

## (무)알리안츠파워밸런스\_코리아인덱스

공시일 : 2024-06-20

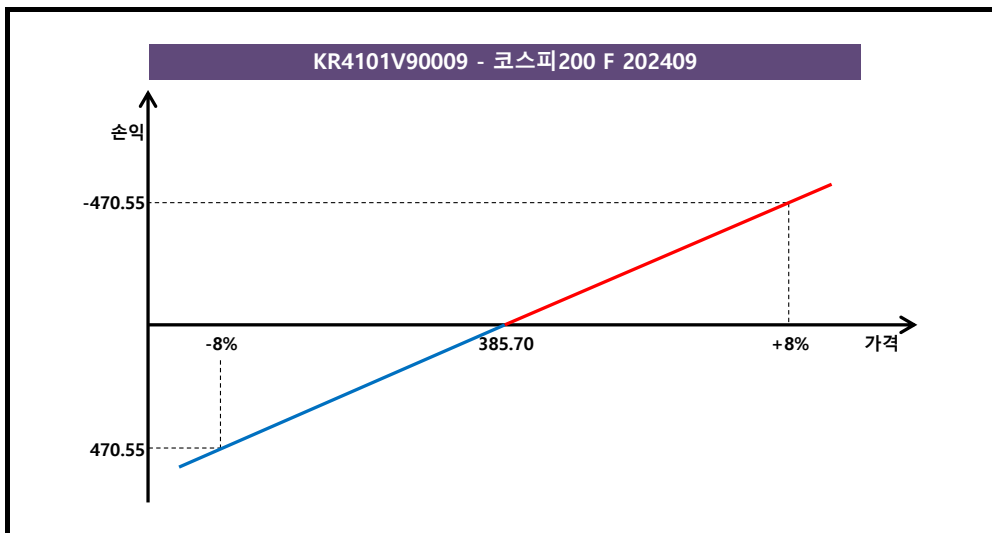
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

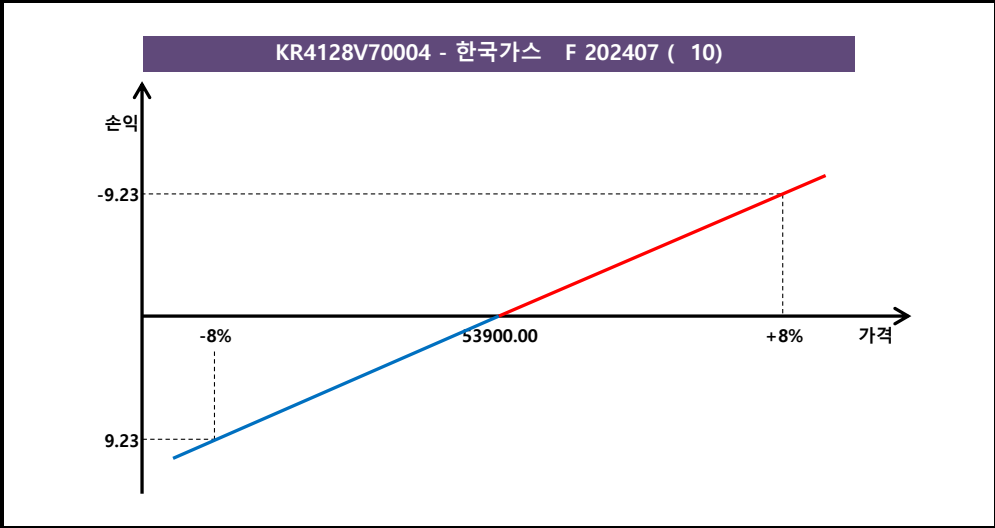
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	7,946	0	7,946	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	7,946	0	7,946	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

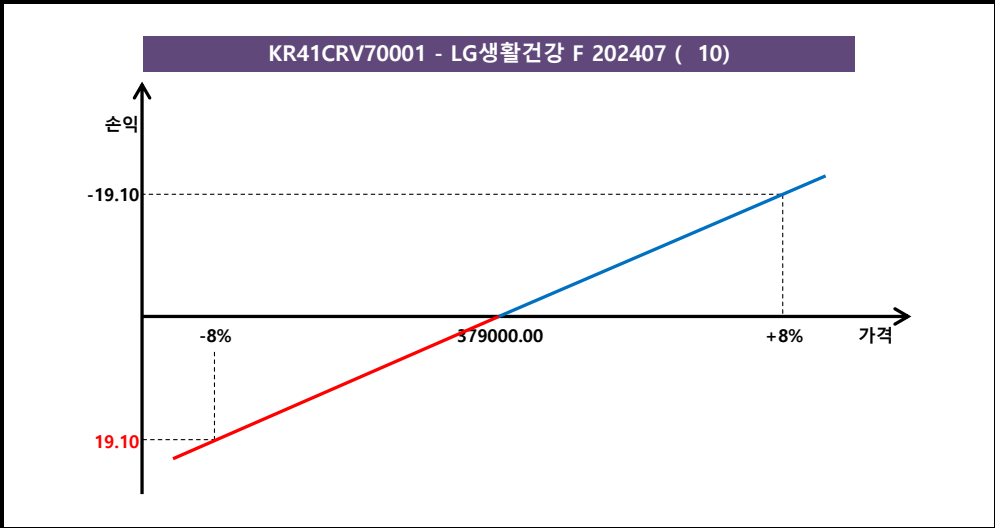
만기 코스피200 F 202409이 385.70 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



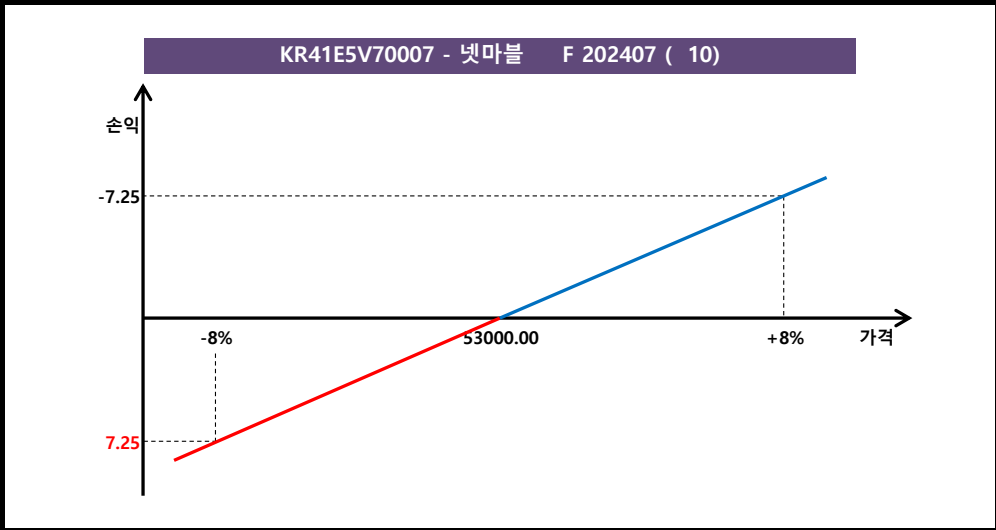
만기 한국가스 F 202407 ( 10)이 53900.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



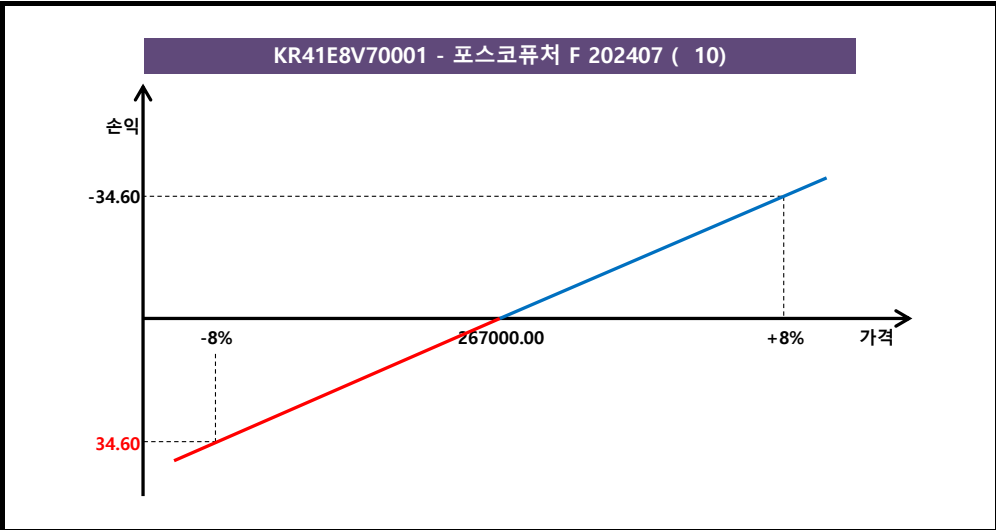
만기 LG생활건강 F 202407 ( 10)이 379000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



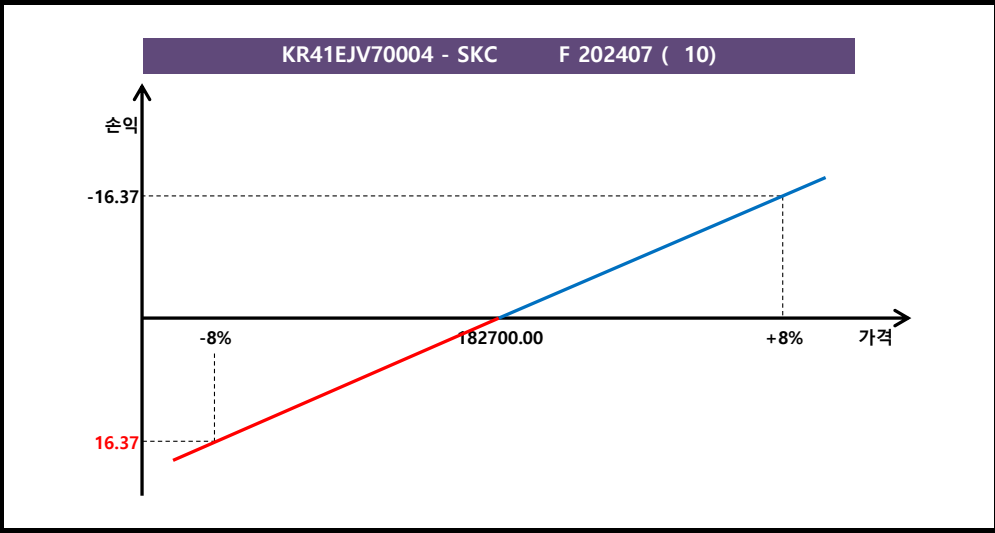
만기 넷마블 F 202407 ( 10)이 53000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



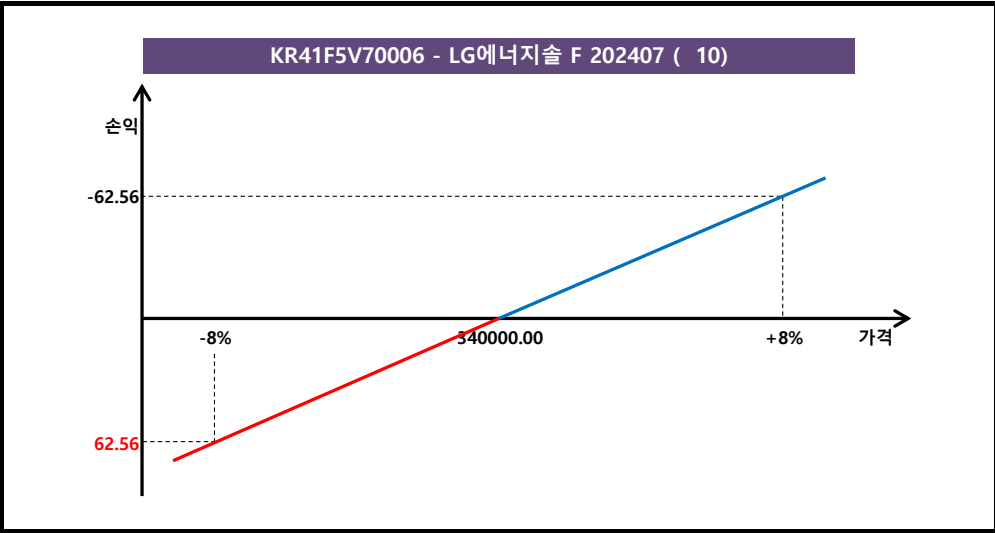
만기 포스코퓨처 F 202407 ( 10)이 267000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



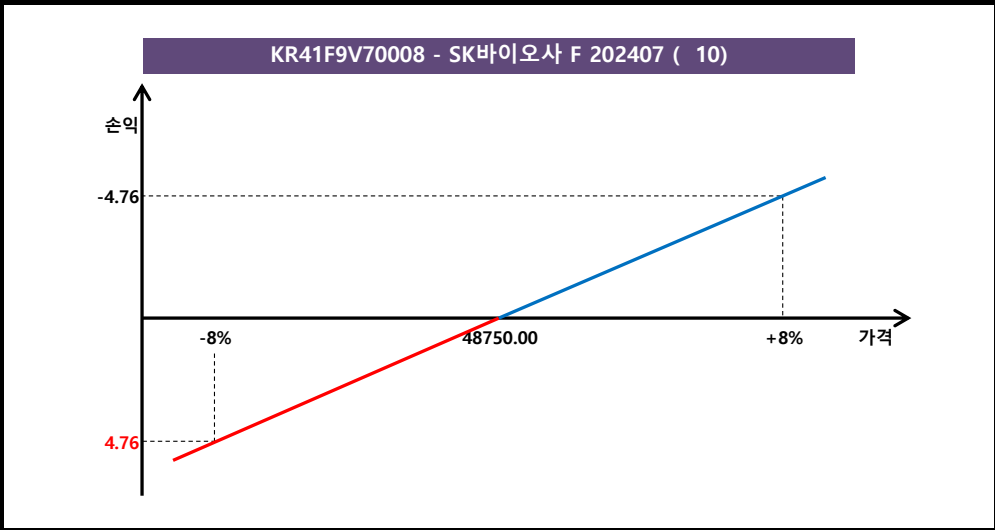
만기 SKC F 202407 ( 10)이 182700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



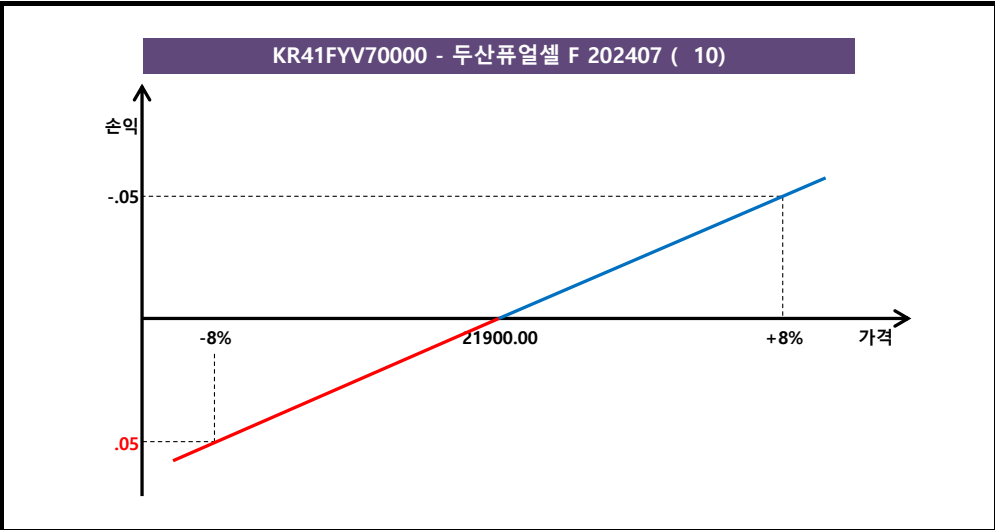
만기 LG에너지솔 F 202407 ( 10)이 340000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



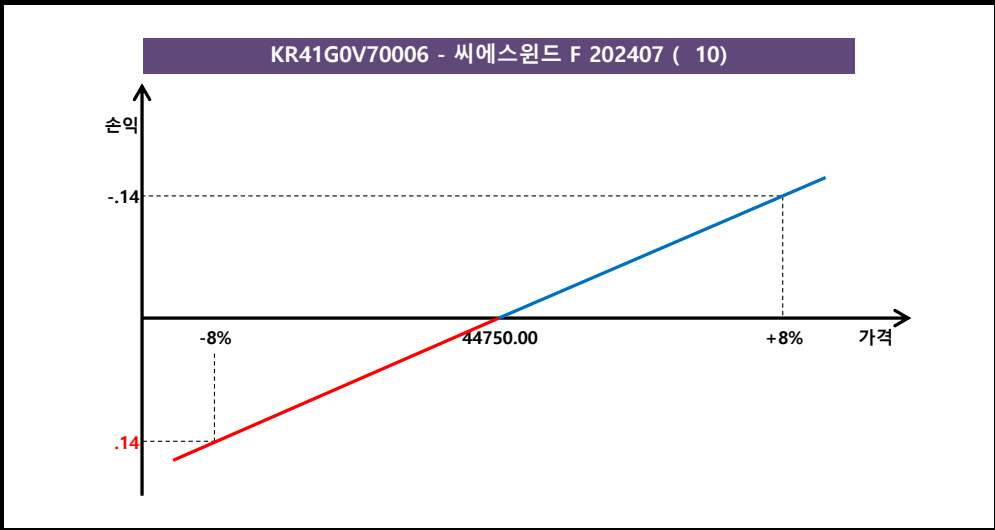
만기 SK바이오사 F 202407 ( 10)이 48750.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



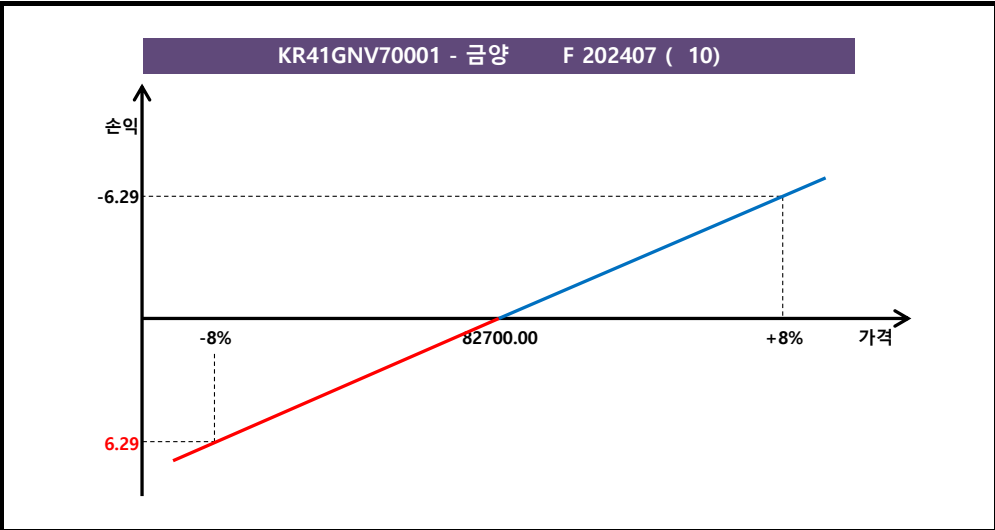
만기 두산퓨얼셀 F 202407 ( 10)이 21900.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



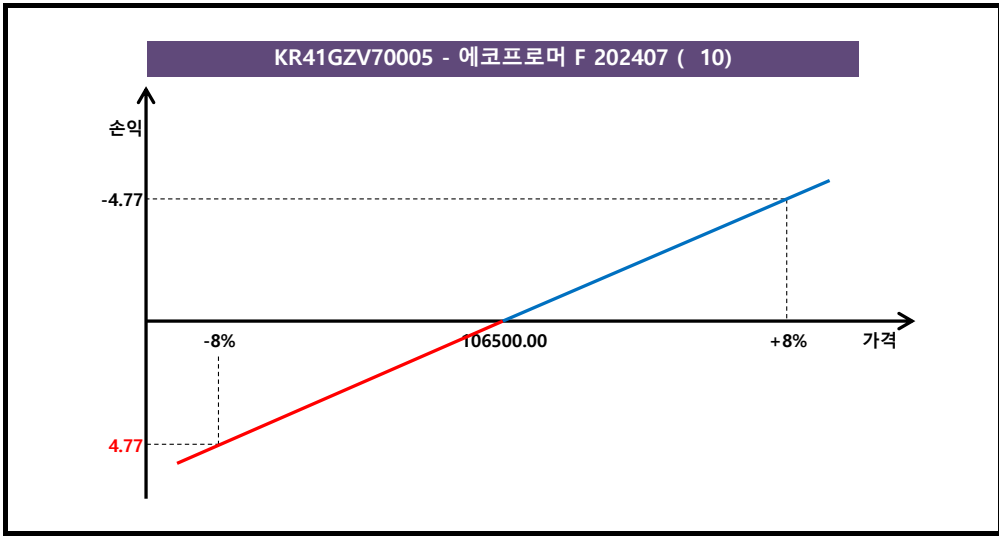
만기 씨에스원드 F 202407 ( 10)이 44750.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 금양 F 202407 ( 10)이 82700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 예코프로머 F 202407 ( 10)이 106500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	635.68
	5.33%	423.52
	2.67%	212.16
	0%	0.00
	-2.67%	-212.16
	-5.33%	-423.52
	-8.00%	-635.68
최대손실 시나리오 위험액		635.68

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR) (단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	1,030.15
-----	----------