유진인덱스알파증권(주식-파생형)

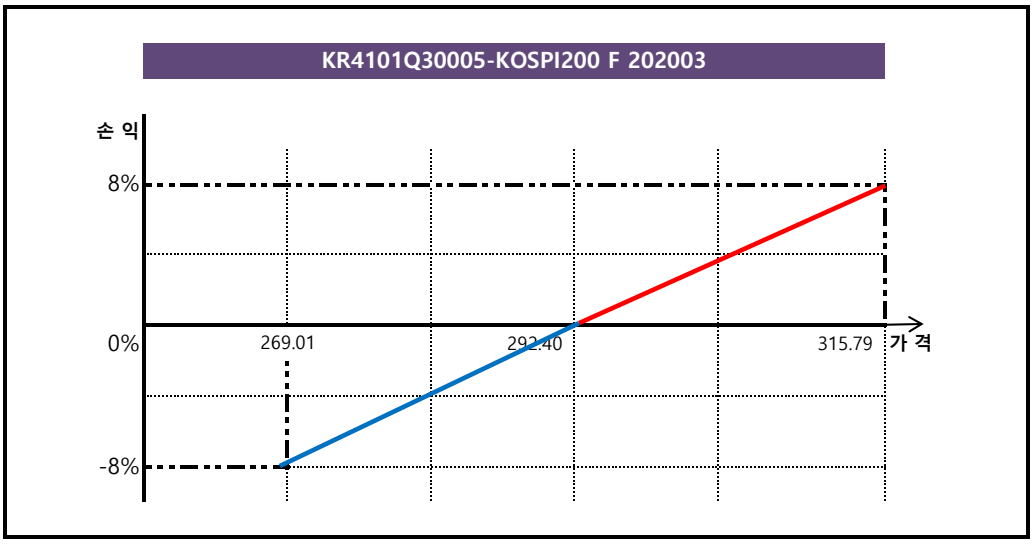
공시일 : 2020-01-08

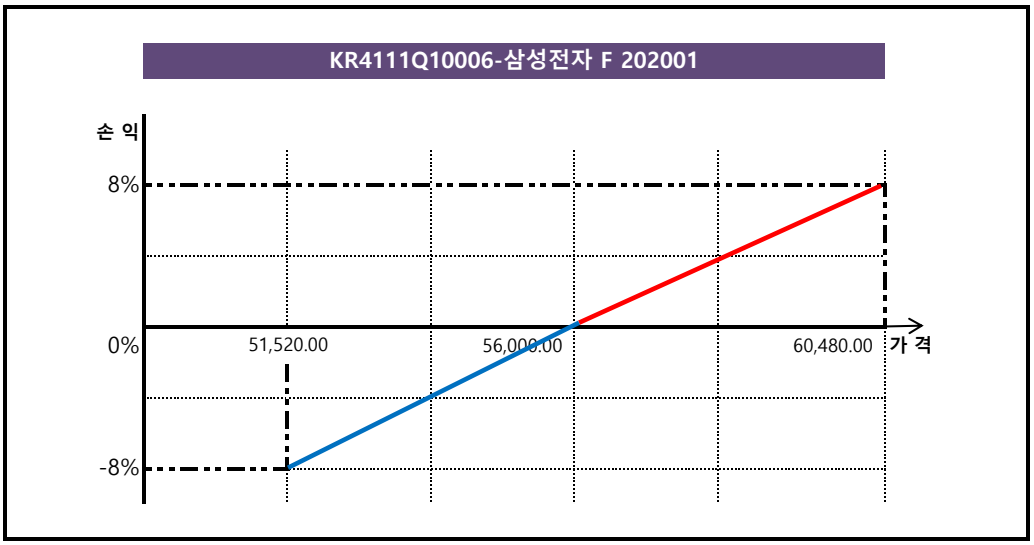
1. 계약금액

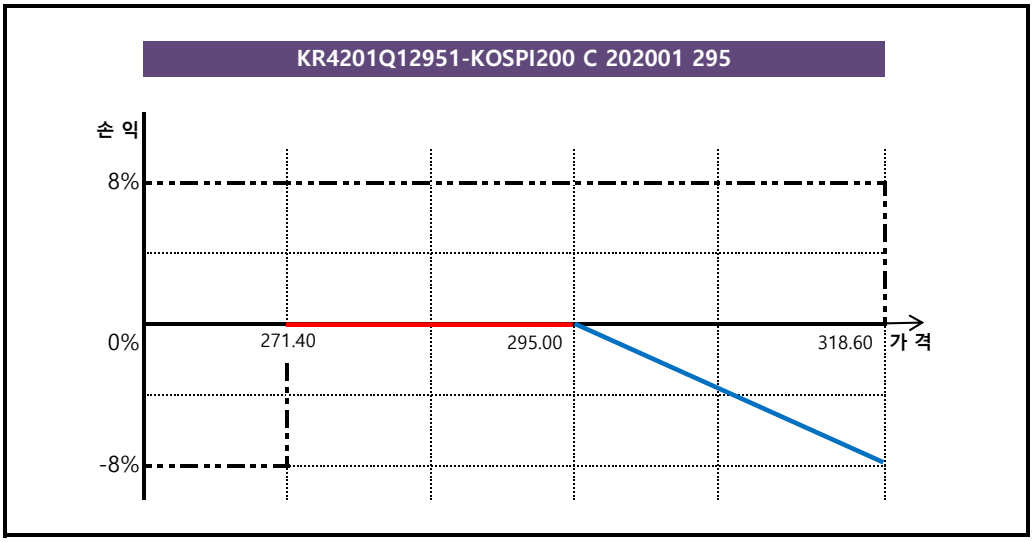
단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0.00	365.50	-365.50	장내
누계	유가증권	선물	1,191.40	0.00	1,191.40	장내
신규	유가증권	옵션	0.00	1.10	-1.10	장내
누계	유가증권	옵션	0.00	1.10	-1.10	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 손익구조변동(최대손실가능금액) **(단위:백만원)**

KR4101Q30005-KOSPI200 F 202003

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	81.87
	5.33%	54.55
	2.67%	27.32
	0%	0.00
	-2.67%	-27.32
	-5.33%	-54.55
	-8%	-81.87

최대손실 시나리오 위험액	81.87

KR4111Q10006-삼성전자 F 202001

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	13.44
	5.33%	8.95
	2.67%	4.49
	0%	0.00
	-2.67%	-4.49
	-5.33%	-8.95
	-8%	-13.44

최대손실 시나리오 위험액	13.44

KR4201Q12951-KOSPI200 C 202001 295

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	-47.21
	5.33%	-27.81
	2.67%	-9.91
	0%	0.00
	-2.67%	1.53
	-5.33%	1.56
	-8%	1.56

최대손실 시나리오 위험액	47.21

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

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

위험액	92.35

유진 코스피 레버리지ETF분할매수 목표전환형 증권투자신탁[주식혼합-재간접파생형]

공시일 : 2020-01-08

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	309.74	0.00	309.74	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	39.06