

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2024-05-09

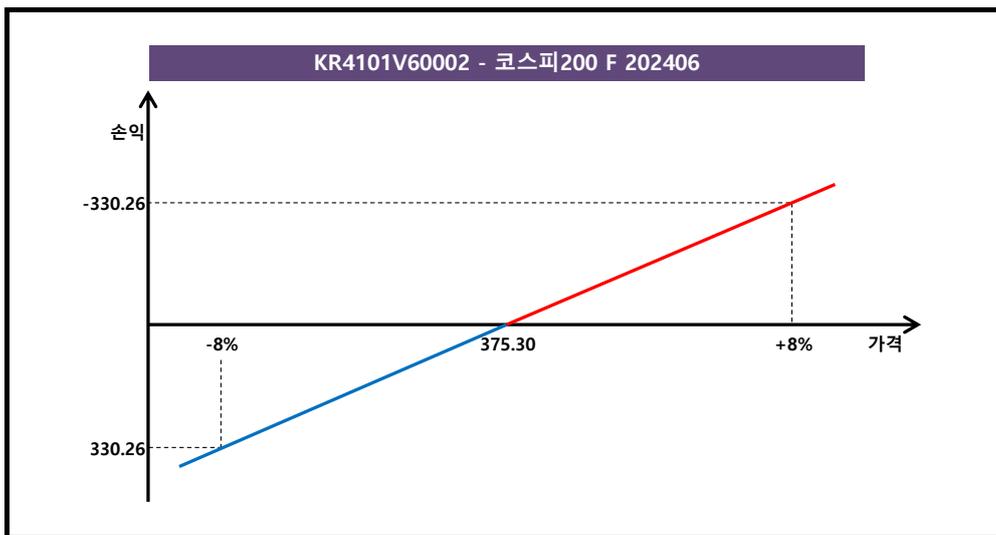
1. 계약금액

(단위:백만원)

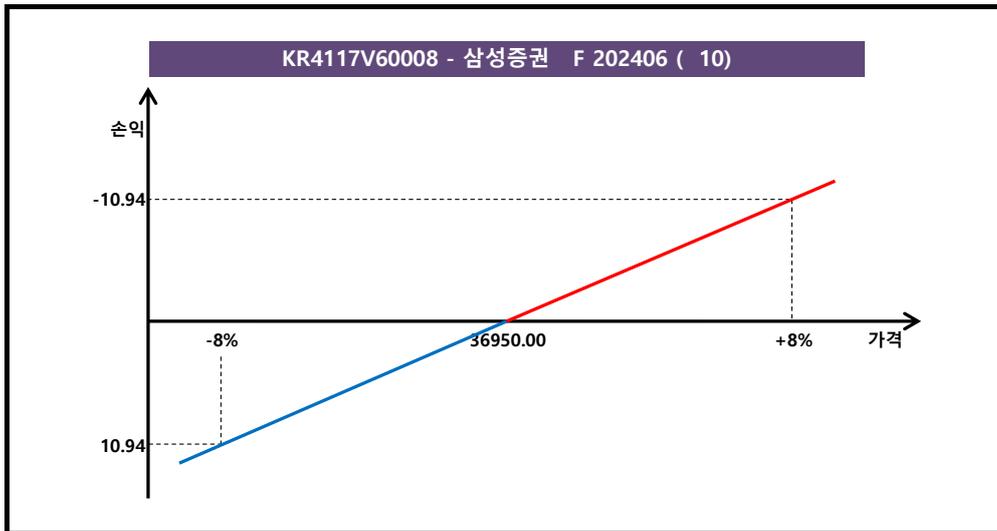
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	5,866	0	5,866	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	5,866	0	5,866	장내

2. 만기시점의 손익구조

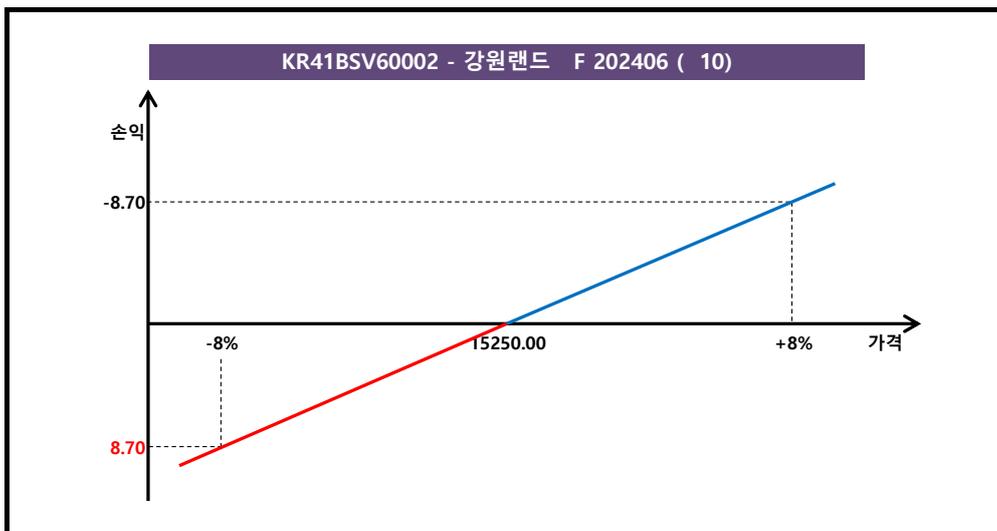
만기 코스피200 F 202406이 375.30 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



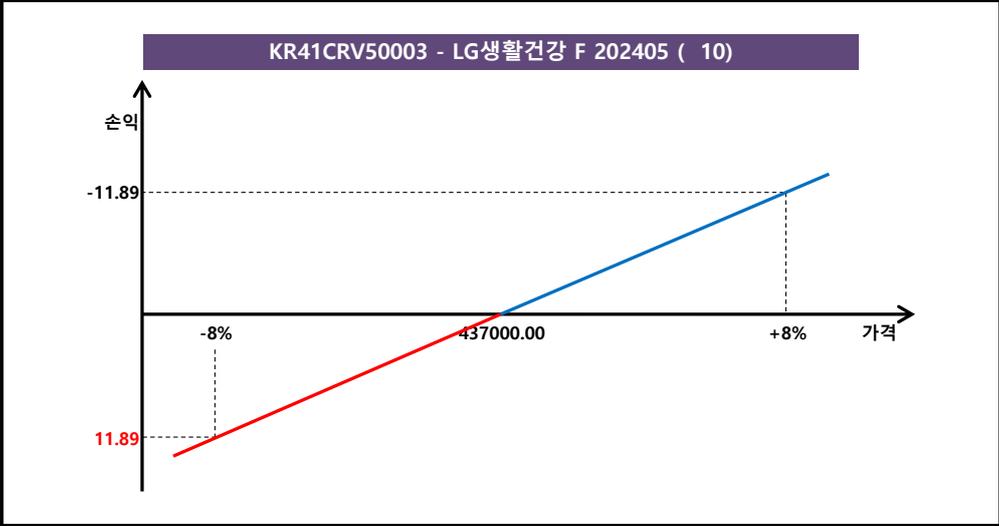
만기 삼성증권 F 202406 (10)이 36950.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



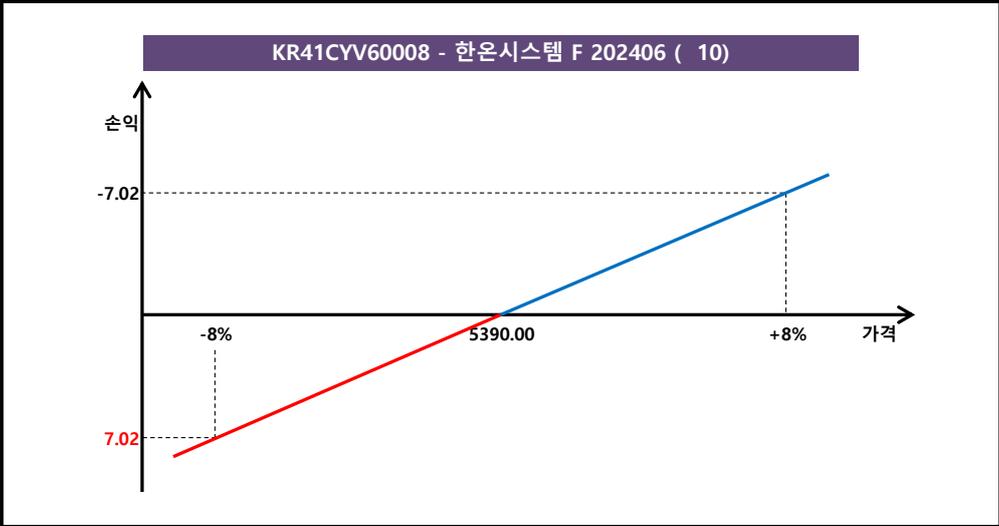
만기 강원랜드 F 202406 (10)이 15250.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



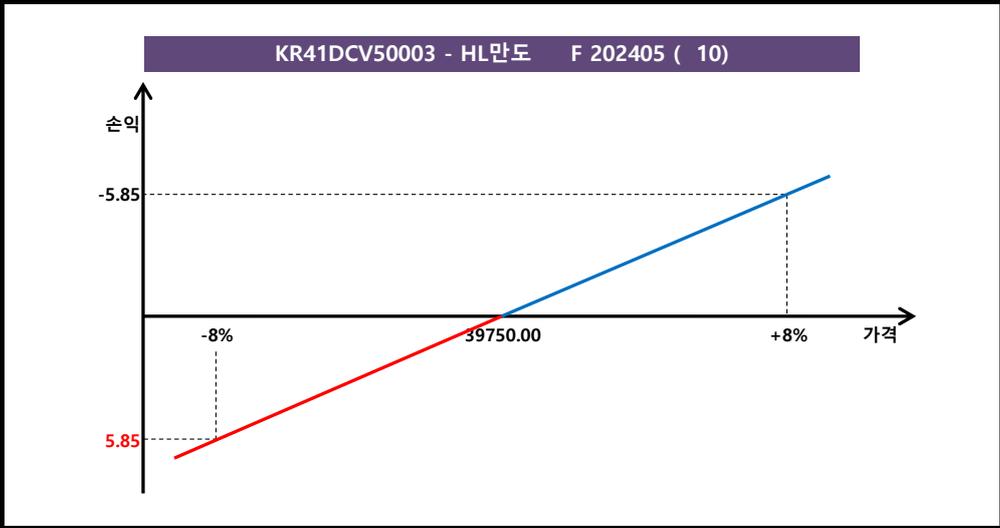
만기 LG생활건강 F 202405 (10)이 437000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



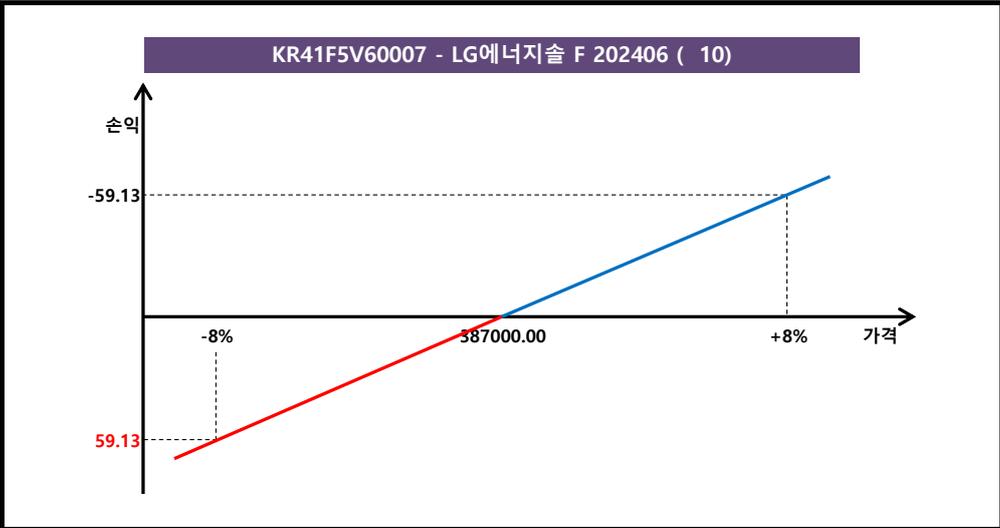
만기 한온시스템 F 202406 (10)이 5390.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



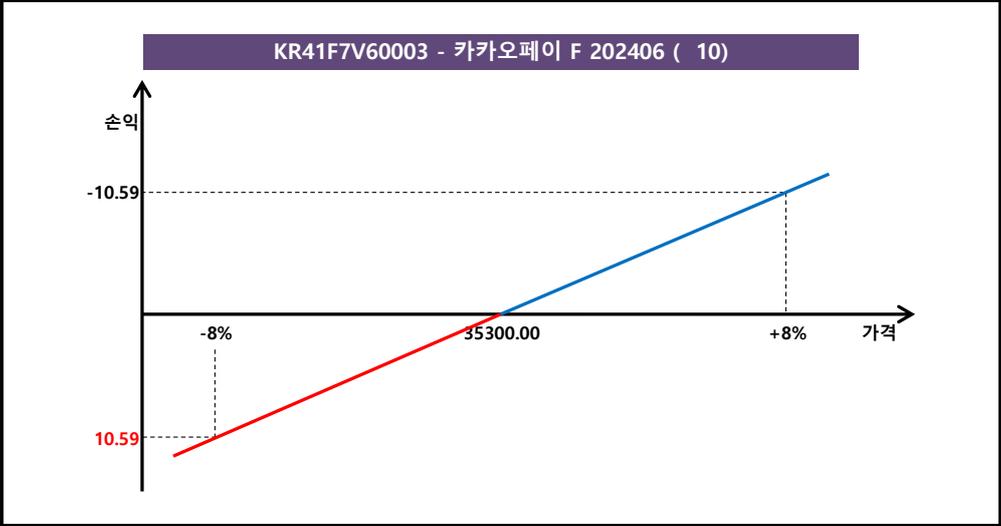
만기 HL만도 F 202405 (10)이 39750.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



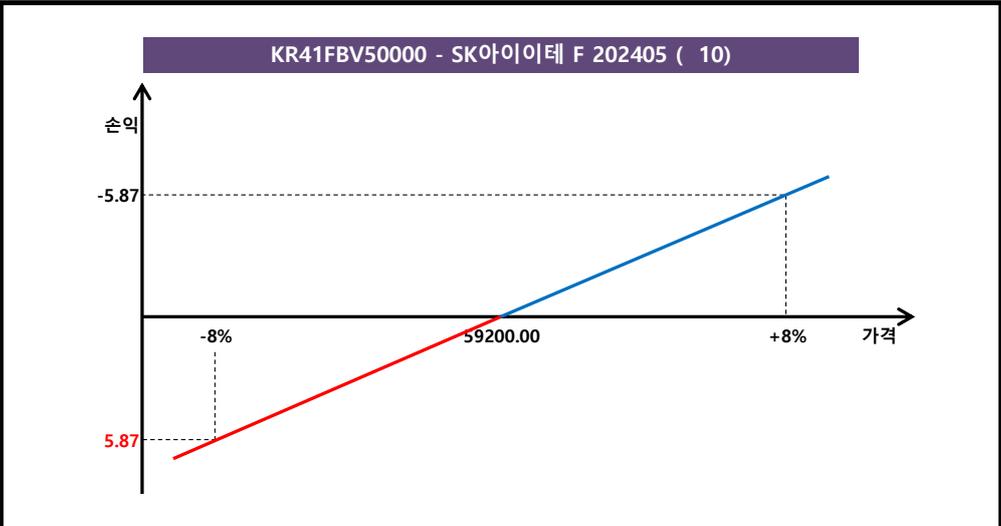
만기 LG에너지솔 F 202406 (10)이 387000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



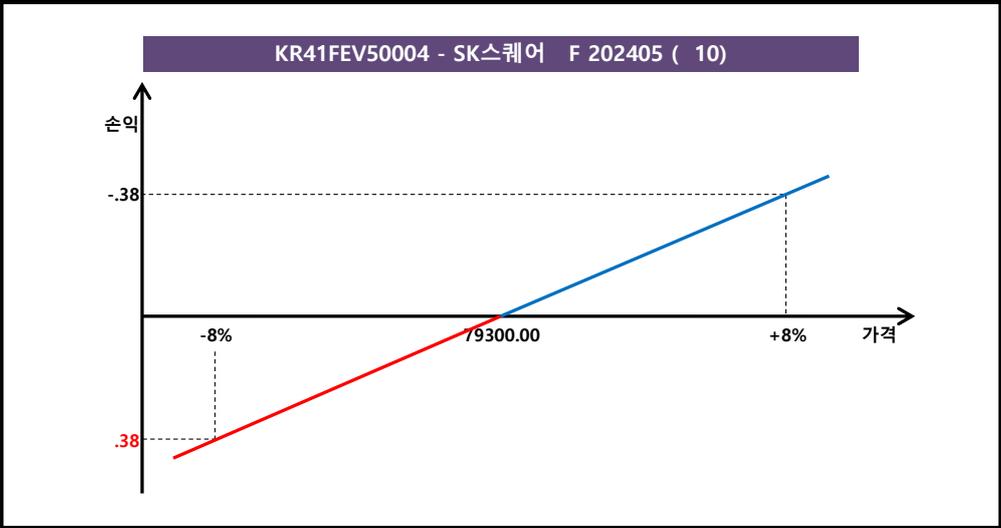
만기 카카오페이 F 202406 (10)이 35300.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



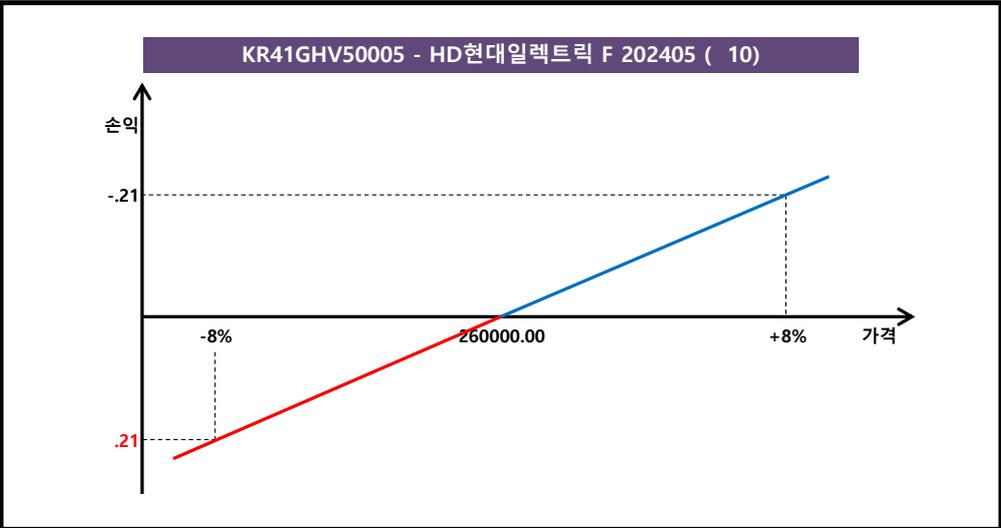
만기 SK아이이테크 F 202405 (10)이 59200.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



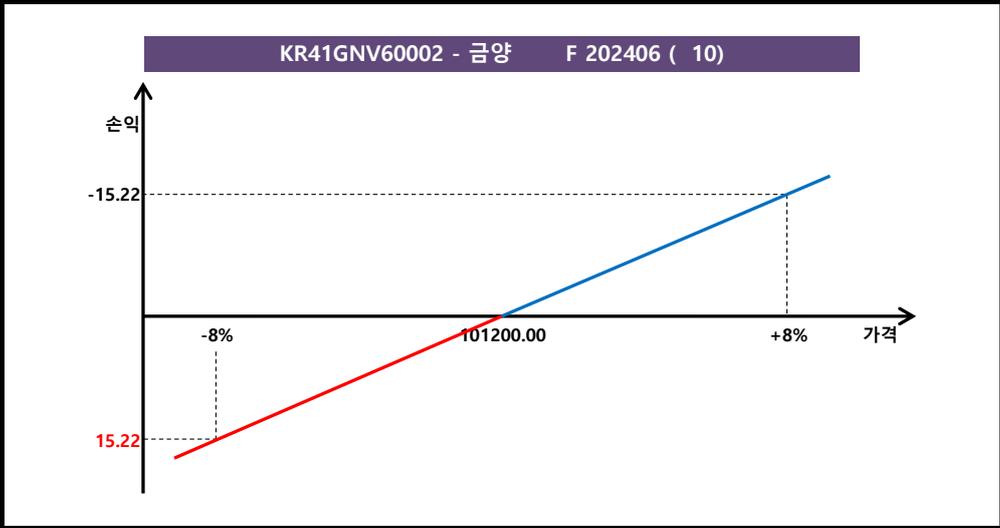
만기 SK스퀘어 F 202405 (10)이 79300.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



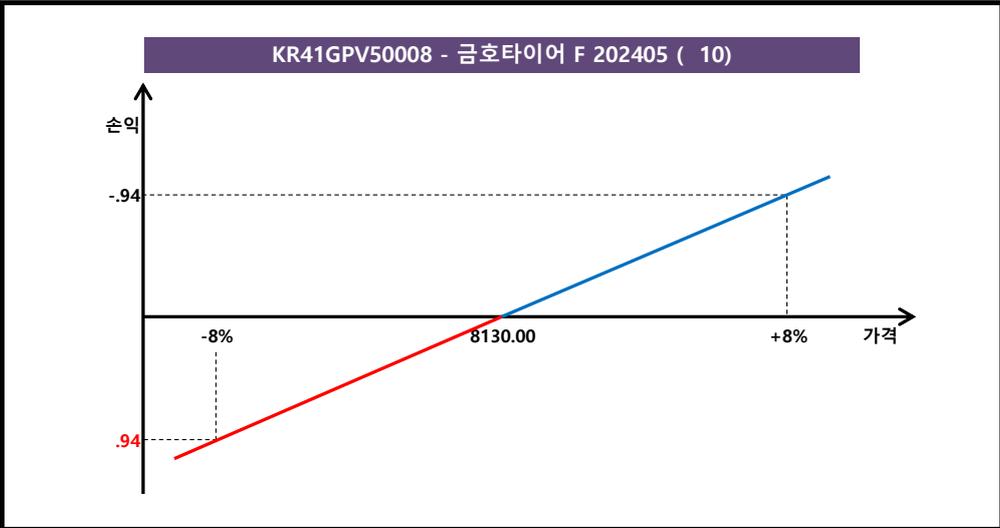
만기 HD현대일렉트릭 F 202405 (10)이 260000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



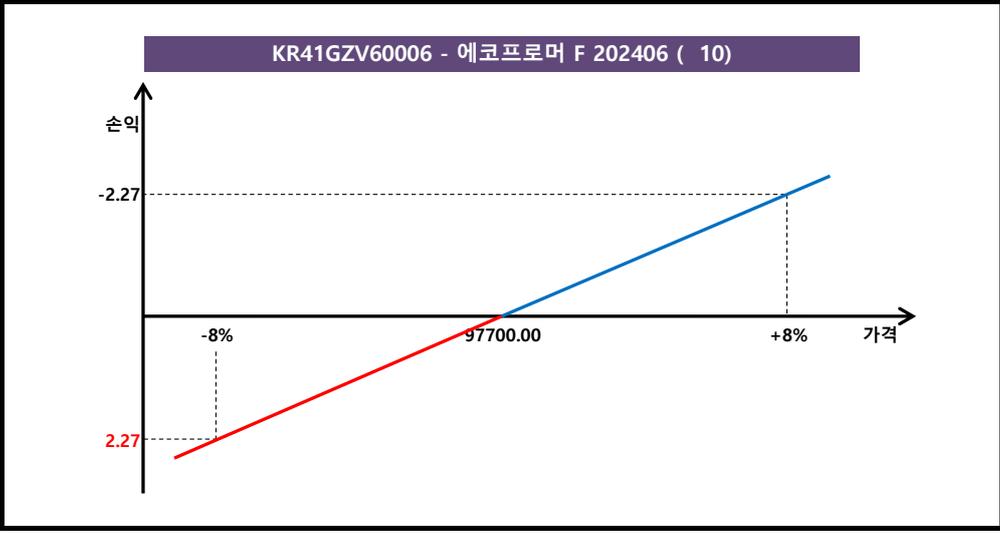
만기 금양 F 202406 (10)이 101200.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 금호타이어 F 202405 (10)이 8130.00 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%	469.27
	5.33%	312.65
	2.67%	156.62
	0%	0.00
	-2.67%	-156.62
	-5.33%	-312.65
	-8.00%	-469.27
최대손실 시나리오 위험액		469.27

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR) (단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	739.70
-----	--------