

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2024-05-08

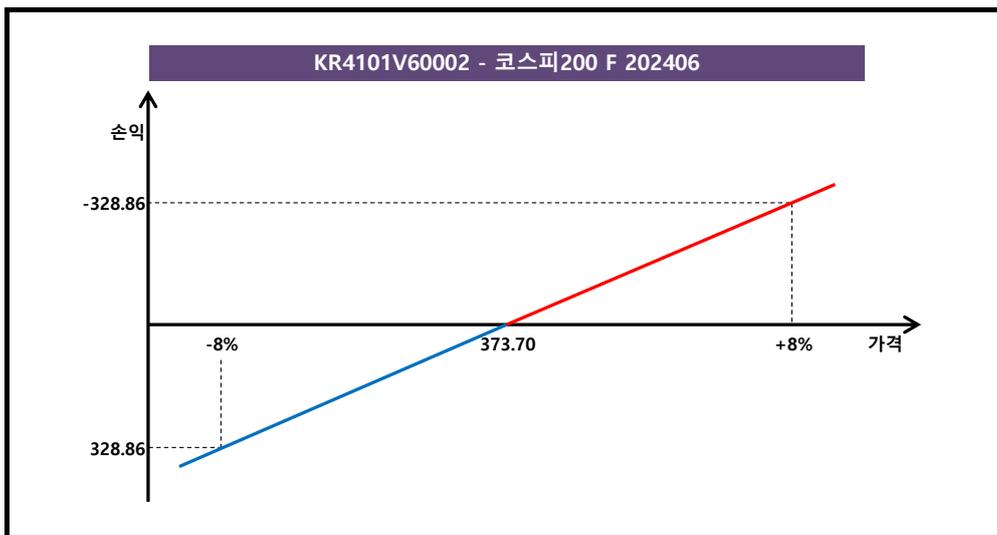
1. 계약금액

(단위:백만원)

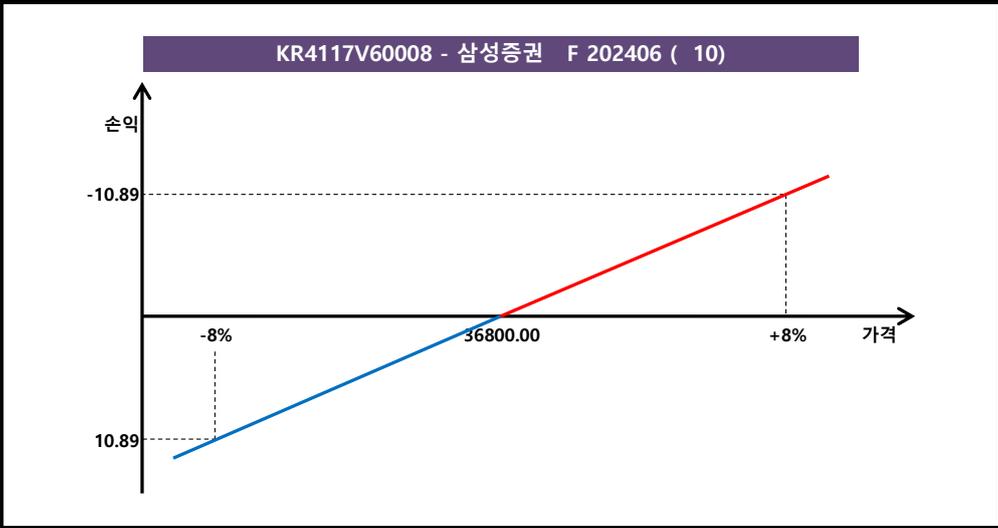
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|-------|-------|-------|-----------|----|
| 누적 | 유가증권 | 선물 | 5,727 | 0 | 5,727 | 장내 |
| 누적 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물+옵션 | 5,727 | 0 | 5,727 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

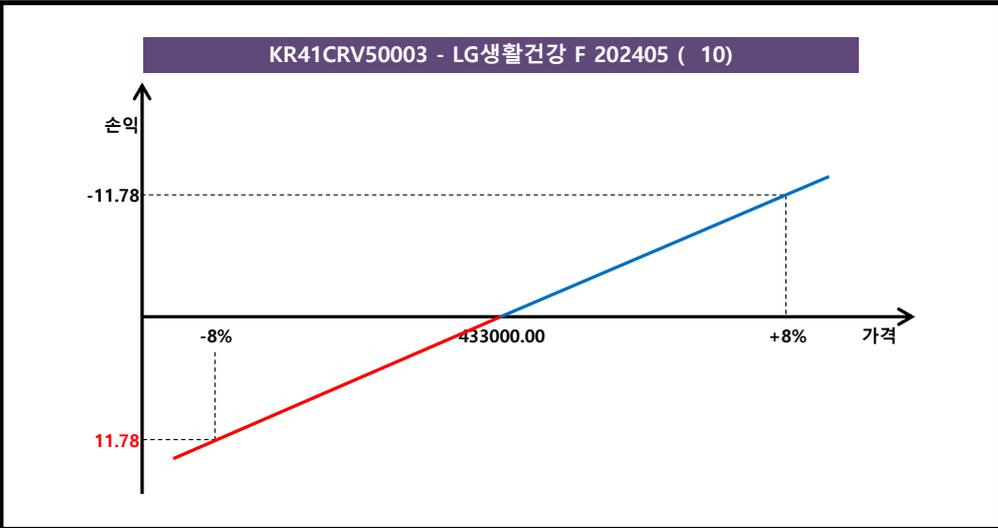
만기 코스피200 F 202406이 373.70 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



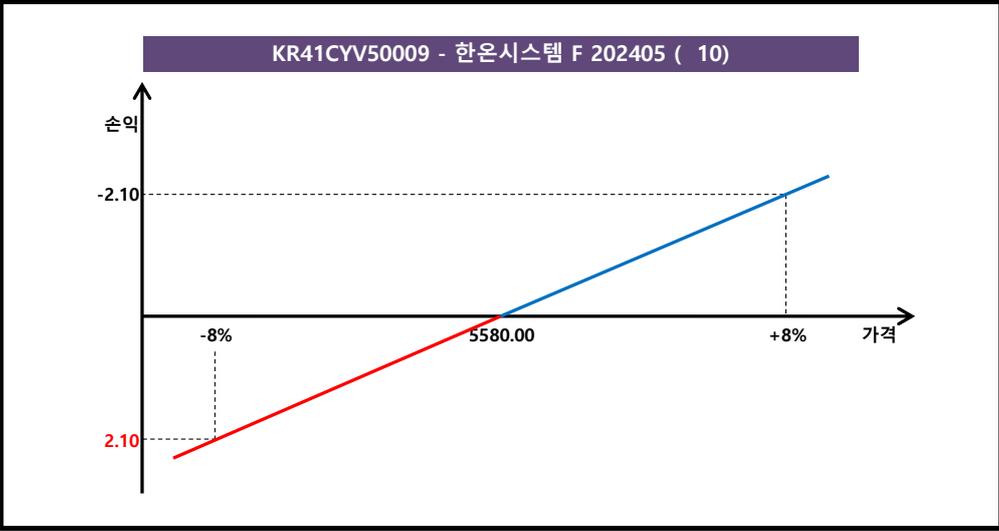
만기 삼성증권 F 202406 (10)이 36800.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



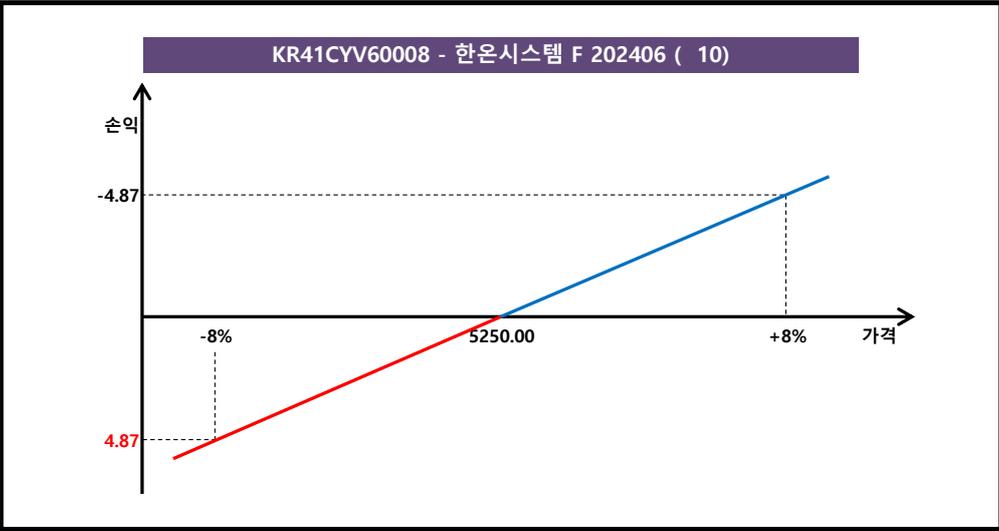
만기 LG생활건강 F 202405 (10)이 433000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



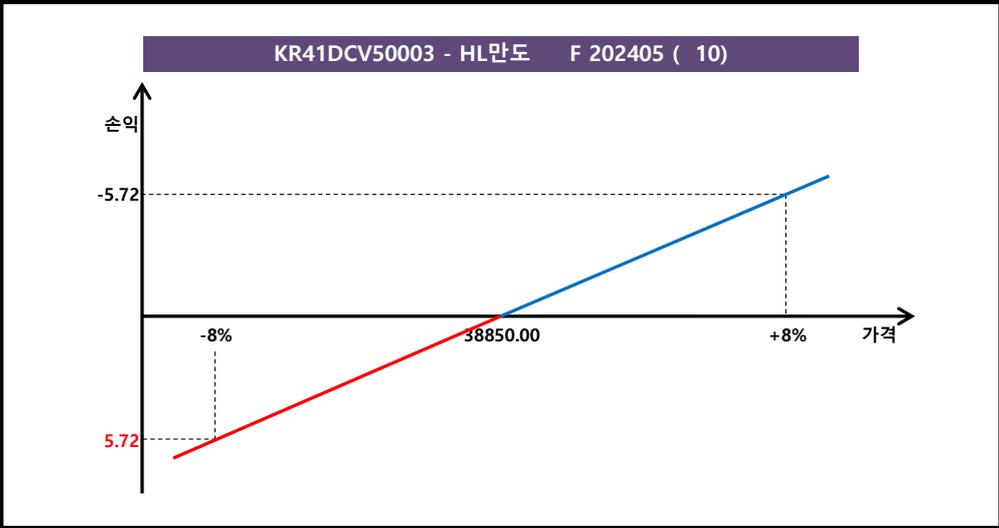
만기 한은시스템 F 202405 (10)이 5580.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



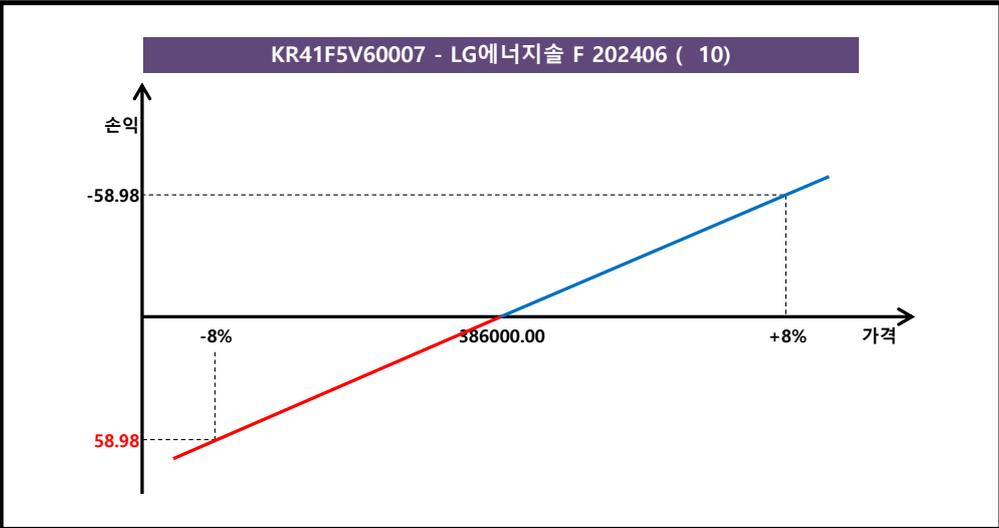
만기 한은시스템 F 202406 (10)이 5250.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



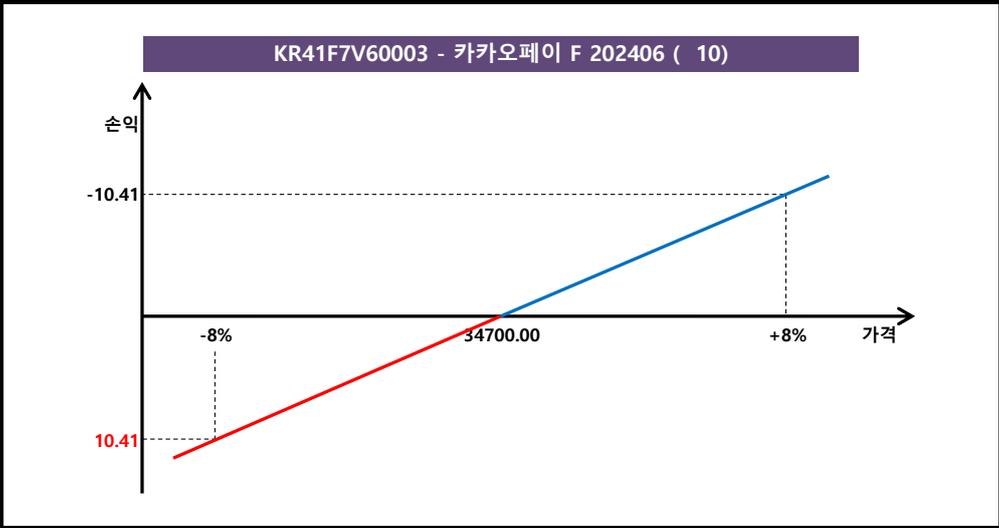
만기 HL만도 F 202405 (10)이 38850.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



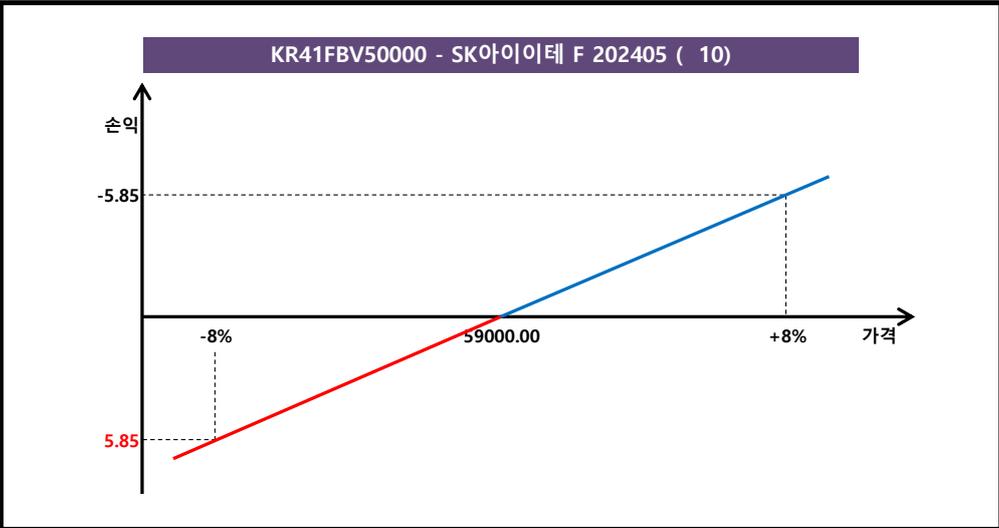
만기 LG에너지솔 F 202406 (10)이 386000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



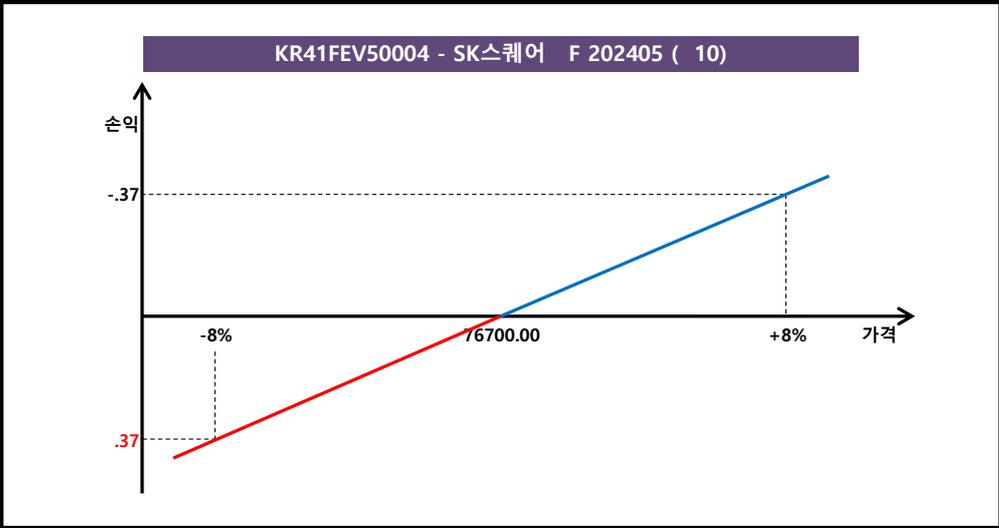
만기 카카오페이 F 202406 (10)이 34700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



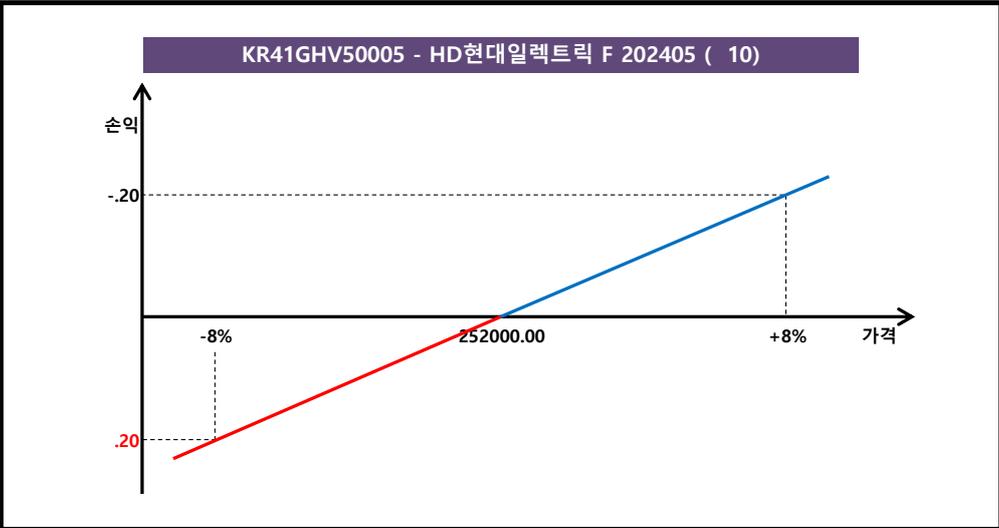
만기 SK아이이테크 F 202405 (10)이 59000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



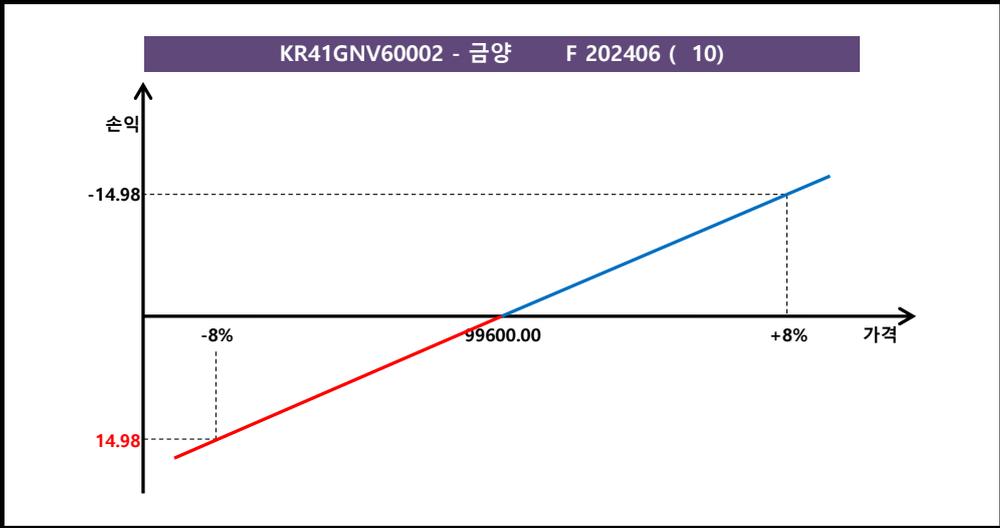
만기 SK스퀘어 F 202405 (10)이 76700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



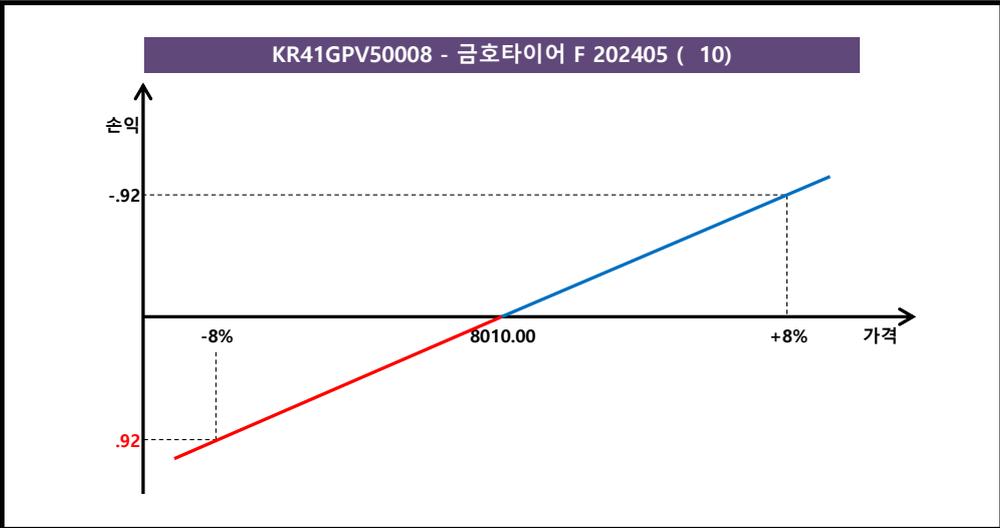
만기 HD현대일렉트릭 F 202405 (10)이 252000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



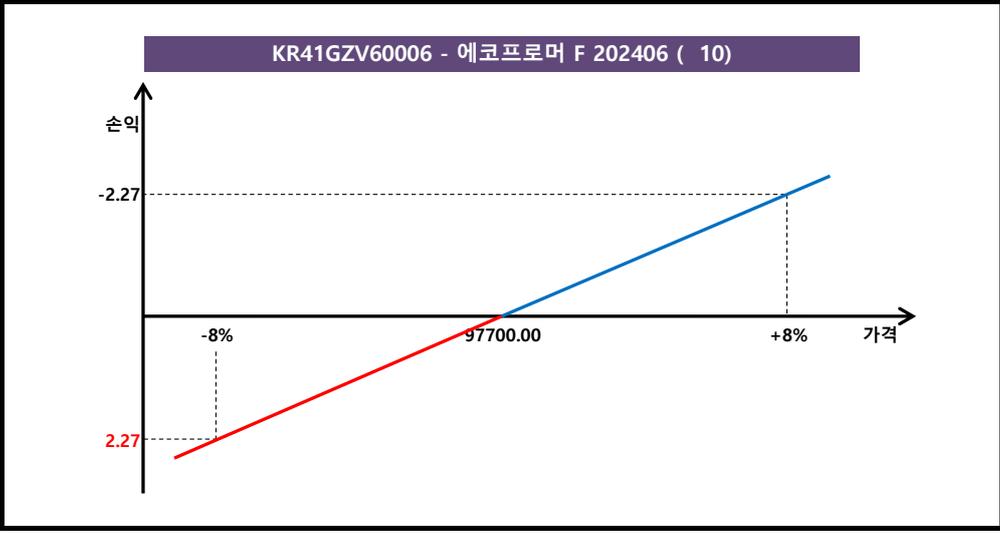
만기 금양 F 202406 (10)이 99600.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 금호타이어 F 202405 (10)이 8010.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 에코프로머 F 202406 (10)이 97700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

| | 구분 | 시나리오 |
|---------------|--------|---------|
| 기초자산 시나리오 | 8.00% | 458.19 |
| | 5.33% | 305.27 |
| | 2.67% | 152.92 |
| | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -152.92 |
| | -5.33% | -305.27 |
| | -8.00% | -458.19 |
| 최대손실 시나리오 위험액 | | 458.19 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR) (단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 726.37 |
|-----|--------|