

# 유진인덱스알파증권(주식-파생형)

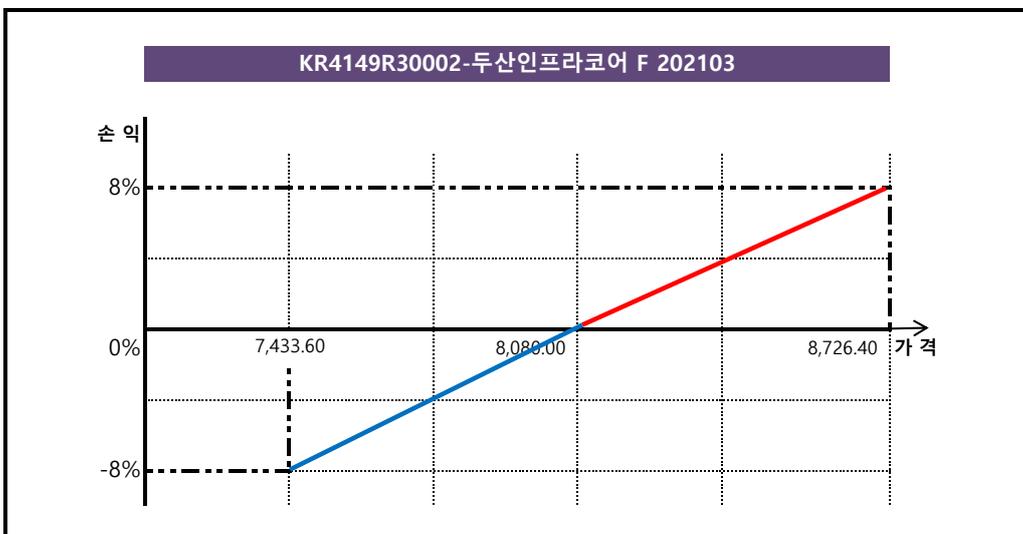
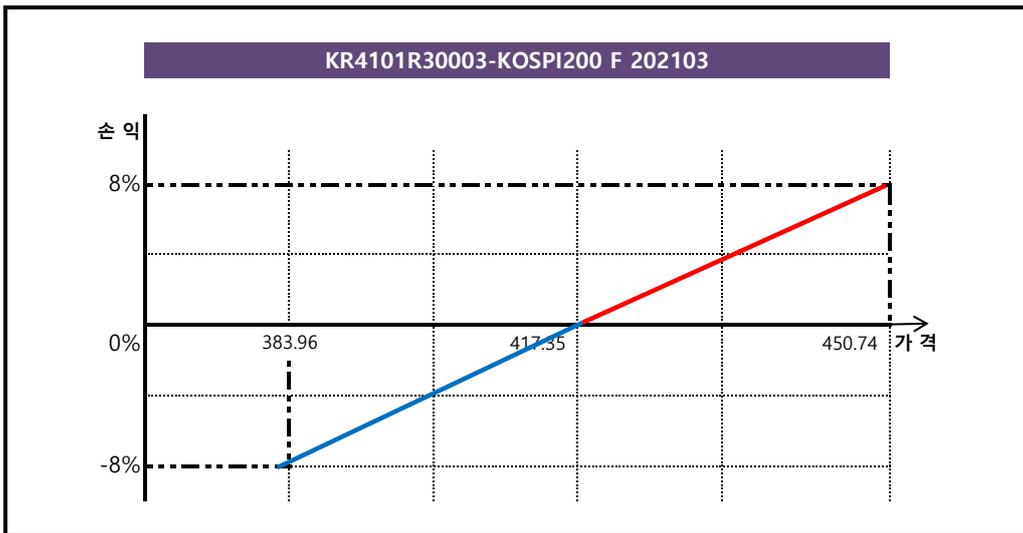
공시일 : 2021-02-19

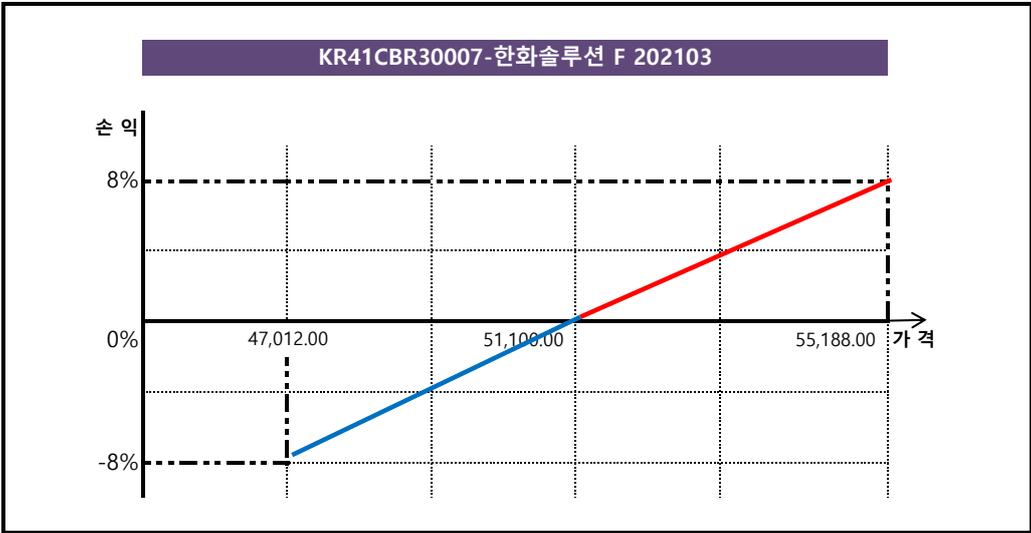
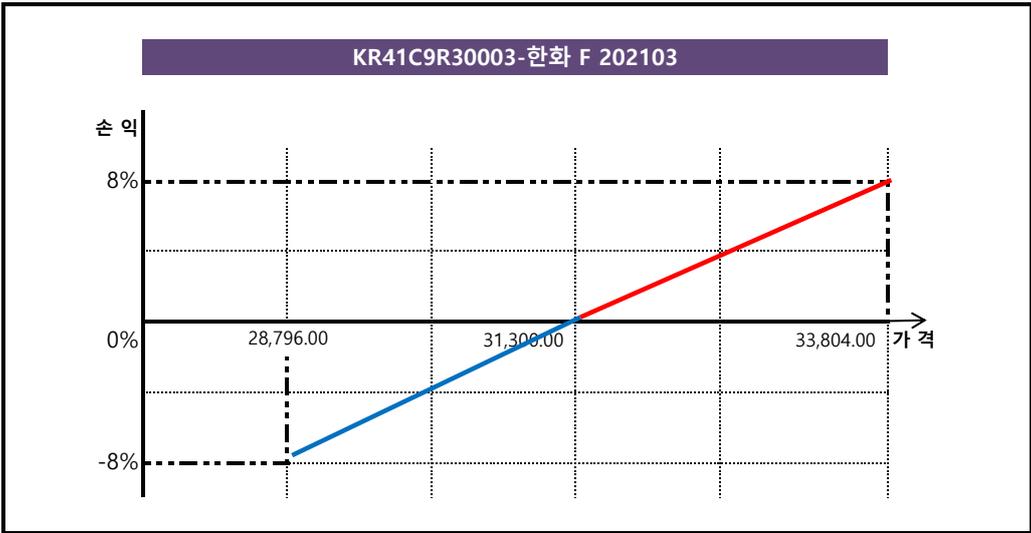
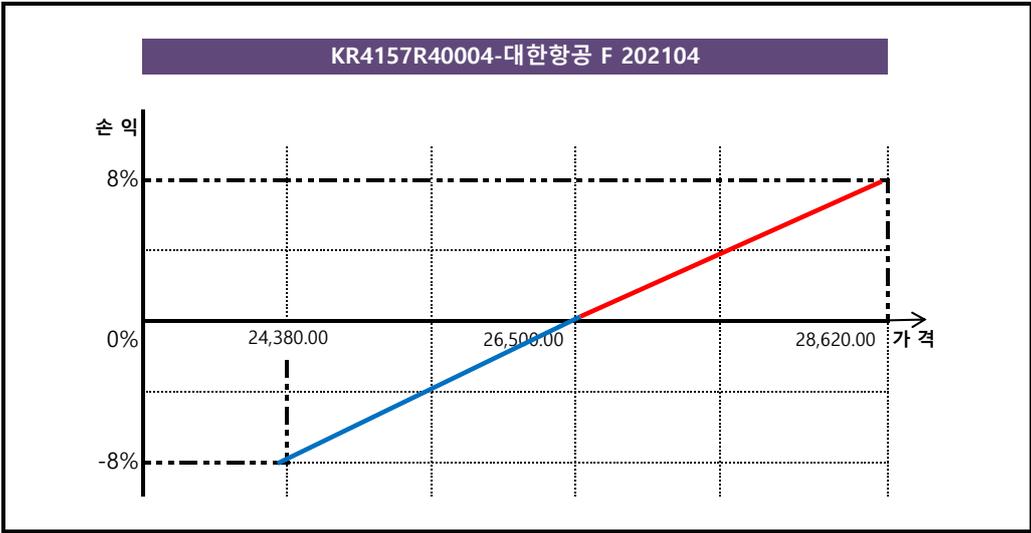
## 1. 계약금액

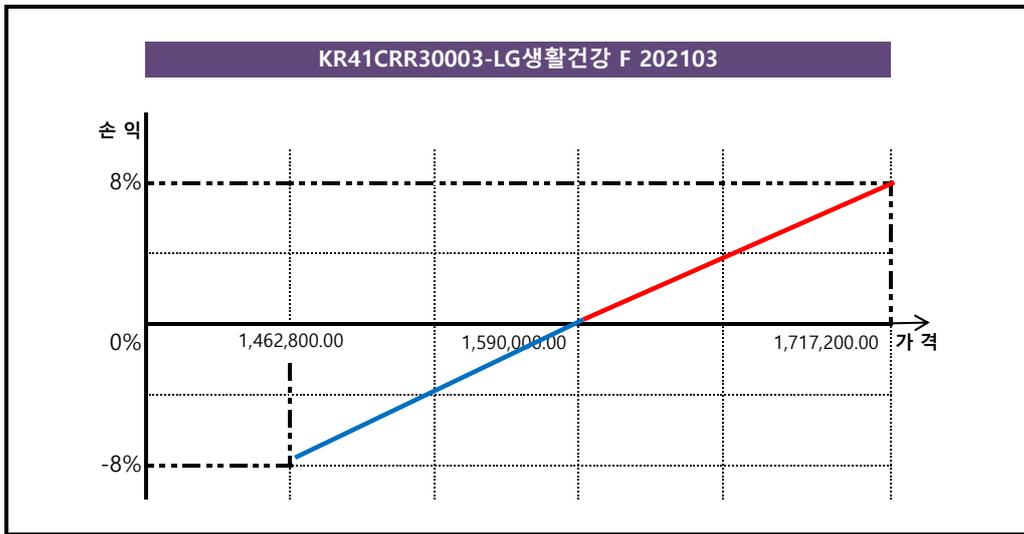
단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	24.97	0.00	24.97	장내
누계	유가증권	선물	1,175.86	0.00	1,175.86	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%	91.82
	5.33%	61.17
	2.67%	30.64
	0%	0.00
	-2.67%	-30.64
	-5.33%	-61.17
	-8%	-91.82
최대손실 시나리오 위험액		91.82

KR4149R30002-두산인프라코어 F 202103

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	0.11
	5.33%	0.07
	2.67%	0.04
	0%	0.00
	-2.67%	-0.04
	-5.33%	-0.07
	-8%	-0.11
최대손실 시나리오 위험액		0.11

KR4157R40004-대한항공 F 202104

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	0.25
	5.33%	0.17
	2.67%	0.08
	0%	0.00
	-2.67%	-0.08
	-5.33%	-0.17
	-8%	-0.25

최대손실 시나리오 위험액	0.25
---------------	------

KR41C9R30003-한화 F 202103

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	0.13
	5.33%	0.08
	2.67%	0.04
	0%	0.00
	-2.67%	-0.04
	-5.33%	-0.08
	-8%	-0.13

최대손실 시나리오 위험액	0.13
---------------	------

KR41CBR30007-한화솔루션 F 202103

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	0.49
	5.33%	0.33
	2.67%	0.16
	0%	0.00
	-2.67%	-0.16
	-5.33%	-0.33
	-8%	-0.49

최대손실 시나리오 위험액	0.49
---------------	------

KR41CRR30003-LG생활건강 F 202103

구분		시나리오
기초자산 시나리오	8%	1.27
	5.33%	0.85
	2.67%	0.42
	0%	0.00
	-2.67%	-0.42
	-5.33%	-0.85
	-8%	-1.27

최대손실 시나리오 위험액	1.27
---------------	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (VaR)

(단위:백만원)

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

위험액	155.06
-----	--------