

TRUE ETN 실전투자대회 투자대상 종목 안내 (2017.12.14 기준)



구분	종목코드	종목명	상품 특징
한국	570020	TRUE 코스피 커버드콜 ETN	<ul style="list-style-type: none"> KOSPI200 5% OTM 커버드콜 전략 KOSPI200선물 매수 + 5% OTM 콜옵션 매도 KOSPI200선물 상승률에 5% 외가격 콜옵션 프리미엄이 추가로 달성됨
	570021	TRUE 코스피 커버드풋 ETN	<ul style="list-style-type: none"> KOSPI200 5% OTM 커버드풋 전략 KOSPI200선물 매도 + 5% OTM 풋옵션 매도 KOSPI200선물 하락률에 5% 외가격 풋옵션 프리미엄이 추가로 달성됨
	570005	TRUE 목표변동성20 코스피선물 ETN	<ul style="list-style-type: none"> 목표변동성20 전략에 따라, KOSPI200지수의 연간 변동성을 20%가 되도록 투자비중 조절 20/VKOSPI지수_{t-2} 만큼 KOSPI200선물을 매수하되 최대 매수 비중을 1.5배, 최소 0.5배로 조절 변동성이 낮은 장에서는 최대 1.5배 레버리지, 변동성이 높은 장에서는 0.5배 디레버리지 효과 창출
	570003	TRUE 빅5 동일가중 ETN	<ul style="list-style-type: none"> 한국 유가증권시장을 대표하는 코스피 종목 유통시가총액 기준 최상위 5종목에 대해 동일가중 투자 매 분기 말 기준으로 유동주식기준 시가총액 최상위 5종목에 대하여 1,4,7,10월 옵션만기일 익일부터 5일간 동일비중(20%씩)으로 리밸런싱을 수행
	570009	TRUE 코리아 프리미어 ETN	<ul style="list-style-type: none"> 미국 달러로 글로벌 시가총액 기준 업종별 상위 10위 이내에 속한 국내 주식에 투자 동일 업종으로 분류되는 해외 기업들과 비교해 상위 10위 이내의 종목들은 글로벌 경쟁력을 갖춘 종목들로 이를 투자하여 국내 우량 기업에 분산투자한 효과 향유 분기별 리밸런싱 수행
미국	570022	TRUE 레버리지 S&P500 선물 ETN(H)	<ul style="list-style-type: none"> E-mini S&P500 최근월 선물 등락률에 2배로 연동되며, 투자원금 전체로 미국 단기채권금리로 재투자 E-mini S&P500 선물은 3,6,9,12월물이 존재하며, 최종거래일은 계약월 3번째 금요일로 최종거래일로부터 5영업일 전에 차월물로 리밸런싱을 수행
	570023	TRUE 인버스2X S&P500 선물 ETN(H)	<ul style="list-style-type: none"> E-mini S&P500 최근월 선물 등락률에 -2배로 연동되며, 투자원금 전체로 미국 단기채권금리로 재투자 E-mini S&P500 선물은 3,6,9,12월물이 존재하며, 최종거래일은 계약월 3번째 금요일로 최종거래일로부터 5영업일 전에 차월물로 리밸런싱을 수행
중국	570006	TRUE 인버스 차이나H ETN(H)	<ul style="list-style-type: none"> 차이나H(HSCEI)지수 등락률 -1배 추종 HSCEI지수는 홍콩증권거래소에 상장된 중국 기반 우량주(H주) 40개의 종목으로 구성된 지수로, 이 HSCEI지수의 일일등락률을 -1배로 추종함 100% 핫헤지
유럽	570004	TRUE 인버스 유로스탁스50 ETN(H)	<ul style="list-style-type: none"> EUROSTOXX50지수 등락률 -1배 추종 EUROSTOXX50지수는 12개 유로존 국가들의 50개블루칩 종목으로 구성된 지수로, 이 EUROSTOXX50지수의 일일등락률을 -1배로 추종함 100% 핫헤지
환율	570011	TRUE 레버리지 엔선물 ETN	<ul style="list-style-type: none"> 한국거래소에 상장된 엔선물(JPY/KRW) 일일등락률 2배 추종 엔선물 매수 포지션으로 엔선물 상승률의 2배의 수익이 발생하며 하락 시 2배의 손실 발생 엔선물이란 엔/원 환율 변동위험을 피하기 위하여 거래하는 선물로 엔/원 재정환율과 유사한 움직임을 보임
	570012	TRUE 인버스 엔선물 ETN	<ul style="list-style-type: none"> 한국거래소에 상장된 엔선물(JPY/KRW) 일일등락률 -1배 추종 엔선물 매도 포지션으로 엔선물 하락 시 수익이 발생하며 상승 시 손실 발생 엔선물이란 엔/원 환율 변동위험을 피하기 위하여 거래하는 선물로 엔/원 재정환율과 유사한 움직임을 보임

TRUE ETN 실전투자대회 투자대상 종목 안내 (2017.12.14 기준)



구분	종목코드	종목명	기초지수	구성종목(2017.12.14 기준)	배수	헤지	1m (%)	3m (%)	6m (%)	1Y (%)
한국	570020	TRUE 코스피 커버드콜 ETN B	코스피 커버드콜 5% OTM 선물지수 (지수코드 : 6601)	KOSPI200 F201803, C 201801 342.5, C 201801 340.0			-1.30	4.85	-	-
	570021	TRUE 코스피 커버드풋 ETN B	코스피 커버드풋 5% OTM 선물지수 (지수코드 : 6602)	KOSPI200 F201803, P 201801 310.0, P 201801 307.5			1.92	-3.58	-	-
	570005	TRUE 목표변동성20 코스피선물 ETN	코스피200 목표변동성20 선물지수 (지수코드 : 6715)	KOSPI200 F201803			-2.28	6.55	8.73	38.42
	570003	TRUE 빅5 동일가중 ETN	WISE BIG5 동일가중 TR지수 (6617)	삼성전자, POSCO, 현대차, SK하이닉스, 신한지주			-2.35	2.20	3.82	24.95
	570009	TRUE 코리아 프리미어 ETN	한경 WISE KR Premier지수 (지수코드 : 6632)	삼성전자, SK하이닉스, 넷마블게임즈, LG전자, POSCO, LG디스플레이, 엔씨소프트, NAVER 등 총 16종목			1.96	8.64	4.89	16.61
미국	570022	TRUE 레버리지 S&P500 선물 ETN(H)	S&P 500 Futures 2X Leveraged TR	E-mini S&P500 F 201712	2	H	7.76	-	-	-
	570023	TRUE 인버스2X S&P500 선물 ETN(H)	S&P 500 Futures 2X Inverse TR	E-mini S&P500 F 201712	-2	H	-7.01	-	-	-
중국	570006	TRUE 인버스 차이나H ETN(H)	HSCEI Short 지수	Ping An, ICBC, BOC, CCB, China Life, Sinopec Corp 등 총 40종목	-1	H	-0.99	-5.61	-14.11	-23.19
유럽	570004	TRUE 인버스 유로스탁스50 ETN(H)	Euro stoxx 50 Daily Short 지수	Total, Sanofi, Siemens, Bayer, SAP, Bco Santander 등 총 50종목	-1	H	-1.24	-2.44	-2.44	-15.26
환율	570011	TRUE 레버리지 엔선물 ETN	레버리지 엔선물지수	엔 F 201712	2		-4.08	-12.27	-13.15	-12.11
	570012	TRUE 인버스 엔선물 ETN	인버스 엔선물지수	엔 F 201712	-1		1.94	6.57	7.08	5.03