| 공시일 | 2024-10-31 |
|---|---|
| 기준일 | 2024-10-30 |

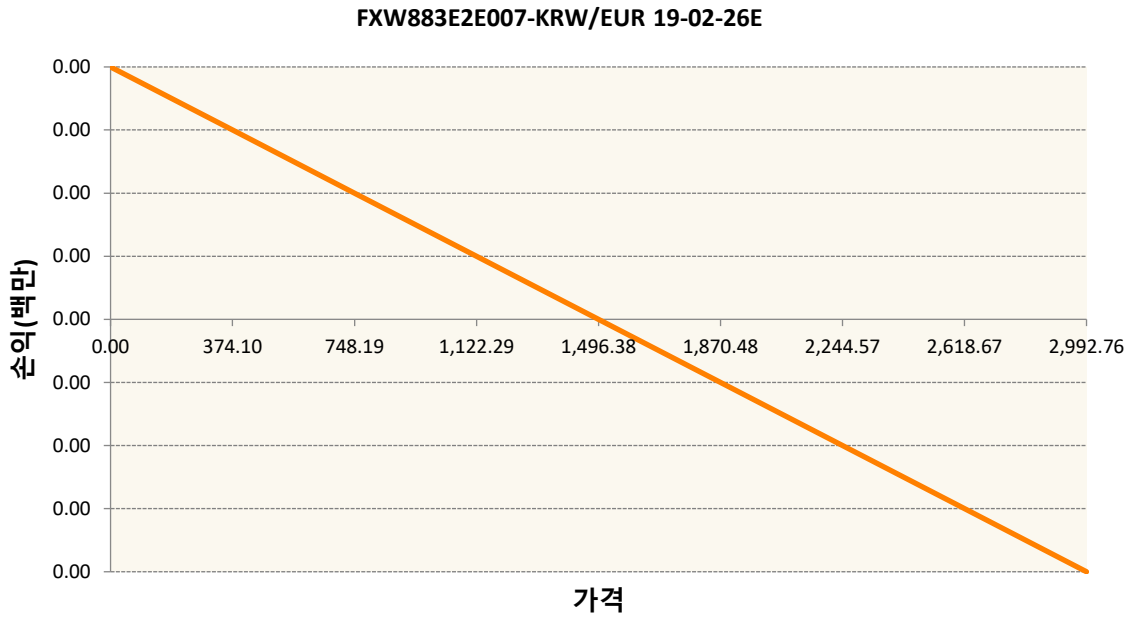
# 한국투자밀라노부동산투자신탁1호(파생형)(07K84)

## 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 | 49,121 | -49,121 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| FXW883E2E007 | KRW/EUR 19-02-26E | 3,930 |

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

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

(단위:백만원)

**5,565**

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

| 공시일 | 2024-10-31 |
|---|---|
| 기준일 | 2024-10-30 |

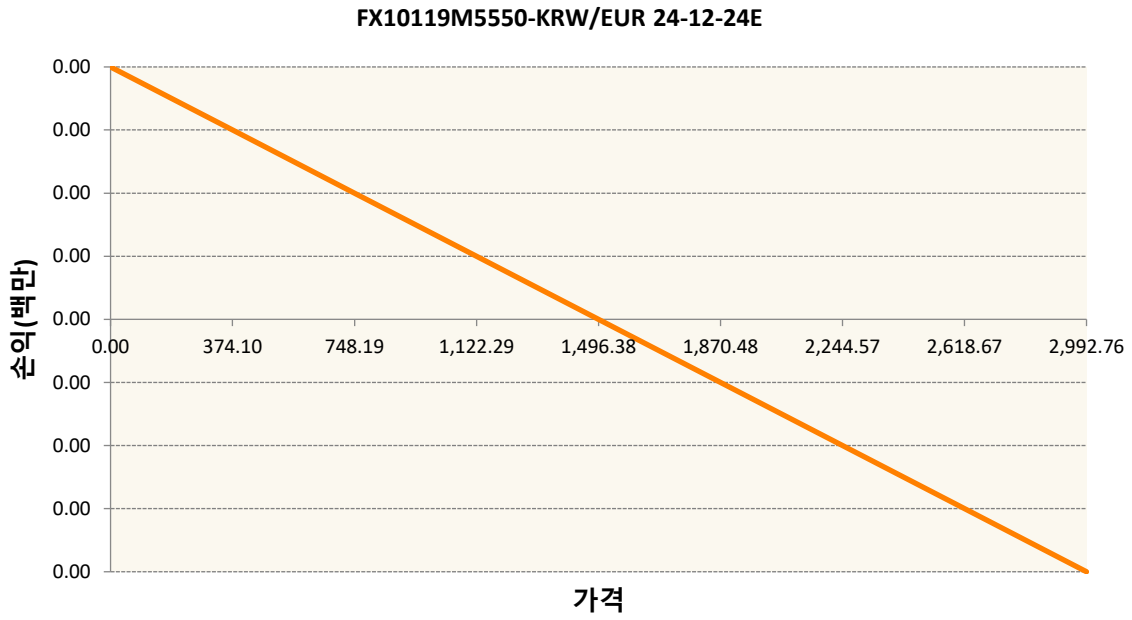
# 한국투자룩셈부르크코어오피스부동산투자신(07K89)

## 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 | 105,098 | -105,098 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| FX10119M5550 | KRW/EUR 24-12-24E | 8,408 |
|---|---|---|

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

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

(단위:백만원)

**11,907**

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