

공시일 2021-03-24
 기준일 2021-03-23

AZ파워밸런스변액연금 글로벌인덱스 리스크컨트롤 펀드

1. 계약금액

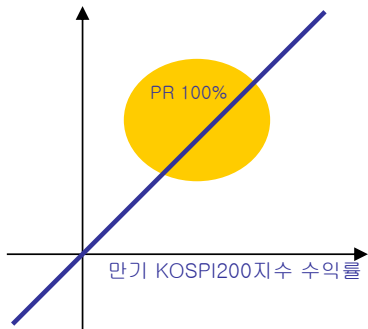
(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|-------|---------|-------|-----------|----|
| 보유 | 지수 | 국내선물 | 41,427 | 0 | 41,427 | 장내 |
| 보유 | 지수 | 해외선물 | 243,847 | 0 | 243,847 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 국내외선물 | 285,274 | 0 | 285,274 | 장내 |

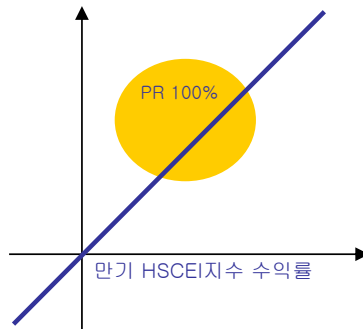
※ 포지션값은 해당 파생상품의 취득가액을 원화로 표시한 것으로서 해당 파생상품이 외화표시일 경우 추가 매입매도 없이 해당 포지션의 수치는 환율에 따라 변동할 수 있습니다.

2. 만기시점의 손익구조

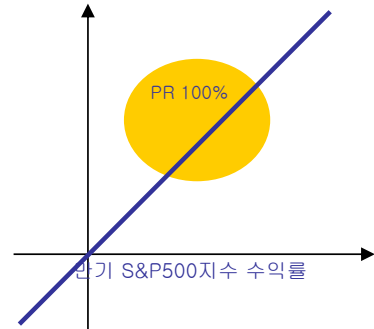
KOSPI200지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



HSCEI지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



S&P500 지수 관련 장내 파생상품 Pay-Off



※ 상기 도해는 거래상대방이 충실하게 의무이행할 것을 가정하며, 투자신탁의 수익구조가 아닌 편입된 파생상품의 수익구조에 관한 도해입니다.

3. 시나리오별 손익구조변동 (최대손실예상금액)

(단위:백만원)

22,826

주) 최대손실 예상금액은 각 포함종목의 최대손실예상금액의 합산 값입니다.

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용에서 관련법규에서 정한 산출방식으로 산출함

4. 파생상품의 최대손실예상금액 (VAR : 99%신뢰수준, 10일기준)

(단위:백만원)

33,989

※ 산출된 값(최대손실예상금액)은 이스트스프링자산운용에서 관련법규에서 정한 산출방식으로 산출함