

집합투자기구(파생형)의 위험에 관한 지표공시 변액유니버설종신적립형 인덱스 주식형_한화자산운용

2018-10-31

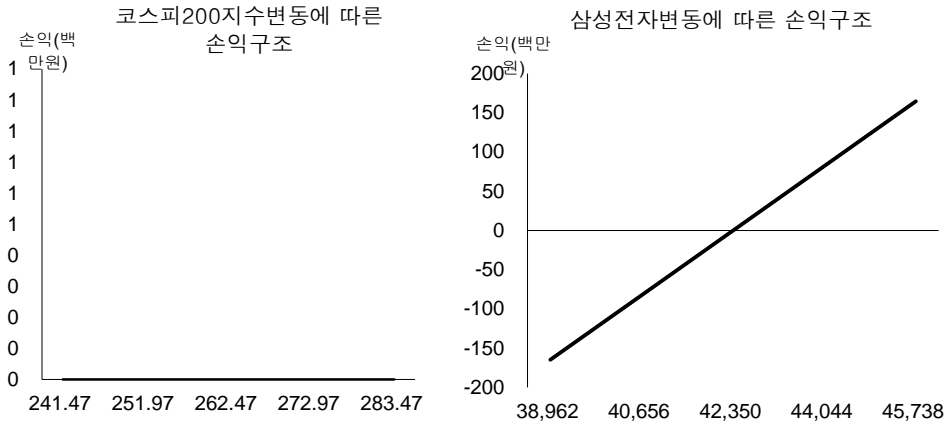
변액유니버설종신적립형 인덱스 주식형

1. 계약금액

(단위, 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수	매도	순포지션	비고
신규	삼성전자	선물	143	0	143	
	KOSPI200	선물	143	0	143	
누계	유가증권	선물	1,025	0	1,025	
		옵션 스왑				
합계			1,025	0	1,025	

2. 파생상품 거래에 따른 만기시점의 손익구조



Kospi200지수가 262.47보다 큰(작은)경우 이익(손실)발생

삼성전자가 42,350보다 큰(작은)경우 이익(손실)발생

3. 시나리오별 손익구조변동

- 유가증권 (기초자산 : Kospi200 현물지수)

(단위 : 백만원)

가격변동시나리오	-8%	-6%	-4%	-2%	2%	4%	6%	8%
시나리오별 기초자산가격	241.47	246.72	251.97	257.22	267.72	272.97	278.22	283.47
집합투자재산의 손익변동	0	0	0	0	0	0	0	0

- 유가증권 (기초자산 : 삼성전자)

(단위 : 백만원)

가격변동시나리오	-8%	-6%	-4%	-2%	2%	4%	6%	8%	
시나리오별 기초자산가격	38,962	39,809	40,656	41,503	43,197	44,044	44,891	45,738	
집합투자재산의 손익변동	-165	-124	-82	-41	0	41	82	124	165

4. 최대손실예상금액 (Value at Risk)

VaR : 0.00 (백만원) --- KOSPI200

VaR : 131.36 (백만원) --- 삼성전자

주1) 최대손실예상금액(VaR)은 펀드의 최대손실금액이 아닌 파생상품의 최대손실금액임

주2) 최대손실예상금액은 10영업일의 보유기간 및 단측 신뢰구간 99%의 단측 신뢰구간을 적용하여 계산됨

주3) 단, 옵션의 경우 최대손실예상금액은 금융감독원에서 제시하는 델타플러스법으로 계산된 값으로 기타파생상품의 10영업일의 보유기간 및 단측 신뢰구간 99%의 단측 신뢰구간을 적용하여 산정되는 최대손실예상금액과 다름