

(무)알리안츠파워밸런스\_코리아인덱스

공시일 : 2020-10-23

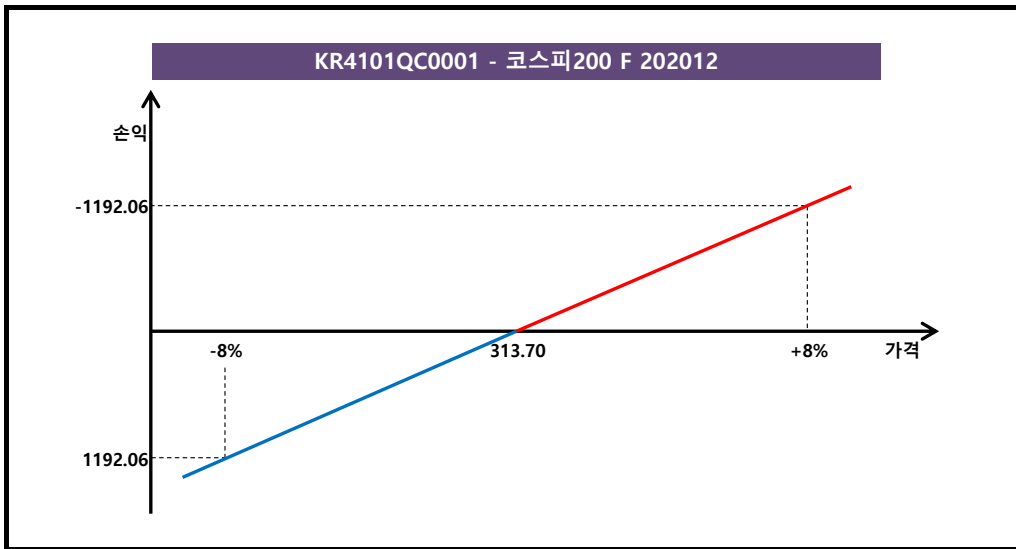
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형  | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|-------|--------|-------|-----------|----|
| 누적 | 유가증권 | 선물    | 14,901 | 0     | 14,901    | 장내 |
| 누적 | 유가증권 | 옵션    | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물+옵션 | 14,901 | 0     | 14,901    | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

만기 코스피200 F 202012이 313.70 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

| 구분            | 시나리오   |           |
|---------------|--------|-----------|
| 기초자산<br>시나리오  | 8.00%  | 1,192.06  |
|               | 5.33%  | 794.21    |
|               | 2.67%  | 397.85    |
|               | 0%     | 0.00      |
|               | -2.67% | -397.85   |
|               | -5.33% | -794.21   |
|               | -8.00% | -1,192.06 |
| 최대손실 시나리오 위험액 |        | 1,192.06  |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

|     |          |
|-----|----------|
| 위험액 | 1,692.24 |
|-----|----------|