

(무)알리안츠파워밸런스\_코리아인덱스

공시일 : 2022-04-05

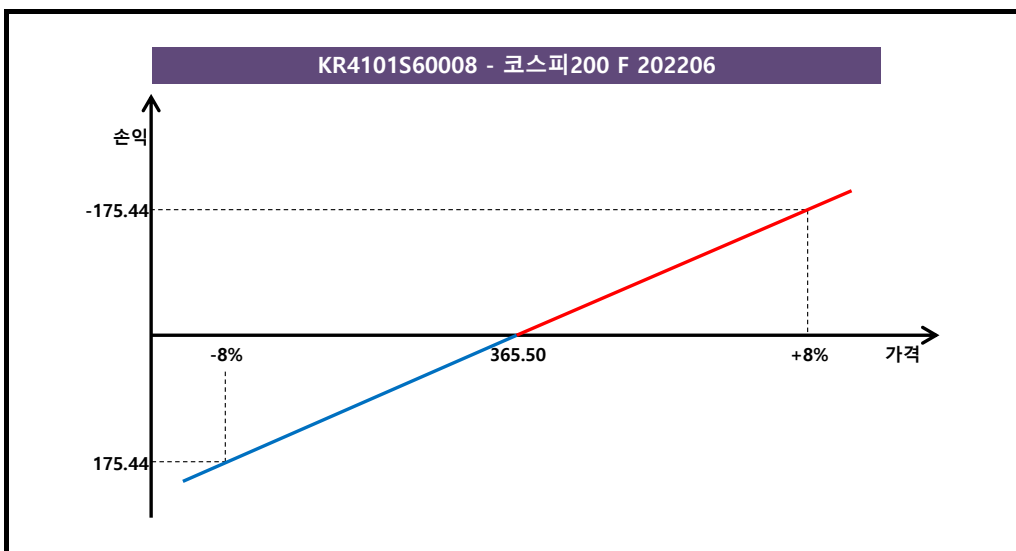
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	2,193	0	2,193	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	2,193	0	2,193	장내

2. 만기시점의 손익구조

만기 코스피200 F 202206이 365.50 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8.00%	175.44
	5.33%	116.89
	2.67%	58.55
	0%	0.00
	-2.67%	-58.55
	-5.33%	-116.89
	-8.00%	-175.44
최대손실 시나리오 위험액		175.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	258.81
-----	--------