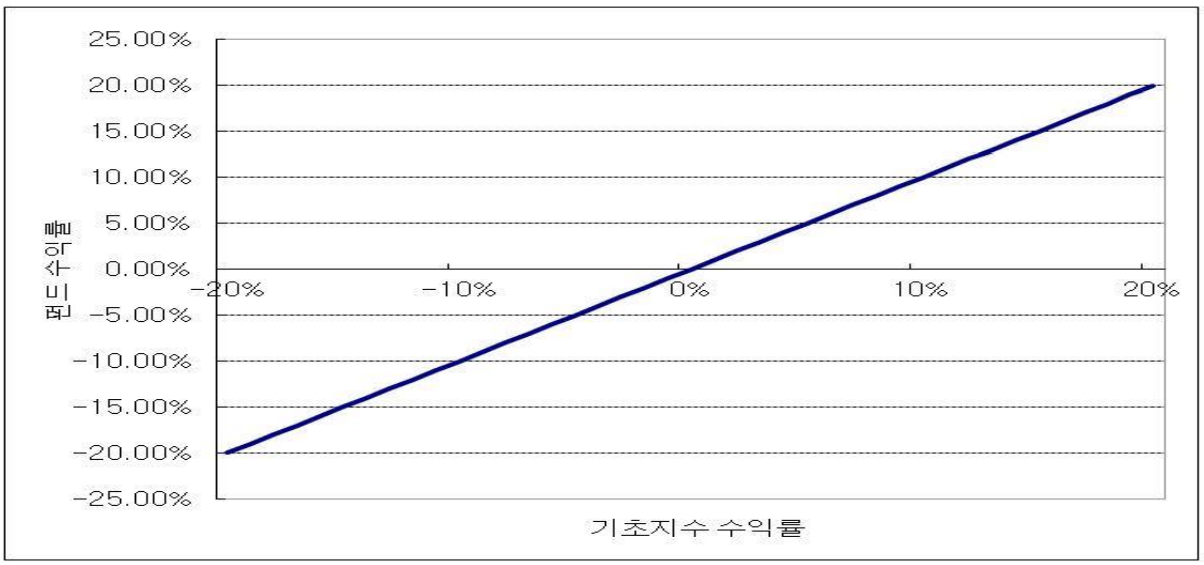
공시일: 2020-10-26

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	16,647	0	16,647	장내
합계			16,647	0	16,647	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,335

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

409

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

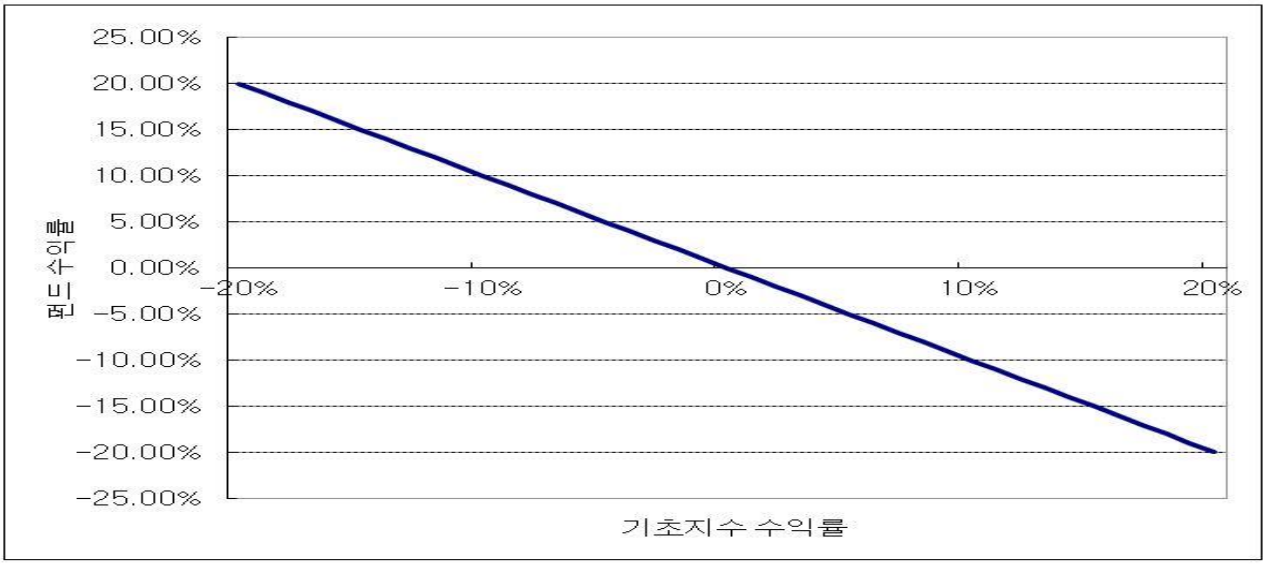
공시일: 2020-10-26

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	3,699	-3,699	장내
합계			0	3,699	-3,699	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

297

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

91

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

공시일: 2020-10-26

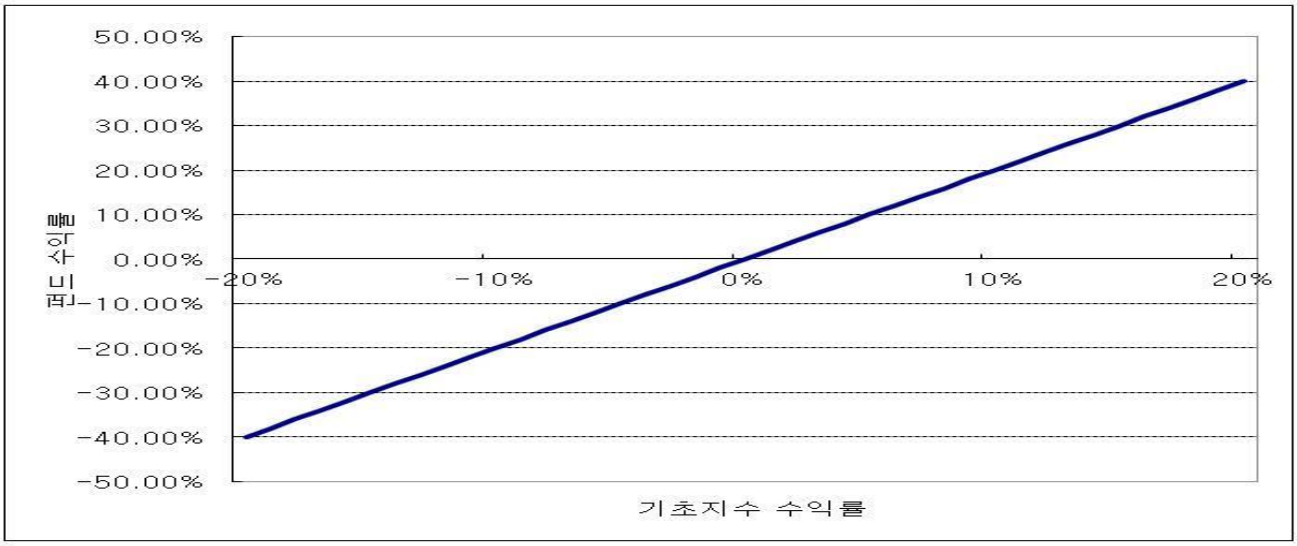
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	7,835	0	7,835	장내
합계			7,835	0	7,835	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	626

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,025

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

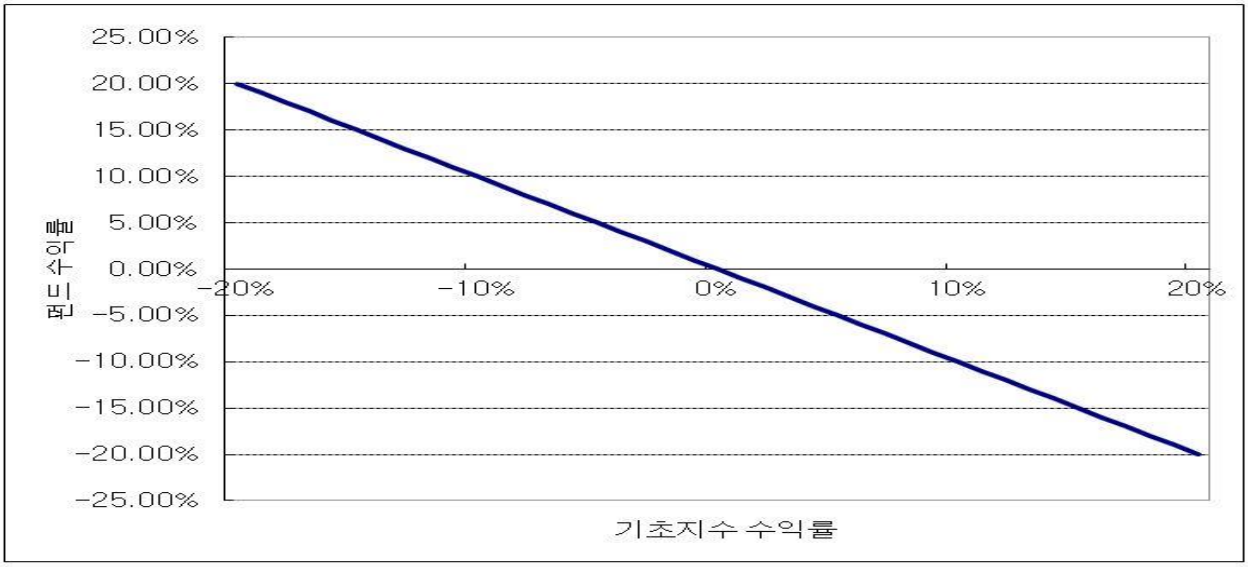
공시일: 2020-10-26

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	3,700	-3,700	장내
합계			0	3,700	-3,700	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

296

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

484

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

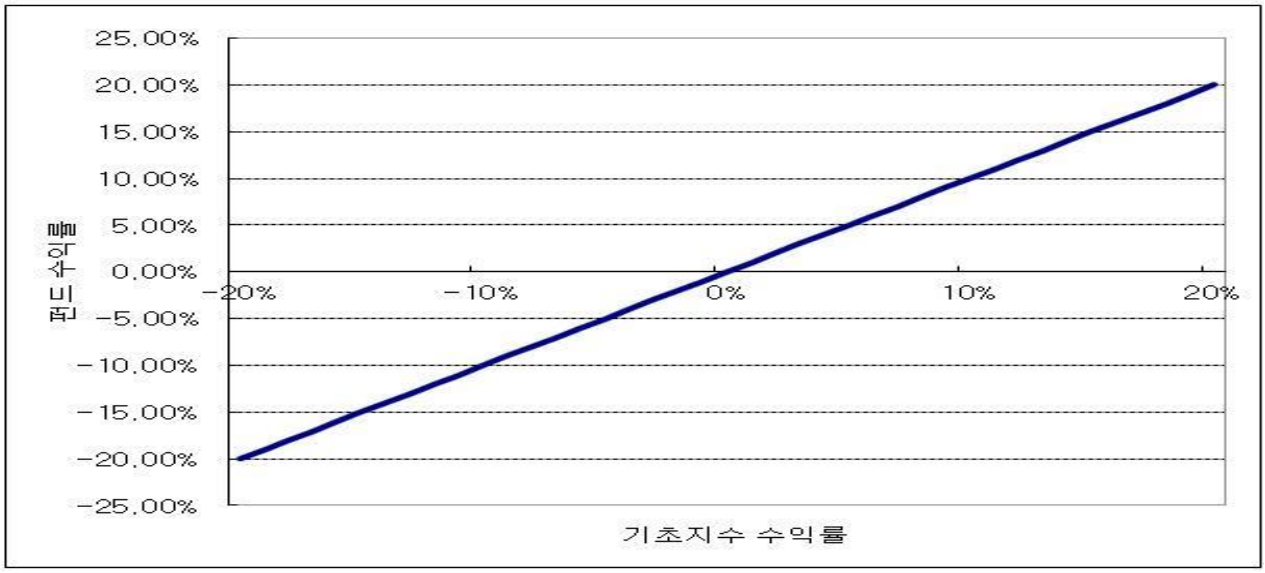
공시일: 2020-10-26

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	12,561	0	12,561	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	4,079	0	4,079	장외
합계			16,640	0	16,640	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

177

드명 : KB KBSTAR KRX300미국달러선물 혼합자산 상장지수 투자신탁(혼합-파생

공시일: 2020-10-26

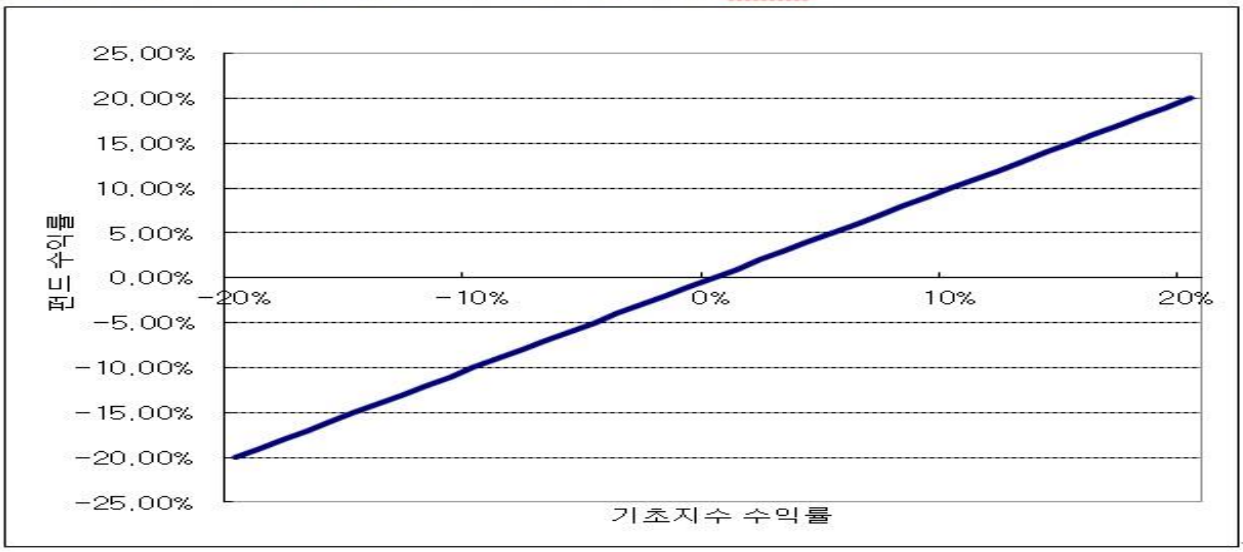
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	7,327	0	7,327	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	8,123	0	8,123	장내
합계			15,450	0	15,450	

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	650

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	734

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

공시일: 2020-10-26

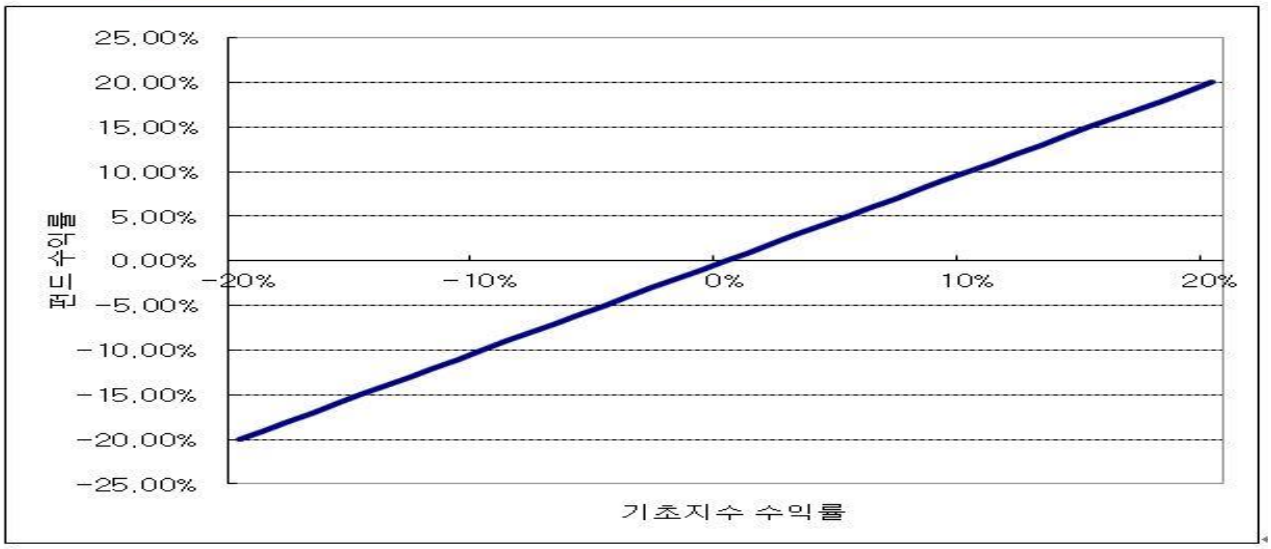
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	3,569	-3,569	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	5,690	0	5,690	장내
합계			5,690	3,569	2,121	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	877

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,448

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

공시일: 2020-10-26

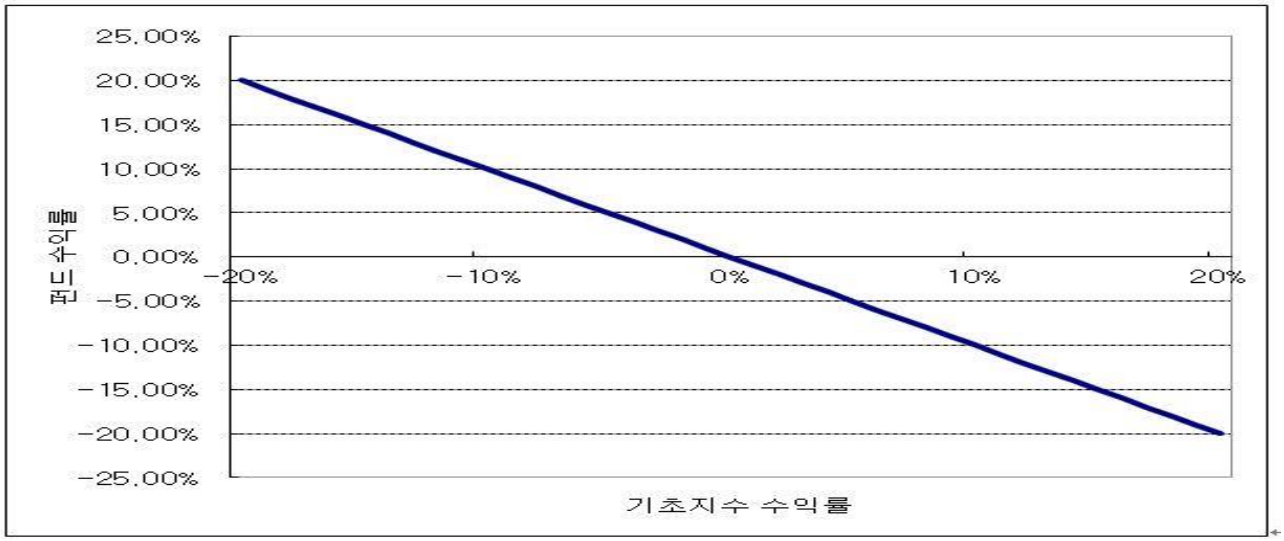
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	680	-680	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	4,064	0	4,064	장내
합계			4,064	680	3,384	

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

626

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,027

: KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 스티프너 증권 상장지수 투자신탁(채권-파

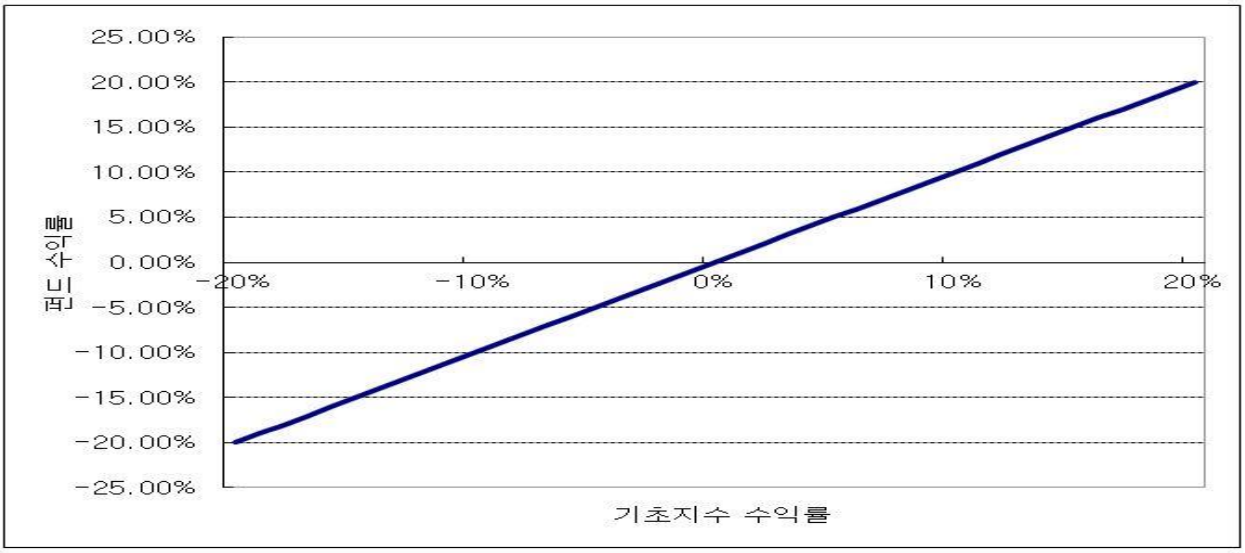
공시일: 2020-10-26

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	6,038	1,982	4,056	장내
합계			6,038	1,982	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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

483

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

23

KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 스티프너 2X 증권 상장지수 투자신탁(채권-

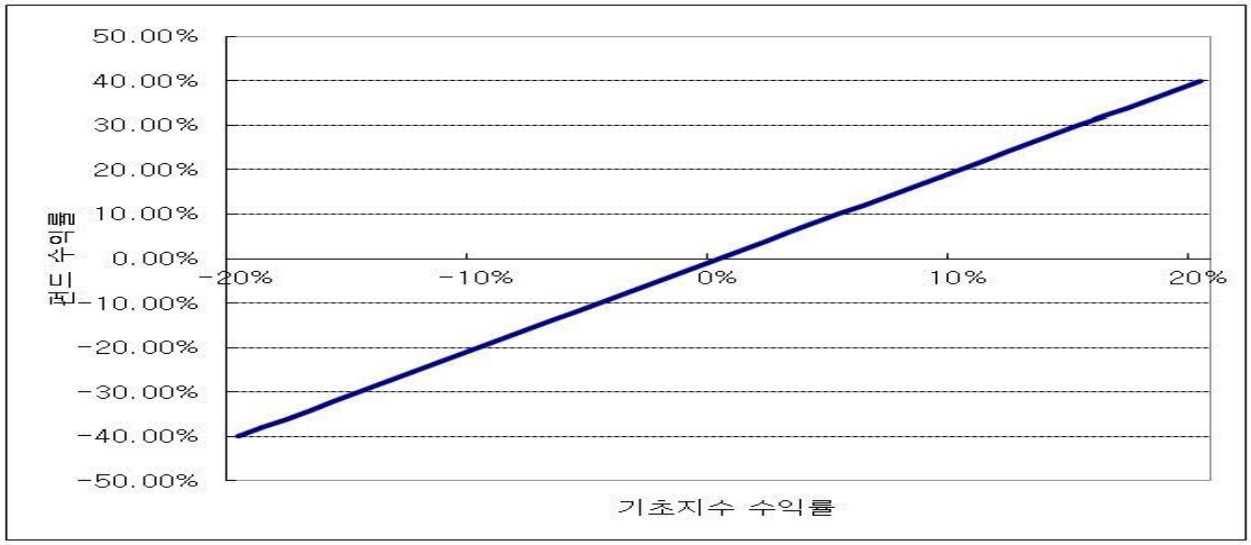
공시일: 2020-10-26

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	7,715	4,096	3,619	장내
합계			7,715	4,096	3,619	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

617

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

60

: KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 플래트너 증권 상장지수 투자신탁(채권-파

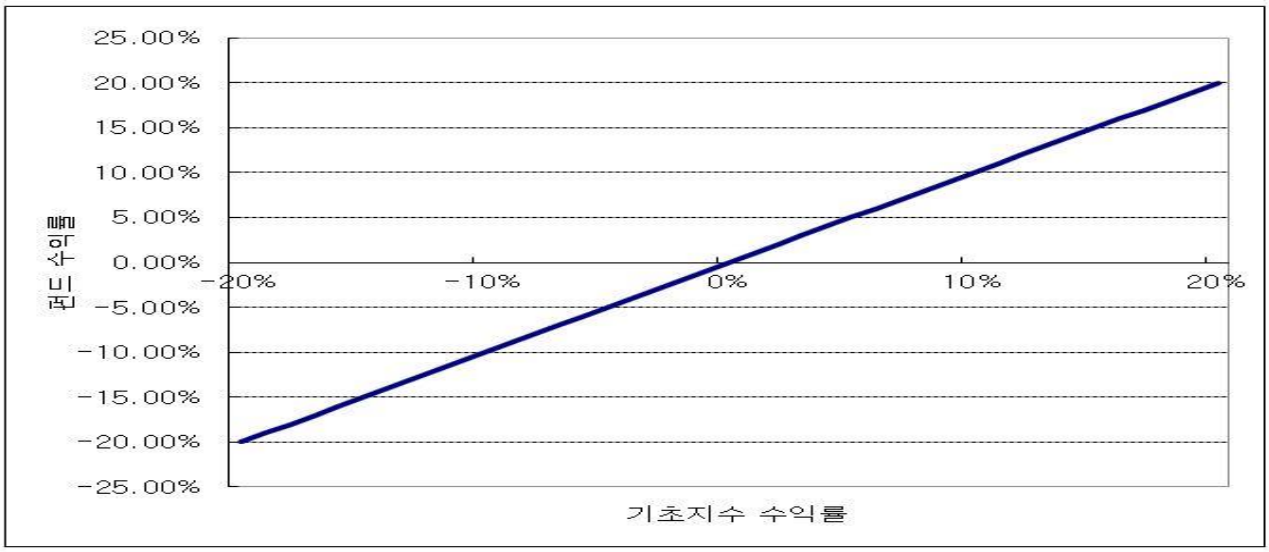
공시일: 2020-10-26

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	1,982	5,926	-3,944	장내
합계			1,982	5,926	-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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

474

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

23

KB KBSTAR KRX국채선물3년10년 플래트너 2X 증권 상장지수 투자신탁(채권-

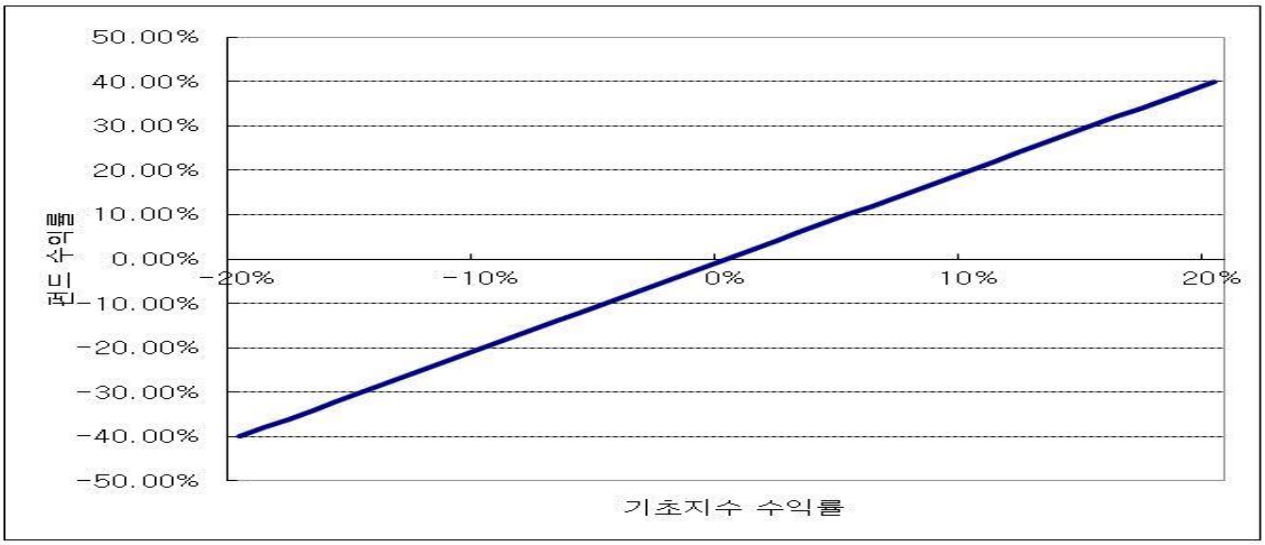
공시일: 2020-10-26

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	10,978	-10,978	장내
합계			0	10,978	-10,978	

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.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

868

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

75