

공시일 2023-12-18

기준일 2023-12-15

한국투자밀라노부동산투자신탁1호(파생형)(07K84)

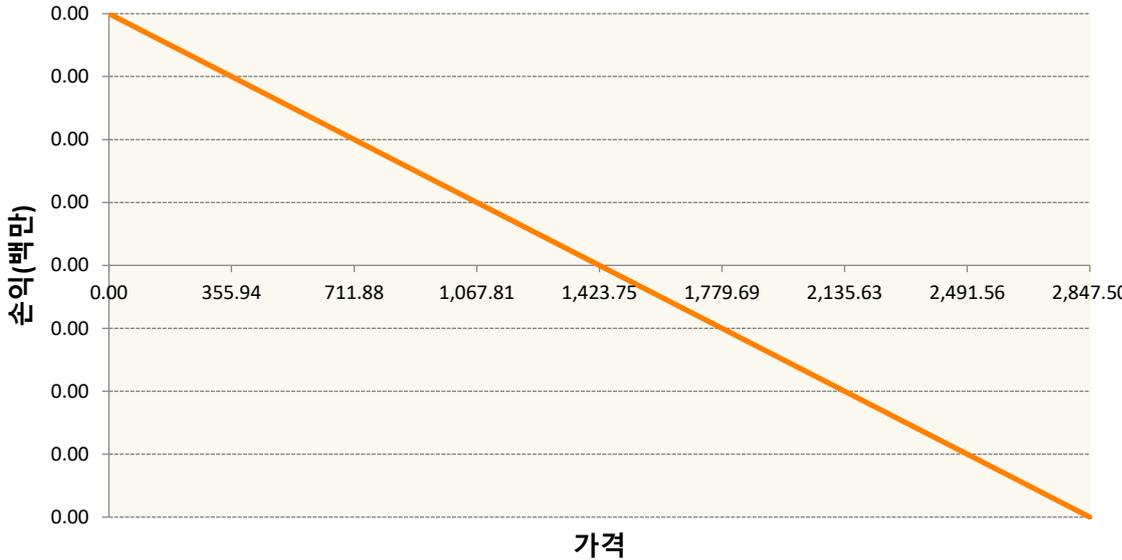
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	58,421	-58,421	장외

2. 만기시점의 손익구조

FX10119G5461-KRW/EUR 15-02-24E



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX10119G5461

KRW/EUR 15-02-24E

4,674

주) 최대손실 예상금액은 기초자산의 7개 가격변동구간과 7개 변동성변동구간을 고려한 총 49개 시나리오로 산출됨

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

3,180

주) VaR는 보유포지션의 시장가치 × 99%신뢰구간에 따른 표준편차의 배수 × 포지션의 변동성 × 10(보유기간)의 제곱근으로 산정함.

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

한국투자도쿄한조몬오피스부동산투자신탁((07K86))

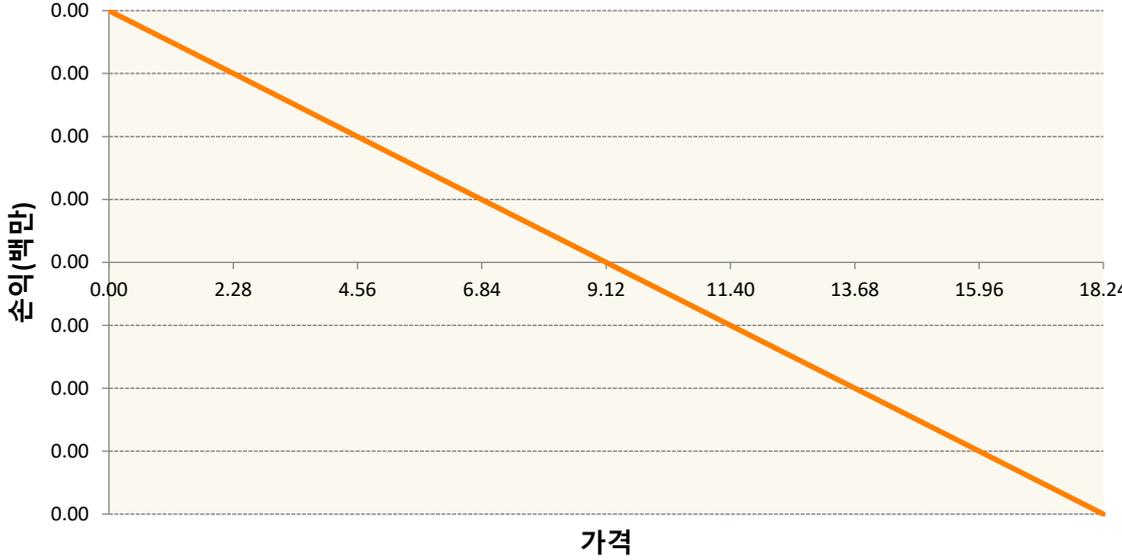
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	1,061	-1,061	장외

2. 만기시점의 손익구조

FX10119M5095-KRW/JPY 03-06-24E



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX10119M5095 KRW/JPY 03-06-24E

85

주) 최대손실 예상금액은 기초자산의 7개 가격변동구간과 7개 변동성변동구간을 고려한 총 49개 시나리오로 산출됨

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

72

주) VaR는 보유포지션의 시장가치 × 99%신뢰구간에 따른 표준편차의 배수 × 포지션의 변동성 × 10(보유기간)의 제곱근으로 산정함.

공시일	2023-12-18
기준일	2023-12-15

한국투자룩셈부르크코어오피스부동산투자신(07K89)

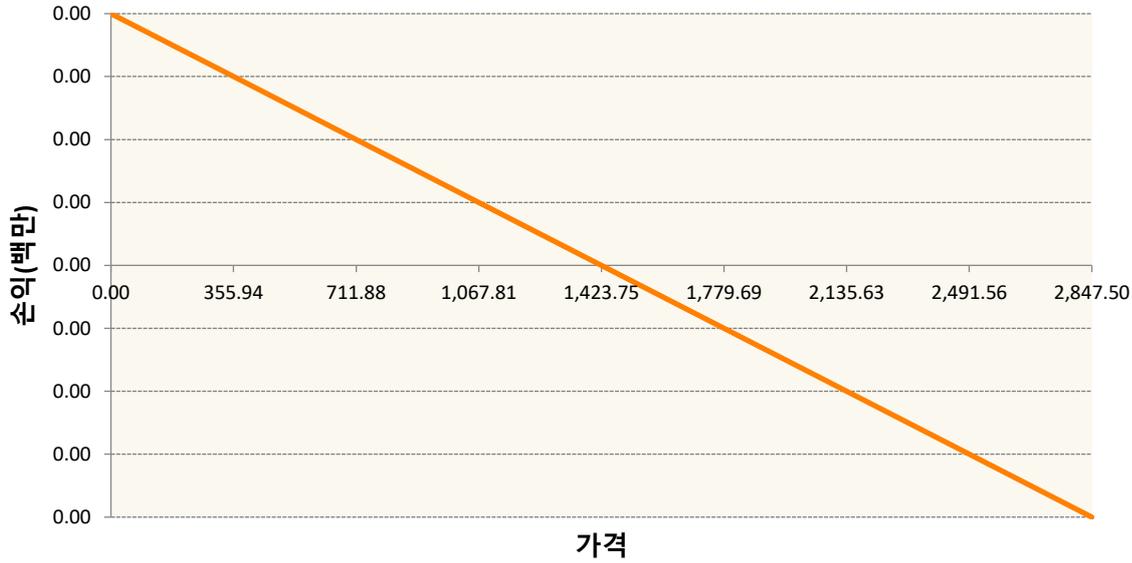
1. 계약금액

(단위:백만원)

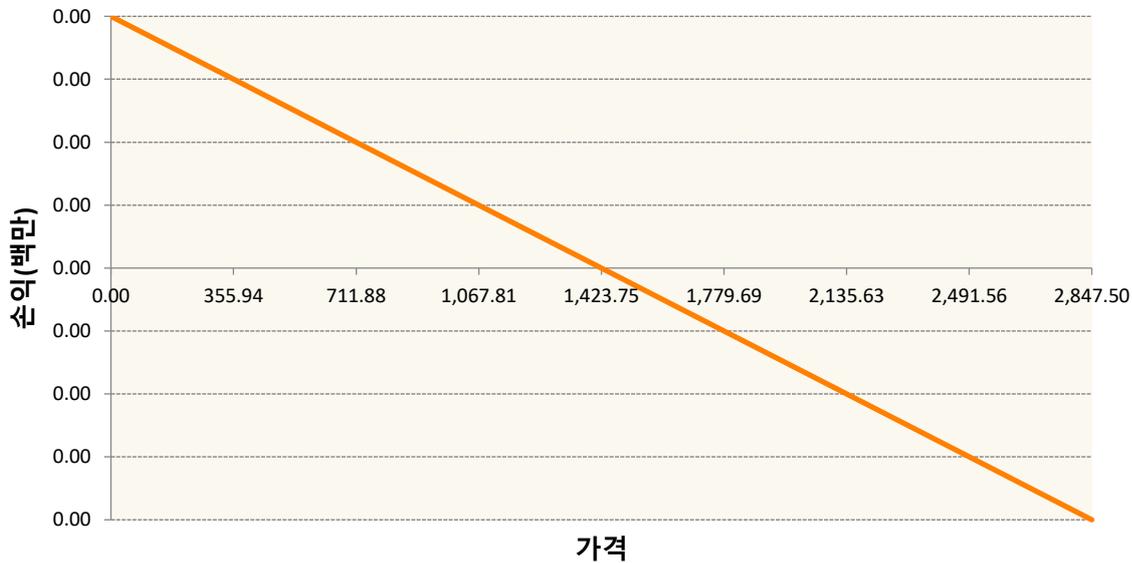
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	102,512	-102,512	장외

2. 만기시점의 손익구조

FX10119M5549-KRW/EUR 07-06-24E



FX10119M5550-KRW/EUR 24-12-24E



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX10119M5549	KRW/EUR 07-06-24E	201
FX10119M5550	KRW/EUR 24-12-24E	8,000

주) 최대손실 예상금액은 기초자산의 7개 가격변동구간과 7개 변동성변동구간을 고려한 총 49개 시나리오로 산출됨

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

5,579

주) VaR는 보유포지션의 시장가치 × 99%신뢰구간에 따른 표준편차의 배수 × 포지션의 변동성 × 10(보유기간)의 제곱근으로 산정함.