

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 540   | 1,404 | -864      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 2,809 | 0     | 2,809     | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션   | 8     | 540   | -532      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션   | 3     | 2,701 | -2,698    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 15    | -15       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 959   | 0     | 959       | 장내 |
| 합계 |      |      | 3,771 | 2,701 | 1,070     |    |

## 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

190

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

271

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 454   | 0     | 454       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 8,232 | 0     | 8,232     | 장내 |
| 합계 |      |      | 8,232 | 0     | 8,232     |    |

## 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 투자전략은 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

658

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

813

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

2021-04-28

## 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  | 5,984 |       | 5,984     | 장외 |
| 합계 |      |      | 5,984 |       | 5,984     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 2.25% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK환헤지지원화플러스지수연계증권HSK-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

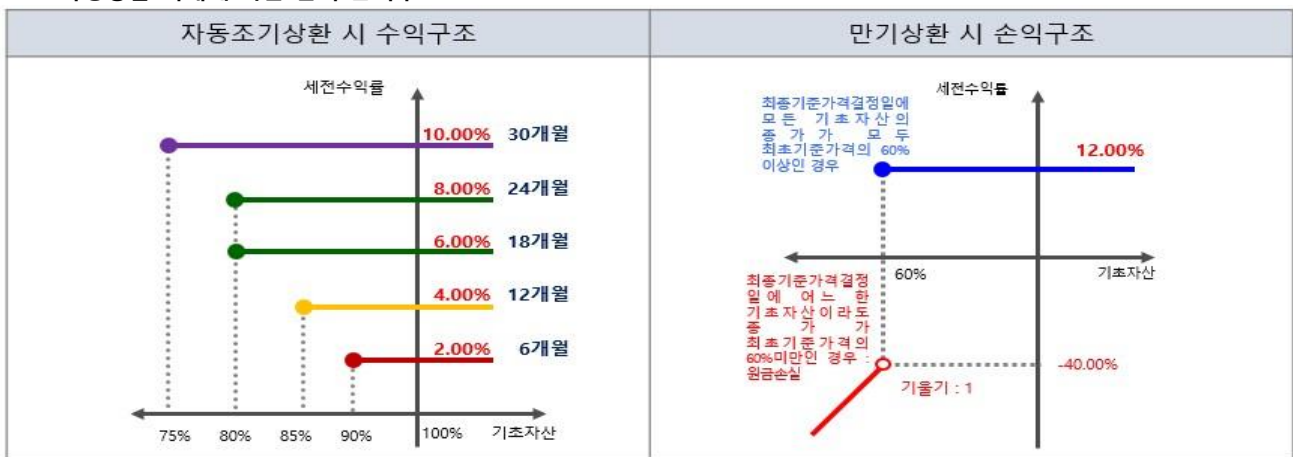
2021-04-28

## 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  | 5,074 |       | 5,074     | 장외 |
| 합계 |      |      | 5,074 |       | 5,074     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |   |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.00%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>60%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 1,160 |       | 1,160     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,160 |       | 1,160     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



|          |   |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.65%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK리자드환헤지원화플러스지수연계증권HSN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

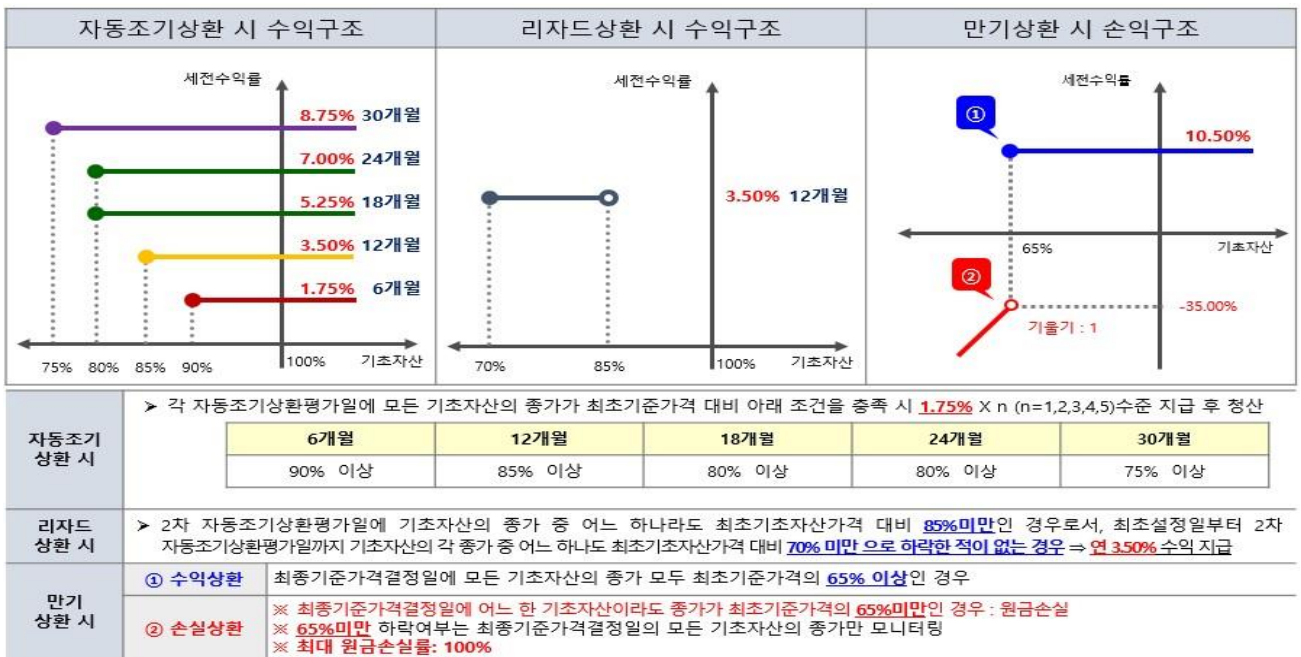
공시일: 2021-04-28

## 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  | 309   |       | 309       | 장외 |
| 합계 |      |      | 309   |       | 309       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

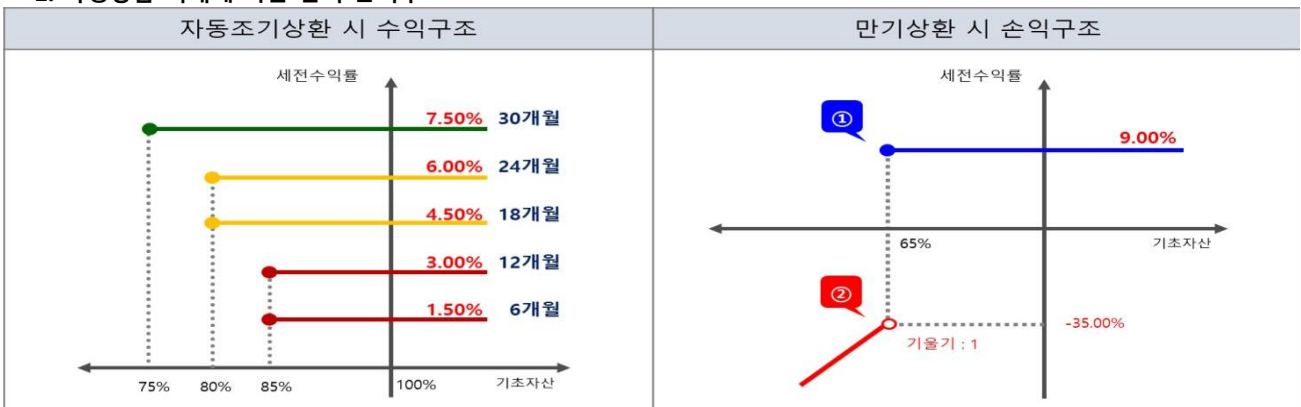
2021-04-28

## 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  | 145   |       | 145       | 장외 |
| 합계 |      |      | 145   |       | 145       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 **1.50%** X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산

| 자동조기상환 시 | 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
|          | 85% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

| 만기상환 시 | ① 수익상환   | ② 손실상환  |
|--------|--|---|
|        | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우 | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b>인 경우 : 원금손실</li> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul> |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

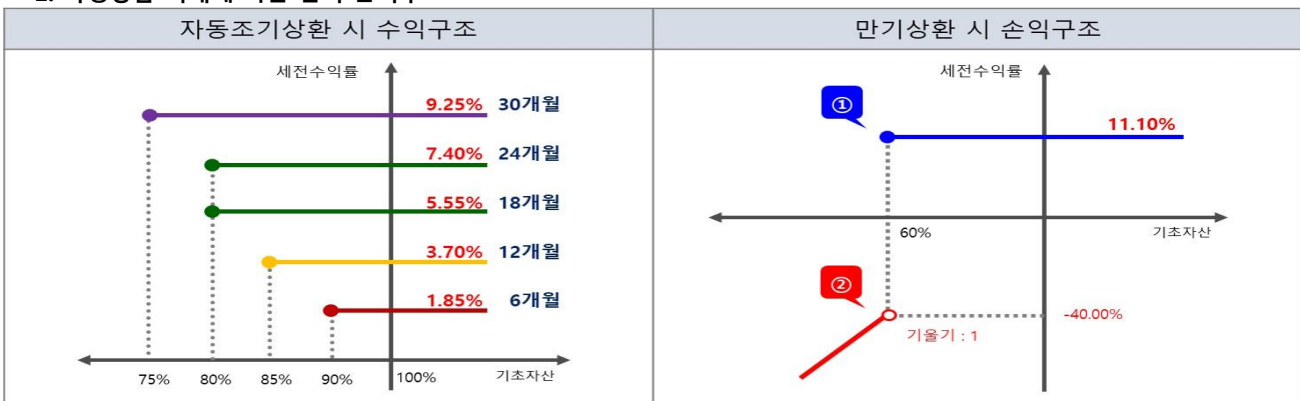
2021-04-28

## 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  | 1,737 |       | 1,737     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,737 |       | 1,737     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시  $1.85\% \times n$  (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산

| 자동조기상환 시 | 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
|          | 90% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

**① 수익상환** : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 **60% 이상**인 경우  
**② 손실상환** :
 

- ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 **60% 미만**인 경우 : 원금손실
- ※ **60% 미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링
- ※ **최대 원금손실률: 100%**

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

10

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK리자드환헤지원화플러스지수연계증권HSN-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 3,818 |       | 3,818     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,818 |       | 3,818     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조  | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |        |      |        |        |        |        |        |  |   |
|--|--------------|-------------|--------|--------|------|--------|--------|--------|--------|--------|--|---|
|  |              |             |        |        |      |        |        |        |        |        |  |   |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> <th>30개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월   | 30개월 | 90% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.15% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 :<br/>                     ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                     ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>                     ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월  | 12개월         | 18개월        | 24개월   | 30개월   |      |        |        |        |        |        |  |   |
| 90% 이상   | 85% 이상       | 80% 이상      | 80% 이상 | 75% 이상 |      |        |        |        |        |        |  |   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

54

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 252   |       | 252       | 장외 |
| 합계 |      |      | 252   |       | 252       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산

| 자동조기상환 시 | 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
|          | 90% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

|        |  |
|--------|--|
| ① 수익상환 | 최초기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우   |
| ② 손실상환 | ※ 최초기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실<br>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최초기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

4

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

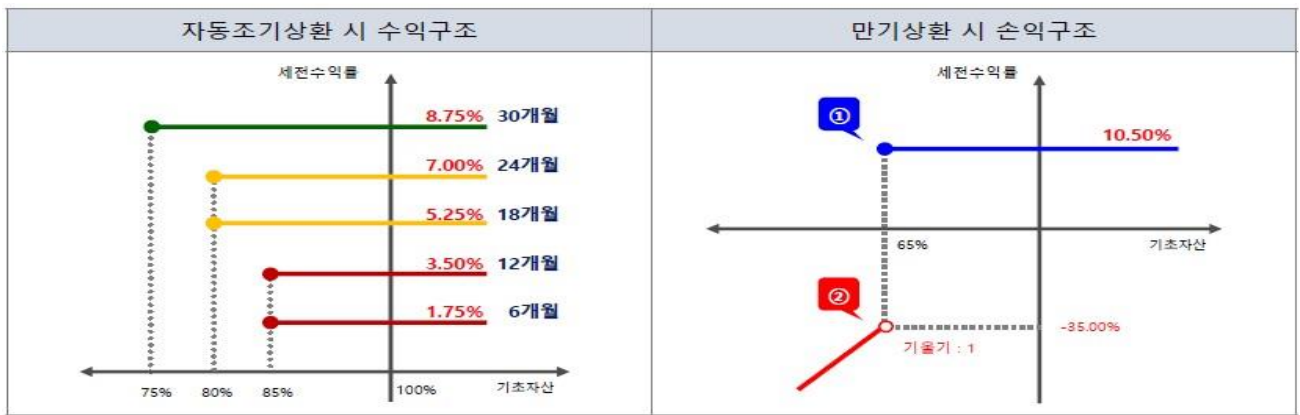
2021-04-28

## 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  | 4,292 |       | 4,292     | 장외 |
| 합계 |      |      | 4,292 |       | 4,292     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산

| 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|--------|--------|--------|--------|--------|
| 85% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

만기상환 시

① 수익상환: 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환: ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우: 현금손실  
 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링  
 ※ 최대 현금손실률: 100%

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

15

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-8호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

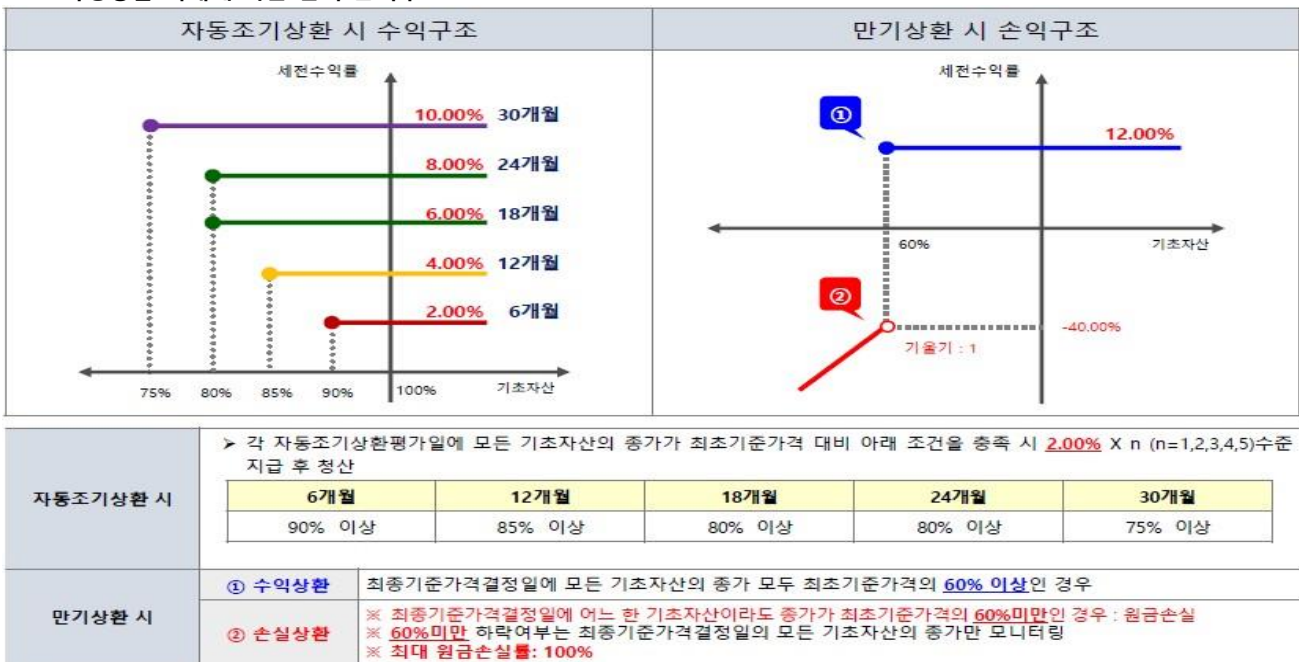
2021-04-28

## 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  | 3,022 |       | 3,022     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,022 |       | 3,022     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

47

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일:

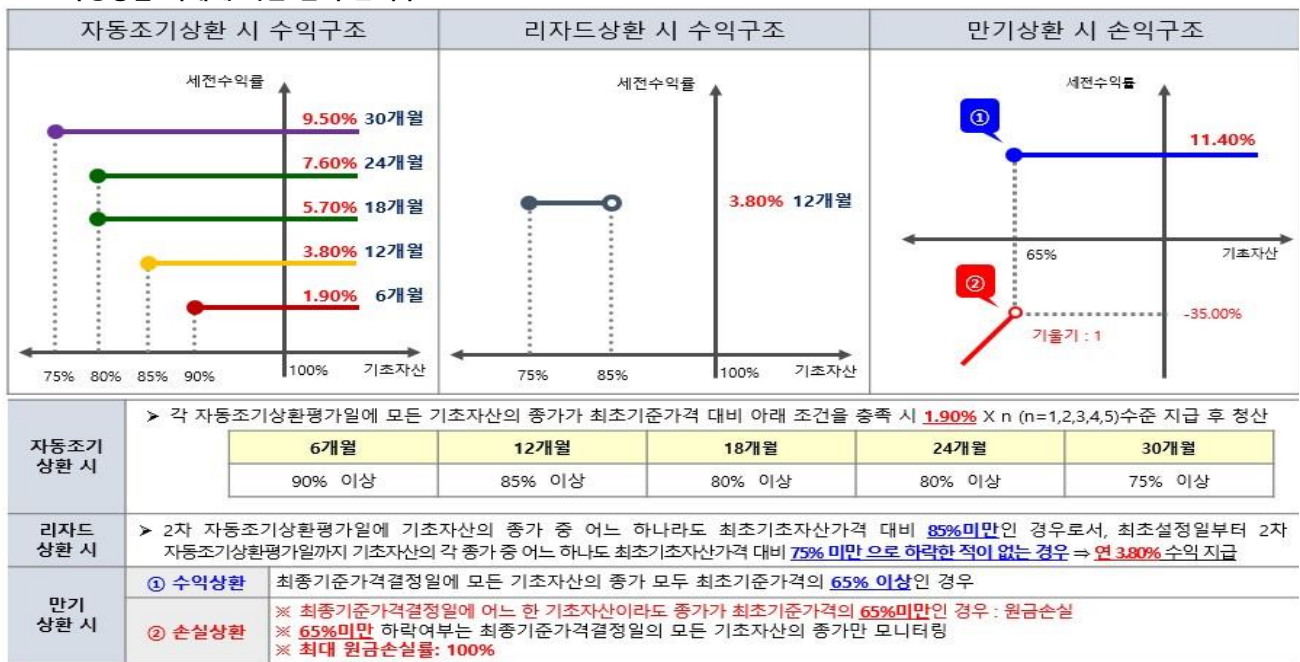
2021-04-28

## 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  | 4,020 |       | 4,020     | 장외 |
| 합계 |      |      | 4,020 |       | 4,020     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

70

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-10호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

## 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  | 373   |       | 373       | 장외 |
| 합계 |      |      | 373   |       | 373       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시  $1.80\% \times n$  (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산

| 자동조기상환 시 | 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
|          | 90% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

|        |   |
|--------|---|
| ① 수익상환 | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>60% 이상</b> 인 경우  |
| ② 손실상환 | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>60%미만</b>인 경우 : 원금손실</li> <li>※ <b>60%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul> |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

7

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)K-8호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

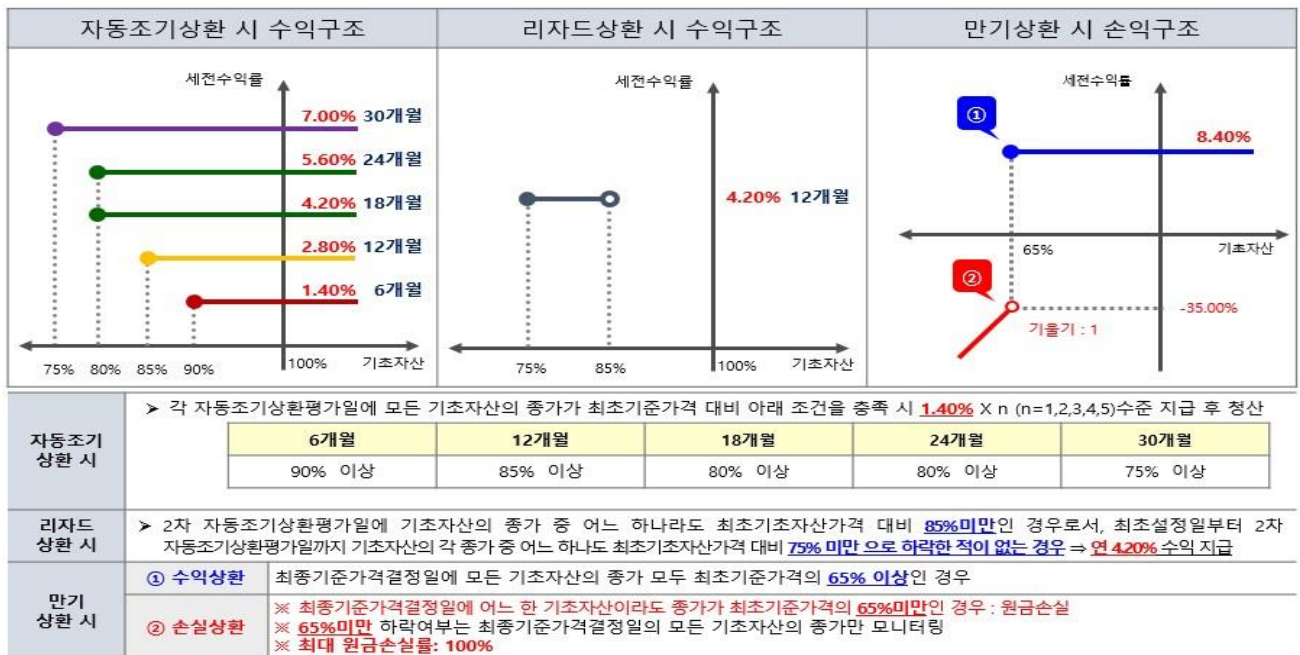
2021-04-28

## 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  | 622   |       | 622       | 장외 |
| 합계 |      |      | 622   |       | 622       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 1,269 |       | 1,269     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,269 |       | 1,269     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |  |        |        |        |
|----------|--|--|--------|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>1.60%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산 |  |        |        |        |
|          | 6개월  | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|          | 90% 이상   | 85% 이상   | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |
| 만기상환 시   | ① 수익상환   | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우   |        |        |        |
|          | ② 손실상환   | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실<br>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> |        |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

31

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 746   |       | 746       | 장외 |
| 합계 |      |      | 746   |       | 746       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조  | 리자드상환 시 수익구조  | 만기상환 시 손익구조  |        |        |      |        |        |        |        |        |  |  |
|--|---|--|--------|--------|------|--------|--------|--------|--------|--------|--|--|
| <p>세전수익률</p> <p>7.50% 30개월</p> <p>6.00% 24개월</p> <p>4.50% 18개월</p> <p>3.00% 12개월</p> <p>1.50% 6개월</p> <p>75% 80% 85% 90% 100% 기초자산</p>   | <p>세전수익률</p> <p>3.00% 12개월</p> <p>75% 85% 100% 기초자산</p> | <p>세전수익률</p> <p>9.00%</p> <p>65%</p> <p>기초자산</p> <p>-35.00%</p> <p>가율기 : 1</p> |        |        |      |        |        |        |        |        |  |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.50% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> <th>30개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월   | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월 | 90% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.00% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환<br/>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환<br/>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월  | 12개월  | 18개월   | 24개월   | 30개월   |      |        |        |        |        |        |  |  |
| 90% 이상   | 85% 이상  | 80% 이상   | 80% 이상 | 75% 이상 |      |        |        |        |        |        |  |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-12호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

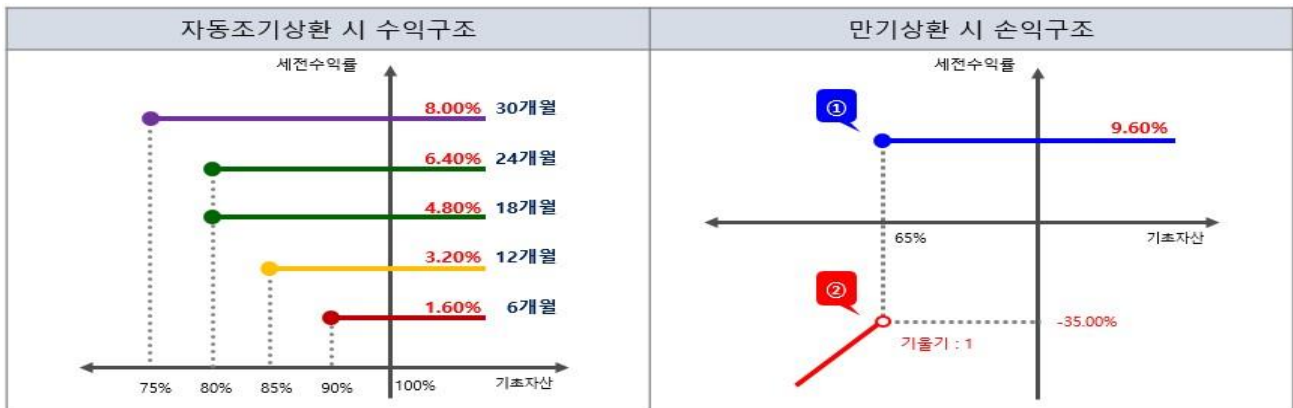
2021-04-28

## 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  | 1,562 |       | 1,562     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,562 |       | 1,562     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |  |        |        |        |
|----------|--|--|--------|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>1.60%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산 |  |        |        |        |
|          | 6개월  | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|          | 90% 이상   | 85% 이상   | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |
| 만기상환 시   | ① 수익상환   | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우   |        |        |        |
|          | ② 손실상환   | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실<br>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> |        |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

43

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

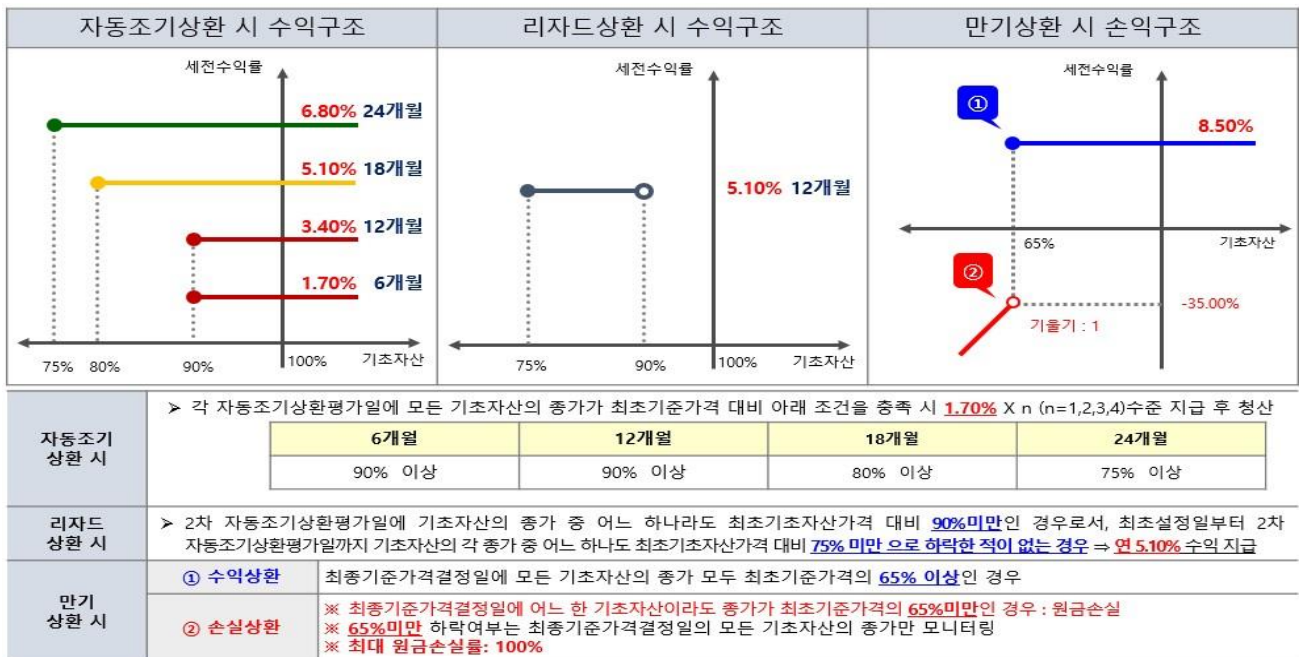
2021-04-28

## 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  | 5,039 |       | 5,039     | 장외 |
| 합계 |      |      | 5,039 |       | 5,039     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

126

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

9

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

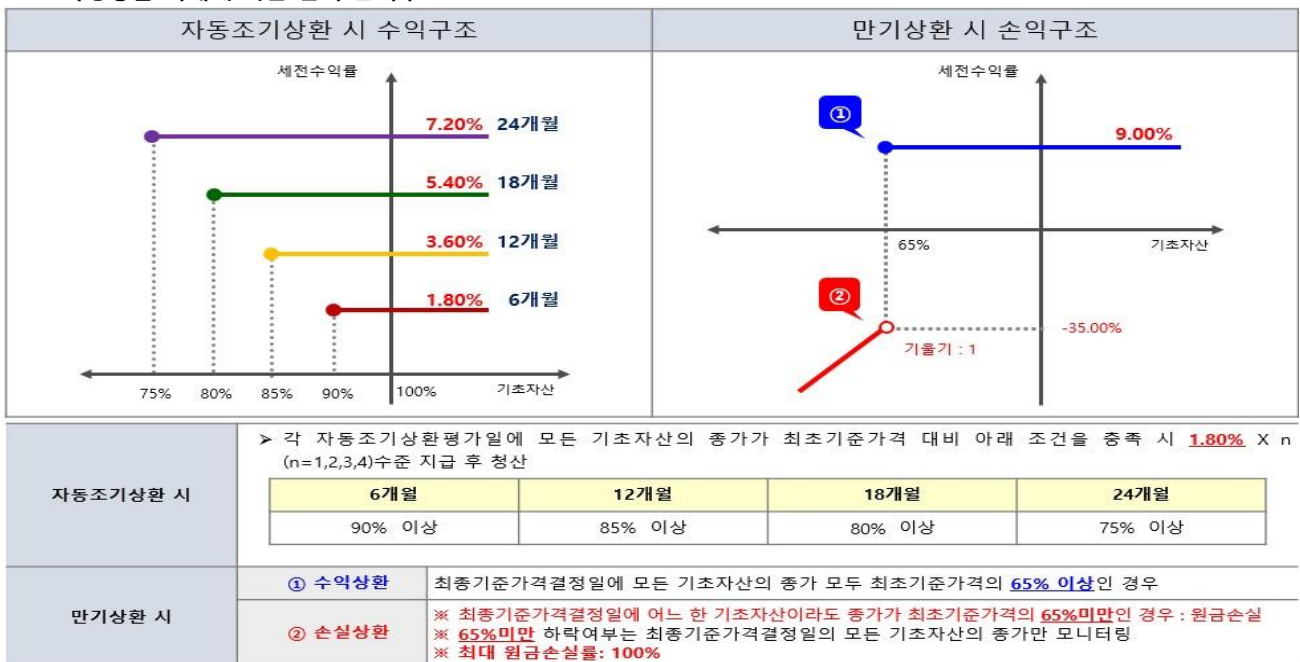
2021-04-28

## 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  | 5,679 |       | 5,679     | 장외 |
| 합계 |      |      | 5,679 |       | 5,679     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

160

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-10호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

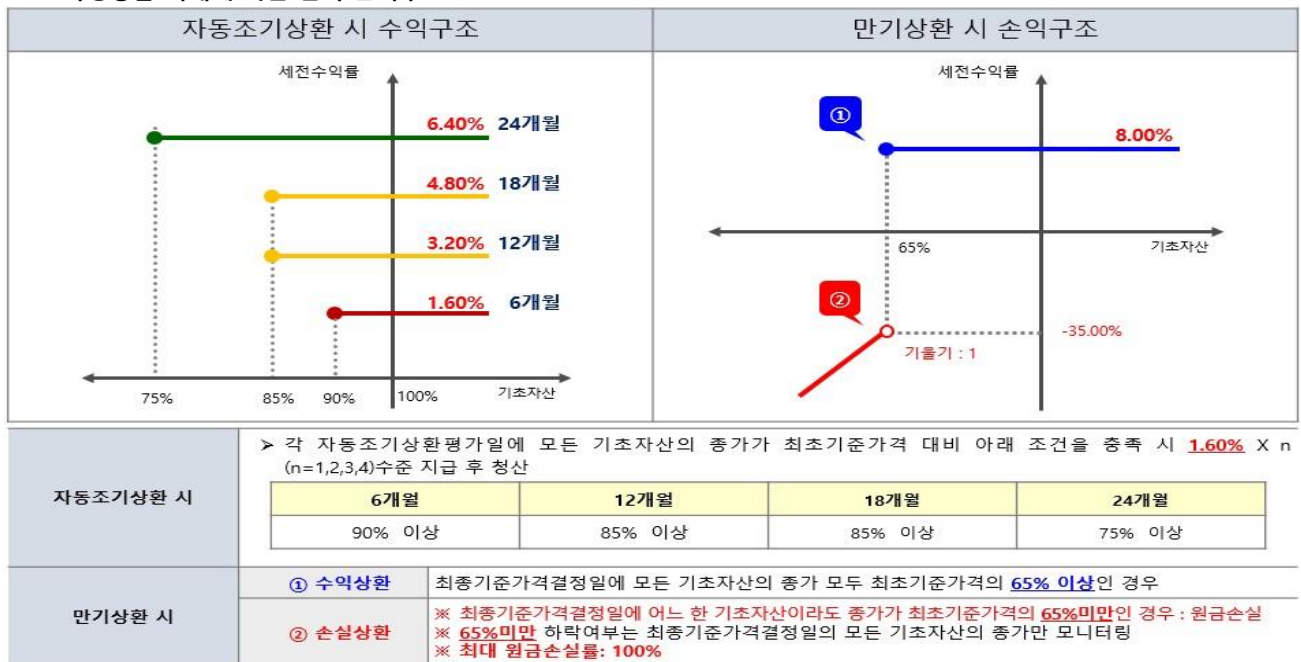
2021-04-28

## 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  | 489   |       | 489       | 장외 |
| 합계 |      |      | 489   |       | 489       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-17호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

2021-04-28

## 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  | 4,216 |       | 4,216     | 장외 |
| 합계 |      |      | 4,216 |       | 4,216     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환<br/>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환<br/>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

122

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

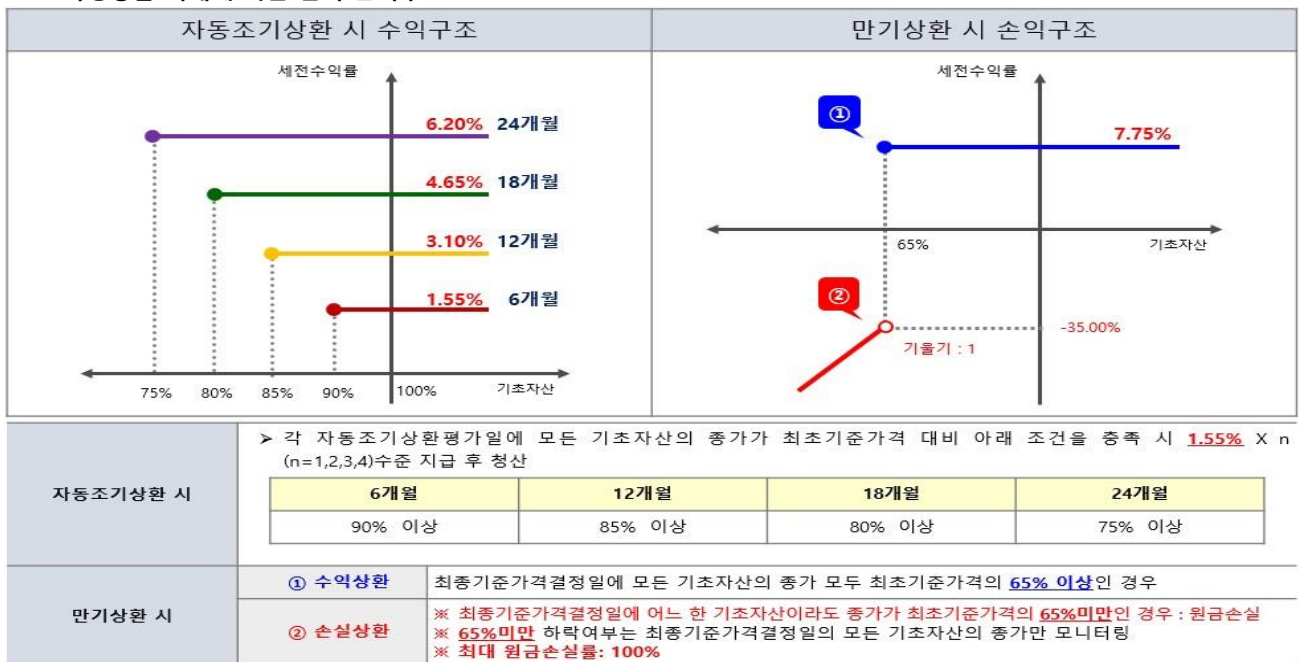
2021-04-28

## 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  | 592   |       | 592       | 장외 |
| 합계 |      |      | 592   |       | 592       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-18호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

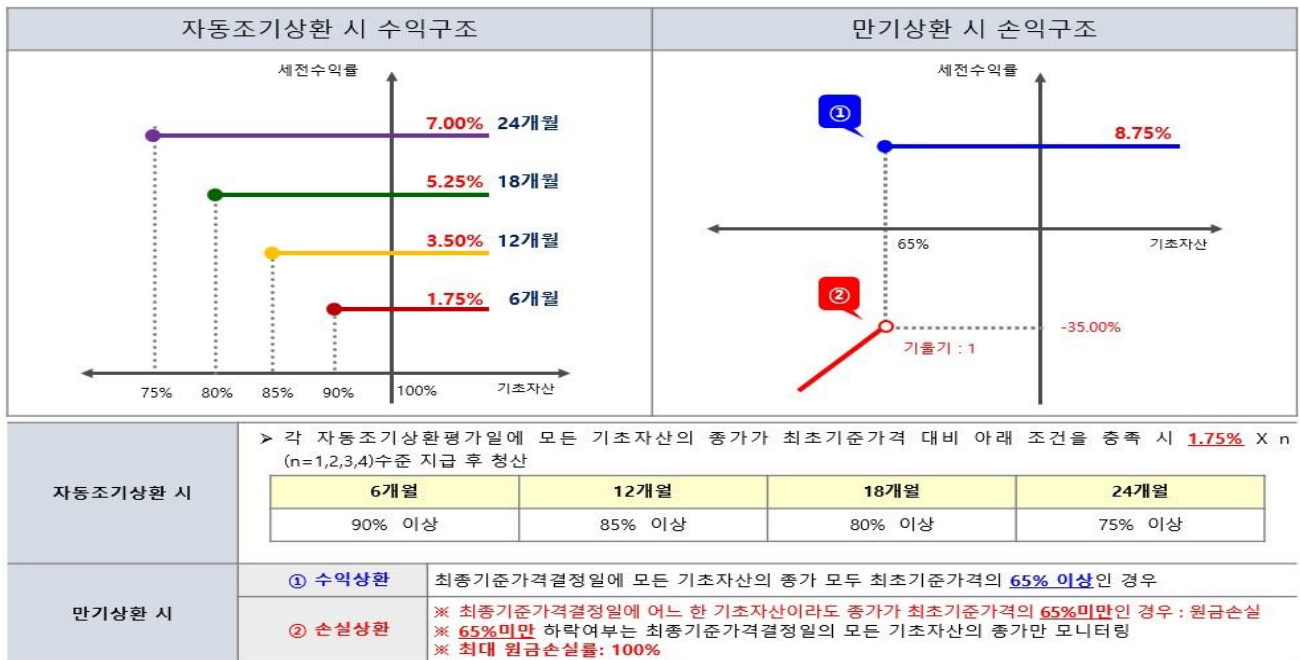
2021-04-28

## 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  | 5,868 |       | 5,868     | 장외 |
| 합계 |      |      | 5,868 |       | 5,868     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

191

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

16

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-19호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

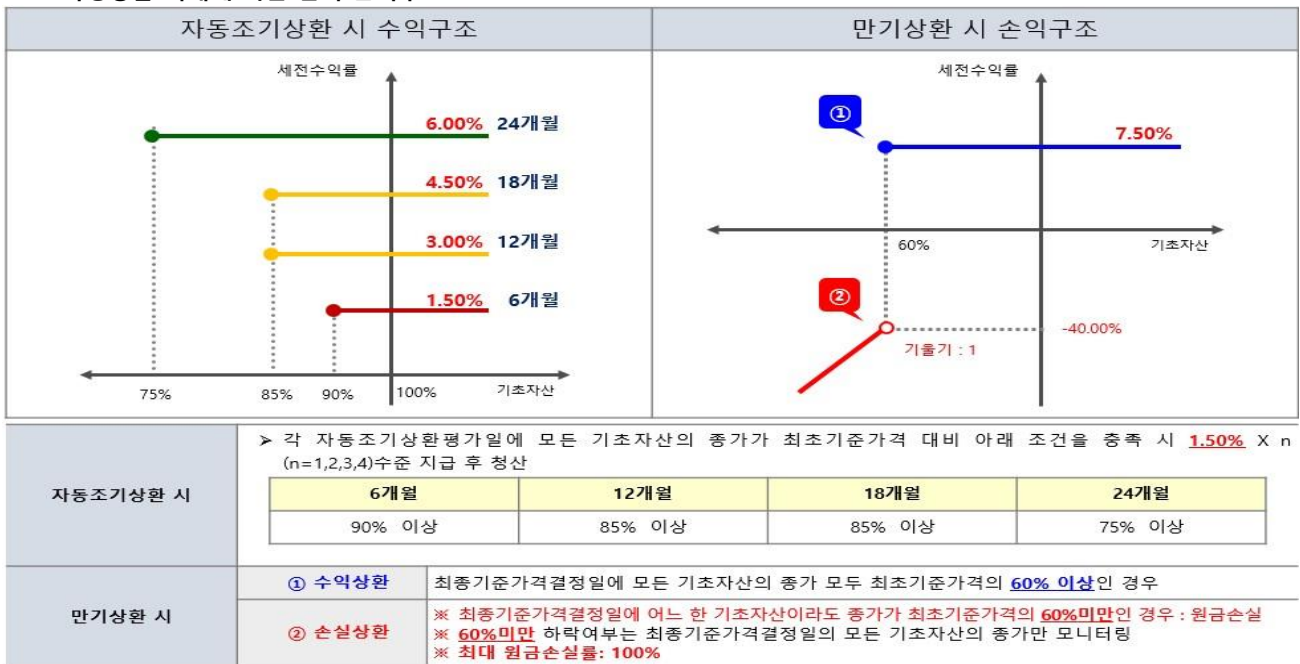
2021-04-28

## 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  | 2,494 |       | 2,494     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,494 |       | 2,494     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

72

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-20호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

2021-04-28

## 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  | 3,198 |       | 3,198     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,198 |       | 3,198     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환<br/>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환<br/>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

119

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-21호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

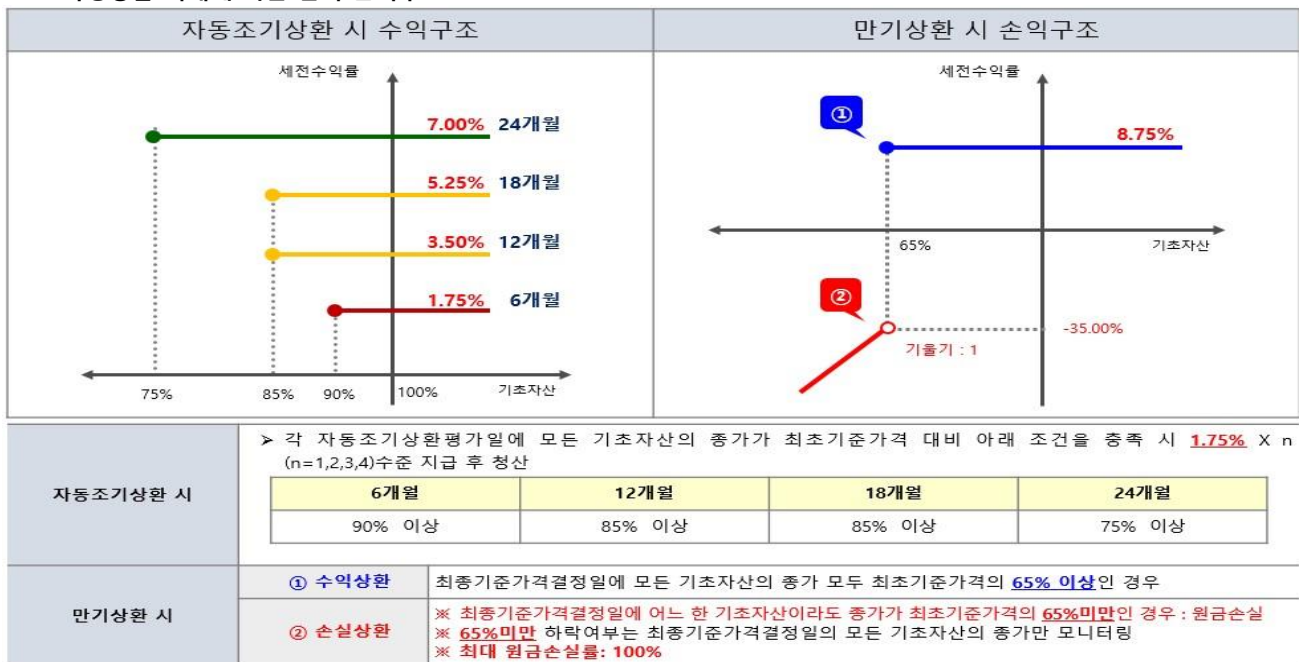
2021-04-28

## 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  | 1,444 |       | 1,444     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,444 |       | 1,444     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

60

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

19

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-22호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

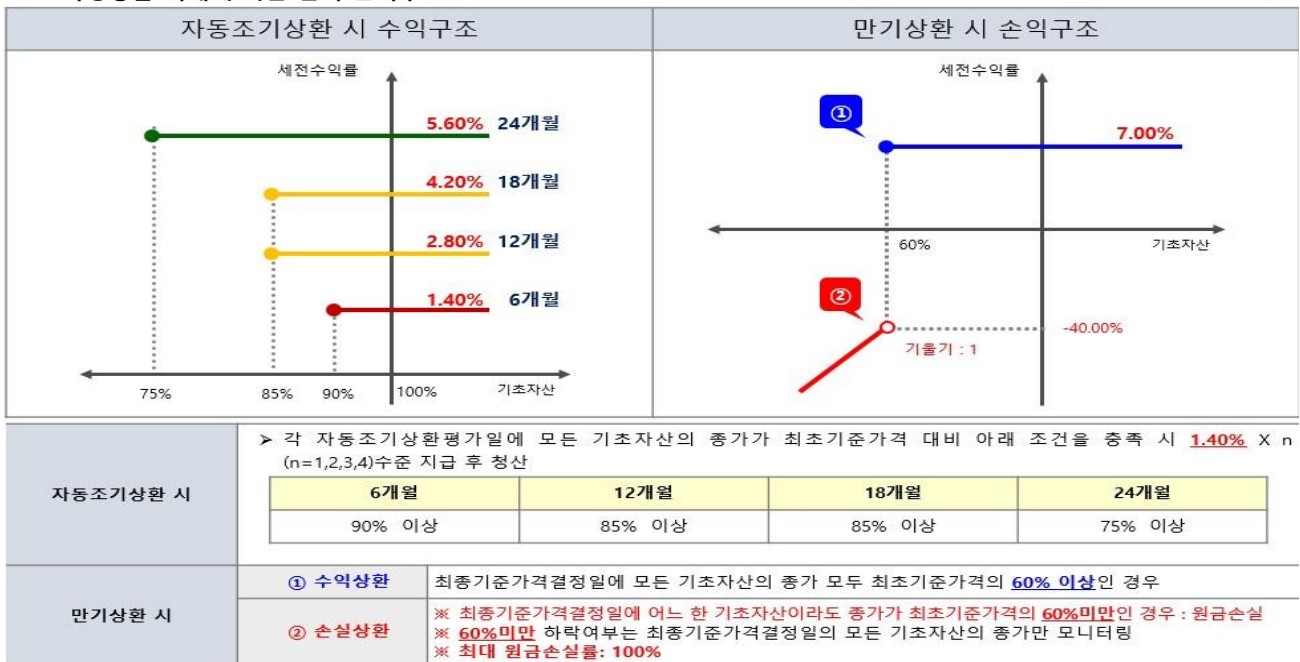
2021-04-28

## 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  | 216   |       | 216       | 장외 |
| 합계 |      |      | 216   |       | 216       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

8

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-12호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

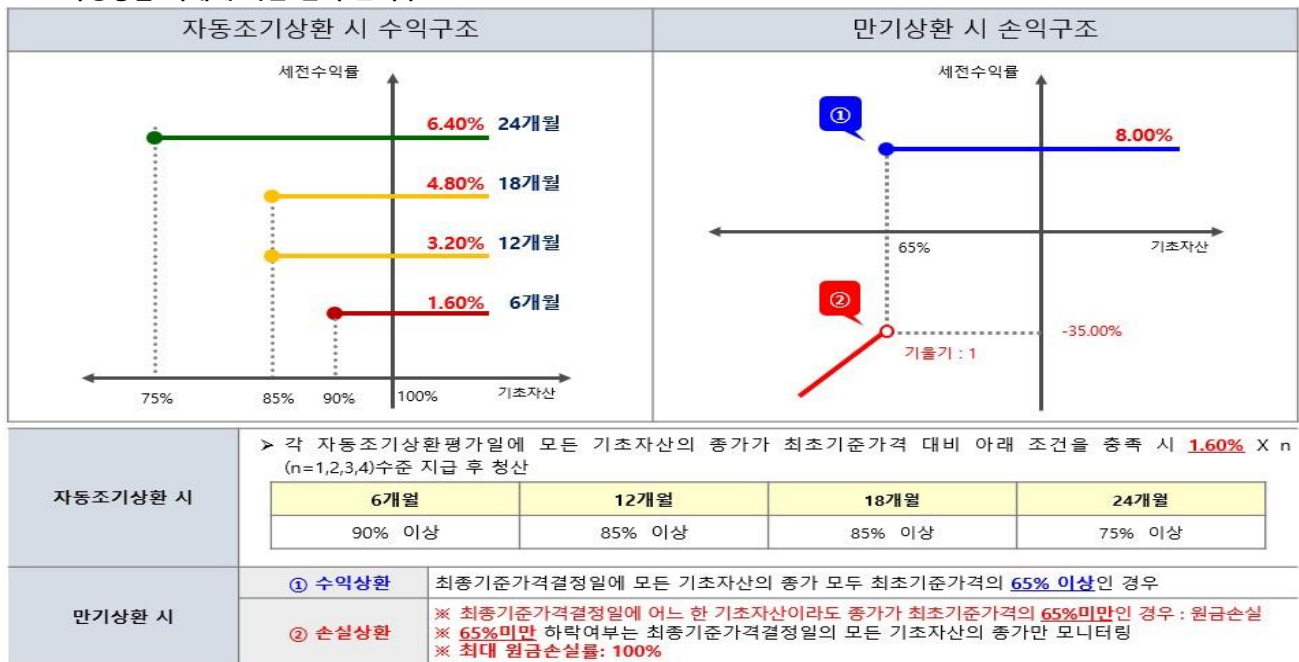
2021-04-28

## 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  | 589   |       | 589       | 장외 |
| 합계 |      |      | 589   |       | 589       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-23호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

2021-04-28

## 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  | 1,941 |       | 1,941     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,941 |       | 1,941     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환<br/>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환<br/>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

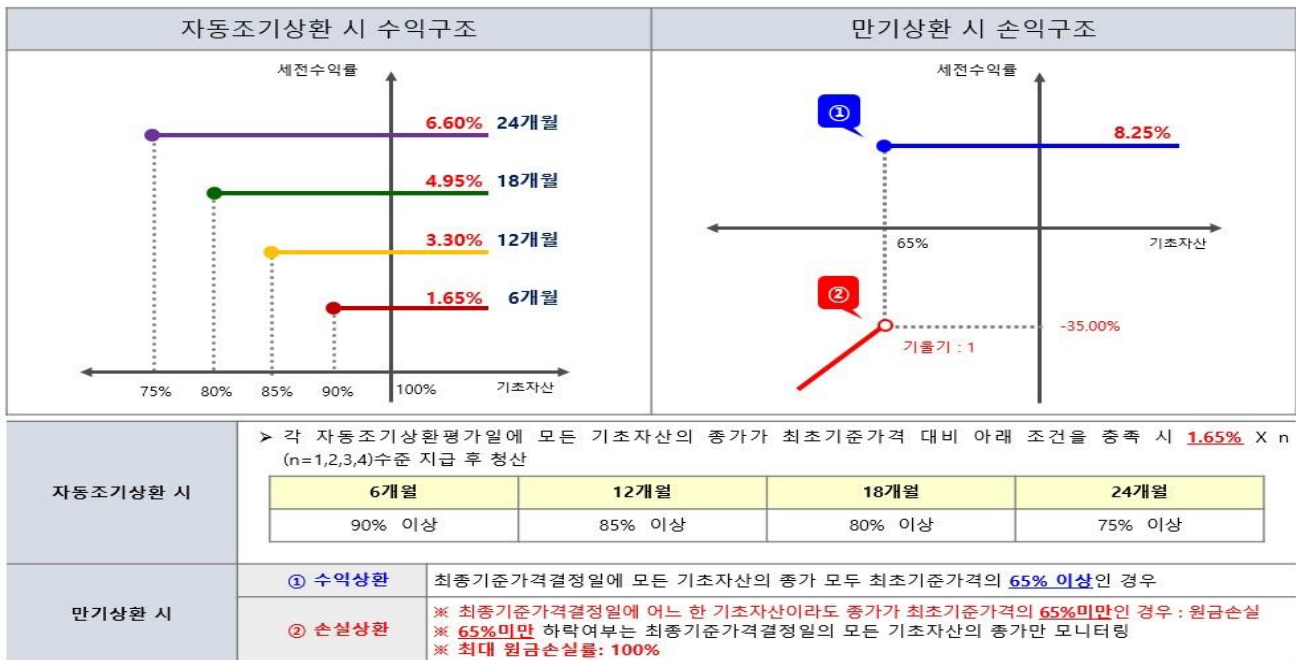
2021-04-28

## 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  | 747   |       | 747       | 장외 |
| 합계 |      |      | 747   |       | 747       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-24호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

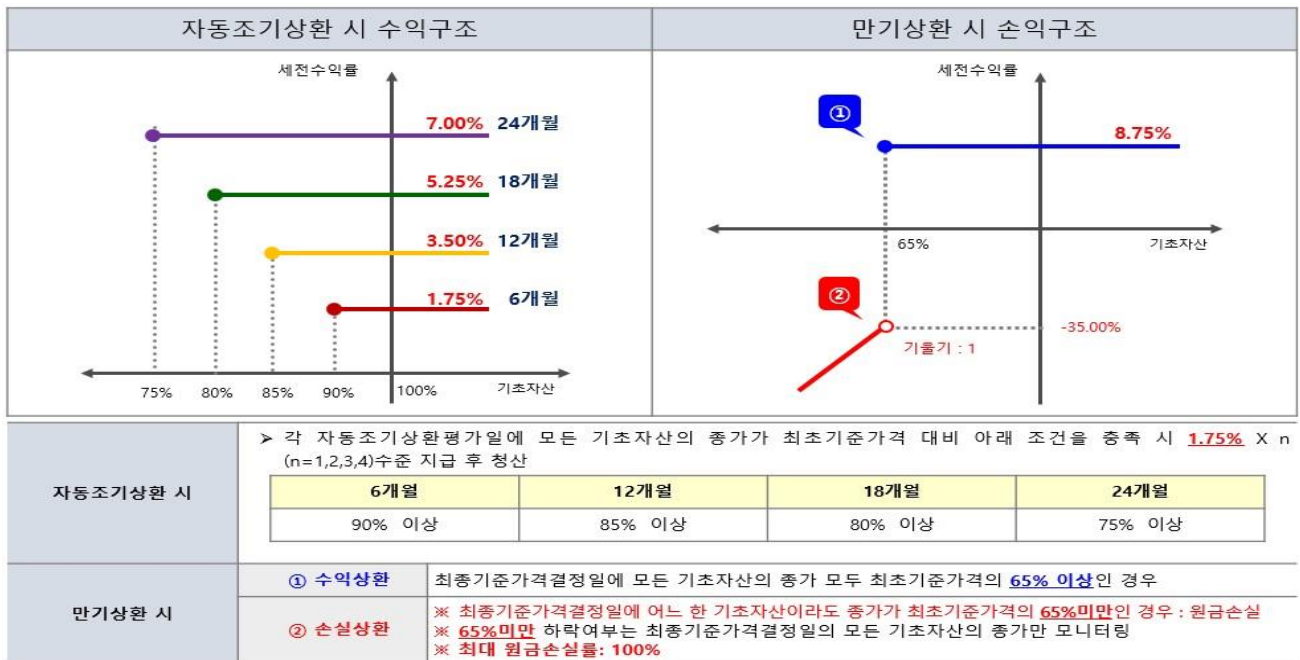
2021-04-28

## 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  | 1,166 |       | 1,166     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,166 |       | 1,166     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

55

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

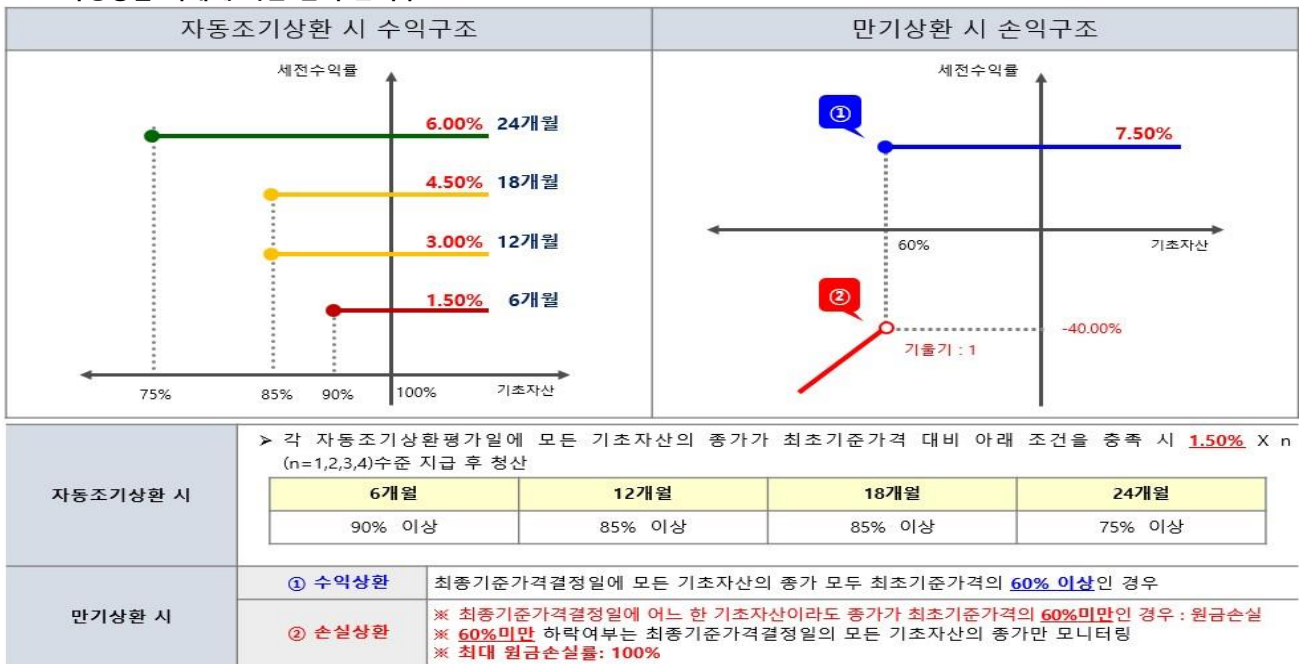
2021-04-28

## 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  | 604   |       | 604       | 장외 |
| 합계 |      |      | 604   |       | 604       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-26호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

2021-04-28

## 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  | 2,040 |       | 2,040     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,040 |       | 2,040     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 : ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>                 ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

113

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

42

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

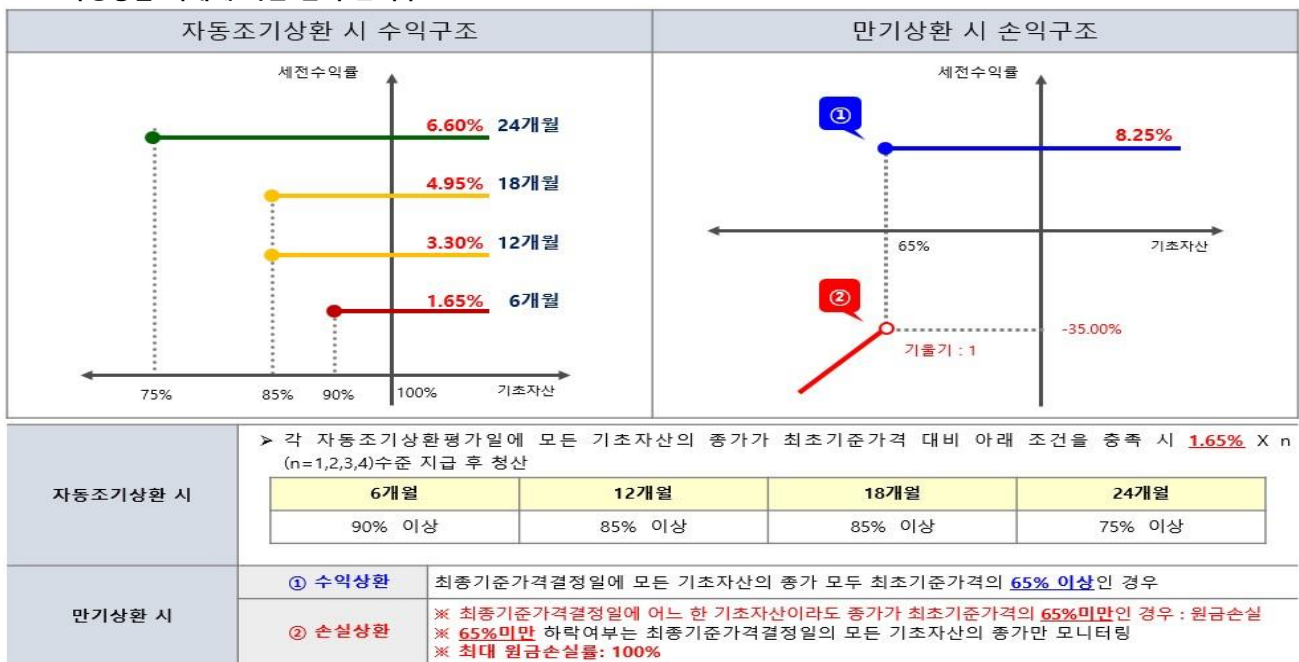
2021-04-28

## 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  | 547   |       | 547       | 장외 |
| 합계 |      |      | 547   |       | 547       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

30

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

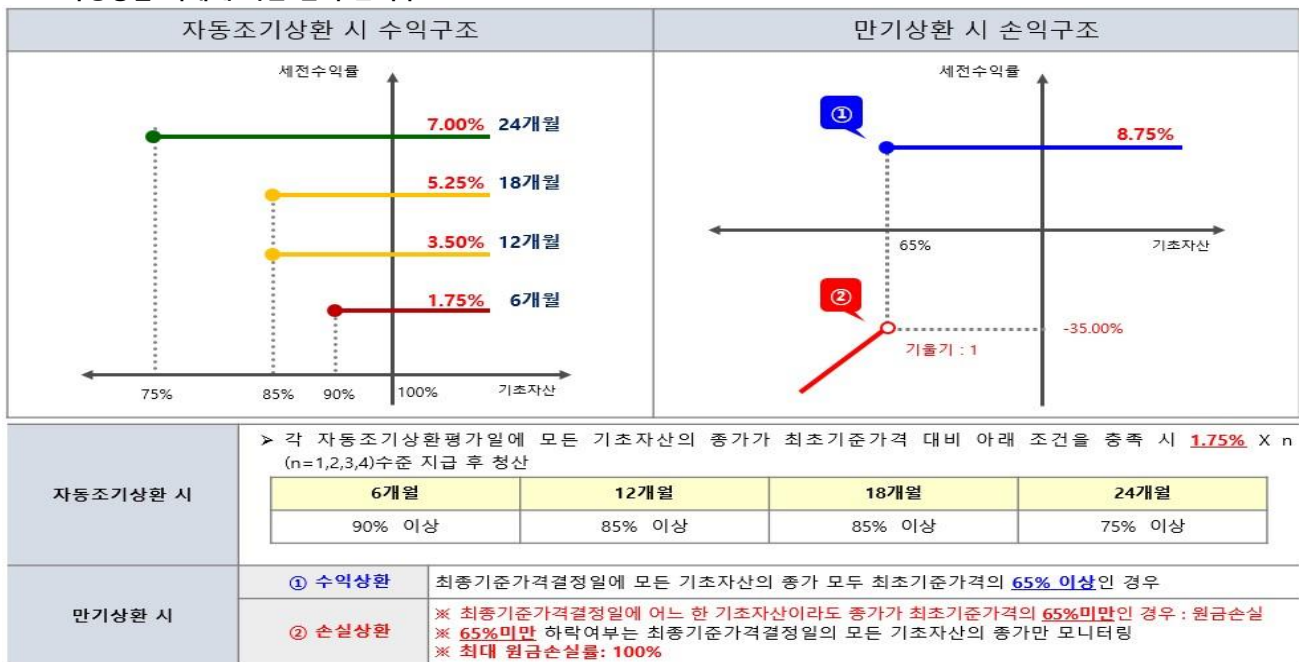
2021-04-28

## 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  | 2,053 |       | 2,053     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,053 |       | 2,053     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

113

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-29호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

2021-04-28

## 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  | 1,680 |       | 1,680     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,680 |       | 1,680     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 : ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

126

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

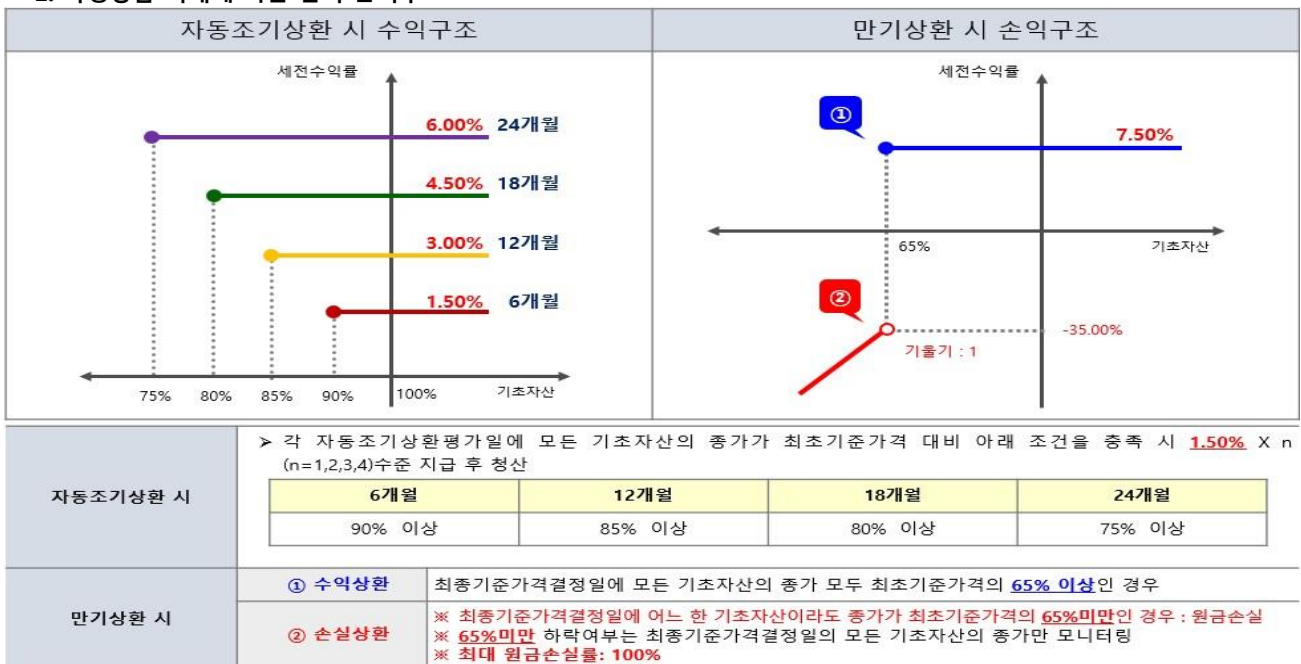
2021-04-28

## 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  | 419   |       | 419       | 장외 |
| 합계 |      |      | 419   |       | 419       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

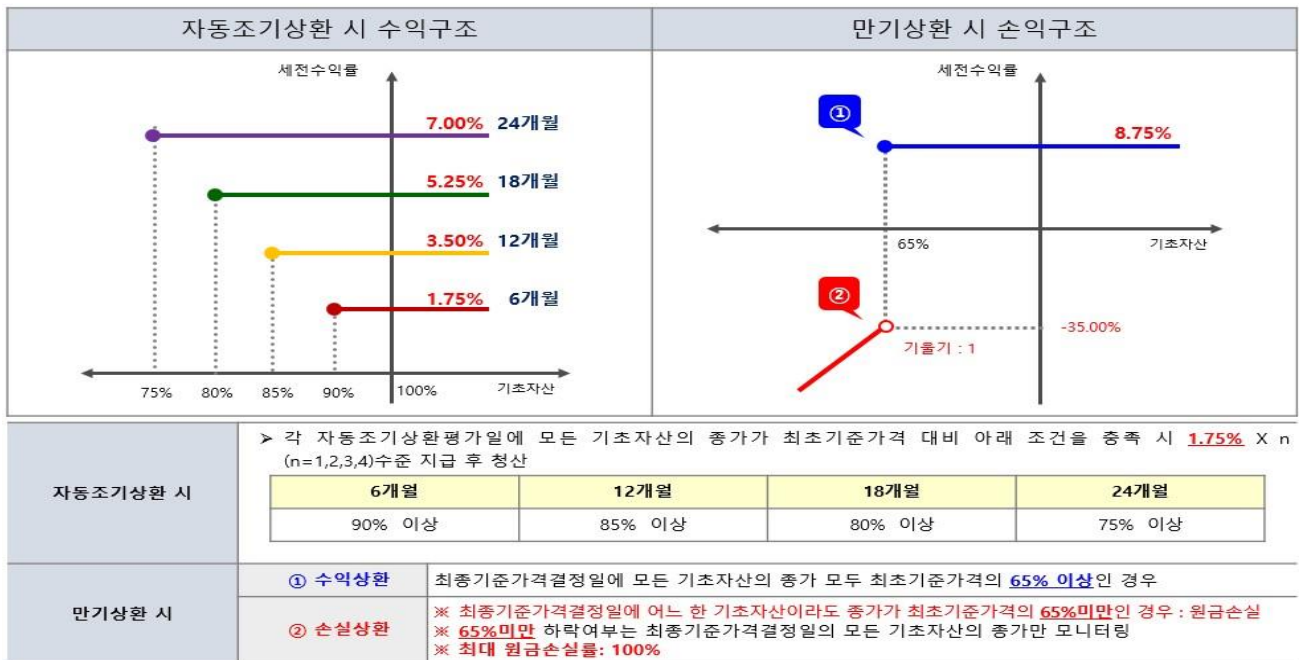
2021-04-28

## 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  | 1,967 |       | 1,967     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,967 |       | 1,967     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

135

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

38

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-32호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

2021-04-28

## 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  | 1,114 |       | 1,114     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,114 |       | 1,114     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환<br/>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환<br/>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

75

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

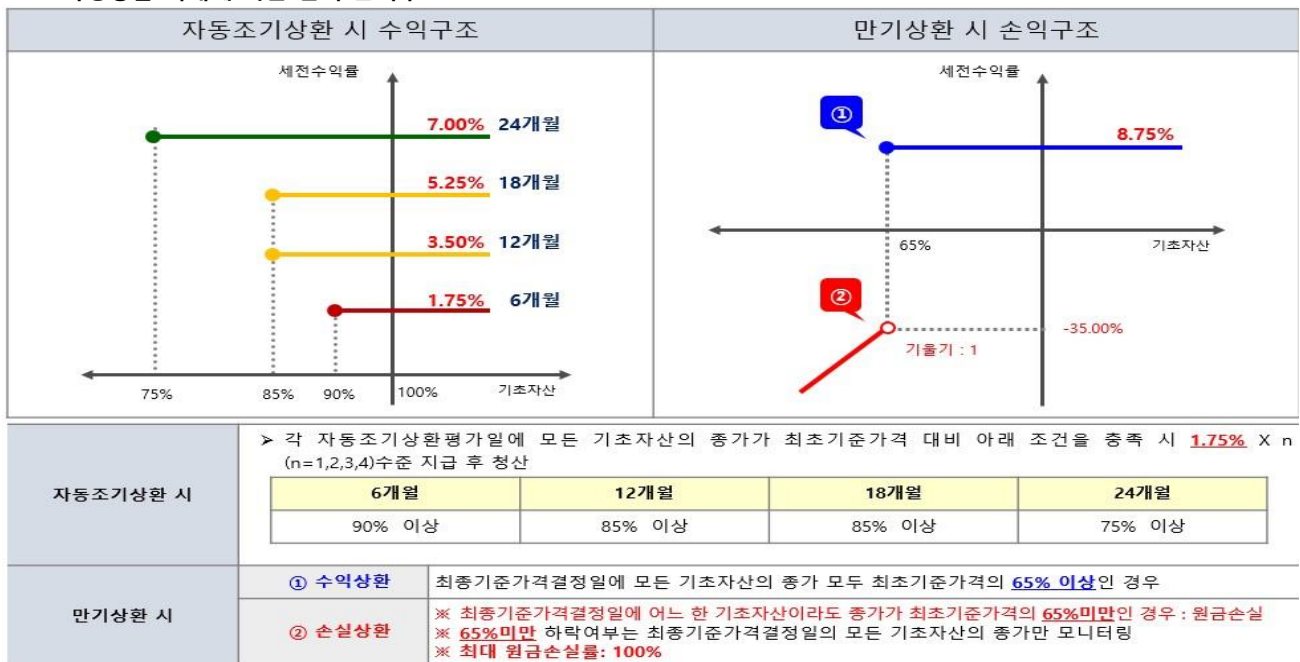
2021-04-28

## 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  | 634   |       | 634       | 장외 |
| 합계 |      |      | 634   |       | 634       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

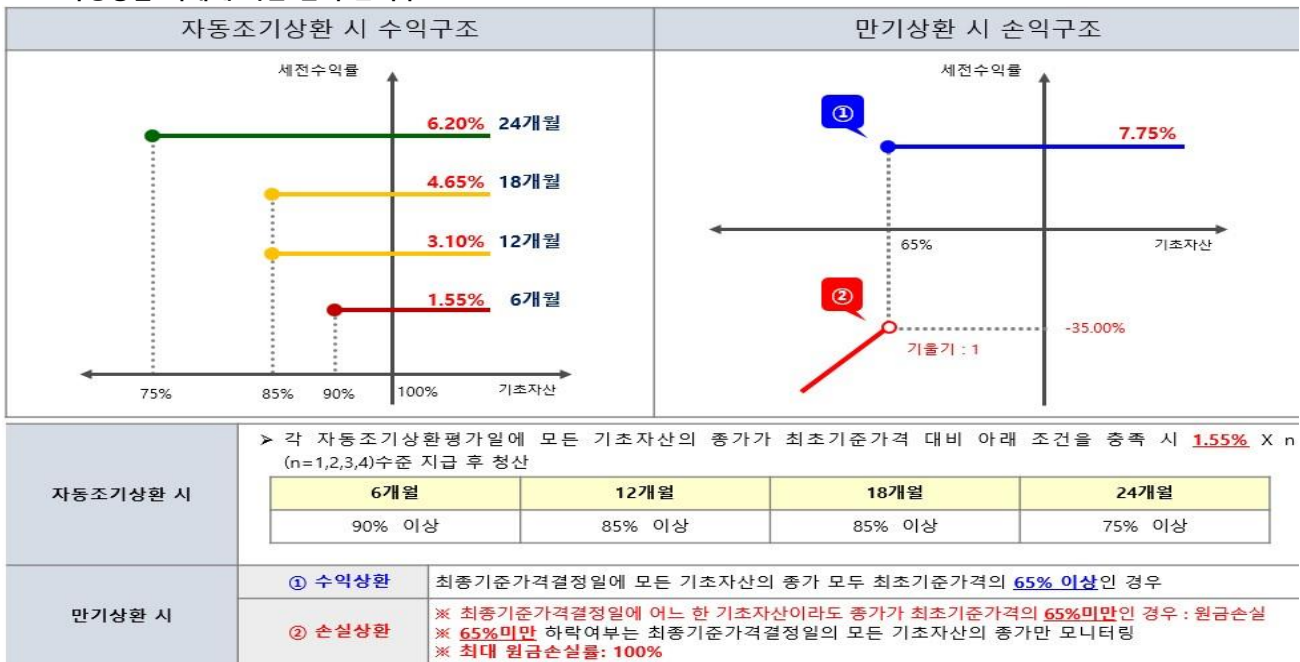
2021-04-28

## 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  | 260   |       | 260       | 장외 |
| 합계 |      |      | 260   |       | 260       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

9

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)NK-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 1,219 |       | 1,219     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,219 |       | 1,219     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.25% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 : ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

45

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

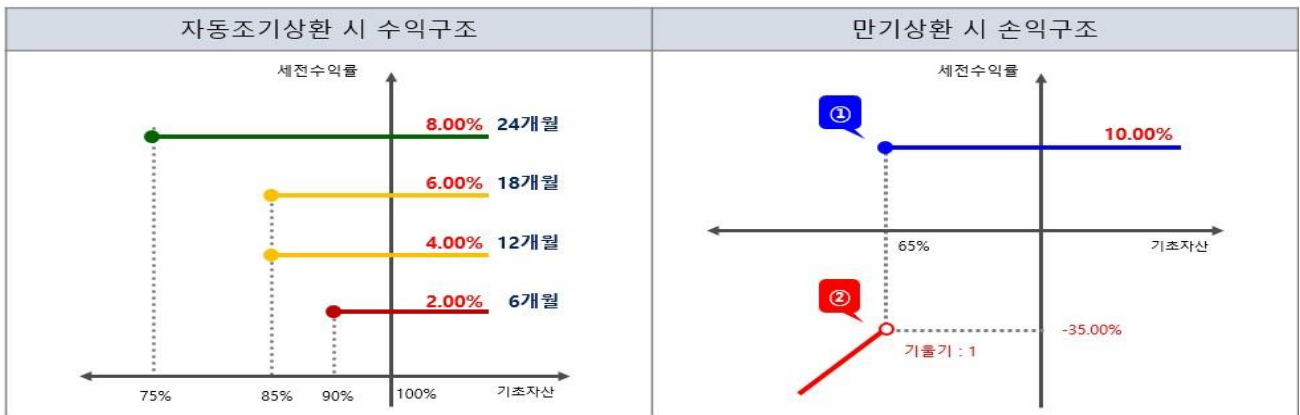
2021-04-28

## 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  | 2,128 |       | 2,128     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,128 |       | 2,128     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

| 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   |
|--------|--------|--------|--------|
| 90% 이상 | 85% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 |

만기상환 시

① 수익상환: 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환: ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실  
 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링  
 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

108

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

74

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권E(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

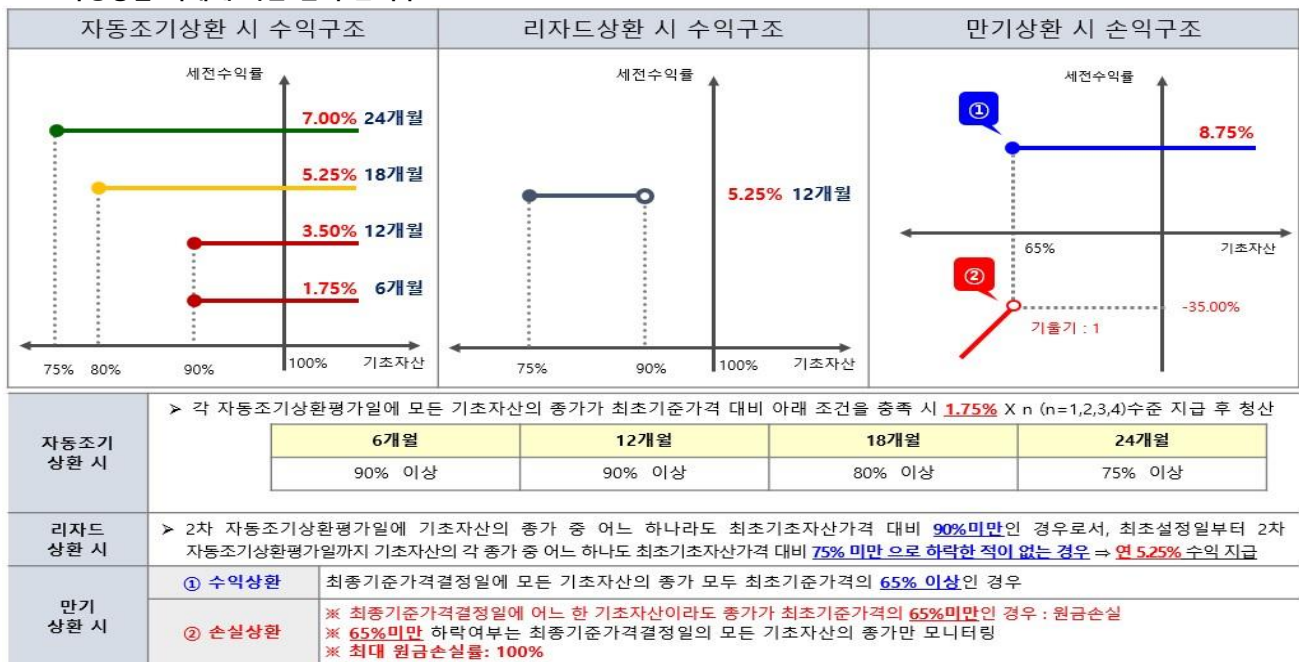
2021-04-28

## 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  | 334   |       | 334       | 장외 |
| 합계 |      |      | 334   |       | 334       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

20

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

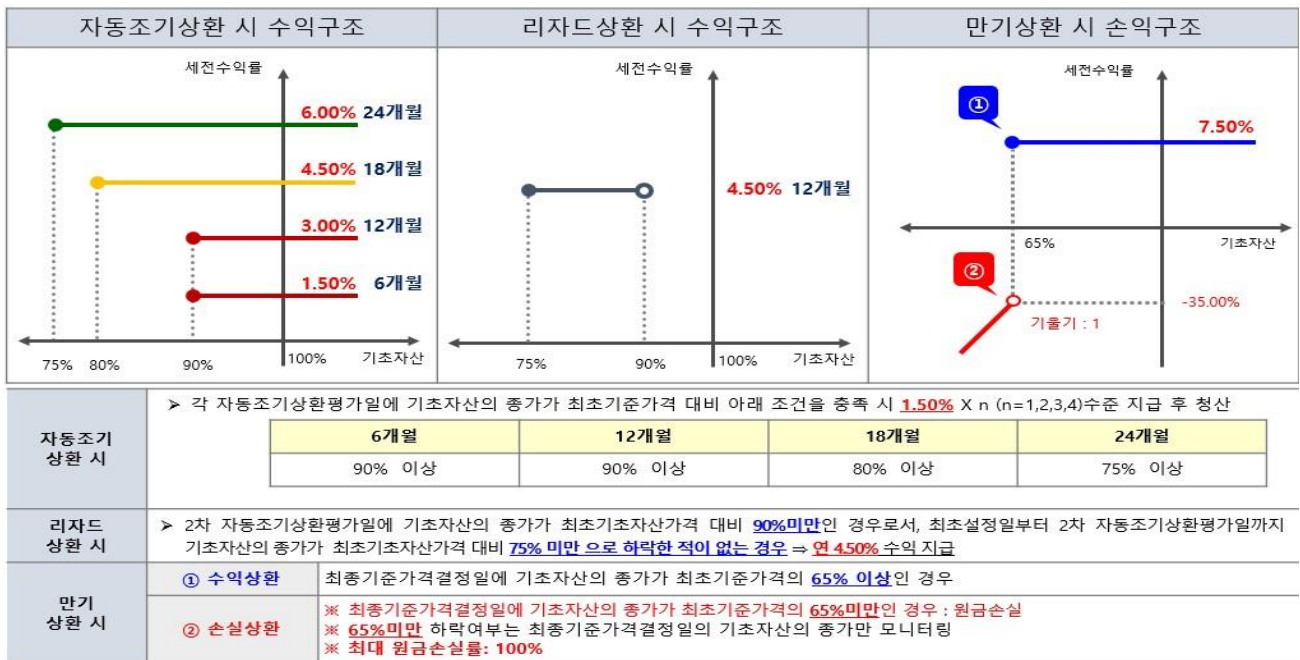
2021-04-28

## 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  | 781   |       | 781       | 장외 |
| 합계 |      |      | 781   |       | 781       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

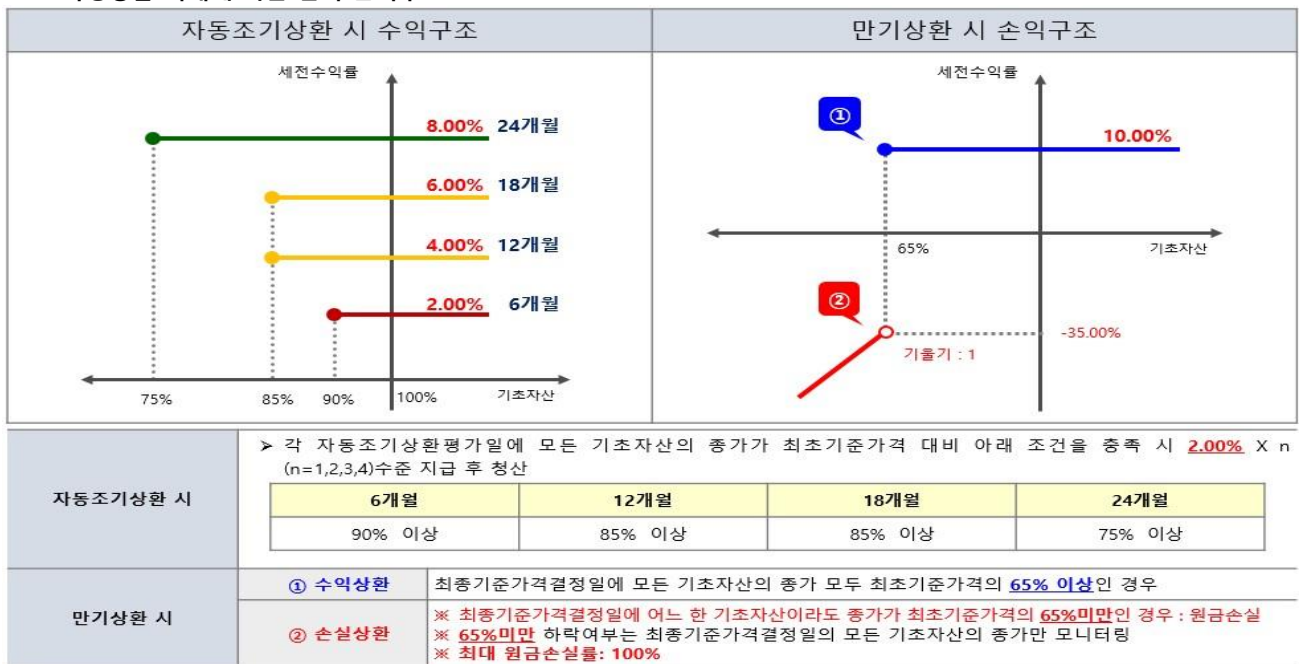
2021-04-28

## 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  | 1,264 |       | 1,264     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,264 |       | 1,264     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

59

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

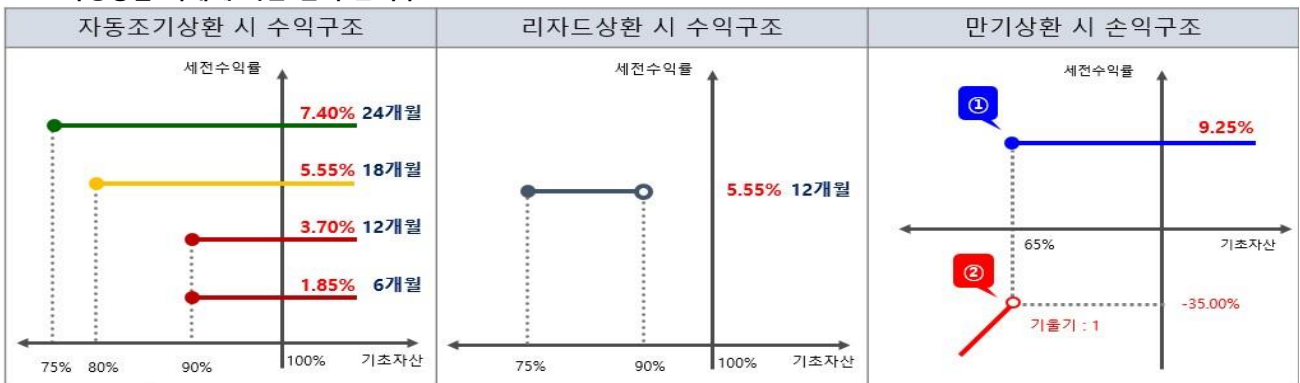
2021-04-28

## 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  | 1,302 |       | 1,302     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,302 |       | 1,302     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| 자동조기상환 시 | <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.85% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월    | 12개월   | 18개월 | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |
|----------|---|--------|--------|------|------|--------|--------|--------|--------|
| 6개월      | 12개월  | 18개월   | 24개월   |      |      |        |        |        |        |
| 90% 이상   | 90% 이상  | 80% 이상 | 75% 이상 |      |      |        |        |        |        |
| 리자드상환 시  | <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.55% 수익 지급</p>   |        |        |      |      |        |        |        |        |
| 만기상환 시   | <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 :<br/>                 ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 총가만 모니터링<br/>                 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>   |        |        |      |      |        |        |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

55

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

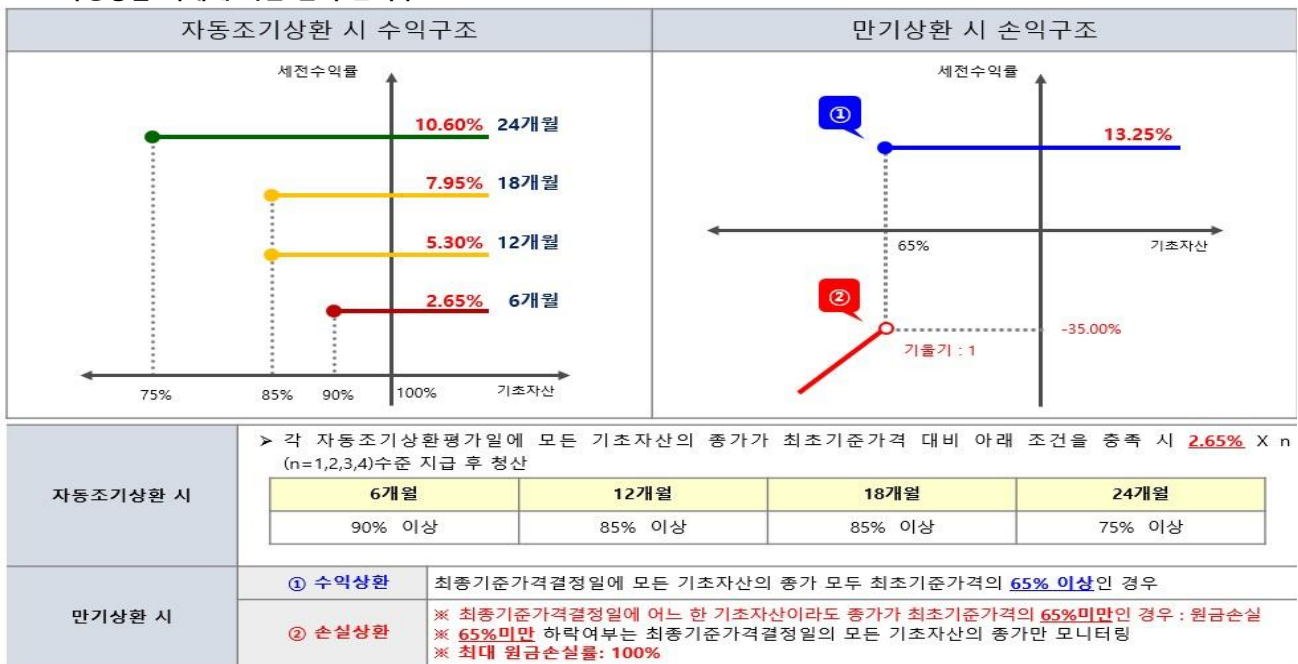
2021-04-28

## 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  | 5,621 |       | 5,621     | 장외 |
| 합계 |      |      | 5,621 |       | 5,621     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

301

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

143

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

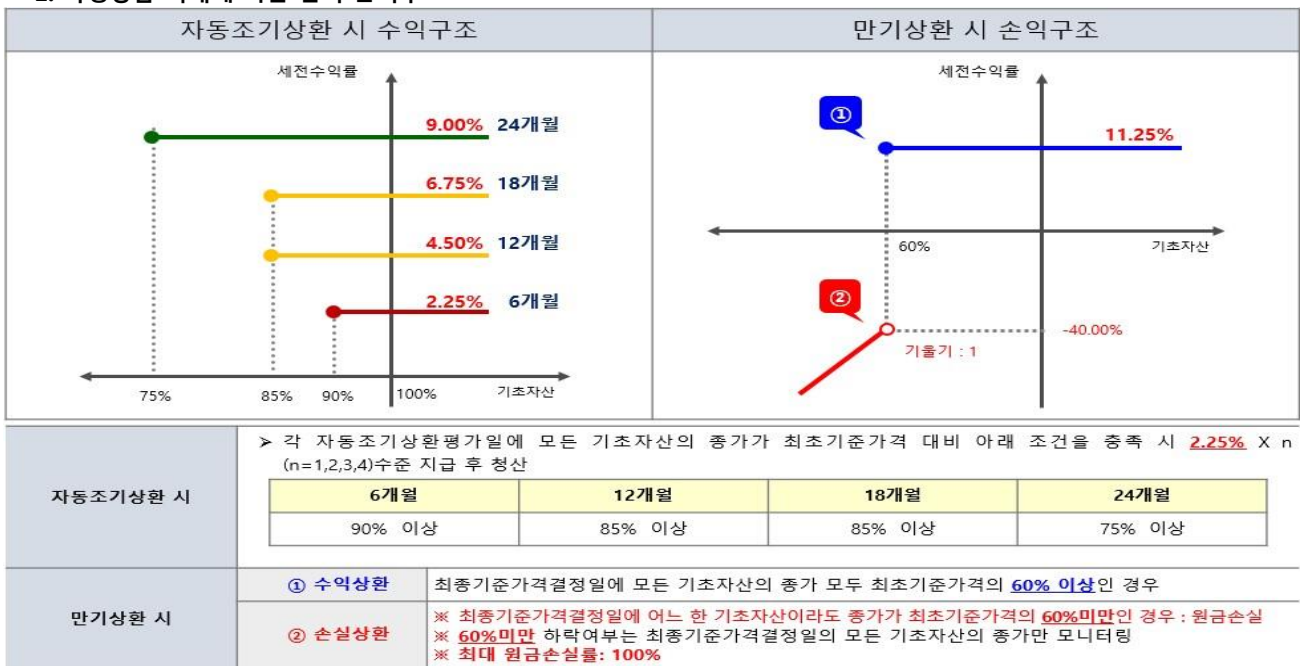
2021-04-28

## 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  | 548   |       | 548       | 장외 |
| 합계 |      |      | 548   |       | 548       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권SE(KRW)K-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 1,989 |       | 1,989     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,989 |       | 1,989     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조  | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |  |   |
|--|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|--|---|
|  |              |             |        |      |        |        |        |        |  |   |
| <p>자동조기상환 시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.25% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리자드 상환 시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.75% 수익 지급</p> | <p>만기 상환 시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 :<br/>                     ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                     ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>                     ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월  | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |  |   |
| 90% 이상   | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |  |   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

91

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

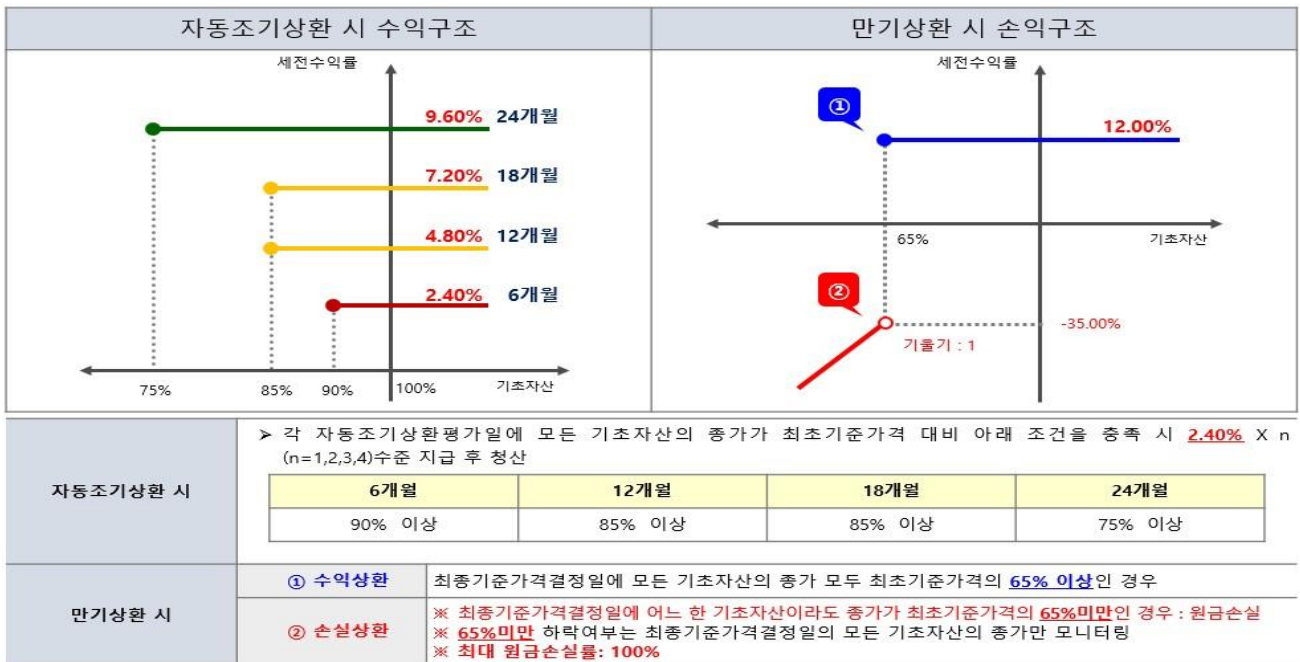
2021-04-28

## 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  | 1,550 |       | 1,550     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,550 |       | 1,550     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

83

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

39

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-5호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

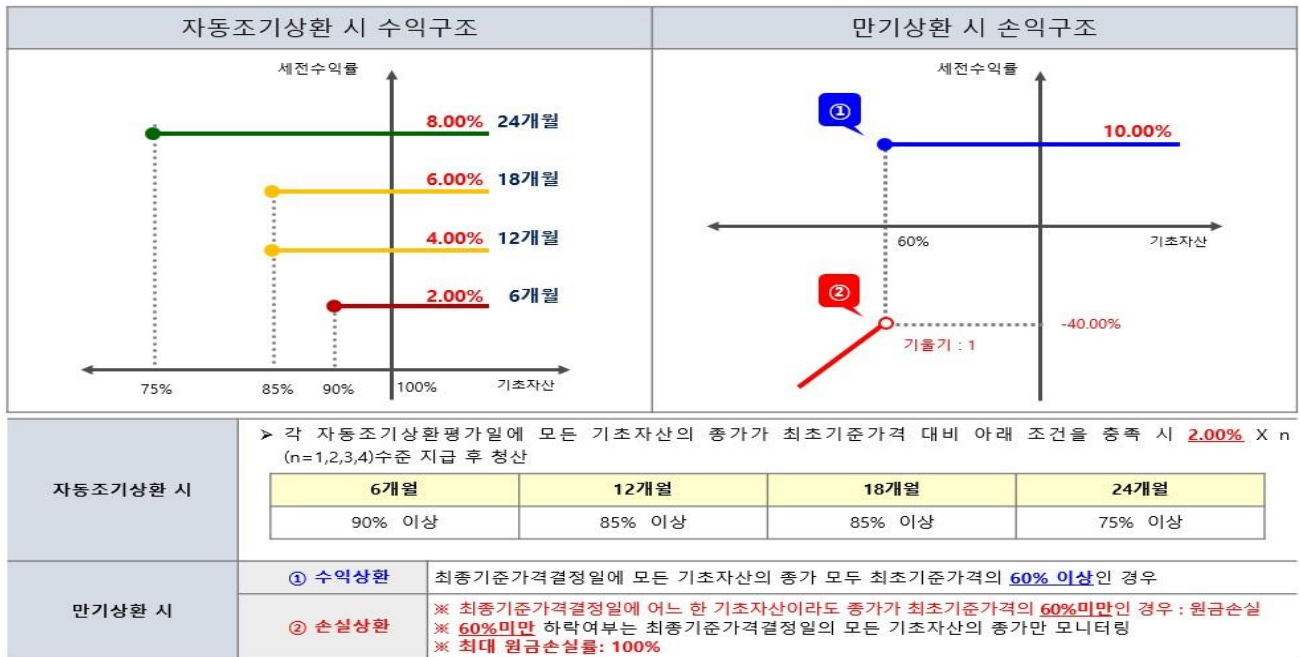
2021-04-28

## 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  | 903   |       | 903       | 장외 |
| 합계 |      |      | 903   |       | 903       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)NK-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

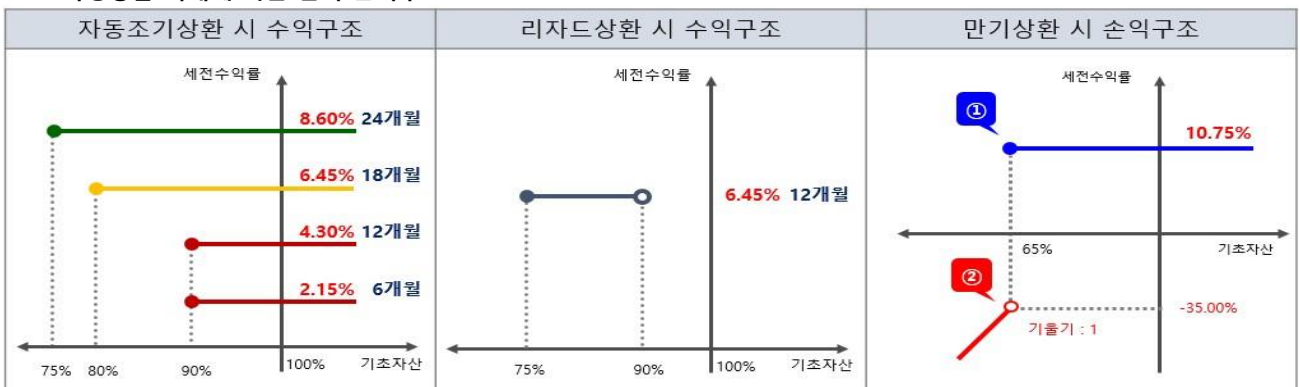
2021-04-28

## 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  | 714   |       | 714       | 장외 |
| 합계 |      |      | 714   |       | 714       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |   |  |        |        |
|----------|---|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.15% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산   |  |        |        |
|          | 6개월   | 12개월   | 18개월   | 24개월   |
|          | 90% 이상  | 90% 이상   | 80% 이상 | 75% 이상 |
| 리자드상환 시  | > 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연6.45% 수익 지급 |  |        |        |
| 만기상환 시   | ① 수익상환  | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우   |        |        |
|          | ② 손실상환  | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ 최대 원금손실률: 100% |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

44

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

25

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

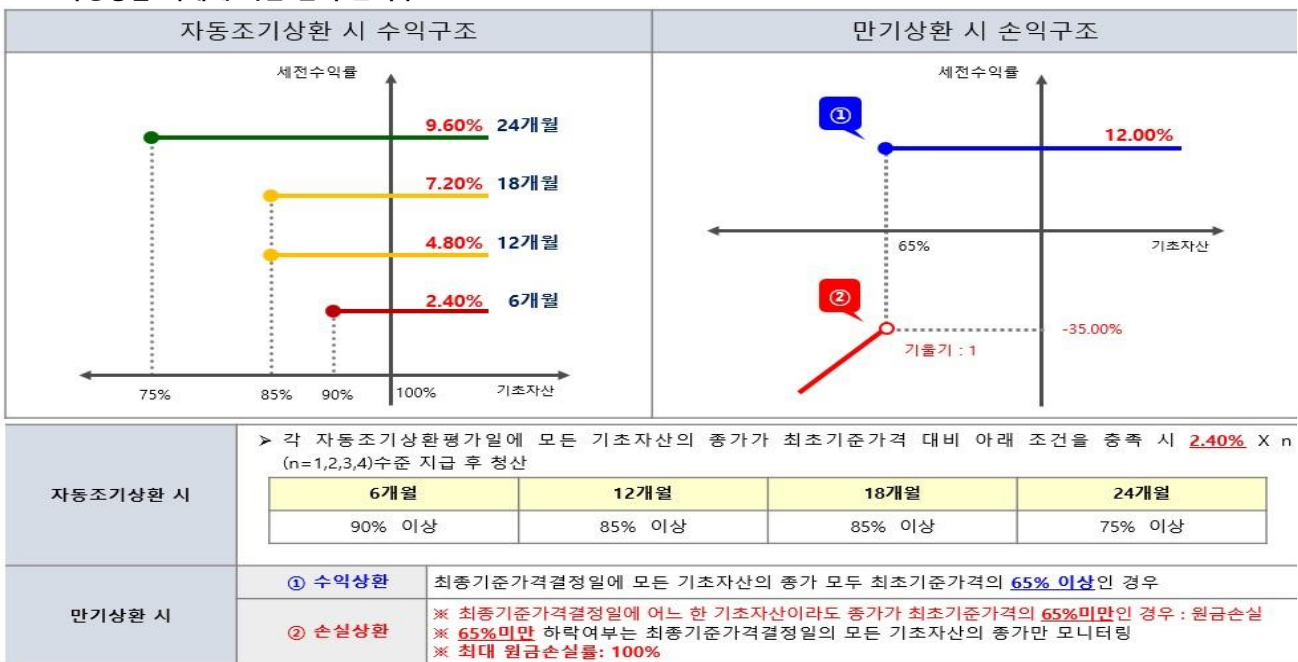
2021-04-28

## 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  | 1,913 |       | 1,913     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,913 |       | 1,913     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

93

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

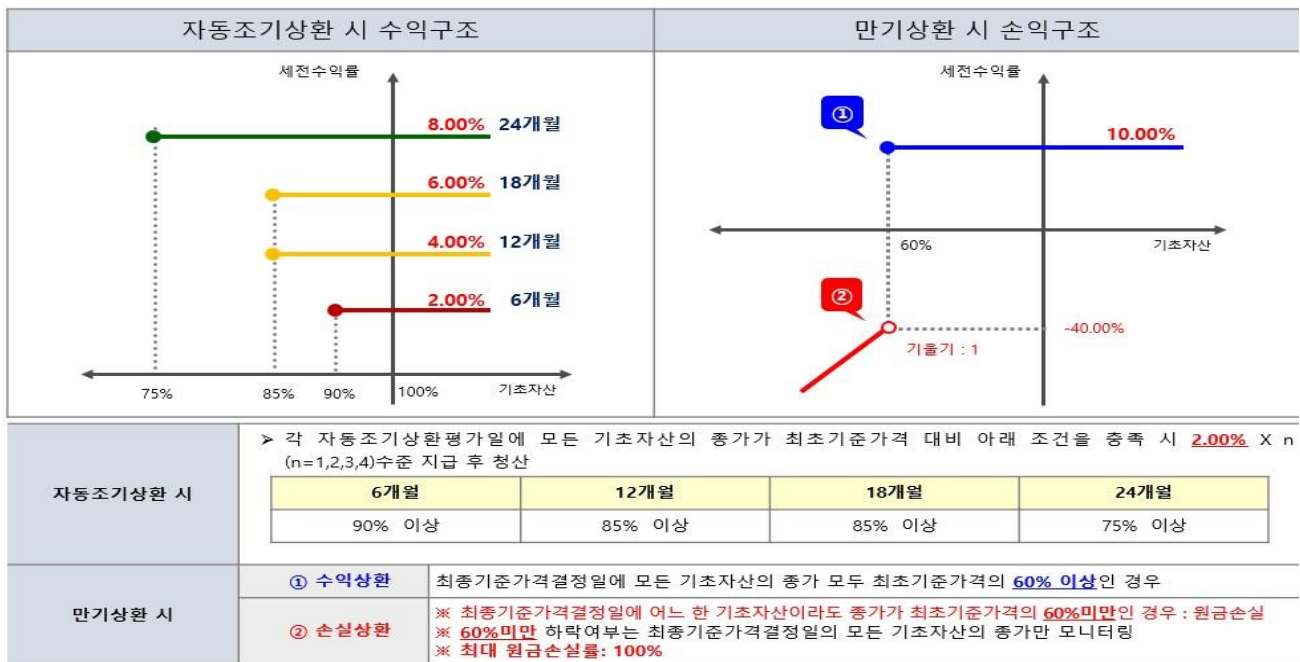
2021-04-28

## 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  | 301   |       | 301       | 장외 |
| 합계 |      |      | 301   |       | 301       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권SE(KRW)N-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

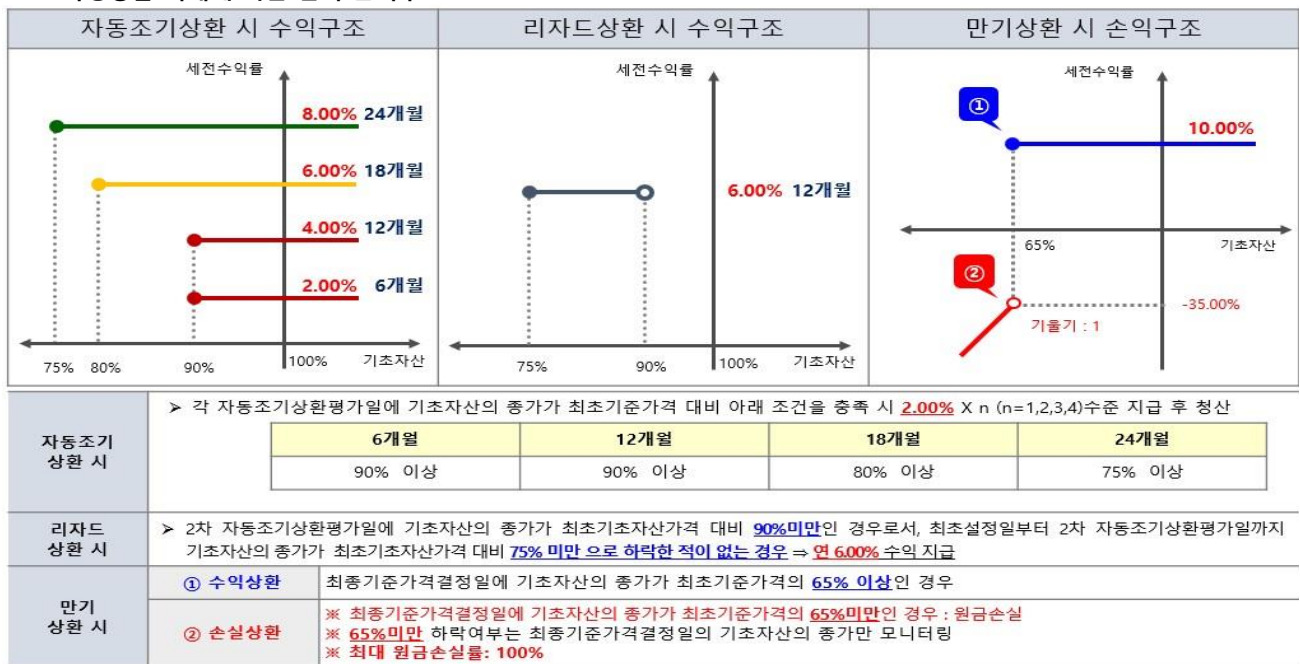
2021-04-28

## 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  | 207   |       | 207       | 장외 |
| 합계 |      |      | 207   |       | 207       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-38호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

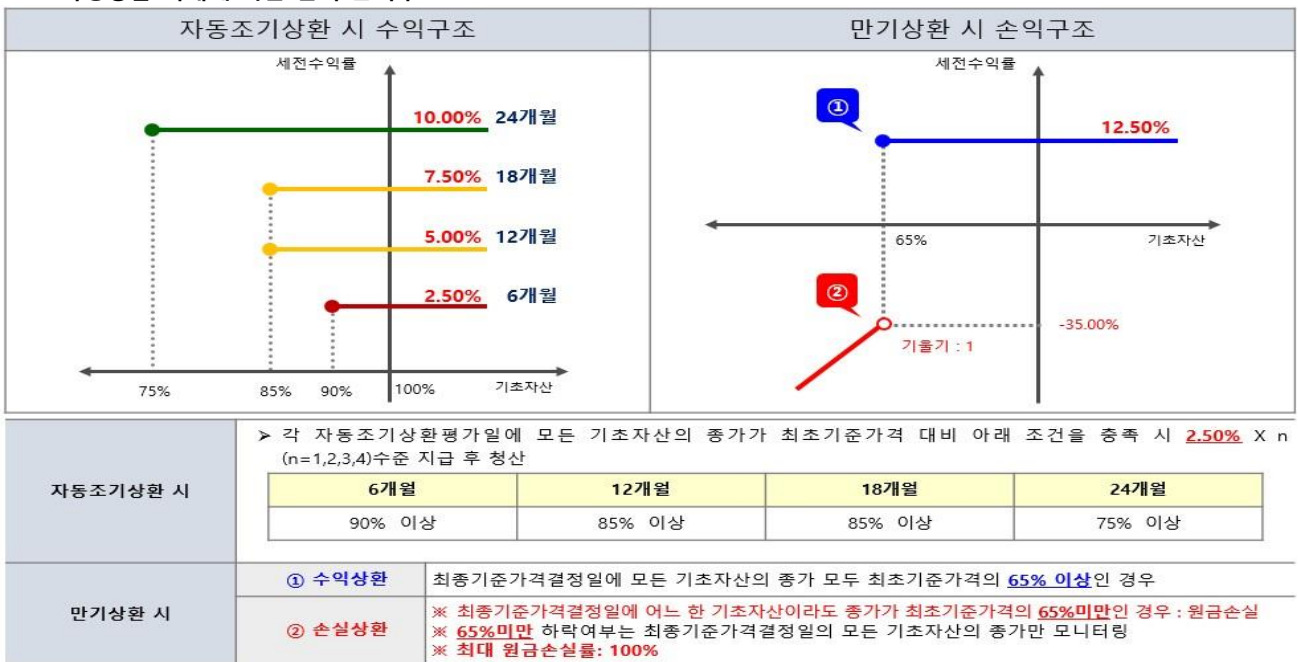
2021-04-28

## 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  | 958   |       | 958       | 장외 |
| 합계 |      |      | 958   |       | 958       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권SHE(KRW)-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

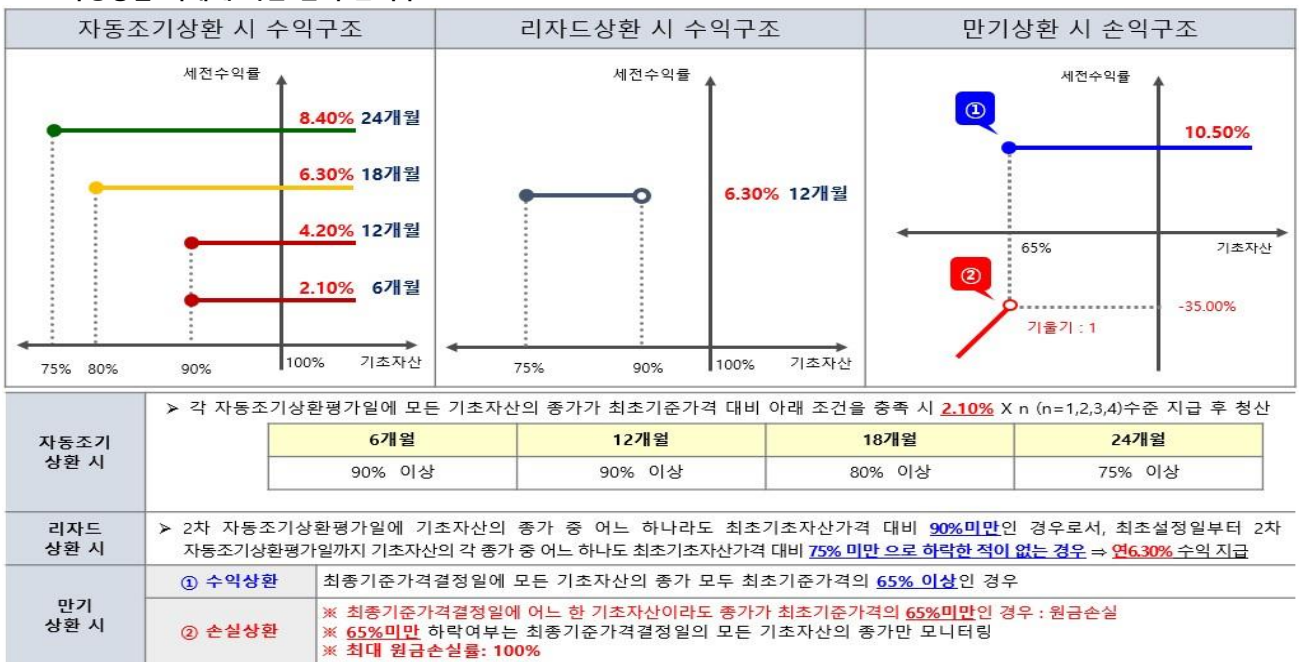
2021-04-28

## 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  | 200   |       | 200       | 장외 |
| 합계 |      |      | 200   |       | 200       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-7호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

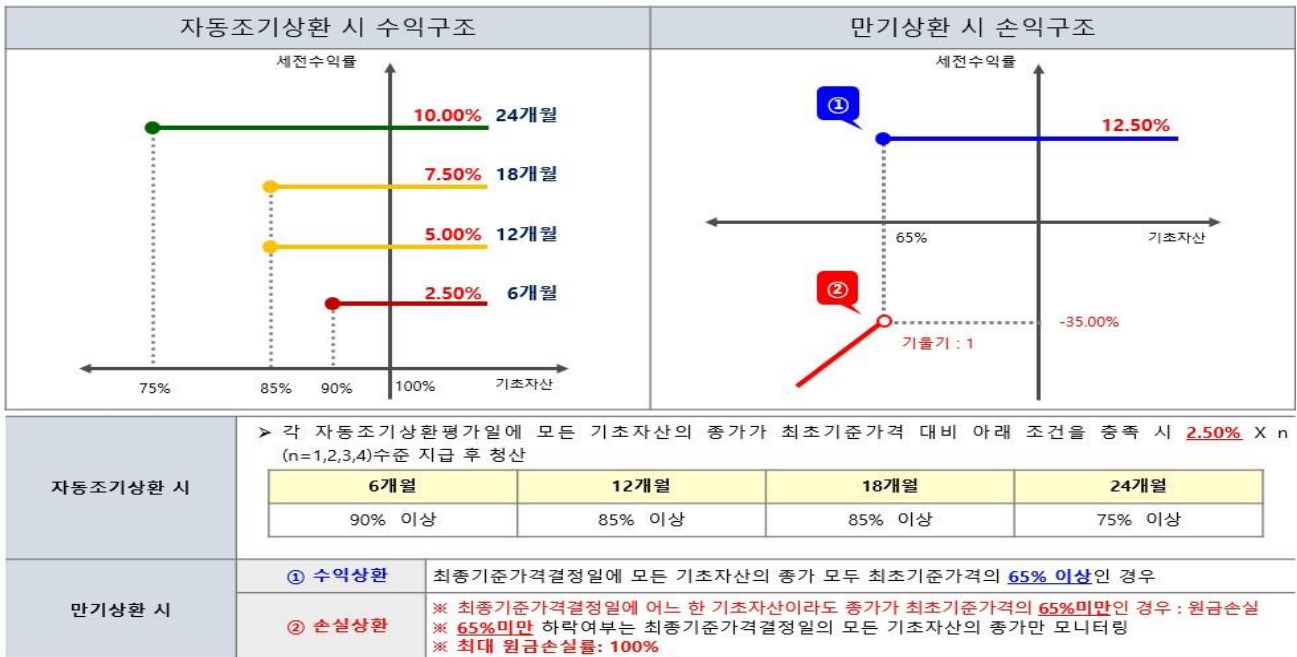
2021-04-28

## 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  | 1,888 |       | 1,888     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,888 |       | 1,888     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

101

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

72

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-40호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

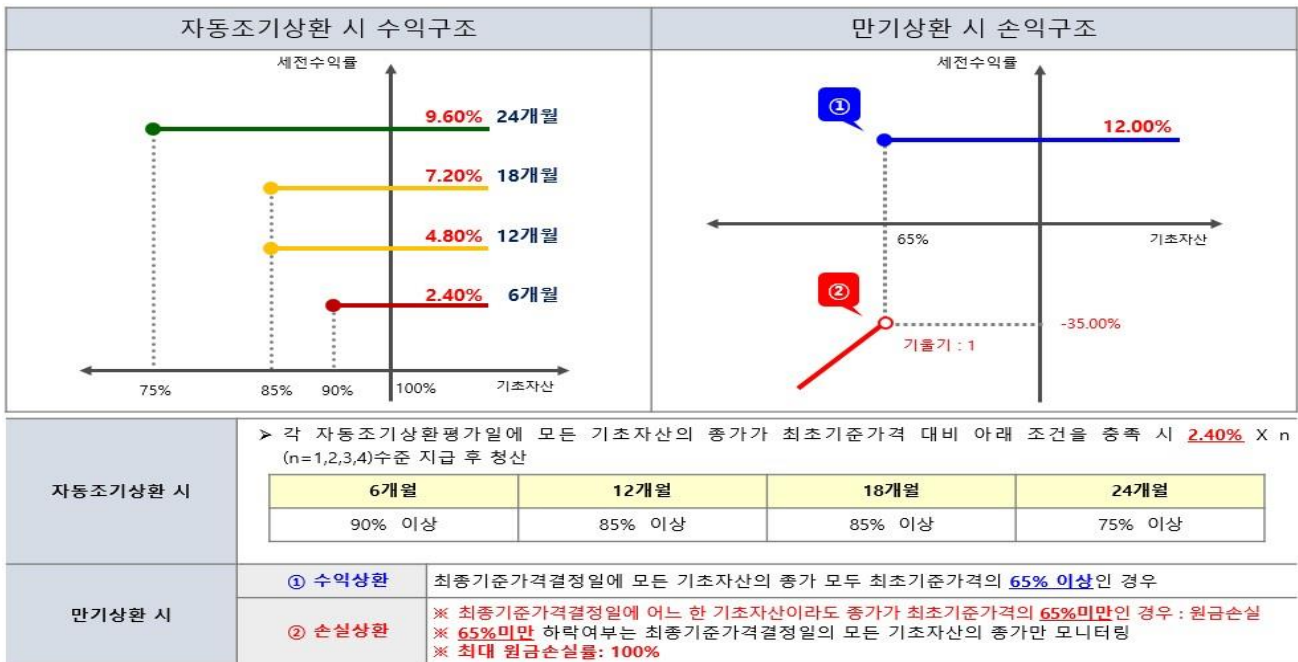
2021-04-28

## 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  | 1,017 |       | 1,017     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,017 |       | 1,017     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권E(KRW)NK-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

2021-04-28

## 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  | 441   |       | 441       | 장외 |
| 합계 |      |      | 441   |       | 441       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |   |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|---|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |   |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급</p> | <p>① 수익상환</p> <p>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환</p> <p>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br/>                 ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |   |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

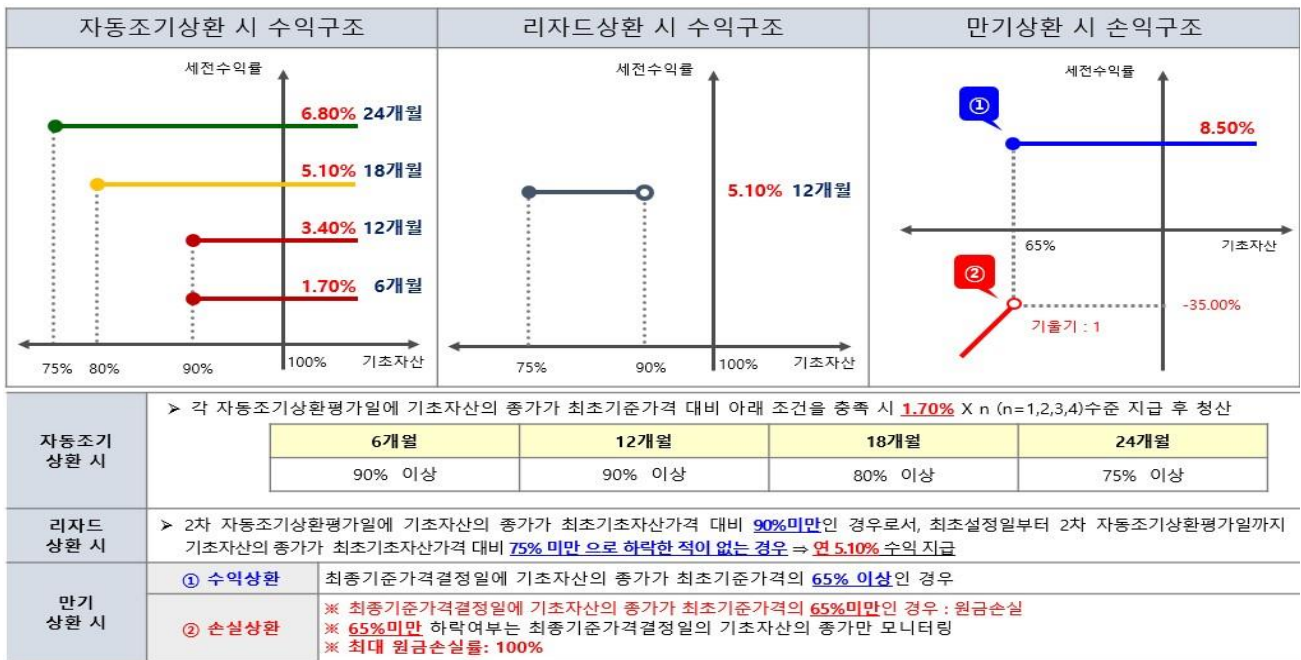
2021-04-28

## 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  | 1,155 |       | 1,155     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,155 |       | 1,155     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

68

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권E(KRW)NK-3호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

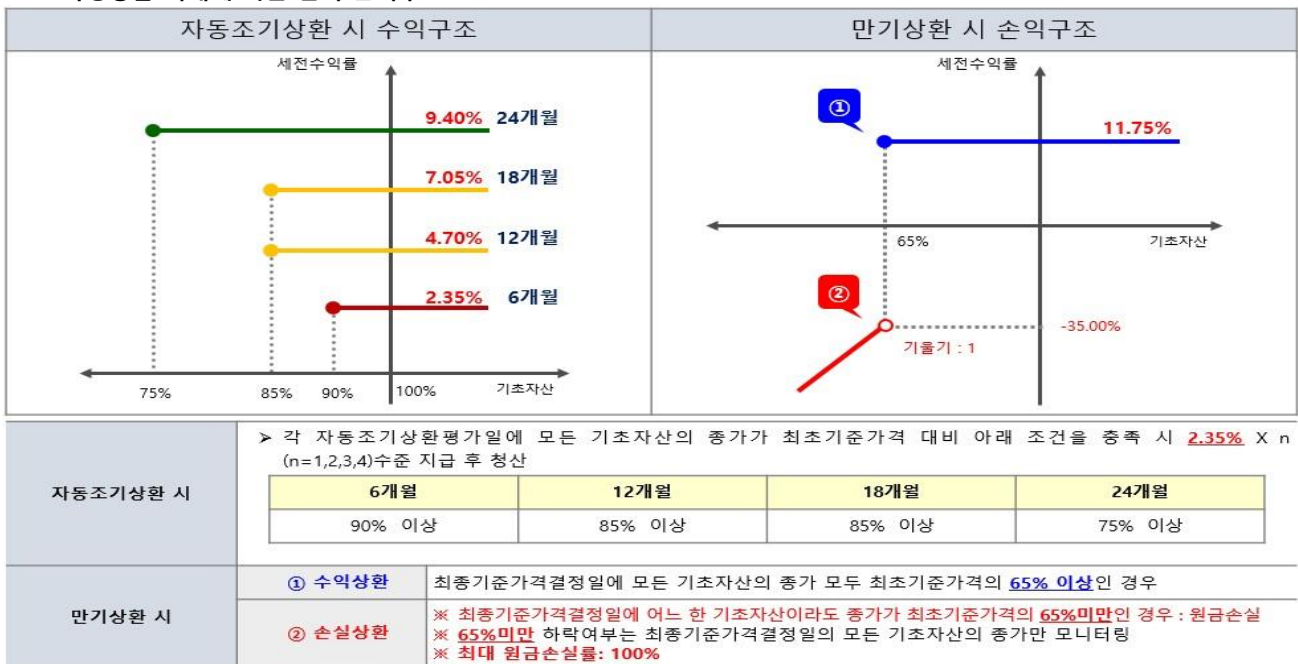
2021-04-28

## 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  | 1,673 |       | 1,673     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,673 |       | 1,673     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

69

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-8호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일:

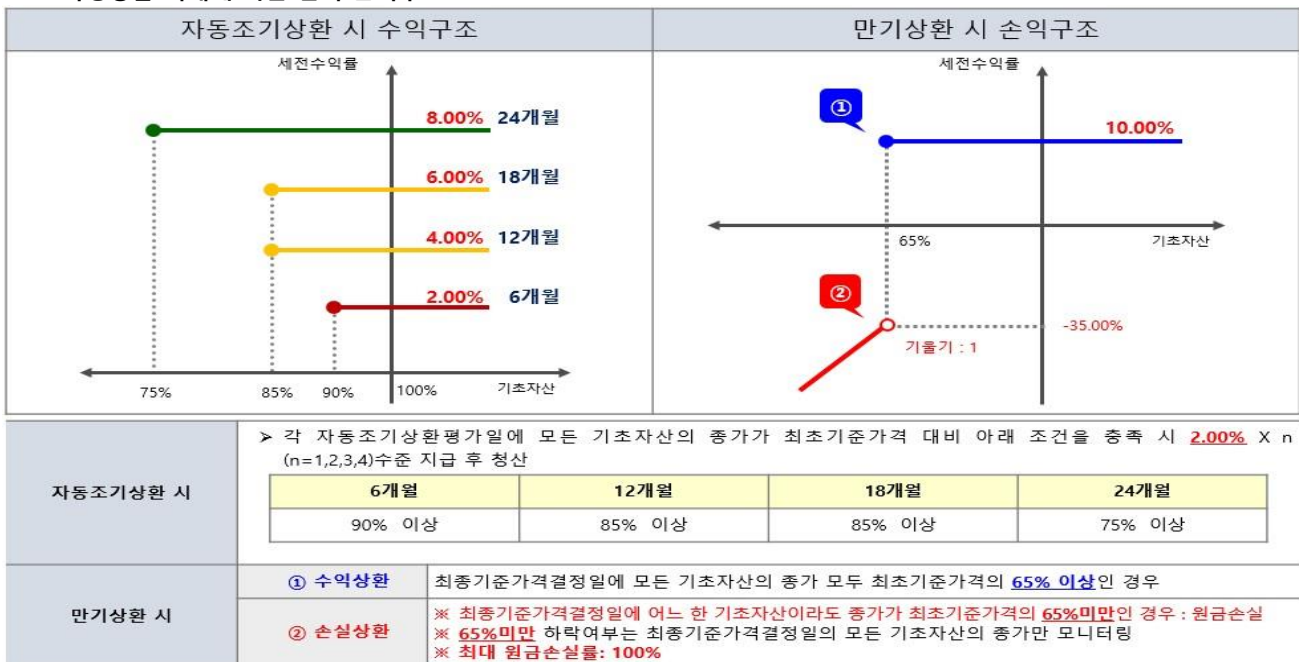
2021-04-28

## 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  | 1,016 |       | 1,016     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,016 |       | 1,016     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

44

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-10호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-04-27

공시일: 2021-04-28

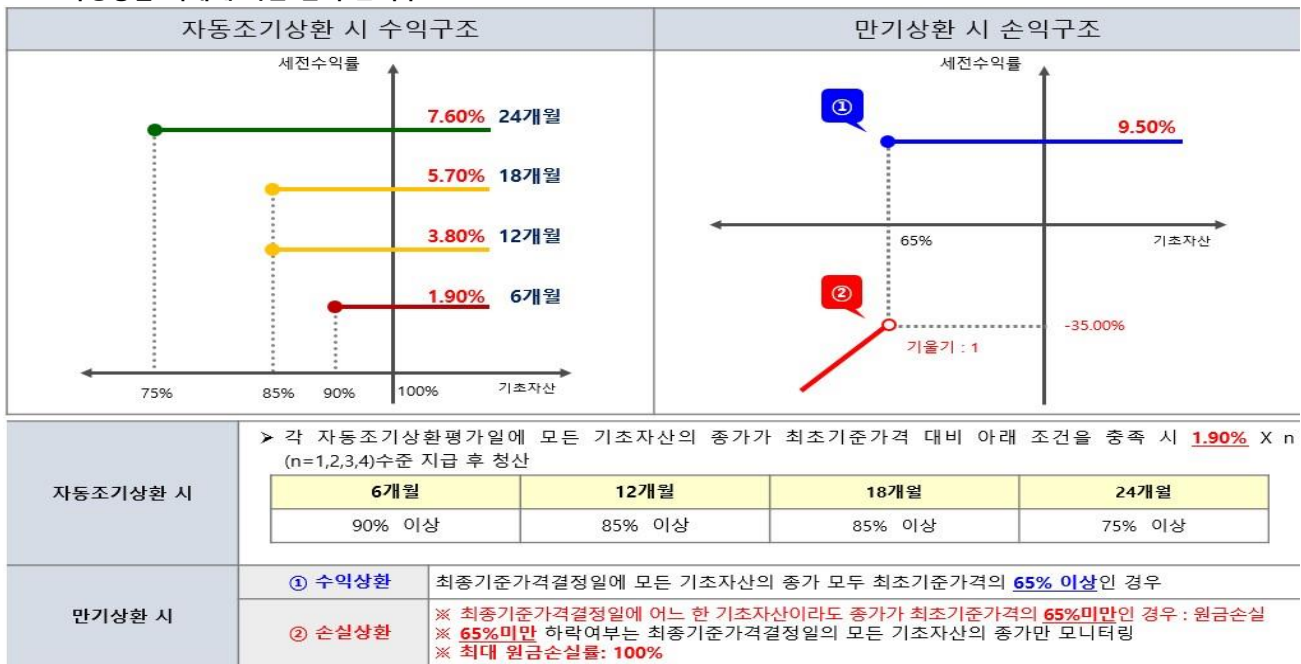
2021-04-28

## 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  | 1,253 |       | 1,253     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,253 |       | 1,253     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

83

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

53