

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2024-05-02

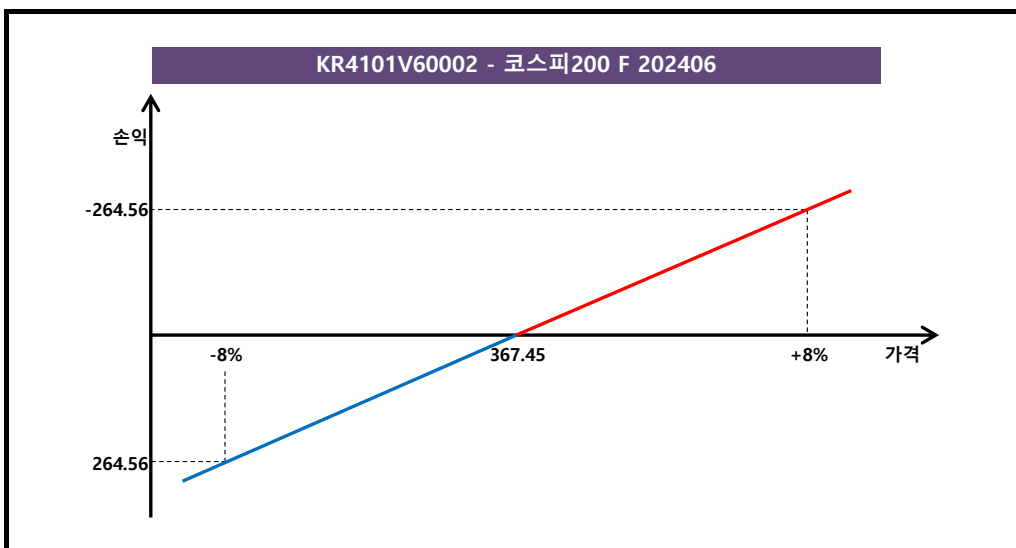
1. 계약금액

(단위:백만원)

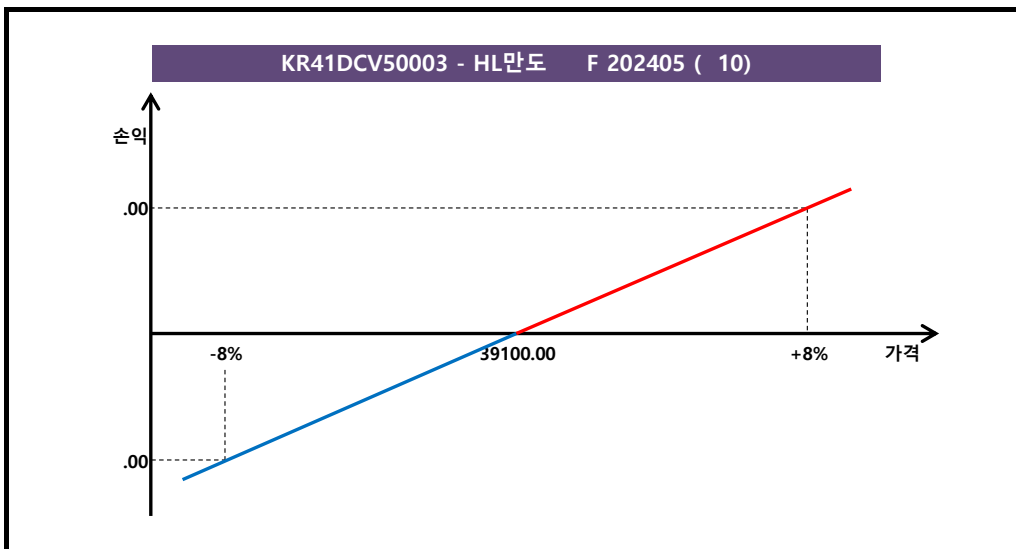
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	3,307	0	3,307	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	3,307	0	3,307	장내

2. 만기시점의 손익구조

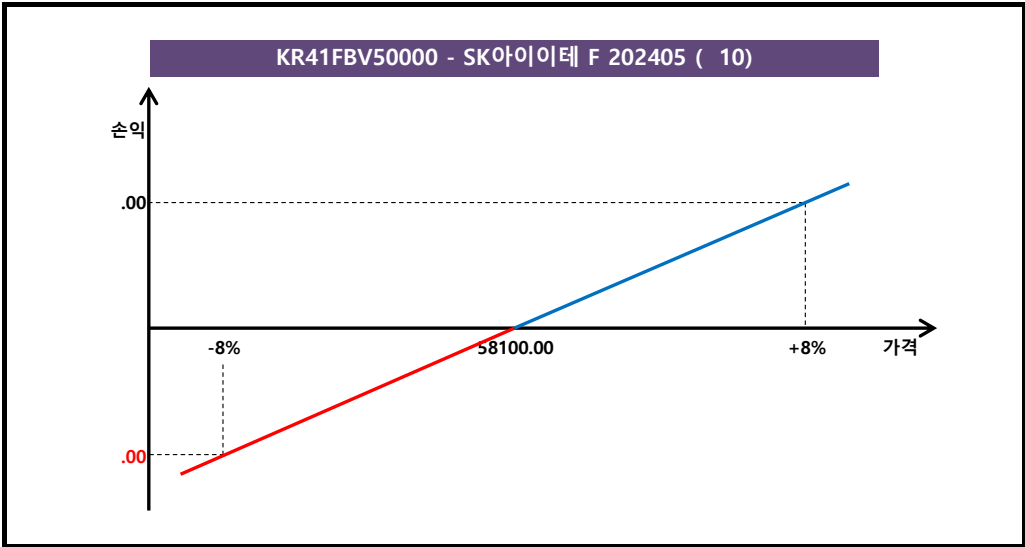
만기 코스피200 F 202406이 367.45 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



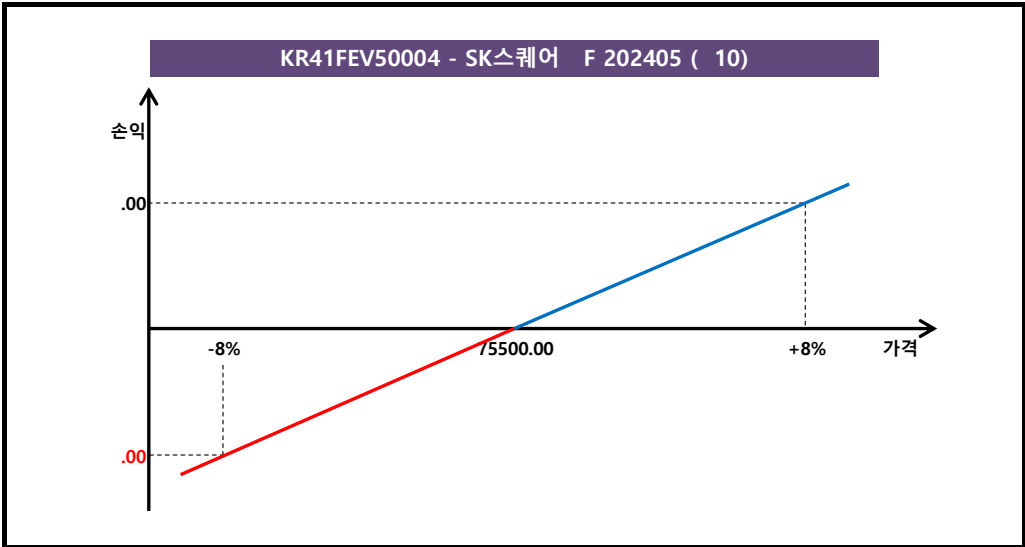
만기 HL만도 F 202405 (10)이 39100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



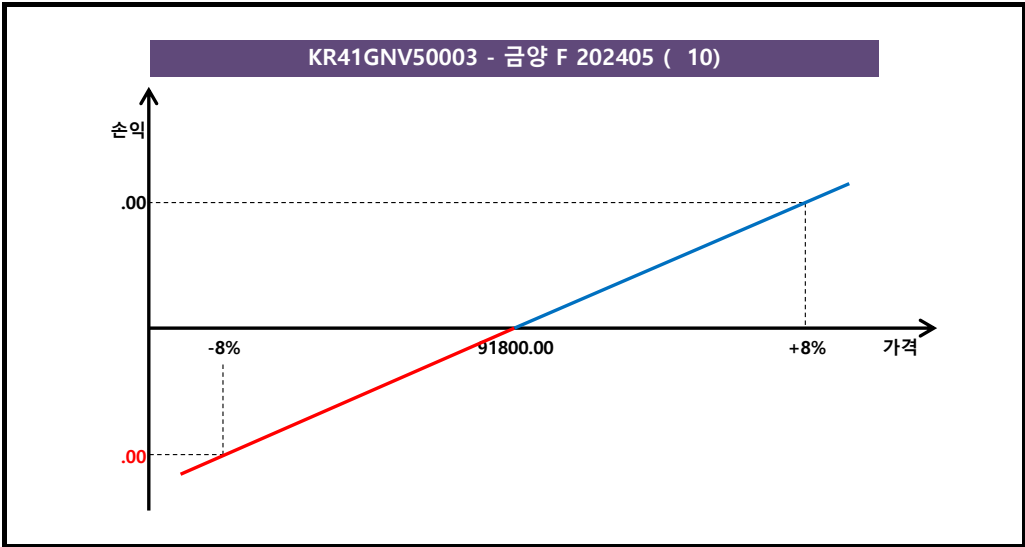
만기 SK아이이테크 F 202405 (10)이 58100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 SK스퀘어 F 202405 (10)이 75500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 금양 F 202405 (10)이 91800.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	264.56
	5.33%	176.27
	2.67%	88.30
	0%	0.00
	-2.67%	-88.30
	-5.33%	-176.27
	-8.00%	-264.56
최대손실 시나리오 위험액		264.56

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR) (단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	319.03
-----	--------