유진인덱스알파증권(주식-파생형)

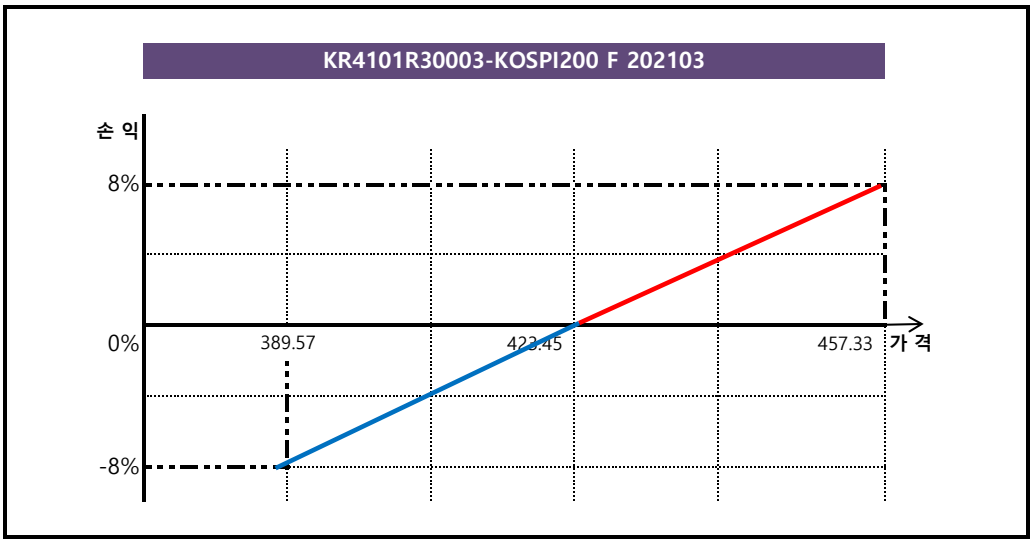
공시일 : 2021-02-18

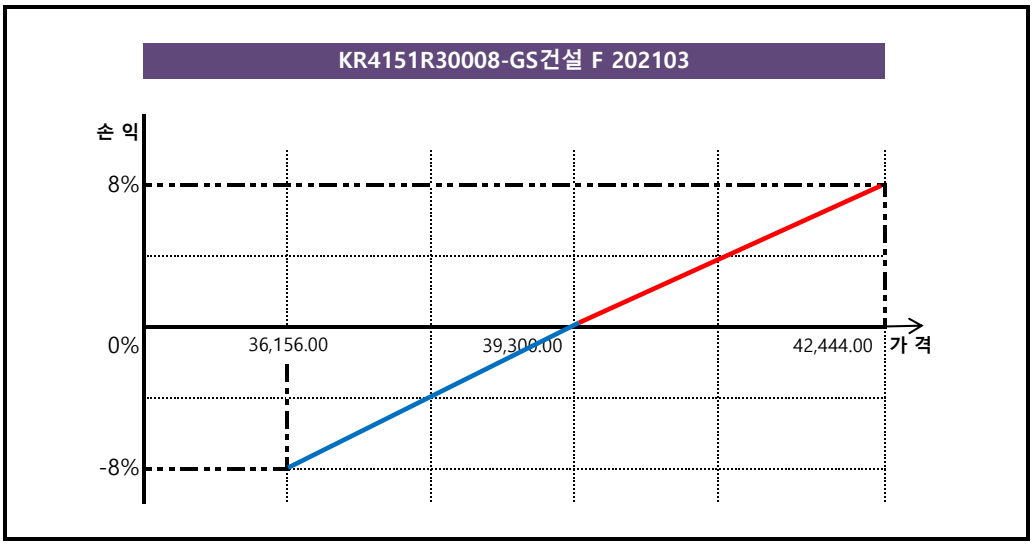
1. 계약금액

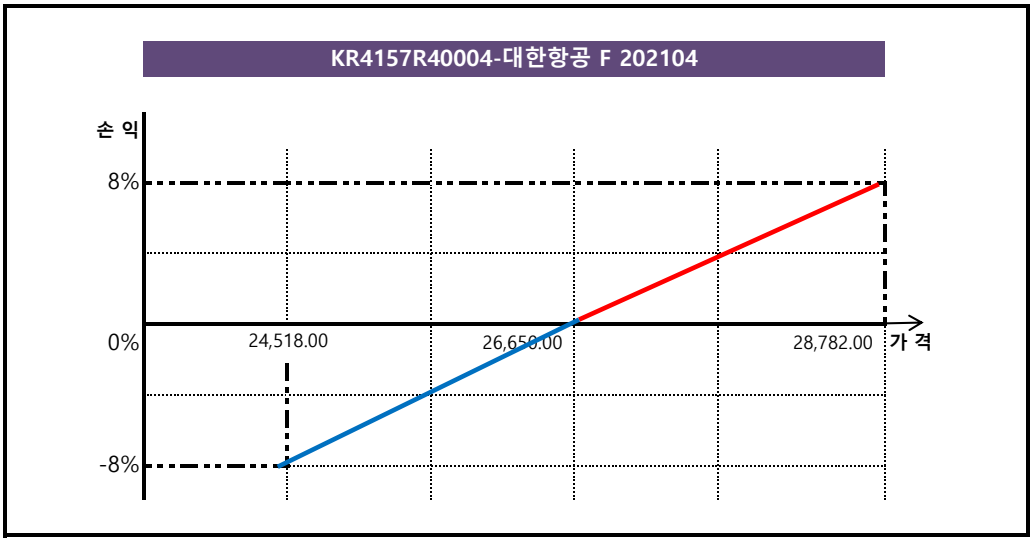
단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0.00	0.00	0.00	장내
누계	유가증권	선물	1,170.43	0.00	1,170.43	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)**

KR4101R30003-KOSPI200 F 202103

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	93.16
	5.33%	62.07
	2.67%	31.09
	0%	0.00
	-2.67%	-31.09
	-5.33%	-62.07
	-8%	-93.16

최대손실 시나리오 위험액	93.16

KR4151R30008-GS건설 F 202103

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	0.22
	5.33%	0.15
	2.67%	0.07
	0%	0.00
	-2.67%	-0.07
	-5.33%	-0.15
	-8%	-0.22

최대손실 시나리오 위험액	0.22

KR4157R40004-대한항공 F 202104

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	0.26
	5.33%	0.17
	2.67%	0.09
	0%	0.00
	-2.67%	-0.09
	-5.33%	-0.17
	-8%	-0.26

최대손실 시나리오 위험액	0.26

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

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

위험액	151.85