

TRUE 코스피 커버드콜 ETN B (570020)



*본 상품은 TRUE 코스피 커버드콜 ETN(570001)과 기초지수 및 구조가 동일한 상품으로, 만기가 연장된 상품입니다.

투자목적

TRUE 코스피 커버드콜 ETN은 커버드콜 전략(코스피선물 매수 + 5% 외가격 콜옵션 매도)을 이용하여 코스피 선물 상승률에 매월 옵션 프리미엄만큼의 초과수익이 달성되는 상품입니다. 지수 급등 시는 일정 수준에서 수익이 한정되므로 코스피200지수의 완만한 상승이나 박스권을 예상할 때 투자하기 적합한 상품입니다. 지수 하락 시는 옵션 프리미엄만큼 손실이 제한됩니다.

기초지수

지수명칭	코스피 커버드콜 5% OTM 선물지수
산출기관	한국거래소
기초지수 기준시점	2013.1.2
기초지수 기준값	1,000pt
기초지수 리밸런싱	매월 지수옵션 만기일

기본정보

ETN 상장일	2017.08.25
ETN 만기평가일	2027.05.12
ETN 만기지급일	2027.05.19
ETN 발행가격	10,000원
ETN 발행수량	1,000,000주
ETN 분배금	미지급
ETN 제비용	연 0.57%

거래정보

상장거래소	한국거래소
종목명	TRUE 코스피 커버드콜 ETN B
종목코드	570020
블룸버그 티커(ETN)	570020 KS Equity
블룸버그 티커(기초지수)	KOSPLFSC INDEX
거래단위	1주
일 평균 거래량(상장 이후)	65,178주
일 평균 거래대금(상장 이후)	67,493만원

* 상장지수증권(ETN)은 예금자보호법에 따라 예금보험공사가 보호하지 않으며, 원금의 손실이 발생할 수 있습니다. * 투자를 결정하기 전에 투자대상, 중도 상환 방법 및 보수 등에 관하여 (간이)투자설명서를 반드시 읽어보시기 바랍니다. * 당사는 이 금융투자상품에 관하여 충분히 설명할 의무가 있으며, 투자자는 투자에 앞서 반드시 영업직원으로 부터 충분한 설명을 듣고 투자결정을 내리시기 바랍니다. * 과거의 운용실적이 미래의 수익을 보장하는 것이 아닙니다. * 상장지수증권(ETN)은 파생결합증권으로 단기간에 투자원금의 전부 또는 상당부분을 잃을 수 있으며, 발행사(한국투자증권, 신용등급 AA (한국기업평가/한국신용평가 2017.06.23기준))의 부도 또는 파산 시 투자원금의 회수가 불가능할 수 있습니다. * AAA/AA.A.BBB 각 +, O, - 순으로 투자적격등급 구분 * 상장지수증권(ETN)의 시장가격은 시장에서 투자자의 수요와 공급에 의해 형성되므로, 추적대상인 기초지수의 가격과 일치하지 않을 수 있으므로, 괴리를 및 지표가치를 확인하시기 바랍니다. * TRUE코스피커버드콜ETN B의 제비용은 연0.57%(운용 0.25%, 기초지수 이용비용 0.24%, 일반사무 0.03%, 기타 0.05%)이며, 영업점계좌의 온라인 거래의 경우 0.127865%+1,500원(3백만원 이상~3천만원 미만)의 거래수수료가 부과되며, 기타수수료에 관한 사항은 당사 홈페이지를 참고하시기 바랍니다.

기초지수 및 ETN 성과

2018.03.31 기준 (%)

기초지수·ETN	1M	3M	6M	1Y	상장 이후
기초지수	1.13	-2.42	0.65	-	2.46
ETN 지표가치	1.08	-2.55	0.38	-	2.11
ETN	1.18	-2.28	0.98	-	2.29

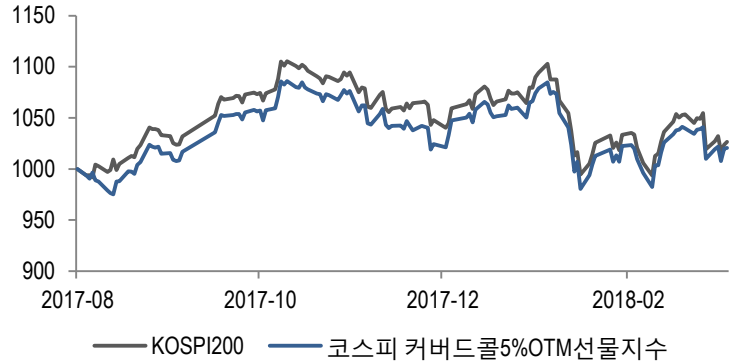
비교지수

KOSPI200	0.56	-3.12	-0.52	-	2.64
----------	------	-------	-------	---	------

*과거의 운용실적이 미래의 수익을 보장하는 것이 아닙니다.

기초지수 추이

(상장일 2017.08.25 = 1,000)



기초지수 구성종목

2018.03.31 기준

구성종목	
선물매수	F 201806
콜옵션 매도	C 201804 332.5 C 201804 330.0

* 4월 코스피옵션 만기일 증가 기준 5% 외가격 2018.5월 콜옵션 으로 교체

투자 안내사항

- 본 ETN은 보유기간과세 대상 상품으로서, 본 ETN 보유기간 중 발생한 이익(매매차익과 과표준분 중 적은 금액)에 대하여 배당소득세가 적용됩니다. (단, 국내상장주식 및 주식관련 장내파생상품에서 발생한 이익은 비과세)
- ETN 증가는 15시 30분에 형성되므로 기초지수 증가 형성 시점과 시차가 발생하는 경우 ETN 일간 수익률과 기초지수 일간 수익률 간 괴리가 발생할 수 있습니다. 기초지수 성과에는 ETN제비용이 반영되어 있지 않으며, 제비용이 반영된 성과는 ETN 지표가치로 확인할 수 있습니다. 본 안내문에서 언급된 기초지수 및 ETN 과거의 수익률이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다.