

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2020-02-11

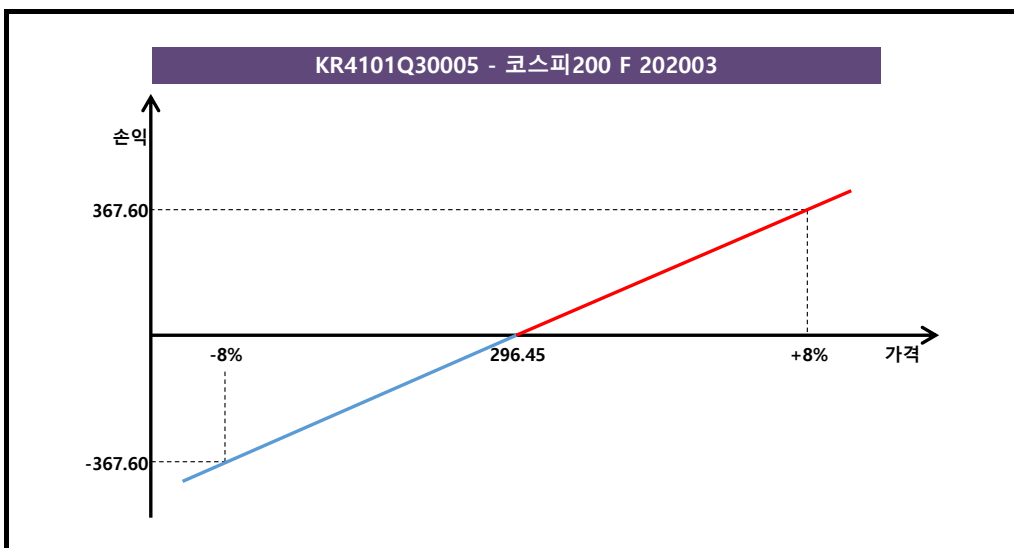
1. 계약금액

(단위:백만원)

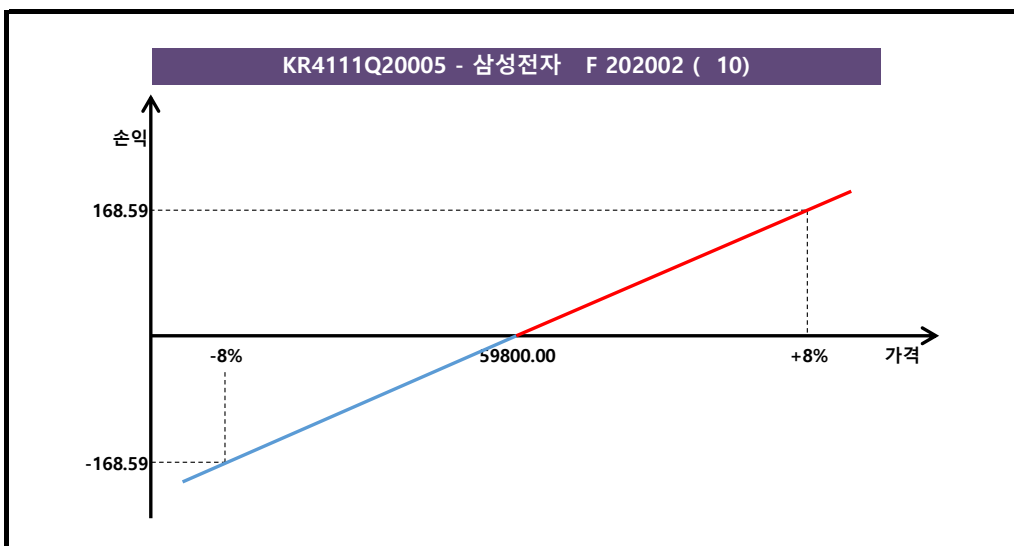
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	9,697	0	9,697	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	9,697	0	9,697	장내

2. 만기시점의 손익구조

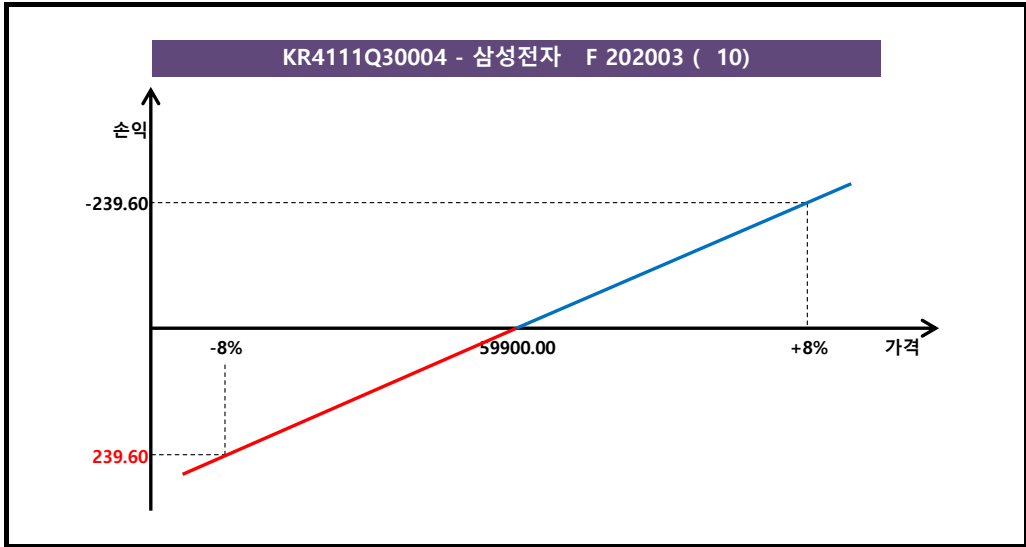
만기 KOSPI200 선물이 296.45 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 삼성전자F 202002 (10)이 59800.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 삼성전자 F 202003 (10)이 59900.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	775.79
	5.33%	516.87
	2.67%	258.92
	0%	0.00
	-2.67%	-258.92
	-5.33%	-516.87
	-8.00%	-775.79
최대손실 시나리오 위험액		775.79

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR) (단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	975.07
-----	--------