

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2019-11-21

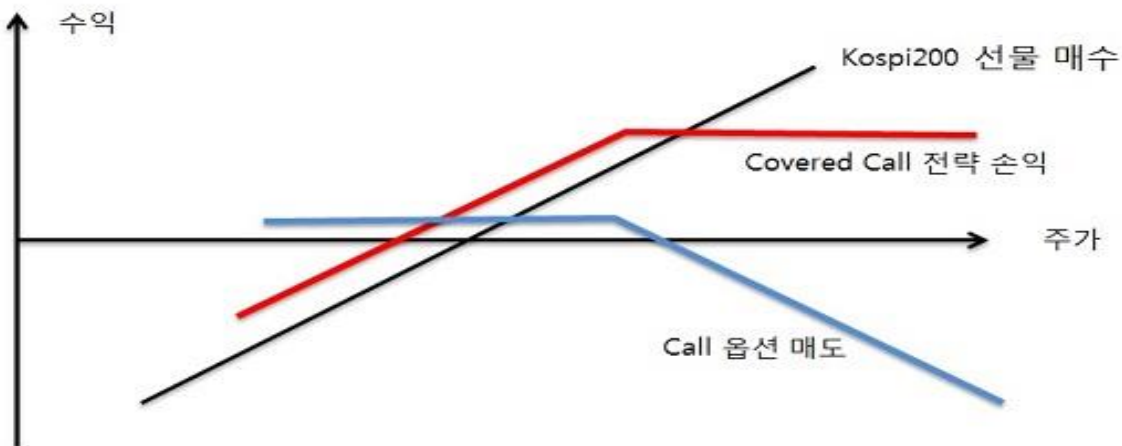
공시일: 2019-11-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 209 | 70 | 139 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 2,087 | 0 | 2,087 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 102 | -102 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 561 | 0 | 561 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 7 | 209 | -202 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 20 | 1,531 | -1,511 | 장내 |
| 합계 | | | 2,668 | 1,531 | 1,137 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



위 그림은 투자자의 이해를 돕기 위하여 Kospi200지수를 기초자산으로 하는 선물 매수와 콜옵션 매도를 활용한 커버드콜 전략을 단순화하여 표시한 것입니다.

이 투자신탁은 Kospi200지수를 추종하는 인덱스펀드로 Kospi200 선물을 주로 투자하나, Kospi200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 동 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

162

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

183

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2019-11-21

공시일: 2019-11-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 237 | 56 | 181 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 320 | 0 | 320 | 장내 |
| 합계 | | | 320 | 0 | 320 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



위 그림은 투자자의 이해를 돕기 위하여 레버리지 펀드 추종을 위한 KOSPI200지수를 기초자산으로 하는 선물 매수 그림을 단순화하여 표시한 것입니다.
이 투자신탁은 KOSPI200지수 일간수익률 2배를 추종하는 레버리지 펀드로 KOSPI200 선물에 주로 투자하나, KOSPI200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 등 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

20

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권HEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2019-11-21

공시일: 2019-11-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 669 | | 669 | 장외 |
| 합계 | | | 669 | | 669 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

51

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22