

## (무)알리안츠파워밸런스\_코리아인덱스

공시일 : 2024-05-07

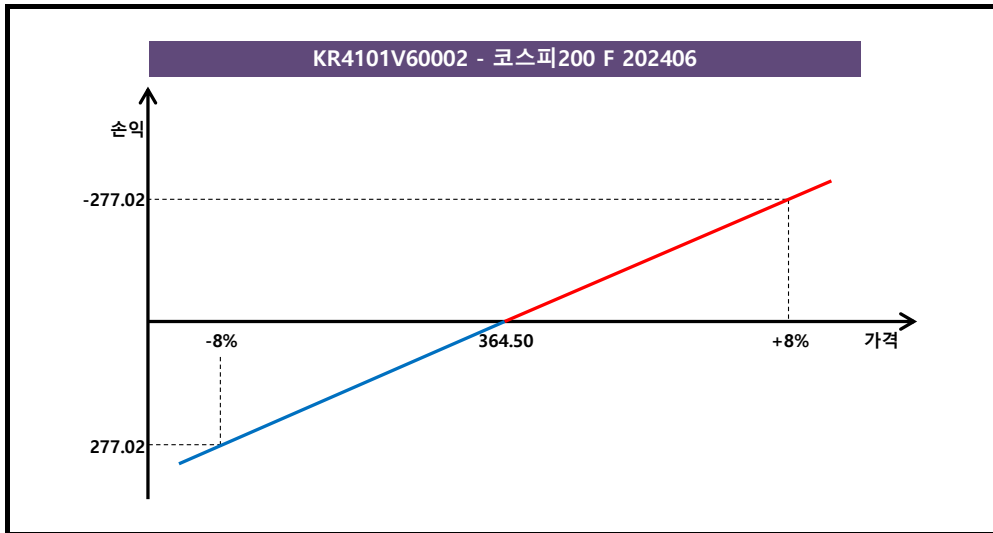
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

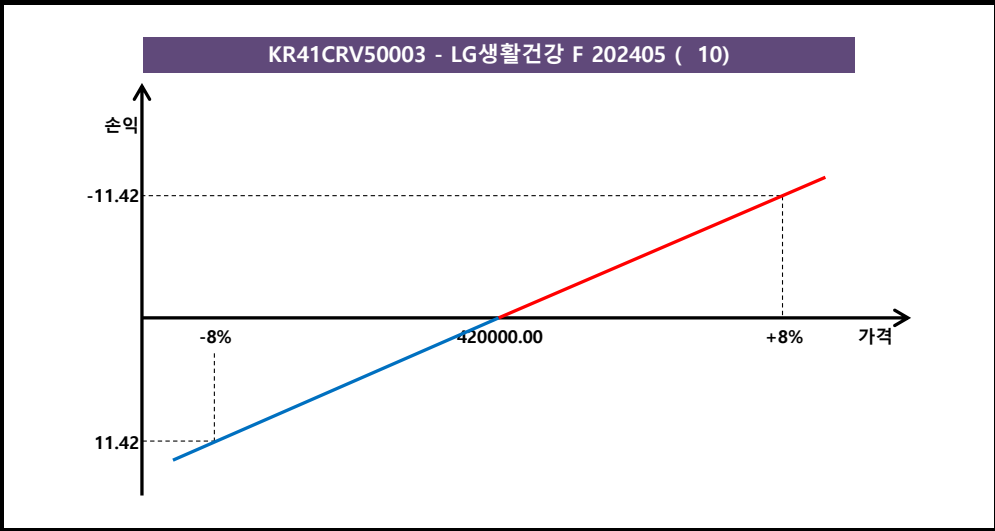
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	4,002	0	4,002	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	4,002	0	4,002	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

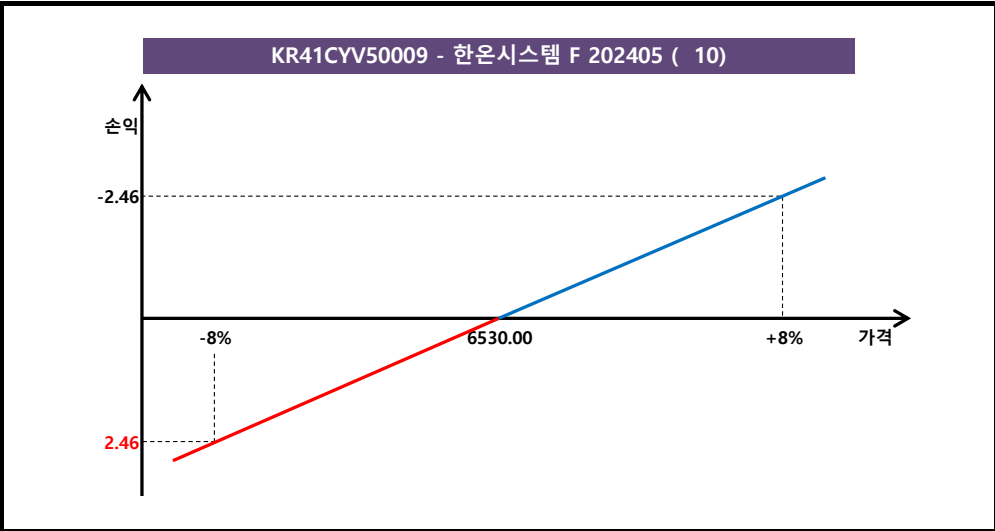
만기 코스피200 F 202406이 364.50 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



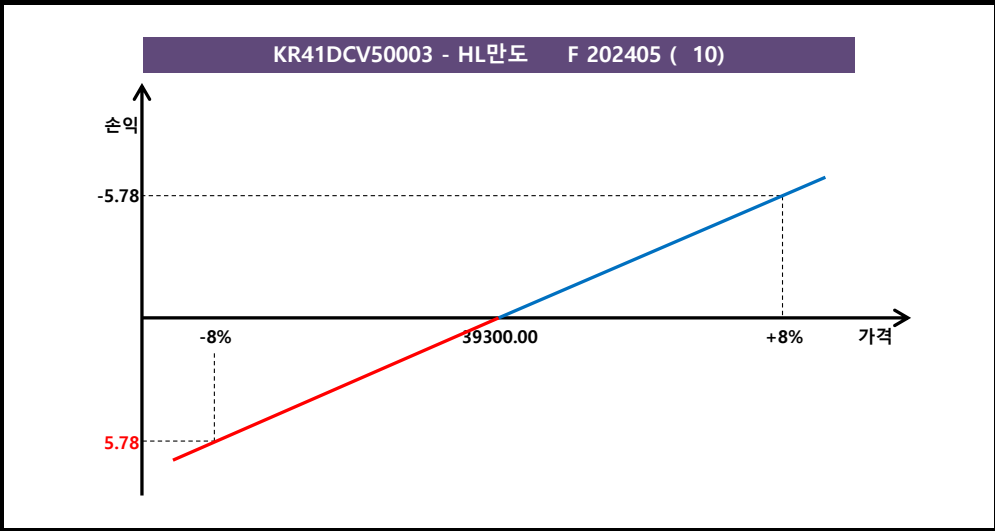
만기 LG생활건강 F 202405 ( 10)이 420000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



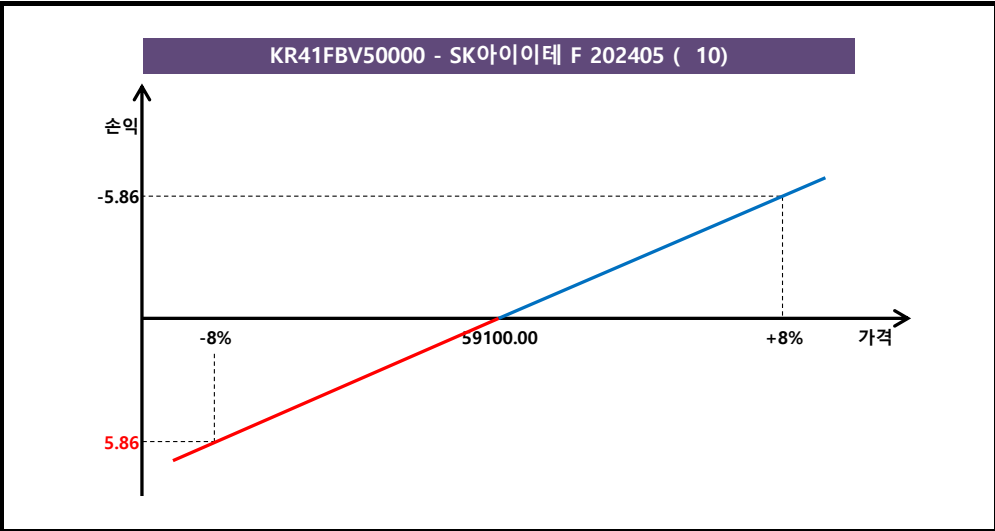
만기 한온시스템 F 202405 ( 10)이 6530.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



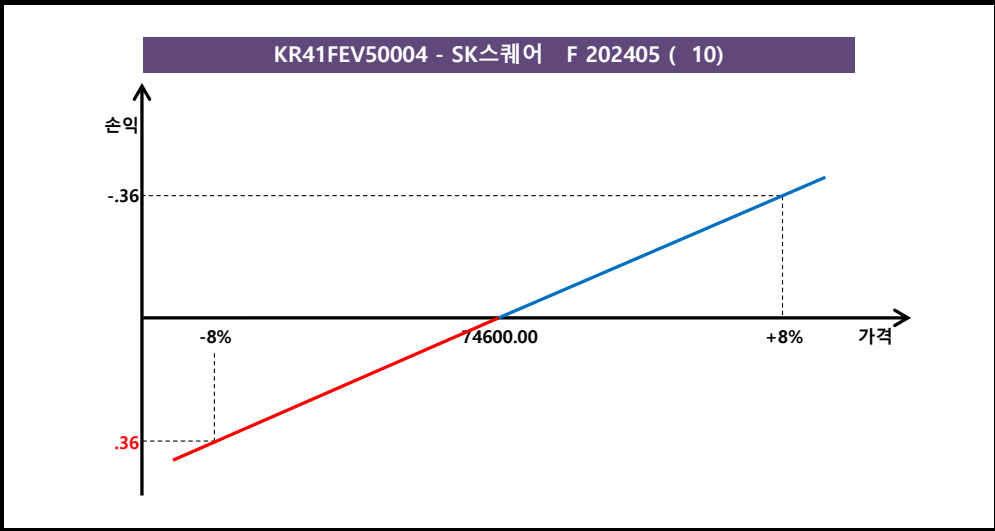
만기 HL만도 F 202405 ( 10)이 39300.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



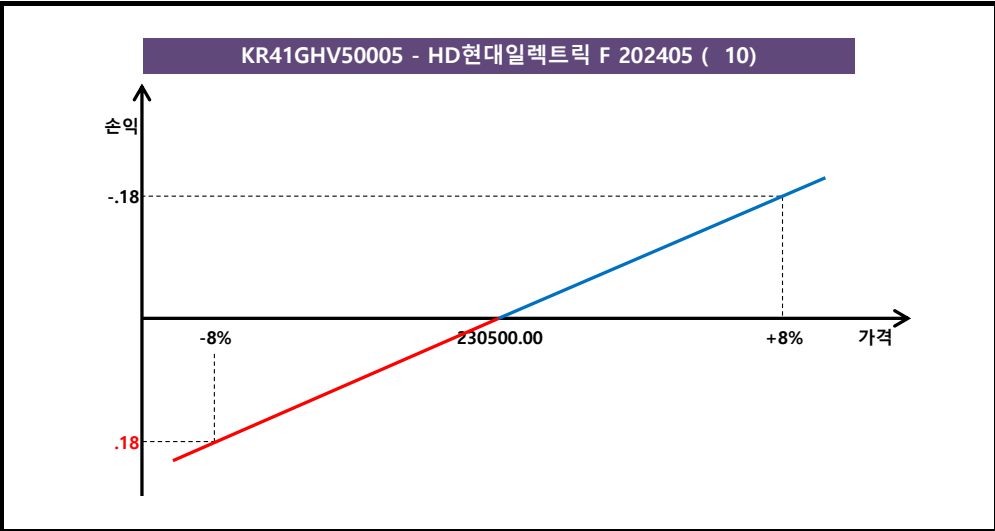
만기 SK아이이테 F 202405 ( 10)이 59100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



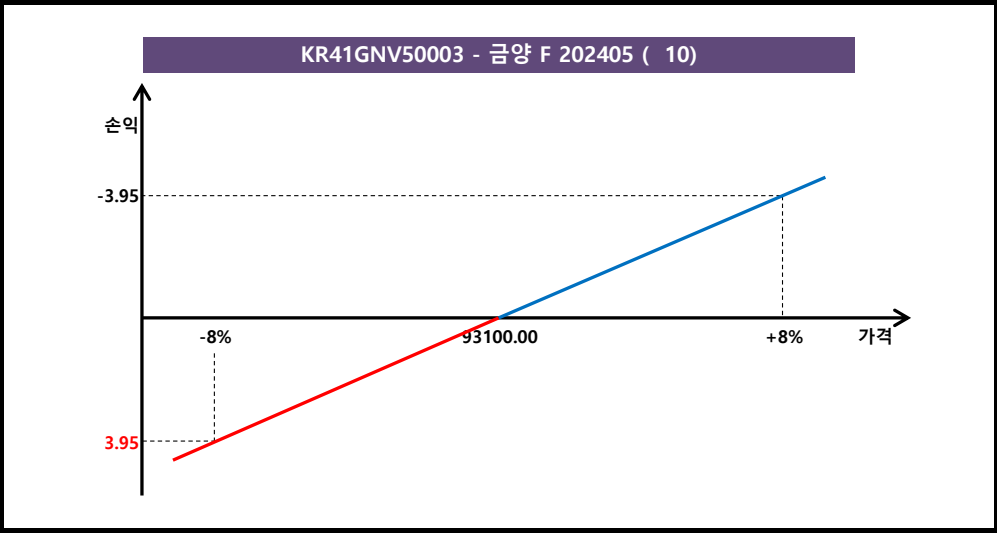
만기 SK스퀘어 F 202405 ( 10)이 74600.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



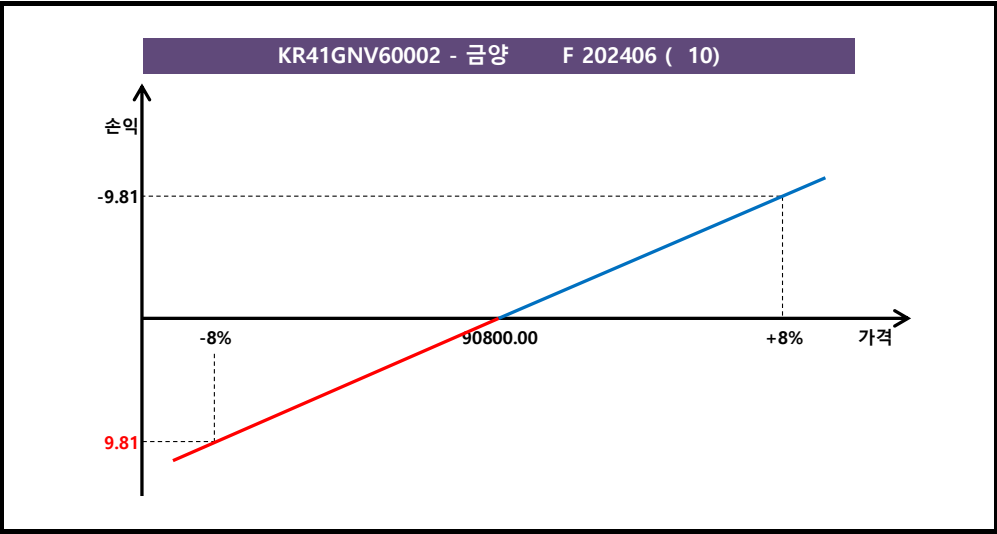
만기 HD현대일렉트릭 F 202405 ( 10)이 230500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



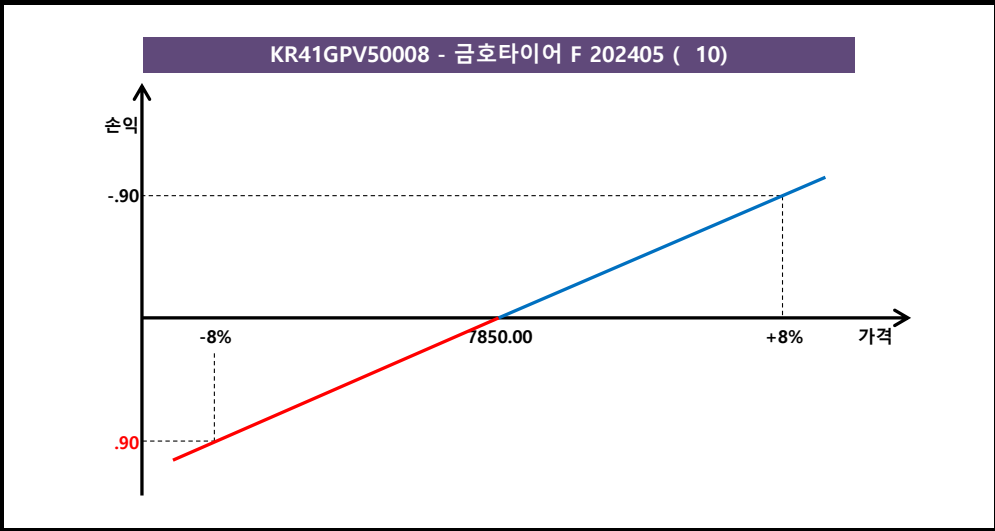
만기 금양 F 202405 ( 10)이 93100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



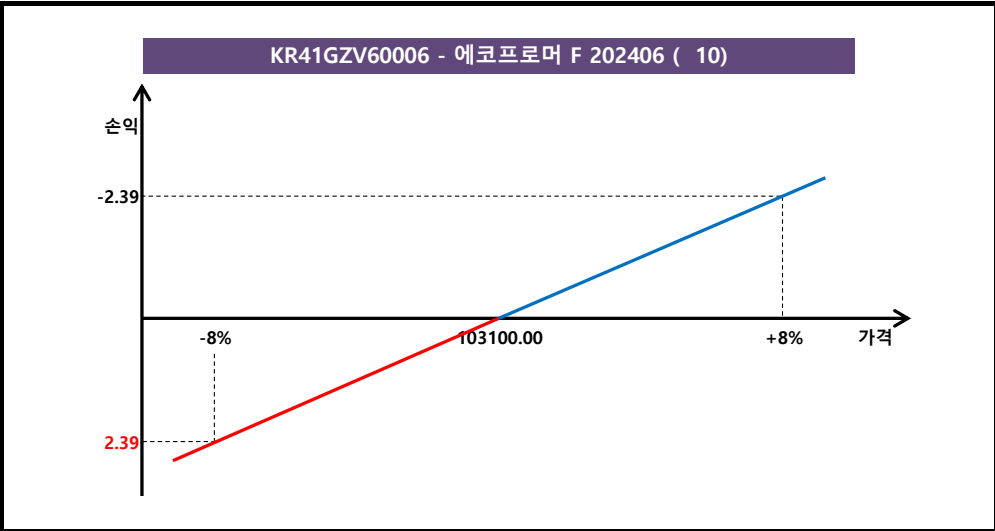
만기 금양 F 202406 ( 10)이 90800.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 금호타이어 F 202405 ( 10)이 7850.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 에코프로머 F 202406 ( 10)이 103100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	320.14
	5.33%	213.29
	2.67%	106.85
	0%	0.00
	-2.67%	-106.85
	-5.33%	-213.29
	-8.00%	-320.14
최대손실 시나리오 위험액		320.14

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	476.36
-----	--------