

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2017-12-04

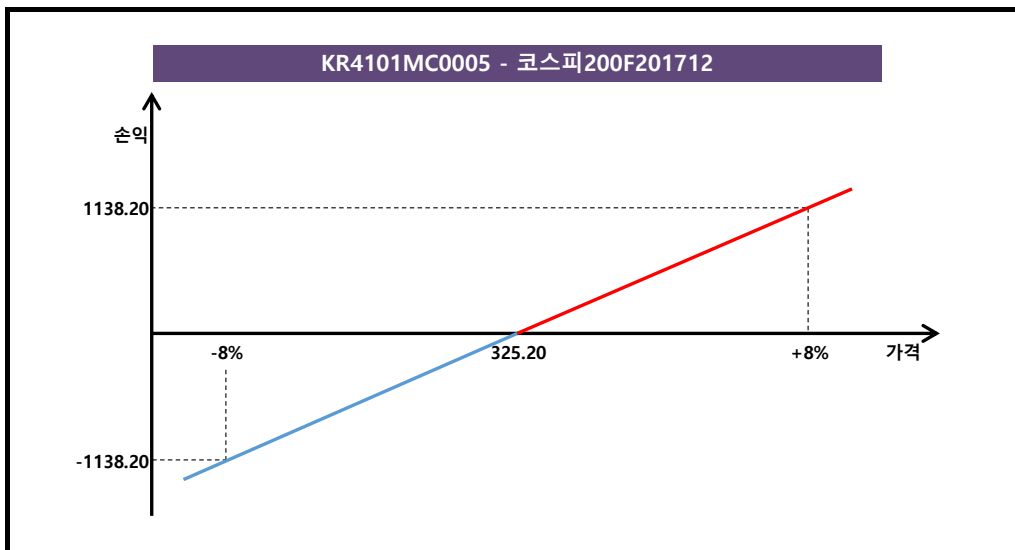
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	14,228	0	14,228	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	14,228	0	14,228	장내

2. 만기시점의 손익구조

만기 코스피200 선물이 325.20 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%
	5.33%
	2.67%
	0%
	-2.67%
	-5.33%
	-8.00%
최대손실 시나리오 위험액	
1,138.20	

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	1,331.65
-----	----------