유진인덱스알파증권(주식-파생형)

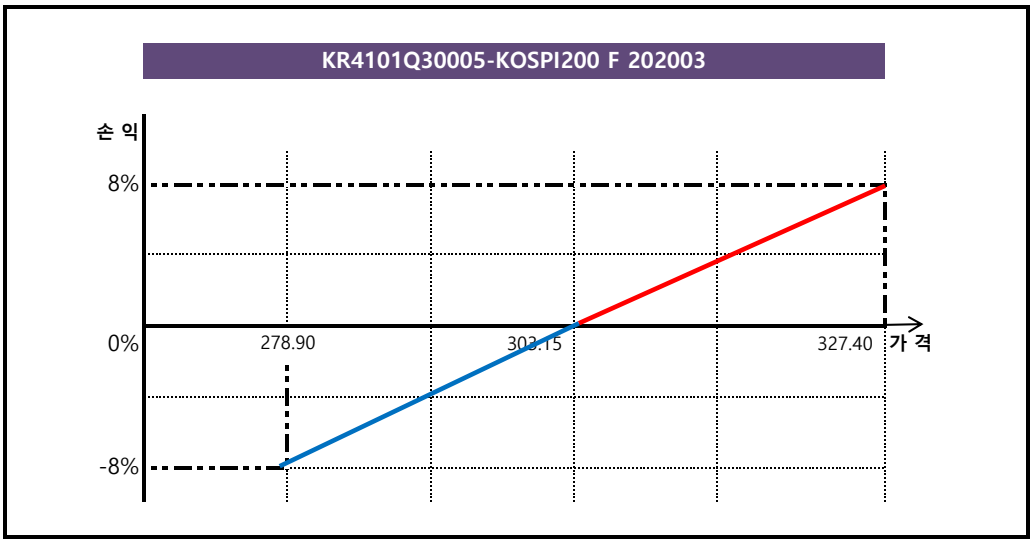
공시일 : 2020-01-17

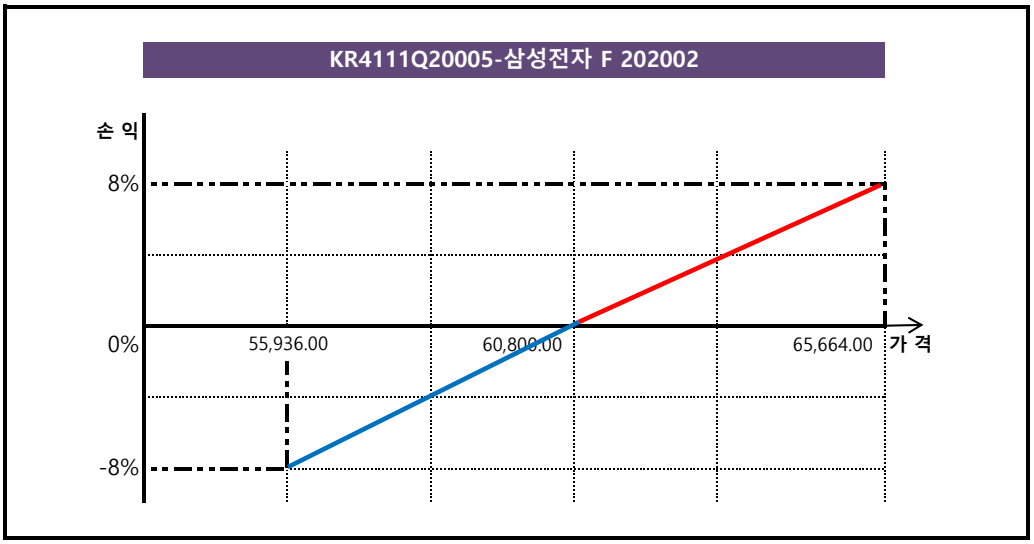
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	12.16	227.36	-215.20	장내
누계	유가증권	선물	1,135.26	0.00	1,135.26	장내
신규	유가증권	옵션	0.00	0.00	0.00	장내
누계	유가증권	옵션	0.00	0.00	0.00	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005-KOSPI200 F 202003

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	48.50
	5.33%	32.32
	2.67%	16.19
	0%	0.00
	-2.67%	-16.19
	-5.33%	-32.32
	-8%	-48.50

최대손실 시나리오 위험액	48.50

KR4111Q20005-삼성전자 F 202002

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	42.32
	5.33%	28.19
	2.67%	14.12
	0%	0.00
	-2.67%	-14.12
	-5.33%	-28.19
	-8%	-42.32

최대손실 시나리오 위험액	42.32

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (VaR) (단위:백만원)

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

위험액	51.27

유진 코스피 레버리지ETF분할매수 목표전환형 증권투자신탁[주식혼합-재간접파생형]

공시일 : 2020-01-17

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	333.91	0.00	333.91	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	42.19