

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2021-01-04

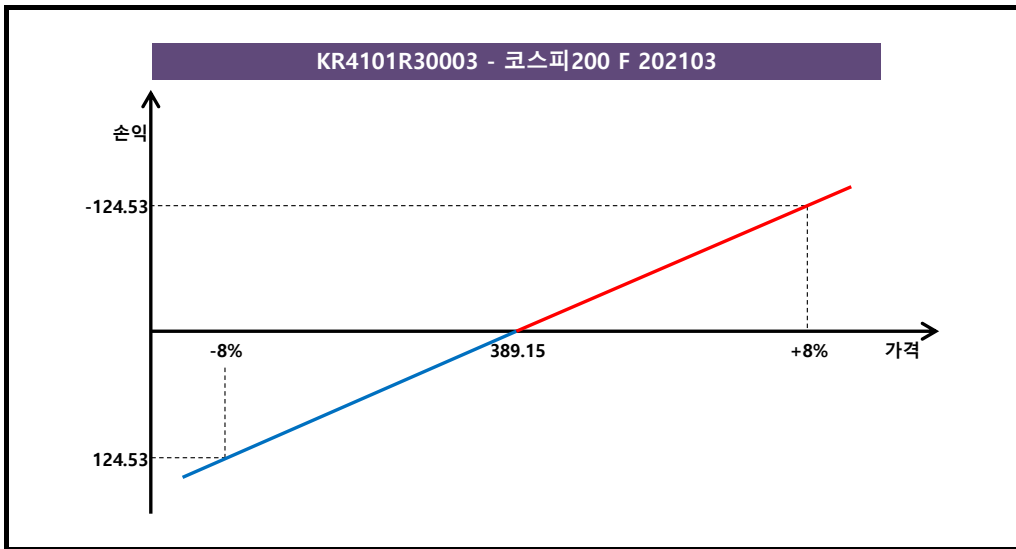
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	1,557	0	1,557	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	1,557	0	1,557	장내

2. 만기시점의 손익구조

만기 코스피200 F 202103이 389.15 보다 작을(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8.00%	124.53
	5.33%	82.97
	2.67%	41.56
	0%	0.00
	-2.67%	-41.56
	-5.33%	-82.97
	-8.00%	-124.53
최대손실 시나리오 위험액		124.53

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	186.15
-----	--------