

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	299	-299	장내
누계	주가지수	선물	1,794	0	1,794	장내
신규	주가지수	옵션	2	0	2	장내
누계	주가지수	옵션	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	379	-379	장내
합계			1,794	379	1,415	

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

142

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

116

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	120	-120	장내
누계	주가지수	선물	17,240	100	17,140	장내
합계			17,240	100	17,140	

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

1,356

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,378

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

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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 동 조 기 상 환 시</p> <p>> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 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 자 드 상 환 시</p> <p>> 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 4.95% 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 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

171

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

168

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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

45

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

38

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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

176

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

152

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

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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 동 조 기 상 환 시</p> <p>> 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 자 드 상 환 시</p> <p>> 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 기 상 환 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 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

138

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

141

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

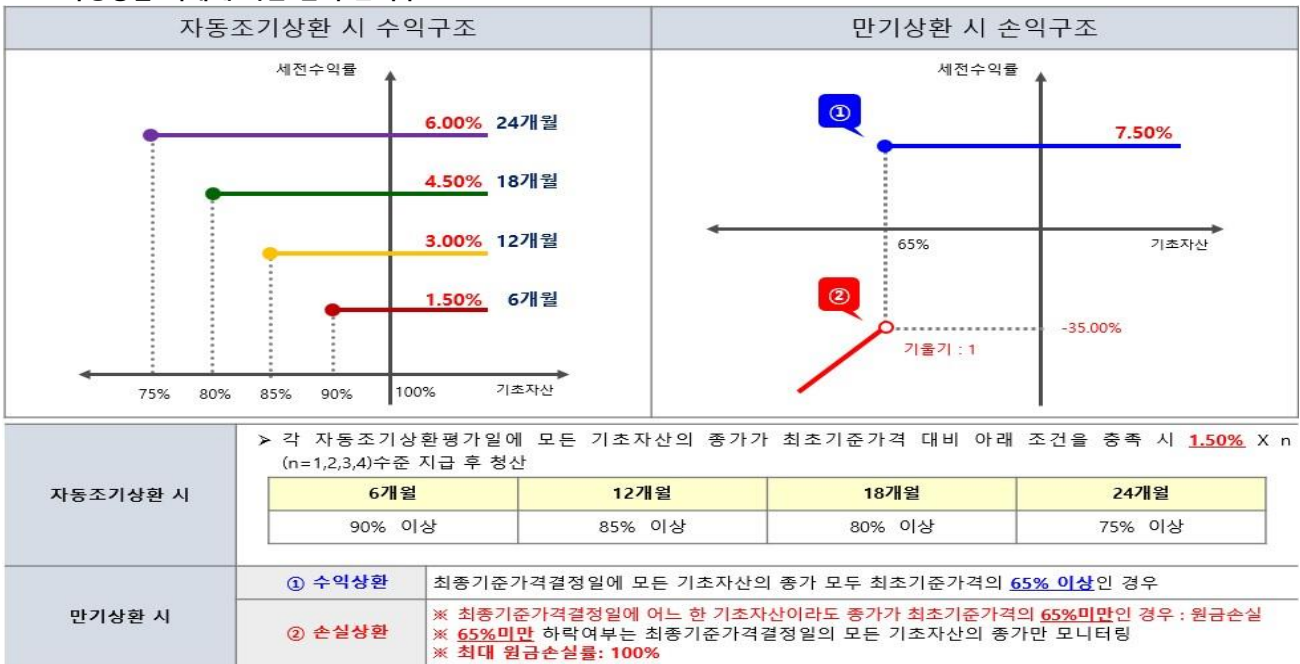
2021-12-28

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

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

37

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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

162

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

176

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

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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	1,099		1,099	장외
합계			1,099		1,099	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>> 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 자 드 상 환 시</p> <p>> 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 기 상 환 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 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

92

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

85

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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

53

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

50

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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

132

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

119

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

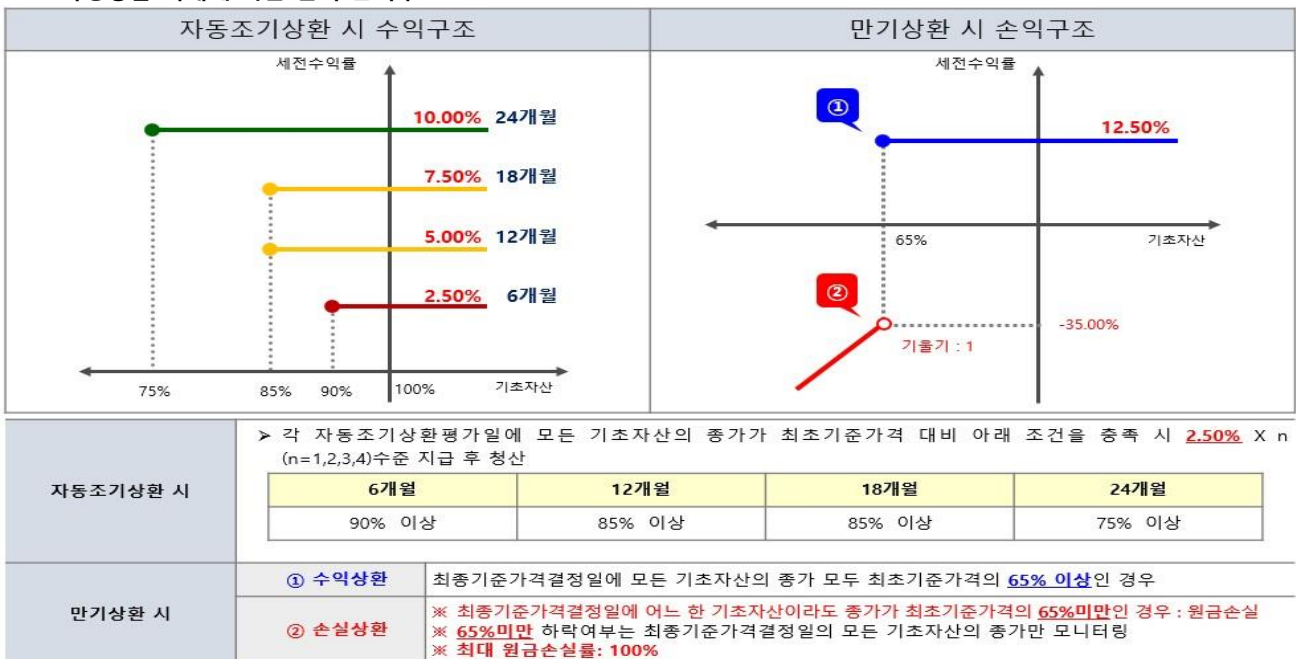
2021-12-28

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

81

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

84

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

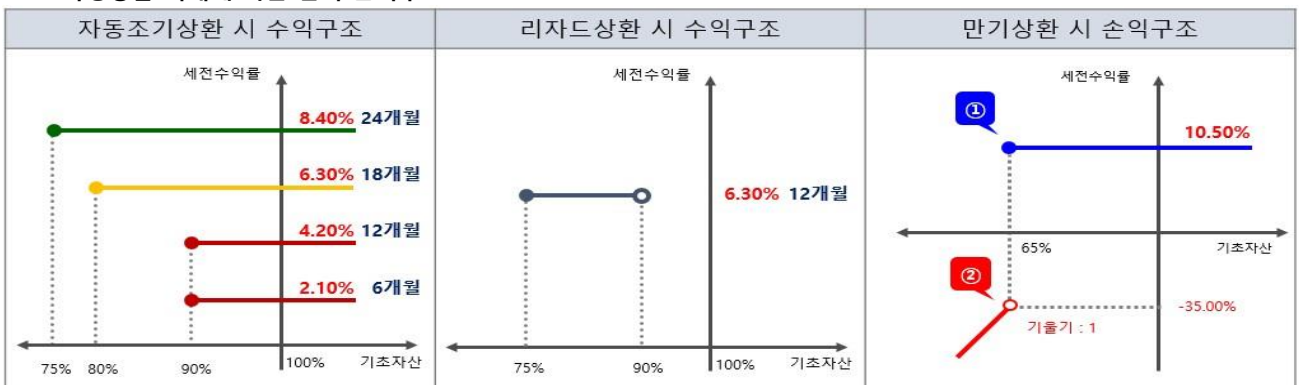
2021-12-28

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



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.10% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산									
	<table border="1"> <tr> <th>기간</th> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> <tr> <td>조건</td> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </table>	기간	6개월	12개월	18개월	24개월	조건	90% 이상	90% 이상	80% 이상
기간	6개월	12개월	18개월	24개월						
조건	90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상						
리자드상환 시	> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만 인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익 지급									
만기상환 시	① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우									
	② 손실상환 : <ul style="list-style-type: none"> ※ 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

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-40호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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

85

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

82

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

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

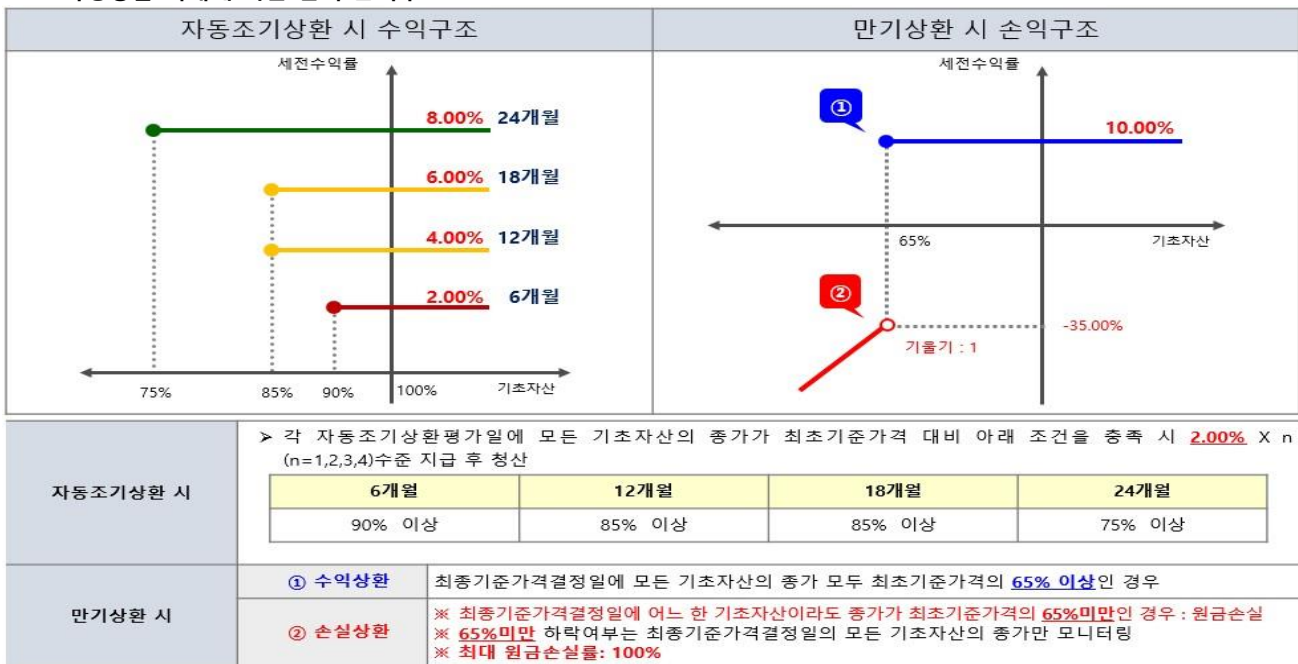
2021-12-28

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	1,015		1,015	장외
합계			1,015		1,015	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

55

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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	972		972	장외
합계			972		972	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.70% 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 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

77

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

73

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

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

2021-12-28

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	2,896		2,896	장외
합계			2,896		2,896	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

229

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

210

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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	2,116		2,116	장외
합계			2,116		2,116	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

129

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

108

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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	1,850		1,850	장외
합계			1,850		1,850	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 1.75% X n (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.50% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 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 3.50% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

139

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

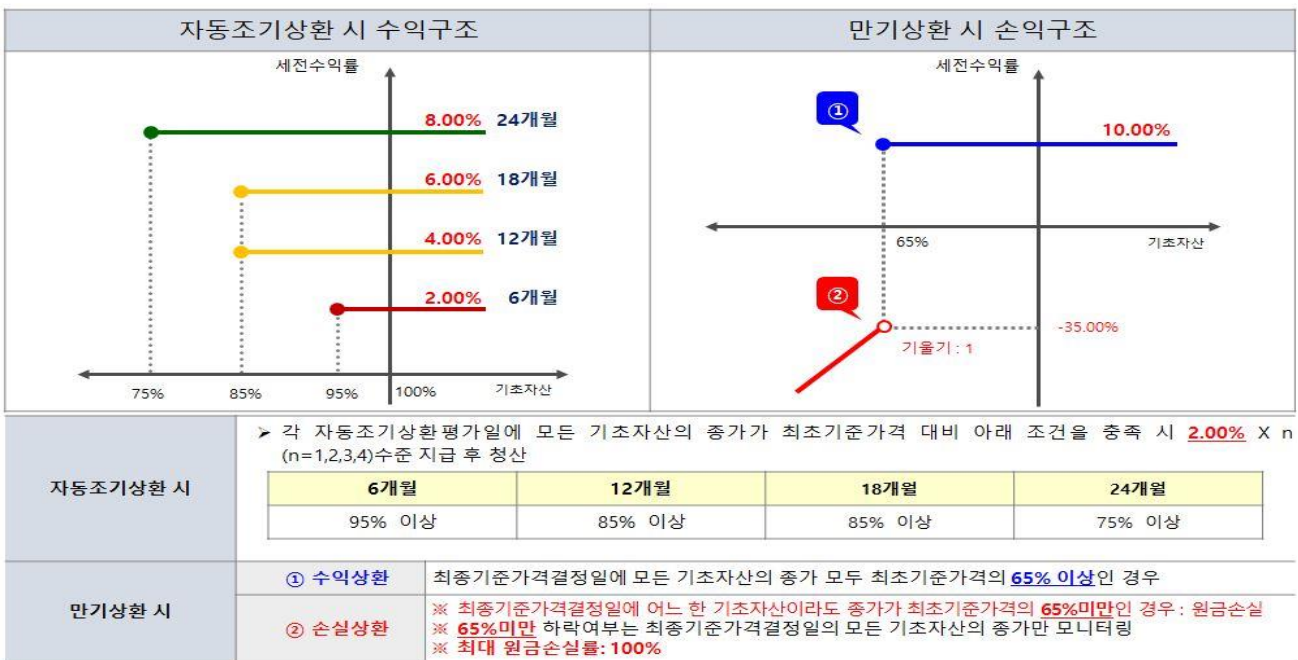
2021-12-28

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	942		942	장외
합계			942		942	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

50

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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	450		450	장외
합계			450		450	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 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
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.30% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 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
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

32

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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	772		772	장외
합계			772		772	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 1.55% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

56

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

58

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

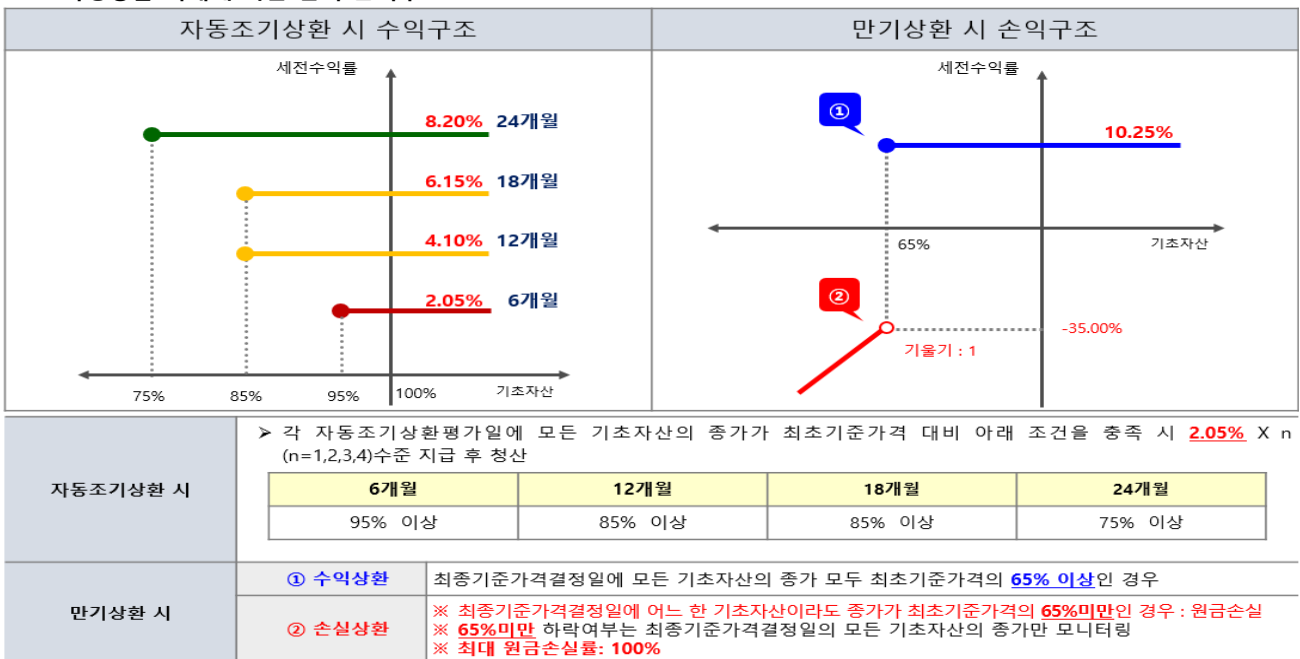
2021-12-28

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	1,286		1,286	장외
합계			1,286		1,286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

141

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

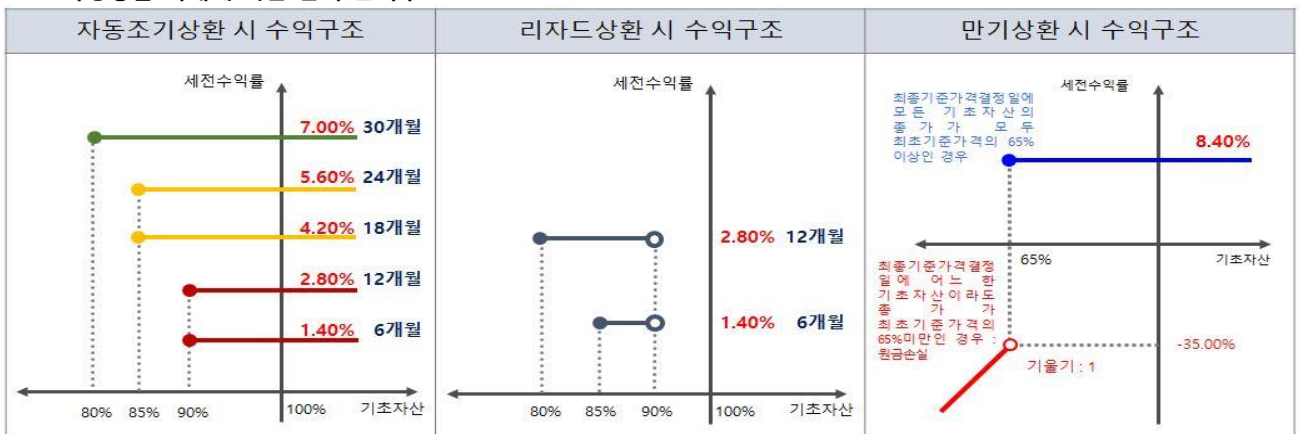
2021-12-28

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	512		512	장외
합계			512		512	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 1.40% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

44

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

61

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-18호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

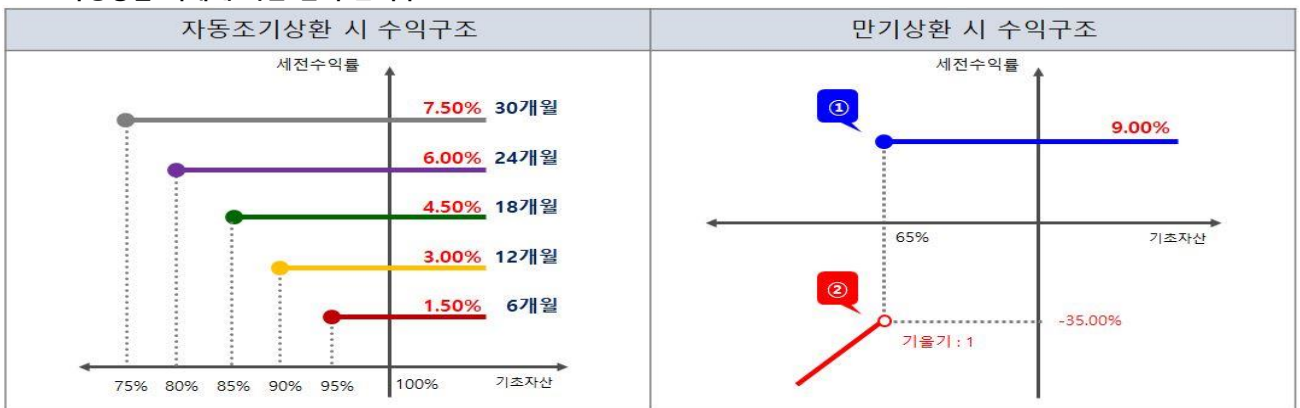
2021-12-28

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	331		331	장외
합계			331		331	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

세전수익률

기초자산

75% 80% 85% 90% 95% 100%

7.50% 30개월

6.00% 24개월

4.50% 18개월

3.00% 12개월

1.50% 6개월

만기상환 시

세전수익률

기초자산

9.00%

65%

-35.00%

기율기 : 1

① 수익상환

② 손실상환

기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.50% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월	30개월
95% 이상	90% 이상	85% 이상	80% 이상	75% 이상

최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

※ 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

5

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

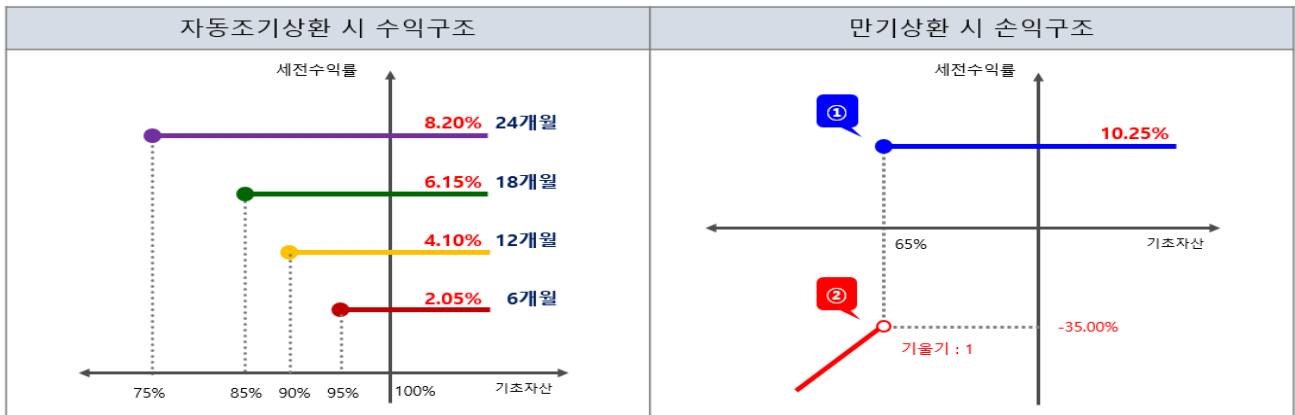
2021-12-28

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	750		750	장외
합계			750		750	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

자동조기상환 시 > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 **2.05%** X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상

만기상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우
② 손실상환	<ul style="list-style-type: none"> ※ 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

58

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

20

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

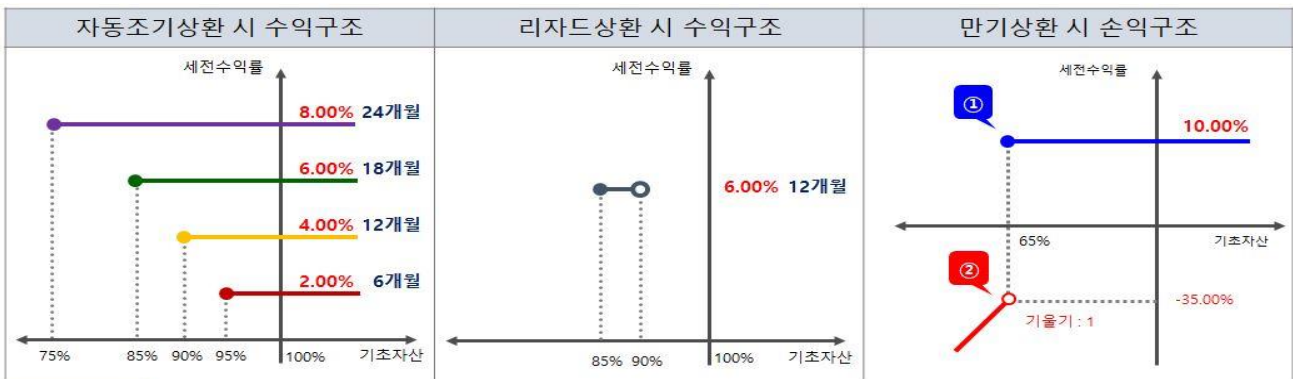
2021-12-28

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	180		180	장외
합계			180		180	

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%미만 인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만 으로 하락한적이 없는 경우 => 연 6.00% 수익지급			
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우		
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만 인 경우: 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%		

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

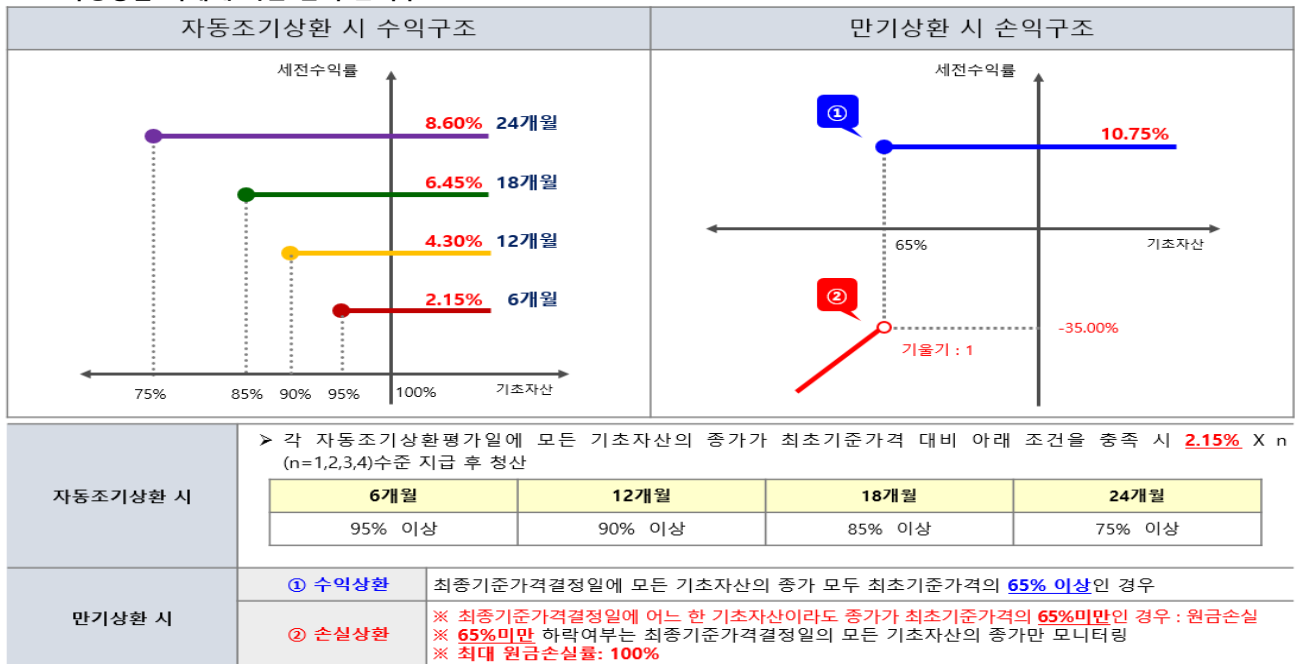
2021-12-28

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	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)

27

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

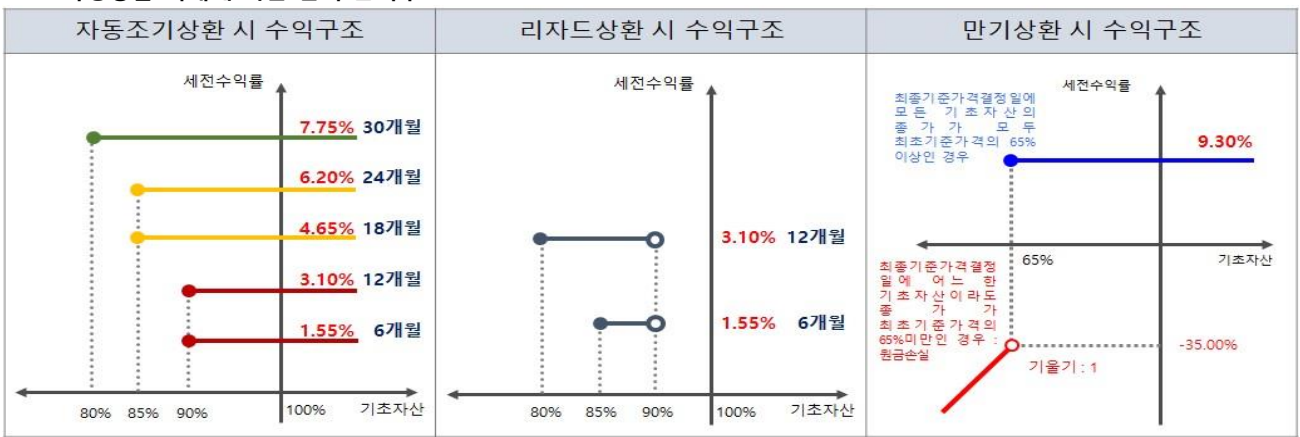
2021-12-28

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	498		498	장외
합계			498		498	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 1.55% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

42

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

59

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

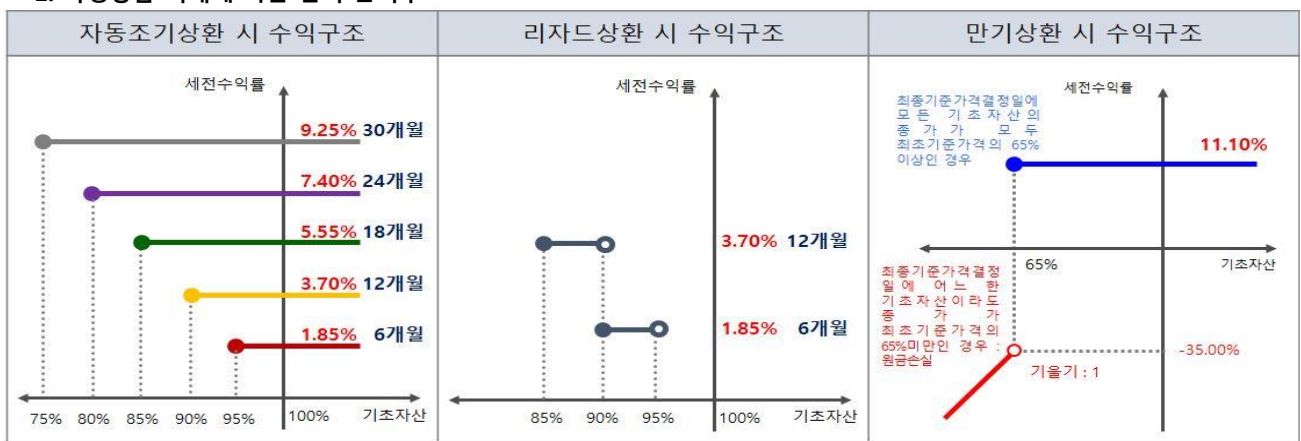
2021-12-28

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	1,241		1,241	장외
합계			1,241		1,241	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.85% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.70% 수익 지급 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 3.70% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

112

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

기준일 : 2021-12-27

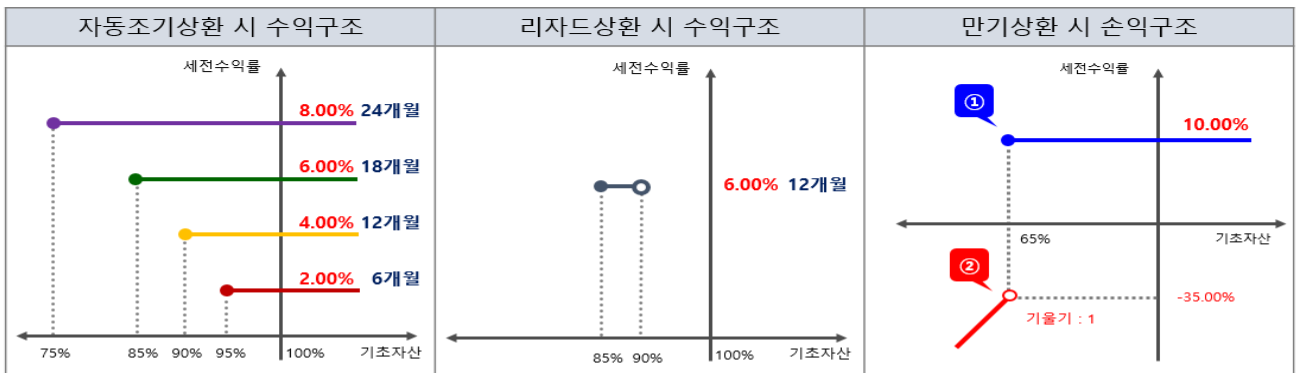
공시일: 2021-12-28

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	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%미만 인 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% 이상 인 경우		
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만 인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%		

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

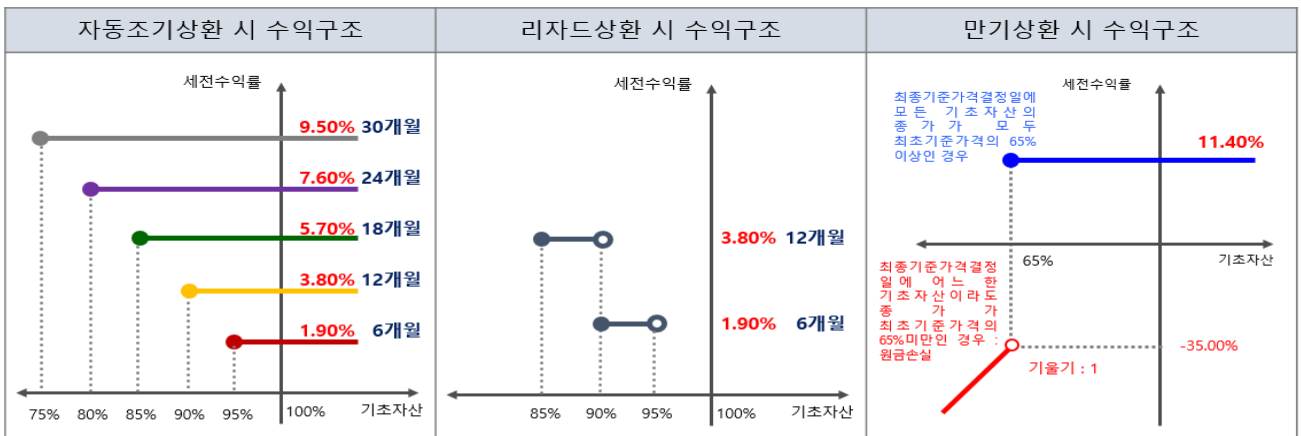
2021-12-28

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	1,395		1,395	장외
합계			1,395		1,395	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.90% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.80% 수익 지급 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 3.80% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

112

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

110

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

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

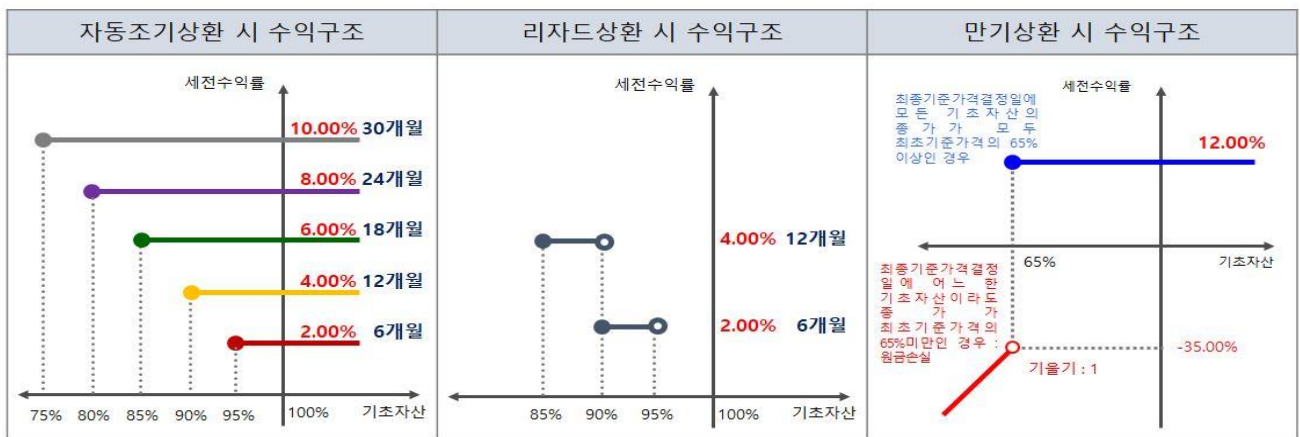
2021-12-28

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	2,464		2,464	장외
합계			2,464		2,464	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.00% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.00% 수익 지급 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 4.00% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

190

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

190

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

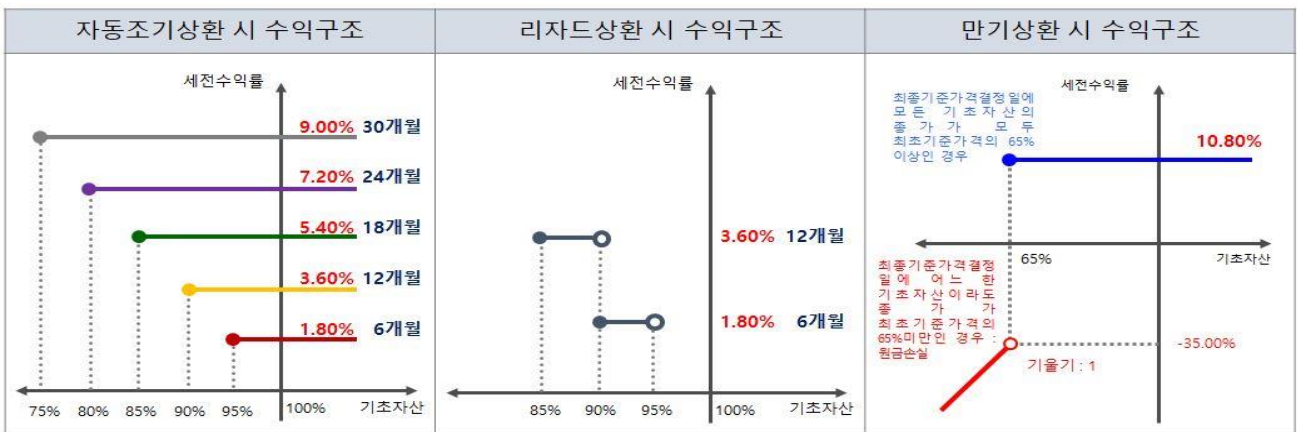
2021-12-28

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	936		936	장외
합계			936		936	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.80% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.60% 수익지급 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 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.60% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

68

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

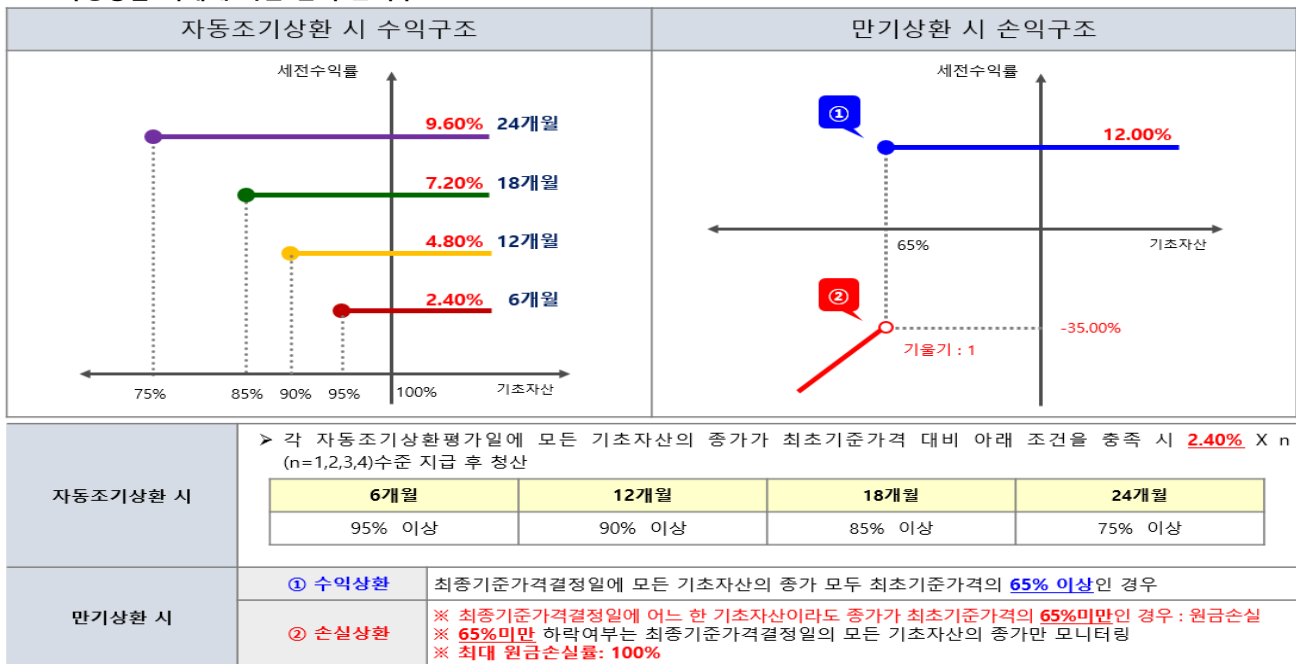
2021-12-28

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	103		103	장외
합계			103		103	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

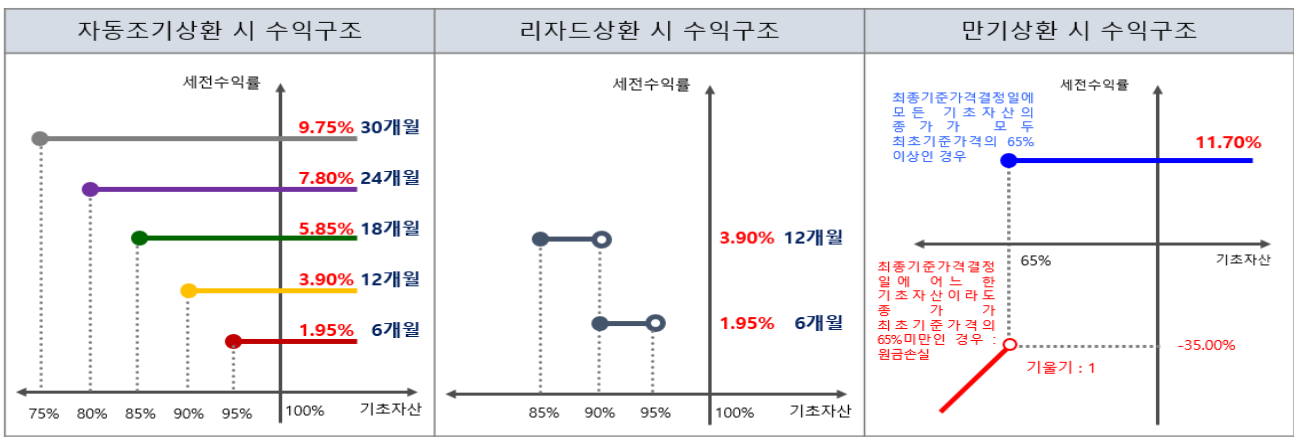
2021-12-28

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	1,523		1,523	장외
합계			1,523		1,523	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.95% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 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 3.90% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

109

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

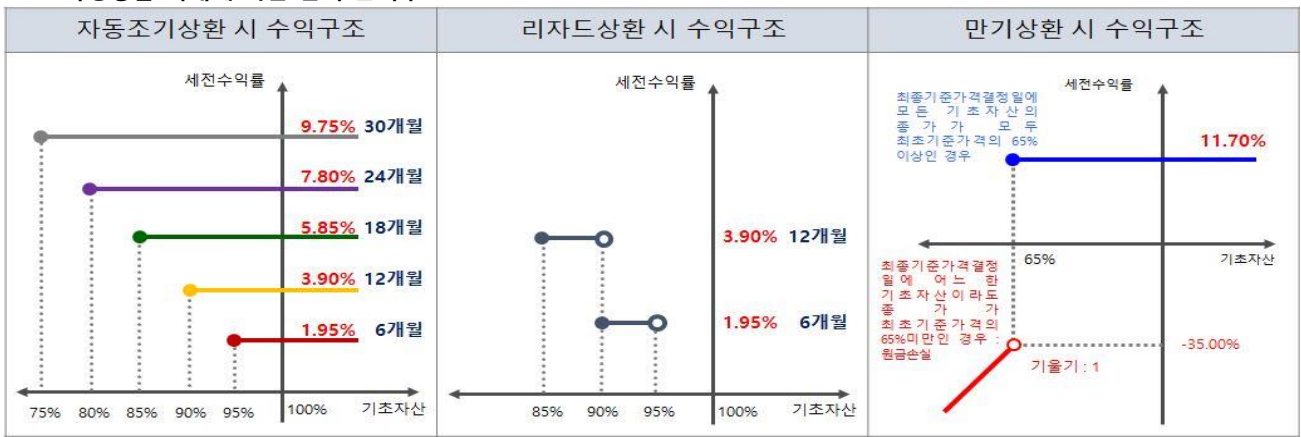
2021-12-28

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	1,891		1,891	장외
합계			1,891		1,891	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.95% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익지급 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 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

119

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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	3,115		3,115	장외
합계			3,115		3,115	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.95% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

238

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

200

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

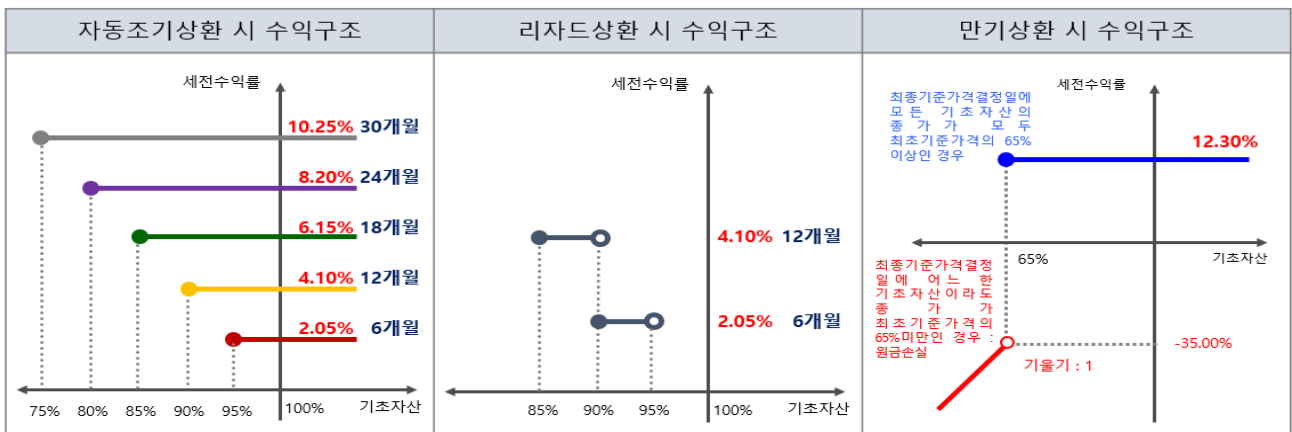
2021-12-28

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	1,287		1,287	장외
합계			1,287		1,287	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 수익 지급 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 4.10% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

96

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

83

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

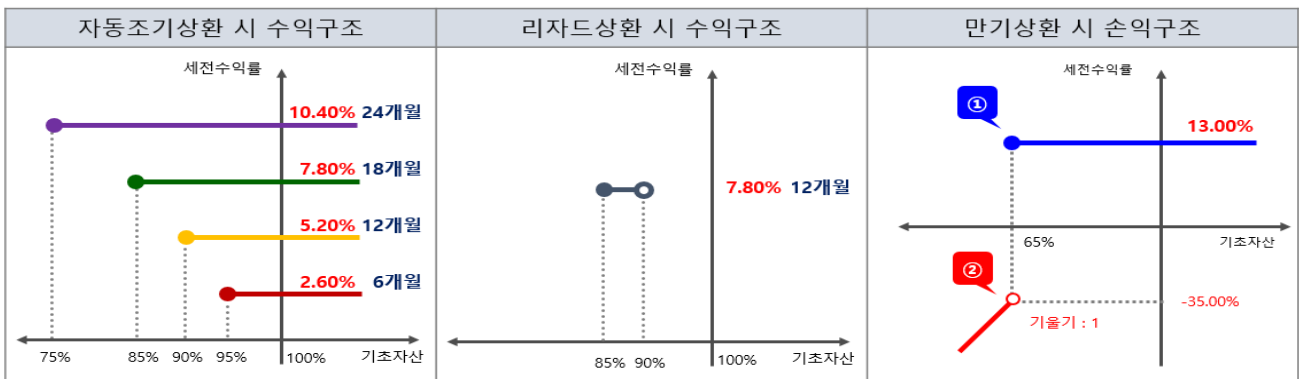
2021-12-28

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	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 2.60% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <tr> <th>기간</th> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> <tr> <td>조건</td> <td>95% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </table>	기간	6개월	12개월	18개월	24개월	조건	95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상
기간	6개월	12개월	18개월	24개월							
조건	95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상							
리자드상환 시	<p>> 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 7.80% 수익 지급</p>										
만기상환 시	<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 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>										

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

18

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

기준일 : 2021-12-27

공시일:

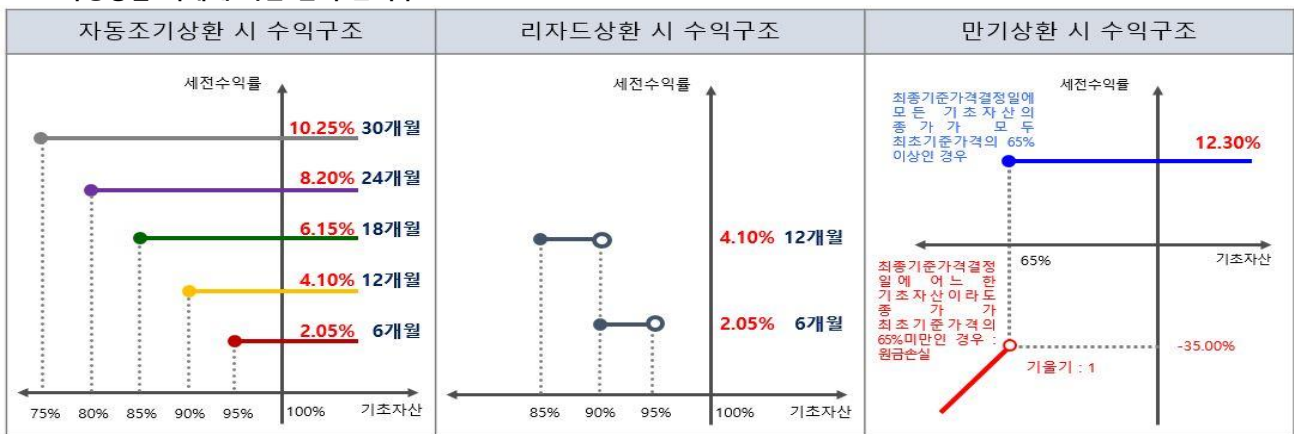
2021-12-28

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	1,840		1,840	장외
합계			1,840		1,840	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

136

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

132

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-19호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

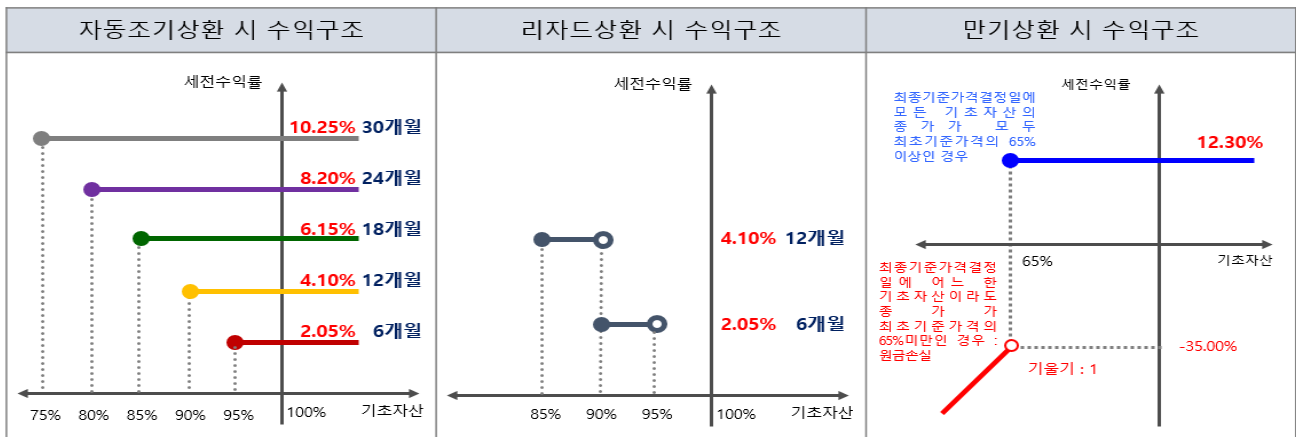
2021-12-28

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	2,548		2,548	장외
합계			2,548		2,548	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 수익 지급 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 4.10% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

156

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

129

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-20호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

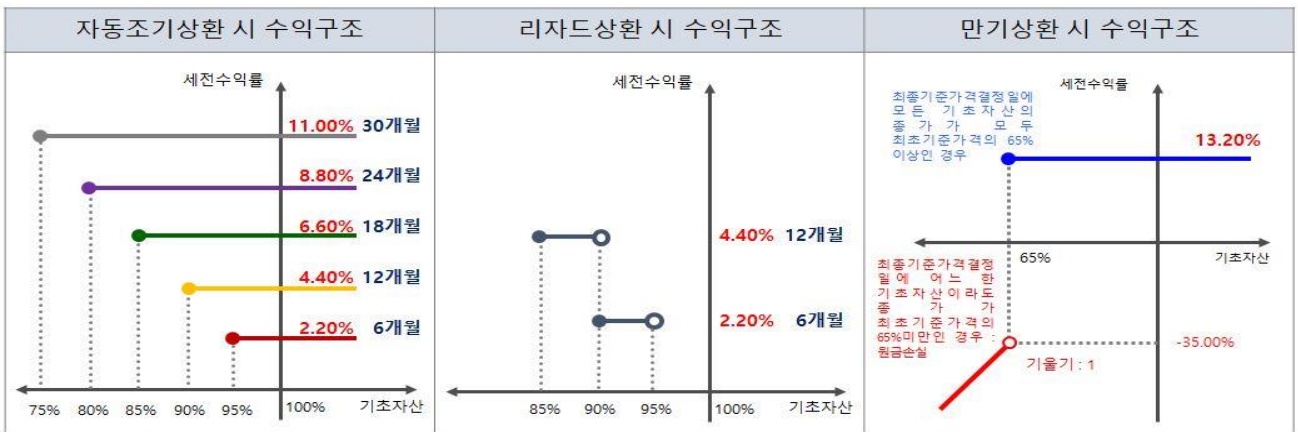
2021-12-28

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	3,710		3,710	장외
합계			3,710		3,710	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.20% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 수익지급 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

230

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

216

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-21호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

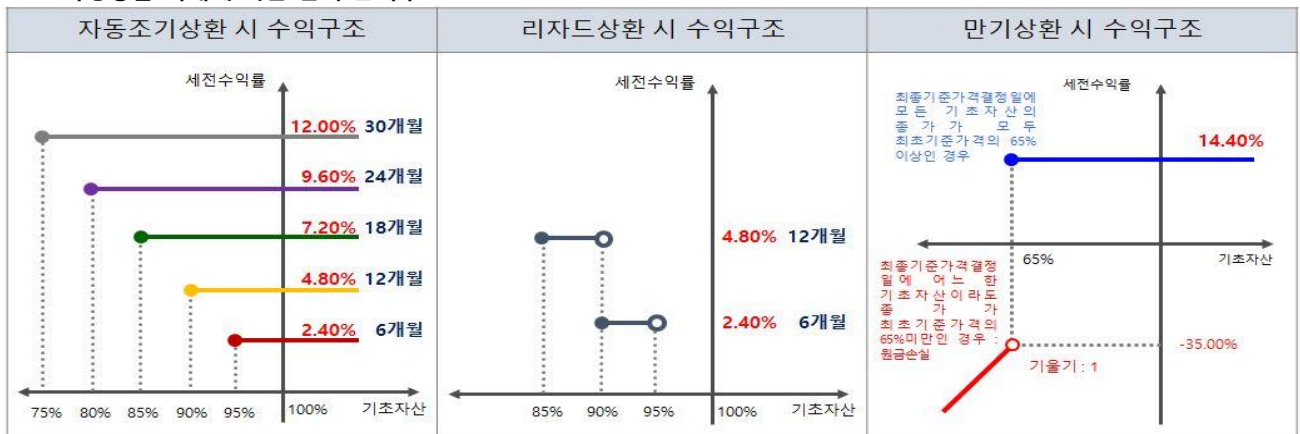
2021-12-28

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	2,503		2,503	장외
합계			2,503		2,503	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.40% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 수익지급 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

155

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

130

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-22호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

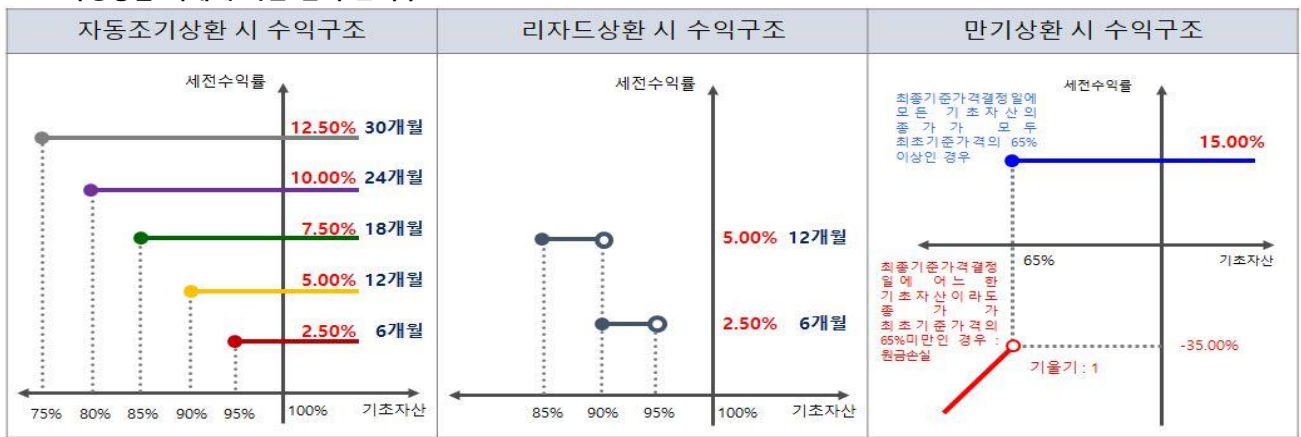
2021-12-28

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	1,204		1,204	장외
합계			1,204		1,204	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.50% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급 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 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

62

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-23호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

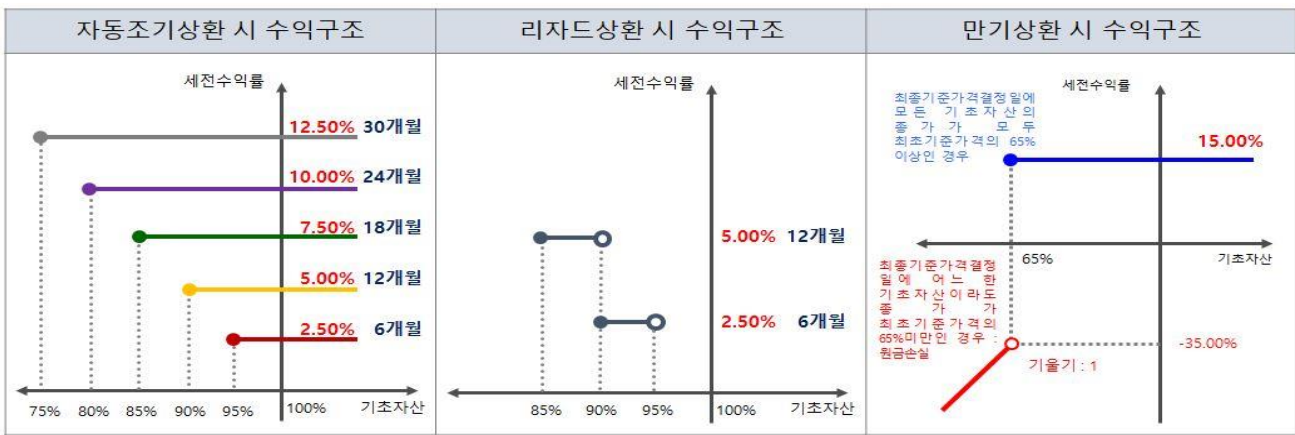
2021-12-28

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	376		376	장외
합계			376		376	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.50% X n (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-24호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

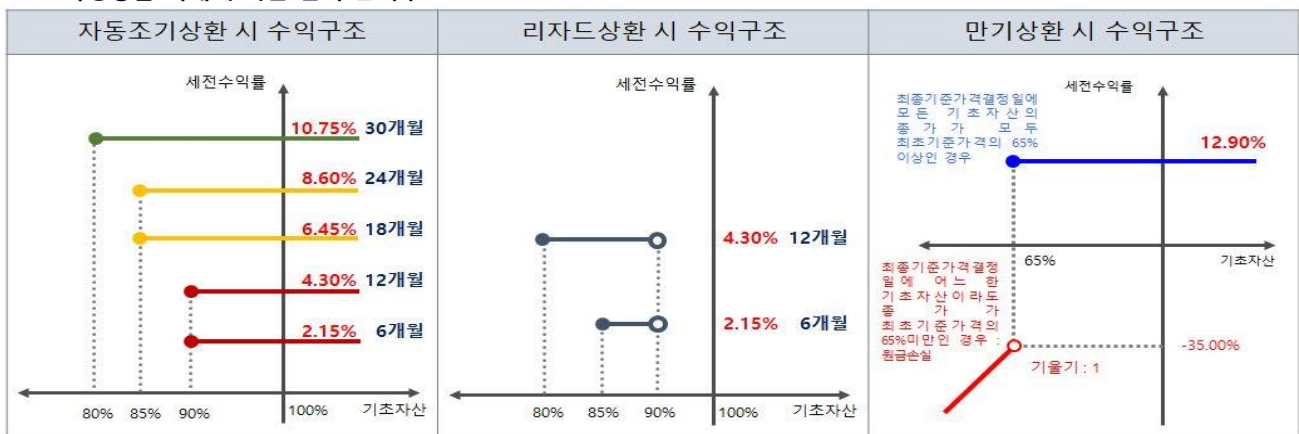
2021-12-28

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	1,842		1,842	장외
합계			1,842		1,842	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.15% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 4.30% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 4.30% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

116

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

92

펀드명 : BNK리자드지수연계증권SHE(KRW)-12호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

2021-12-28

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	823		823	장외
합계			823		823	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 3.10% 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>95% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상	<p>리 자 드 상 환 시</p> <p>▶ 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 9.30% 수익 지급</p>	<p>만 기 상 환 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 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

49

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

41

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

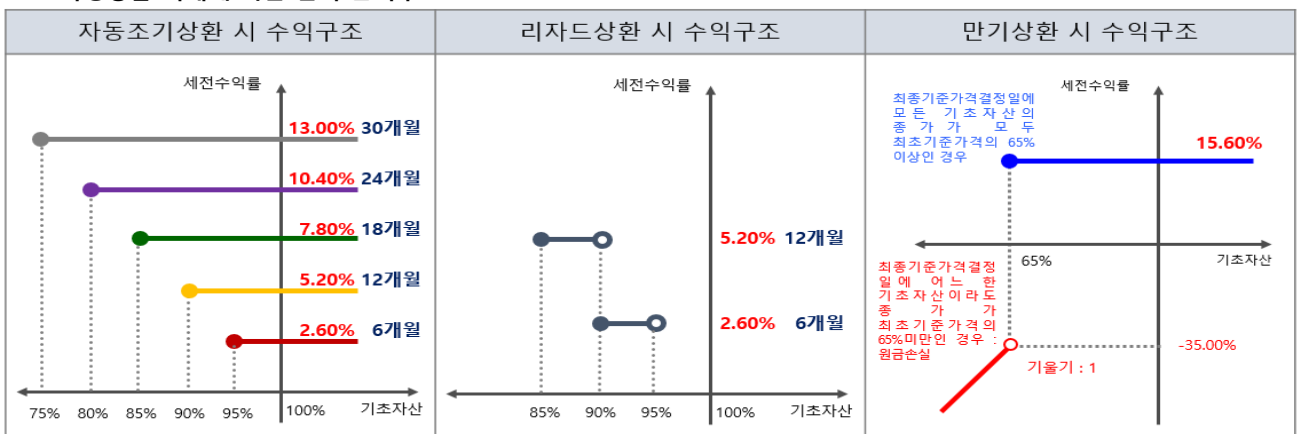
2021-12-28

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	2,262		2,262	장외
합계			2,262		2,262	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.60% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 수익 지급 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 5.20% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

104

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-26호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

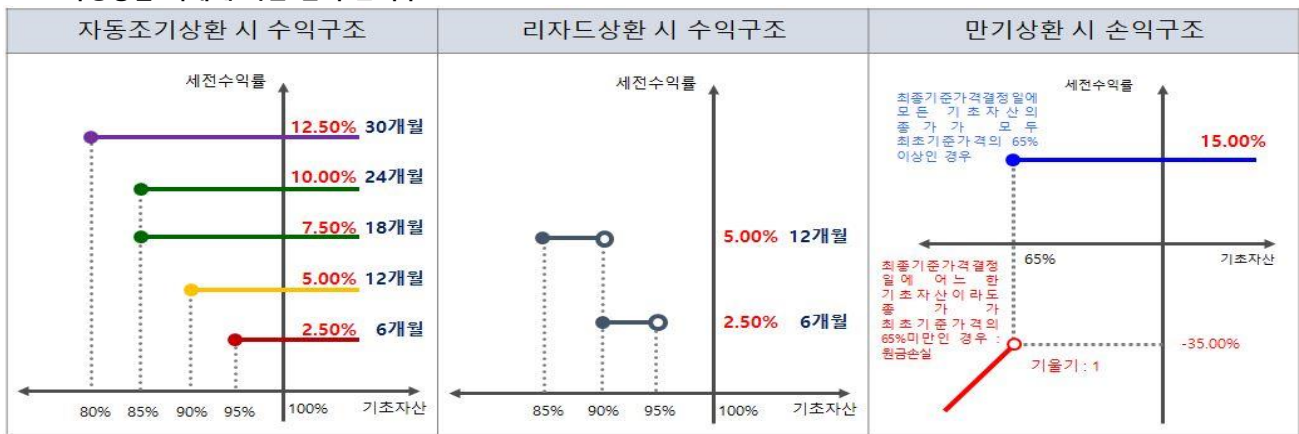
2021-12-28

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	1,277		1,277	장외
합계			1,277		1,277	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.50% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

74

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

68

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일:

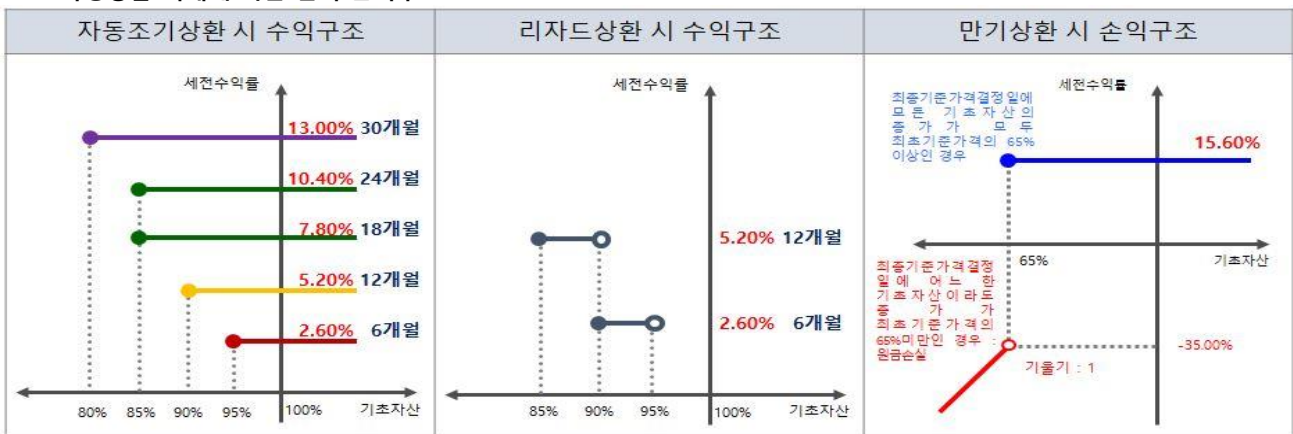
2021-12-28

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	966		966	장외
합계			966		966	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.60% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 수익 지급 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 5.20% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

49

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-28호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-12-27

공시일: 2021-12-28

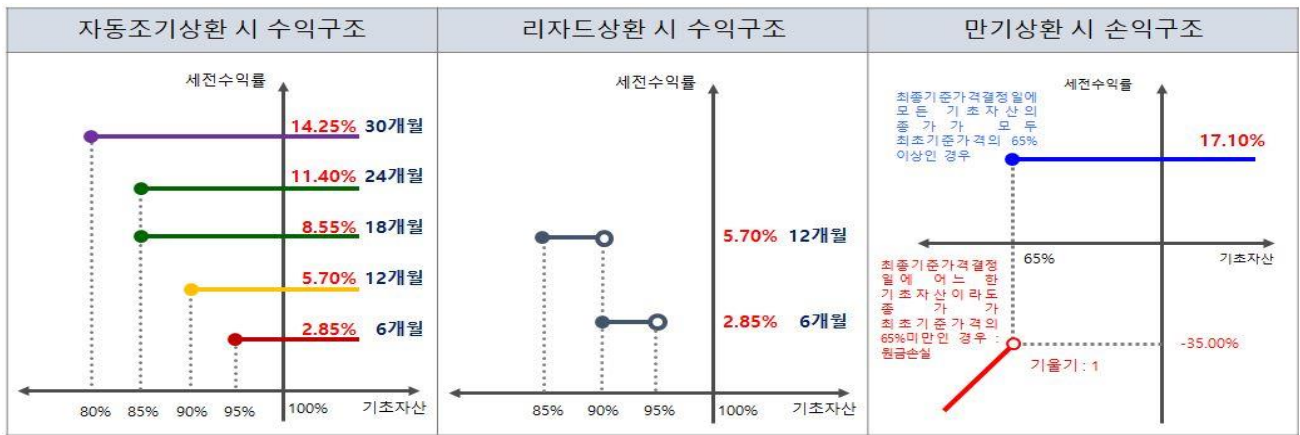
2021-12-28

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	1,371		1,371	장외
합계			1,371		1,371	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.85% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.70% 수익지급 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 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.70% 수익지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

76