유진인덱스알파증권(주식-파생형)

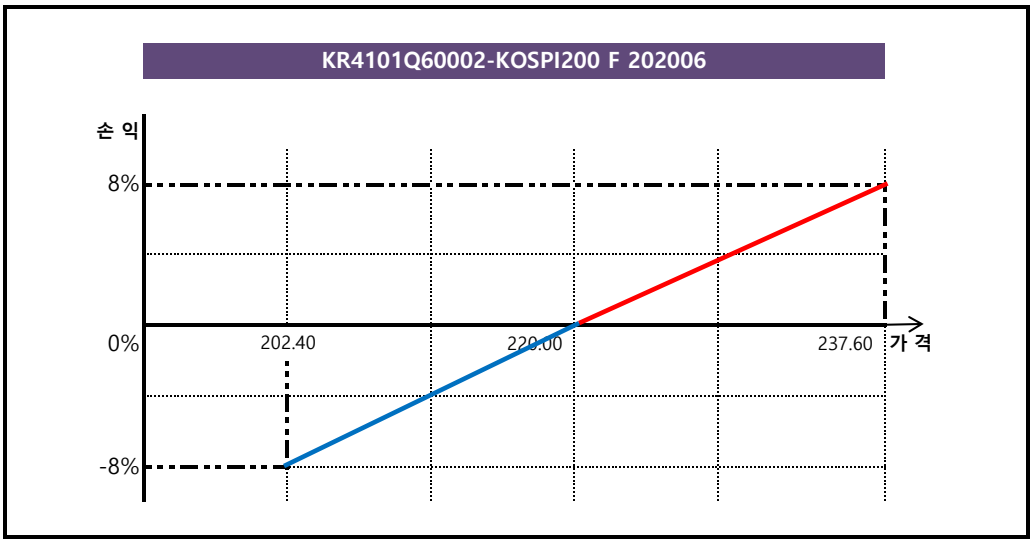
공시일 : 2020-03-25

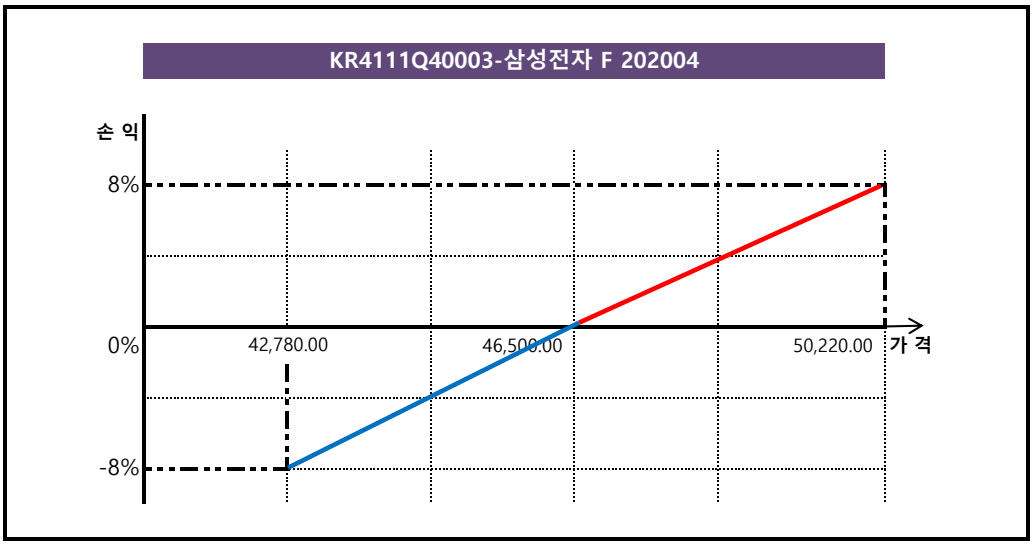
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	156.50	0.00	156.50	장내
누계	유가증권	선물	1,240.60	0.00	1,240.60	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)

KR4101Q60002-KOSPI200 F 202006

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	30.80
	5.33%	20.52
	2.67%	10.28
	0%	0.00
	-2.67%	-10.28
	-5.33%	-20.52
	-8%	-30.80

최대손실 시나리오 위험액	30.80

KR4111Q40003-삼성전자 F 202004

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	68.45
	5.33%	45.60
	2.67%	22.84
	0%	0.00
	-2.67%	-22.84
	-5.33%	-45.60
	-8%	-68.45

최대손실 시나리오 위험액	68.45

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (VaR) (단위:백만원)

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

위험액	212.28

유진 코스피 레버리지ETF분할매수 목표전환형 증권투자신탁[주식혼합-재간접파생형]

공시일 : 2020-03-25

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	188.05	0.00	188.05	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	60.71