

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 539   | 462   | 77        | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 4,616 | 0     | 4,616     | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션   | 5     | 539   | -533      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션   | 4     | 1,539 | -1,534    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 119   | 436   | -317      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 157   | 0     | 157       | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,777 | 1,539 | 3,239     |    |

## 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 투자전략은 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

362

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

406

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0      | 462   | -462      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 19,464 | 154   | 19,310    | 장내 |
| 합계 |      |      | 19,464 | 154   | 19,310    |    |

## 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

1,537

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,680

# 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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   | 4,770 | 0     | 4,770     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 30    | -30       | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,770 | 30    | 4,740     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



위 그림은 투자자의 이해를 돕기 위하여 KOSPI200지수를 기초자산으로 하는 선물 매수 그림은 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

380

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

412

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

기준일 : 2022-12-15

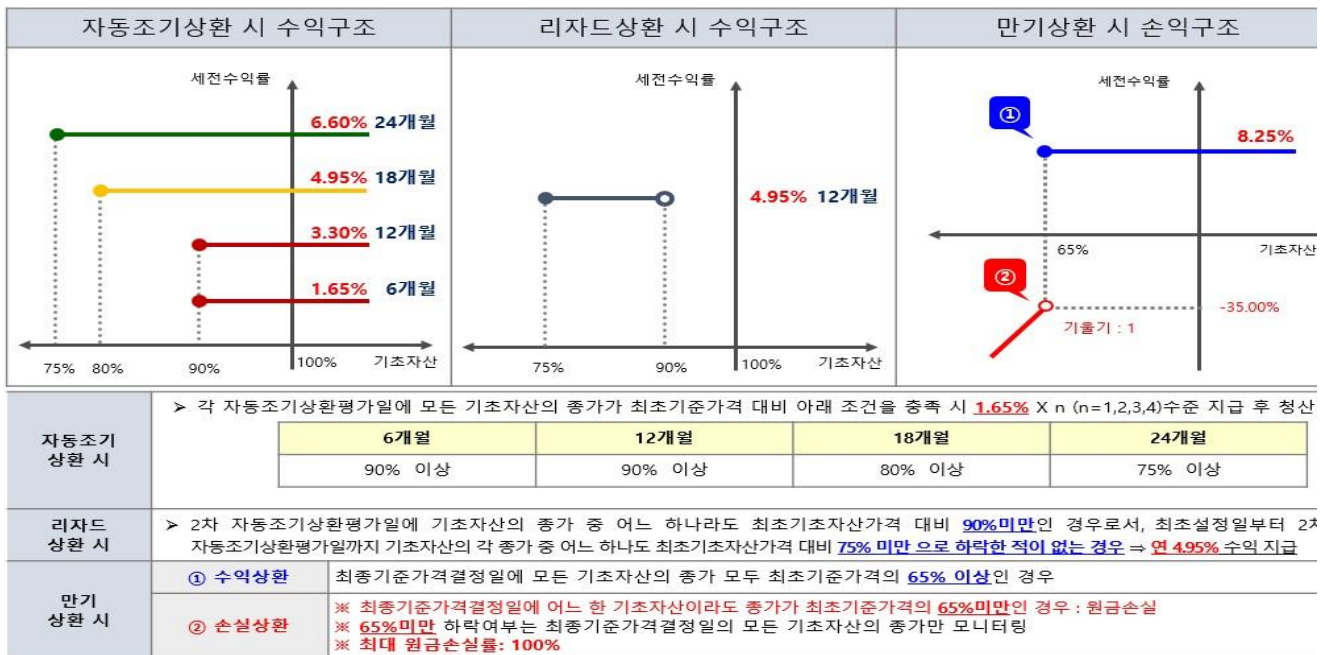
공시일: 2022-12-16

## 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  | 2,031 |       | 2,031     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,031 |       | 2,031     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

168

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

39

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

83

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

172

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

343

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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

136

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

31

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

58

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

160

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

297

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

기준일 : 2022-12-15

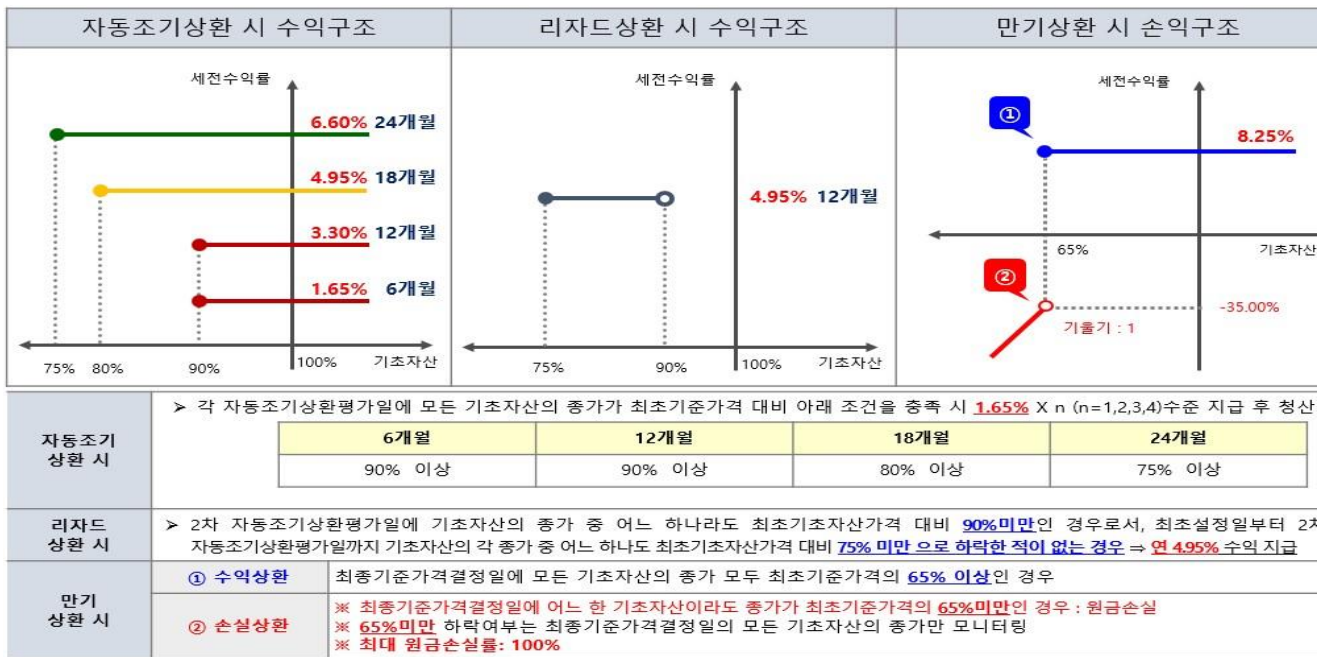
공시일: 2022-12-16

## 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  | 1,064 |       | 1,064     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,064 |       | 1,064     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

86

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 581   |       | 581       | 장외 |
| 합계 |      |      | 581   |       | 581       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

47

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

91

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 1,540 |       | 1,540     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,540 |       | 1,540     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

127

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

253

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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

77

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

156

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 195   |       | 195       | 장외 |
| 합계 |      |      | 195   |       | 195       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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

80

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

181

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

104

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

99

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

|  |           |
|--|-----------|
|  | <b>63</b> |
|--|-----------|

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

|  |            |
|--|------------|
|  | <b>124</b> |
|--|------------|

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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)

215

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

409

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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

207

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

184

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

기준일 : 2022-12-15

공시일:

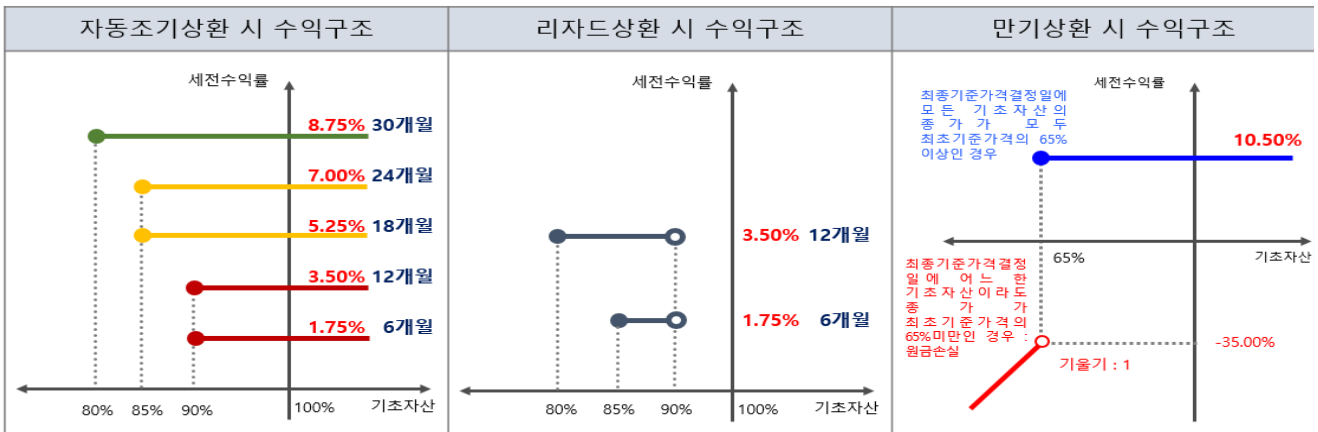
2022-12-16

## 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%</b> <b>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%미만</b>인 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%미만</b>인 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>   |

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

128

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

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

기준일 : 2022-12-15

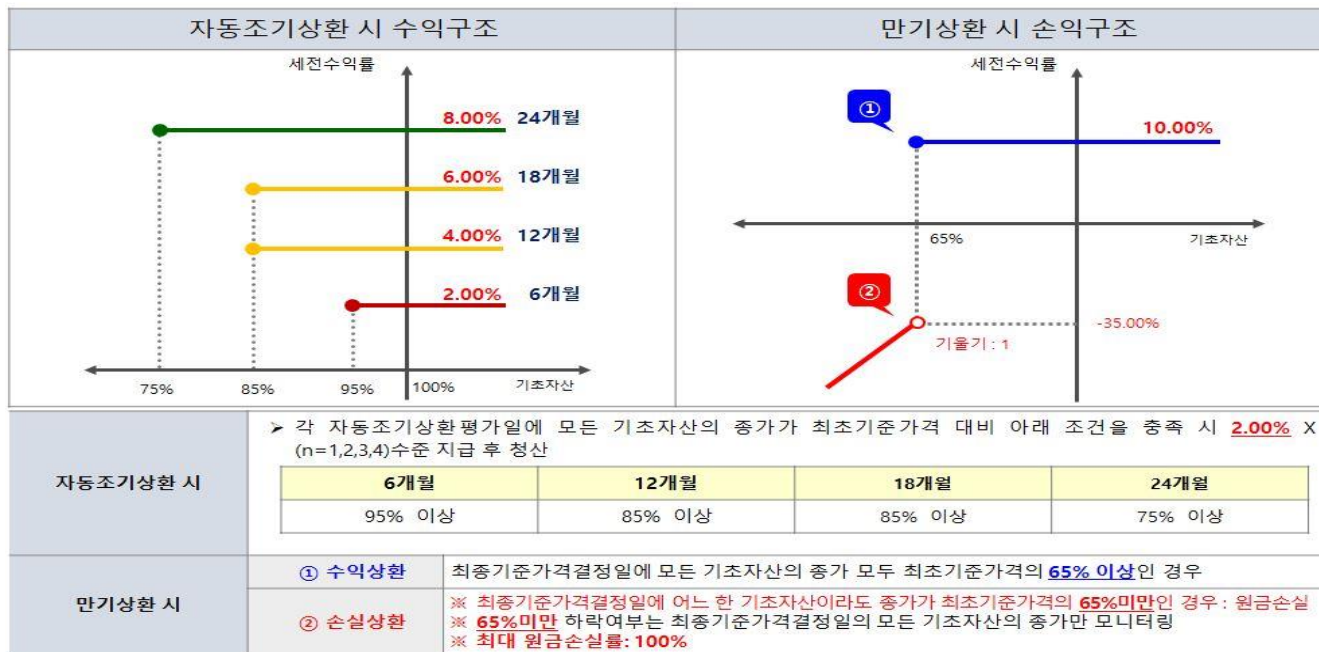
공시일: 2022-12-16

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

88

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

77

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.65%</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%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.30%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.30%</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

31

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 756   |       | 756       | 장외 |
| 합계 |      |      | 756   |       | 756       |    |

## 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>1.55% 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>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 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%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

51

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 502   |       | 502       | 장외 |
| 합계 |      |      | 502   |       | 502       |    |

## 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>1.40%</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 최초기준가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 2.80%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 <b>80%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 2.80%</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

36

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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

34

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

49

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

기준일 : 2022-12-15

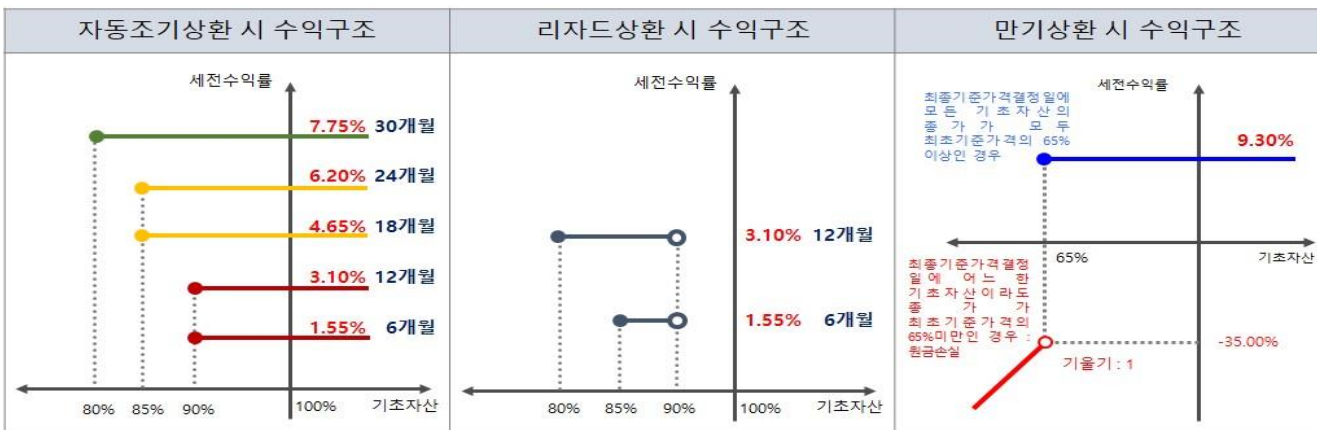
공시일: 2022-12-16

## 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%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 3.10% 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%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 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

34

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

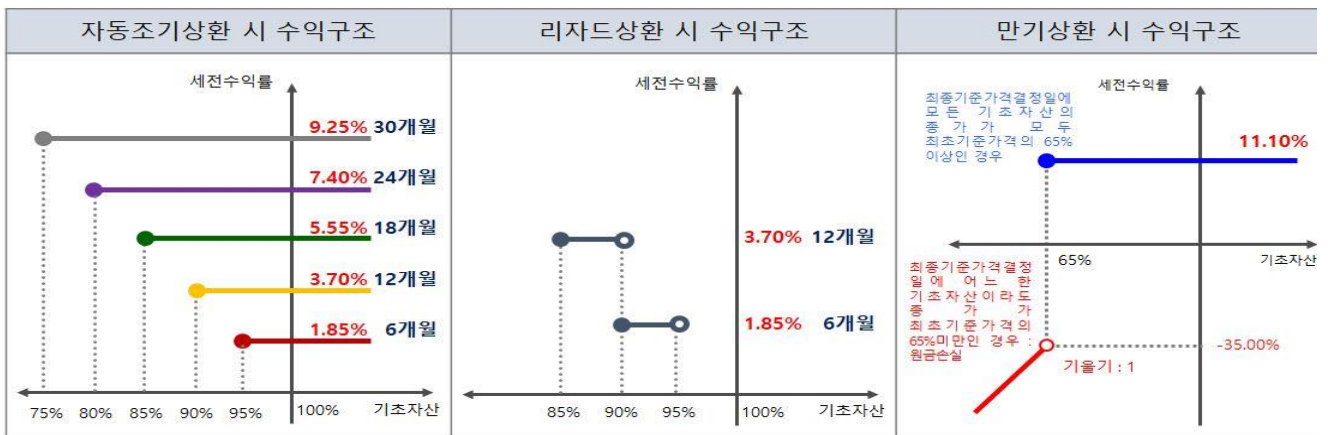
기준일 : 2022-12-15      공시일: 2022-12-16

## 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 1 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 2 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

97

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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

14

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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 1: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <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 2: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <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

107

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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> <math>2.00\% \times n</math> (<math>n=1,2,3,4,5</math>) 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 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 4.00% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 4.00% 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

196

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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 하나도 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

76

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

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

기준일 : 2022-12-15

공시일:

2022-12-16

## 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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.90%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 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 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

122

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 1,890 |       | 1,890     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,890 |       | 1,890     |    |

## 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% 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%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.90%</b> 수익 지급</li> <li>▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 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

143

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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> ⇒ 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 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 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 ⇒ 연 3.90% 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 원금손실: 100%</b></li> </ul>  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

236

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

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

기준일 : 2022-12-15

공시일:

2022-12-16

## 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 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 ⇒ 연 <b>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% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>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

103

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

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

기준일 : 2022-12-15

공시일:

2022-12-16

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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 자동조기상환평가일까지 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

144

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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"> <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%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 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

198

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.20%</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%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.40%</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%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.40%</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

284

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

18

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

기준일 : 2022-12-15

공시일:

2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.40%</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 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.80%</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%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.80%</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

191

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.50%</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 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.00%</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

91

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-23호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

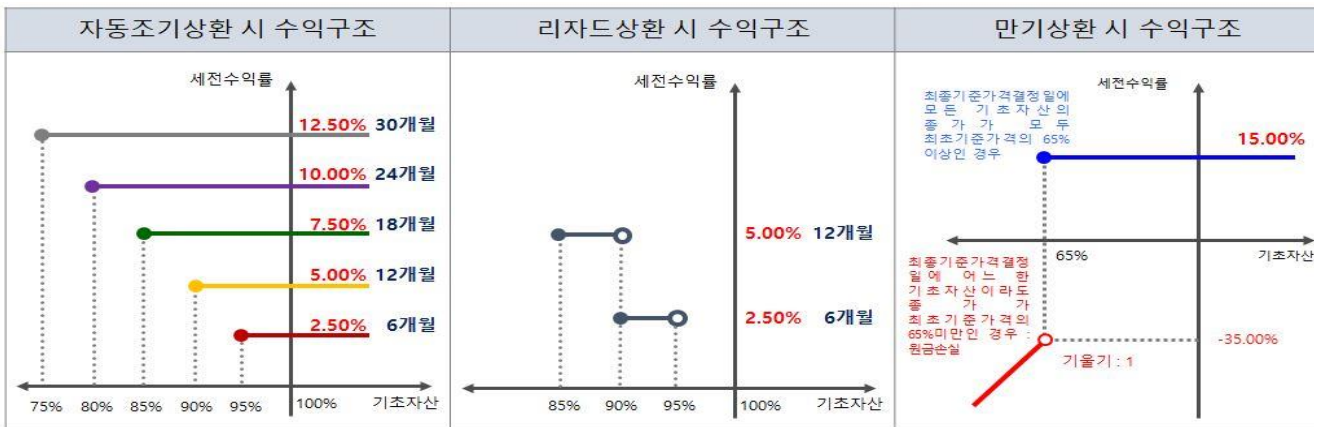
2022-12-16

## 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 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>2.50%</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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 5.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.00%</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

27

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-24호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

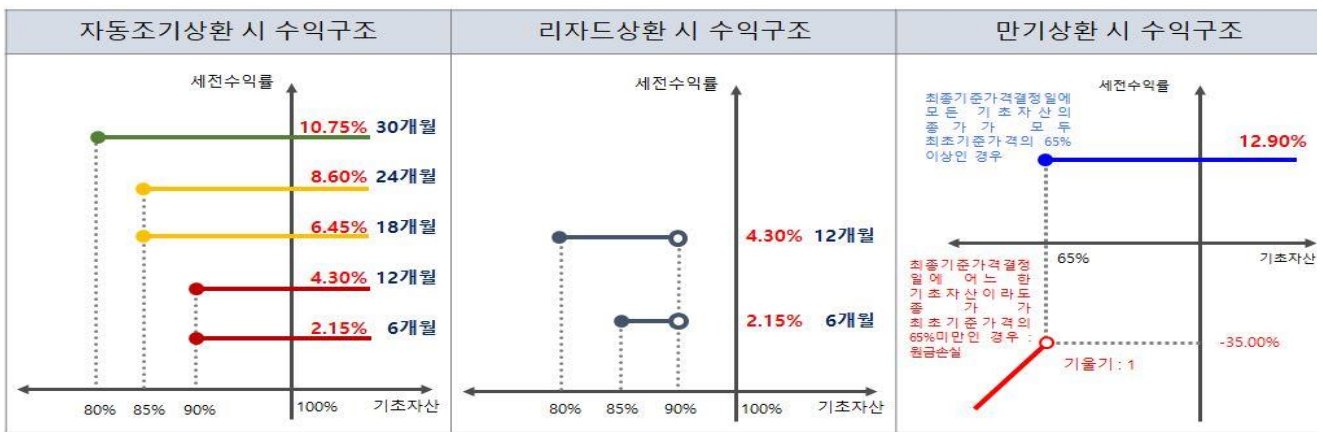
2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.15%</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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.30%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.30%</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

134

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

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

기준일 : 2022-12-15

공시일:

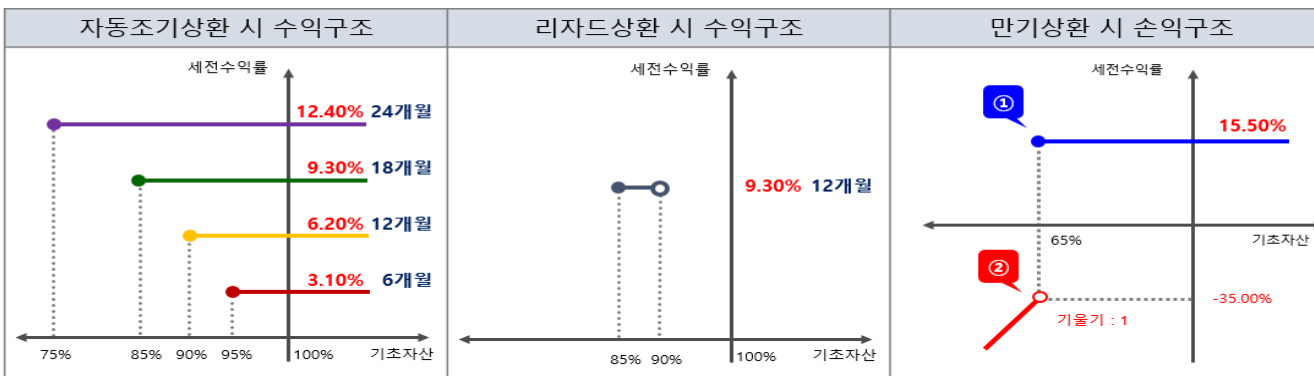
2022-12-16

## 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 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>3.10%</b> X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산   |  |             |             |
|          | <b>6개월</b>   | <b>12개월</b>  | <b>18개월</b> | <b>24개월</b> |
|          | 95% 이상   | 90% 이상   | 85% 이상      | 75% 이상      |
| 리자드상환 시  | > 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 9.30%</b> 수익 지급 |  |             |             |
| 만기상환 시   | ① 수익상환   | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우   |             |             |
|          | ② 손실상환   | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실<br>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> |             |             |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

66

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.60%</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 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 5.20%</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 5.20%</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

165

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

10

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-26호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

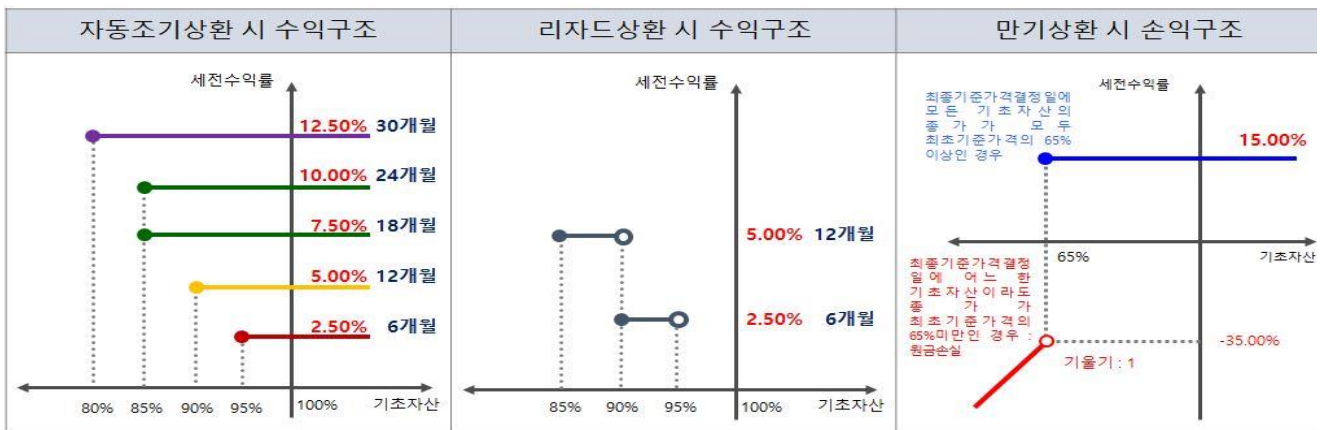
공시일: 2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.50%</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 경우</b>로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 5.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 5.00%</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

90

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.60%</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 5.20%</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 5.20%</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

69

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-28호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%</b> <b>30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.85%</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%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 5.70%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.70%</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

96

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-29호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

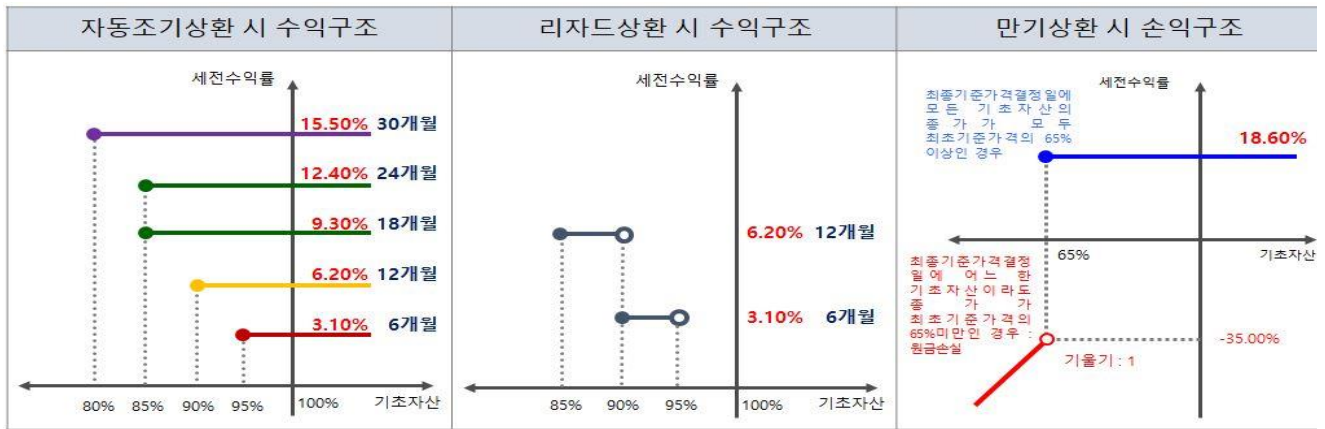
공시일: 2022-12-16

## 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  | 672   |       | 672       | 장외 |
| 합계 |      |      | 672   |       | 672       |    |

## 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 85%</b> <b>30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.10%</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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.20%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.20%</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

47

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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



|          | 기간    | 상환조건  | 손익률(세전)        |
|----------|-------|---|----------------|
| 자동조기상환 시 | 6개월   | 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 90% 이상인 경우   | 3.25% 수        |
|          | 12개월  | 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 85% 이상인 경우<br>2차 자동조기상환평가일에 조기상환이 되지 않을 경우, 단독관찰기초자산 결정                      | 6.50% 수        |
|          | 18개월  | 3차 자동조기상환평가일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 85% 이상인 경우<br>단독관찰기초자산 : 단독관찰결정일에 모든 기초자산 중 (중간평가가격/최초기준가격)의 비율이 가장 작은 기초자산 | 9.75% 수        |
|          | 24개월  | 4차 자동조기상환평가일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 80% 이상인 경우  | 13.00% 수       |
|          | 30개월  | 5차 자동조기상환평가일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 75% 이상인 경우  | 16.25% 수       |
| 만기상환 시   | ①수익상환 | 최종기준가격결정일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우   | 19.50% 수       |
|          | ②손실상환 | ※ 최종기준가격결정일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br>※ 단독관찰기초자산의 하락률 기준으로 원금손실 발생 ※ 최대 원금손실률: 100%            | -35% ~ -100% 수 |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

8

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-31호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

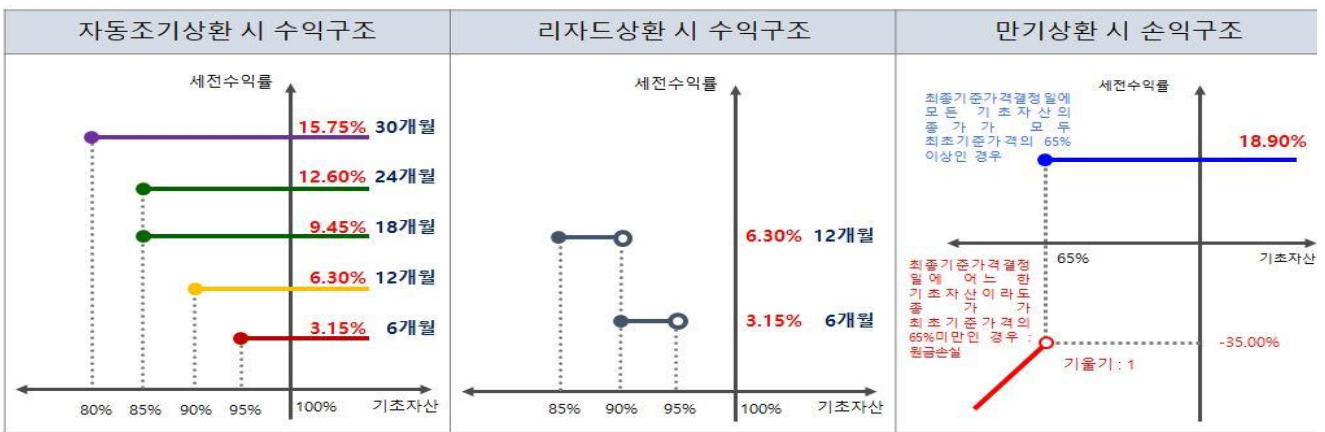
2022-12-16

## 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  | 743   |       | 743       | 장외 |
| 합계 |      |      | 743   |       | 743       |    |

## 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 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.15%</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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 6.30%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.30%</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

52

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-32호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 973   |       | 973       | 장외 |
| 합계 |      |      | 973   |       | 973       |    |

## 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>2.80%</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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 5.60%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.60%</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

72

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 698   |       | 698       | 장외 |
| 합계 |      |      | 698   |       | 698       |    |

## 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> ⇒ 2.75% 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, 최초결제일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 5.50% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초결제일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.50% 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

58

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-34호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 992   |       | 992       | 장외 |
| 합계 |      |      | 992   |       | 992       |    |

## 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>2.90%</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>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>5.80%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>5.80%</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

79

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-35호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

공시일: 2022-12-16

## 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  | 326   |       | 326       | 장외 |
| 합계 |      |      | 326   |       | 326       |    |

## 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 85%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.15%</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 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.30%</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 ⇒ <b>연 6.30%</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

24

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-36호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-12-15

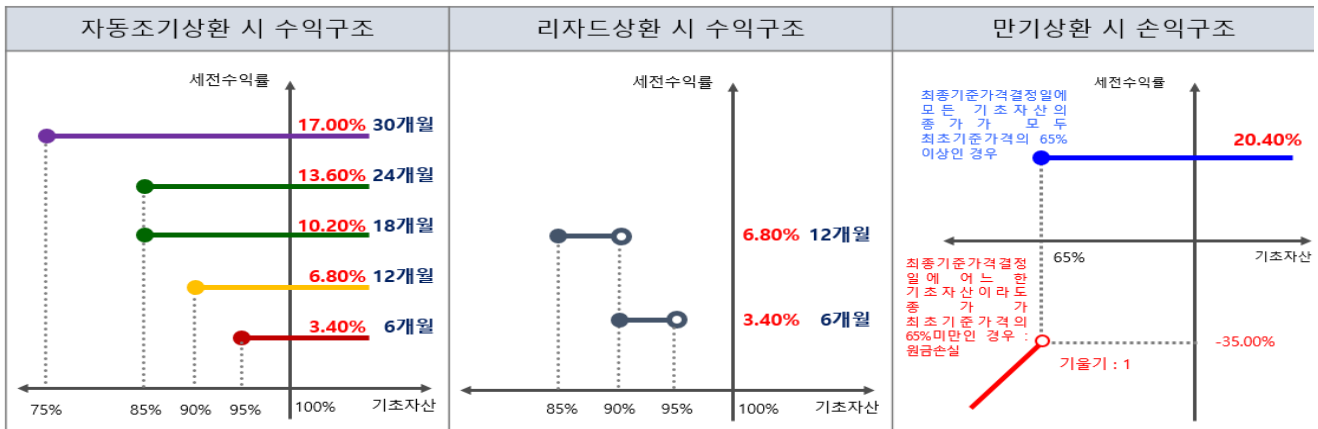
공시일: 2022-12-16

## 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  | 908   |       | 908       | 장외 |
| 합계 |      |      | 908   |       | 908       |    |

## 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 85% 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.40%</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 6.80%</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% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.80%</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

73

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6