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

공시일: 2020-10-27

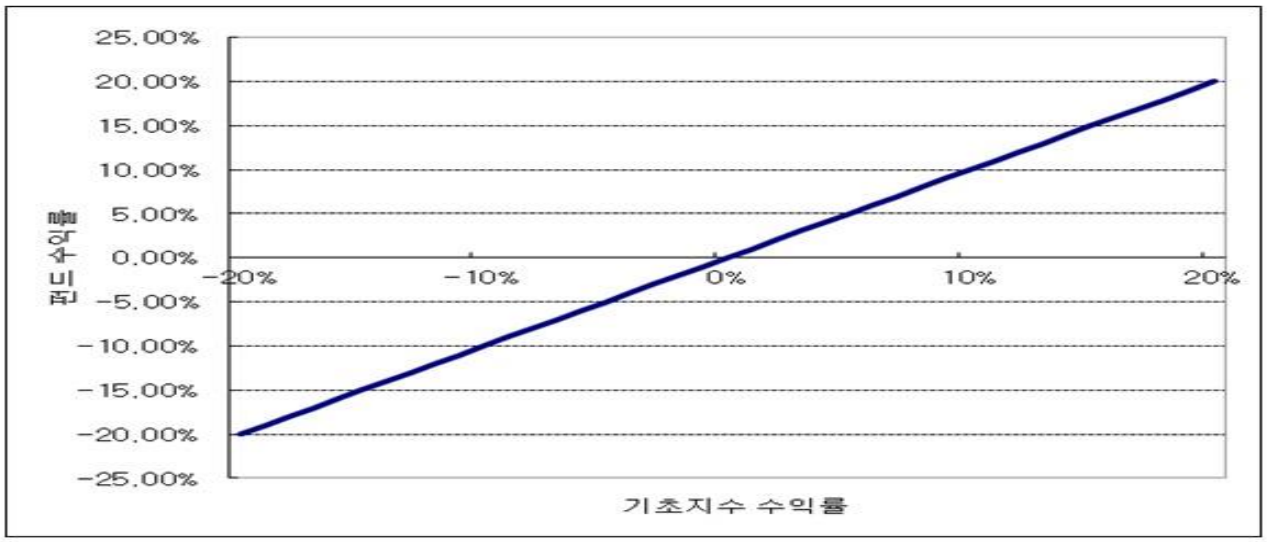
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	17,367	-17,367	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	8,452	0	8,452	장내
합계			8,452	17,367	-8,914	

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	1,389

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,149

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

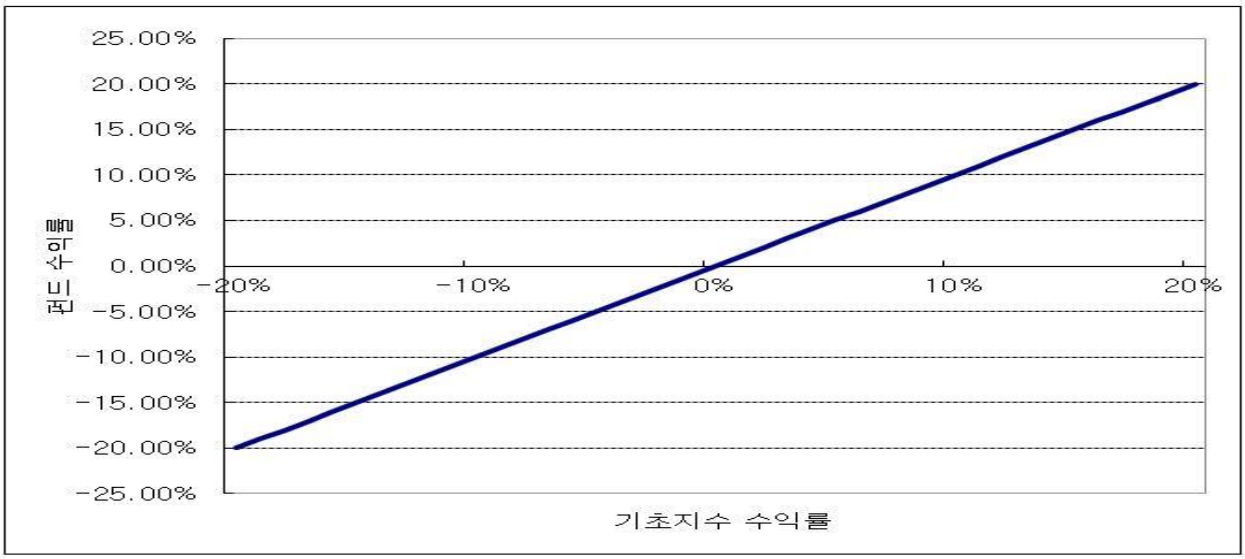
공시일: 2020-10-27

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	933	0	933	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	40	0	40	장내
합계			973	0	973	

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)

125

펀드명 : KB 액티브 인베스터 증권 모투자신탁(주식혼합-파생형)

공시일: 2020-10-27

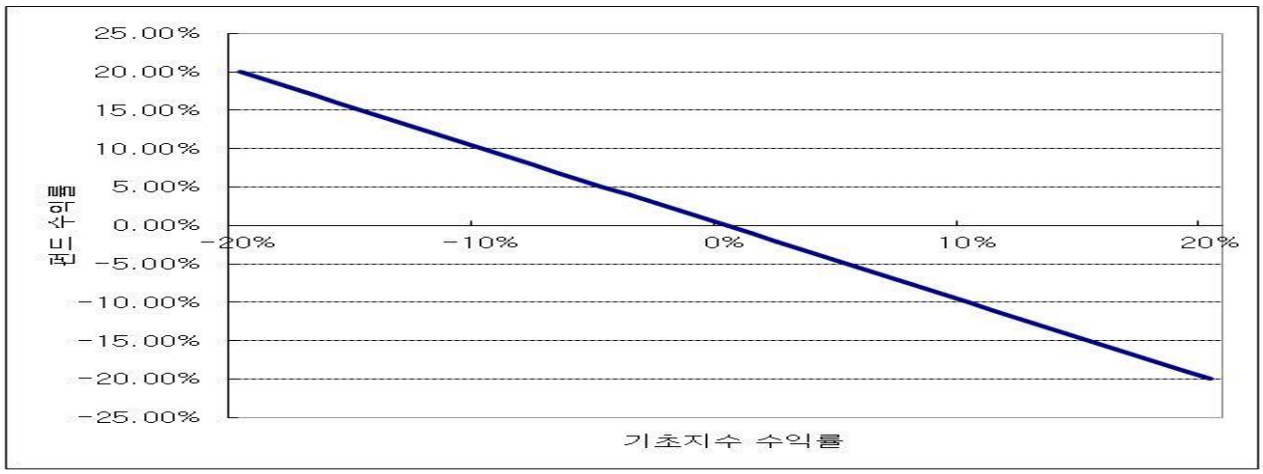
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	2,822	-2,822	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	92	-92	장내
합계			0	2,914	-2,914	

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	226

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	378

펀드명 : KB스타차이나H인덱스증권 모[주식-파생형]

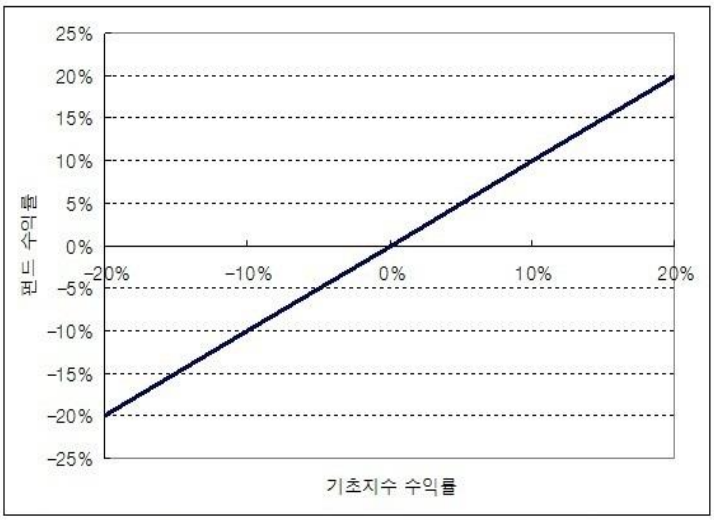
공시일: 2020-10-27

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	61,442	0	61,442	장내
신규	통화	선도	2,328	0	2,328	장외
누계	통화	선도	15,876	0	15,876	장외
합계			77,318	0	77,318	

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

9,432

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,791

펀드명 : KB스타 미국S&P500인덱스모[주식파생형]

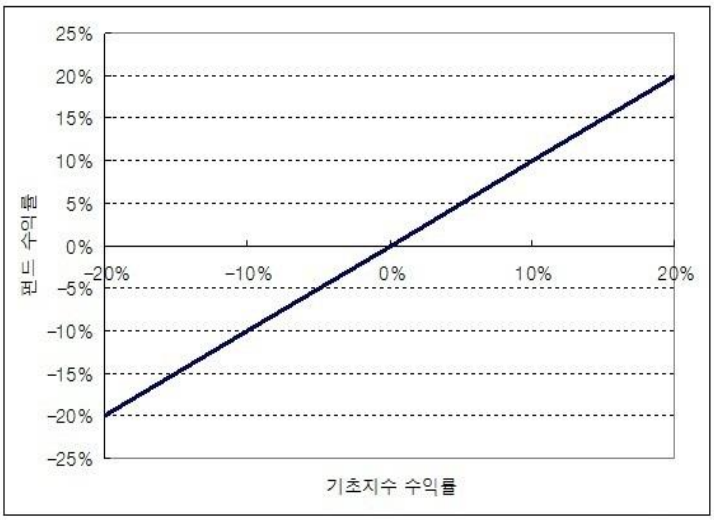
공시일: 2020-10-27

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	34,068	-34,068	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	78,627	0	78,627	장내
합계			78,627	34,068	44,559	

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	12,051

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	12,463

펀드명 : KB스타 코리아리버스인덱스(주식파생형)(운용)

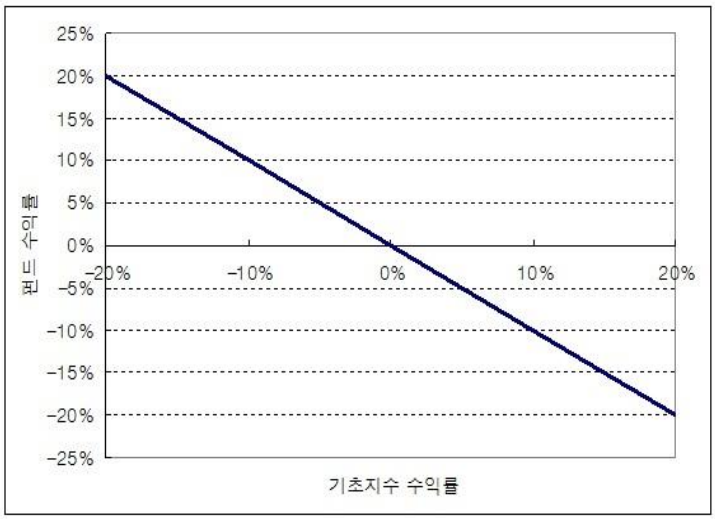
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	235	-235	장내
누계	주가지수	선물	0	46,559	-46,559	장내
합계			0	46,559	-46,559	

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

3,728

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,091

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

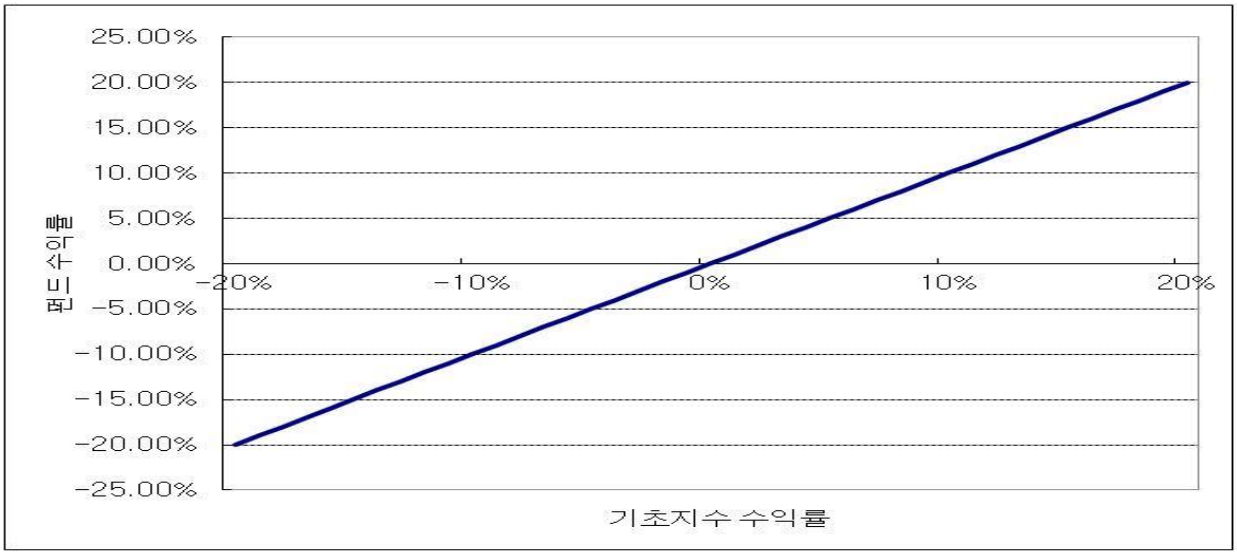
공시일: 2020-10-27

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	16,589	0	16,589	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	9,782	0	9,782	장외
합계			26,371	0	26,371	

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	2,534

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,677

펀드명 : KB 중국본토 A주 레버리지 모(주식-파생재간접)

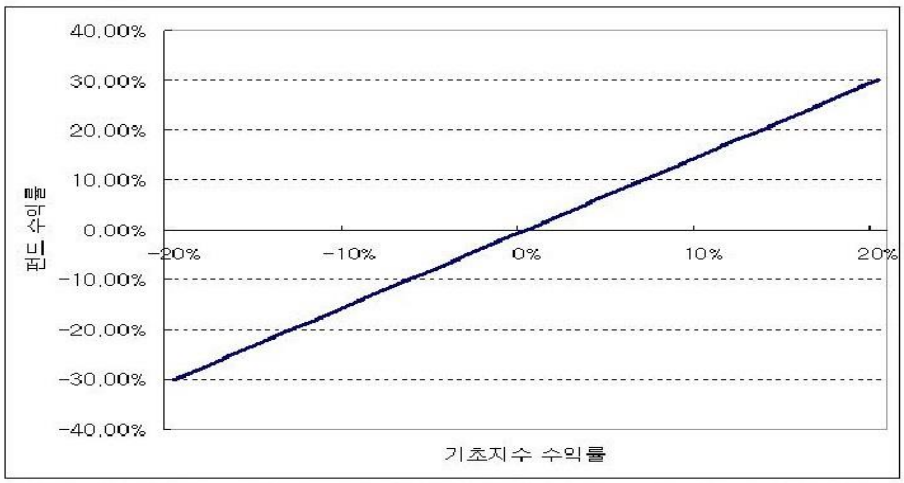
공시일: 2020-10-27

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	70,944	-70,944	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	81,741	0	81,741	장내
합계			81,741	70,944	10,797	

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

12,576

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,960

펀드명 : KB스타 코리아 레버리지1.5 증권(주식-파생형)(운용)

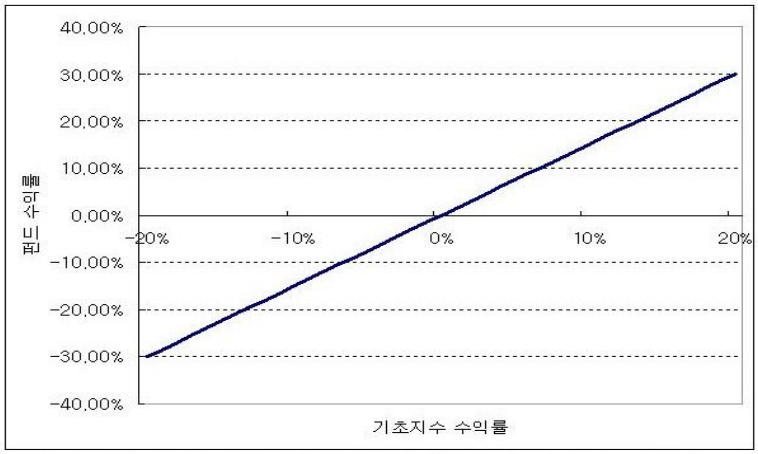
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	16	-16	장내
누계	주가지수	선물	5,597	0	5,597	장내
합계			5,597	0	5,597	

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

448

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

732

펀드명 : KB스타 코리아 레버리지2.0 증권(주식-파생형)(운용)

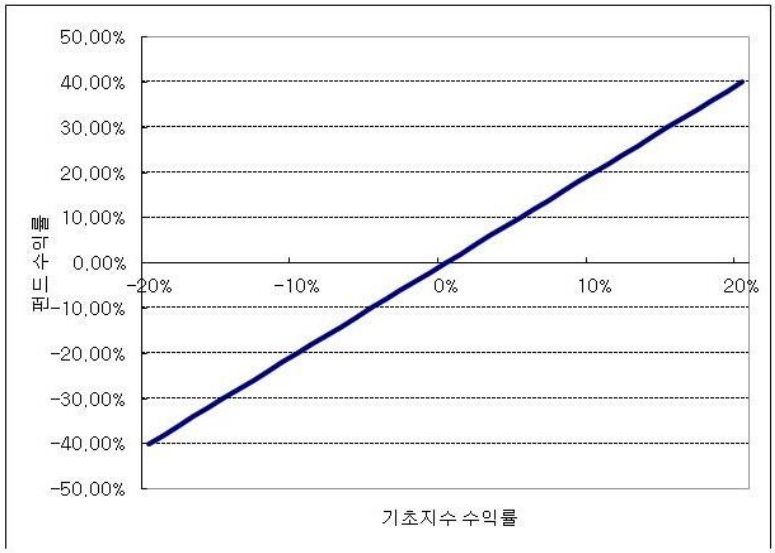
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	784	-784	장내
누계	주가지수	선물	161,703	0	161,703	장내
합계			161,703	0	161,703	

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

12,853

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

21,157

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

공시일: 2020-10-27

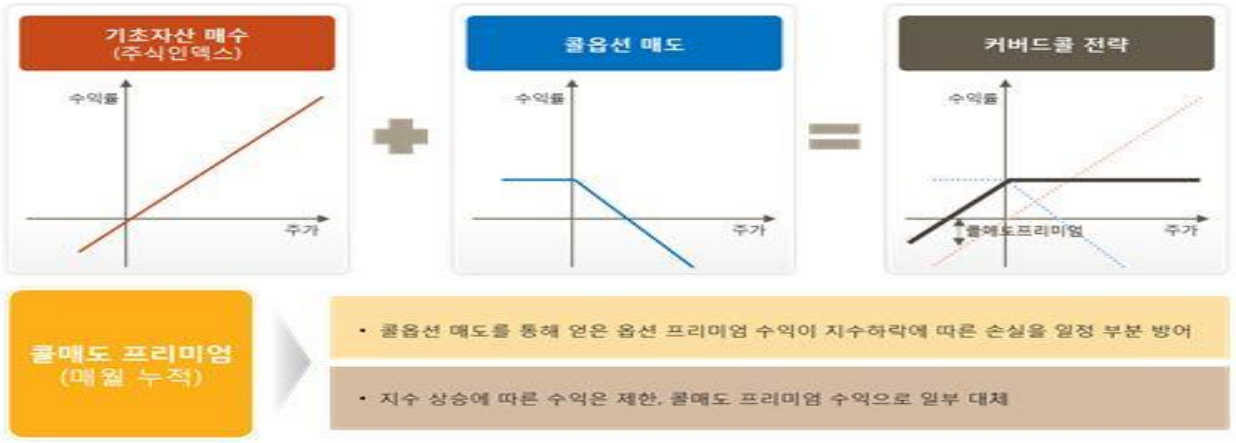
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	627	0	627	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	181	0	181	장내
합계			808	0	808	

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: 2020-10-27

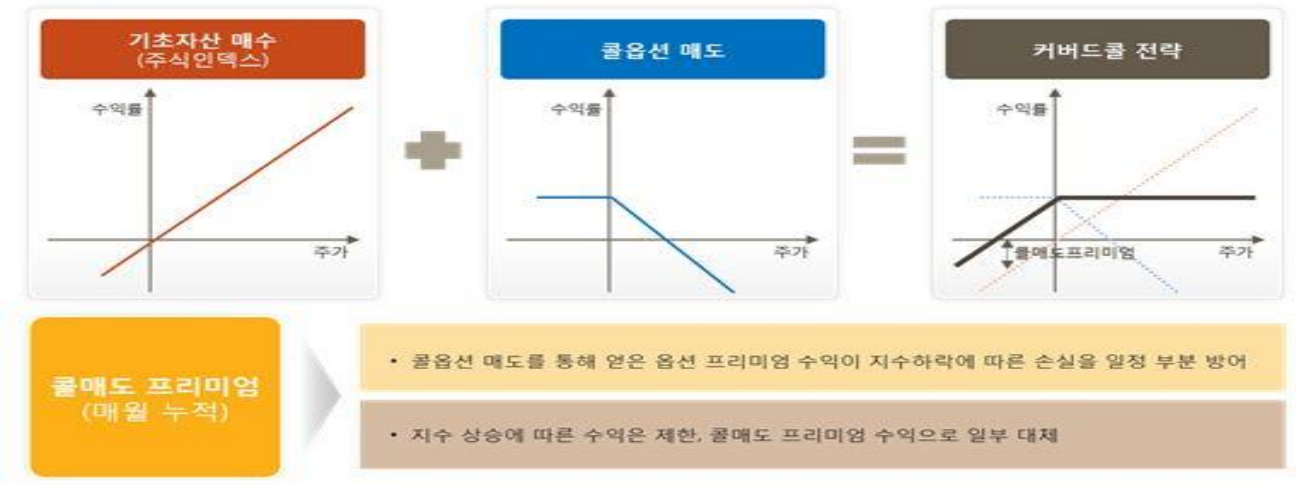
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	580	0	580	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	547	0	547	장외
합계			1,127	0	1,127	

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	89

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	85

펀드명 : KB스타 코스닥150 인덱스 증권 모(주식-파생형)

공시일: 2020-10-27

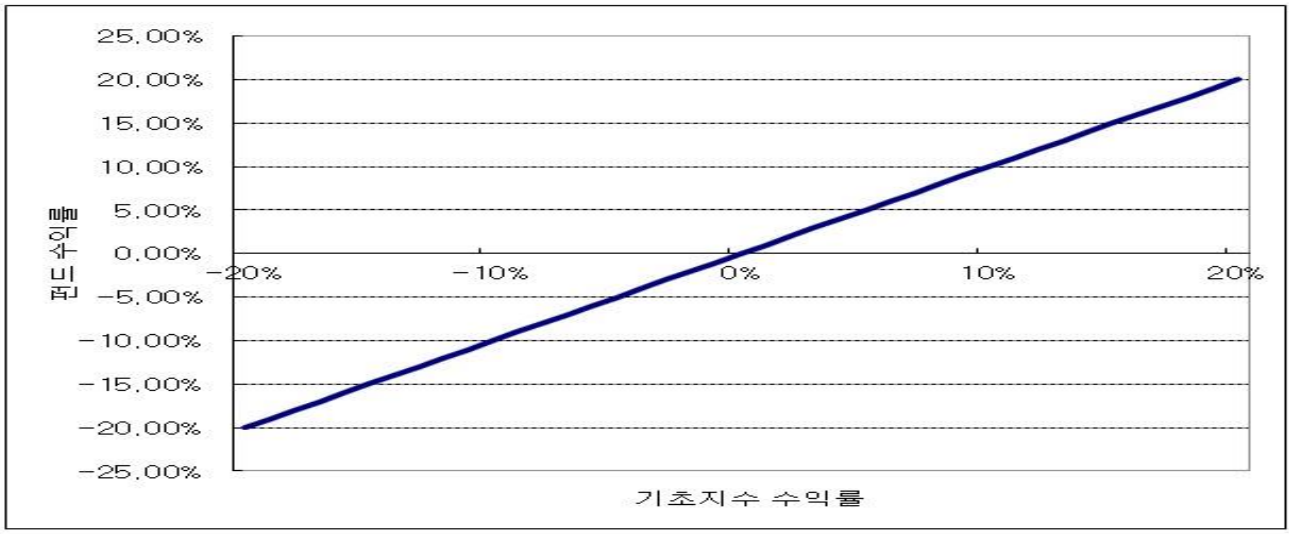
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	93,453	0	93,453	장내
합계			93,453	0	93,453	

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

7,402

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,328

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

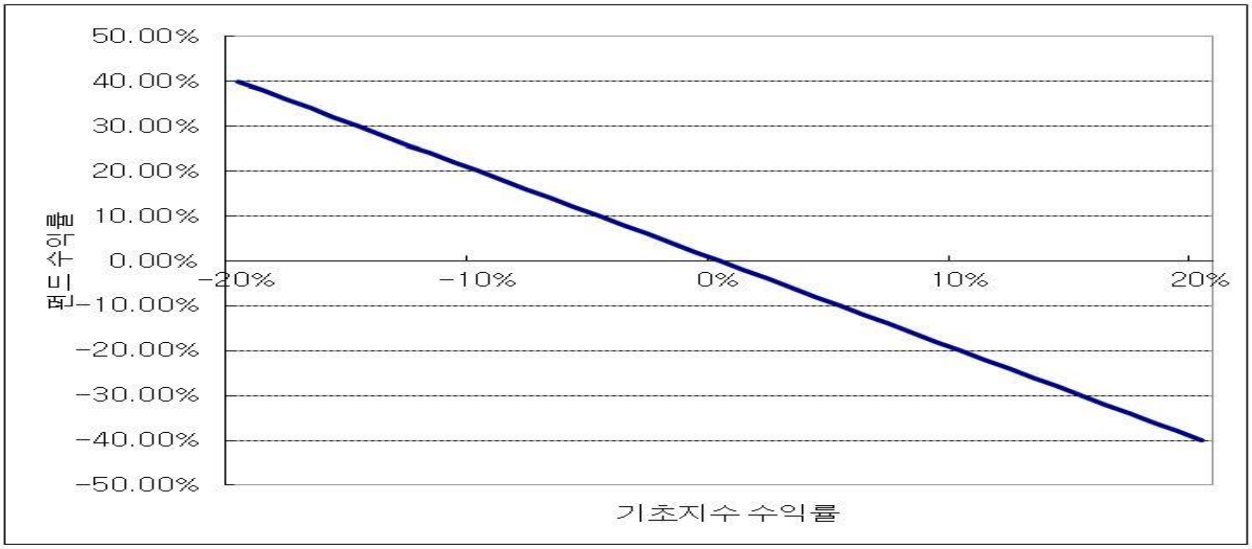
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,333	-1,333	장내
누계	주가지수	선물	0	31,588	-31,588	장내
합계			0	31,588	-31,588	

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

2,529

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,132

펀드명 : KB 차이나 H 인버스 인덱스 증권(주식-파생형)(운용)

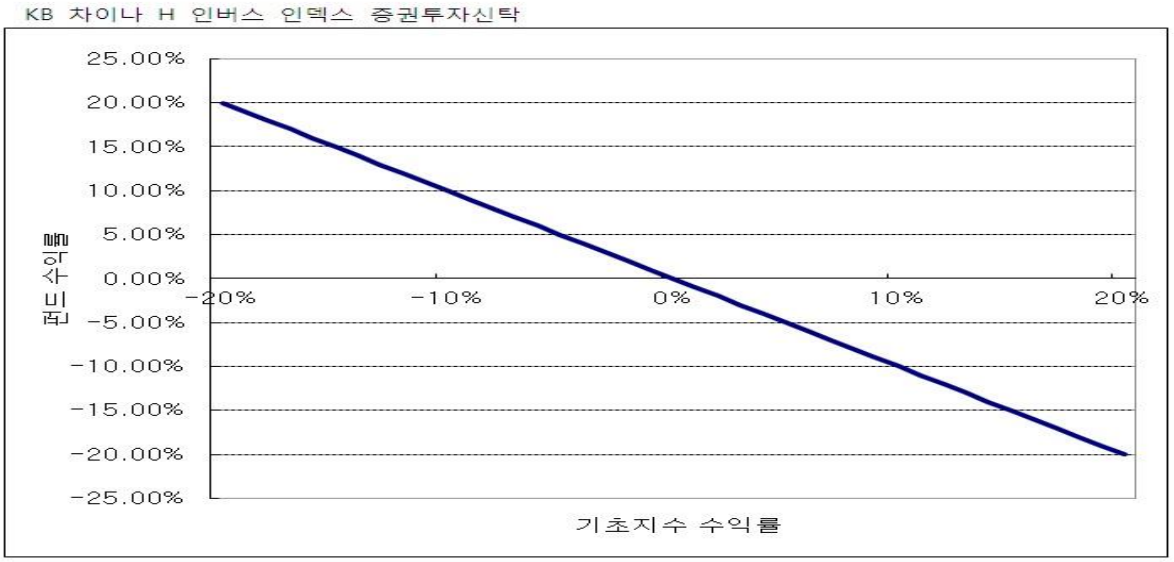
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,105	147	958	장내
누계	주가지수	선물	2,431	0	2,431	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	568	0	568	장외
합계			2,999	0	2,999	

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

373

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

228

펀드명 : KB스타 이머징 인덱스 증권 모투자신탁(주식-파생형)

공시일: 2020-10-27

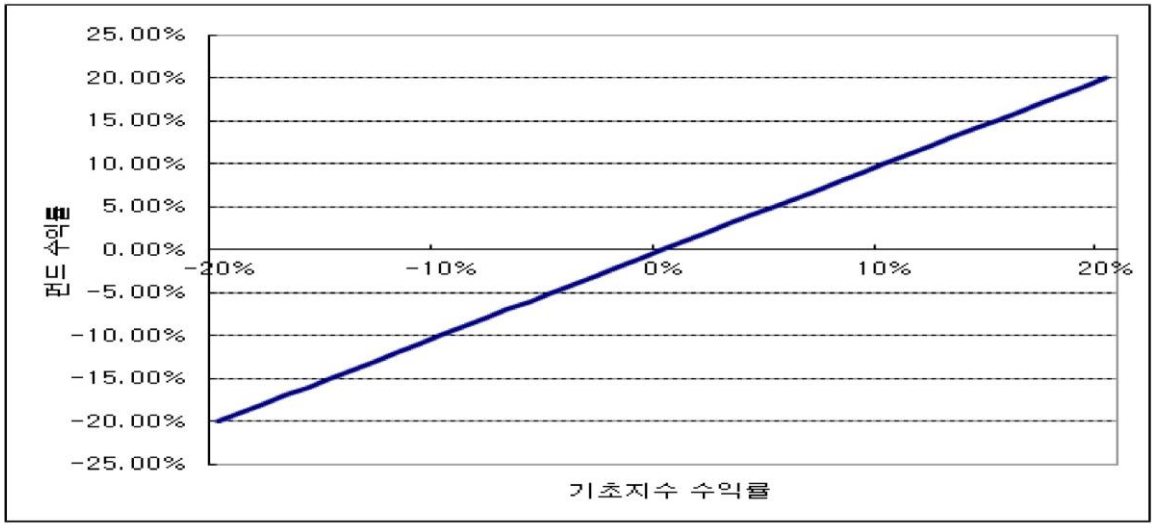
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	2,932	-2,932	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	5,292	0	5,292	장내
합계			5,292	2,932	2,360	

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	811

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	530

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

공시일: 2020-10-27

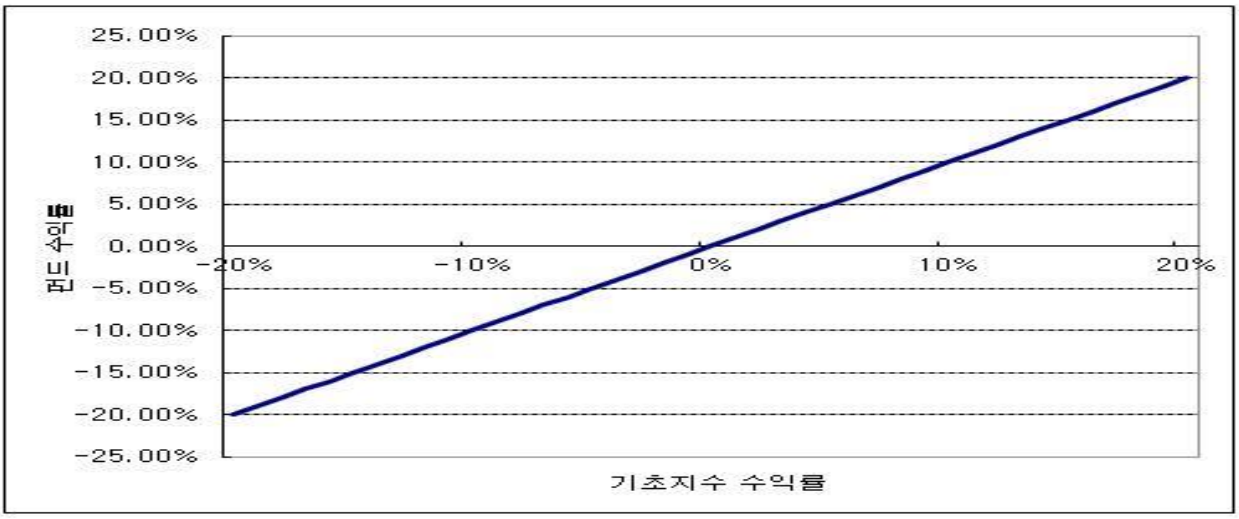
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	17,694	-17,694	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	41,777	0	41,777	장내
합계			41,777	17,694	24,083	

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

6,410

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,932

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

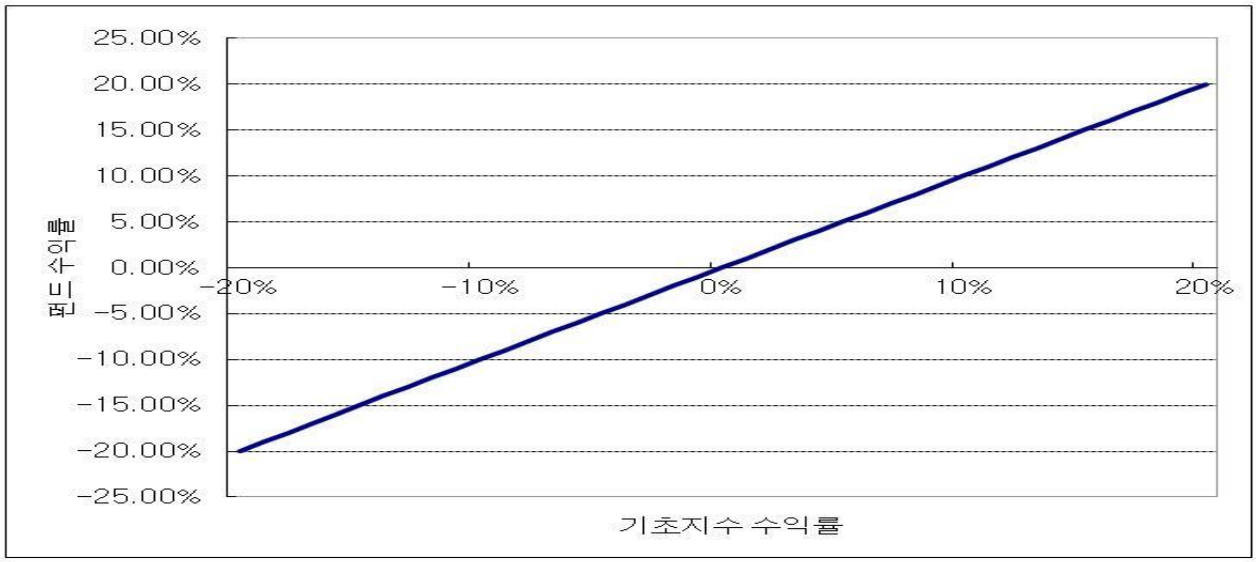
공시일: 2020-10-27

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	274	0	274	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	175	0	175	장내
합계			450	0	450	

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)	61

펀드명 : KB스타코리아인덱스(주식-파생형)(운용)

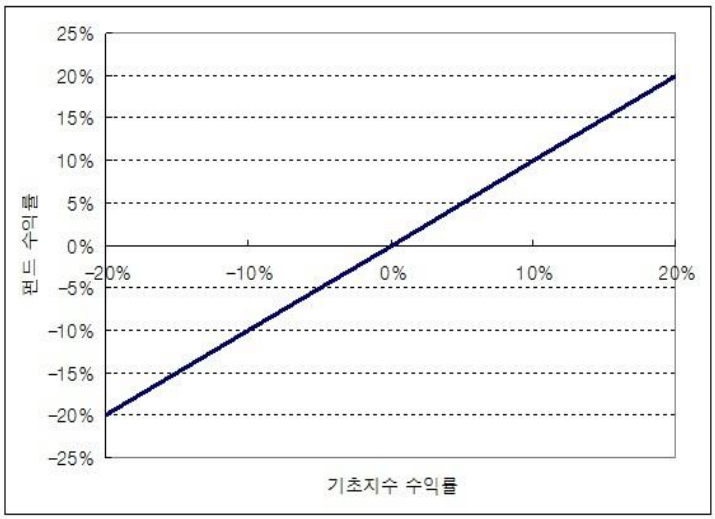
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	353	470	-118	장내
누계	주가지수	선물	6,819	1,293	5,526	장내
합계			6,819	1,293	5,526	

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

490

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

724

펀드명 : KB스타 재팬 인덱스 증권 모(주식-파생형)

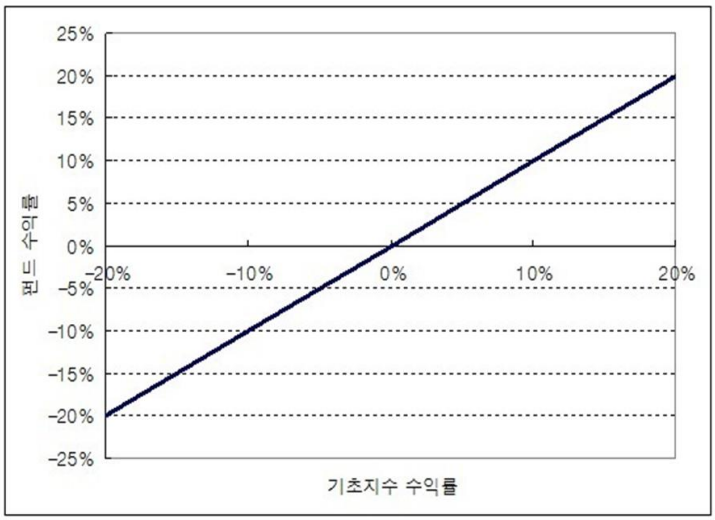
공시일: 2020-10-27

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	10,358	0	10,358	장내
신규	통화	선도	323	0	323	장외
누계	통화	선도	3,161	0	3,161	장외
합계			13,520	0	13,520	

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	1,590

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,021

펀드명 : KB스타 골드(금-파생형)(운용)

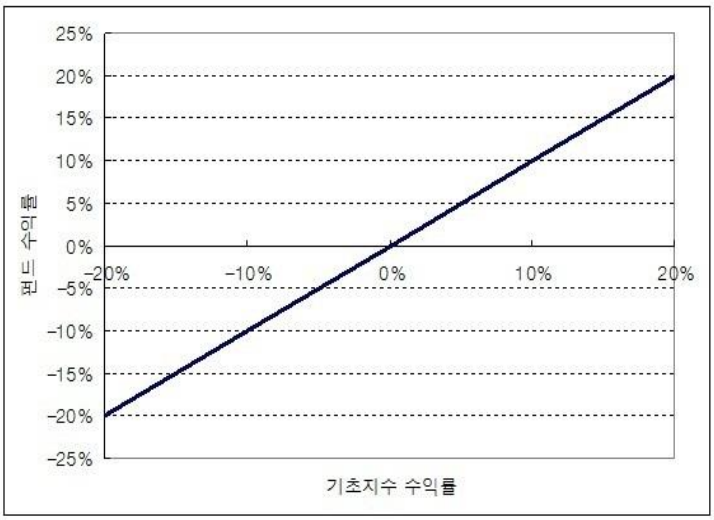
공시일: 2020-10-27

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	4,962	-4,962	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	60,908	0	60,908	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	11,027	0	11,027	장외
합계			71,935	4,962	66,973	

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

9,375

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,414

펀드명 : KB스타 유로 인덱스 증권 모(주식-파생형)

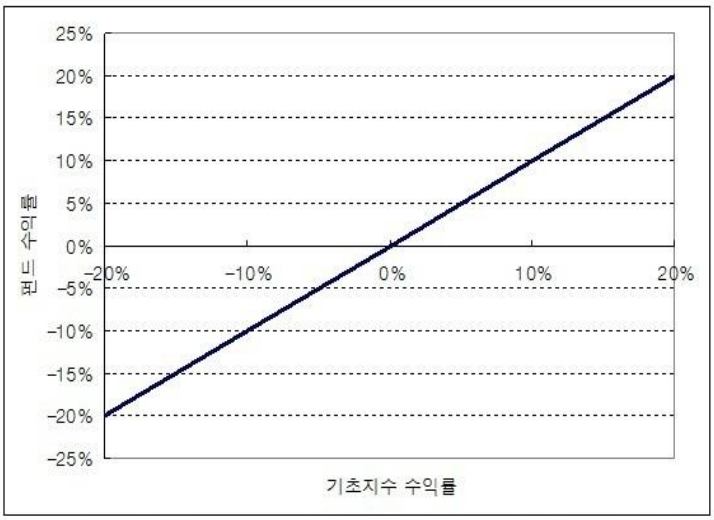
공시일: 2020-10-27

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	19,224	0	19,224	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	9,233	0	9,233	장외
합계			28,457	0	28,457	

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

2,945

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,748

펀드명 : KB 원자재 특별자산 모투자신탁[상품파생형]

공시일: 2020-10-27

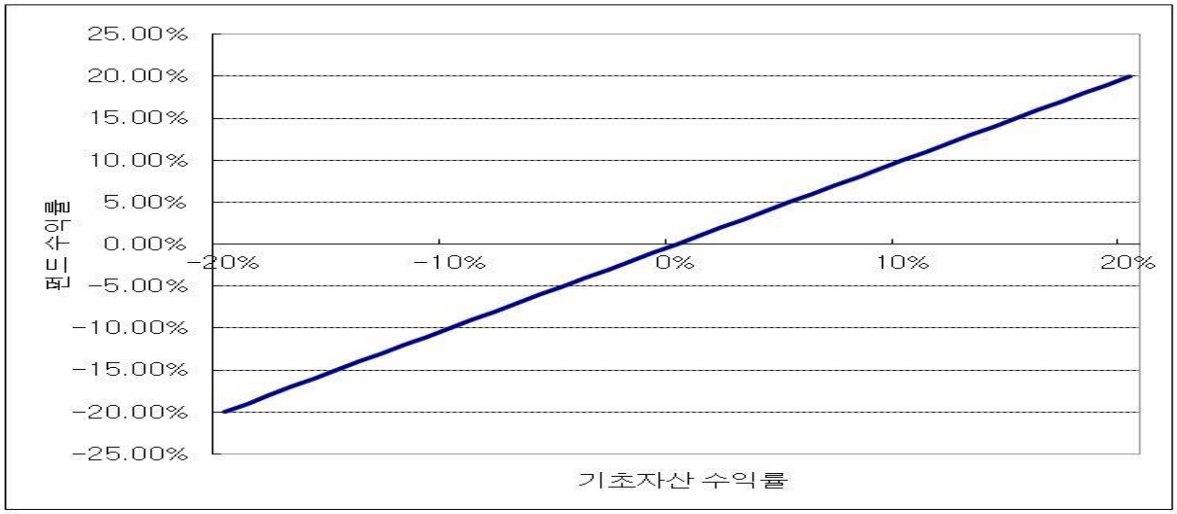
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	1,229	-1,229	장내
신규	상품	선물	171	171	0	장내
누계	상품	선물	2,968	0	2,968	장내
합계			2,968	1,229	1,739	

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)	406

펀드명 : KB KStar 주식혼합 증권 ETF

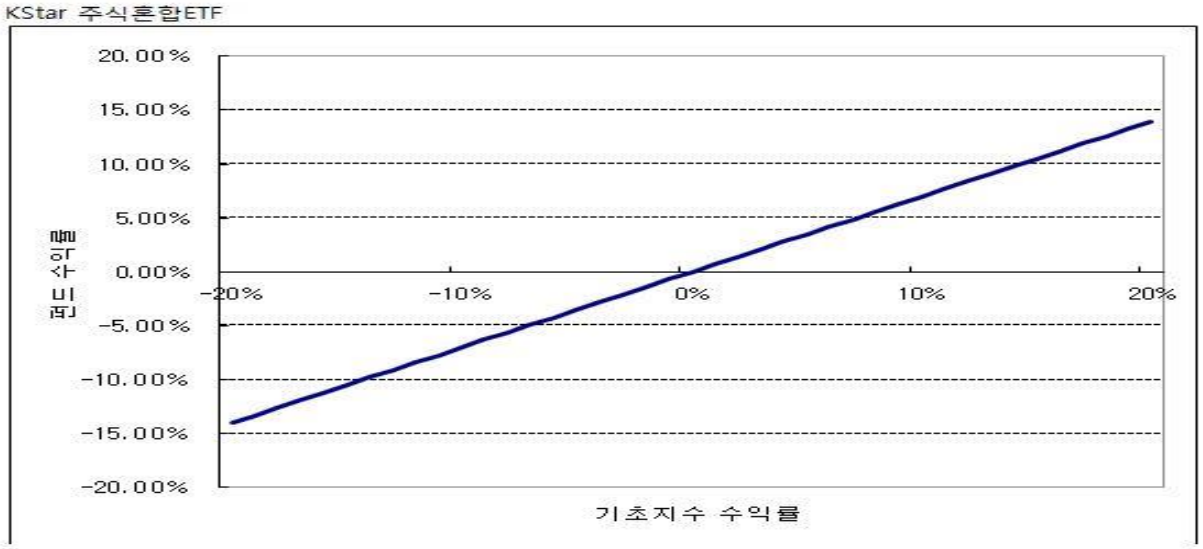
공시일: 2020-10-27

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	302	0	302	장내
합계			526	0	526	

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

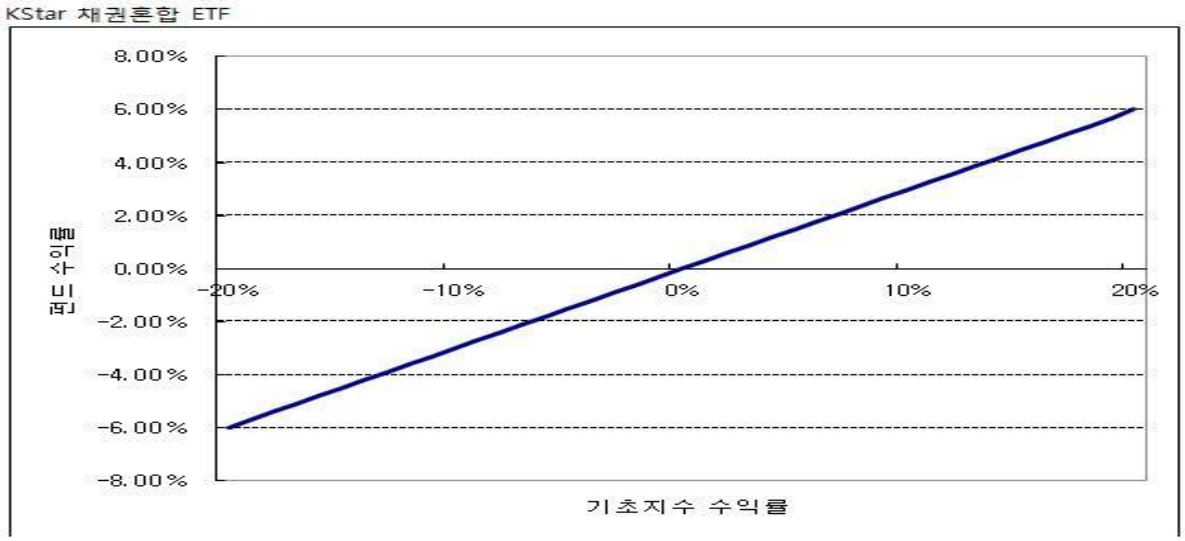
공시일: 2020-10-27

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			405	0	405	

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)

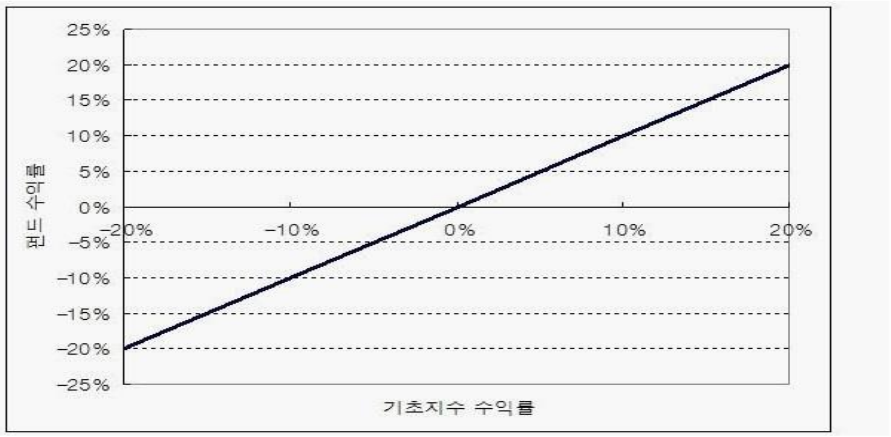
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	6,743	0	6,743	장외
누계	주가지수	스왑	46,719	0	46,719	장외
합계			46,719	0	46,719	

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

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15,408

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

공시일: 2020-10-27

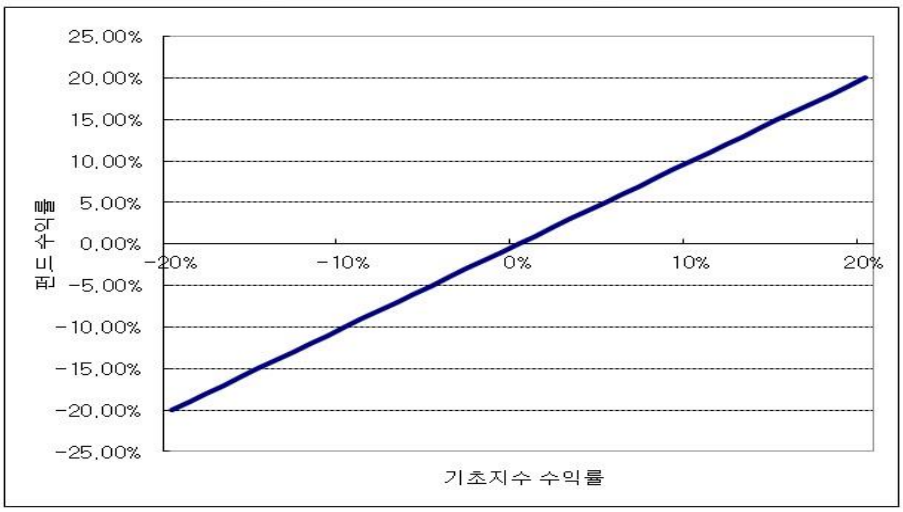
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	810	0	810	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	6,112	0	6,112	장외
합계			6,922	0	6,922	

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

124

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

295

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

공시일: 2020-10-27

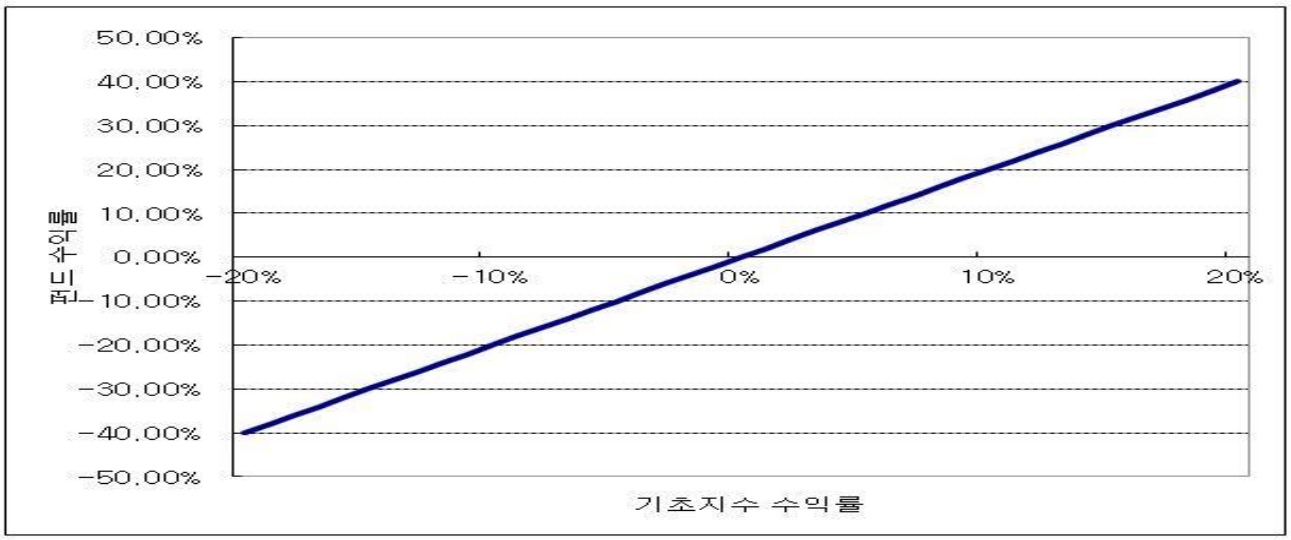
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	314	-314	장내
누계	주가지수	선물	80,734	0	80,734	장내
합계			80,734	0	80,734	

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

6,464

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

10,561

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

공시일: 2020-10-27

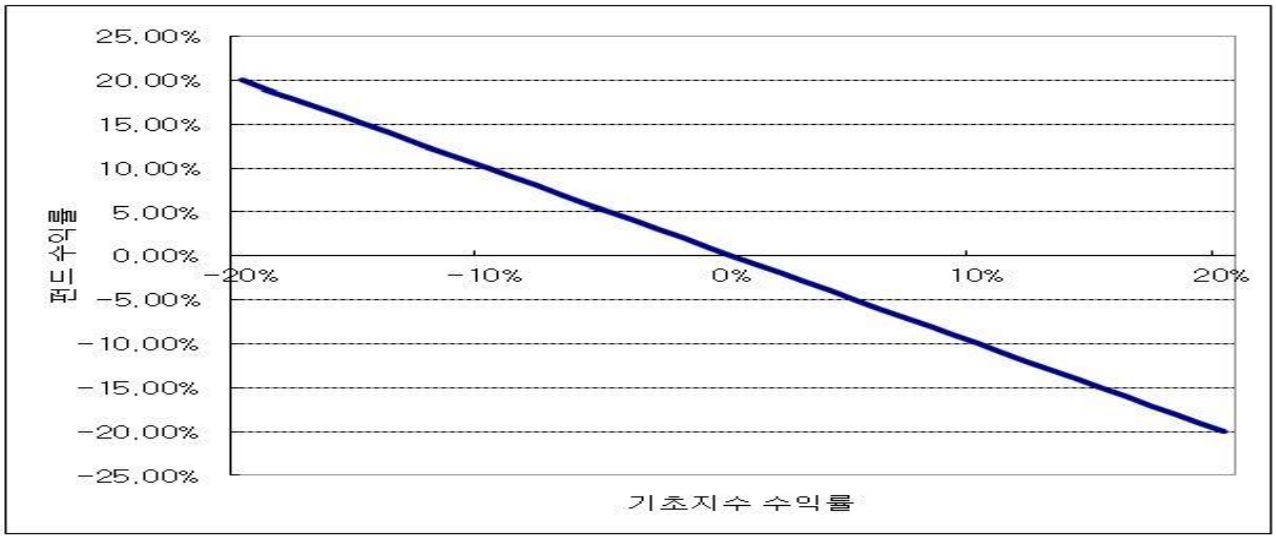
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	4,625	-4,625	장내
합계			0	4,625	-4,625	

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

370

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

605

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

공시일: 2020-10-27

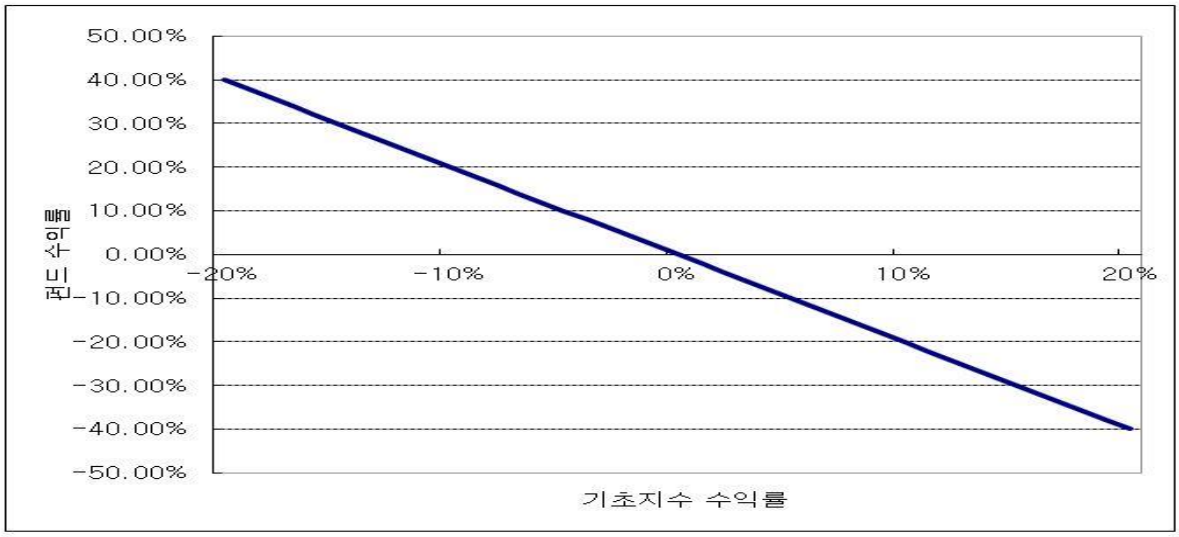
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	784	-784	장내
누계	주가지수	선물	0	67,879	-67,879	장내
합계			0	67,879	-67,879	

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

5,435

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,880

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

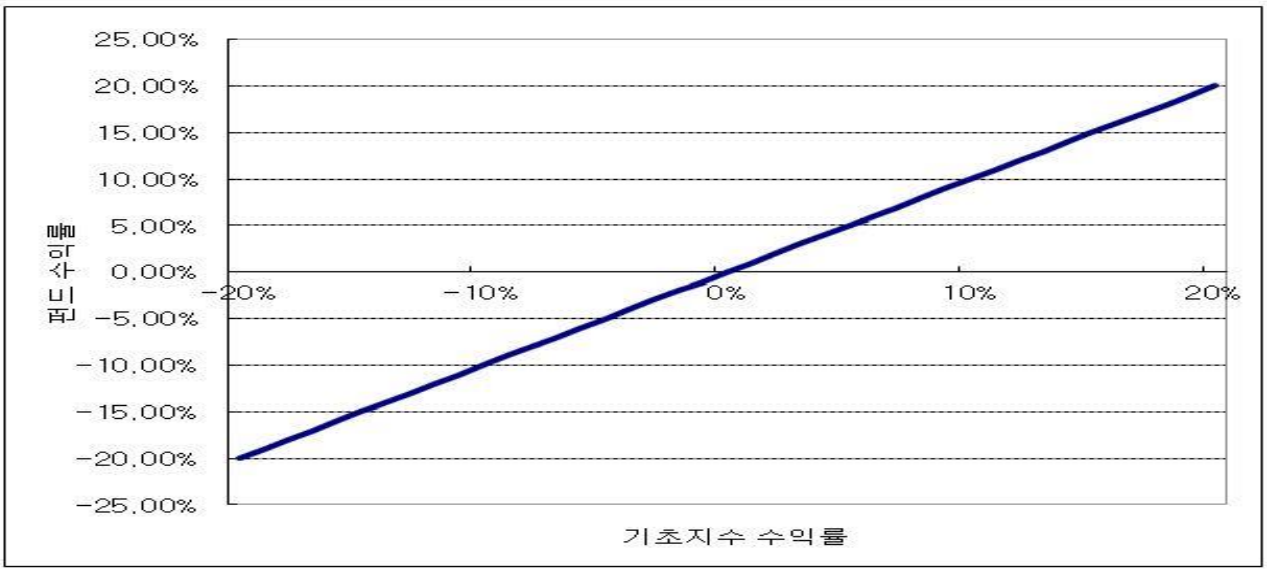
공시일: 2020-10-27

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	5,286	0	5,286	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	3,045	0	3,045	장외
합계			8,331	0	8,331	

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

812

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

347

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

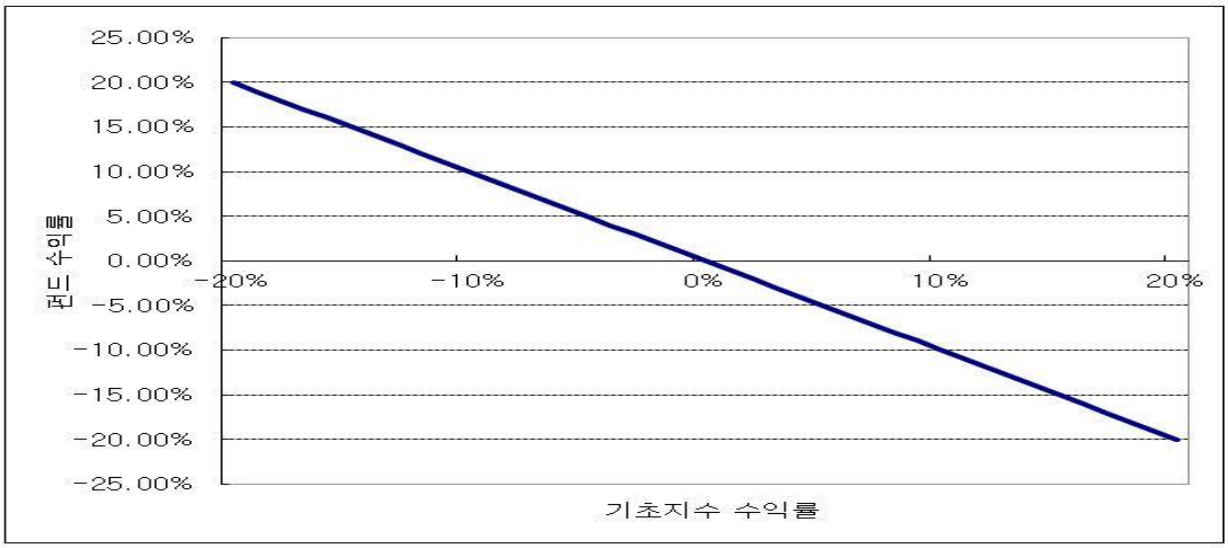
공시일: 2020-10-27

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	3,132	0	3,132	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	1,804	0	1,804	장외
합계			4,937	0	4,937	

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

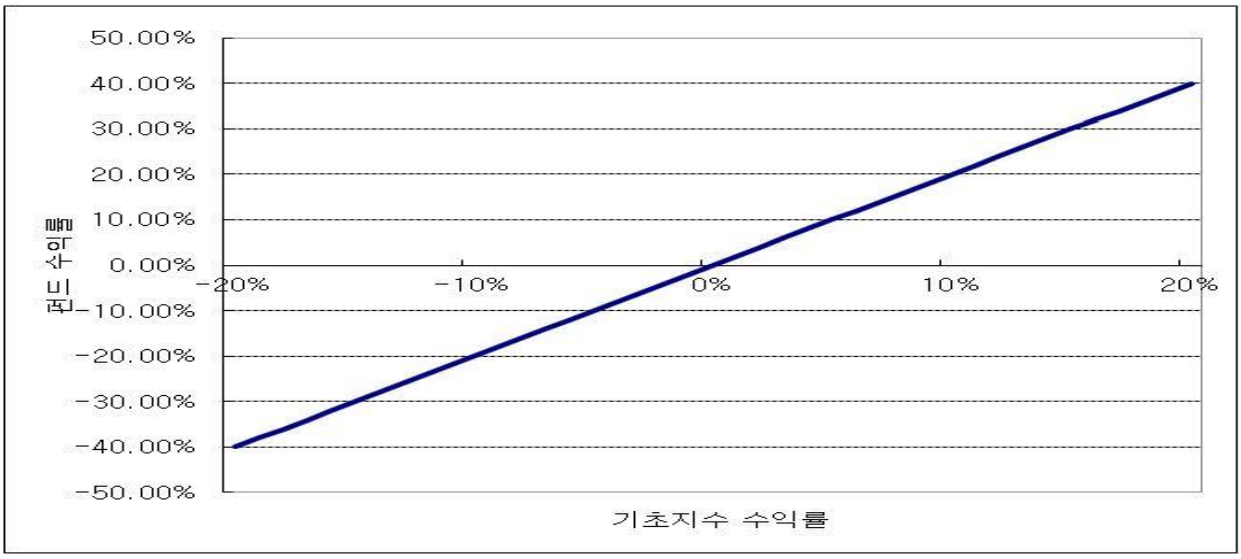
공시일: 2020-10-27

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	7,236	0	7,236	장외
합계			7,236	0	7,236	

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

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

988

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

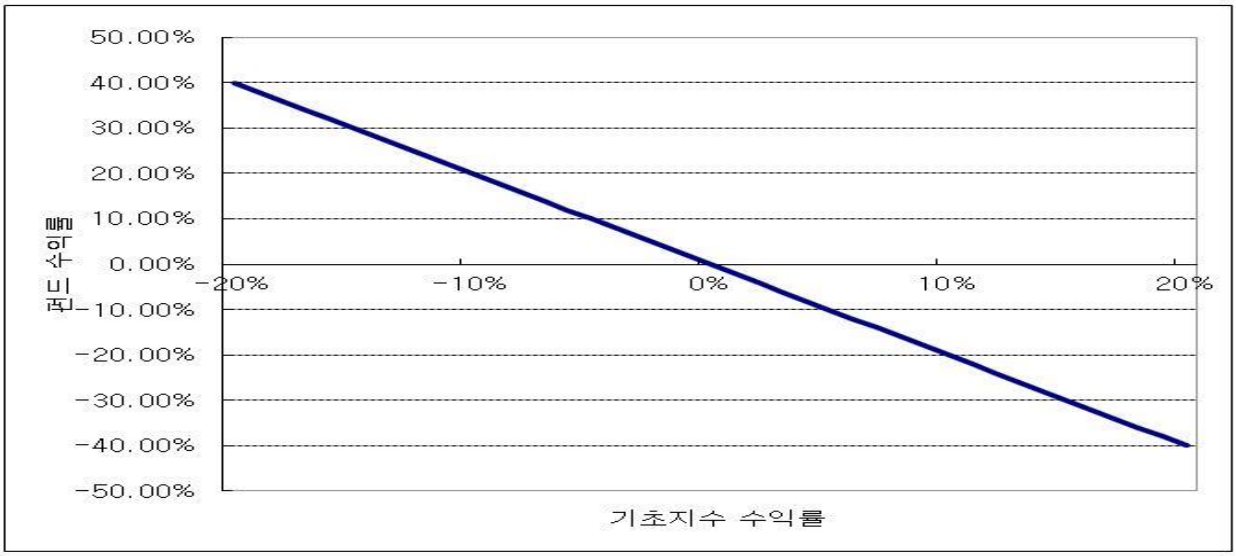
공시일: 2020-10-27

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	2,770	0	2,770	장외
합계			2,770	0	2,770	

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

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

330

펀드명 : KB KBSTAR 코스닥150선물인버스증권 상장지수 투자신탁(주식-파생형

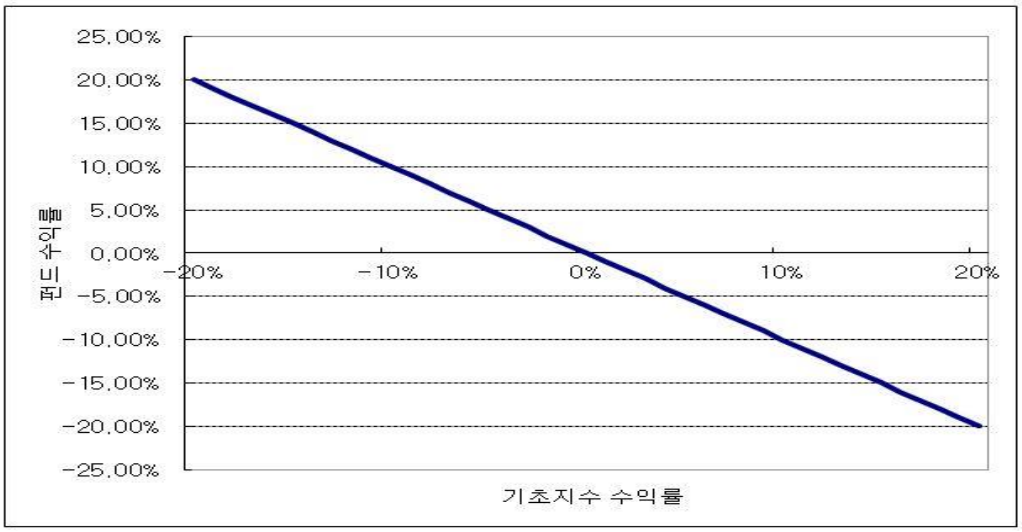
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	400	-400	장내
누계	주가지수	선물	0	6,514	-6,514	장내
합계			0	6,514	-6,514	

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

516

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,068

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

공시일: 2020-10-27

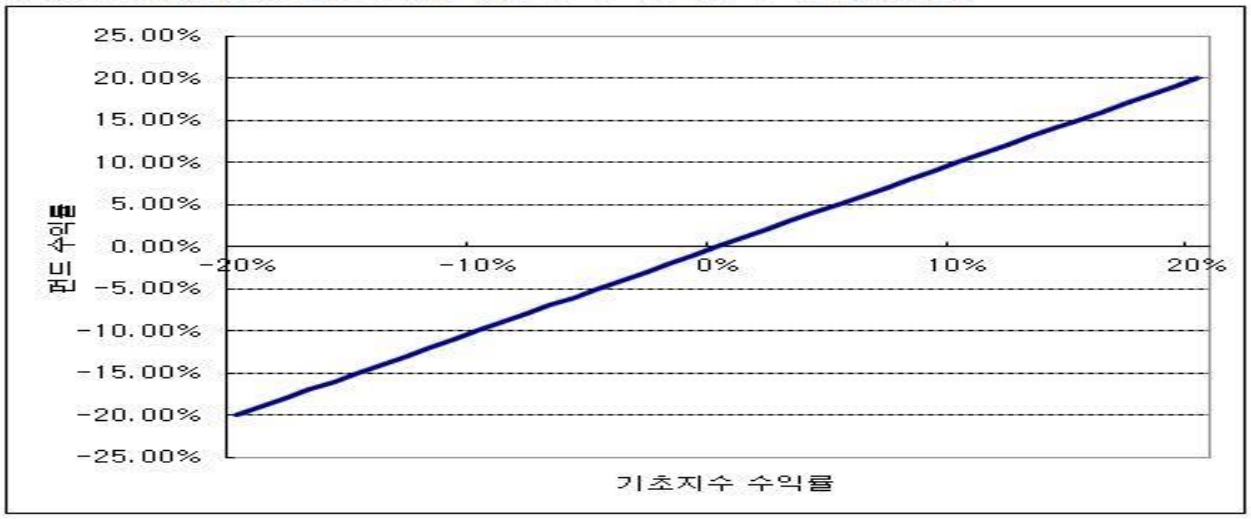
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	7,868	0	7,868	장외
합계			7,868	0	7,868	

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

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,239

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

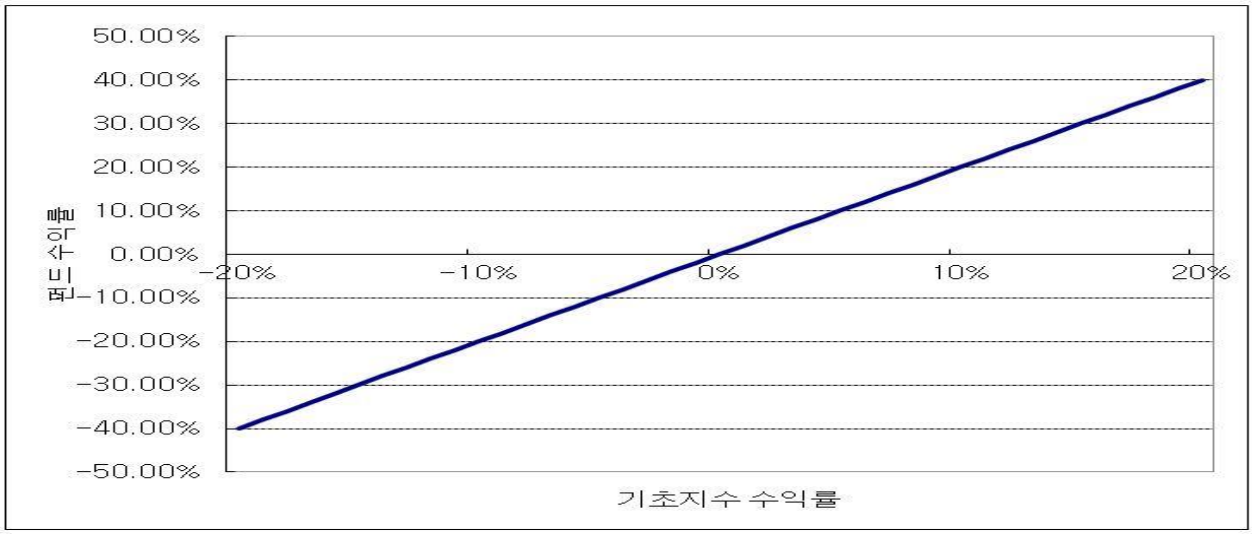
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	9,877	-9,877	장내
누계	주가지수	선물	269,811	0	269,811	장내
합계			269,811	0	269,811	

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

21,370

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

44,255

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

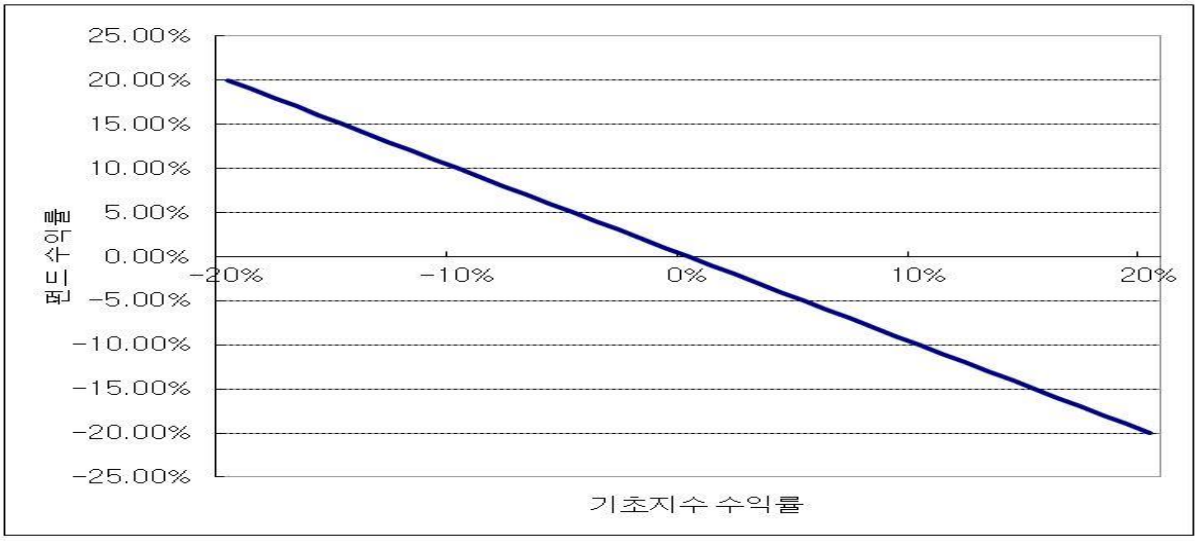
공시일: 2020-10-27

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	283,158	-283,158	장내
합계			0	283,158	-283,158	

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

22,642

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,888

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

공시일: 2020-10-27

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	314	0	314	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	194	0	194	장내
합계			508	0	508	

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)	67

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

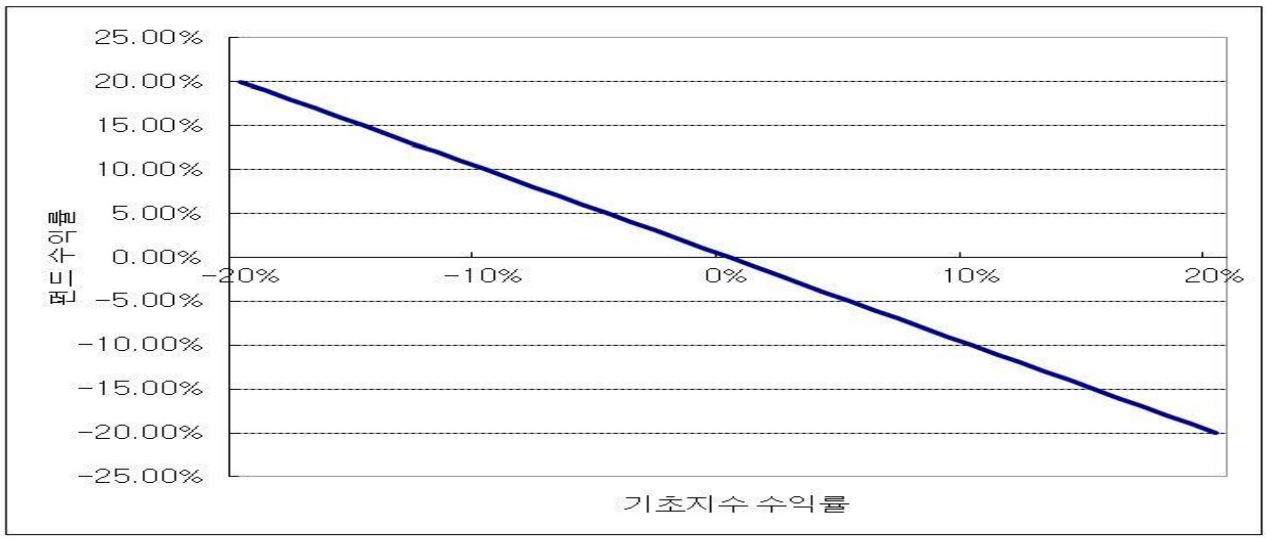
공시일: 2020-10-27

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	4,862	0	4,862	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	1,892	0	1,892	장외
합계			6,754	0	6,754	

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	746

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	465

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

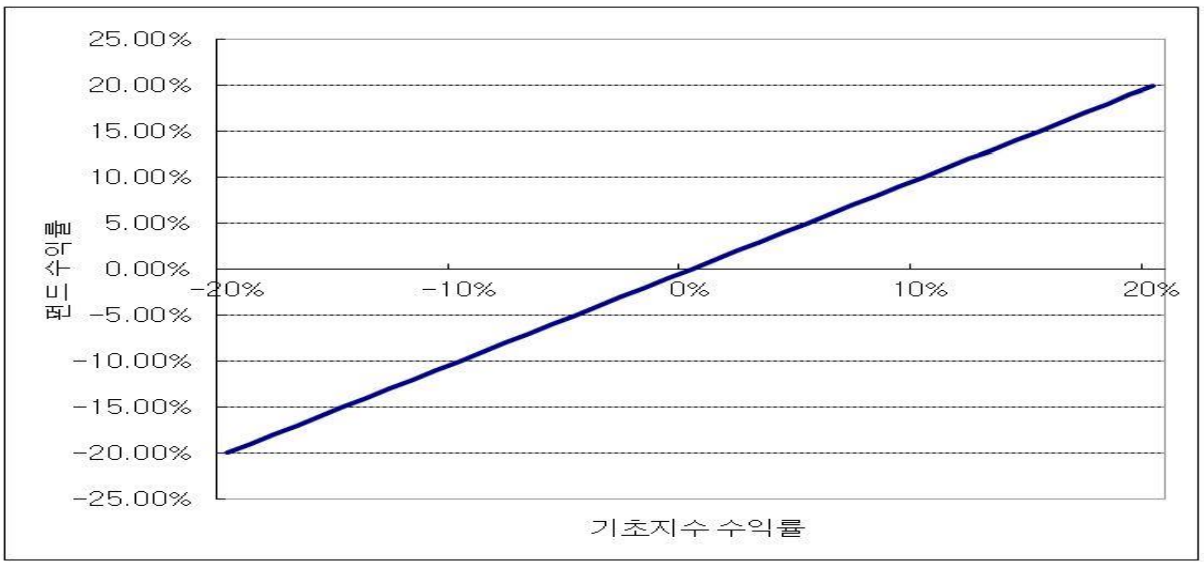
공시일: 2020-10-27

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	16,725	0	16,725	장내
합계			16,725	0	16,725	

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

1,337

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

411

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

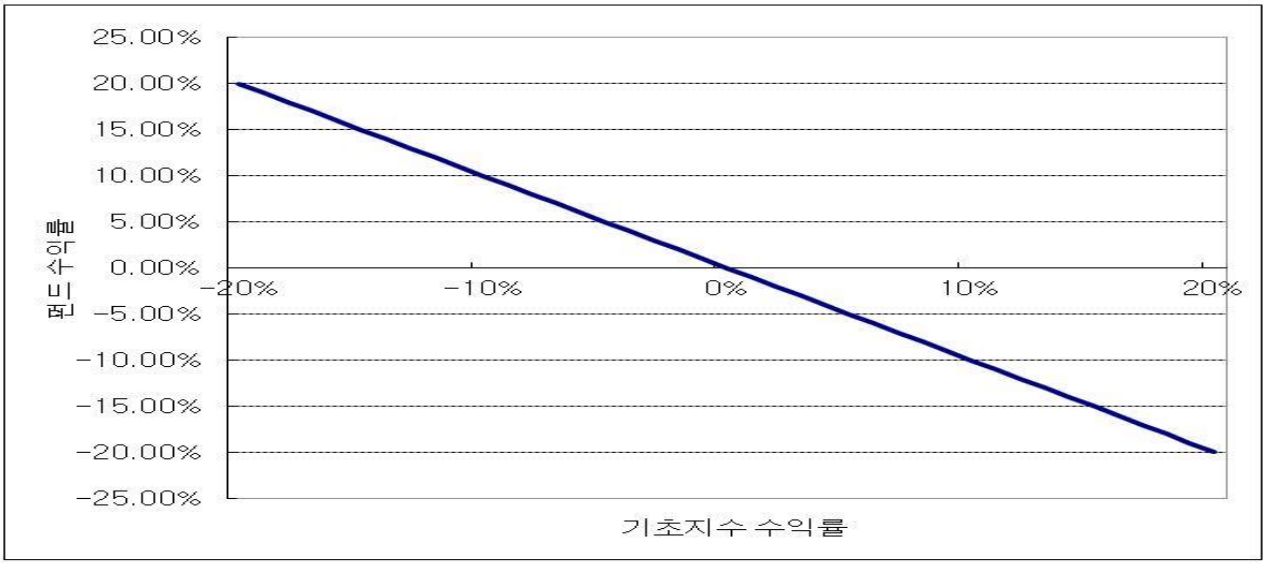
공시일: 2020-10-27

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	3,717	-3,717	장내
합계			0	3,717	-3,717	

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

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

공시일: 2020-10-27

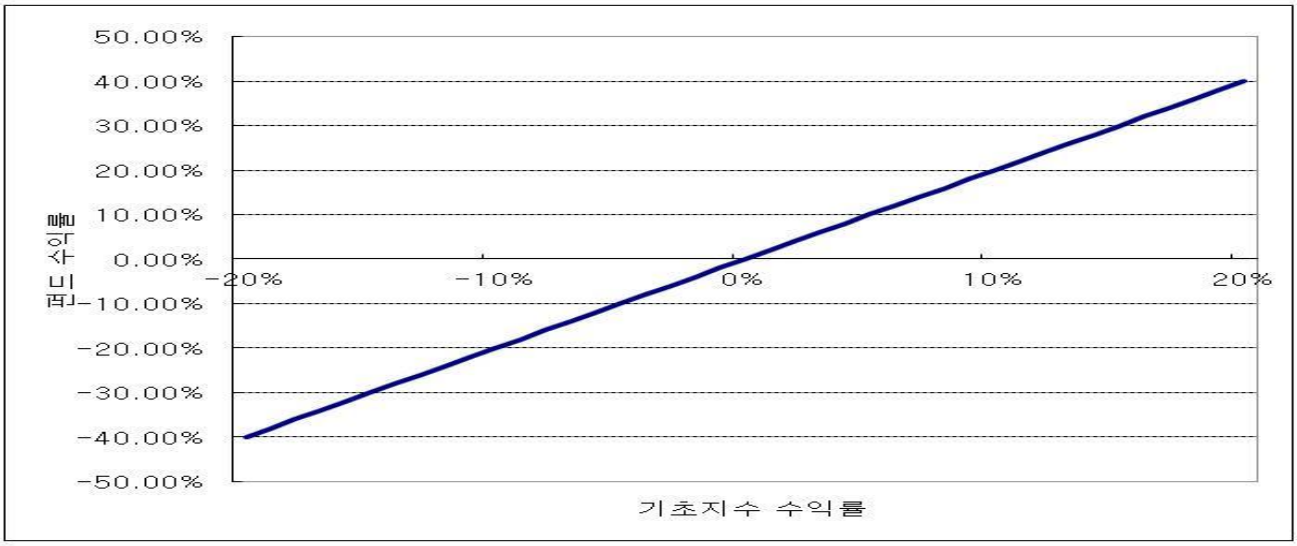
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	72	-72	장내
누계	주가지수	선물	7,707	0	7,707	장내
합계			7,707	0	7,707	

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	617

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,008

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

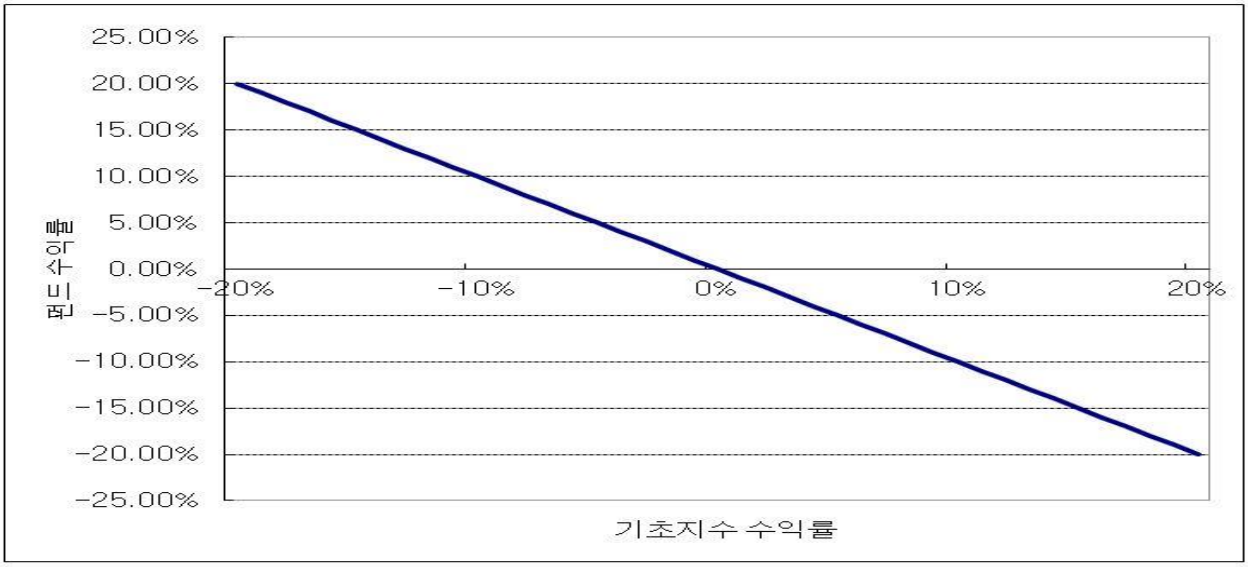
공시일: 2020-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	72	-72	장내
누계	주가지수	선물	0	3,746	-3,746	장내
합계			0	3,746	-3,746	

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

300

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

490

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

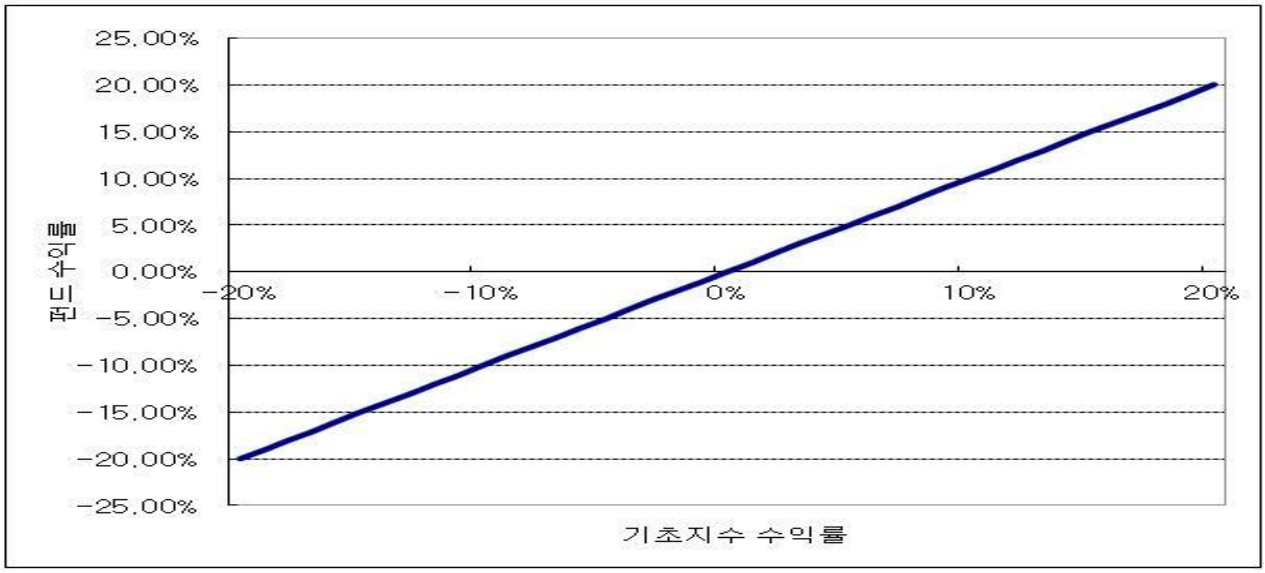
공시일: 2020-10-27

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	12,454	0	12,454	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	4,060	0	4,060	장외
합계			16,514	0	16,514	

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)

176

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

공시일: 2020-10-27

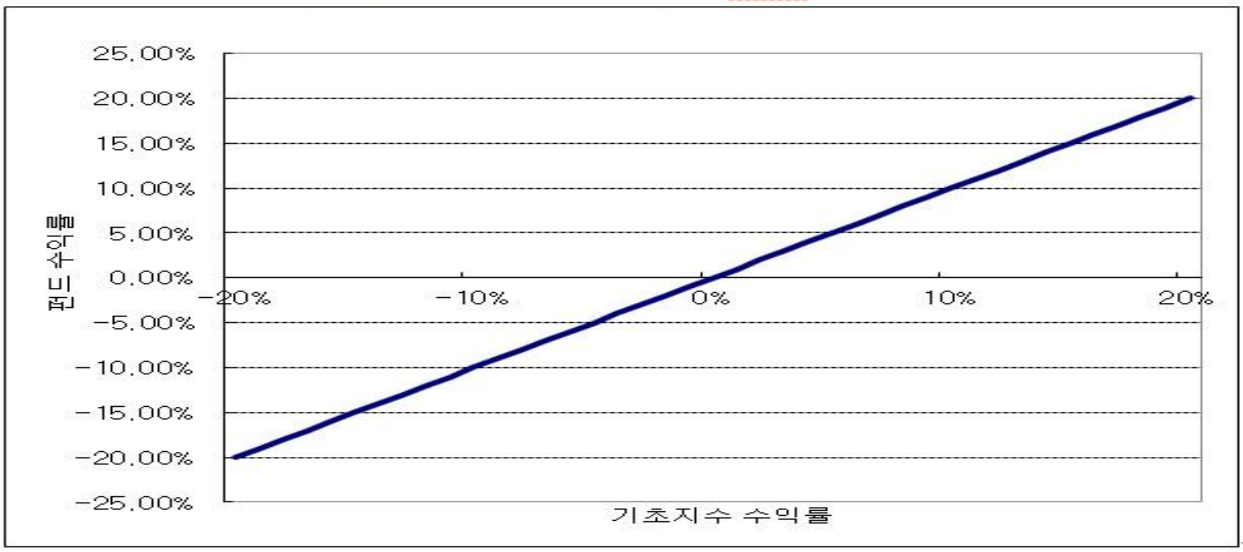
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	7,275	0	7,275	장내
신규	통화	선물	0	101	-101	장내
누계	통화	선물	7,984	0	7,984	장내
합계			15,259	0	15,259	

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	639

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	731

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

공시일: 2020-10-27

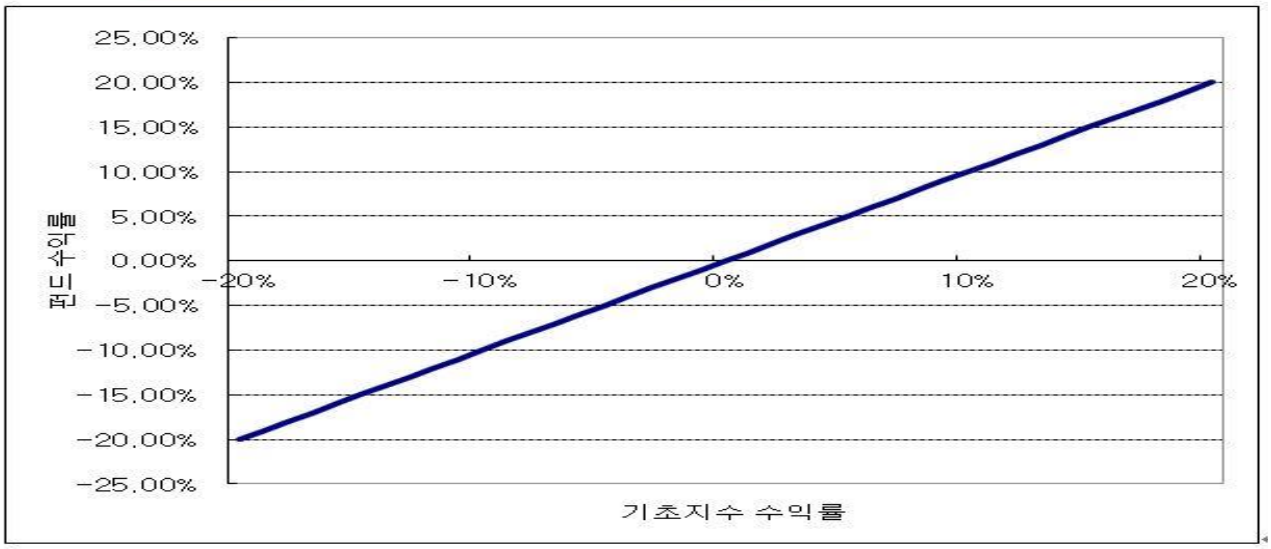
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	3,552	-3,552	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	5,594	0	5,594	장내
합계			5,594	3,552	2,041	

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	862

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,421

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

공시일: 2020-10-27

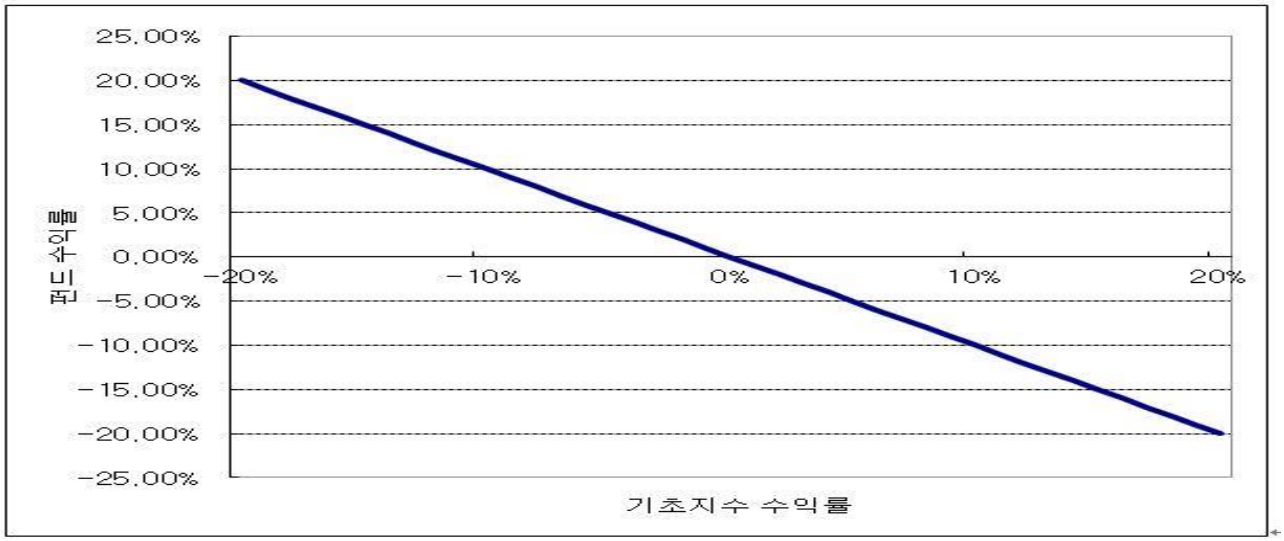
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	677	-677	장내
신규	상품	선물	0	0	0	장내
누계	상품	선물	3,995	0	3,995	장내
합계			3,995	677	3,319	

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

615

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,008

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

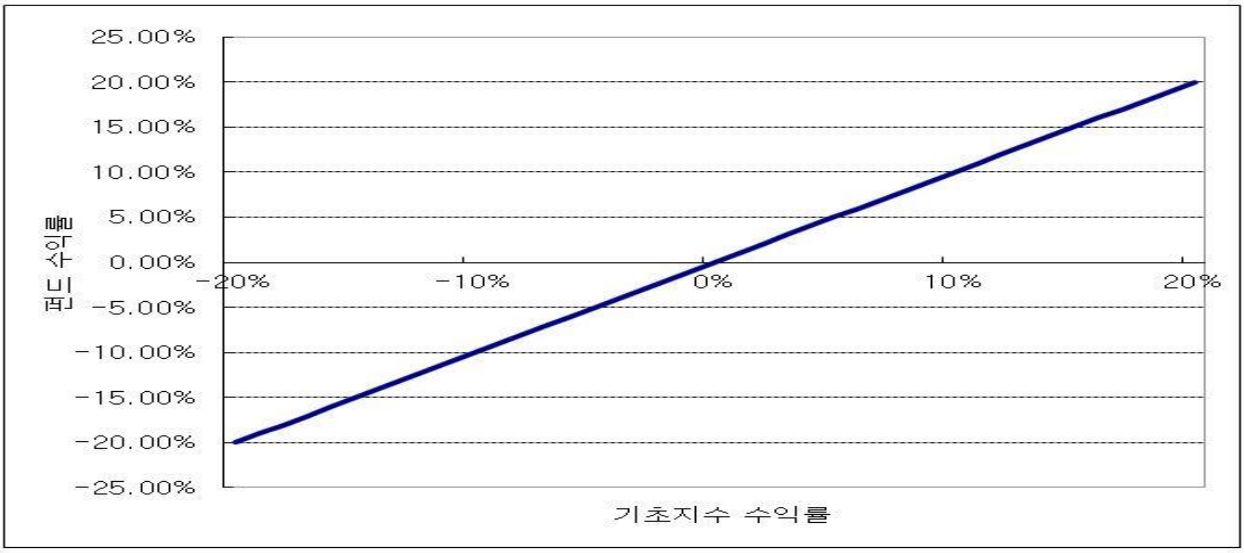
공시일: 2020-10-27

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	6,044	1,991	4,053	장내
합계			6,044	1,991	4,053	

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-

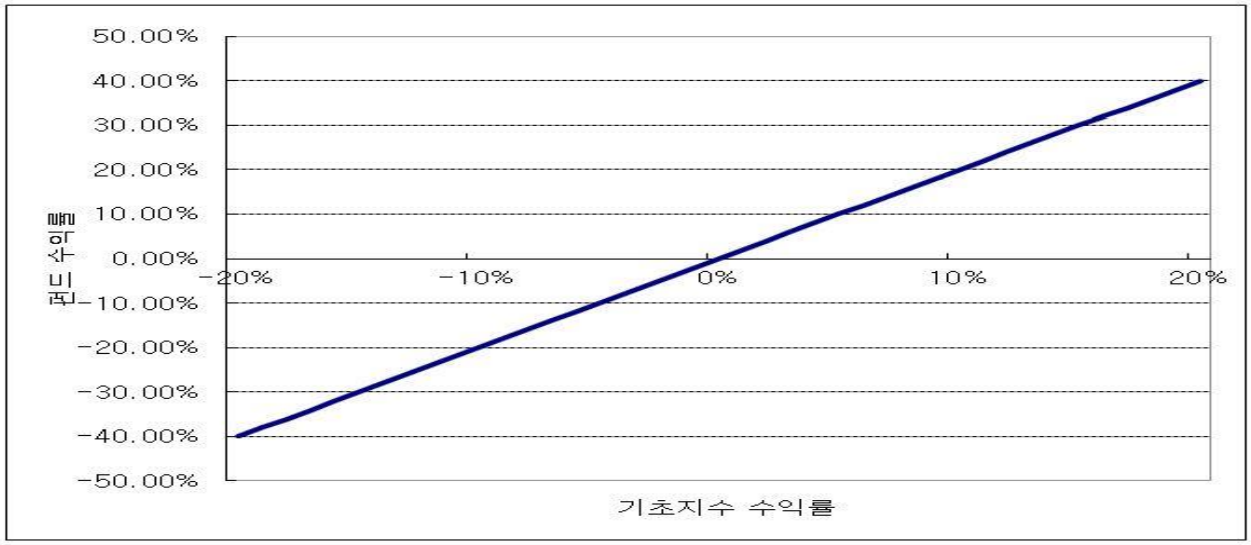
공시일: 2020-10-27

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	7,722	4,115	3,608	장내
합계			7,722	4,115	3,608	

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

618

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

61

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

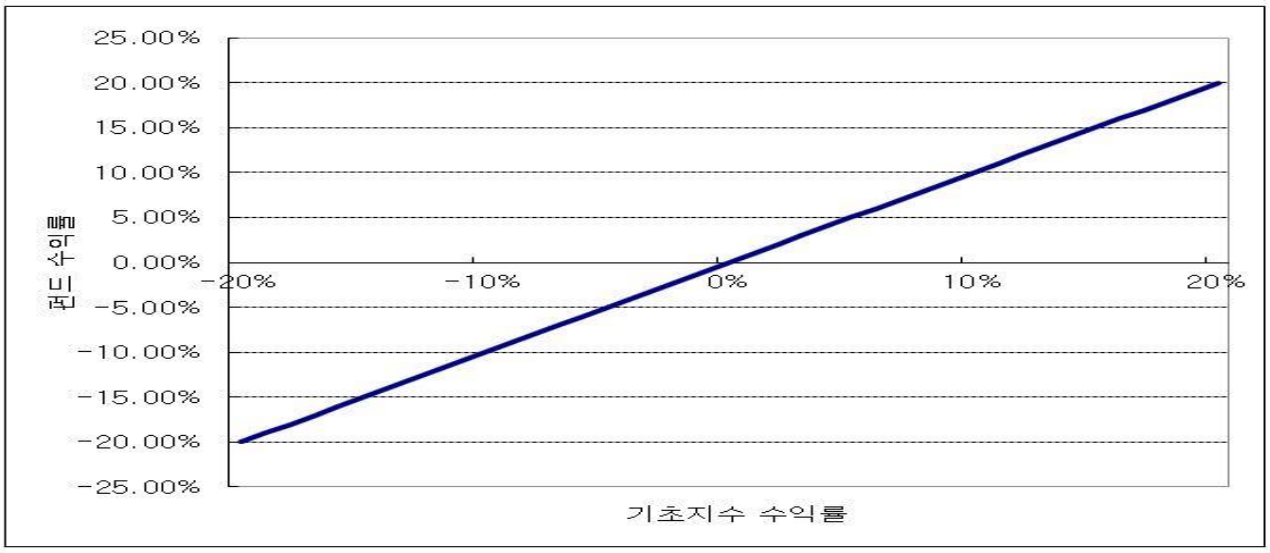
공시일: 2020-10-27

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	1,991	5,932	-3,941	장내
합계			1,991	5,932	-3,941	

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-

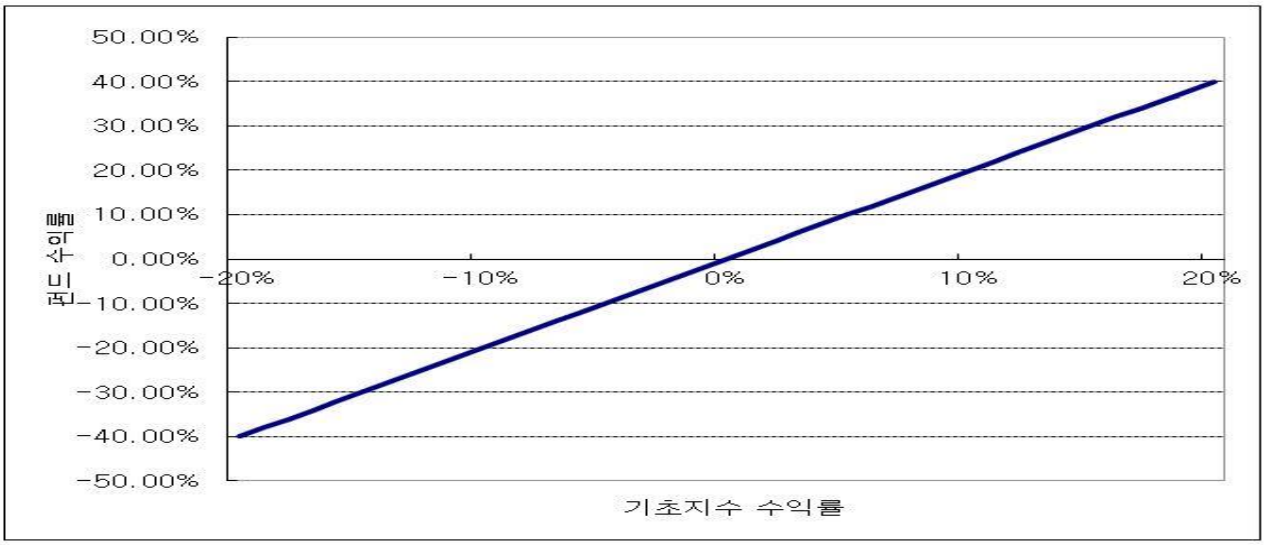
공시일: 2020-10-27

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	10,989	-10,989	장내
합계			0	10,989	-10,989	

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