ABLKOSPI200인덱스증권모투자신탁[주식_파생형]

공시일 : 2018-08-01

1. 계약금액

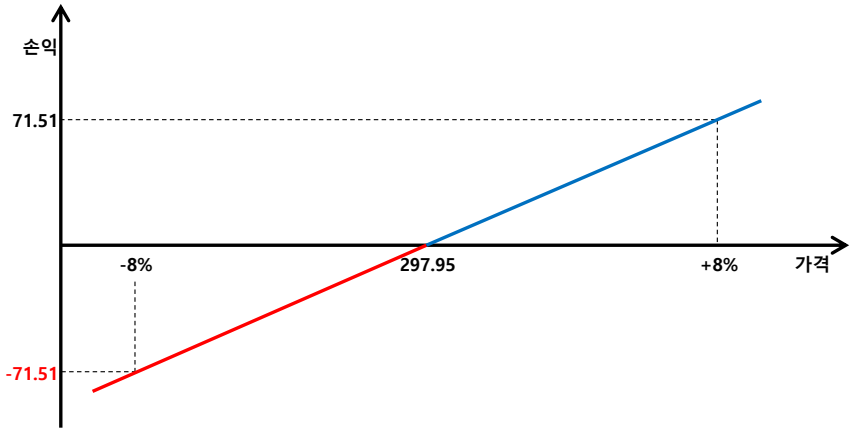
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	894	0	894	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	894	0	894	장내

2. 만기시점의 손익구조

만기 KOSPI200 선물이 297.95 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생

KR4101N90006 - 코스피200 F 201809



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	71.51
	5.33%	47.64
	2.67%	23.87
	0%	0.00
	-2.67%	-23.87
	-5.33%	-47.64
	-8.00%	-71.51

최대손실 시나리오 위험액	71.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	79.85