

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 790   | 296   | 493       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 5,330 | 0     | 5,330     | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션   | 1     | 1,938 | -1,937    | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션   | 0     | 1,552 | -1,552    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 560   | 0     | 560       | 장내 |
| 합계 |      |      | 5,890 | 1,552 | 4,338     |    |

## 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

422

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

474

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 17,272 | 0     | 17,272    | 장내 |
| 합계 |      |      | 17,272 | 0     | 17,272    |    |

## 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 펀드 KOSPI200 선물에 주로 투자하나, KOSPI200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 동 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,378

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,423

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

205

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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

43

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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

172

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

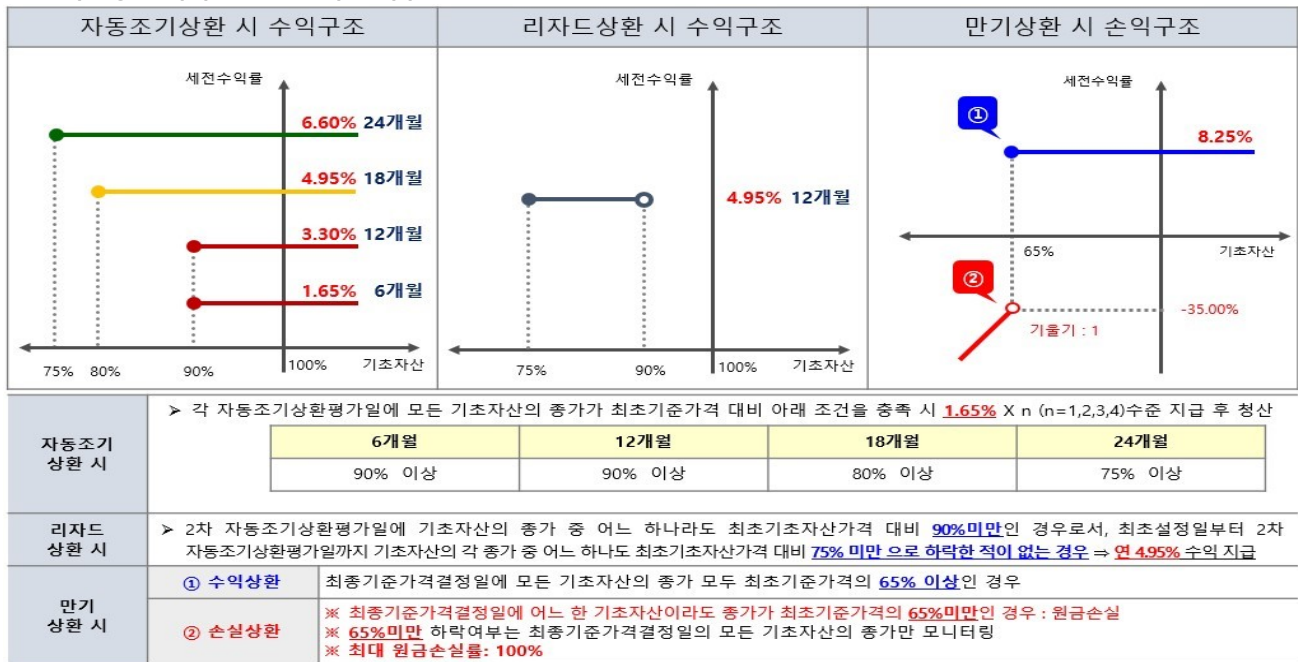
2021-10-05

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

134

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

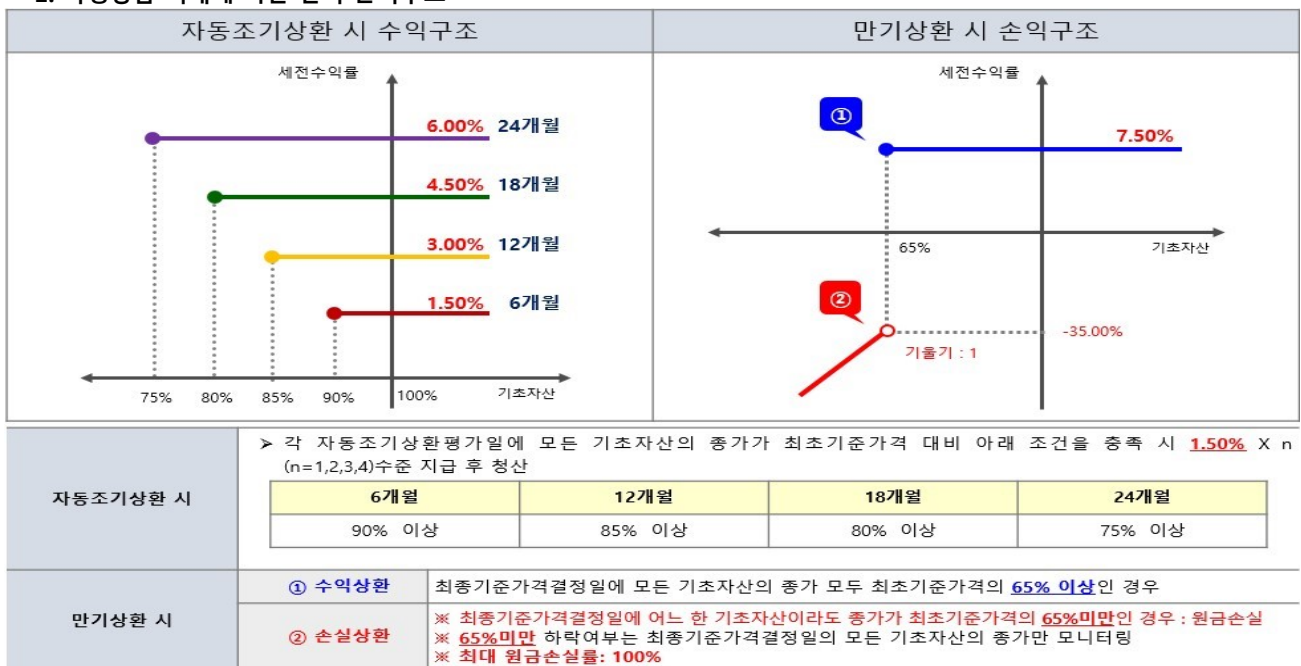
2021-10-05

## 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

33

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

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

기준일 : 2021-10-01

공시일:

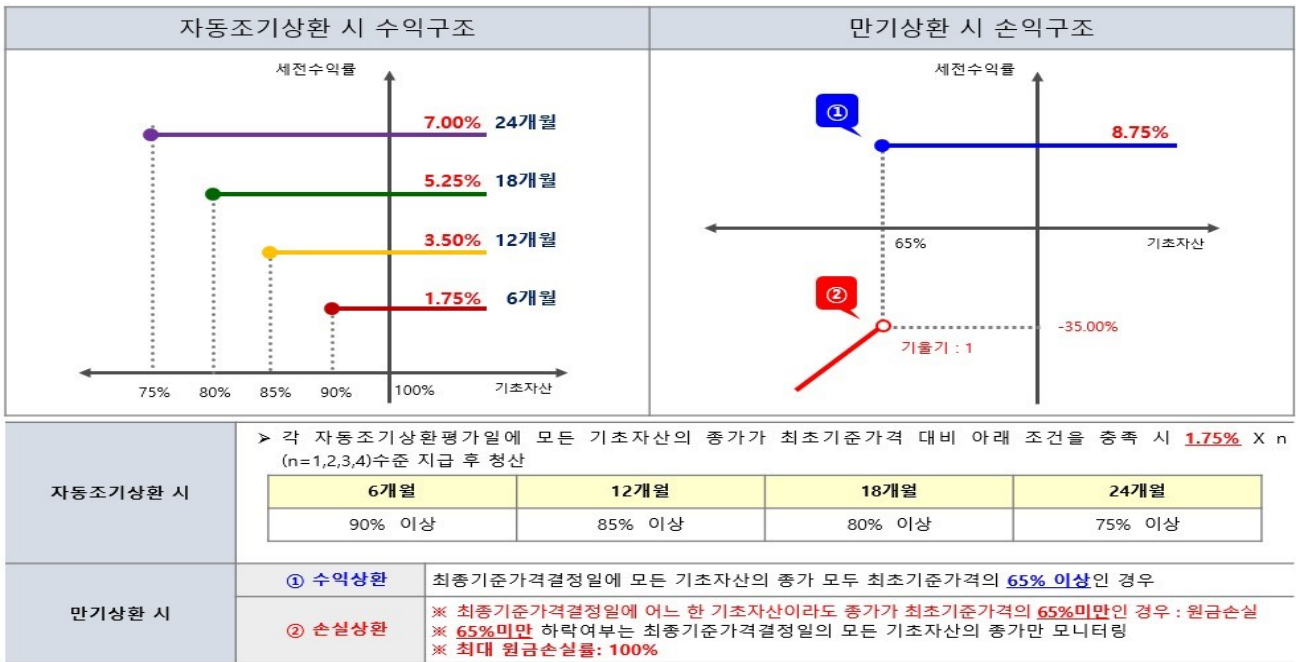
2021-10-05

## 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

161

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

24

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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  | 1,099 |       | 1,099     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,099 |       | 1,099     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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

52

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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

128

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

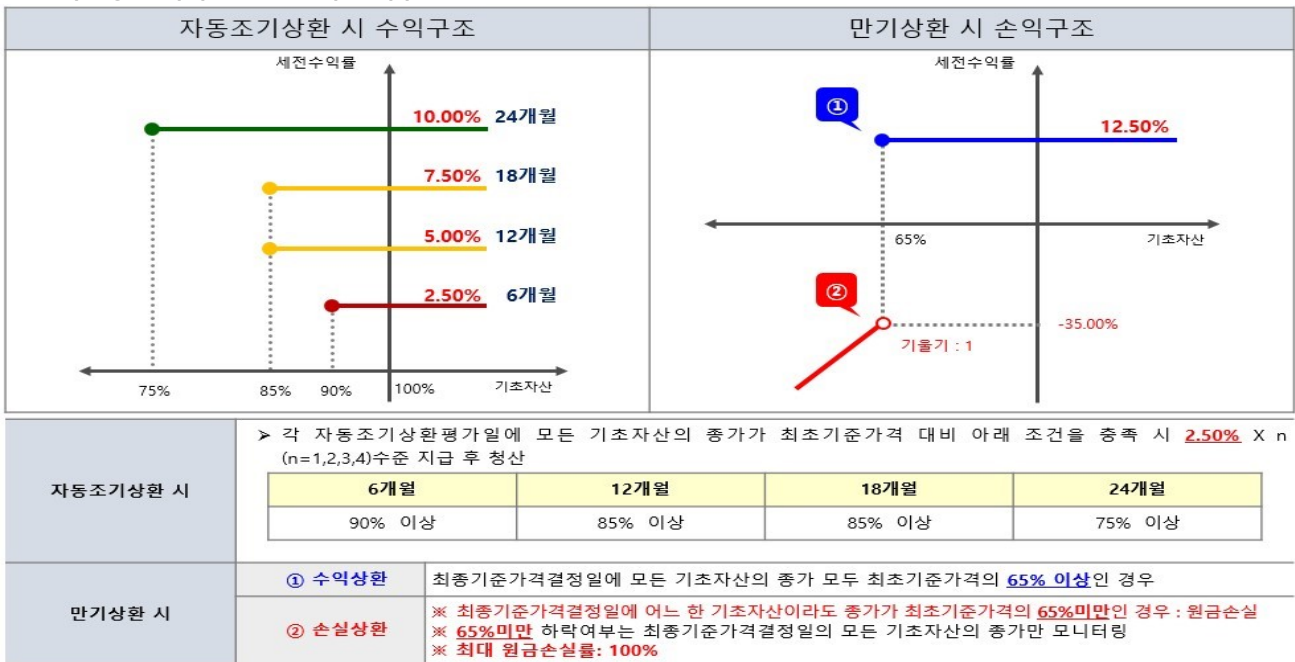
2021-10-05

## 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

75

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

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

기준일 : 2021-10-01

공시일:

2021-10-05

## 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

20

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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

79

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

20

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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>자동조기상환 시</p> <p>                     &gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>2.00%</b> 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 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>75% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>6.00%</b> 수익 지급                 </p> | <p>만기 상환 시</p> <p>                     ① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b>인 경우<br/>                     ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b>인 경우 : 원금손실<br/>                     ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br/>                     ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> </p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |   |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

52

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

29

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

2021-10-05

## 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

| 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 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>1.70%</b> 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 총가가 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 <b>75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>5.10%</b> 수익 지급                 </p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>                     ① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 <b>65% 이상</b>인 경우<br/>                     ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b>인 경우 : 원금손실<br/>                     ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 총가만 모니터링<br/>                     ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> </p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

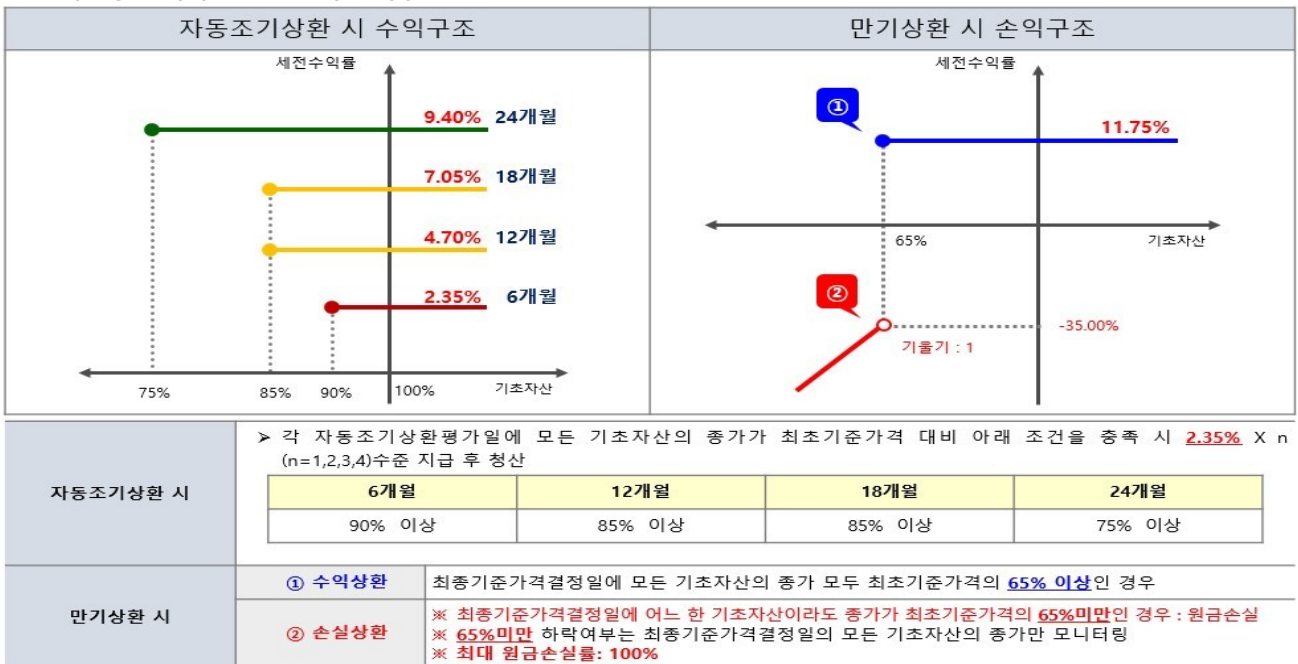
2021-10-05

## 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

223

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

153

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

기준일 : 2021-10-01

공시일:

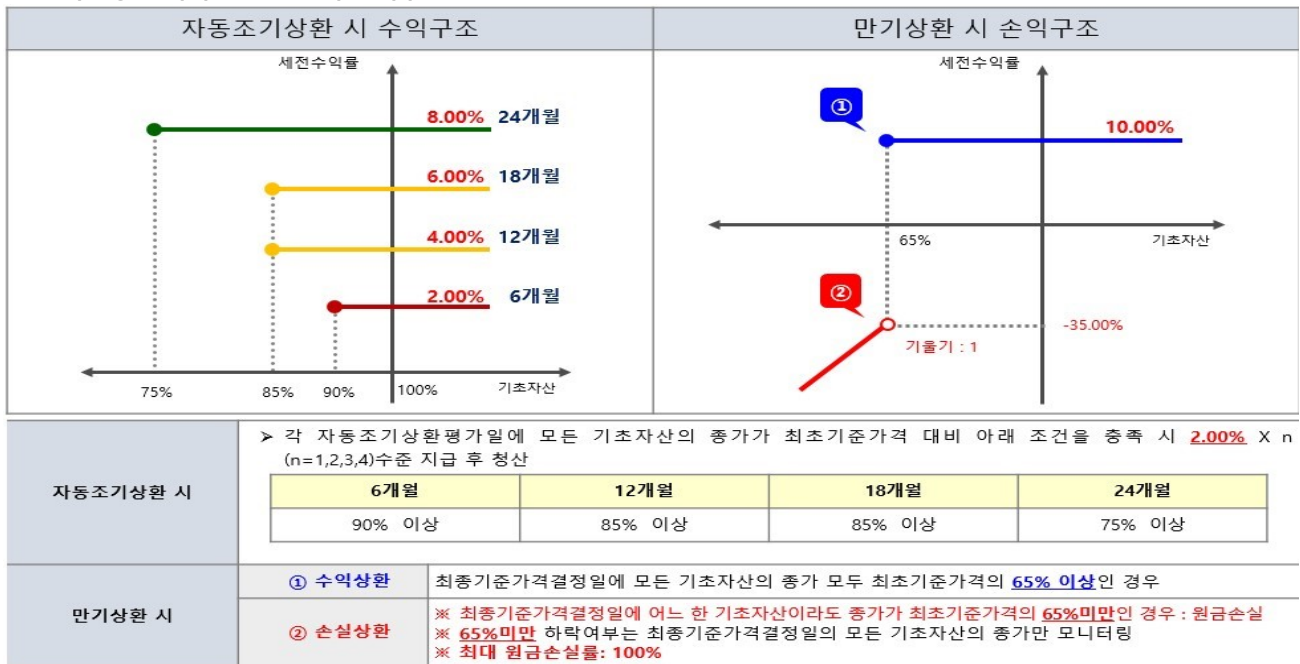
2021-10-05

## 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

113

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

108

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

기준일 : 2021-10-01

공시일:

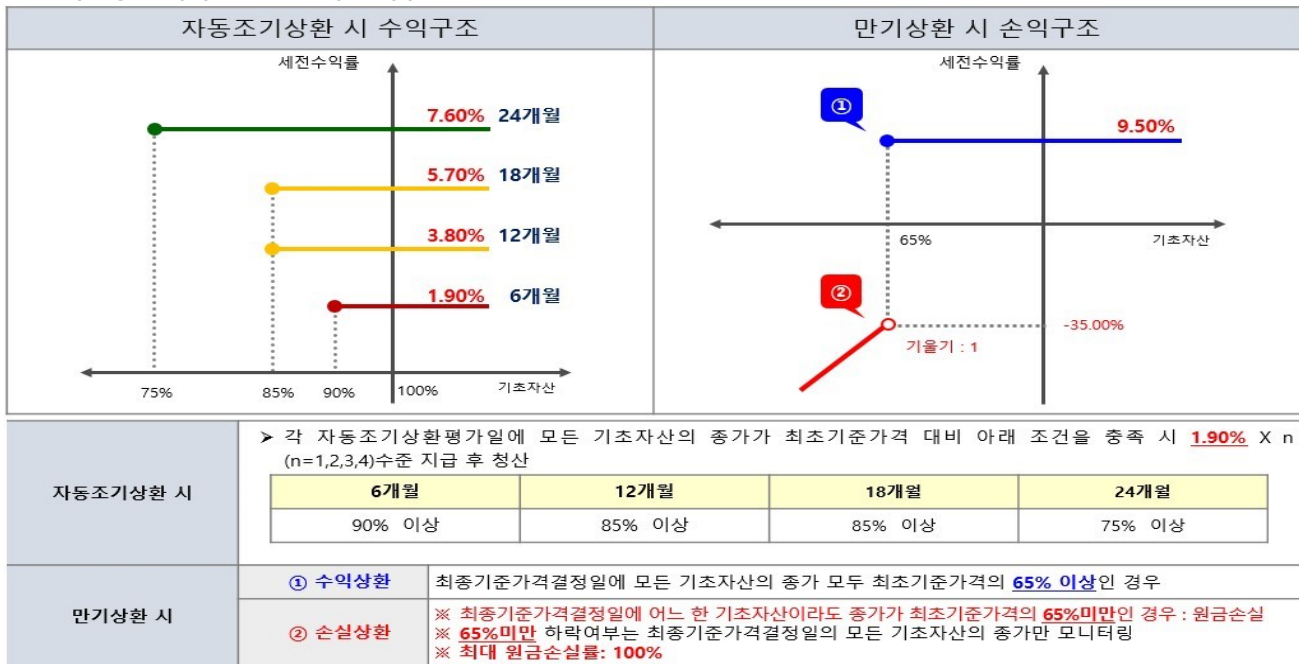
2021-10-05

## 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

130

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

108

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-16호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

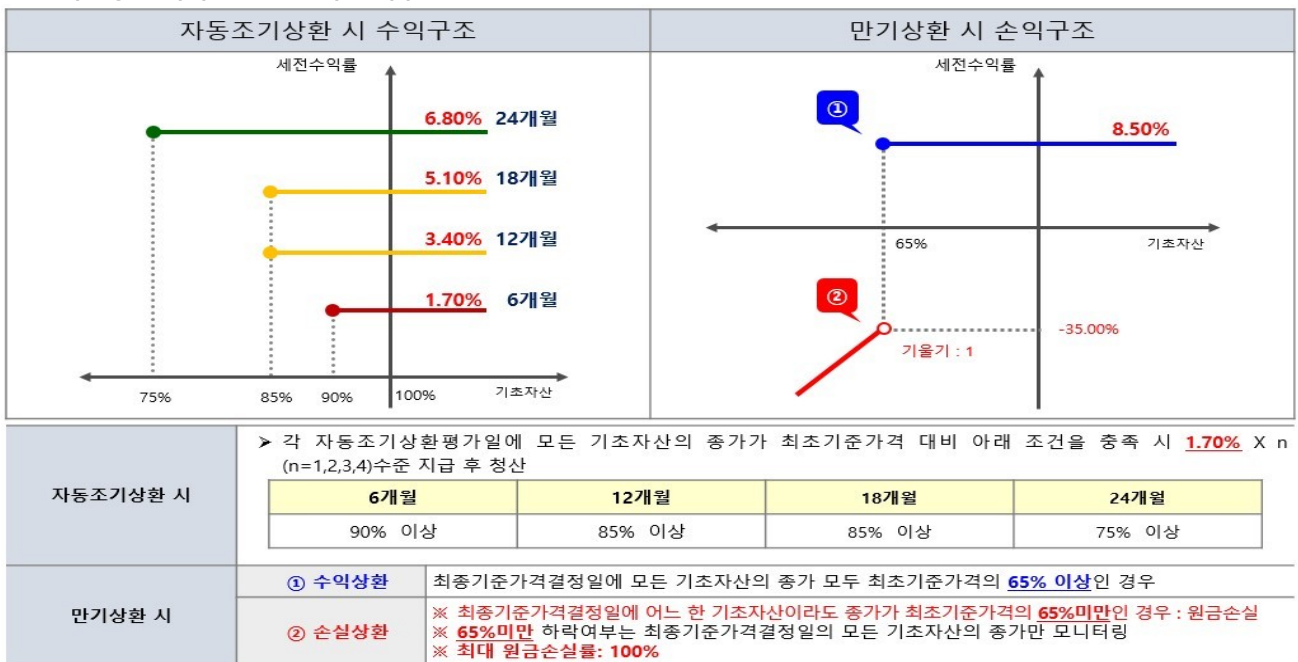
2021-10-05

## 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  | 972   |       | 972       | 장외 |
| 합계 |      |      | 972   |       | 972       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

74

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

24

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-42호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

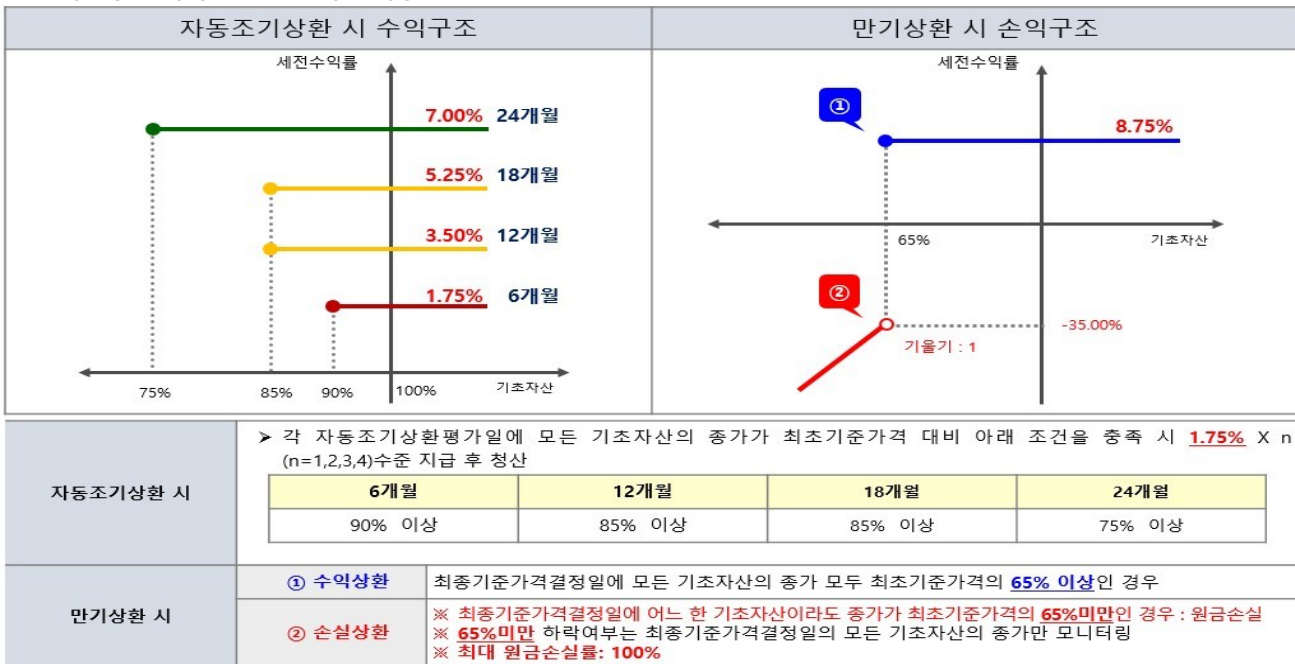
2021-10-05

## 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  | 2,896 |       | 2,896     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,896 |       | 2,896     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

231

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-11호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

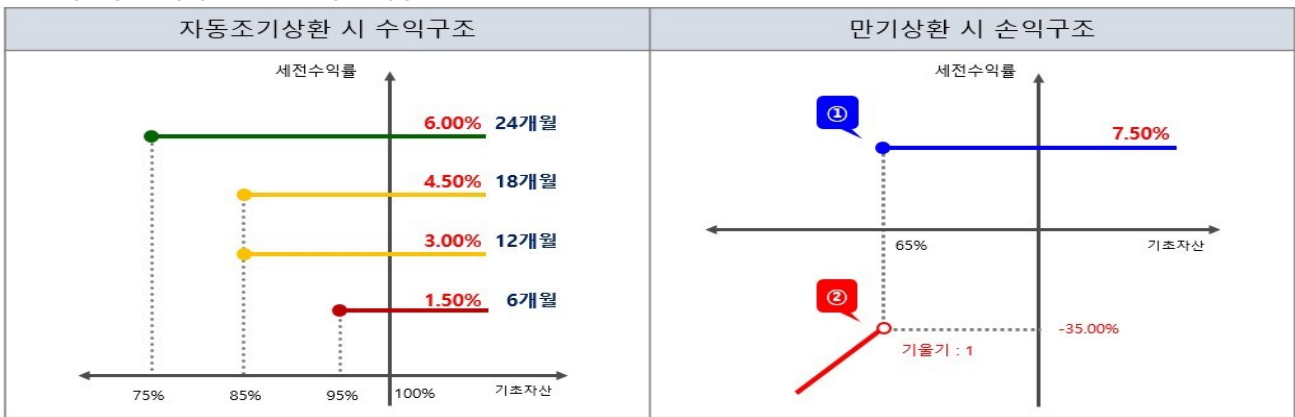
2021-10-05

## 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  | 1,335 |       | 1,335     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,335 |       | 1,335     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

▶ 각 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.50% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

| 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   |
|--------|--------|--------|--------|
| 95% 이상 | 85% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 |

만기상환 시

① 수익상환: 최종기준가격결정일에 기초자산의 증가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환: ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우: 원금손실  
 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 증가만 모니터링  
 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

67

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-12호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

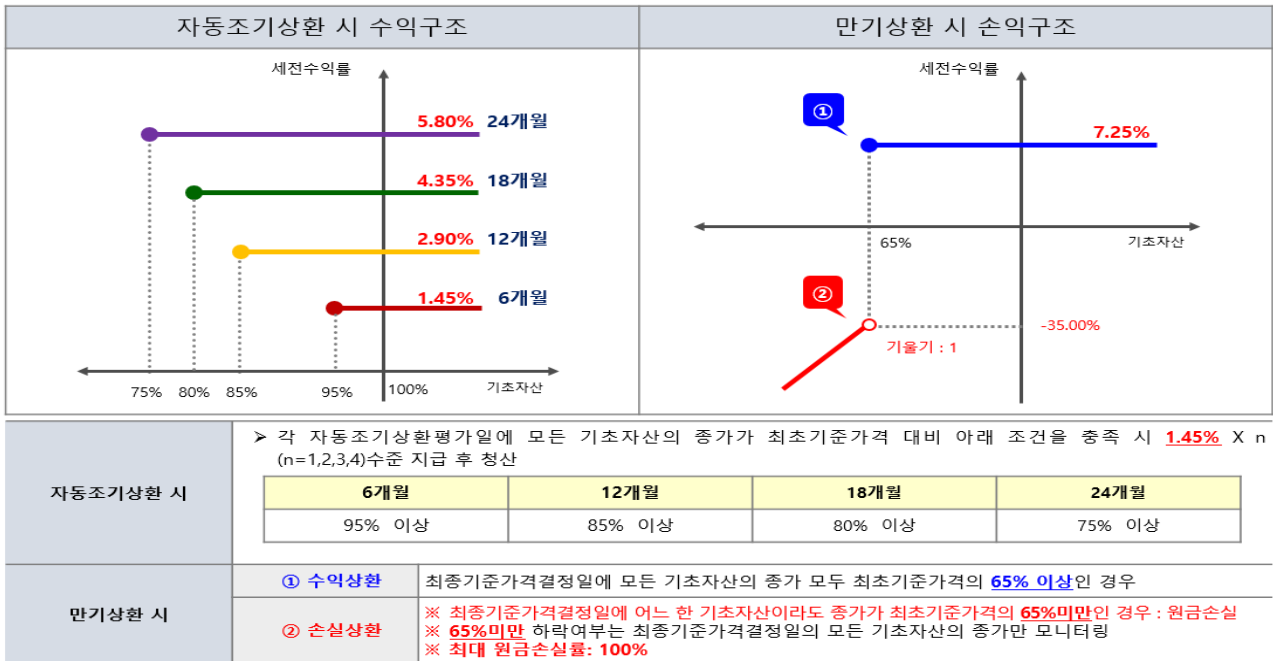
2021-10-05

## 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  | 511   |       | 511       | 장외 |
| 합계 |      |      | 511   |       | 511       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

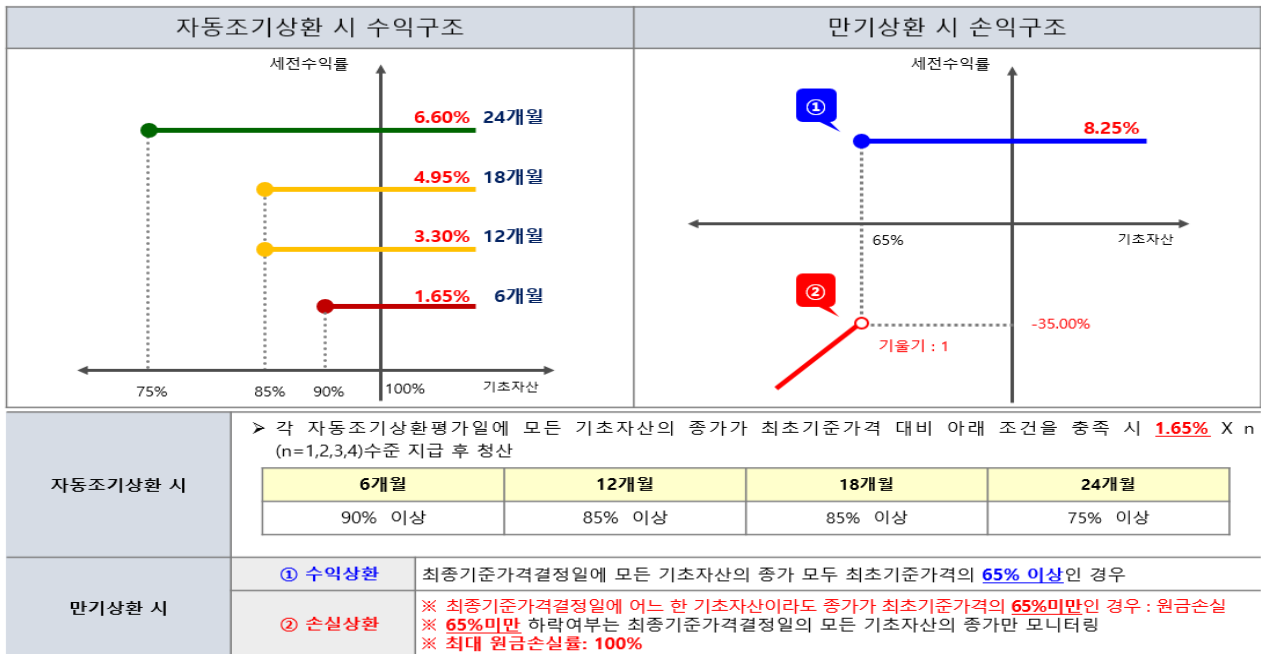
2021-10-05

## 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  | 2,429 |       | 2,429     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,429 |       | 2,429     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

188

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

153



# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-6호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

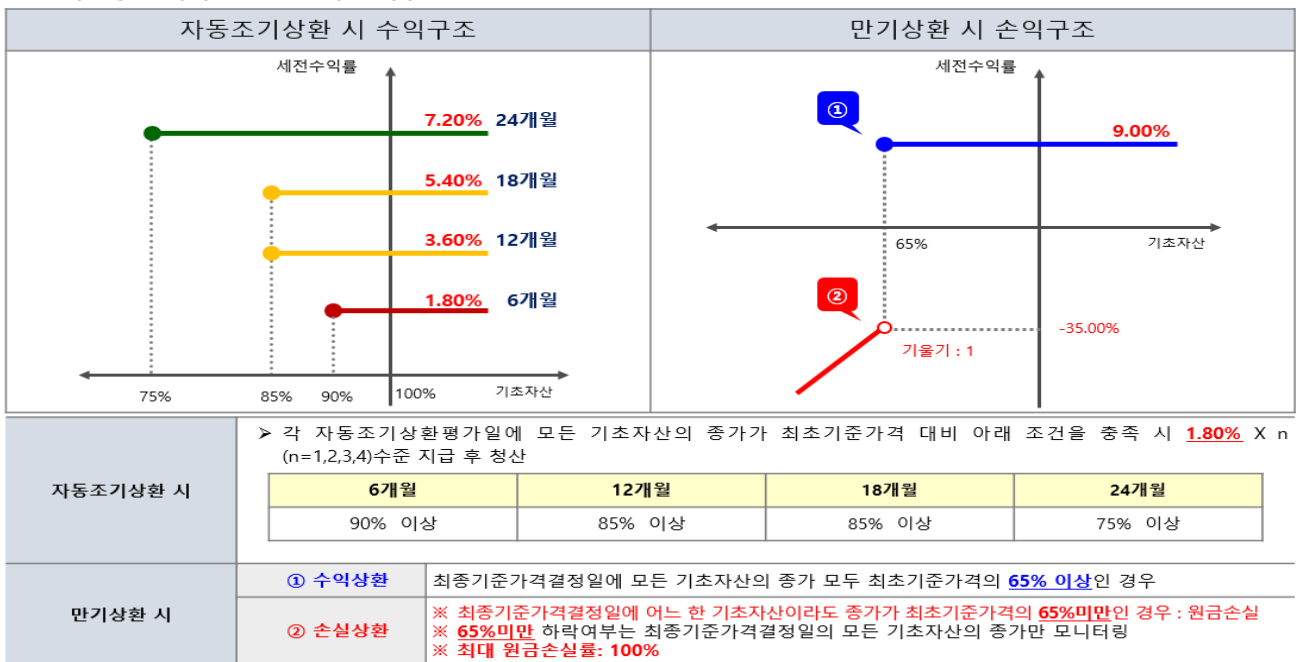
2021-10-05

## 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  | 1,448 |       | 1,448     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,448 |       | 1,448     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

95

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

45

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-14호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

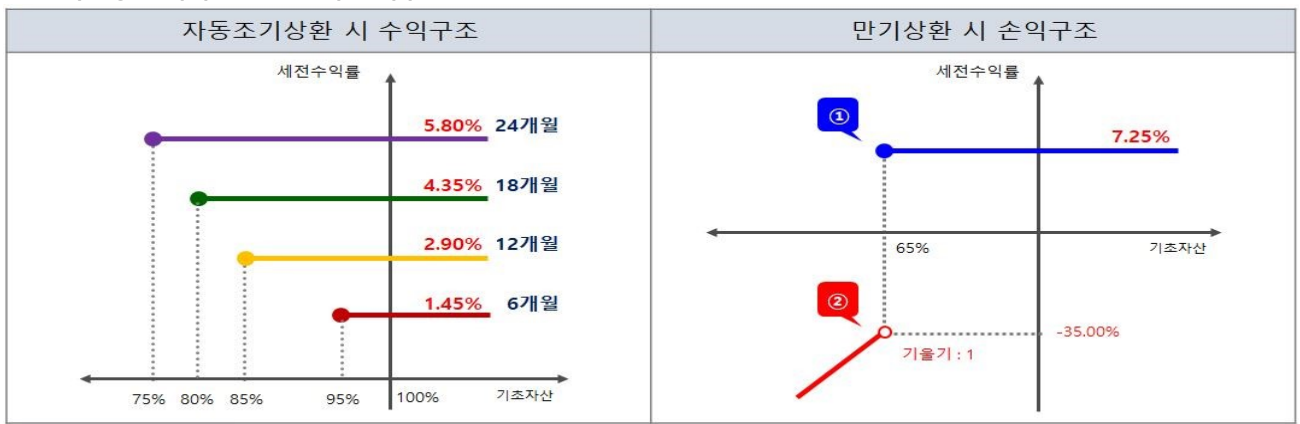
2021-10-05

## 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  | 141   |       | 141       | 장외 |
| 합계 |      |      | 141   |       | 141       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.45% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

| 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   |
|--------|--------|--------|--------|
| 95% 이상 | 85% 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: 원금손실  
 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링  
 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

7

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-10-01

공시일:

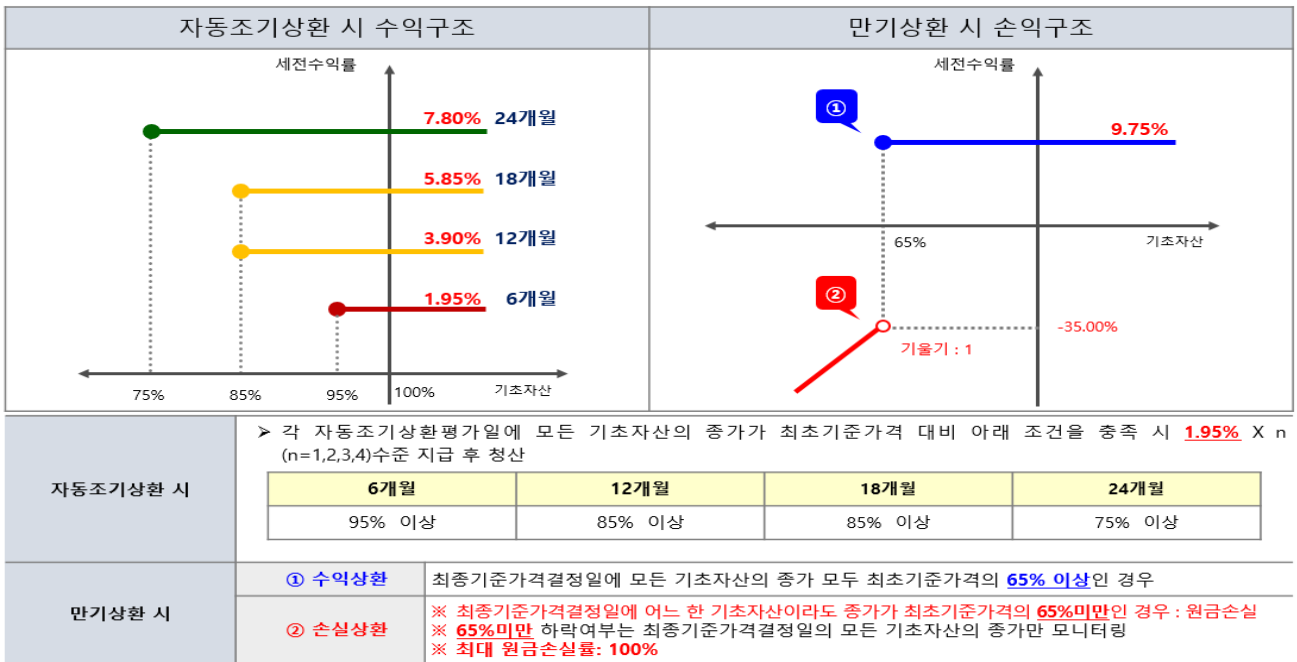
2021-10-05

## 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  | 2,116 |       | 2,116     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,116 |       | 2,116     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

138

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

85

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-15호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

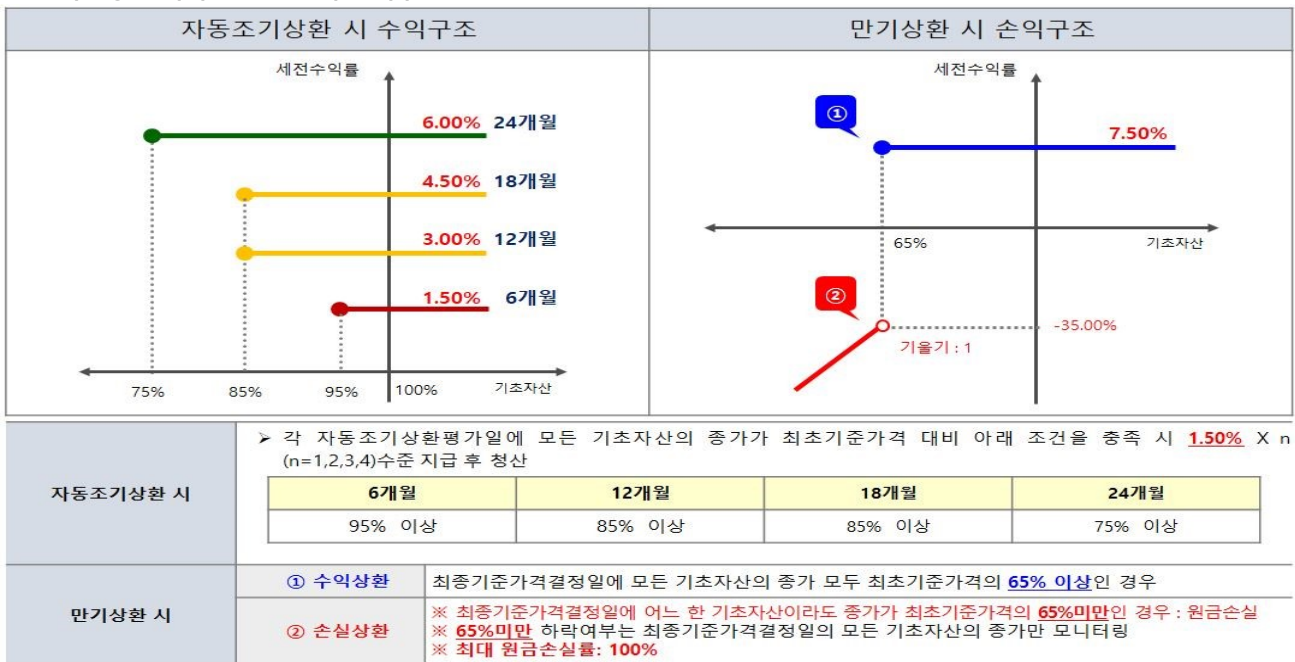
2021-10-05

## 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  | 97    |       | 97        | 장외 |
| 합계 |      |      | 97    |       | 97        |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-7호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

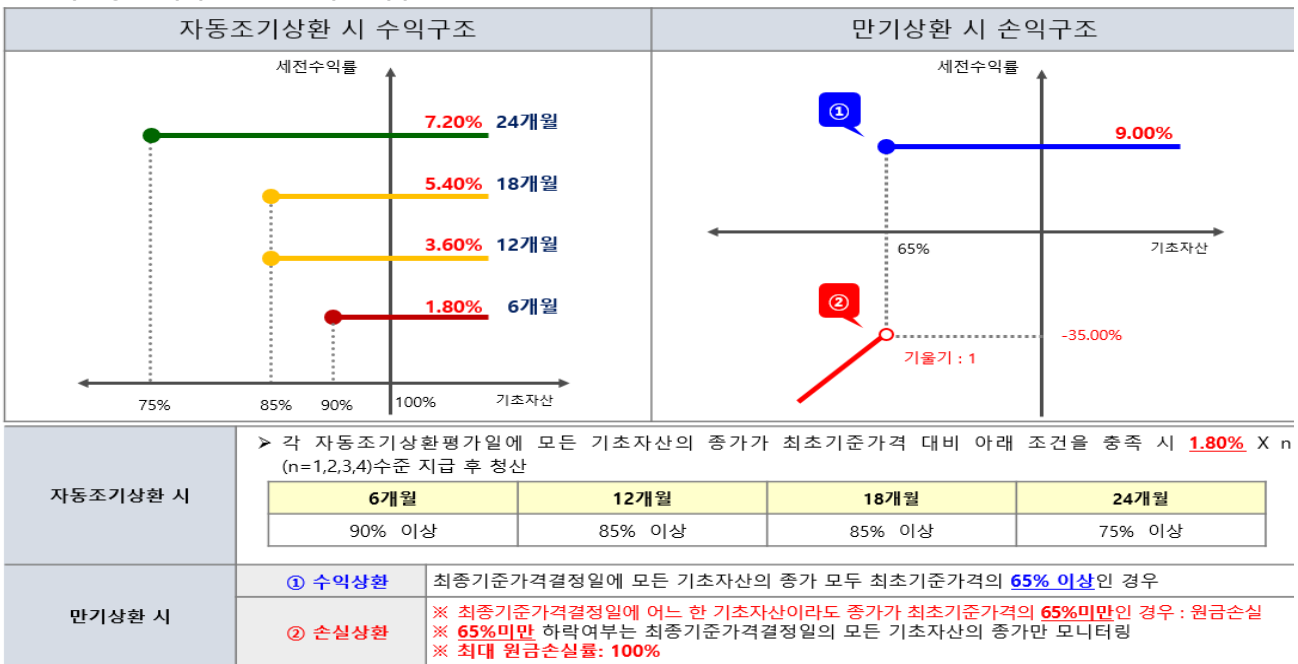
2021-10-05

## 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  | 537   |       | 537       | 장외 |
| 합계 |      |      | 537   |       | 537       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

34

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권HSN-1호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

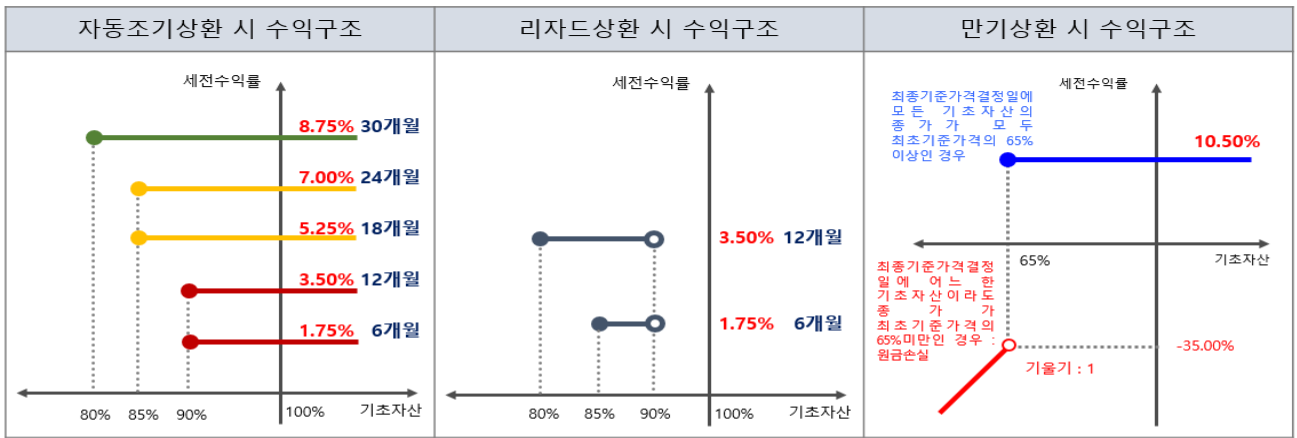
2021-10-05

## 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  | 1,850 |       | 1,850     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,850 |       | 1,850     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.75%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.50%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.50%</b> 수익 지급</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

147

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

190

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

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

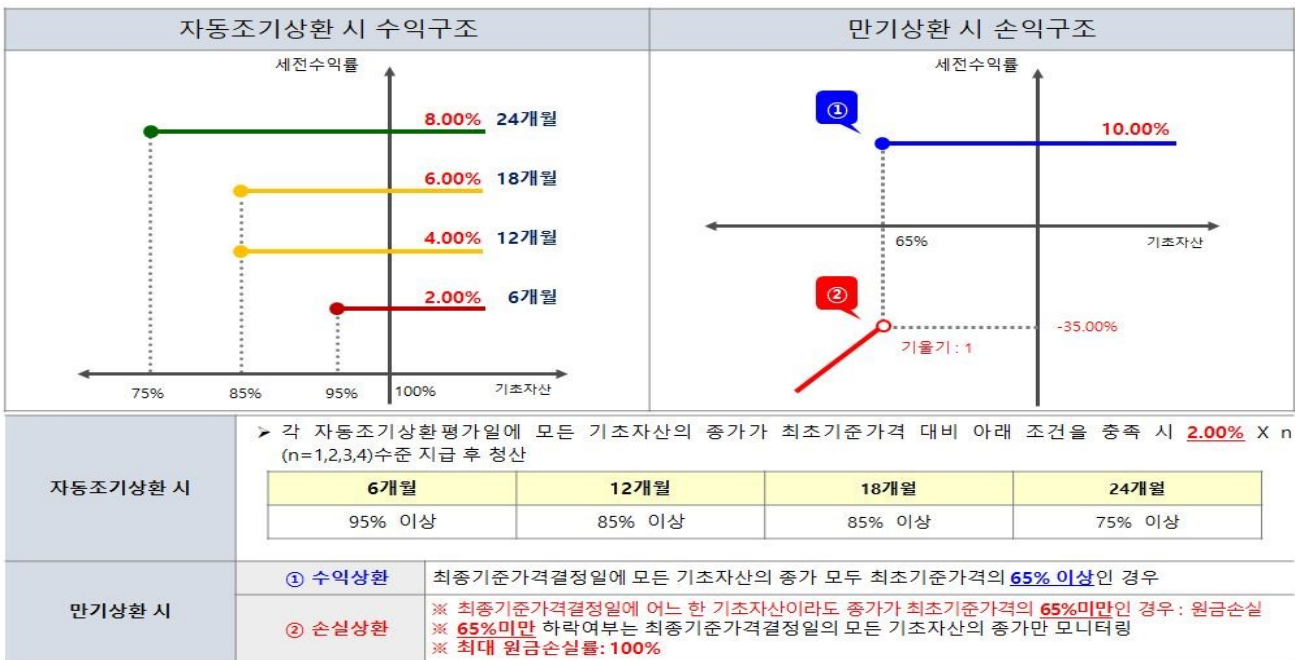
2021-10-05

## 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  | 942   |       | 942       | 장외 |
| 합계 |      |      | 942   |       | 942       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권HSN-2호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

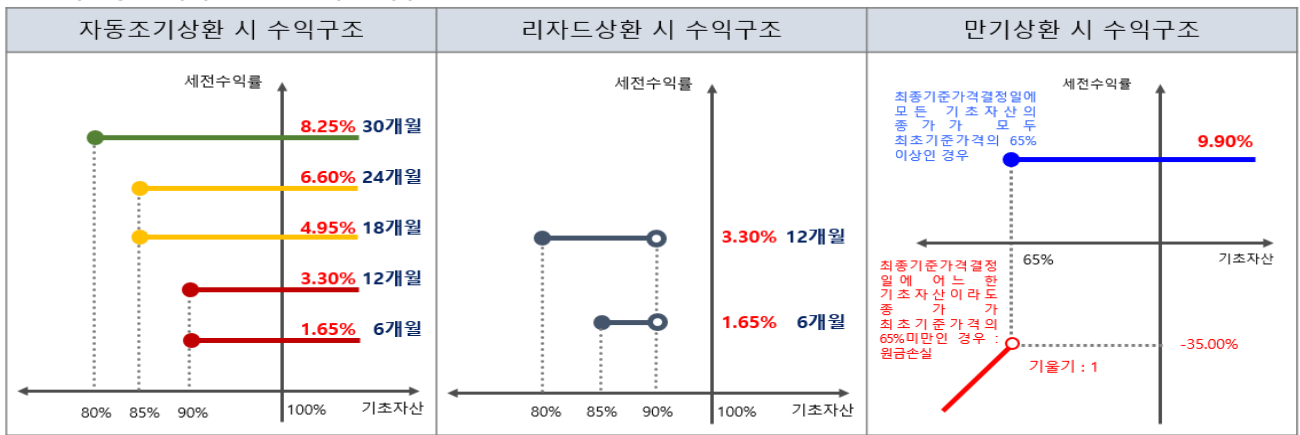
2021-10-05

## 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  | 450   |       | 450       | 장외 |
| 합계 |      |      | 450   |       | 450       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |   |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 1.65% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>   |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.30% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.30% 수익 지급</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>최대 원금손실률: 100%</li> </ul>  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

39

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SHE-1호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

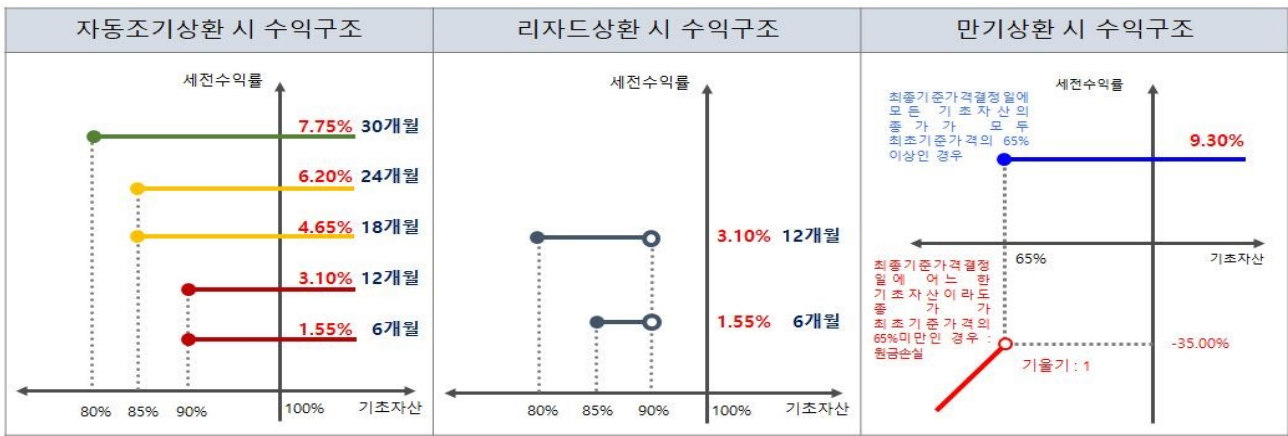
2021-10-05

## 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  | 777   |       | 777       | 장외 |
| 합계 |      |      | 777   |       | 777       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ 1.55% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>   |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>3.10%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>3.10%</b> 수익지급</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

60

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

63

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-8호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

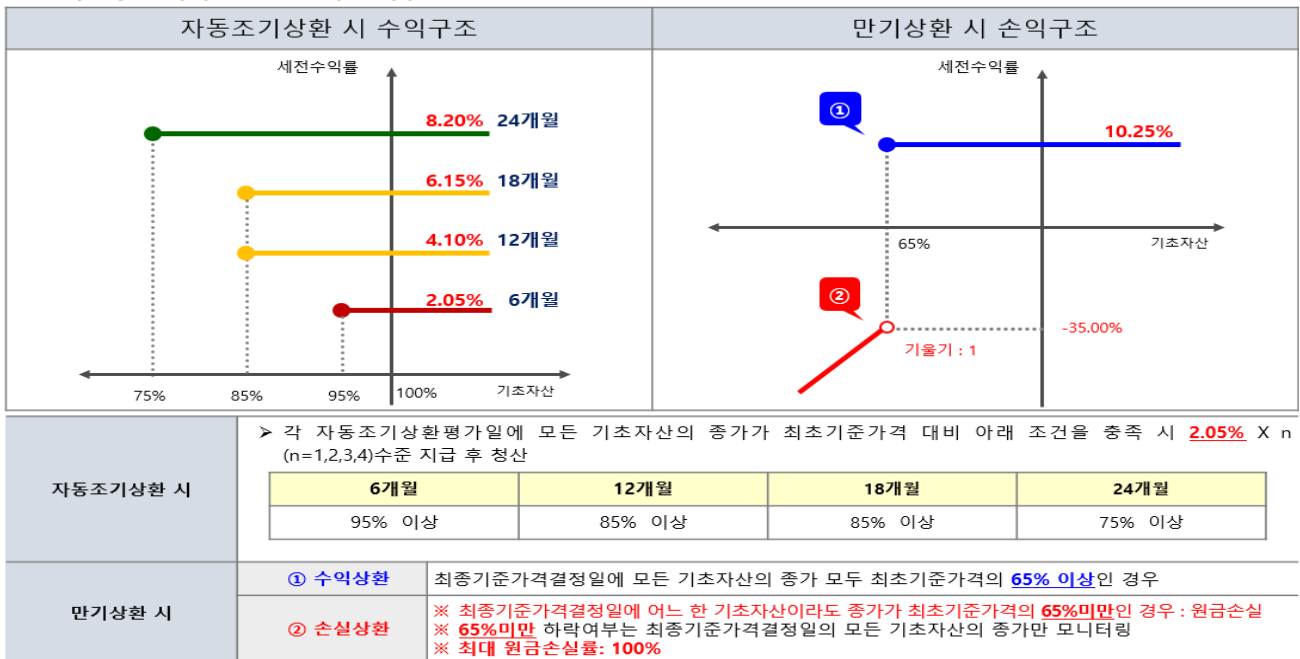
2021-10-05

## 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  | 1,286 |       | 1,286     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,286 |       | 1,286     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

78

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

40

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SHE-2호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

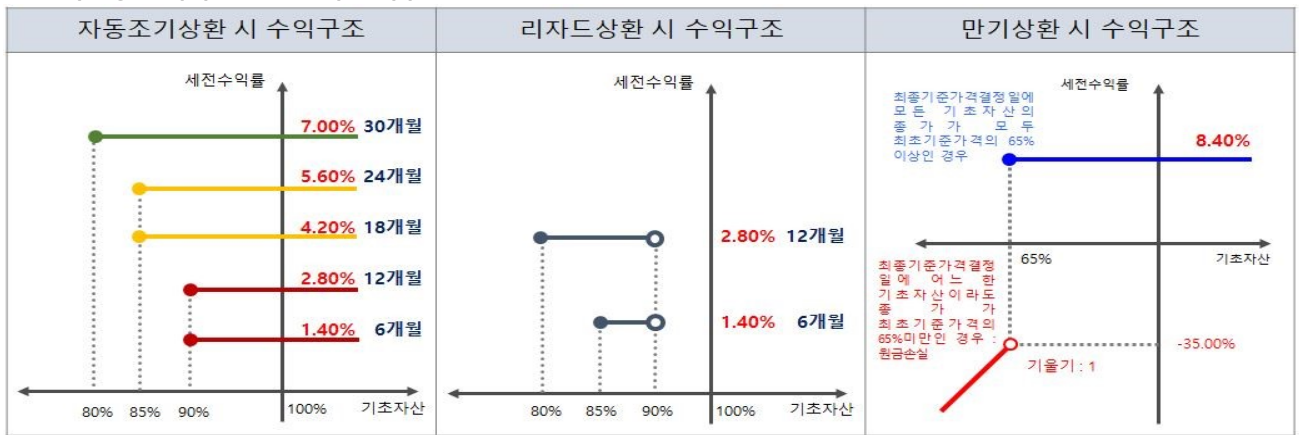
2021-10-05

## 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  | 512   |       | 512       | 장외 |
| 합계 |      |      | 512   |       | 512       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ 1.40% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>   |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 2.80% 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 <b>80%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 2.80% 수익지급</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

46

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

60

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-18호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

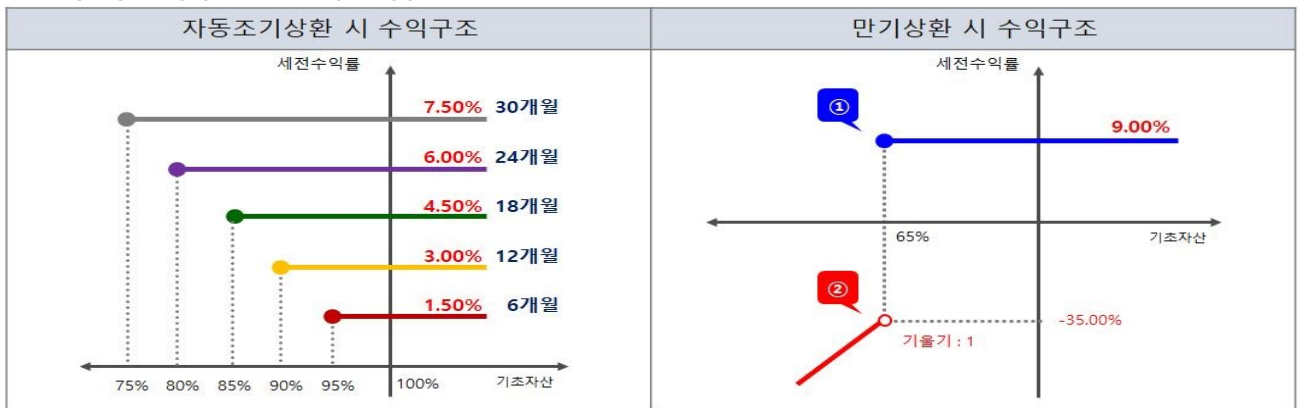
2021-10-05

## 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  | 331   |       | 331       | 장외 |
| 합계 |      |      | 331   |       | 331       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



> 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

| 자동조기상환 시 | 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   | 30개월   |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
|          | 95% 이상 | 90% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

| 만기상환 시 | ① 수익상환   | ② 손실상환   |
|--------|--|--|
|        | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우 | ※ 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

21

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-9호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

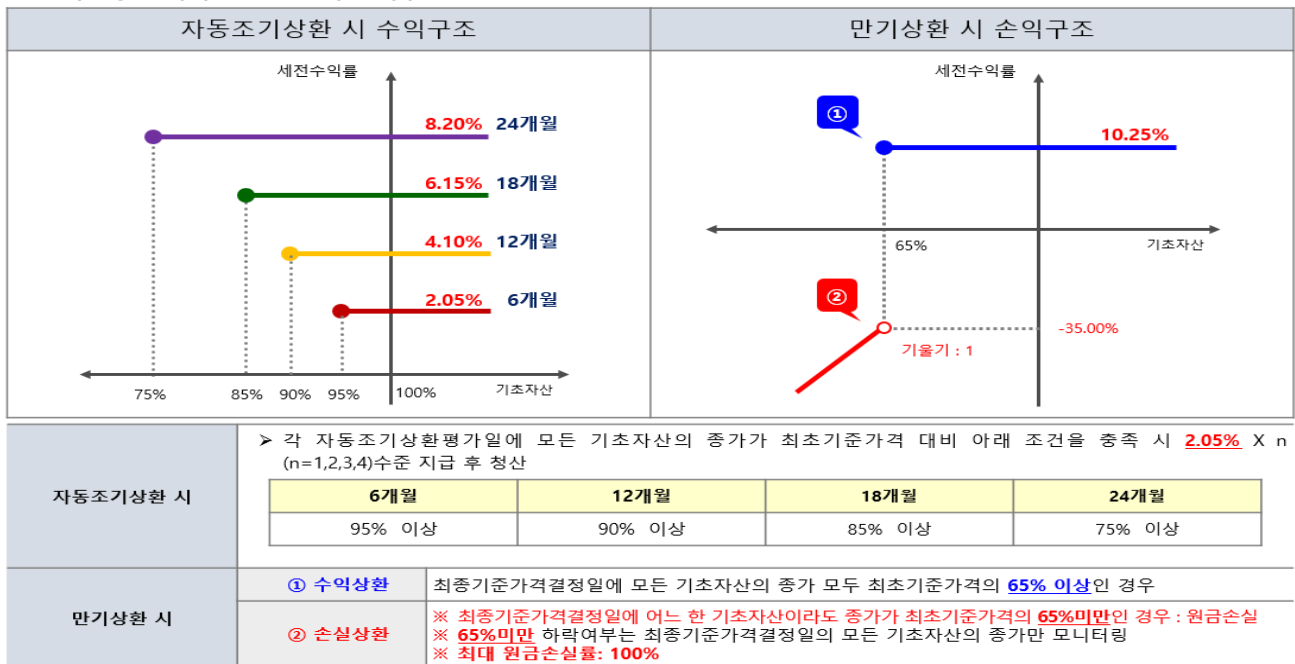
2021-10-05

## 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  | 750   |       | 750       | 장외 |
| 합계 |      |      | 750   |       | 750       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

43

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권SE(KRW)N-10호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

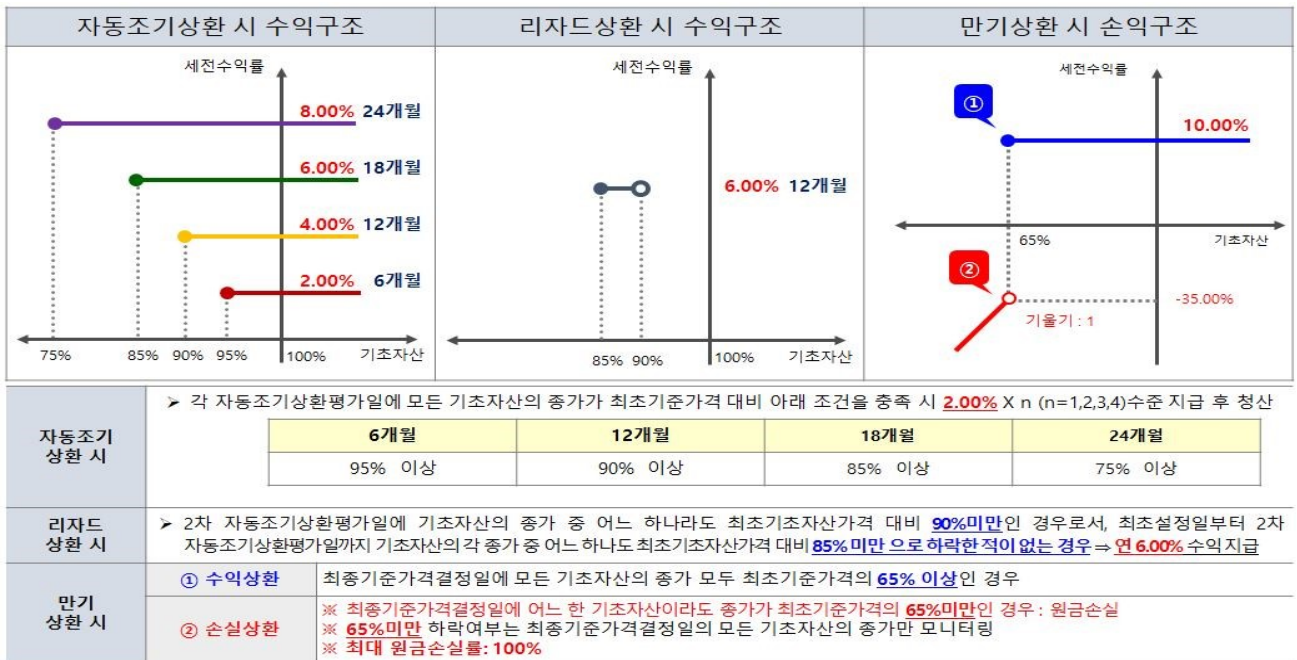
2021-10-05

## 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  | 180   |       | 180       | 장외 |
| 합계 |      |      | 180   |       | 180       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)H-1호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

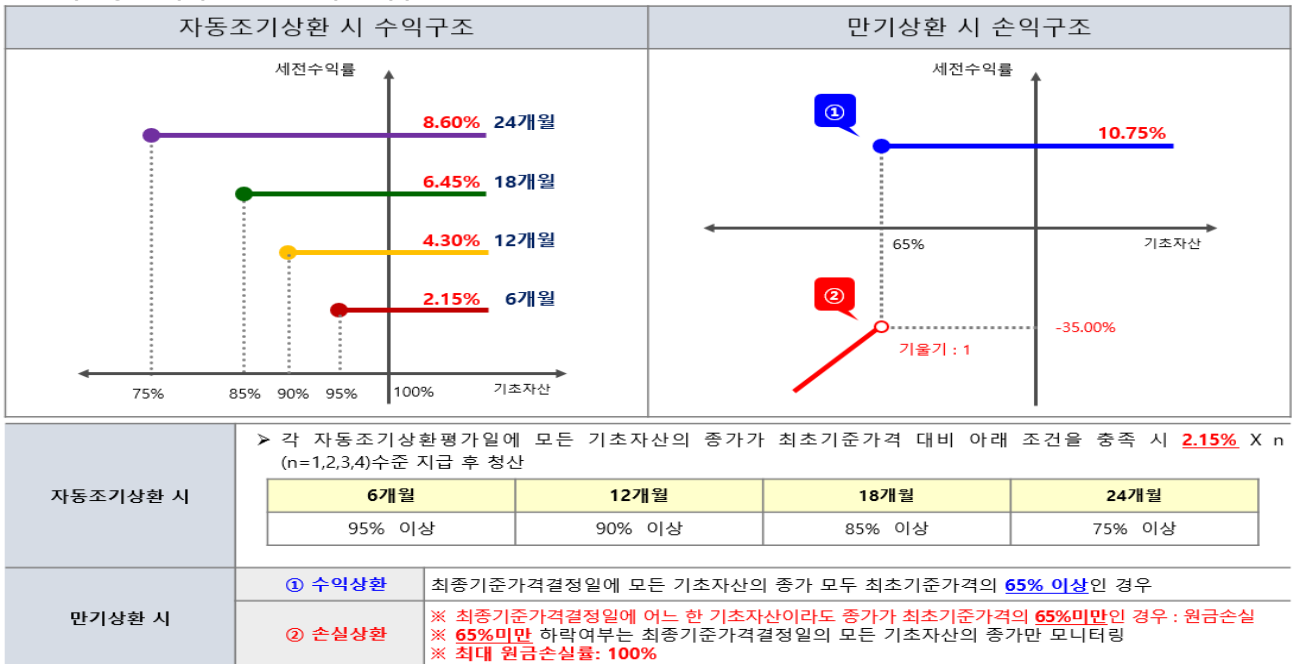
2021-10-05

## 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  | 424   |       | 424       | 장외 |
| 합계 |      |      | 424   |       | 424       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SHE-3호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

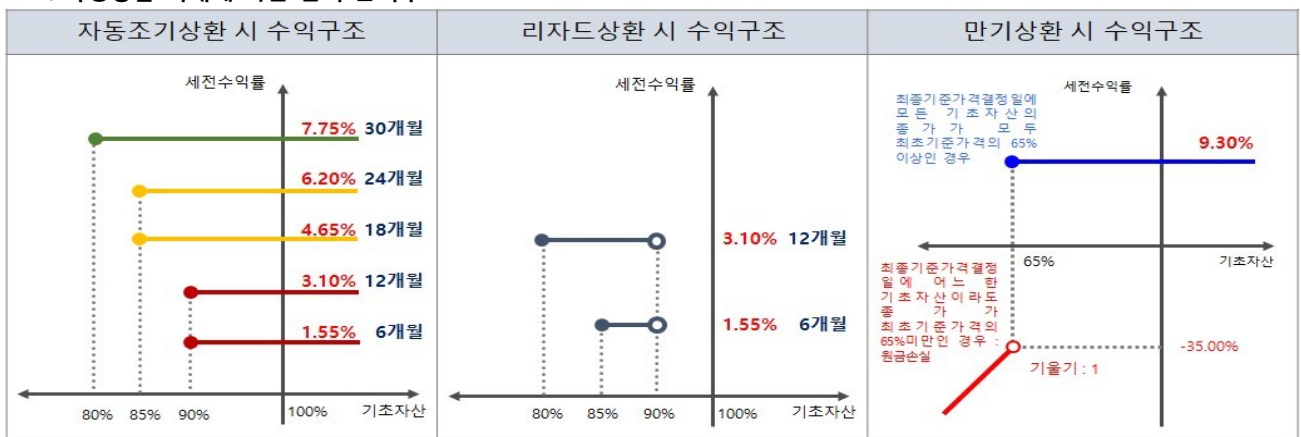
2021-10-05

## 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  | 498   |       | 498       | 장외 |
| 합계 |      |      | 498   |       | 498       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ 1.55% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>   |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.10%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>80%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.10%</b> 수익지급</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

41

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-10호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

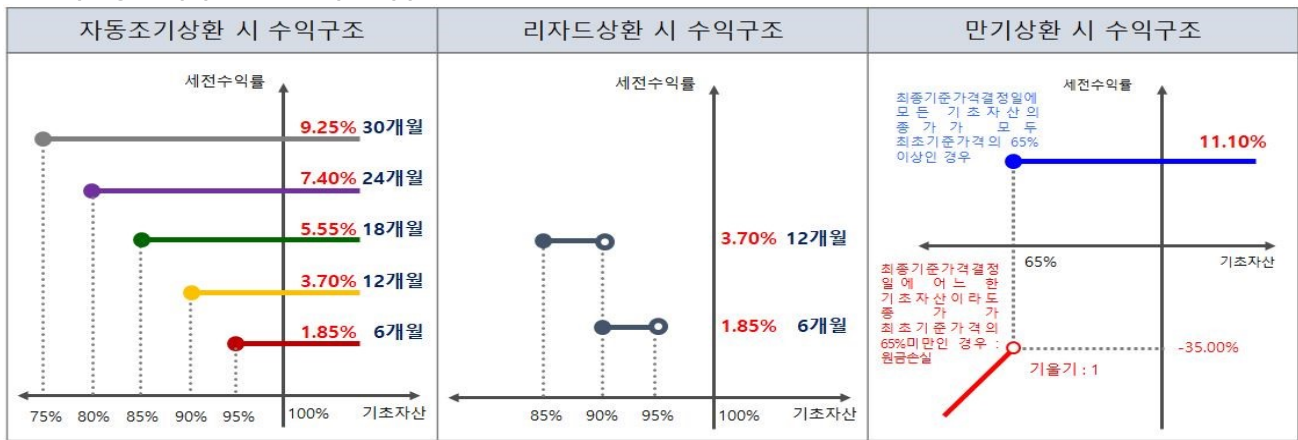
2021-10-05

## 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  | 1,241 |       | 1,241     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,241 |       | 1,241     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.85%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.70%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.70%</b> 수익 지급</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

83

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

74

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

기준일 : 2021-10-01

공시일:

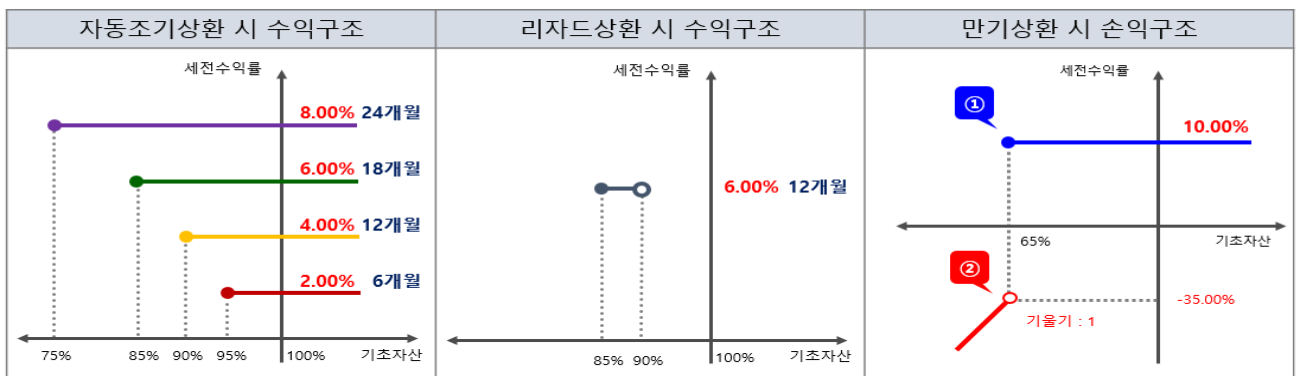
2021-10-05

## 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  | 167   |       | 167       | 장외 |
| 합계 |      |      | 167   |       | 167       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |  |        |        |
|----------|--|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산  |  |        |        |
|          | 6개월  | 12개월   | 18개월   | 24개월   |
|          | 95% 이상   | 90% 이상   | 85% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 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

12

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-11호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

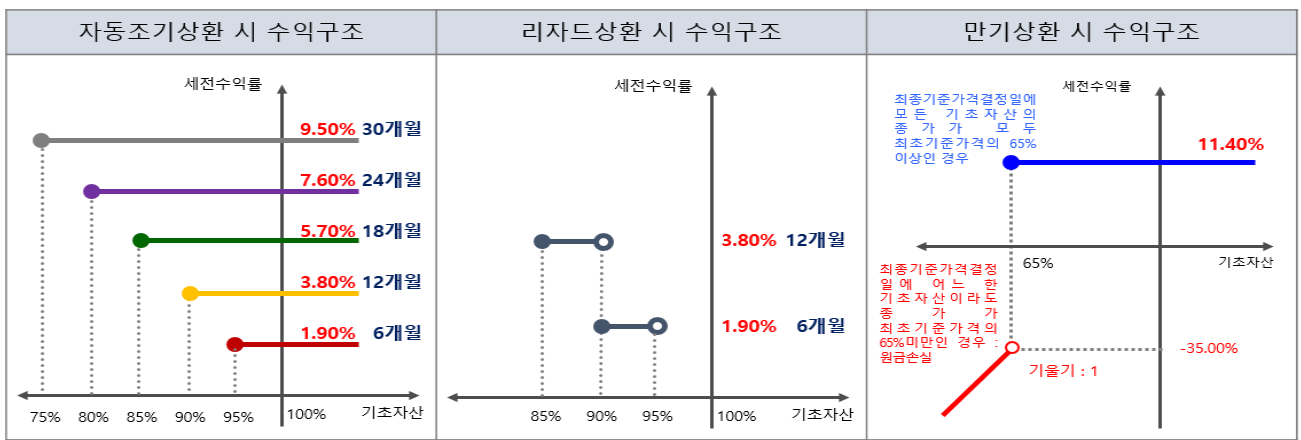
2021-10-05

## 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  | 1,395 |       | 1,395     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,395 |       | 1,395     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.90%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.80%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.80%</b> 수익 지급</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

90

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

91

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-12호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

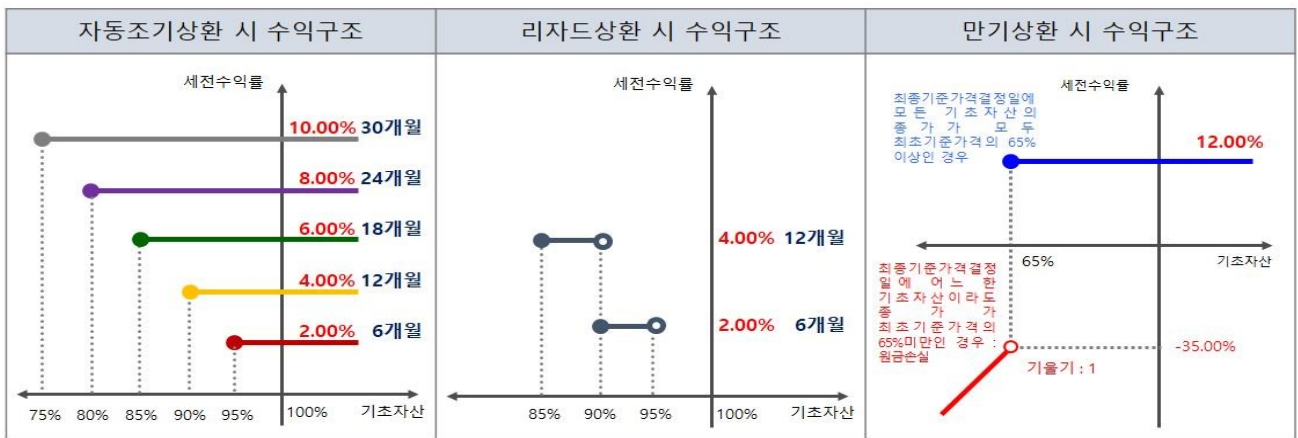
2021-10-05

## 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  | 2,464 |       | 2,464     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,464 |       | 2,464     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 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>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.00%</b> 수익 지급</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

155

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

168

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-13호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

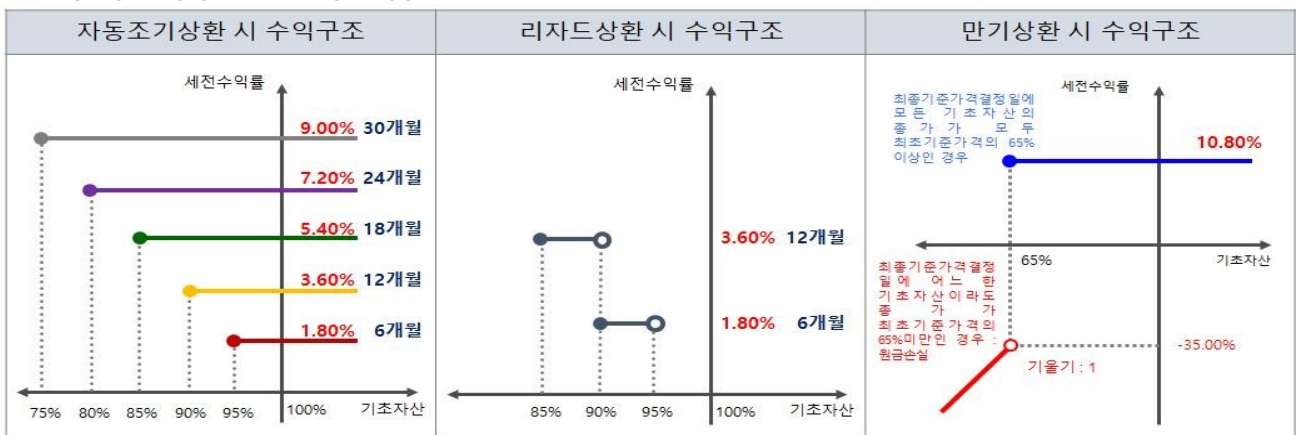
2021-10-05

## 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  | 936   |       | 936       | 장외 |
| 합계 |      |      | 936   |       | 936       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.80% X n</b> (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.60%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.60%</b> 수익지급</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

58

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

48

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

기준일 : 2021-10-01

공시일:

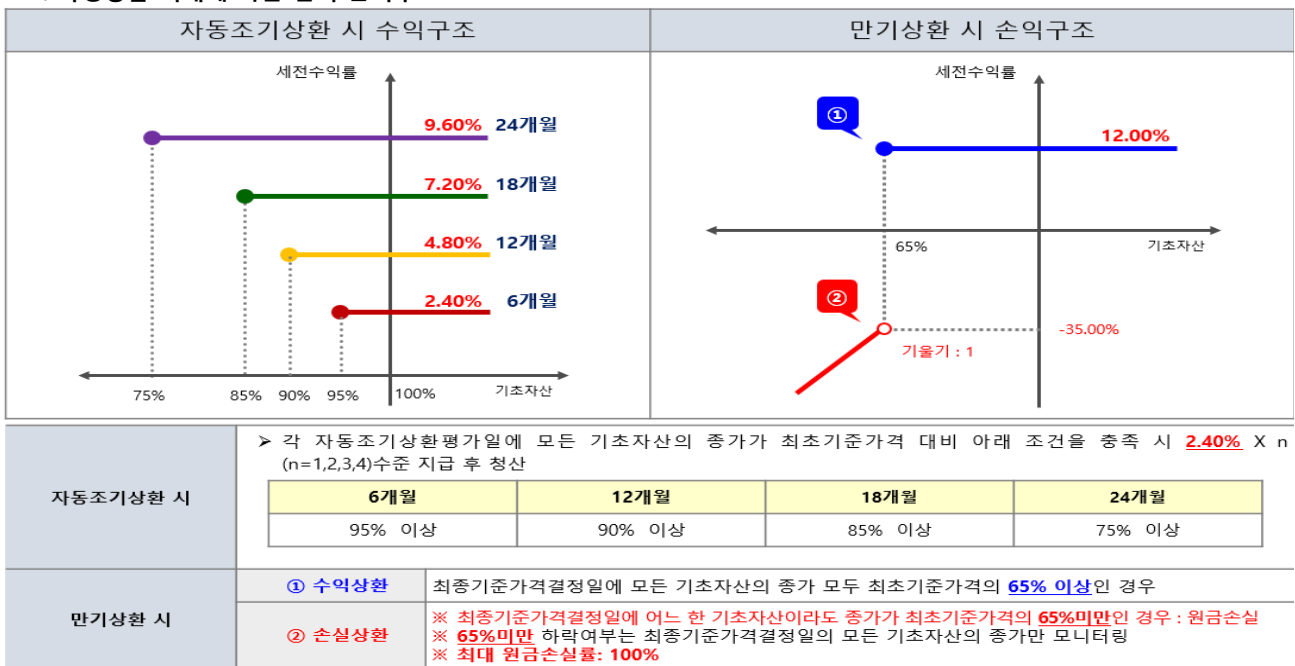
2021-10-05

## 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  | 103   |       | 103       | 장외 |
| 합계 |      |      | 103   |       | 103       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-14호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

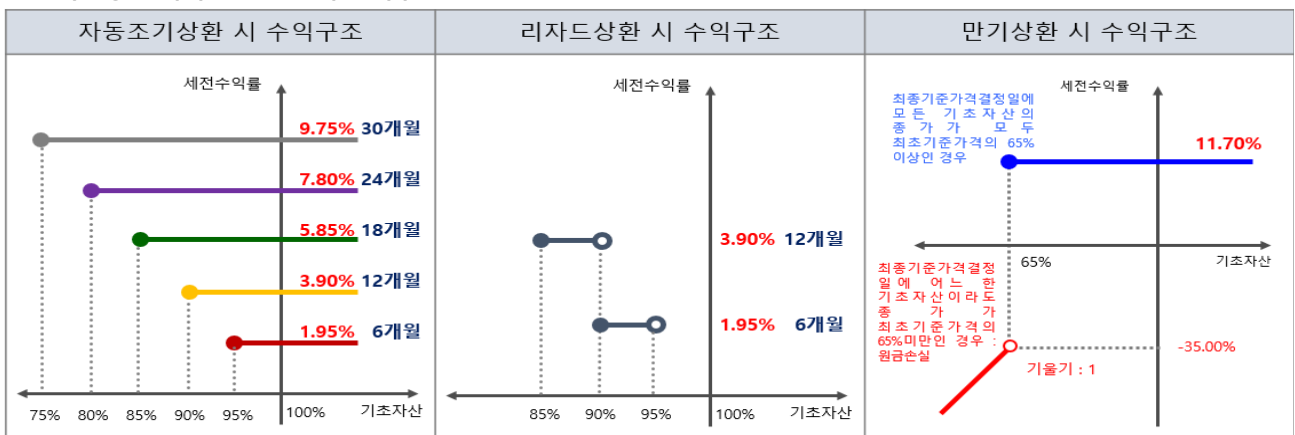
2021-10-05

## 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  | 1,523 |       | 1,523     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,523 |       | 1,523     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.95%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.90%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.90%</b> 수익 지급</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

94

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

89

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-15호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

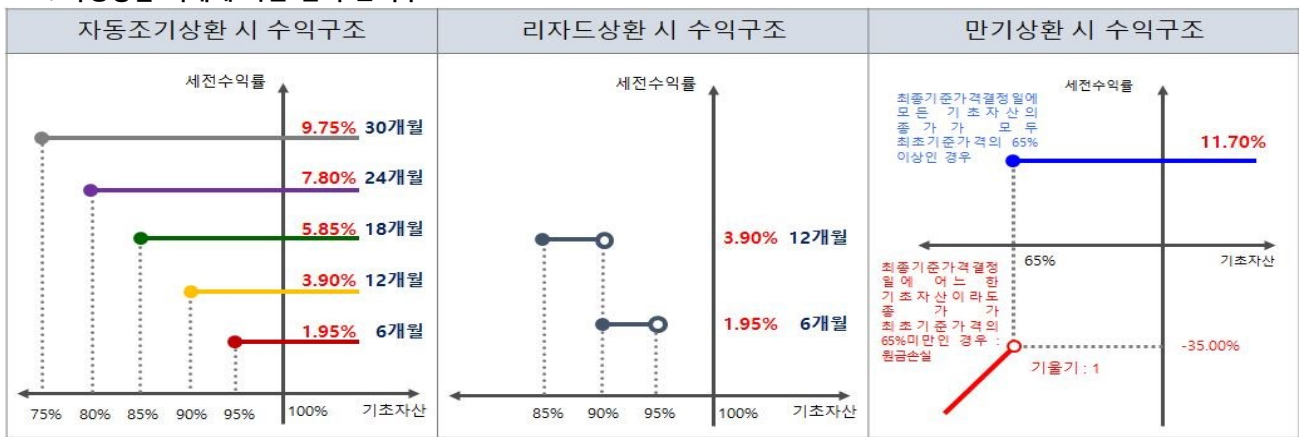
2021-10-05

## 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  | 1,891 |       | 1,891     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,891 |       | 1,891     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 1.95% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>   |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>3.90%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>3.90%</b> 수익지급</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

115

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

99

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-16호(온라인)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일: 2021-10-05

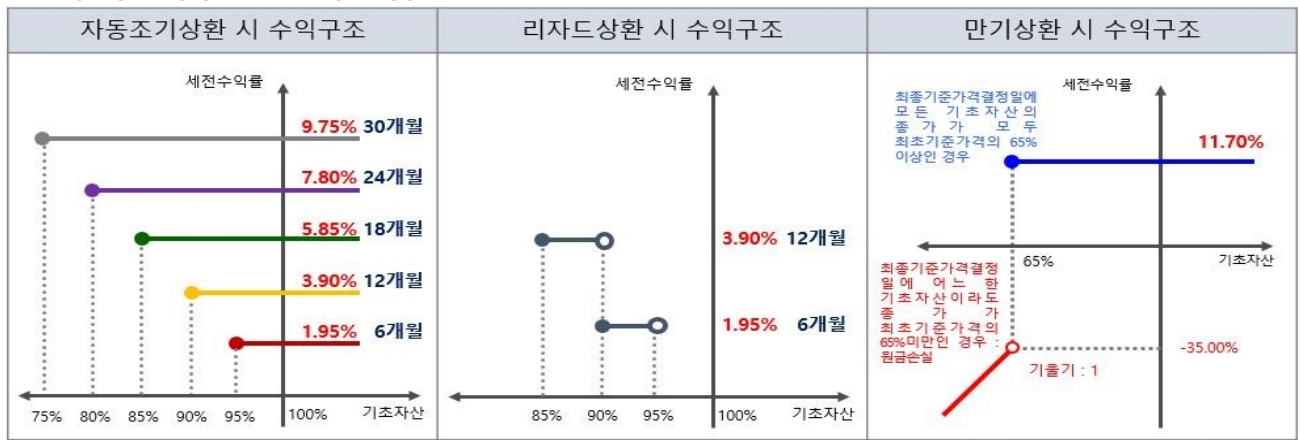
2021-10-05

## 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  | 3,115 |       | 3,115     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,115 |       | 3,115     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.95%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.90%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.90%</b> 수익 지급</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <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

183

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

170

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-17호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

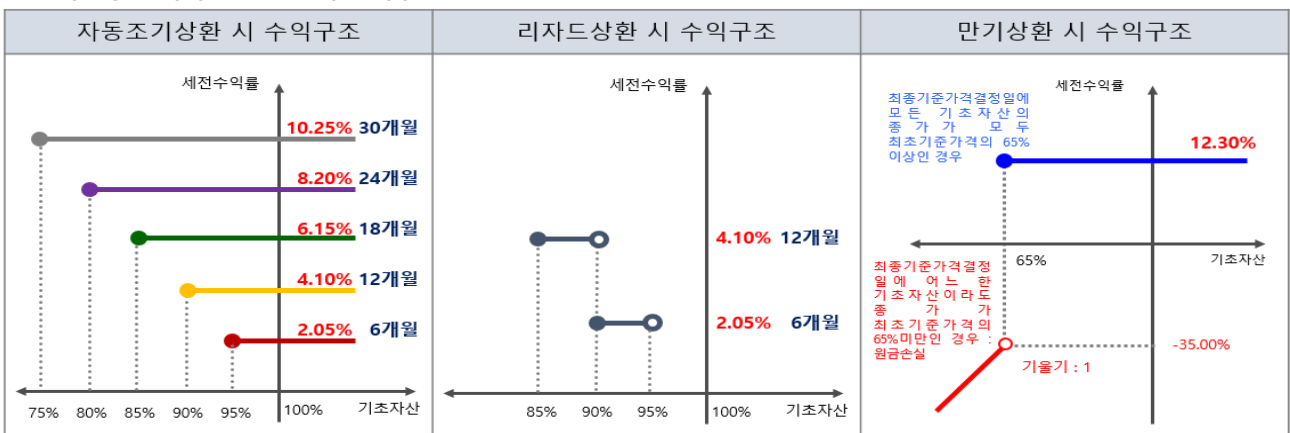
2021-10-05

## 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  | 1,287 |       | 1,287     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,287 |       | 1,287     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.05%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.10%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.10%</b> 수익 지급</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

76

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

74

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-44호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

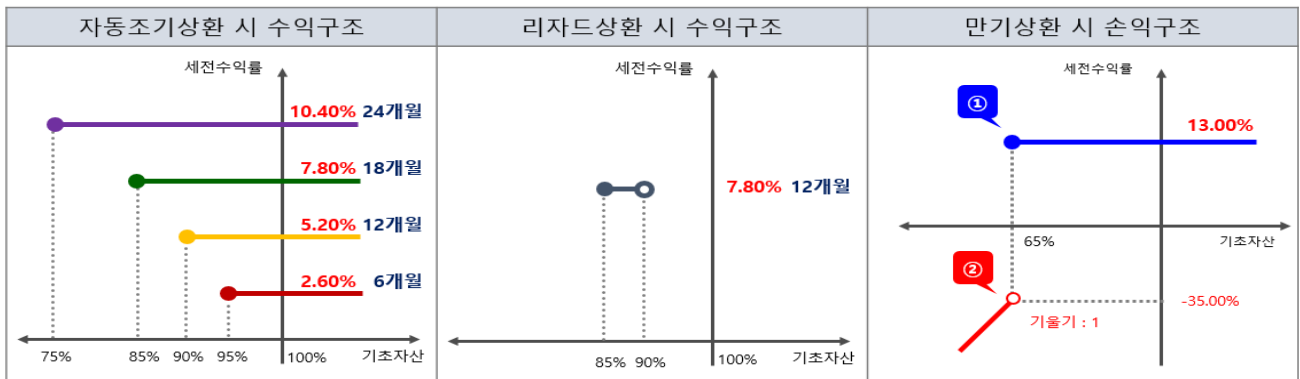
2021-10-05

## 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  | 320   |       | 320       | 장외 |
| 합계 |      |      | 320   |       | 320       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| 자동조기상환 시 | <p>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>2.60%</b> X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> <tr> <td>95% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </table>                   | 6개월    | 12개월   | 18개월 | 24개월 | 95% 이상 | 90% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 |
|----------|--|--------|--------|------|------|--------|--------|--------|--------|
| 6개월      | 12개월   | 18개월   | 24개월   |      |      |        |        |        |        |
| 95% 이상   | 90% 이상   | 85% 이상 | 75% 이상 |      |      |        |        |        |        |
| 리자드상환 시  | <p>▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 7.80%</b> 수익 지급</p>   |        |        |      |      |        |        |        |        |
| 만기상환 시   | <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b>인 경우</p> <p>② 손실상환 :<br/>                 ※ 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></p> |        |        |      |      |        |        |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-18호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-10-01

공시일:

2021-10-05

## 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  | 1,840 |       | 1,840     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,840 |       | 1,840     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.05%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.10%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.10%</b> 수익 지급</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

111

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

113