

공시일 2025-11-10

기준일 2025-11-07

## 골드리치특별자산(금-파생형)

## 1. 계약금액

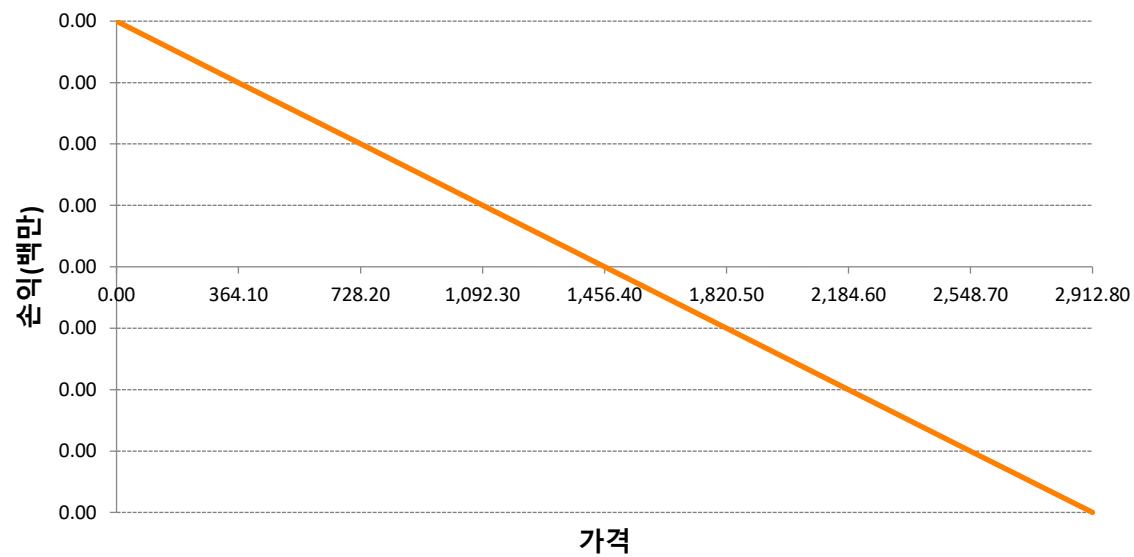
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	실물자산	선도	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	6,396	0	6,396	장내
누계	실물자산	선도	29,869	0	29,869	장내
누계	통화	선물	0	6,699	-6,699	장내

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

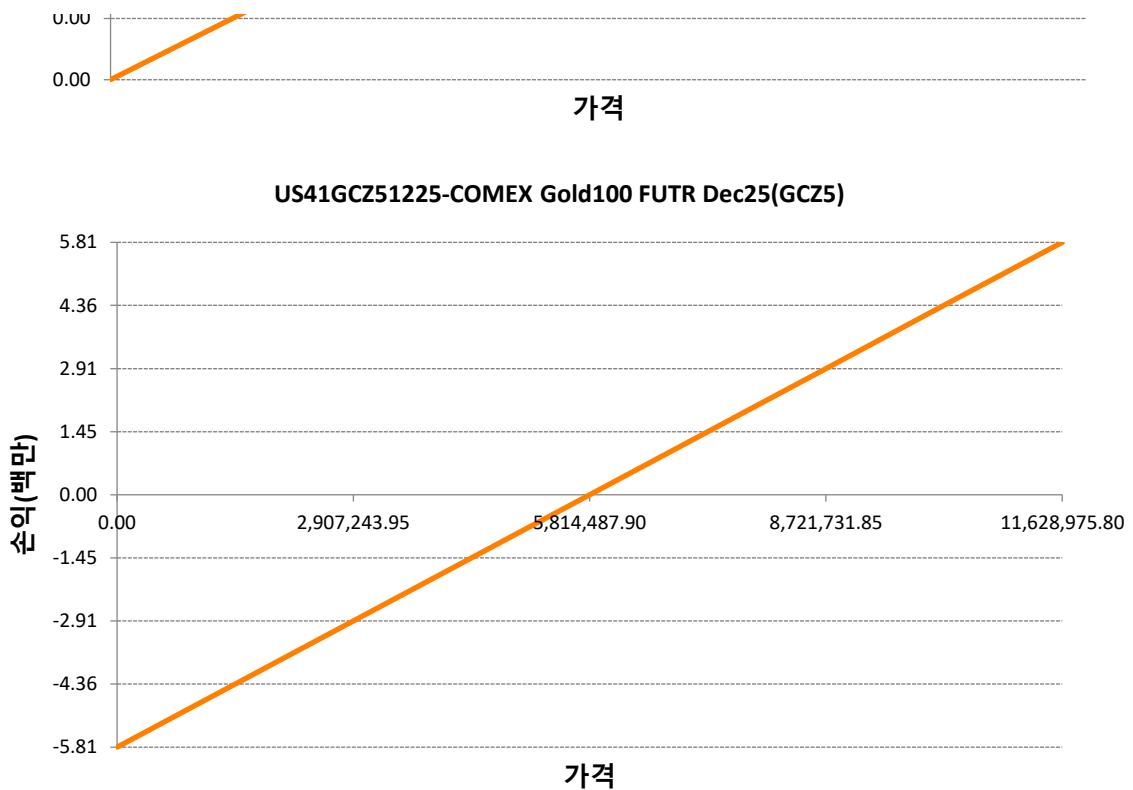
## 2. 만기시점의 손익구조

## KR4175WB0005-2025-11 달러선물



## LBMA20251121-LBMA골드ICBC20251121





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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만 원)

3,437

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:백만 원)

2,567

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

공시일 2025-11-10

기준일 2025-11-07

## 변액보험코리아원자재지수연계증권3(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

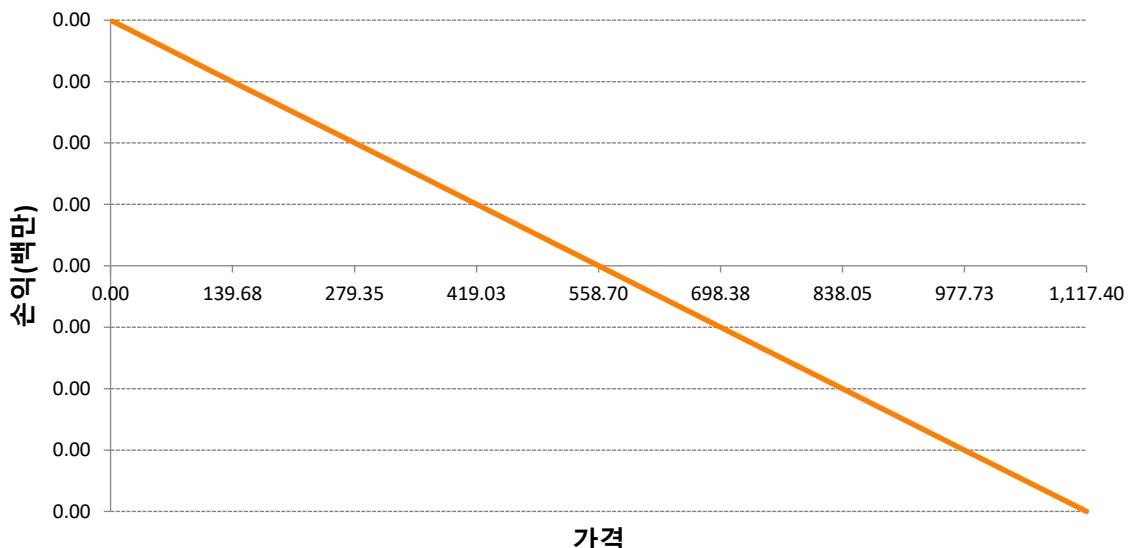
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3,333	-3,333	장내
누계	유가증권	선물	0	1,816	-1,816	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

KR4101WC0003-2025-12 코스피200지수선물



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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

145

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)

0

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

공시일 2025-11-10

기준일 2025-11-07

## 변액보험코리아글로벌지수연계증권3(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

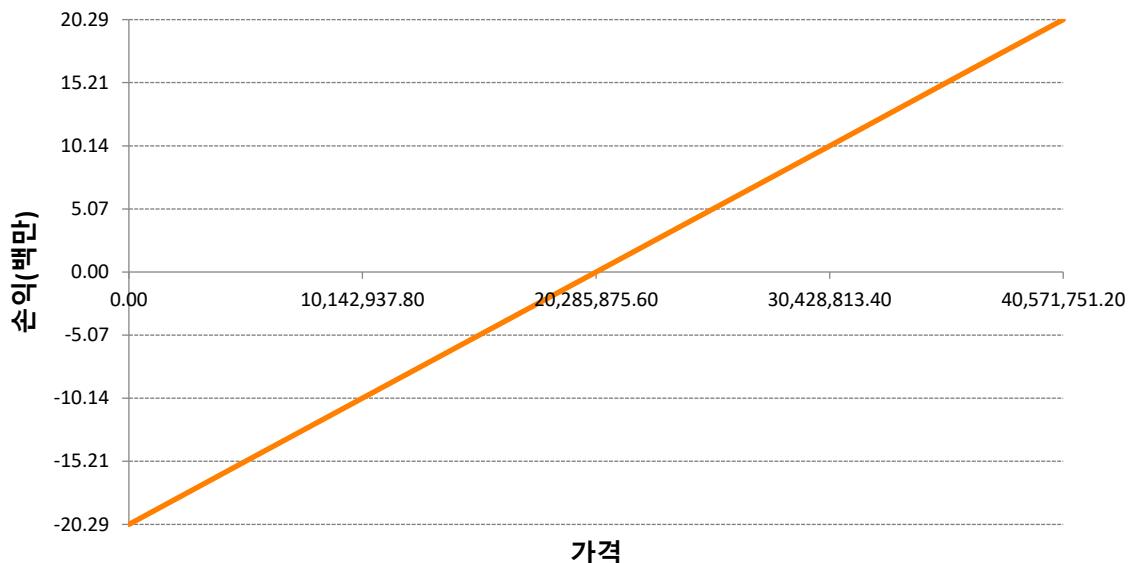
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	972	-972	장내
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	559	-559	장내
누계	지수	선물	203	0	203	장내

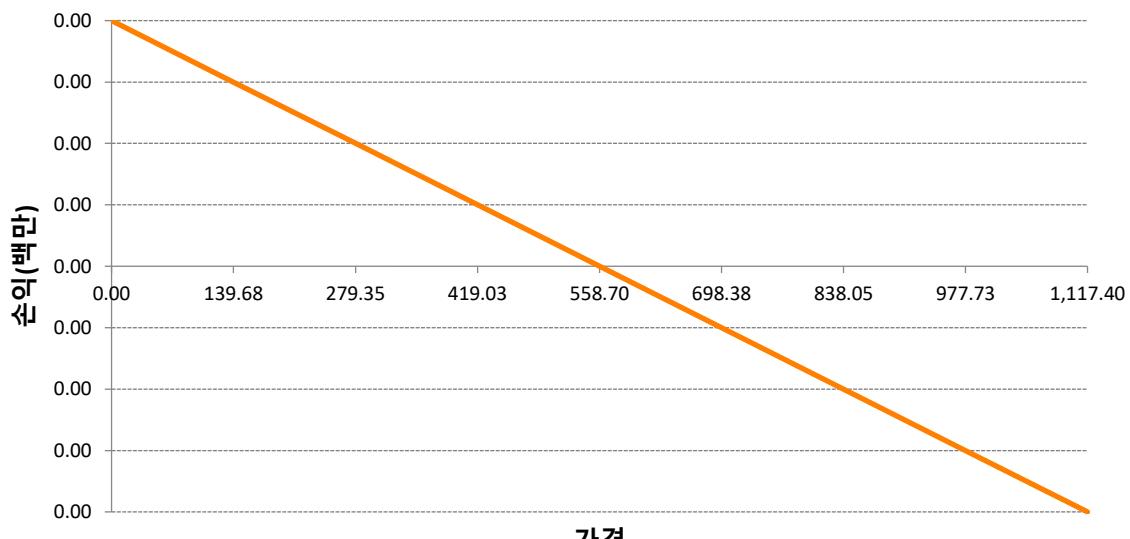
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액 또는 명목계약금액을 원화로 표시한 것으로써 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

### 2. 만기시점의 손익구조

DE41ZWPZ5C25-MSCI World Index Dec25(ZWPZ5)



KR4101WC0003-2025-12 코스피200지수선물



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

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

61

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)

12

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

공시일 2025-11-10

기준일 2025-11-07

## 변액보험코리아원자재지수연계증권4(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

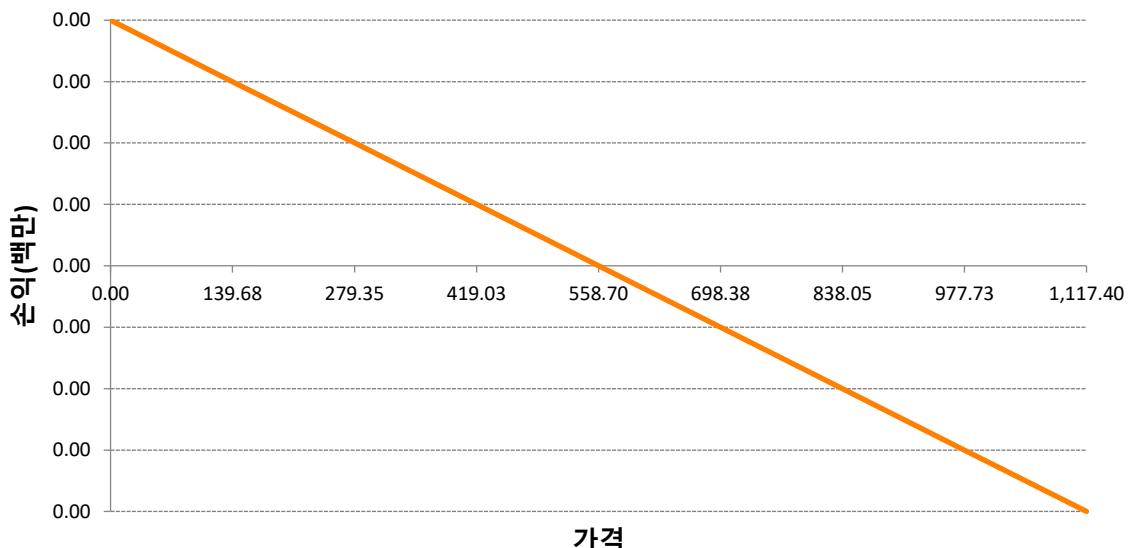
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	278	-278	장내
누계	유가증권	선물	0	140	-140	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

KR4101WC0003-2025-12 코스피200지수선물



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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

11

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)

0

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

공시일 2025-11-10

기준일 2025-11-07

## 변액보험코리아차이나지수연계증권2(주Hon-파생형)

### 1. 계약금액

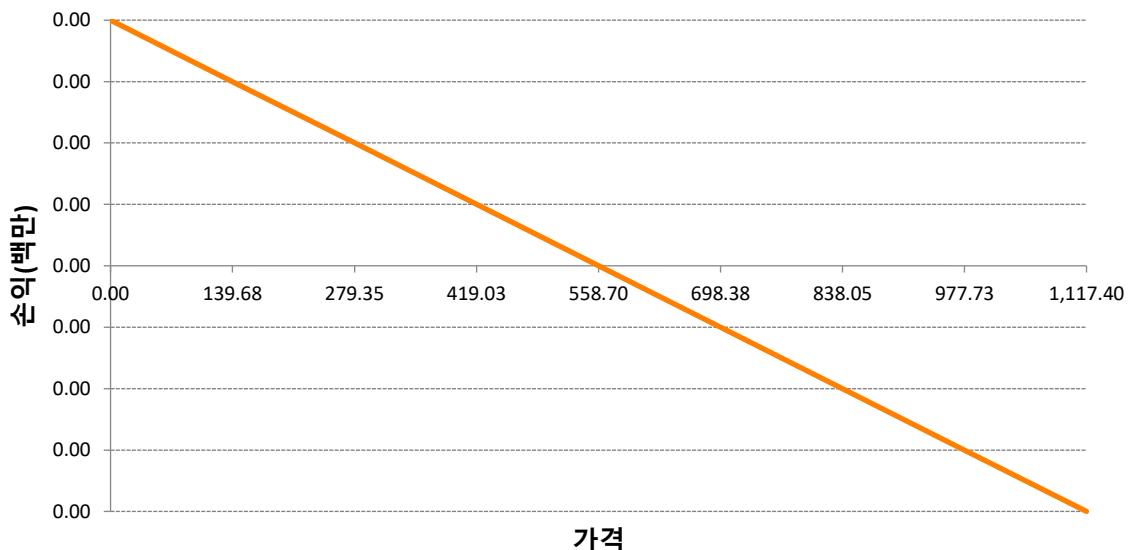
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	140	-140	장내
누계	유가증권	선물	0	140	-140	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

KR4101WC0003-2025-12 코스피200지수선물



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

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

11

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)

0

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