

공시일 2024-05-17

기준일 2024-05-16

골드리치특별자산(금-파생형)

1. 계약금액

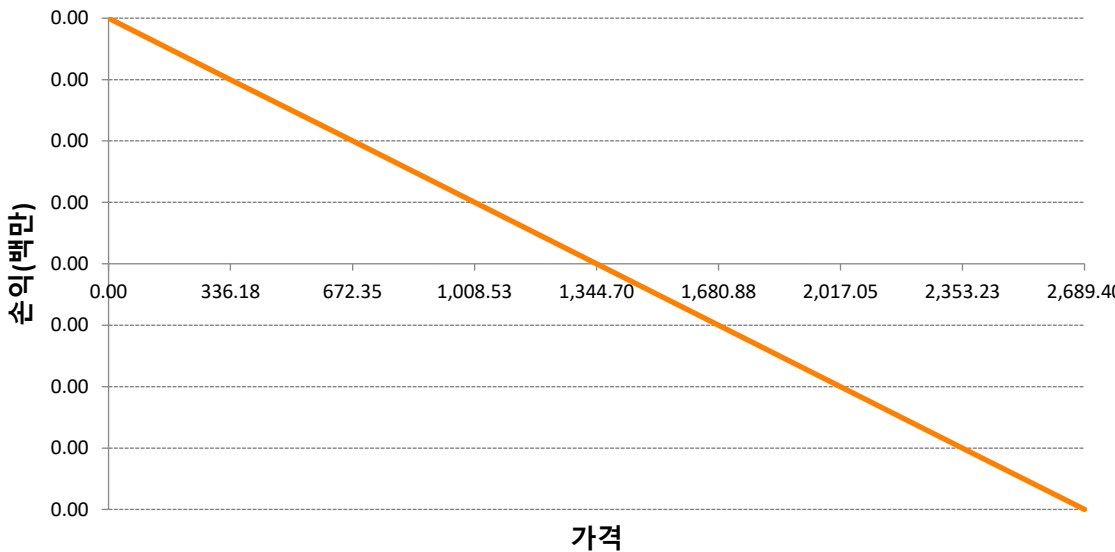
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선도	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,899	0	2,899	장내
누계	유가증권	선도	12,876	0	12,876	장내
누계	통화	선물	0	2,905	-2,905	장내

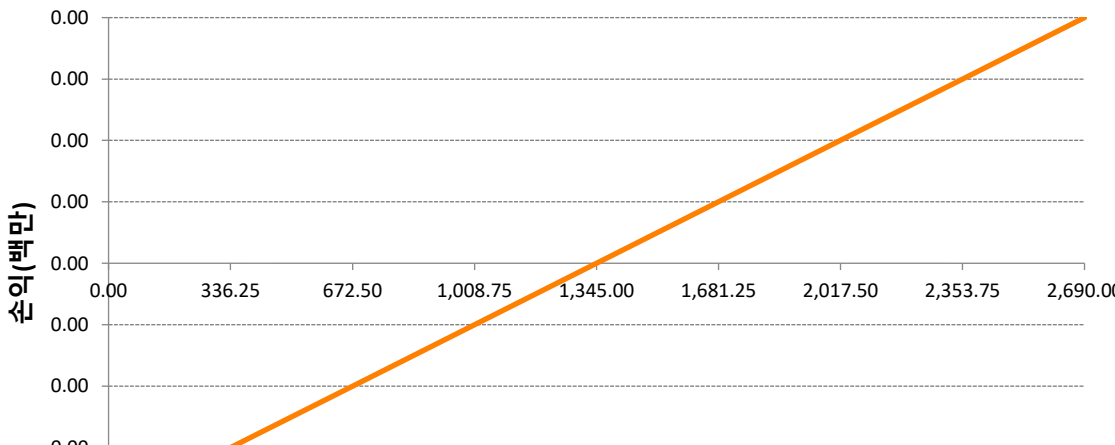
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

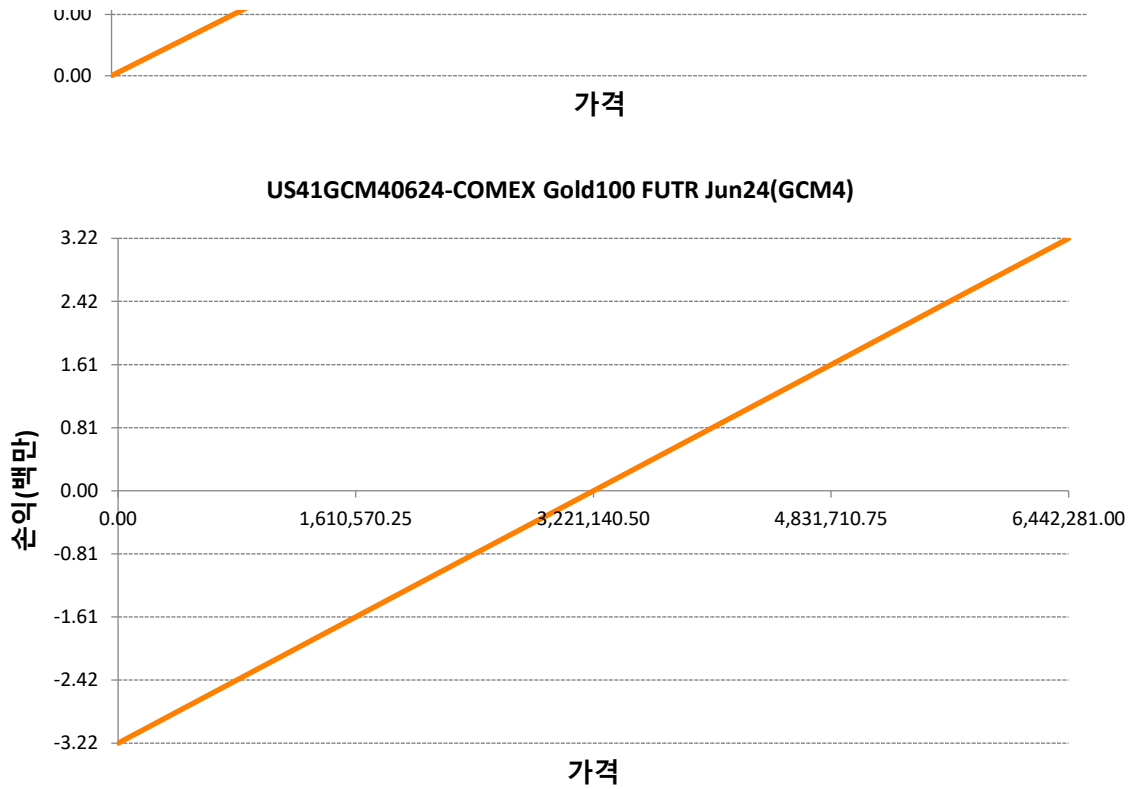
2. 만기시점의 손익구조

KR4175V50007-2024-05 달러선물



LBMA20240520-LBMA골드ICBC20240520





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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

1,494

주) 최대손실 예상금액은 각 포함종목의 최대손실예상금액의 합산 값입니다.

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함

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

(단위:백만원)

941

※ 산출된 값(VaR)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함

공시일	2024-05-17
기준일	2024-05-16

변액보험코리아원자재지수연계증권3(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

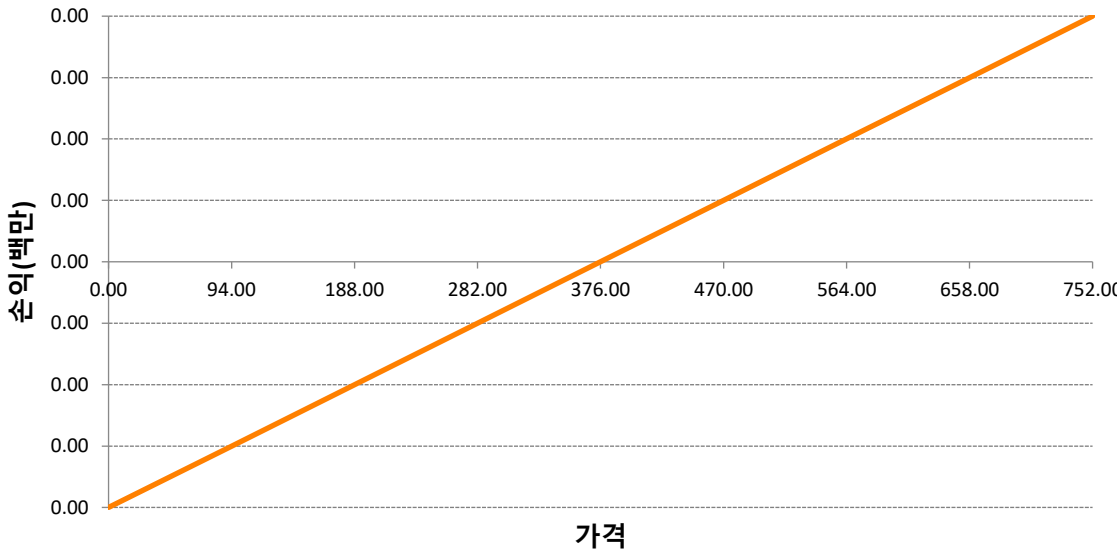
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,128	0	1,128	장내

※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 수익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

90

주) 최대손실 예상금액은 각 포함종목의 최대손실예상금액의 합산 값입니다.

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함

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

(단위:백만원)

87

※ 산출된 값(VaR)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함

공시일 2024-05-17

기준일 2024-05-16

변액보험코리아글로벌지수연계증권3(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

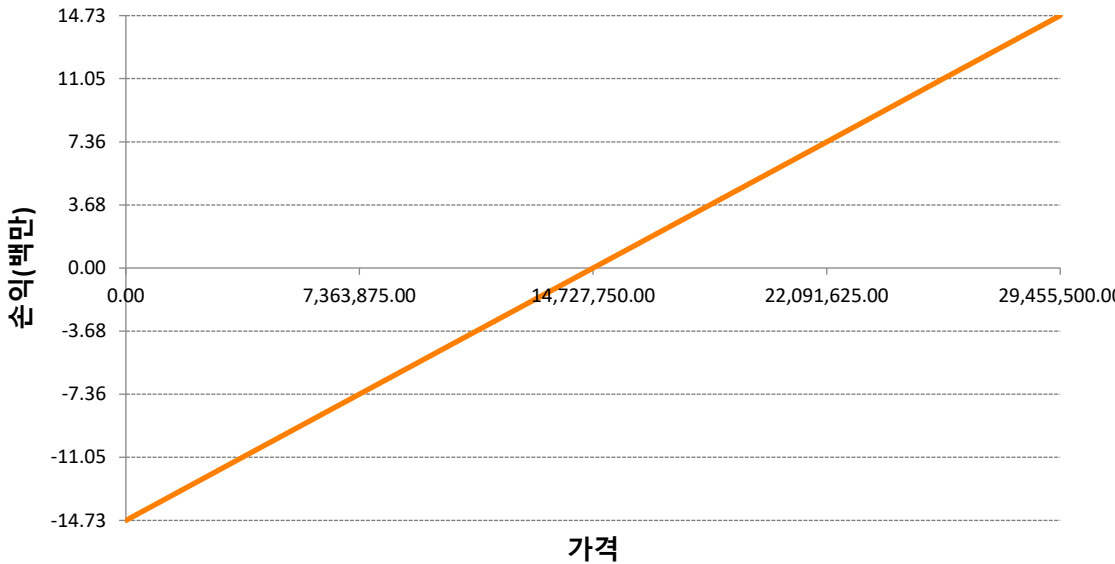
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	564	0	564	장내
누계	지수	선물	147	0	147	장내

※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 손익구조

DE41ZWPM4624-MSCI World Index Jun24(ZWPM4)



KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



각역

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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

57

주) 최대손실 예상금액은 각 포함종목의 최대손실예상금액의 합산 값입니다.

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함

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

(단위:백만원)

51

※ 산출된 값(VaR)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함

공시일 2024-05-17

기준일 2024-05-16

변액보험코리아원자재지수연계증권4(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

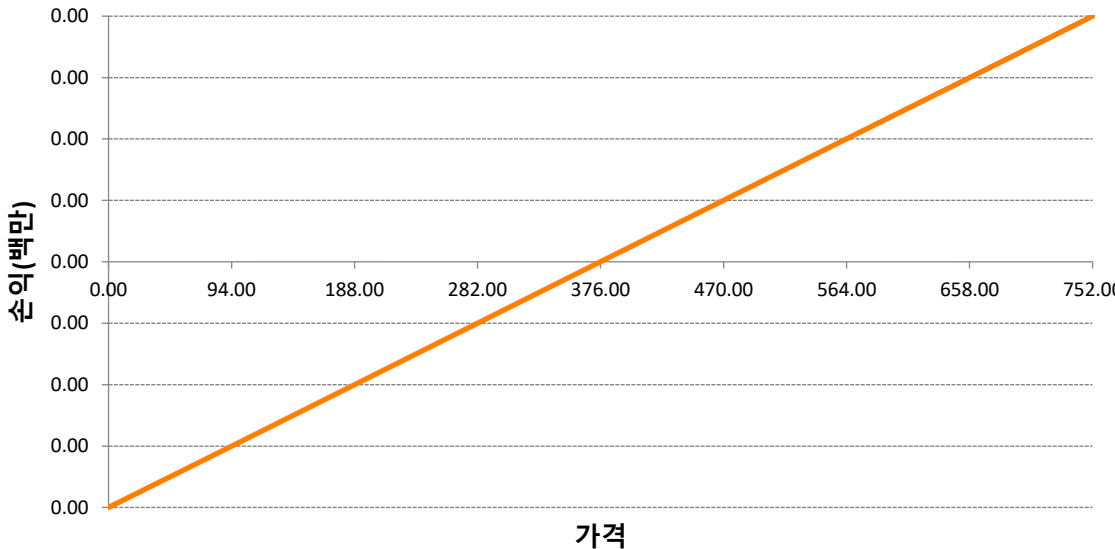
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	188	0	188	장내

※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 수익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

15

주) 최대손실 예상금액은 각 포함종목의 최대손실예상금액의 합산 값입니다.

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함

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

(단위:백만원)

14

※ 산출된 값(VaR)은 이스트스프링자산운용과 사전에 협의한 산출방식으로 한국자산평가에서 산출함