(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2018-08-02

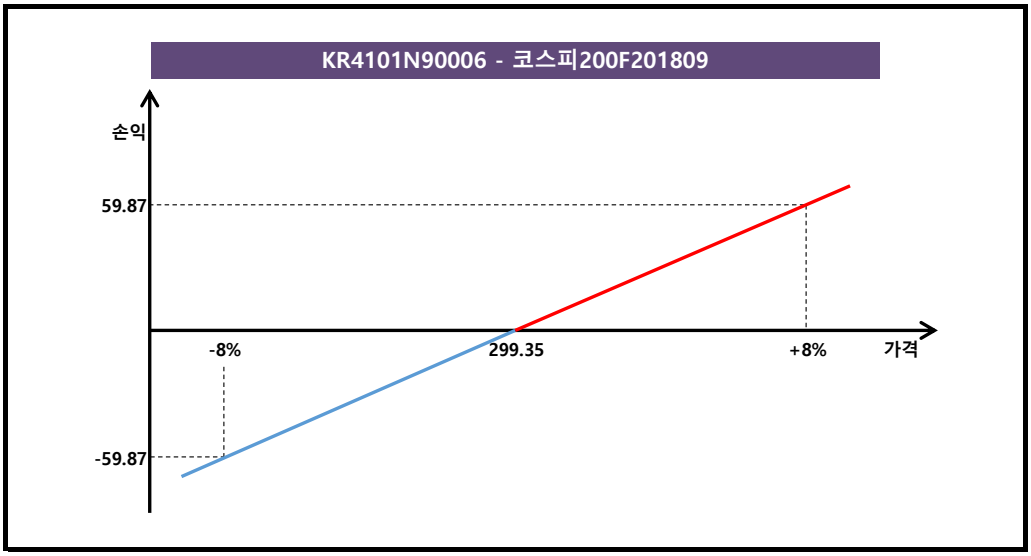
1. 계약금액

(단위:백만원)

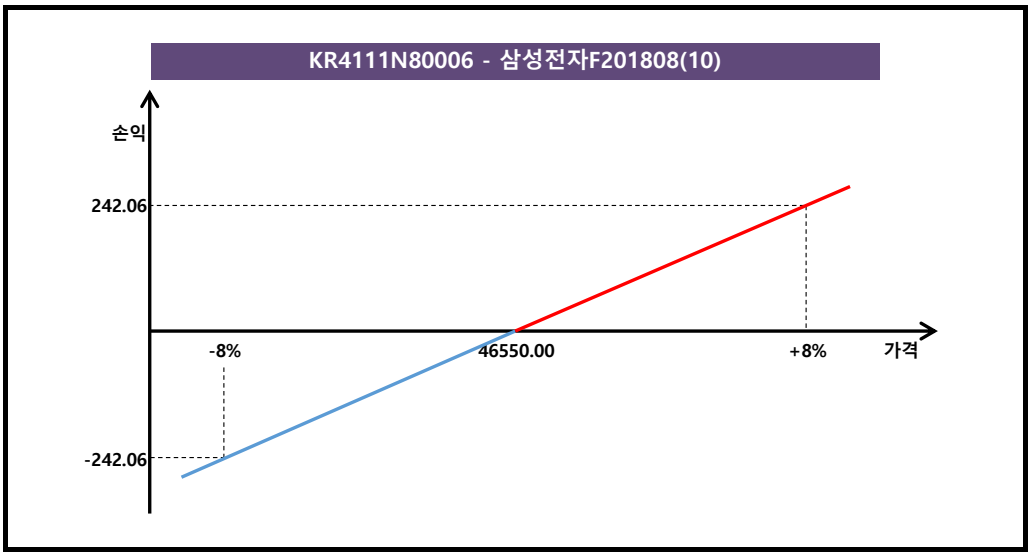
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	3,774	0	3,774	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	3,774	0	3,774	장내

2. 만기시점의 손익구조

만기 코스피200 F 201809 이 299.35 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 삼성전자 F 201808 (10) 이 46550.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	301.93
	5.33%	201.16
	2.67%	100.77
	0%	0.00
	-2.67%	-100.77
	-5.33%	-201.16
	-8.00%	-301.93

최대손실 시나리오 위험액	301.93

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR) (단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	433.81