

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-05-12 |
| 기준일 | 2021-05-11 |

골드리치특별자산(금-파생형)

1. 계약금액

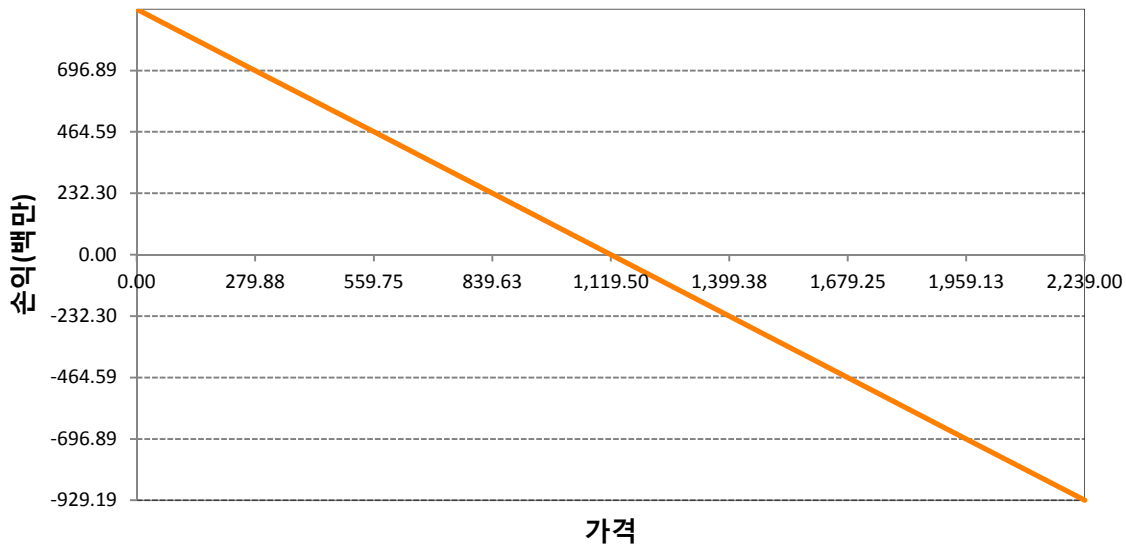
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,703 | 929 | 2,774 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 41,460 | 0 | 41,460 | 장외 |

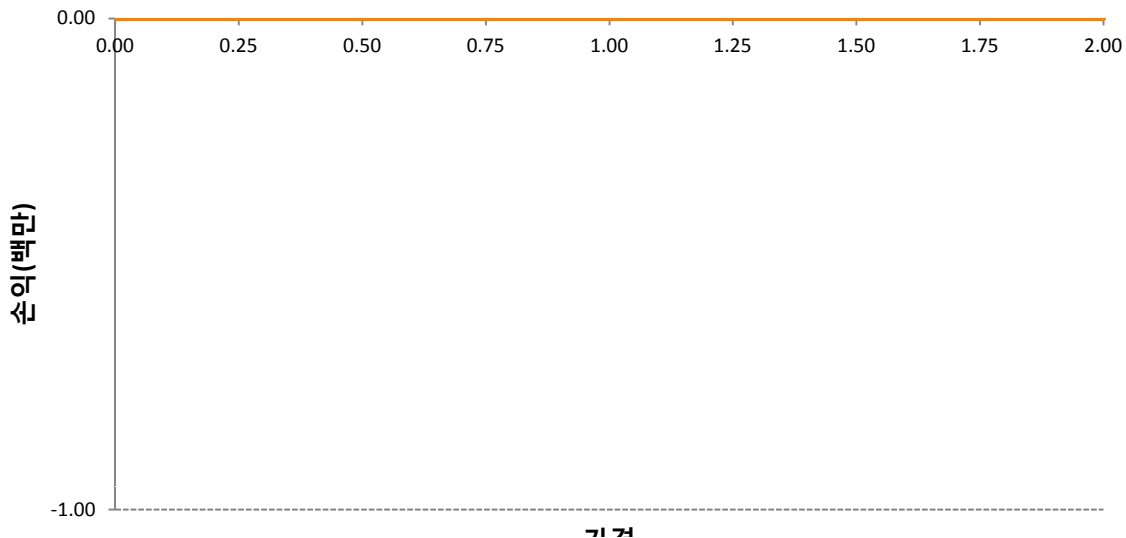
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 손익구조

KR4175R50005-2021-05 달러선물

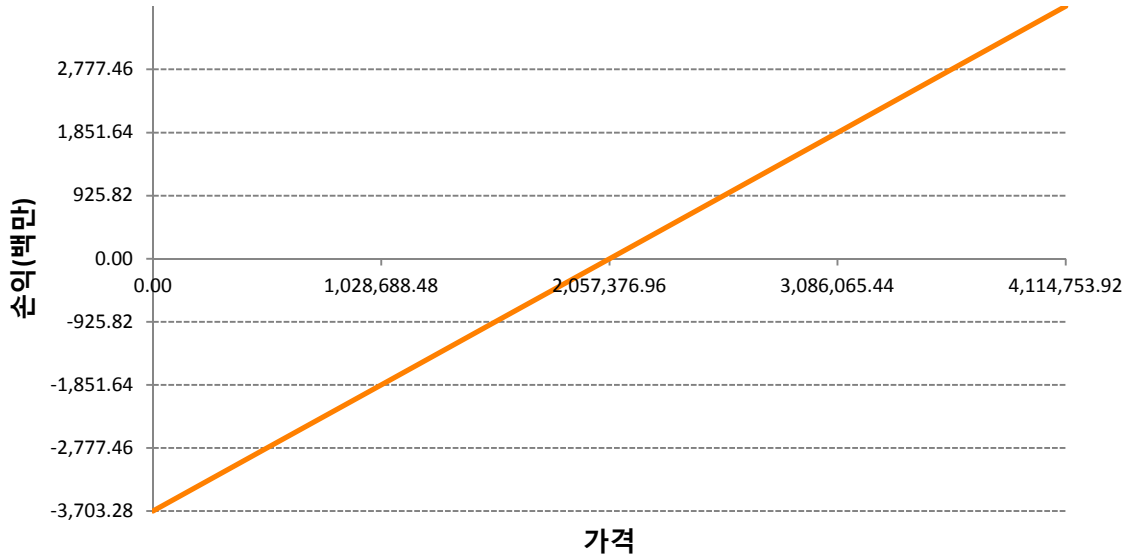


KRA790930029-NH투자골드(스왑210528)



가격

US41GCM10621-COMEX Gold100 FUTR Jun21(GCM1)



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

| | |
|----------------------------------|----------|
| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
| | 474 |

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) |
| | 427 |

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

공시일 2021-05-12

기준일 2021-05-11

변액보험코리아원자재지수연계증권2호(주식혼합-파생형)

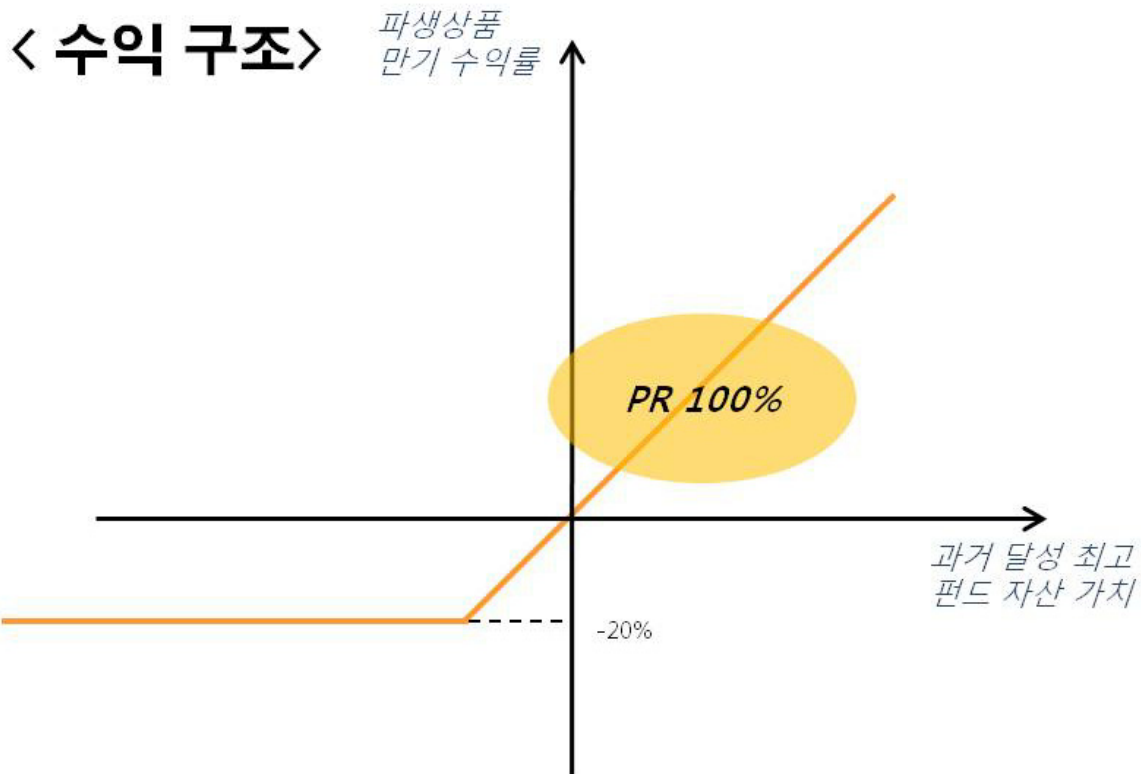
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 4,491 | 0 | 4,491 | 장외 |

※ 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



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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

318

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)

42

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

공시일 2021-05-12

기준일 2021-05-11

코리아차이나지수연계증권1호(주식혼합-파생형)

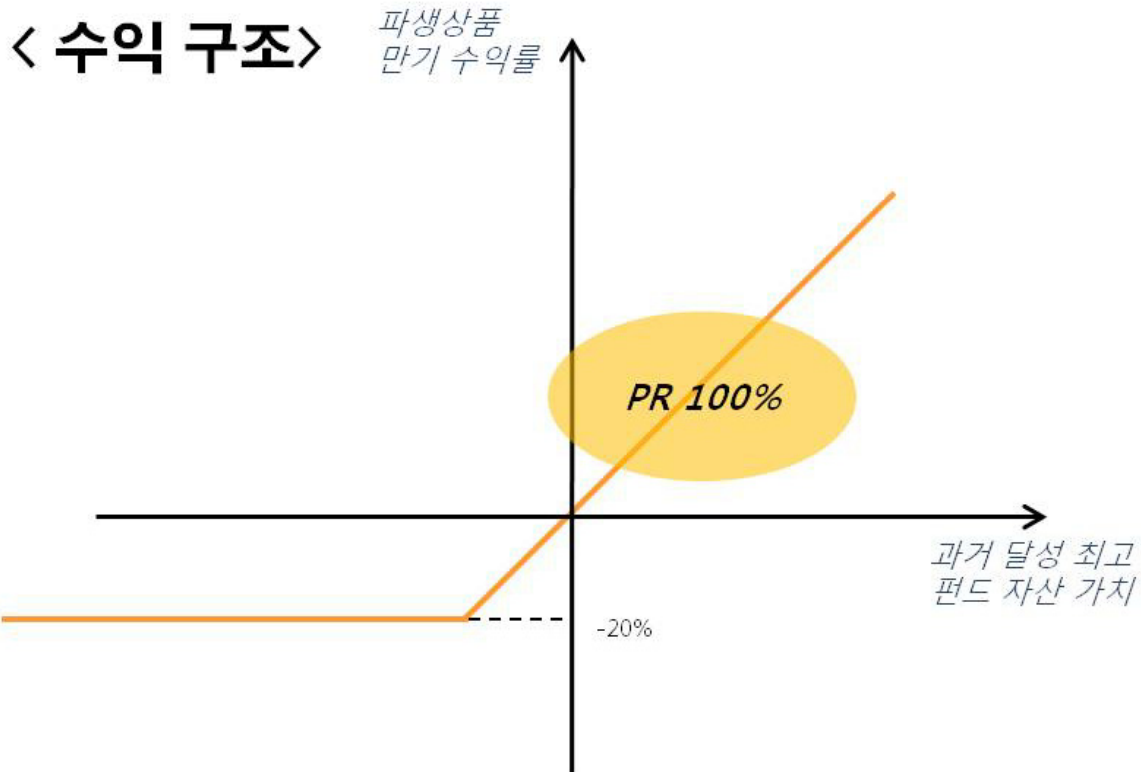
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 2,098 | 0 | 2,098 | 장외 |

※ 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



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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

149

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)

29

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

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-05-12 |
| 기준일 | 2021-05-11 |

변액보험코리아원자재지수연계증권3(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

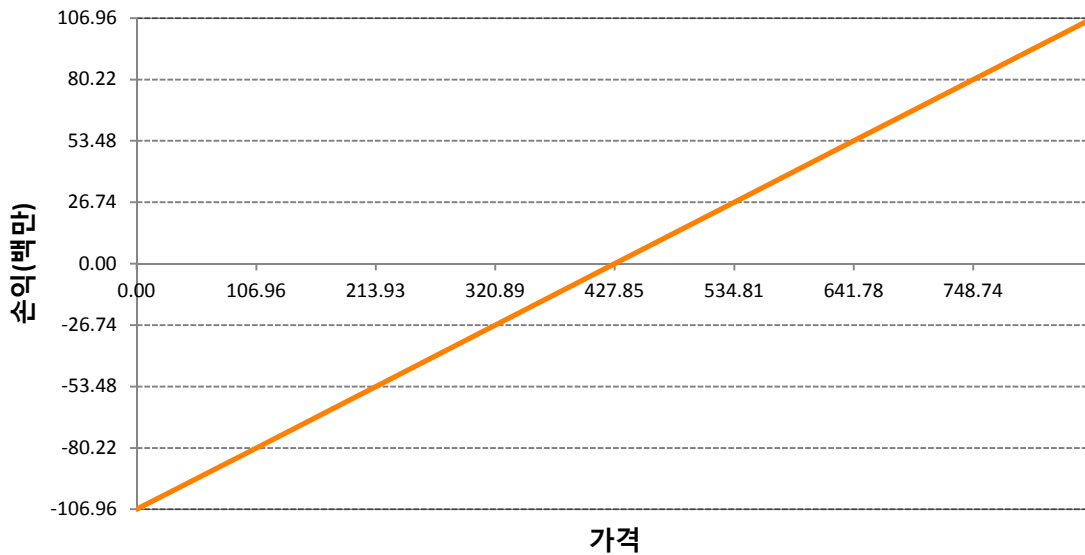
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 107 | 0 | 107 | 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

KR4101R60000-2021-06 코스피200지수선물



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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

9

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)

10

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

공시일 2021-05-12

기준일 2021-05-11

변액보험코리아글로벌지수연계증권3(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

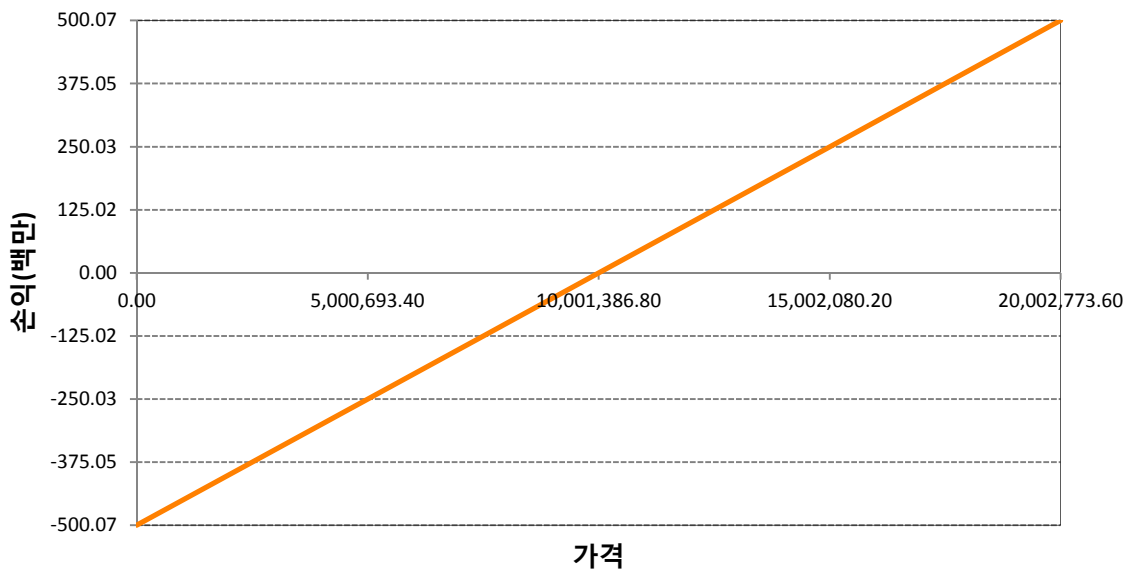
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,249 | 0 | 1,249 | 장내 |

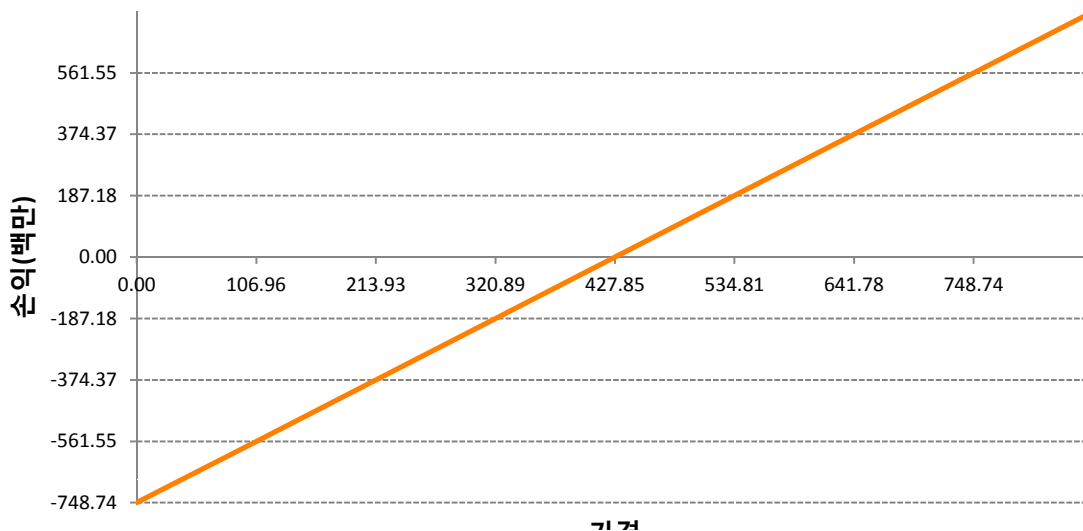
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로써 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 손익구조

DE000C2FU1M1-MSCI World Index Jun21(ZWPM1)



KR4101R60000-2021-06 코스피200지수선물



가속

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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

100

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)

108

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