

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-16 |
| 기준일 | 2024-05-15 |

글로벌인덱스 리스크컨트롤형 펀드

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|-------|---------|-------|-----------|----|
| 보유 | 지수 | 국내선물 | 50,850 | 0 | 50,850 | 장내 |
| 보유 | 지수 | 해외선물 | 136,834 | 0 | 136,834 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 국내외선물 | 187,684 | 0 | 187,684 | 장내 |

※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도 없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 손익구조

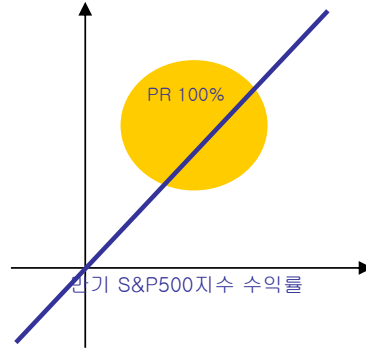
KOSPI200지수 관련 장내 파생상품
Pay-Off



HSCEI지수 관련 장내 파생상품
Pay-Off



S&P500 지수 관련 장내 파생상품
Pay-Off



※ 상기 도해는 거래상대방이 충실하게 의무이행할 것을 가정하며, 투자신탁의 수익구조가 아닌 편입된 파생상품의 수익구조에 관한 도해입니다.

3. 시나리오별 손익구조변동 (최대손실예상금액)

(단위:백만원)

15,015

주) 최대손실 예상금액은 각 포함종목의 최대손실예상금액의 합산 값입니다.

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용에서 관련법규에서 정한 산출방식으로 산출함

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

(단위:백만원)

13,577

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용에서 관련법규에서 정한 산출방식으로 산출함