

## (무)알리안츠파워밸런스\_코리아인덱스

공시일 : 2022-02-10

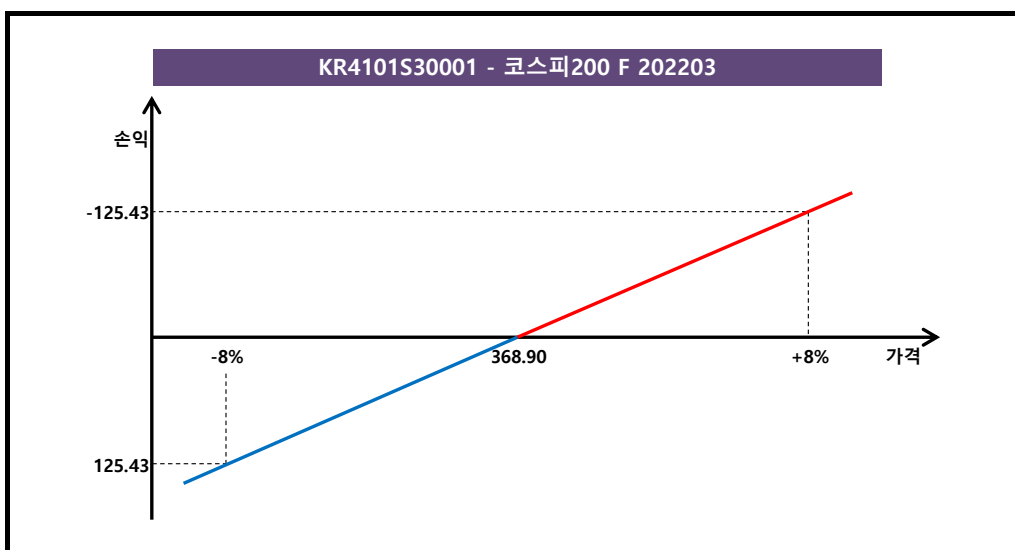
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	1,568	0	1,568	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	1,568	0	1,568	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

만기 코스피200 F 202203이 368.90 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



### 3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8.00%	125.43
	5.33%	83.57
	2.67%	41.86
	0%	0.00
	-2.67%	-41.86
	-5.33%	-83.57
	-8.00%	-125.43
최대손실 시나리오 위험액		125.43

### 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액

178.13