

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2023-01-04

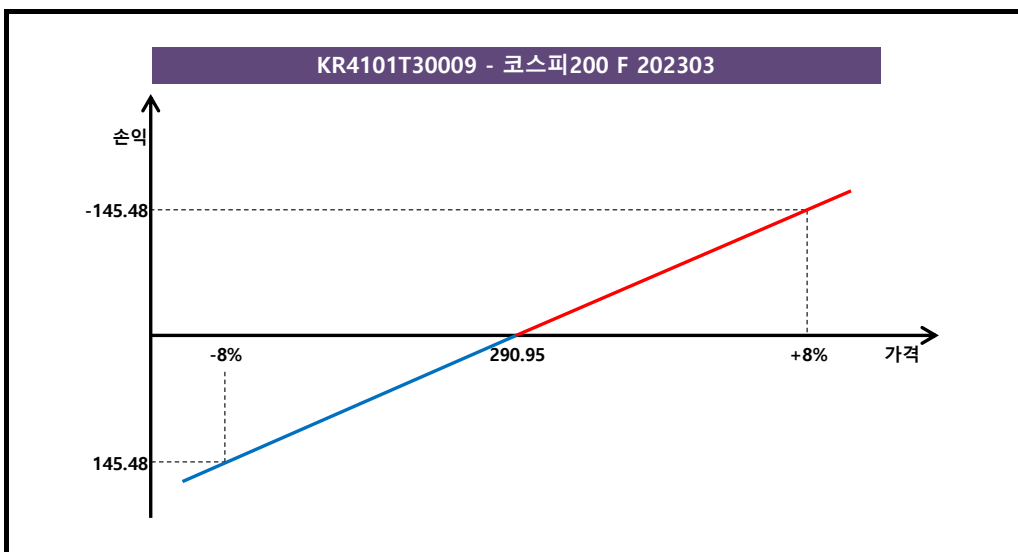
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|-------|-------|-------|-----------|----|
| 누적 | 유가증권 | 선물 | 1,818 | 0 | 1,818 | 장내 |
| 누적 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물+옵션 | 1,818 | 0 | 1,818 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

만기 코스피200 F 202303이 290.95 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

| 구분 | 시나리오 | |
|---------------|--------|---------|
| 기초자산 시나리오 | 8.00% | 145.48 |
| | 5.33% | 96.92 |
| | 2.67% | 48.55 |
| | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -48.55 |
| | -5.33% | -96.92 |
| | -8.00% | -145.48 |
| 최대손실 시나리오 위험액 | | 145.48 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 203.23 |
|-----|--------|