

(무)알리안츠파워밸런스_코리아인덱스

공시일 : 2024-06-28

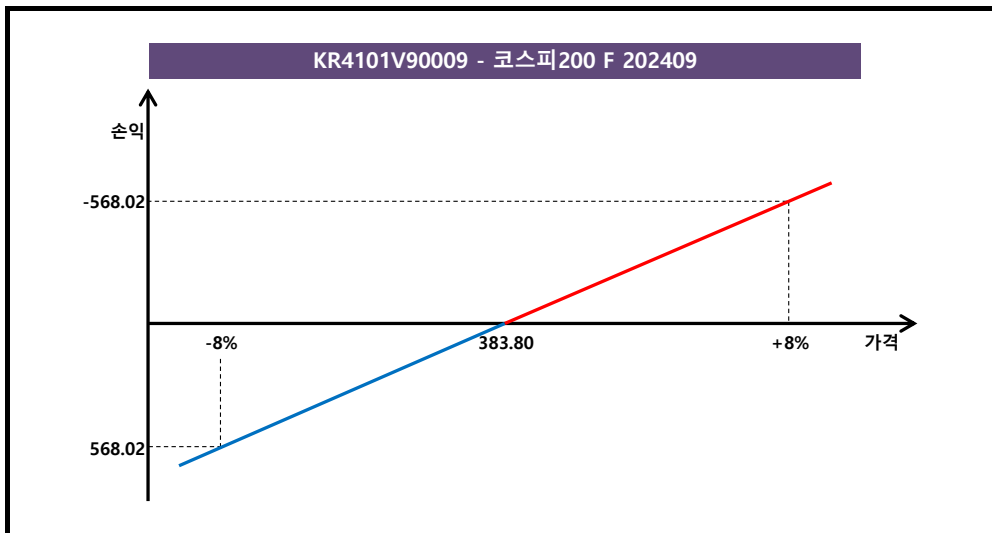
1. 계약금액

(단위:백만원)

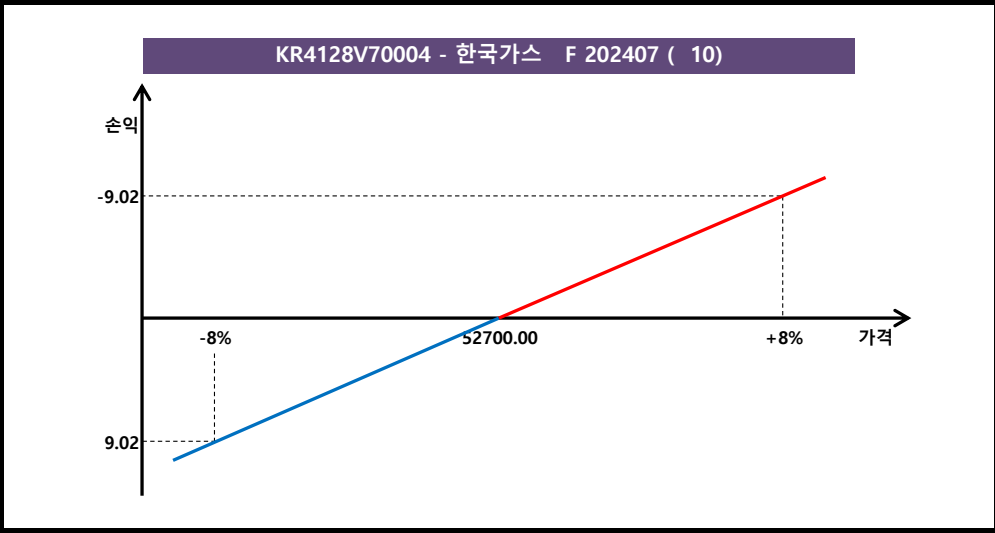
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누적	유가증권	선물	9,333	0	9,333	장내
누적	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물+옵션	9,333	0	9,333	장내

2. 만기시점의 손익구조

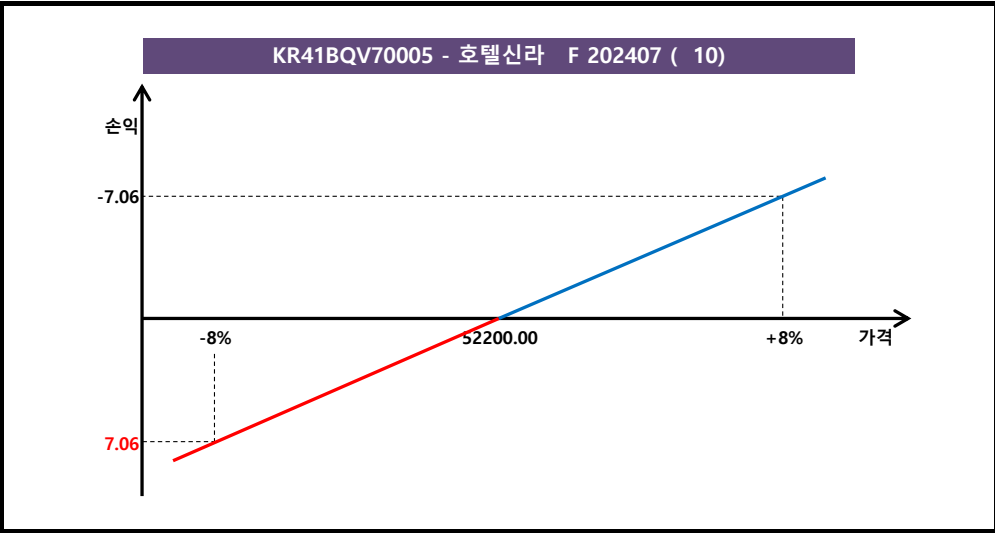
만기 코스피200 F 202409이 383.80 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



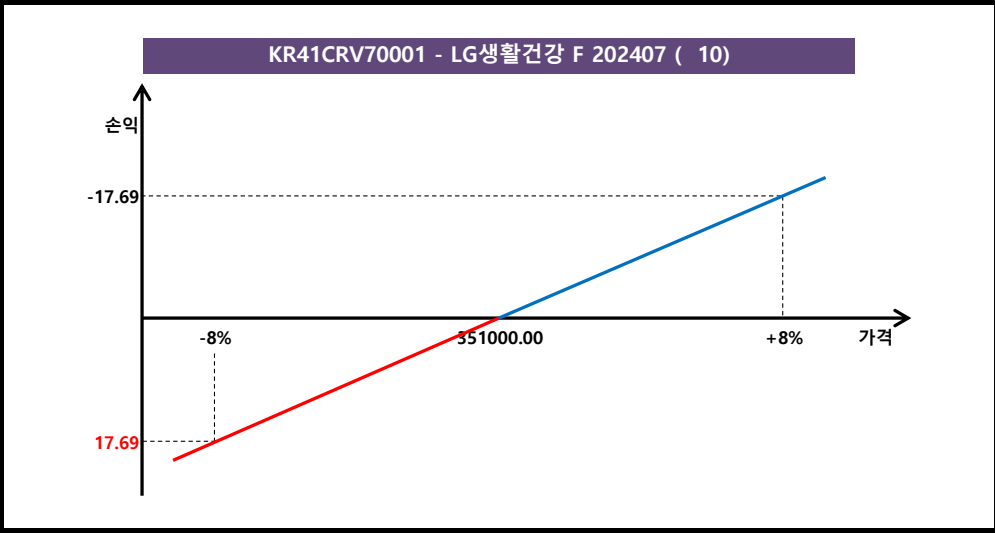
만기 한국가스 F 202407 (10)이 52700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



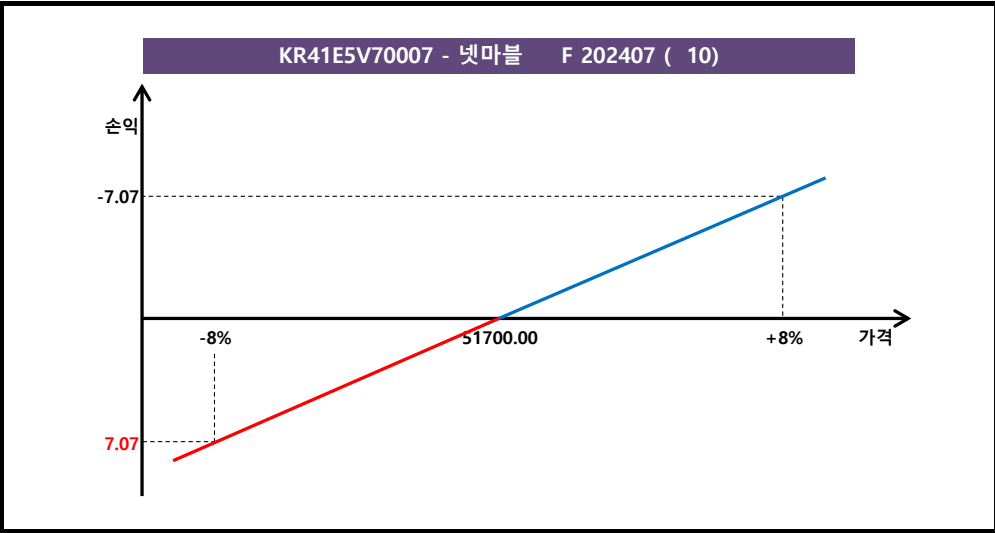
만기 호텔신라 F 202407 (10)이 52200.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



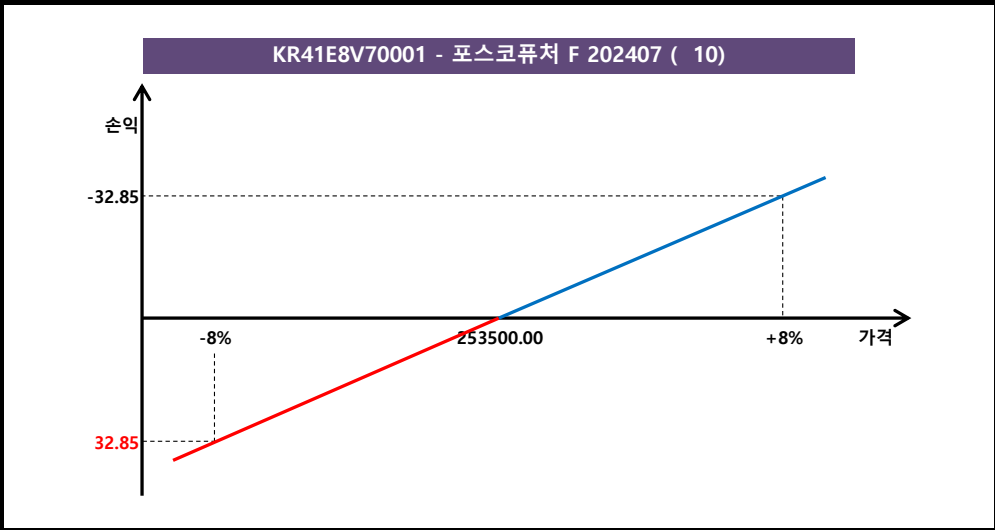
만기 LG생활건강 F 202407 (10)이 351000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



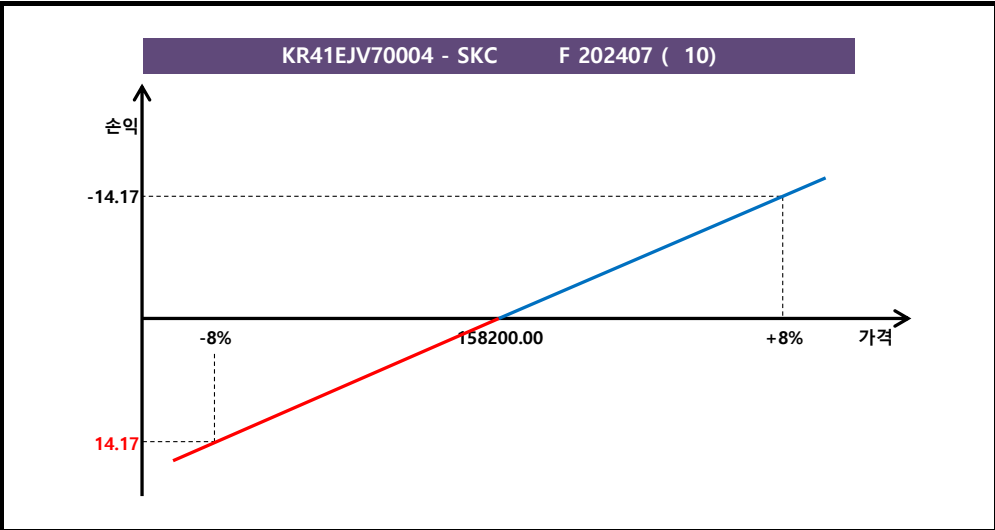
만기 넷마블 F 202407 (10)이 51700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



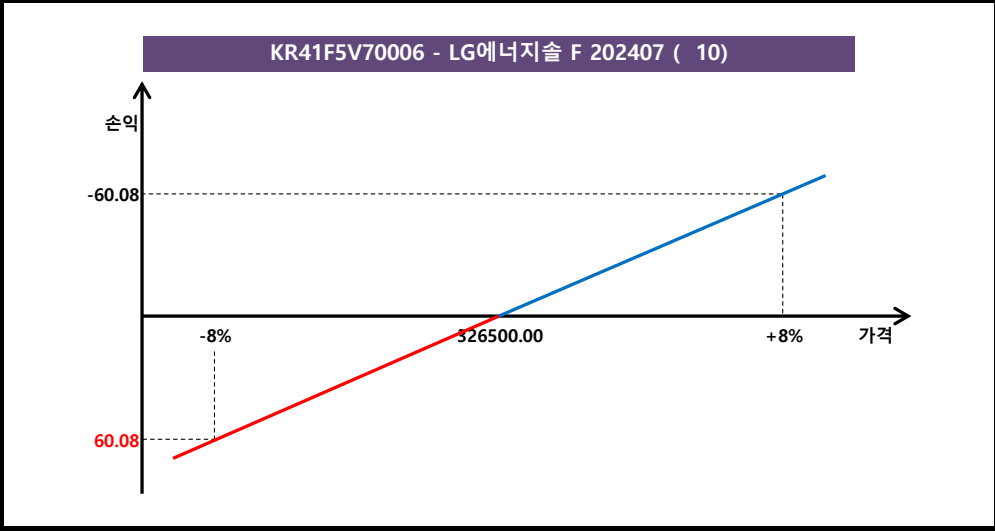
만기 포스코퓨처 F 202407 (10)이 253500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



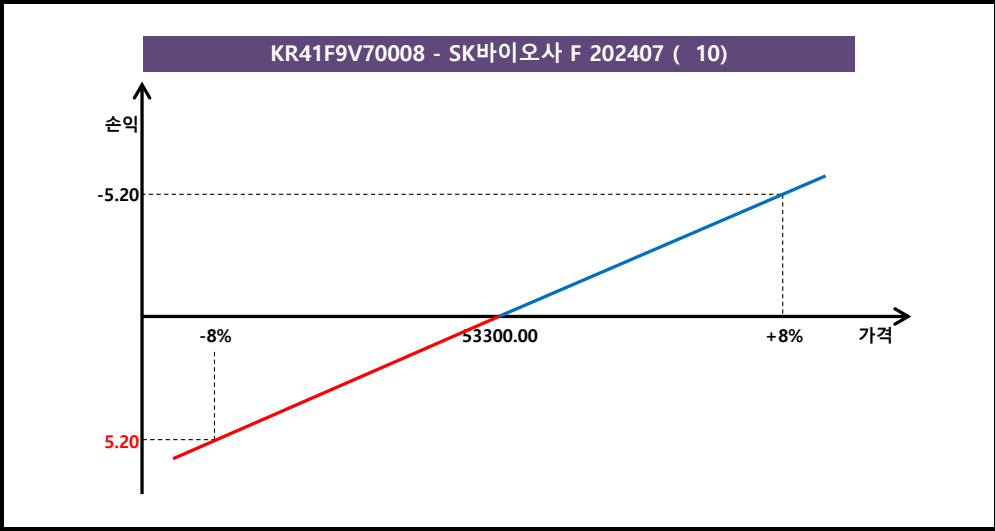
만기 SKC F 202407 (10)이 158200.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



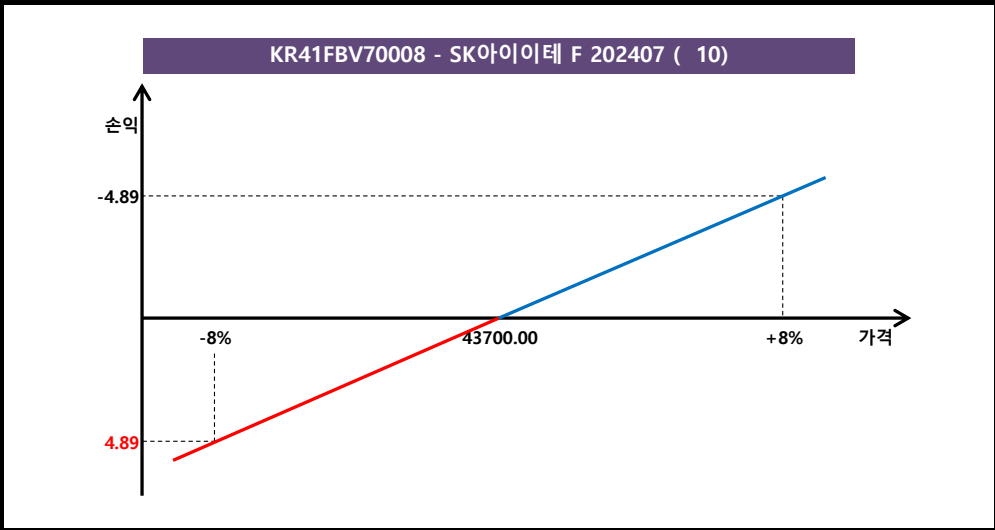
만기 LG에너지솔 F 202407 (10)이 326500.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



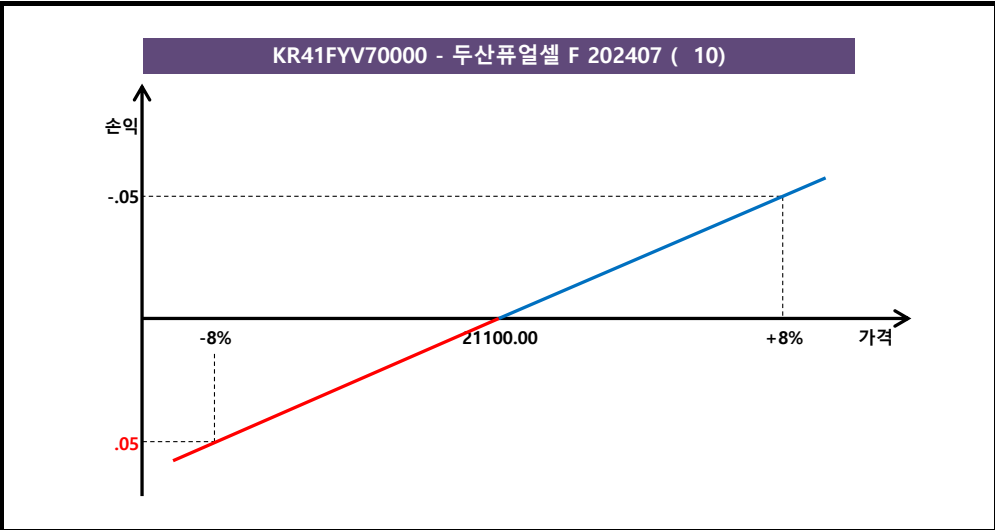
만기 SK바이오사 F 202407 (10)이 53300.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



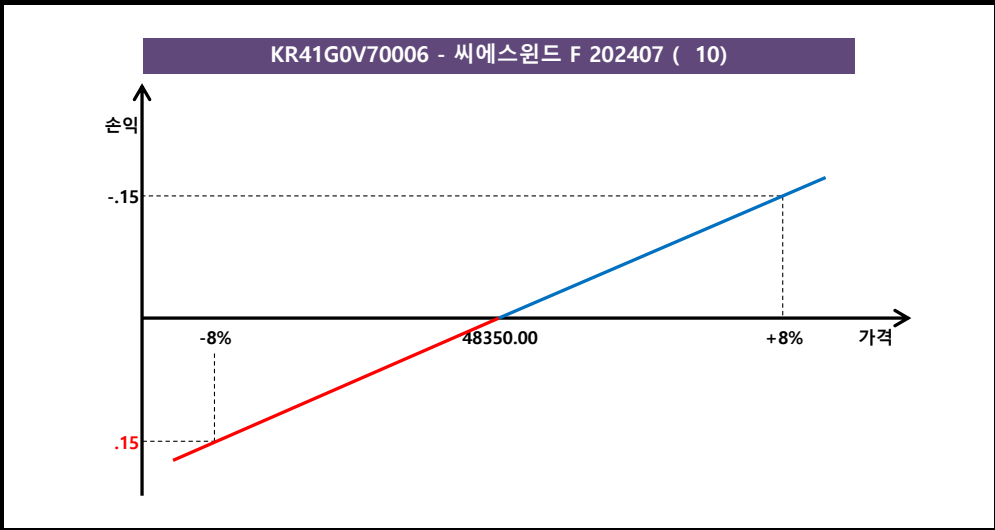
만기 SK아이이테크 F 202407 (10)이 43700.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



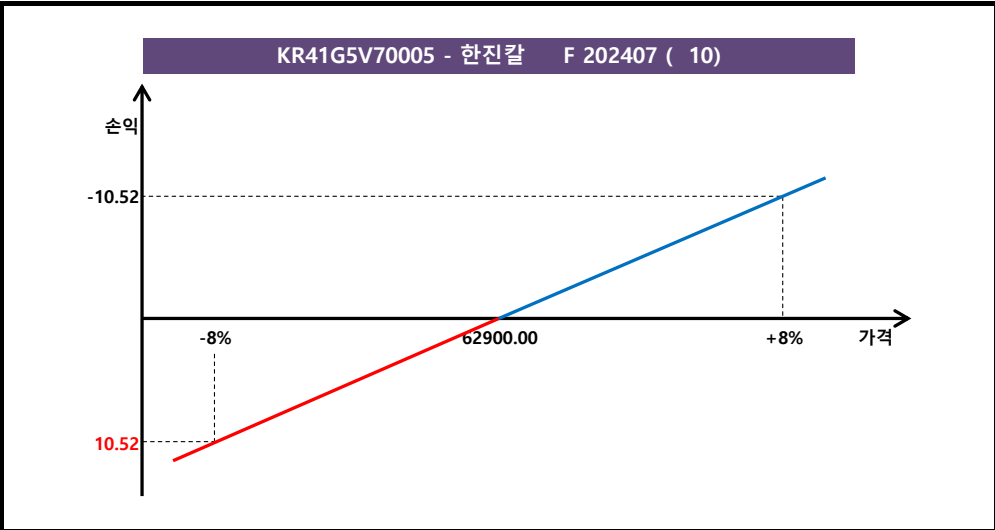
만기 두산퓨얼셀 F 202407 (10)이 21100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



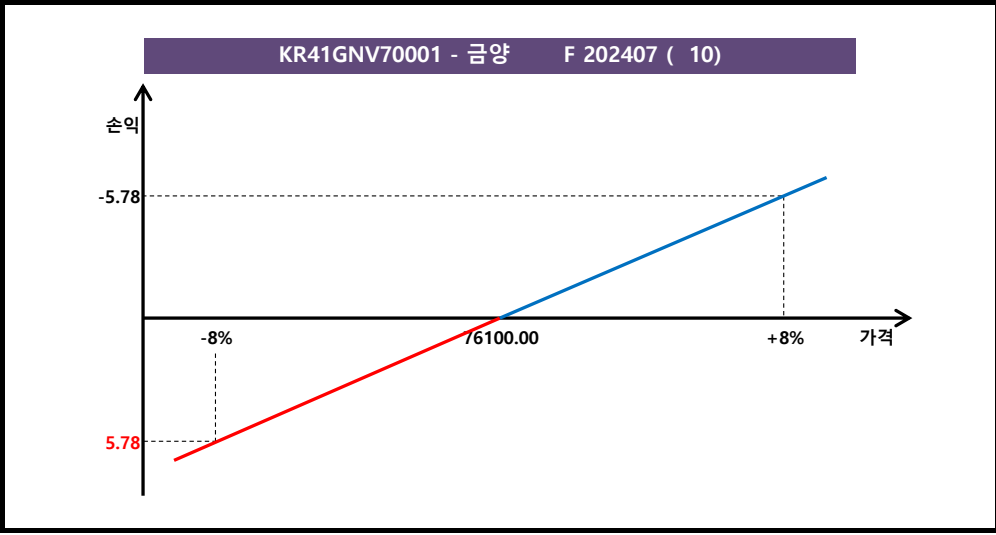
만기 씨에스원드 F 202407 (10)이 48350.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



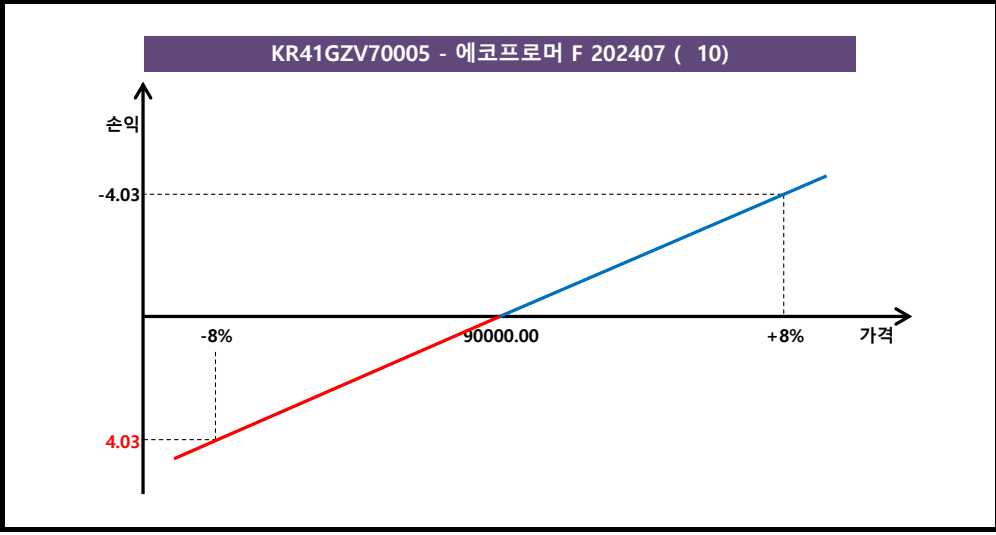
만기 한진칼 F 202407 (10)이 62900.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 금양 F 202407 (10)이 76100.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



만기 에코프로머 F 202407 (10)이 90000.00 보다 작은(큰) 경우 손실(이익) 발생



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)

(단위:백만원)

	구분	시나리오
기초자산 시나리오	8.00%	746.61
	5.33%	497.43
	2.67%	249.18
	0%	0.00
	-2.67%	-249.18
	-5.33%	-497.43
	-8.00%	-746.61
최대손실 시나리오 위험액		746.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(VaR)

(단위:백만원)

99%신뢰수준, 10일기준 적용

위험액	1,171.17
-----	----------