

공시일 2024-10-11

기준일 2024-10-10

## 골드리치특별자산(금-파생형)

### 1. 계약금액

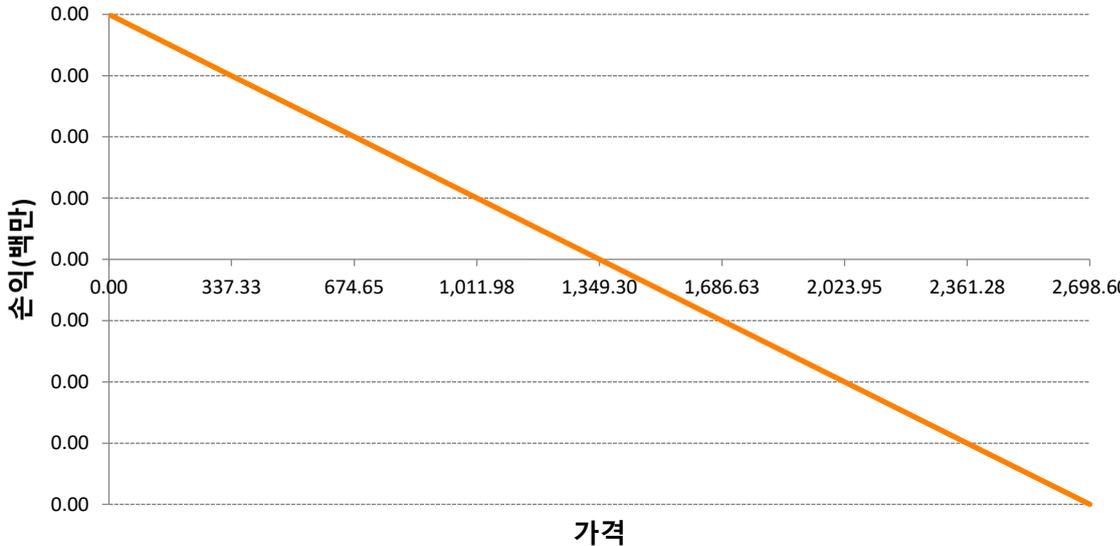
(단위:백만원)

| 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   | 3,191  | 0     | 3,191     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선도   | 12,919 | 0     | 12,919    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0      | 2,631 | -2,631    | 장내 |

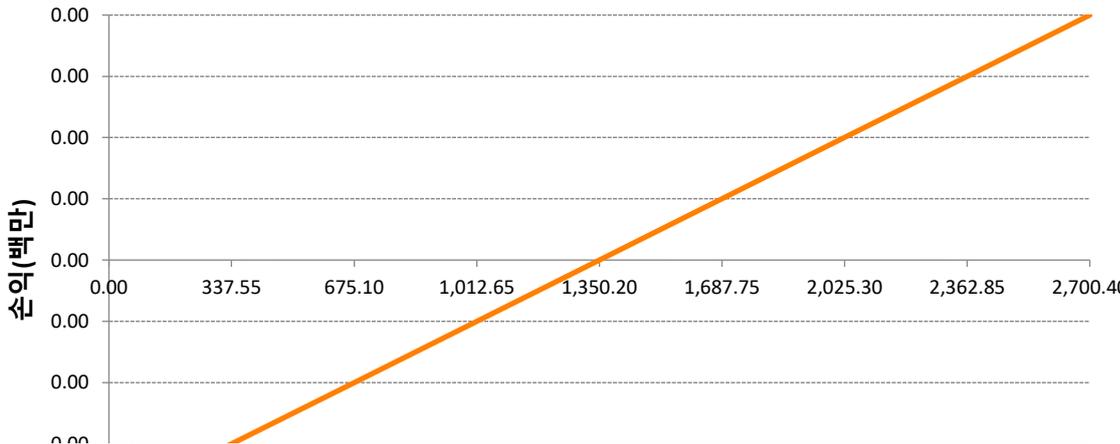
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

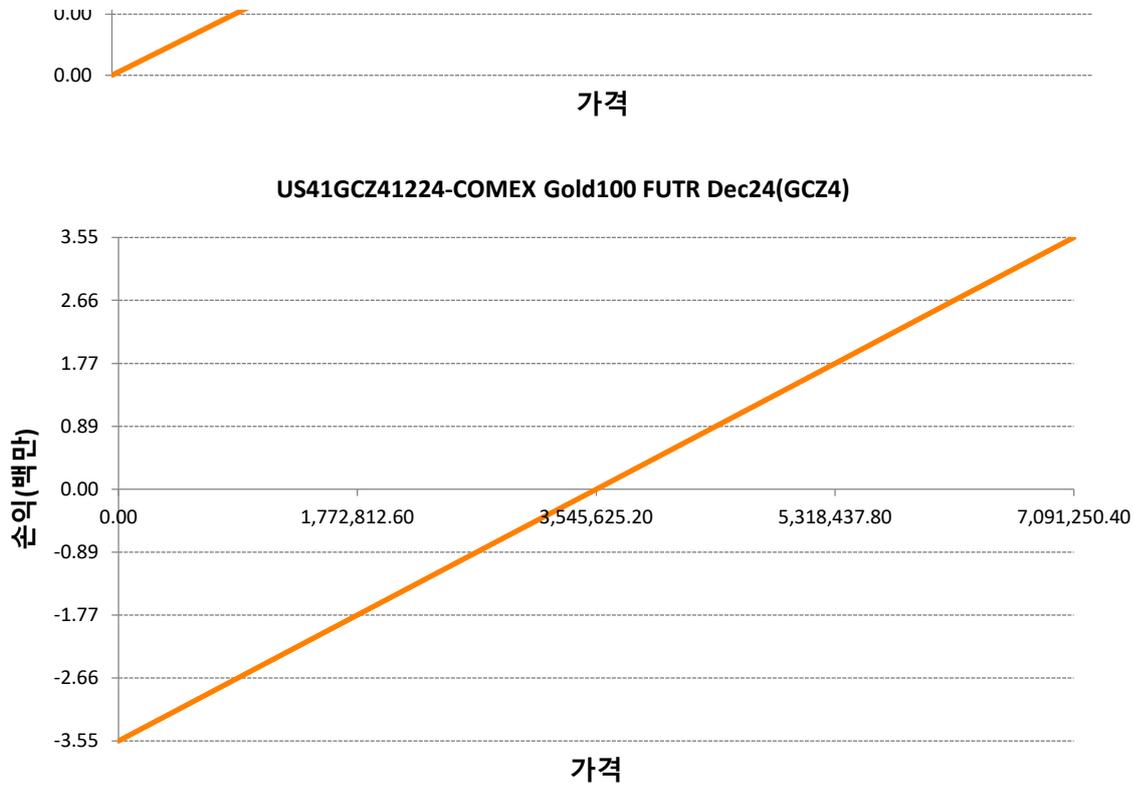
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4175VA0007-2024-10 달러선물



LBMA20241021-LBMA골드ICBC20241021





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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

1,499

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)

944

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-11 |
| 기준일 | 2024-10-10 |

## 변액보험코리아원자재지수연계증권3(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

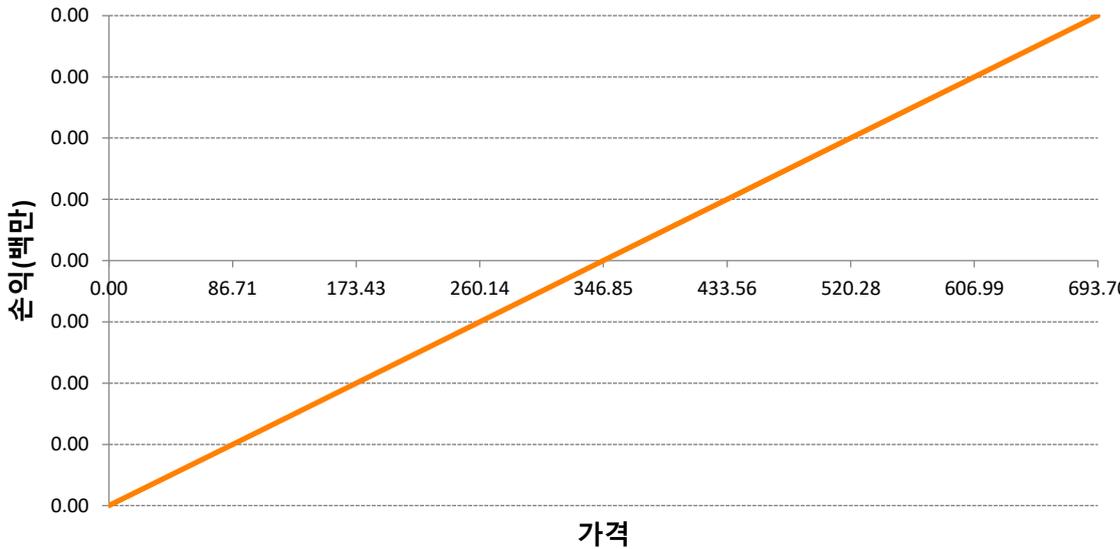
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,474 | 0     | 1,474     | 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

KR4101VC0004-2024-12 코스피200지수선물



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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

118

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)

146

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

공시일 2024-10-11

기준일 2024-10-10

## 변액보험코리아글로벌지수연계증권3(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

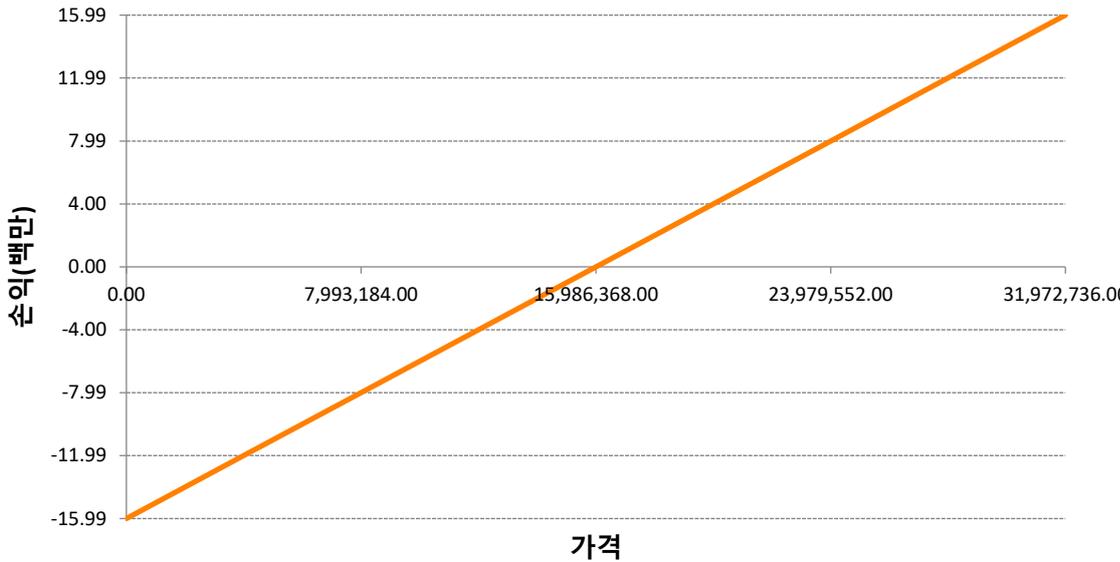
(단위:백만원)

| 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   | 434   | 0     | 434       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 160   | 0     | 160       | 장내 |

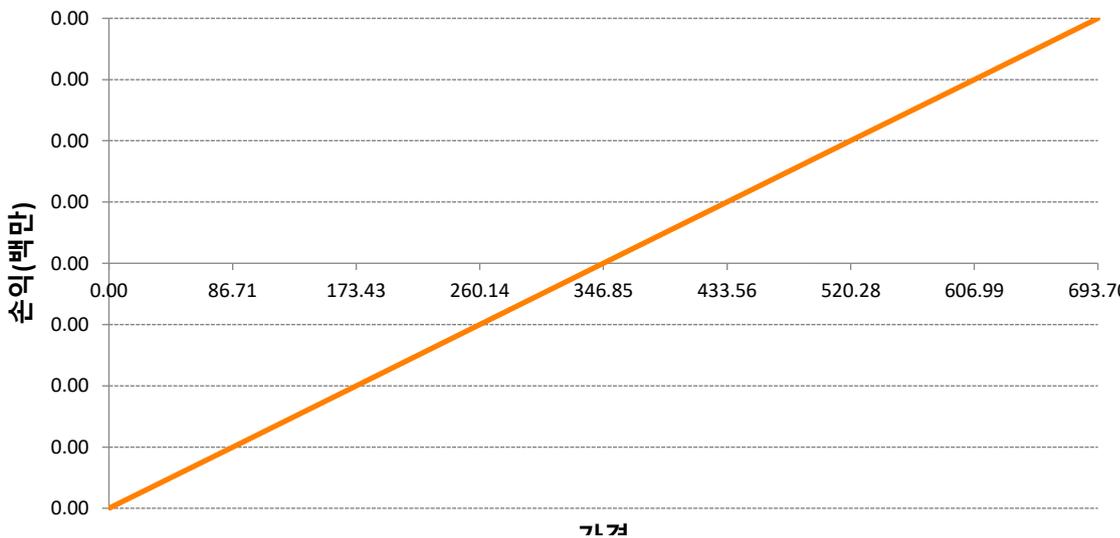
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

### 2. 만기시점의 손익구조

DE41ZWPZ4C24-MSCI World Index Dec24(ZWPZ4)



KR4101VC0004-2024-12 코스피200지수선물



## 각역

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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

47

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)

50

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-11 |
| 기준일 | 2024-10-10 |

## 변액보험코리아원자재지수연계증권4(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

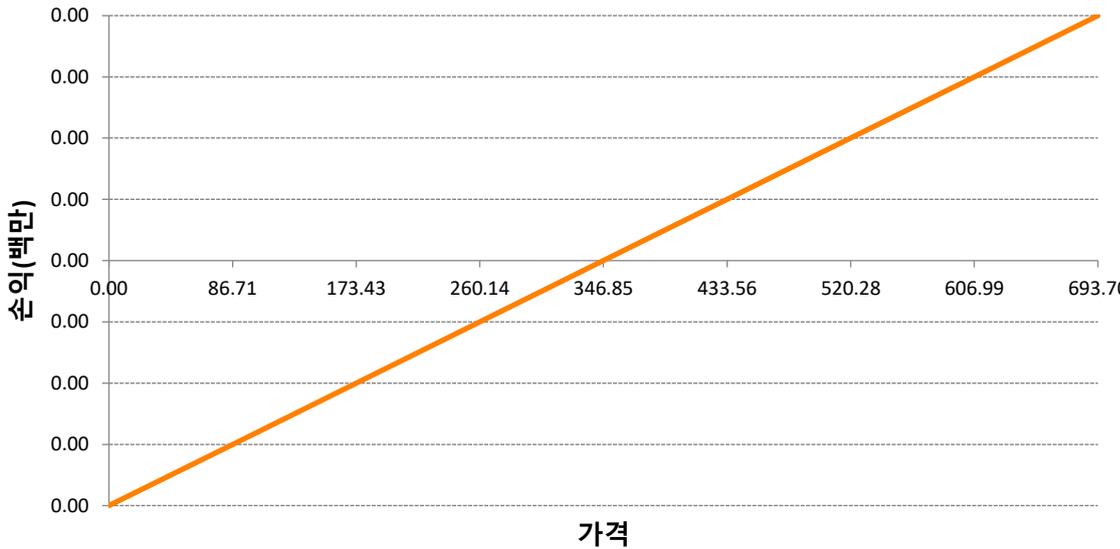
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 87    | 0     | 87        | 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

KR4101VC0004-2024-12 코스피200지수선물



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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

7

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)

9

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

공시일 2024-10-11

기준일 2024-10-10

## 변액보험코리아차이나지수연계증권2(주혼-파생형)

### 1. 계약금액

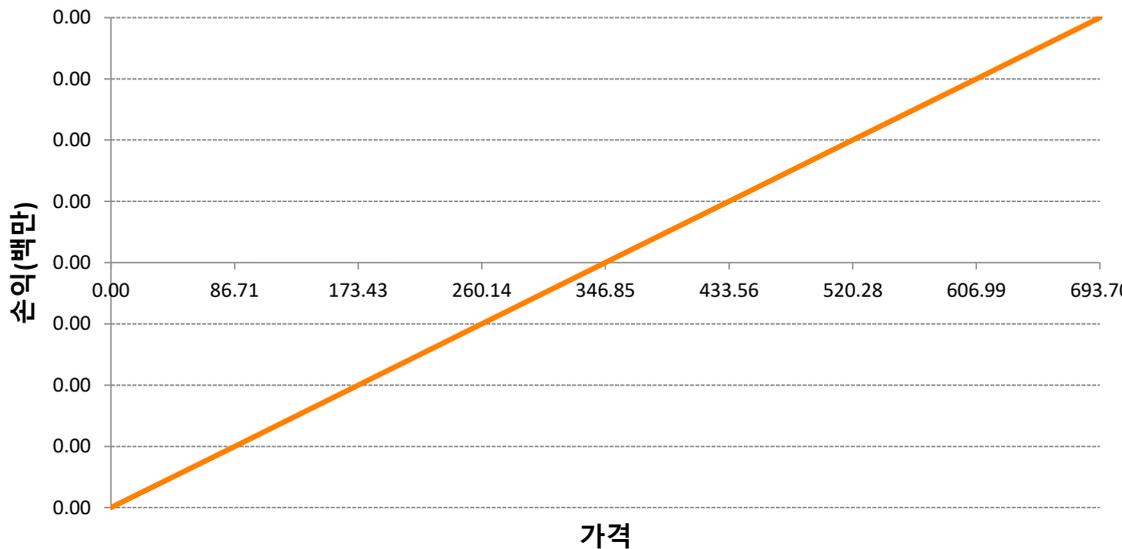
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 87    | 0     | 87        | 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

KR4101VC0004-2024-12 코스피200지수선물



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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

7

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)

9

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