

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-05 |
| 기준일 | 2020-06-04 |

## 골드리치특별자산(금-파생형)

### 1. 계약금액

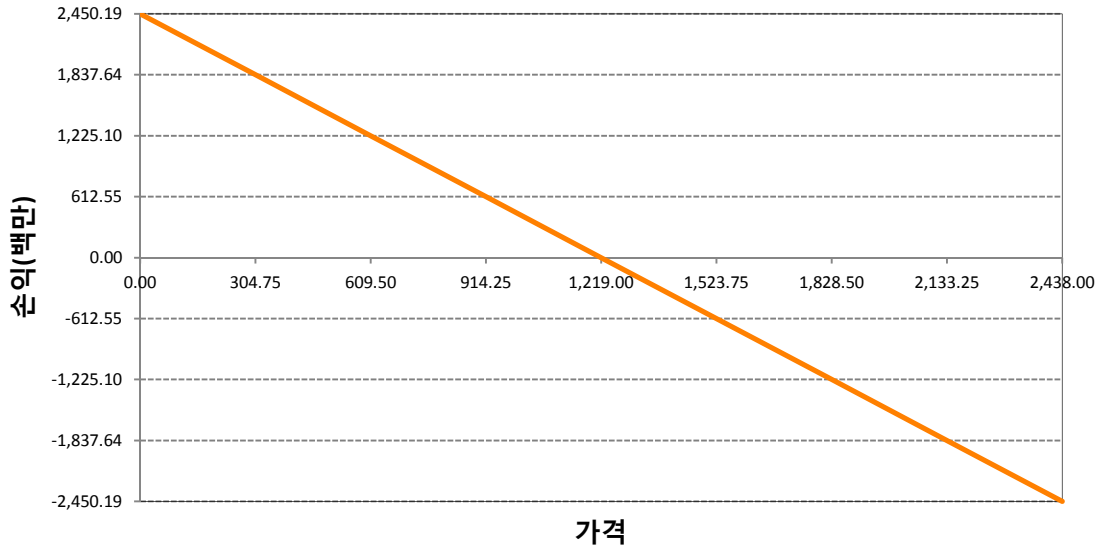
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 7,064  | 2,450 | 4,614     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 12,968 | 0     | 12,968    | 장외 |

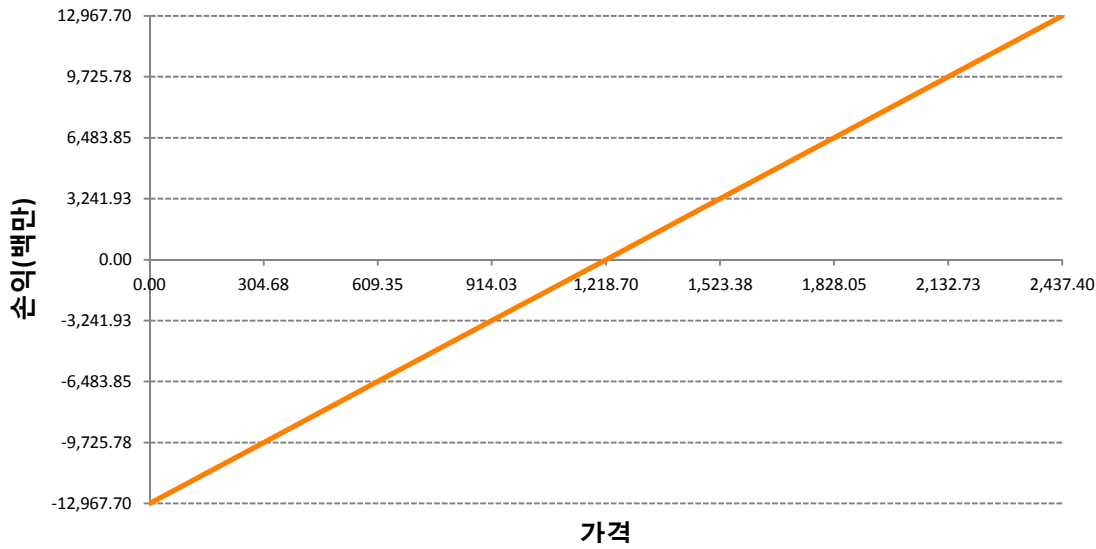
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로써 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

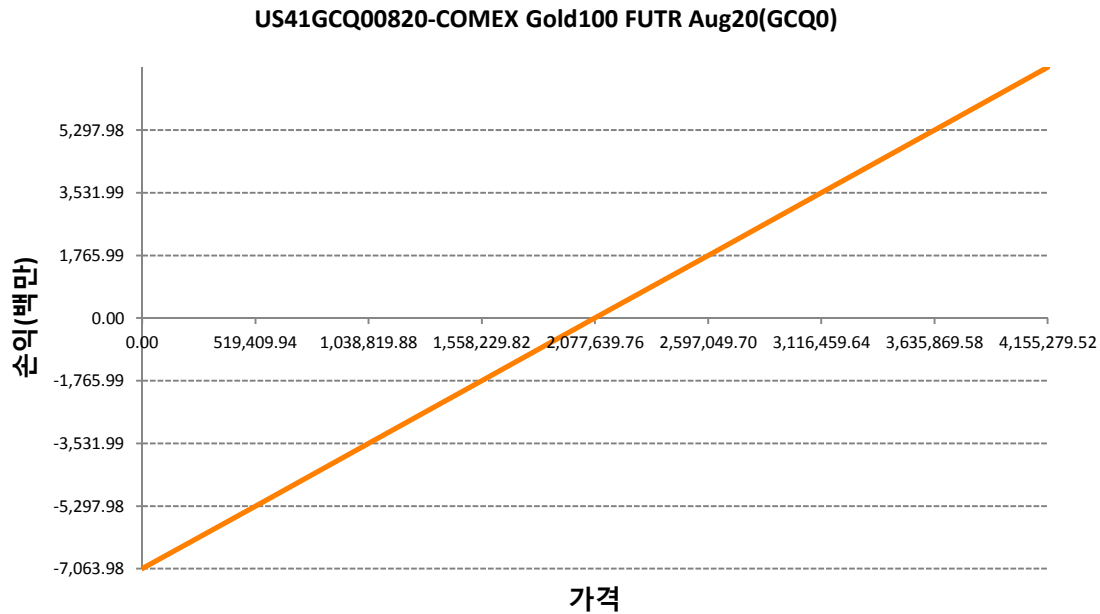
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4175Q60006-2020-06 달러선물



LBMA20200617-LBMA골드ICBC20200617





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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

1,799

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)

1,309

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-05 |
| 기준일 | 2020-06-04 |

## 변액보험코리아원자재지수연계증권1호(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   | 29,943 | 0     | 29,943    | 장외 |

※ 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

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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 2,180 |
|-------|

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-05 |
| 기준일 | 2020-06-04 |

## 변액보험코리아글로벌지수연계증권1호(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   | 12,798 | 0     | 12,798    | 장외 |

※ 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

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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 940 |
|-----|

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)

|   |
|---|
| 8 |
|---|

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

공시일 2020-06-05  
기준일 2020-06-04

## 변액보험코리아원자재지수연계증권2호(주식혼합-파생형)

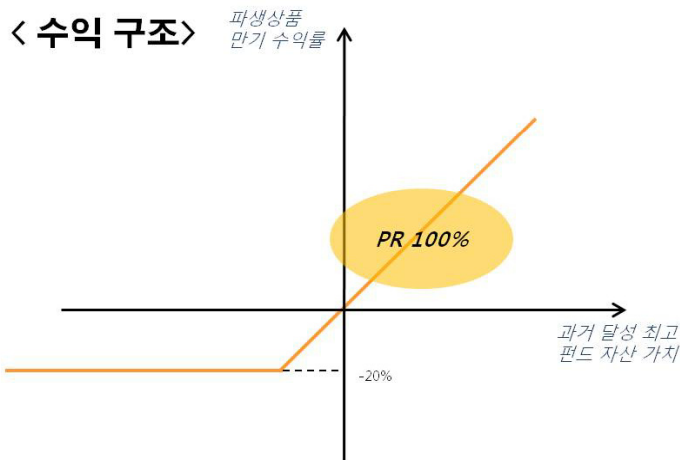
### 1. 계약금액

(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 것으로써 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)

305

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)

3

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-05 |
| 기준일 | 2020-06-04 |

## 코리아차이나지수연계증권1호(주식혼합-파생형)

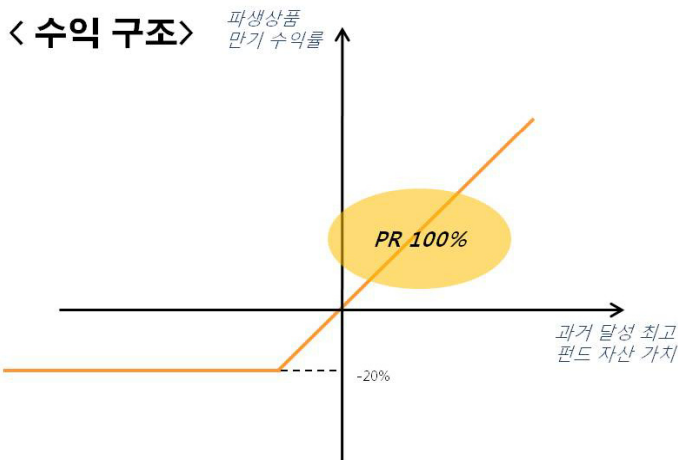
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 2,497 | 0     | 2,497     | 장외 |

※ 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



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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

171

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)

2

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