

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2024-06-11

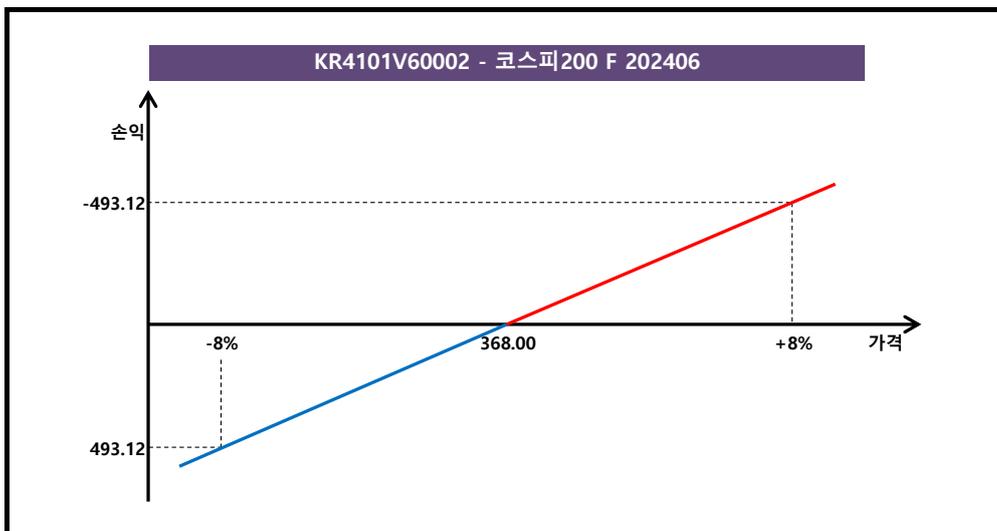
1. 계약금액

(단위:백만원)

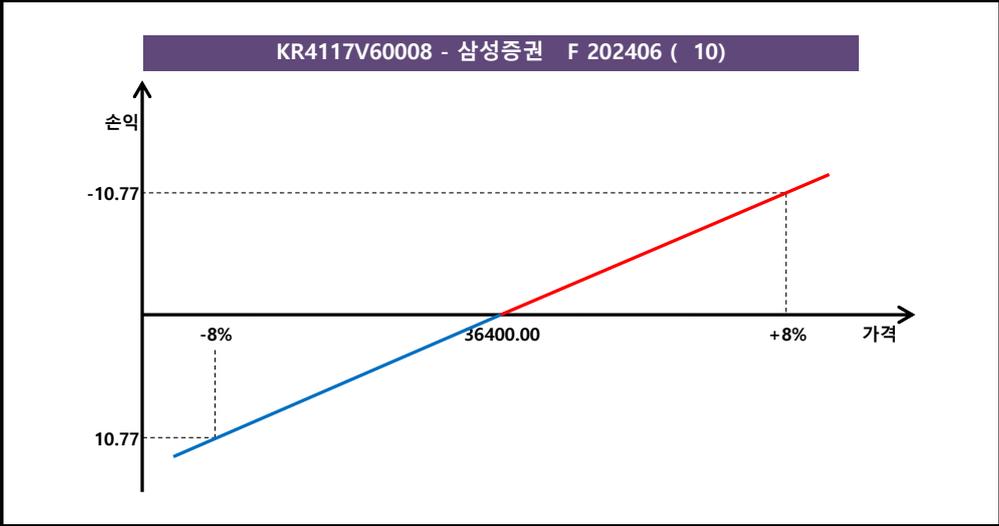
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	9,036	0	9,036	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	9,036	0	9,036	장내

2. 만기시점의 손익구조

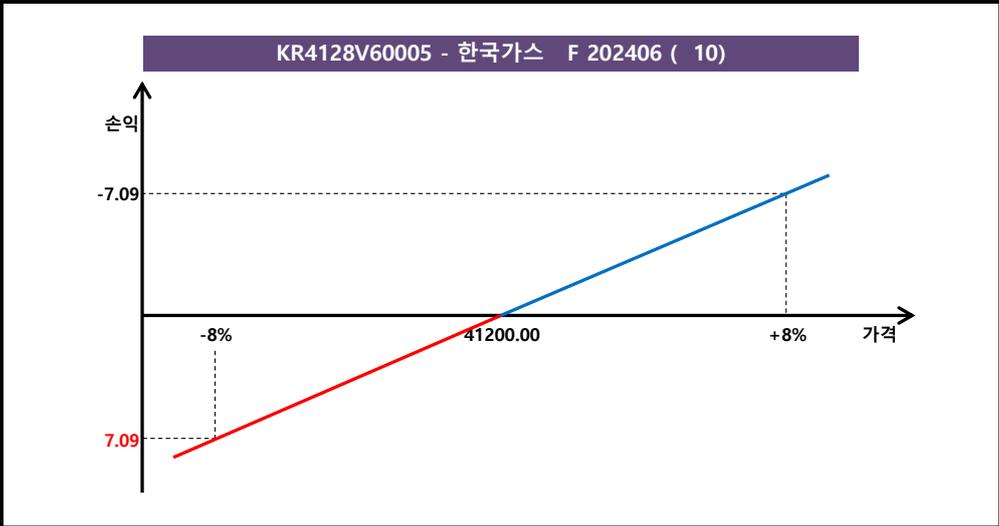
만기 코스피200 F 202406이 368.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



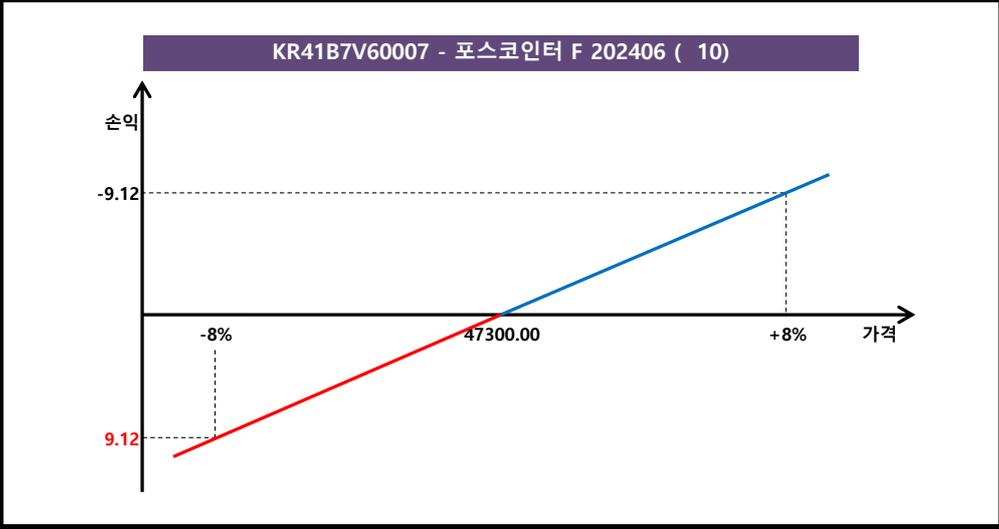
만기 삼성증권 F 202406 (10)이 36400.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



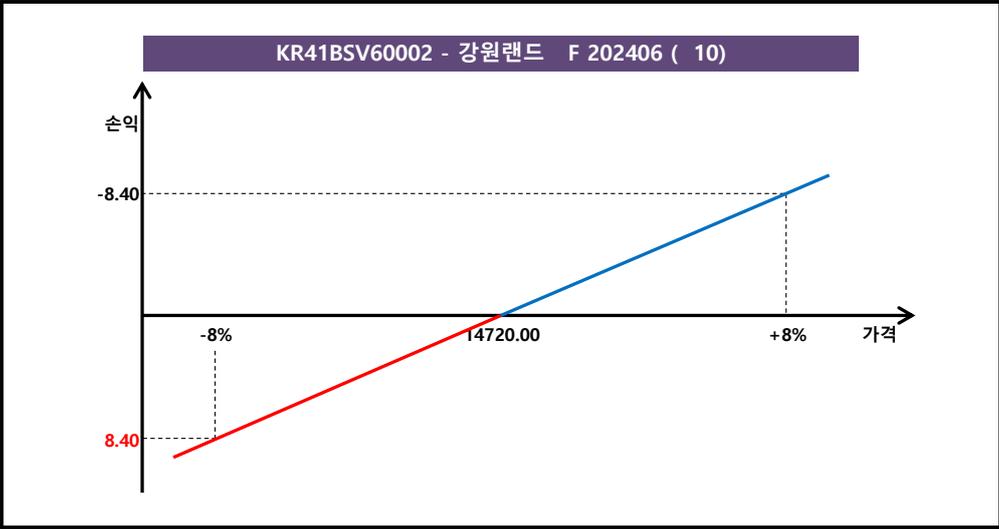
만기 한국가스 F 202406 (10)이 41200.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



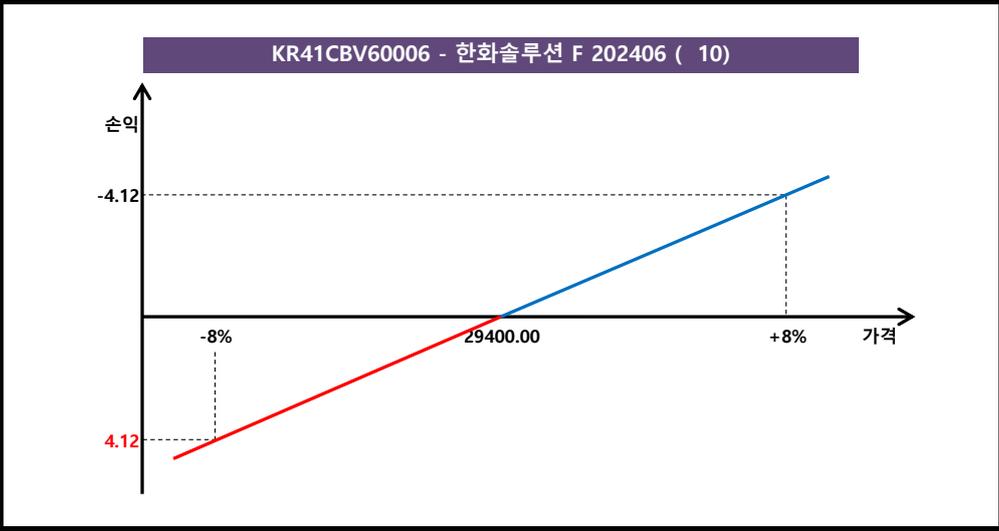
만기 포스코인터 F 202406 (10)이 47300.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



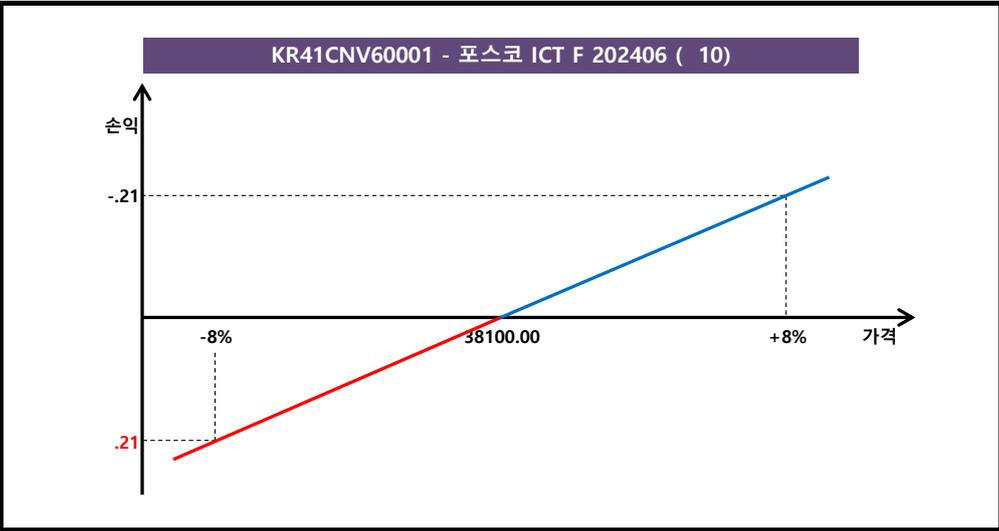
만기 강원랜드 F 202406 (10)이 14720.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



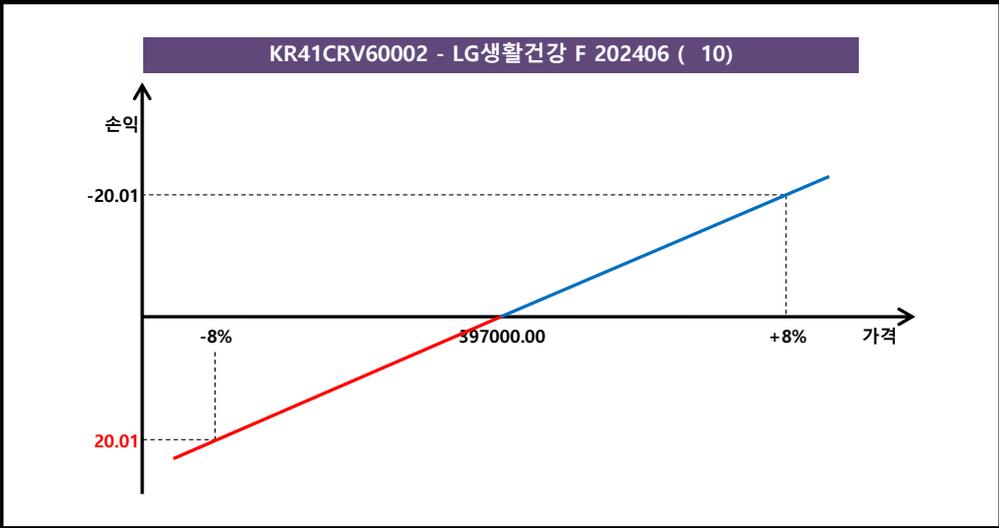
만기 한화솔루션 F 202406 (10)이 29400.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



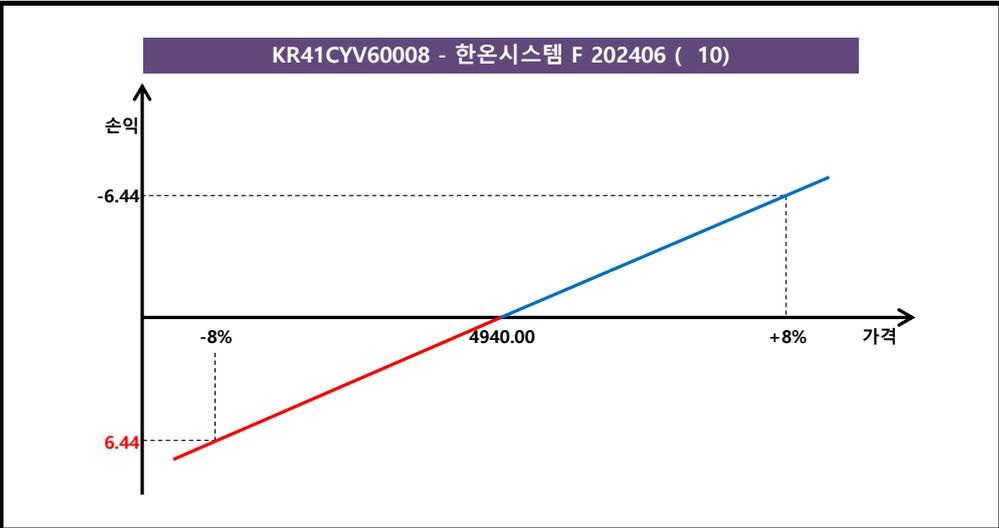
만기 포스코 ICT F 202406 (10)이 38100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



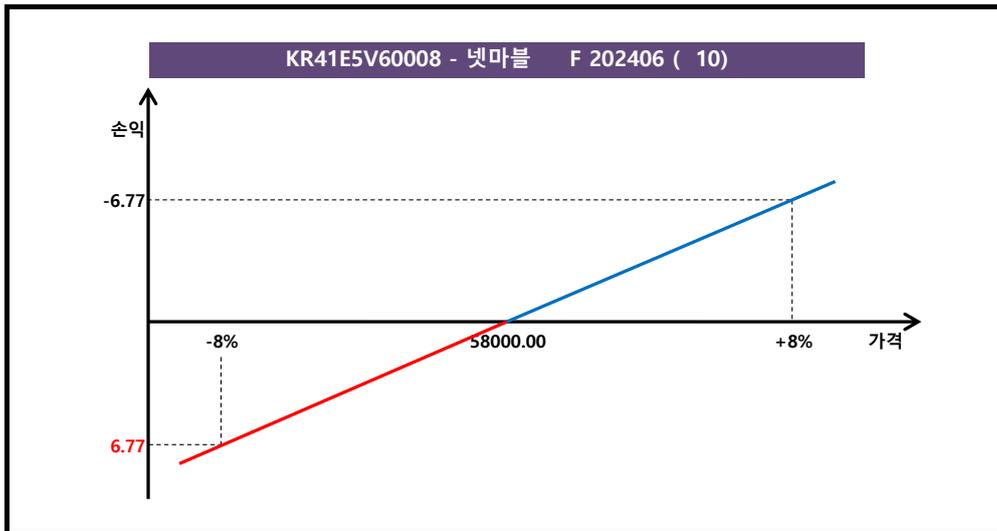
만기 LG생활건강 F 202406 (10)이 397000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



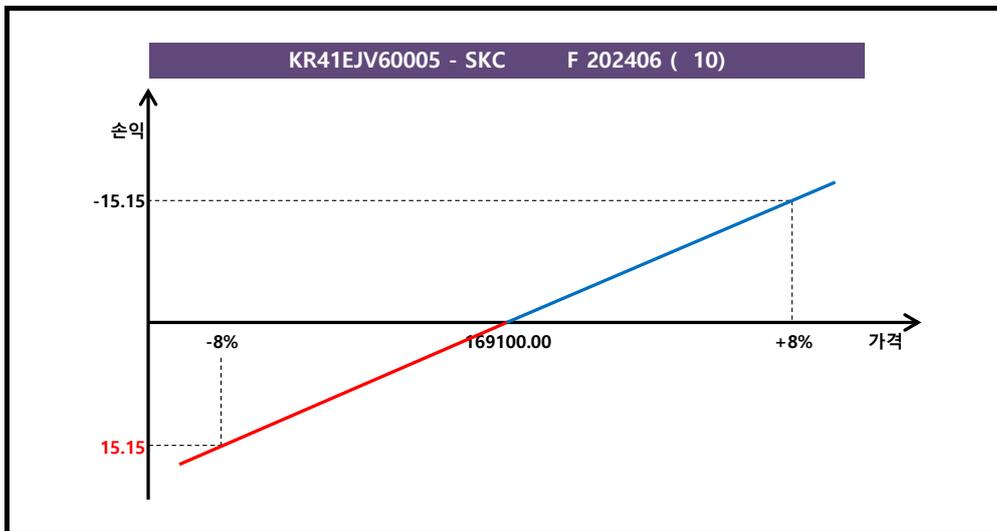
만기 한온시스템 F 202406 (10)이 4940.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



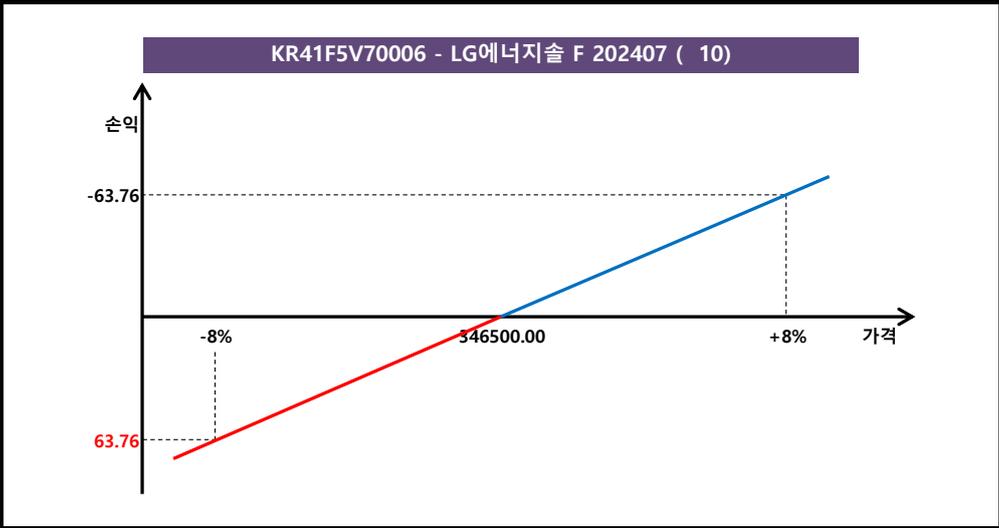
만기 넷마블 F 202406 (10)이 58000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



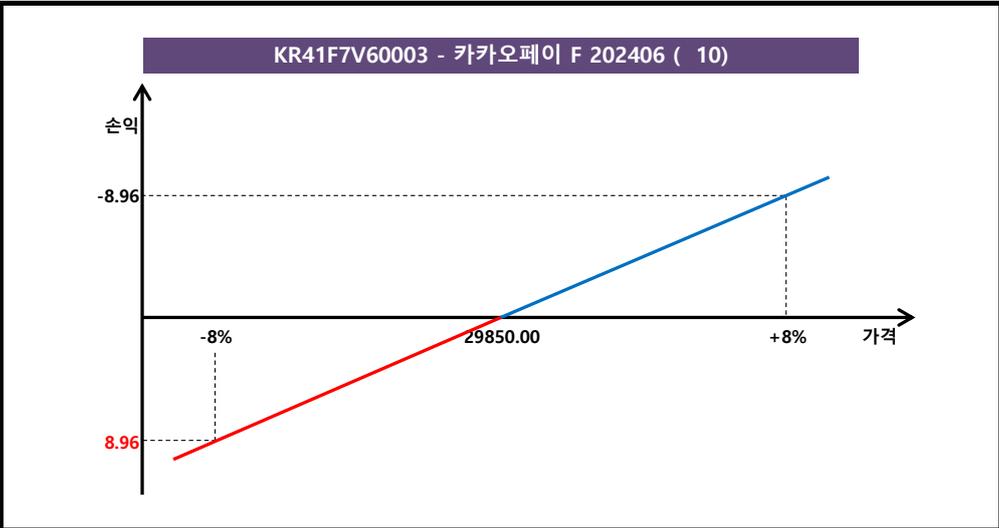
만기 SKC F 202406 (10)이 169100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



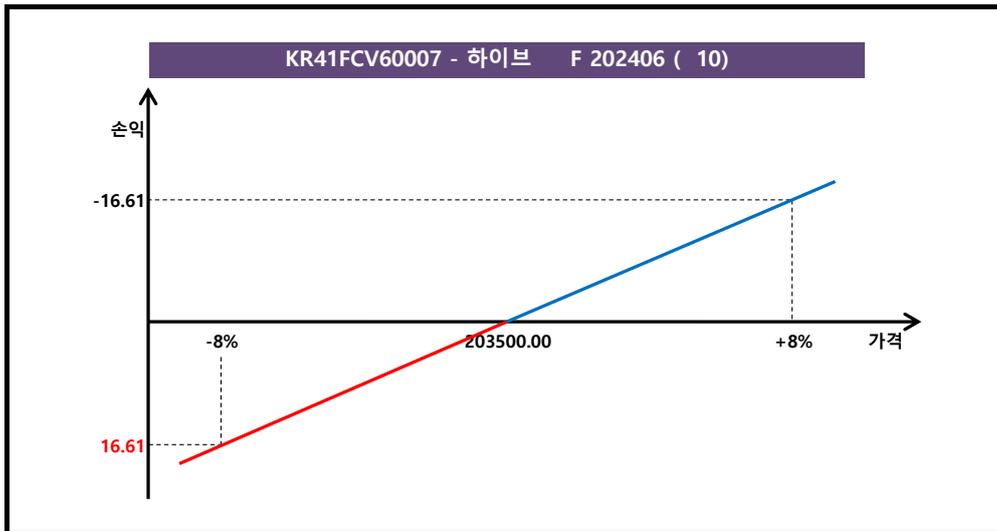
만기 LG에너지솔 F 202407 (10)이 346500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



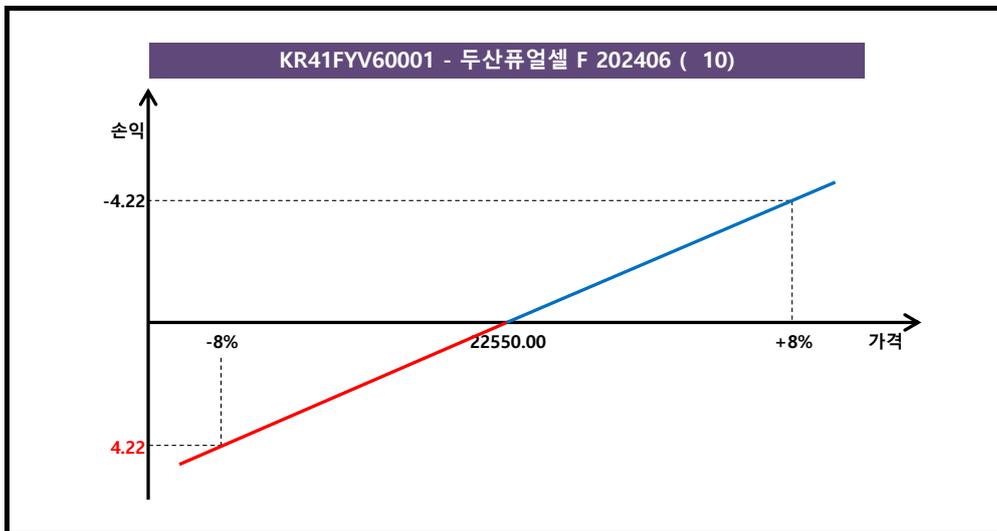
만기 카카오페이 F 202406 (10)이 29850.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



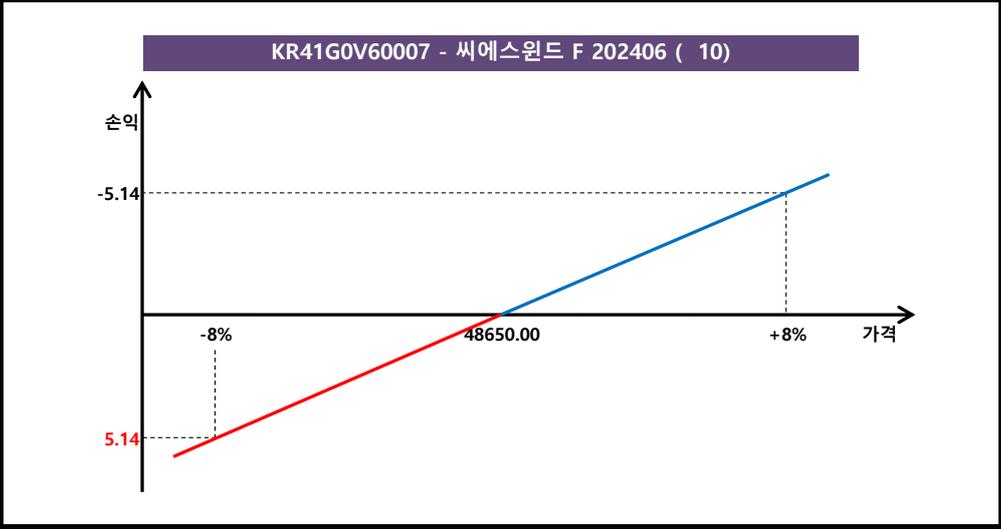
만기 하이브 F 202406 (10)이 203500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



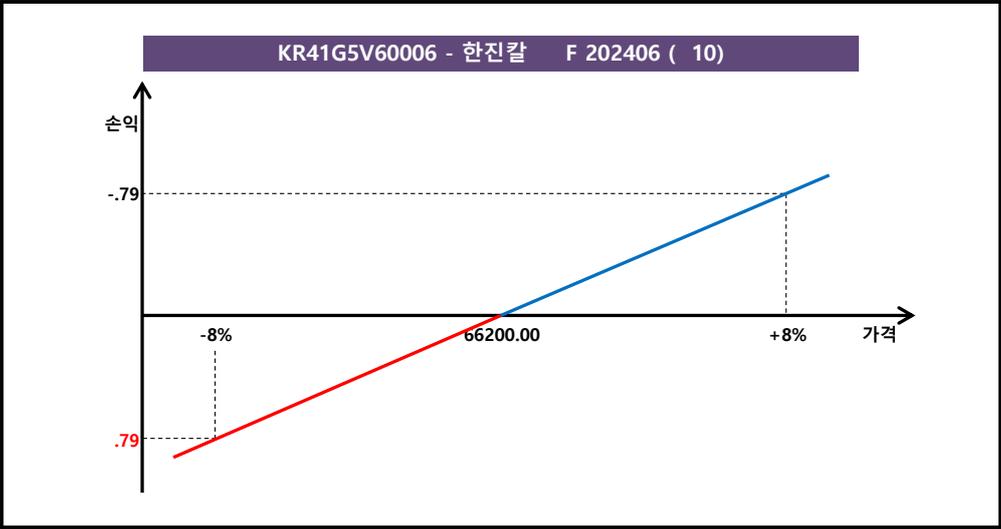
만기 두산퓨얼셀 F 202406 (10)이 22550.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



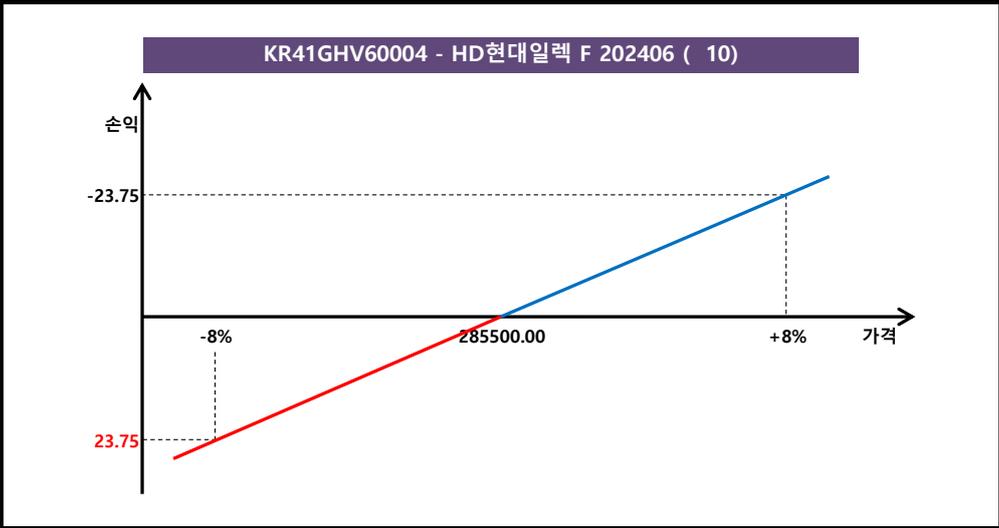
만기 씨에스윈드 F 202406 (10)이 48650.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



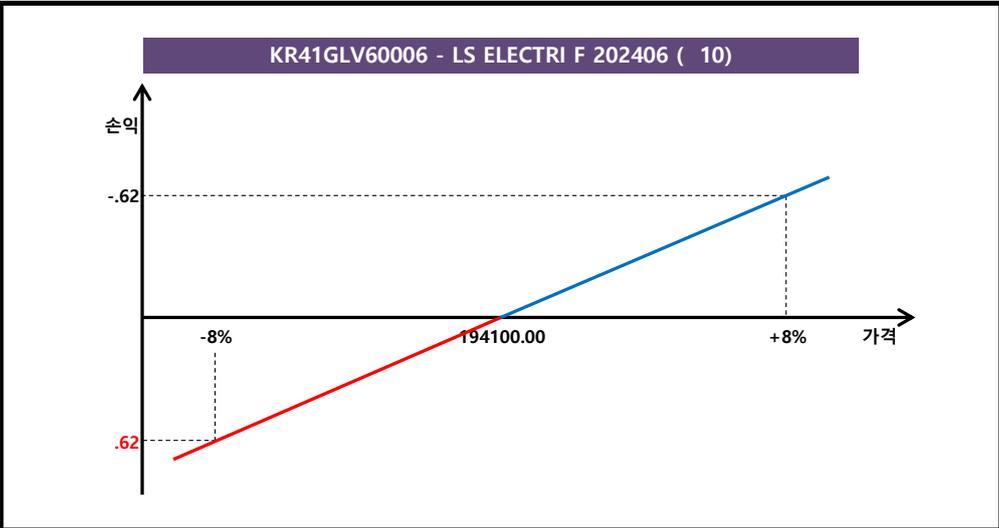
만기 한진칼 F 202406 (10)이 66200.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



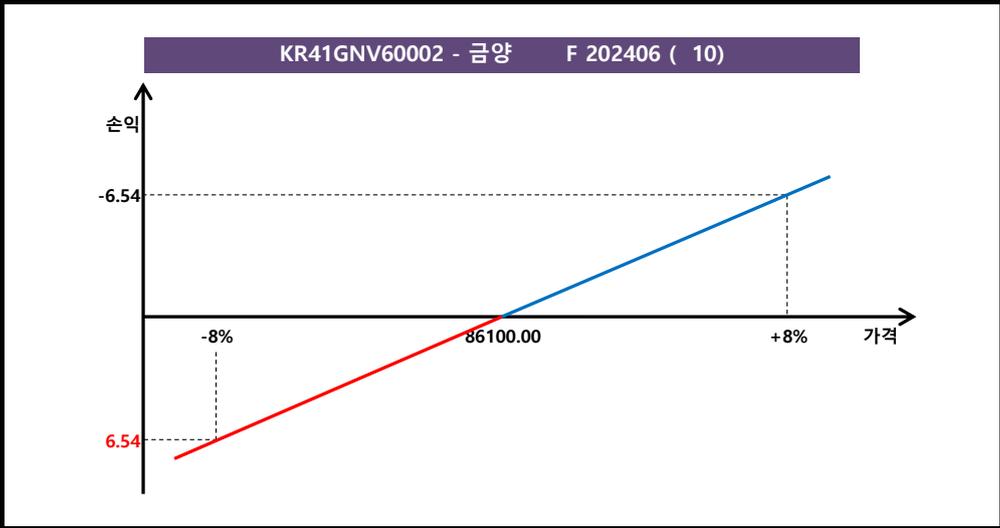
만기 HD현대일렉 F 202406 (10)이 285500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



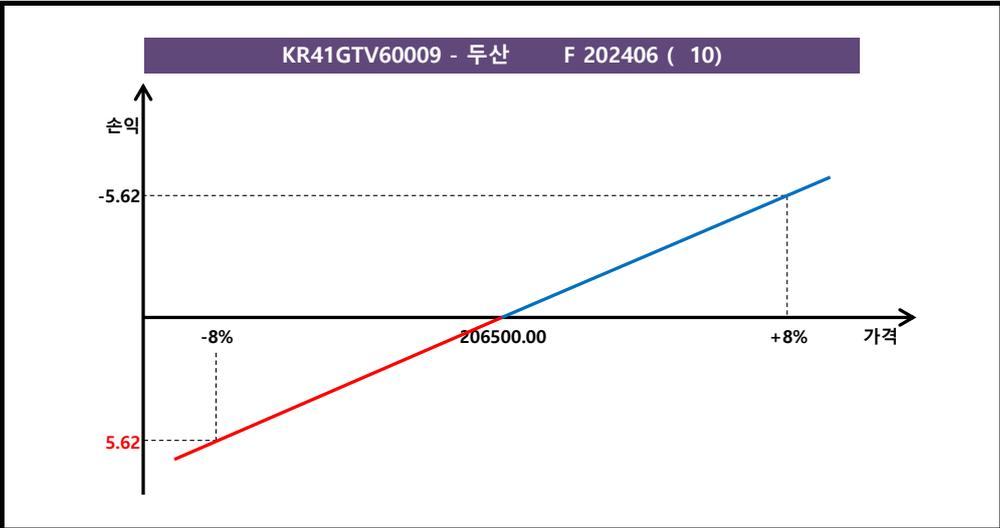
만기 LS ELECTRI F 202406 (10)이 194100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



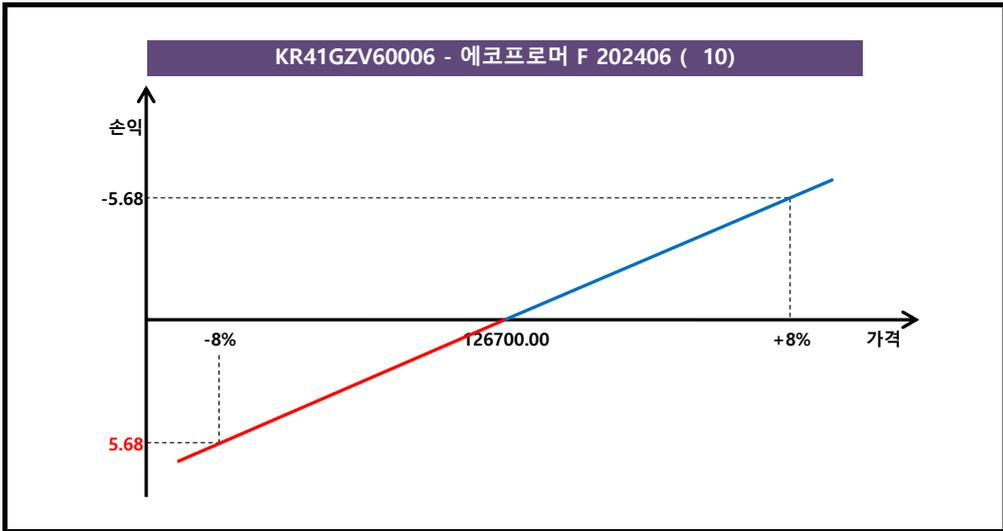
만기 금양 F 202406 (10)이 86100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 두산 F 202406 (10)이 206500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 예코프로머 F 202406 (10)이 126700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	722.88
	5.33%	481.62
	2.67%	241.26
	0%	0.00
	-2.67%	-241.26
	-5.33%	-481.62
	-8.00%	-722.88
최대손실 시나리오 위험액		722.88

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR) (단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	1,241.76
-----	----------