유진인덱스알파증권(주식-파생형)

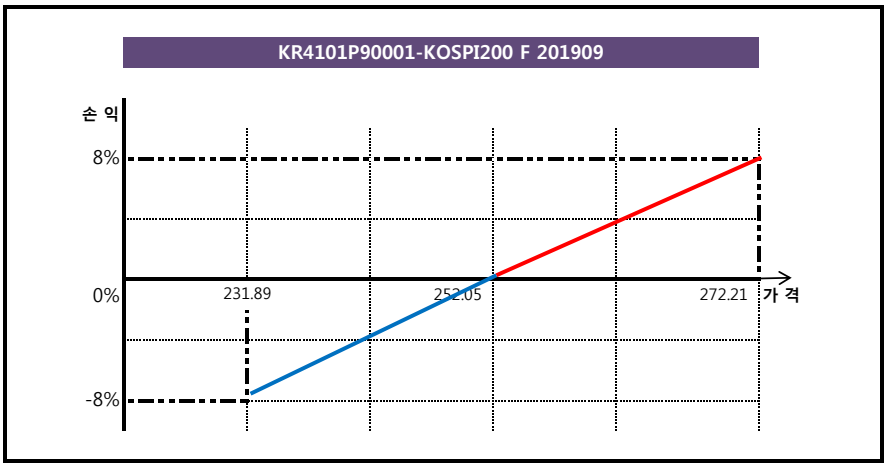
공시일 : 2019-08-14

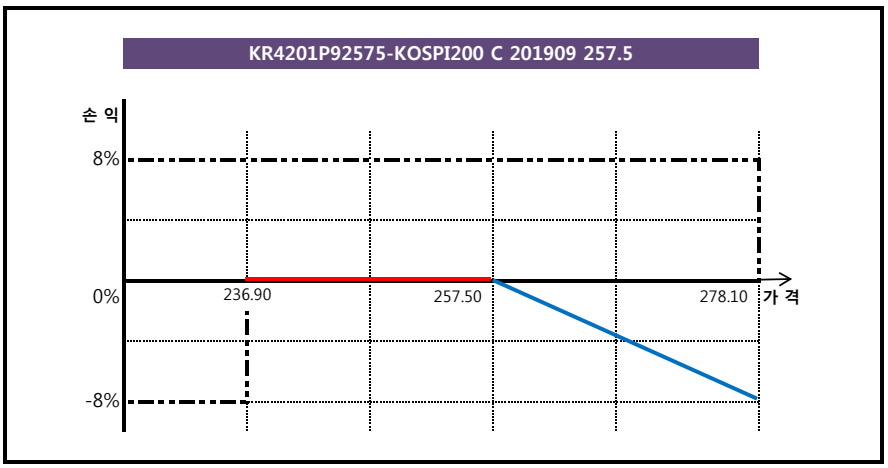
1. 계약금액

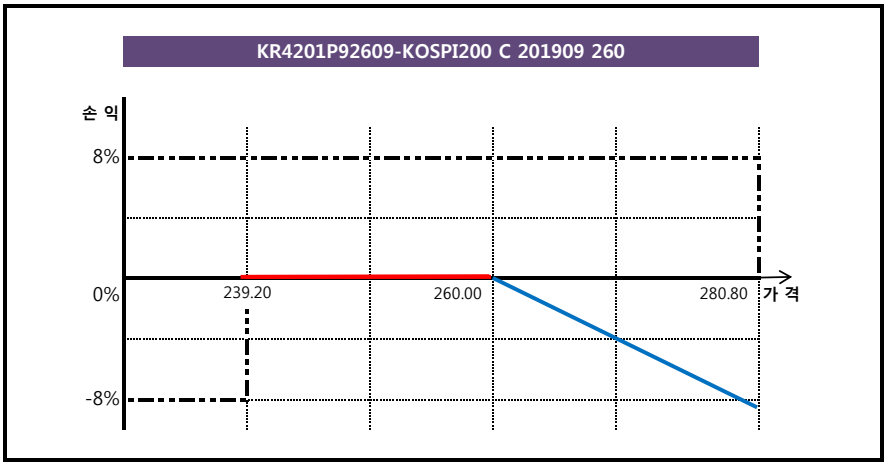
단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0.00	189.03	-189.03	장내
누계	유가증권	선물	1,323.26	0.00	1,323.26	장내
신규	유가증권	옵션	0.00	5.32	-5.32	장내
누계	유가증권	옵션	0.00	6.96	-6.96	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 손익구조변동(최대손실가능금액) **(단위:백만원)**

KR4101P90001-KOSPI200 F 201909

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	105.86
	5.33%	70.53
	2.67%	35.33
	0%	0.00
	-2.67%	-35.33
	-5.33%	-70.53
	-8%	-105.86

최대손실 시나리오 위험액	105.86

KR4201P92575-KOSPI200 C 201909 257.5

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	-32.85
	5.33%	-18.96
	2.67%	-7.80
	0%	0.00
	-2.67%	4.48
	-5.33%	6.50
	-8%	7.20

최대손실 시나리오 위험액	32.85

KR4201P92609-KOSPI200 C 201909 260

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	-14.72
	5.33%	-8.23
	2.67%	-3.26
	0%	0.00
	-2.67%	1.74
	-5.33%	2.46
	-8%	2.69

최대손실 시나리오 위험액	14.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (VaR) **(단위:백만원)**

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

위험액	85.24

유진 코스피 레버리지ETF분할매수 목표전환형 증권투자신탁[주식혼합-재간접파생형]

공시일 : 2019-08-14

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ETF	0.00	0.00	0.00	장내
누계	유가증권	ETF	291.77	0.00	291.77	장내

2. 만기시점의 손익구조

이 투자신탁은 KOSPI200지수를 추종하는 레버리지ETF에 주로 투자하며,
KOSPI지수 구간별(종가 기준)로 사전에 정해진 투자비중에 따라 ETF를 분할하여 매수/매도 합니다.

3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

이 투자신탁이 주로 투자하는 레버리지ETF는 기초지수의 일별수익률을 매일 2배수만큼 추적하는 것을
목표로 하기 때문에 일정기간의 누적수익률에 대해서는 2배수로 연동되지 않을 수 있습니다.
또한 시장 상황에 따라 추적하는 기초지수 일별수익률의 2배와 격차가 발생할 수 있습니다.

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (VaR) (단위:백만원)

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

위험액	39.25