

알리안츠 KOSPI200 인덱스 증권 투자신탁 [주식_파생형]

공시일 : 2013-07-16

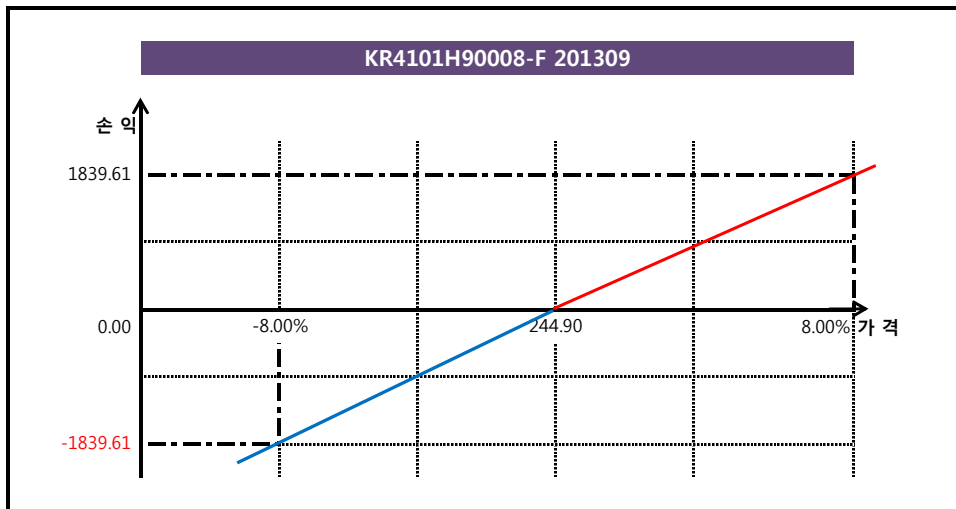
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	22,898	0	22,898	장내
누계	유가증권	선물	22,898	0	22,898	장내

2. 만기시점의 손익구조

만기 KOSPI200이 244.90 보다 큰(작은) 경우 이익(손실) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	1,839.61
	5.33%	1,225.64
	2.67%	613.97
	0%	0.00
	-2.67%	-613.97
	-5.33%	-1,225.64
	-8.00%	-1,839.61
최대손실 시나리오 위험액		1,839.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액

2,022.56