

공시일	2023-01-26
기준일	2023-01-25

ABL 인공지능 팀챗리지 펀드 파생상품 위험지표 공시

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
보유	지수	국내선물	323	0	323	장내
보유	지수	해외선물	38,746	0	38,746	장내
누계	지수	국내외선물	39,069	0	39,069	장내

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

2. 만기시점의 손익구조



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

3. 시나리오별 손익구조변동 (최대손실예상금액)

(단위: 백만원)

3,100

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)

4,153

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