

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2024-05-13

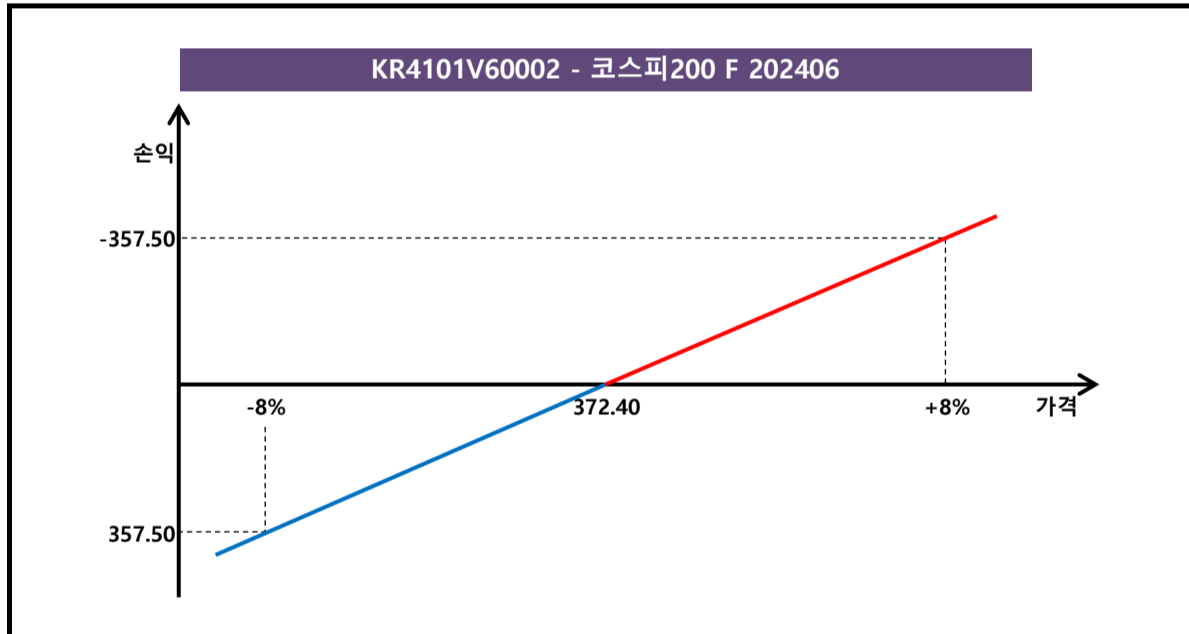
1. 계약금액

(단위:백만원)

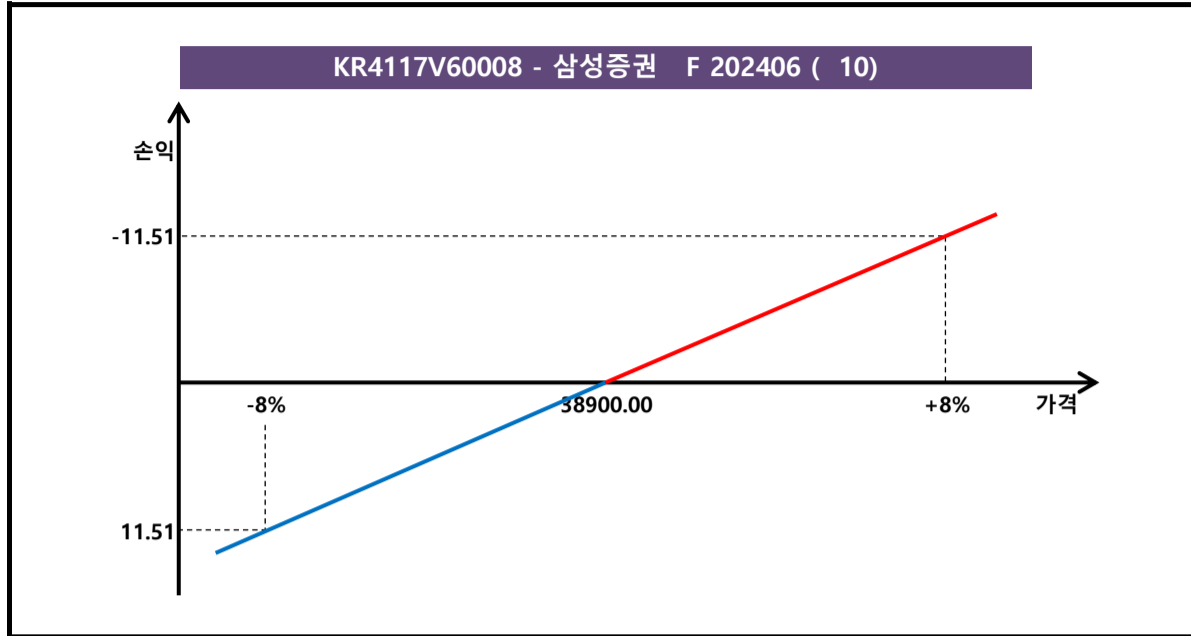
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	6,236	0	6,236	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	6,236	0	6,236	장내

2. 만기시점의 손익구조

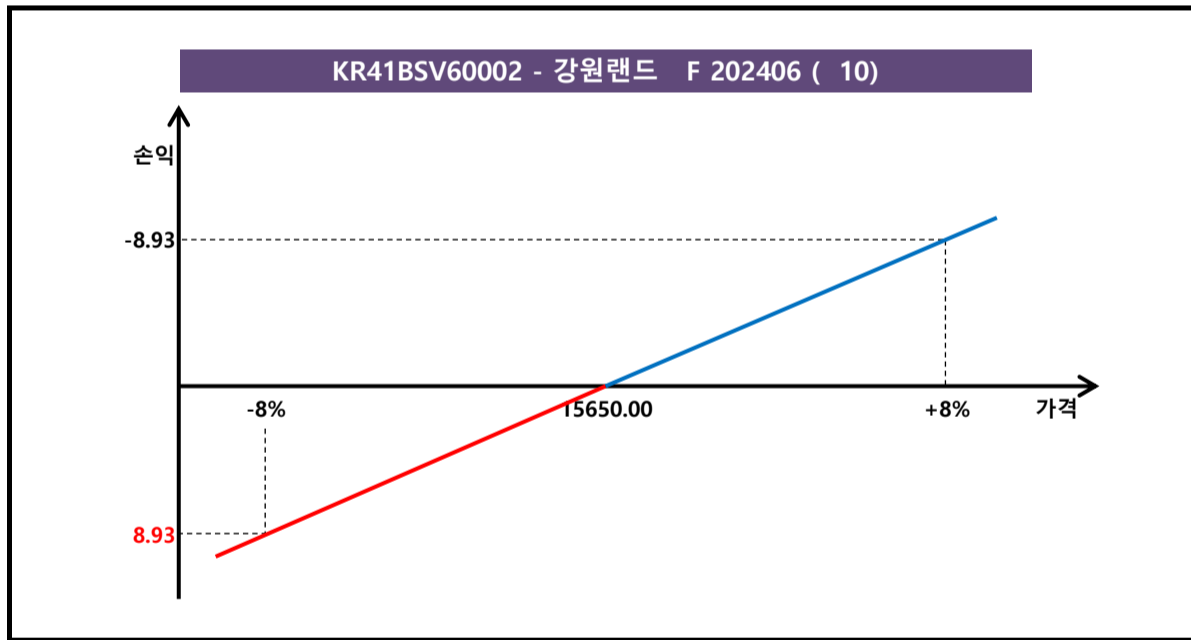
만기 코스피200 F 202406이 372.40 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



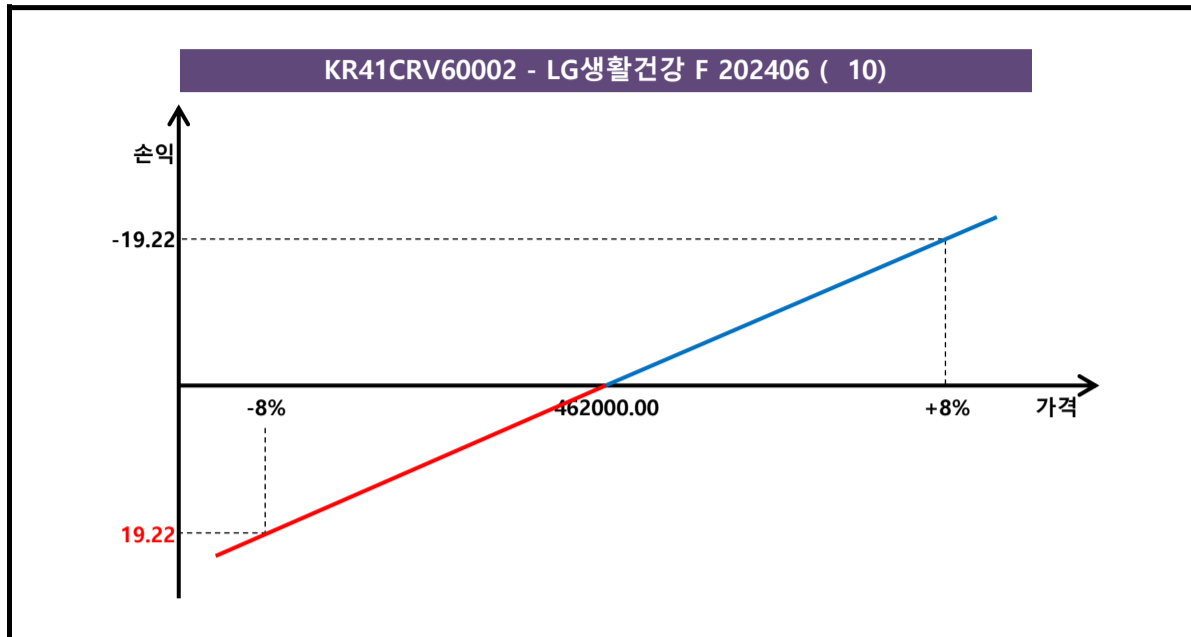
만기 삼성증권 F 202406 (10)이 38900.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



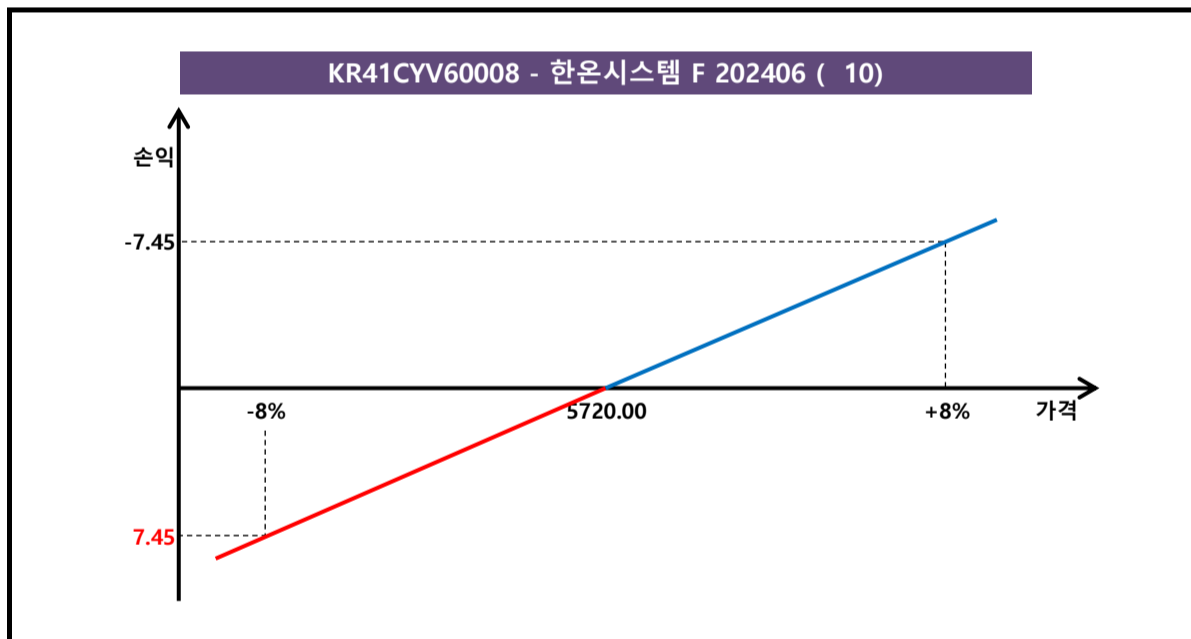
만기 강원랜드 F 202406 (10)이 15650.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



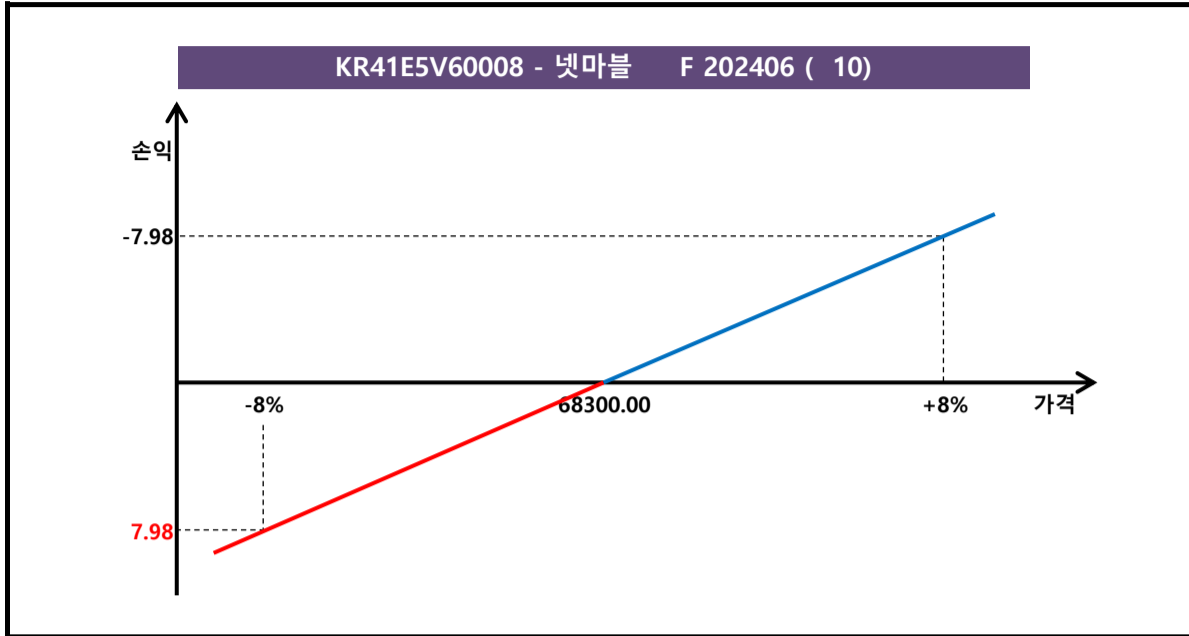
만기 LG생활건강 F 202406 (10)이 462000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



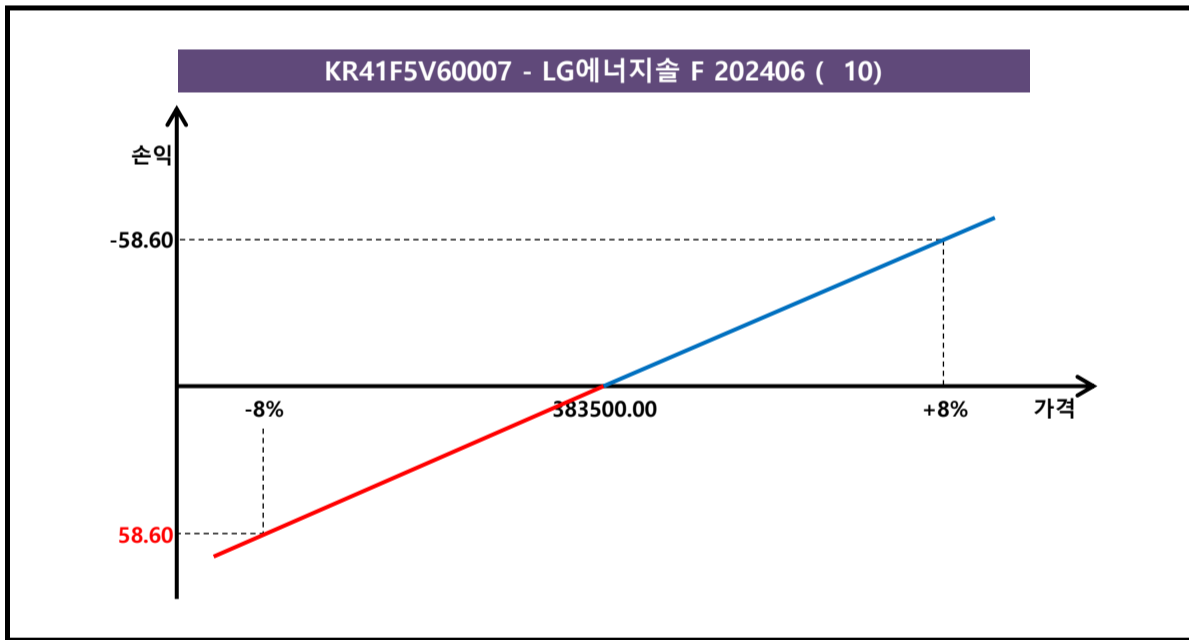
만기 한온시스템 F 202406 (10)이 5720.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



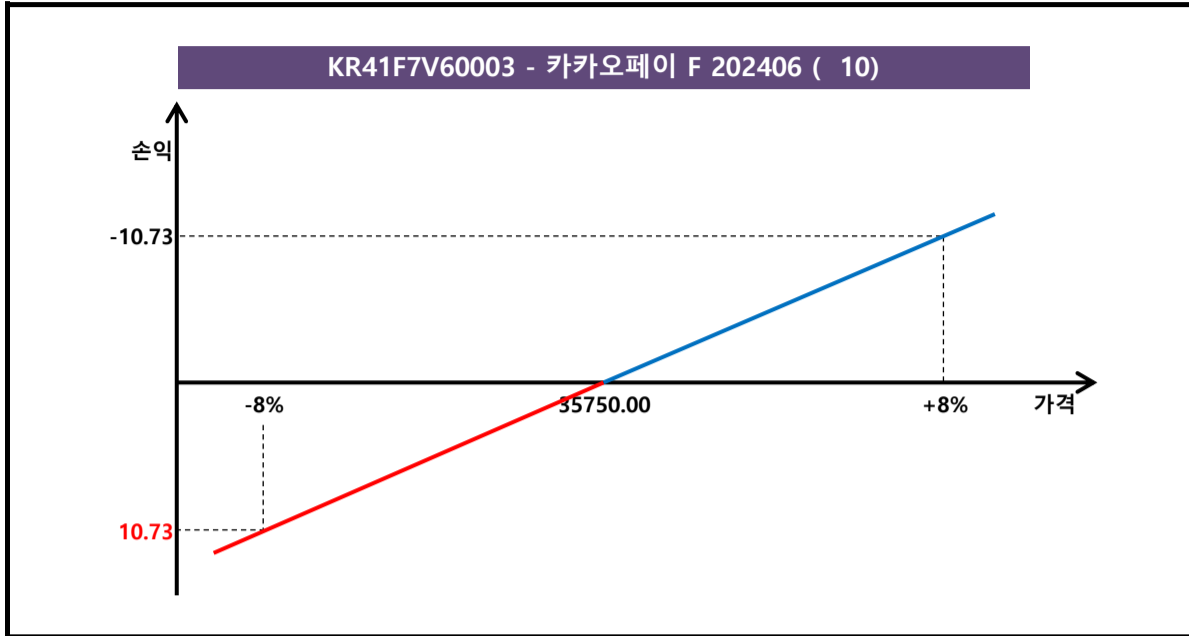
만기 넷마블 F 202406 (10)이 68300.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



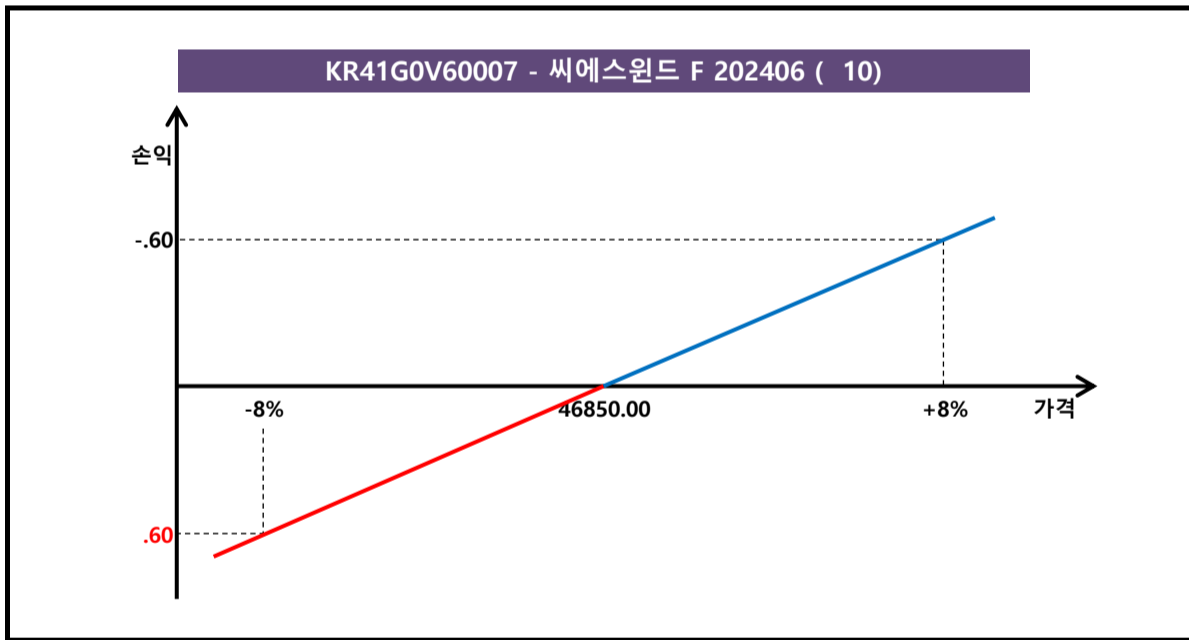
만기 LG에너지솔 F 202406 (10)이 383500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



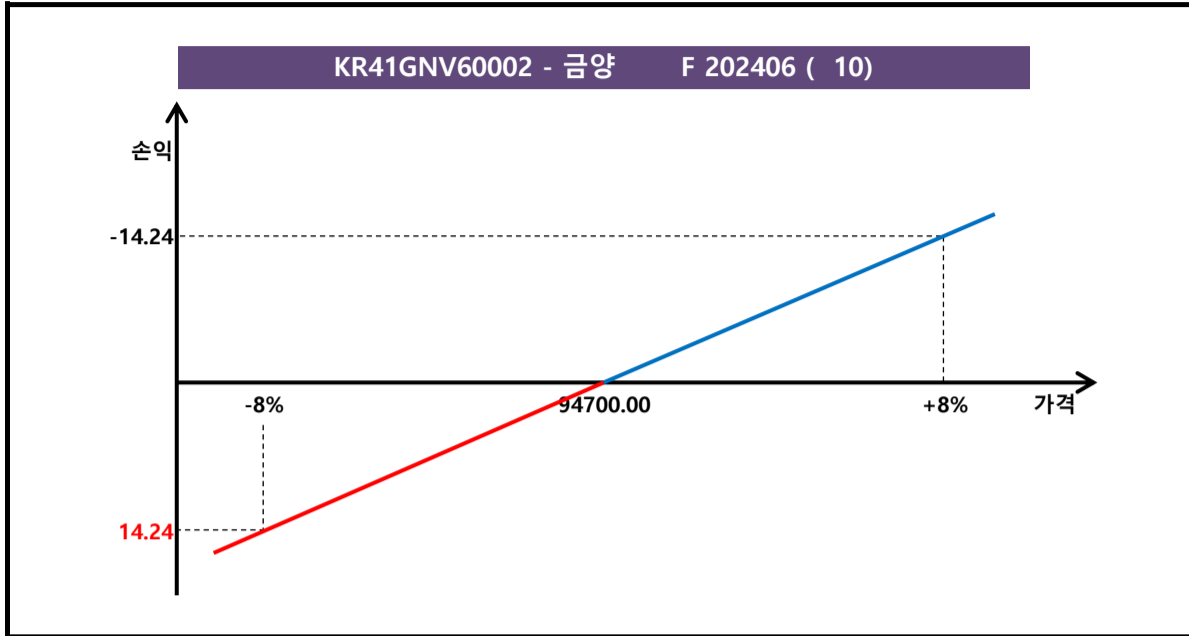
만기 카카오페이 F 202406 (10)이 35750.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



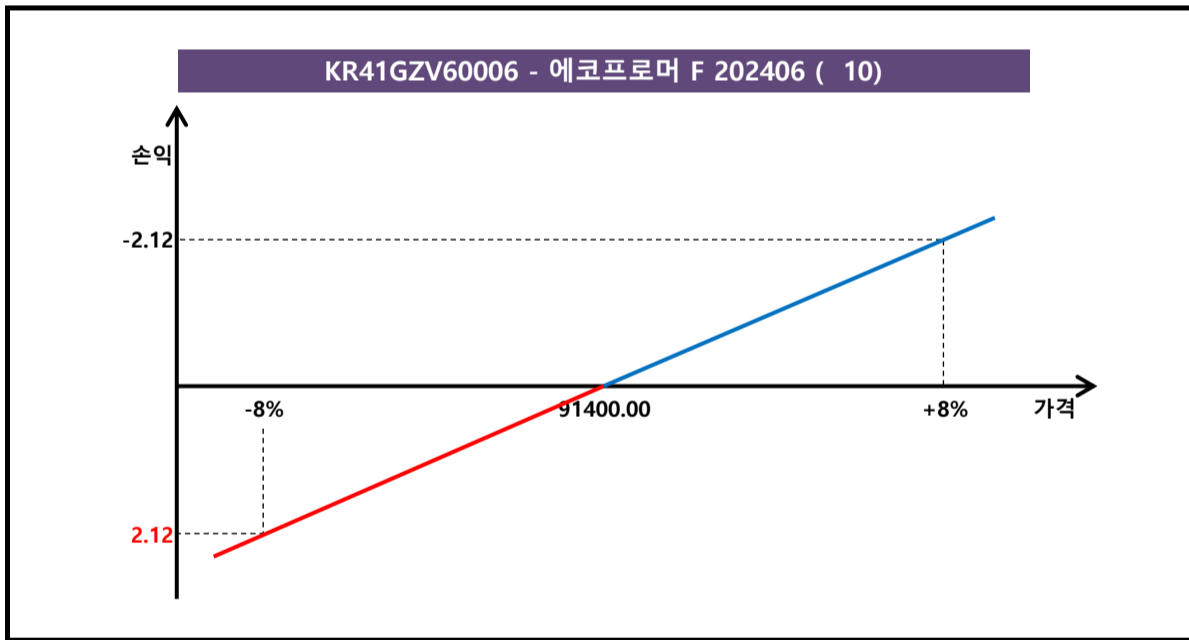
만기 씨에스윈드 F 202406 (10)이 46850.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 금양 F 202406 (10)이 94700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 에코프로머 F 202406 (10)이 91400.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	498.88
	5.33%	332.38
	2.67%	166.50
	0%	0.00
	-2.67%	-166.50
	-5.33%	-332.38
	-8.00%	-498.88
최대손실 시나리오 위험액		498.88

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	789.14
-----	--------