

## (무)알리안츠변액적립보험팀챌린지자산배분D형

공시일 : 2017-12-13

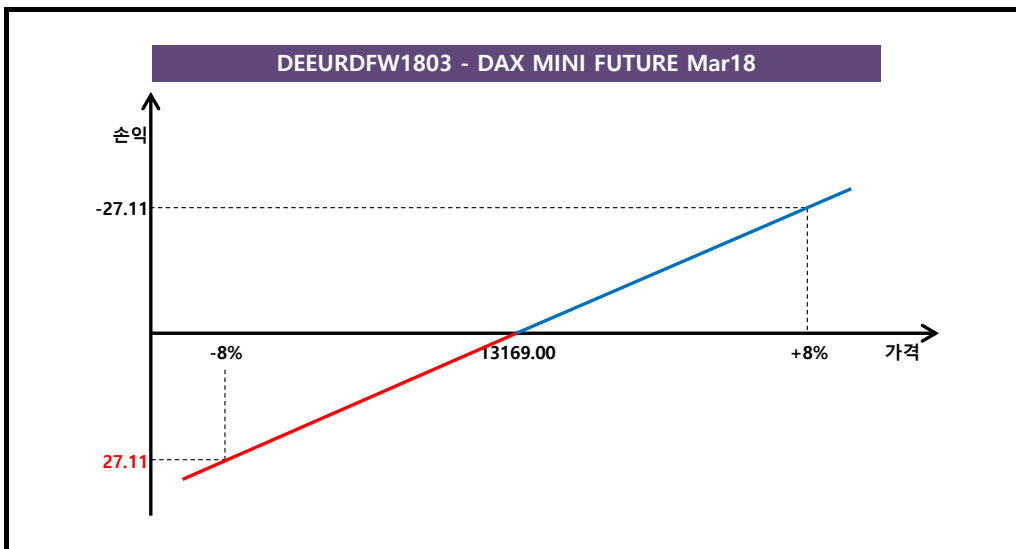
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	339	0	339	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	339	0	339	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

만기 DAX 선물이 13169.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



### 3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8.00%	27.11
	5.33%	18.06
	2.67%	9.05
	0%	0.00
	-2.67%	-9.05
	-5.33%	-18.06
	-8.00%	-27.11
최대손실 시나리오 위험액		27.11

### 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액

18.37