

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2024-05-03

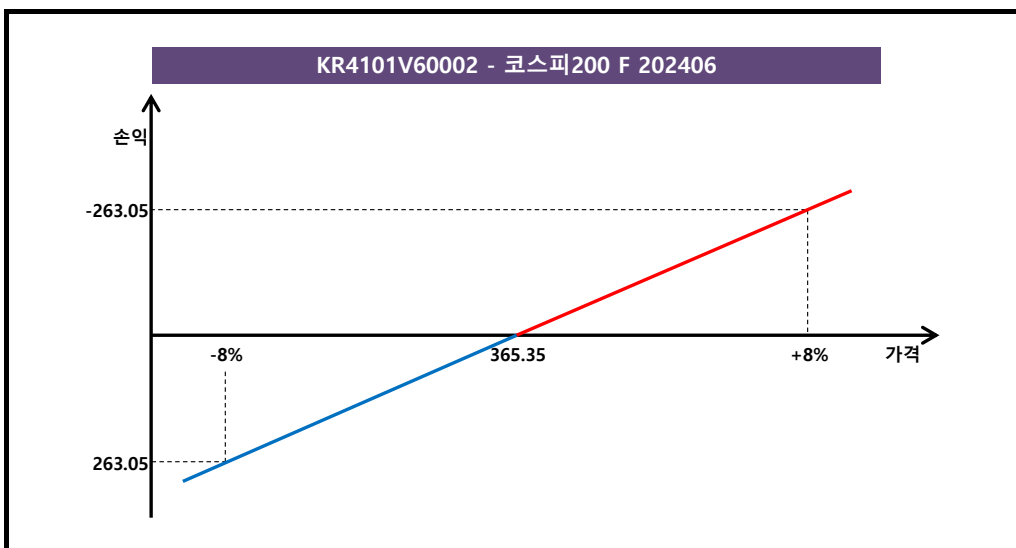
1. 계약금액

(단위:백만원)

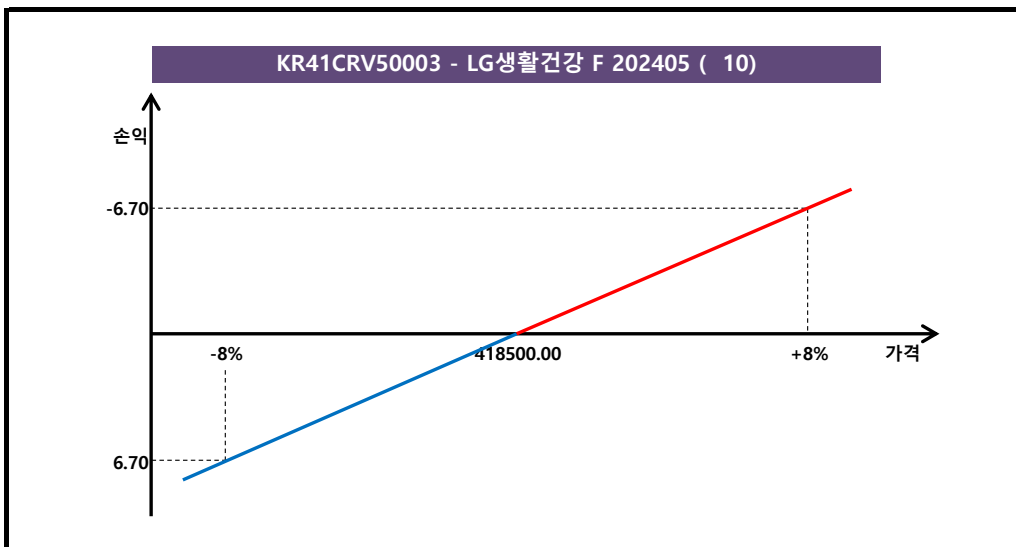
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	3,549	0	3,549	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	3,549	0	3,549	장내

2. 만기시점의 손익구조

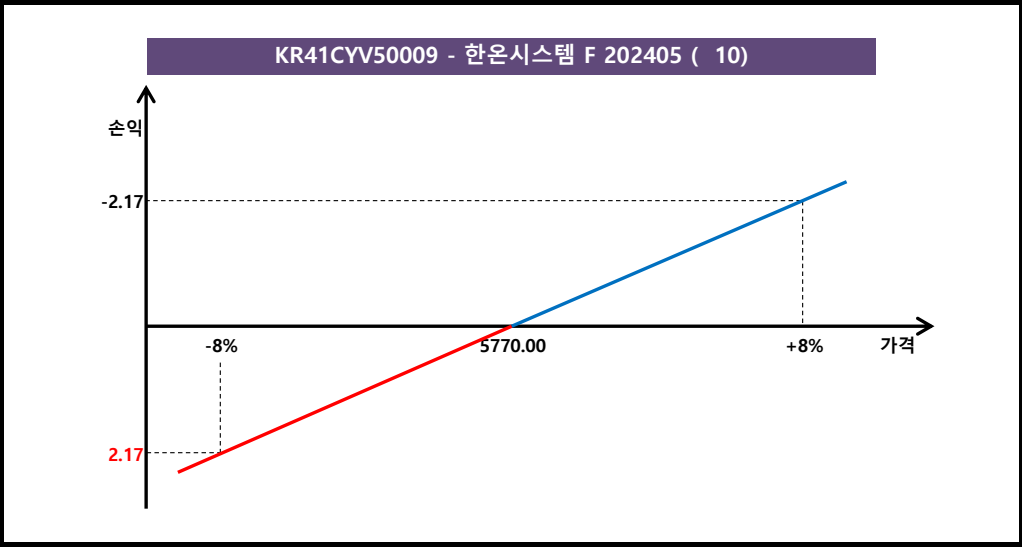
만기 코스피200 F 202406이 365.35 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



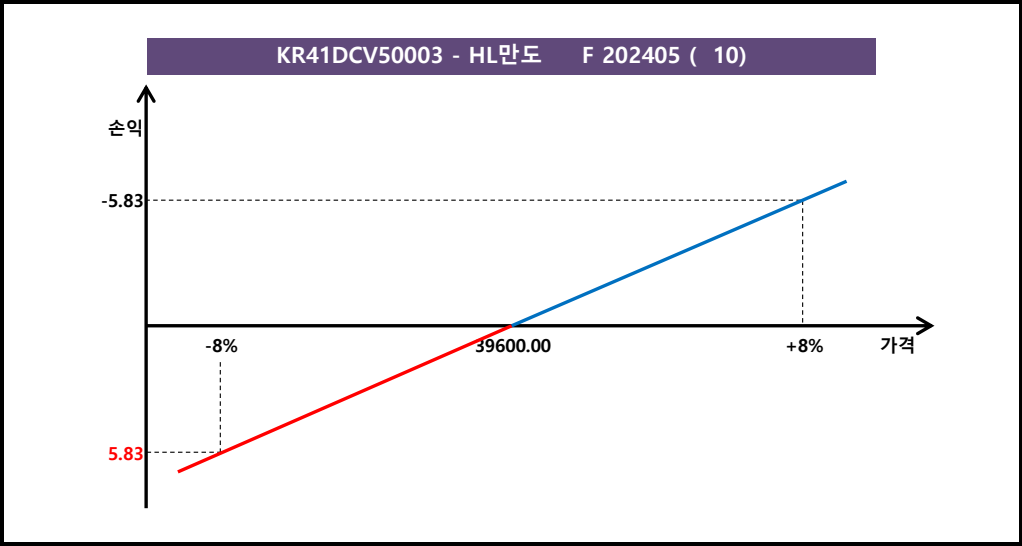
만기 LG생활건강 F 202405 (10)이 418500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



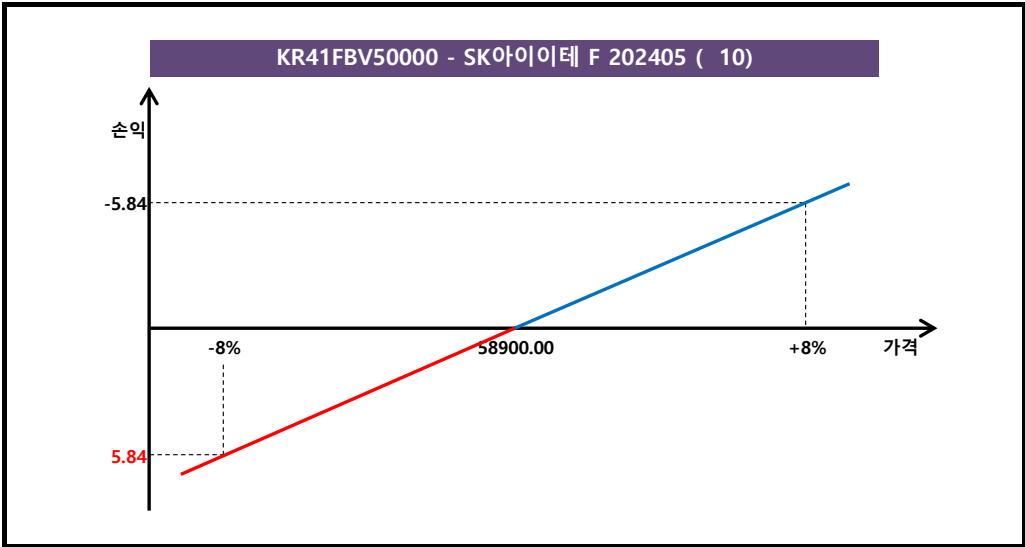
만기 한온시스템 F 202405 (10)이 5770.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



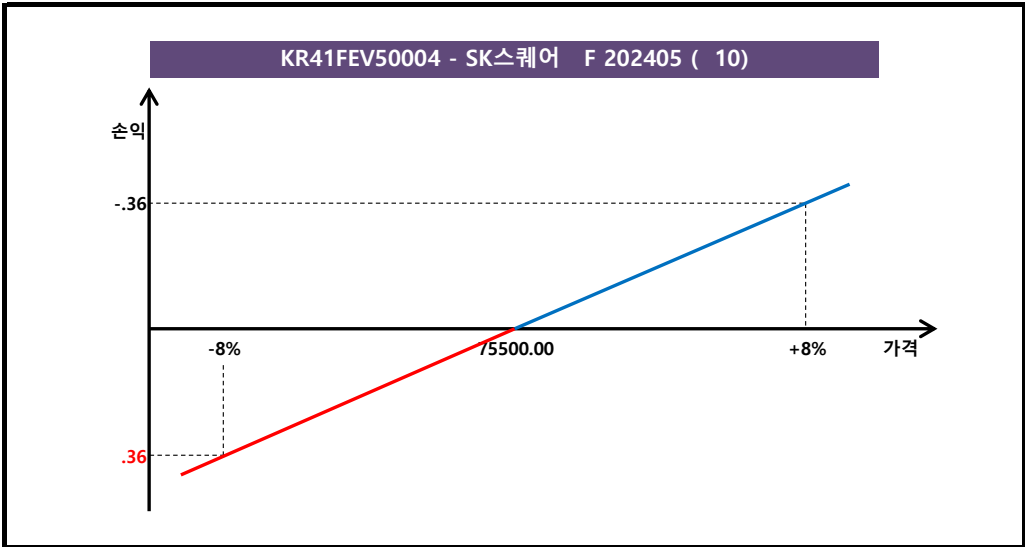
만기 HL만도 F 202405 (10)이 39600.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 SK아이이테크 F 202405 (10)이 58900.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



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



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	283.95
	5.33%	189.18
	2.67%	94.77
	0%	0.00
	-2.67%	-94.77
	-5.33%	-189.18
	-8.00%	-283.95
최대손실 시나리오 위험액		283.95

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	369.76
-----	--------