# 유진인덱스알파증권(주식-파생형)

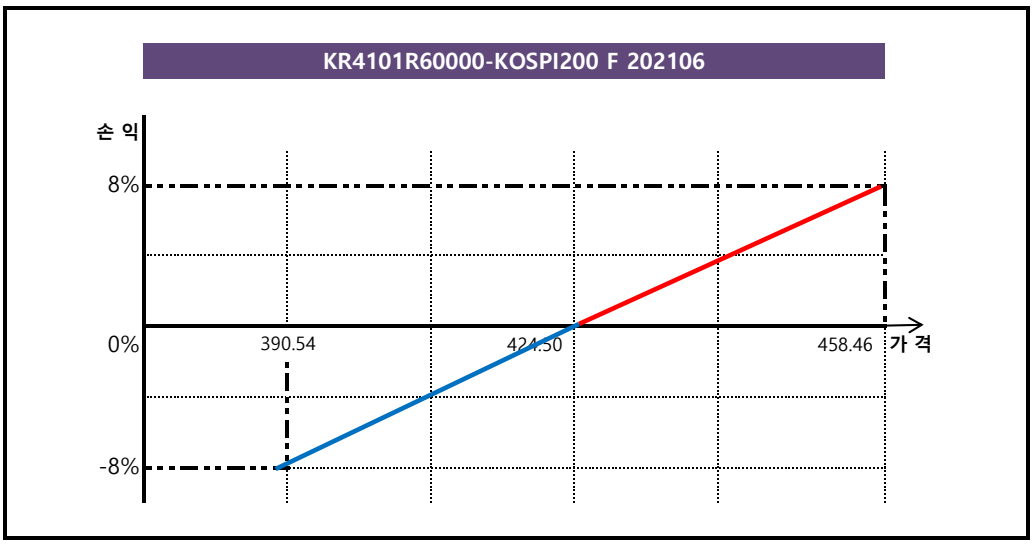
공시일 : 2021-04-09

## 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 | 1,167.37 | 0.00 | 1,167.37 | 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)

KR4101R60000-KOSPI200 F 202106

| 구분 | | 시나리오 |
|---|---|---|
| 기초자산 시나리오 | 8% | 93.39 |
| | 5.33% | 62.22 |
| | 2.67% | 31.17 |
| | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -31.17 |
| | -5.33% | -62.22 |
| | -8% | -93.39 |

| 최대손실 시나리오 위험액 | 93.39 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (VaR)

(단위:백만원)

(99%신뢰수준, 10일기준 적용)

| 위험액 | 142.42 |
|---|---|