

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 611 | 611 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 2,063 | 0 | 2,063 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 22 | 1,375 | -1,353 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 17 | 1,528 | -1,511 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 630 | 67 | 563 | 장내 |
| 합계 | | | 2,710 | 1,595 | 1,115 | |

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

156

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

188

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-03-14

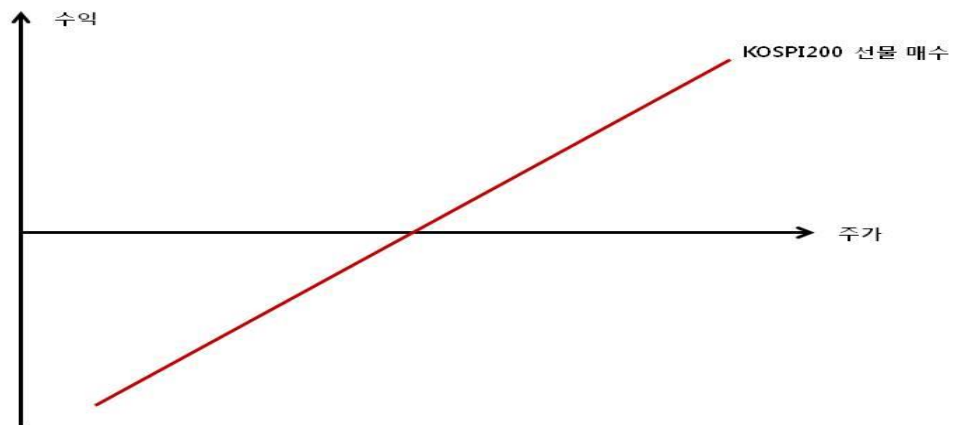
공시일: 2023-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 306 | -306 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 21,314 | 0 | 21,314 | 장내 |
| 합계 | | | 21,314 | 0 | 21,314 | |

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

1,712

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,852

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 535 | 611 | -76 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 2,521 | 0 | 2,521 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 601 | 134 | 467 | 장내 |
| 합계 | | | 3,122 | 134 | 2,988 | |

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.

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

203

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

238

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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

210

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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)

| | |
|--|-----------|
| | 55 |
|--|-----------|

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|--|-----------|
| | 90 |
|--|-----------|

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

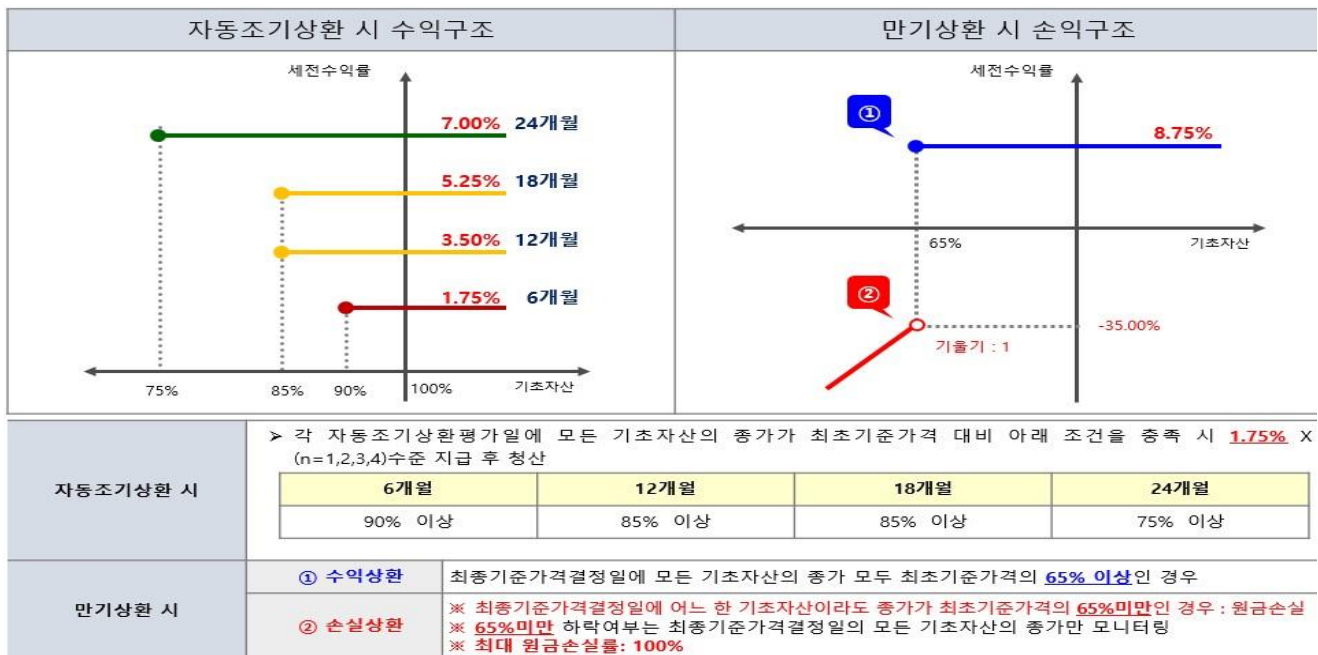
공시일: 2023-03-15

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 | 2,048 | | 2,048 | 장외 |
| 합계 | | | 2,048 | | 2,048 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

213

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

349

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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

144

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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)

35

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

61

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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)

170

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

295

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

기준일 : 2023-03-14

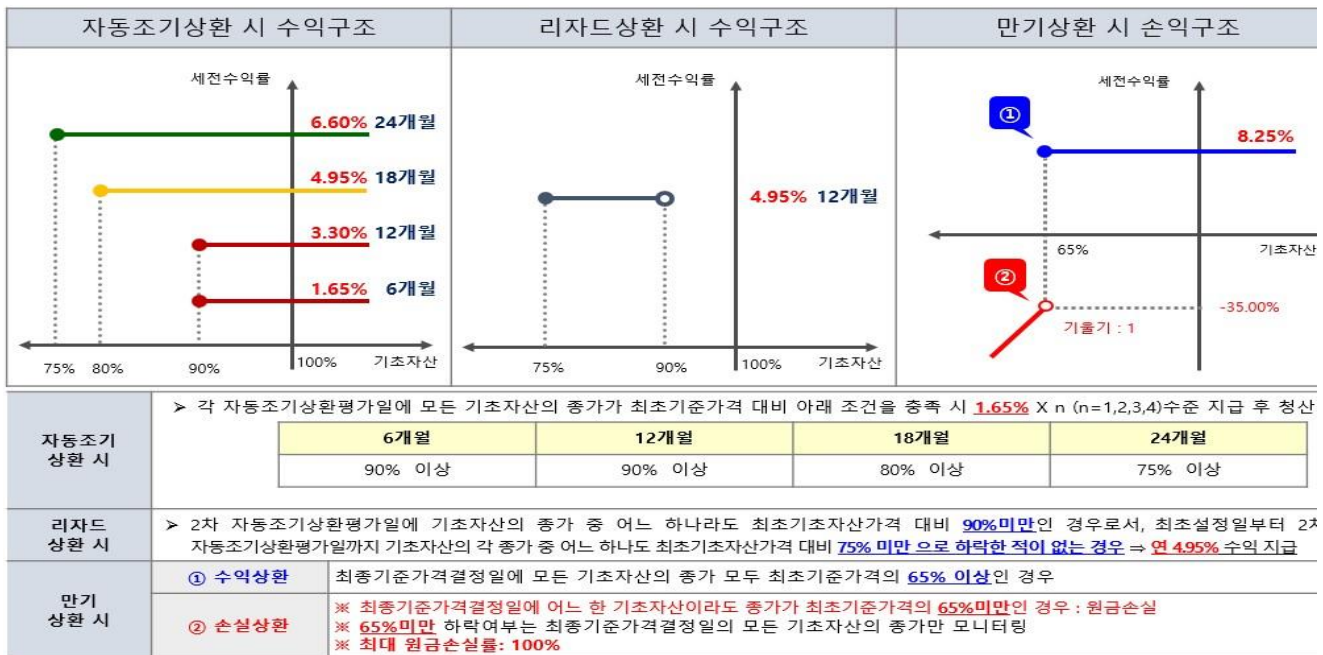
공시일: 2023-03-15

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

99

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

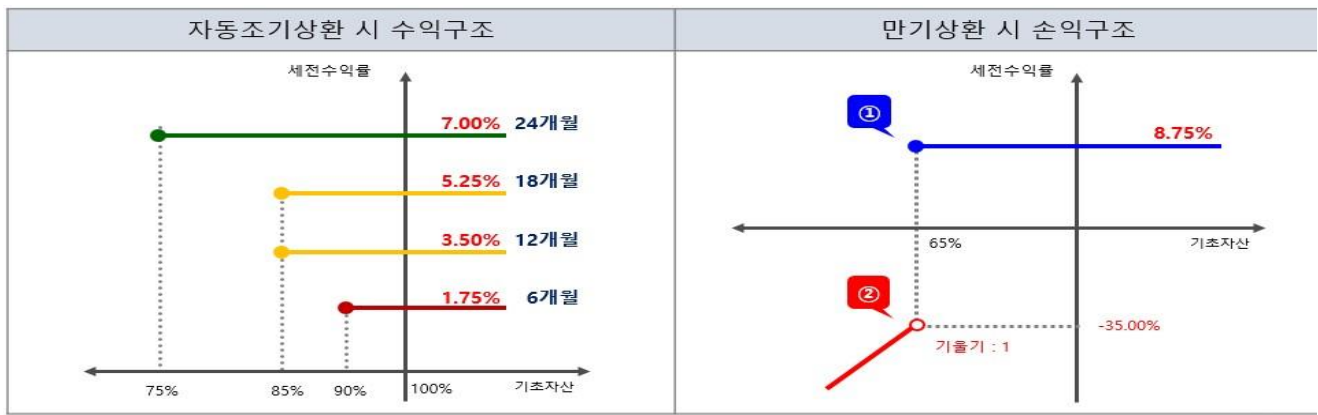
공시일: 2023-03-15

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



| | | | | |
|----------|--|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산 | | | |
| | 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 |
| | 90% 이상 | 85% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 |
| 만기상환 시 | ① 수익상환 | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우 | | |
| | ② 손실상환 | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만 인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% | | |

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

55

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

90

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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)

154

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

239

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

92

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

135

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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

18

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-40호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

94

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

149

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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

131

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

130

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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)

74

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

133

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 | 2,886 | | 2,886 | 장외 |
| 합계 | | | 2,886 | | 2,886 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

| |
|-----|
| 226 |
|-----|

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| |
|-----|
| 432 |
|-----|

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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

233

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

205

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

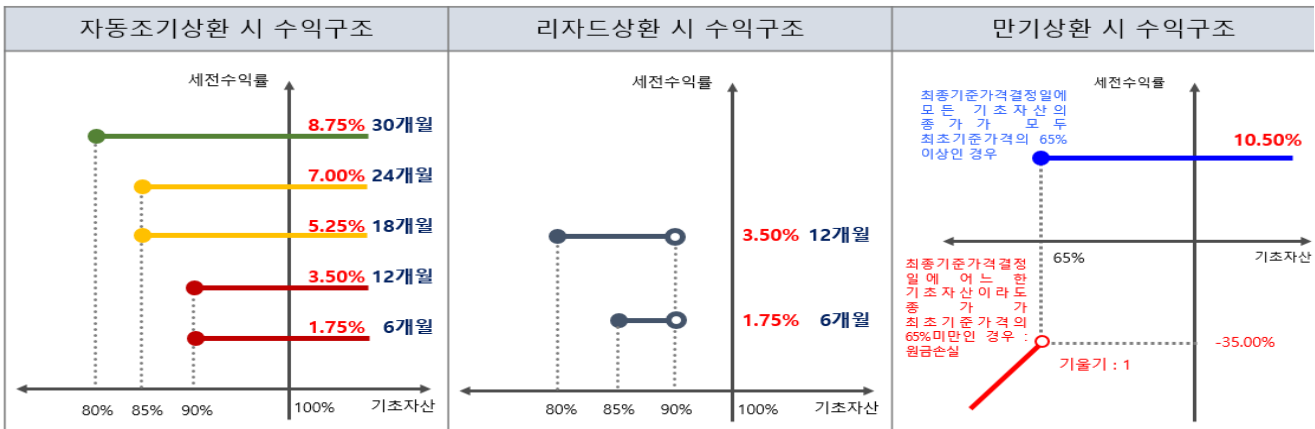
기준일 : 2023-03-14 공시일: 2023-03-15

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% |

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

128

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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)

104

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

95

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 1 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 2 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

30

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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"> 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 하나라도 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

52

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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"> 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 최초기준가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 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

37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

36

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

57

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

기준일 : 2023-03-14

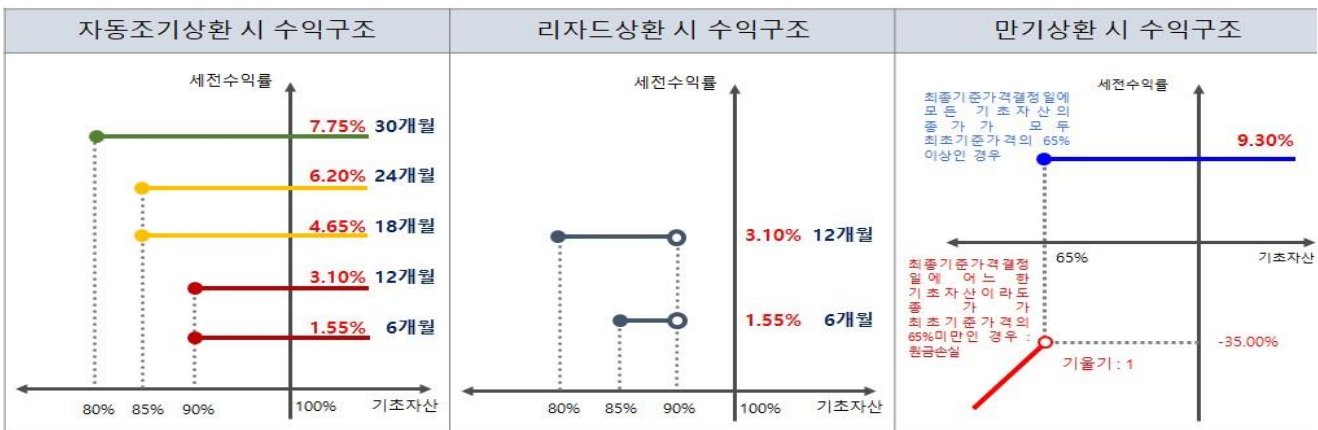
공시일: 2023-03-15

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

35

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

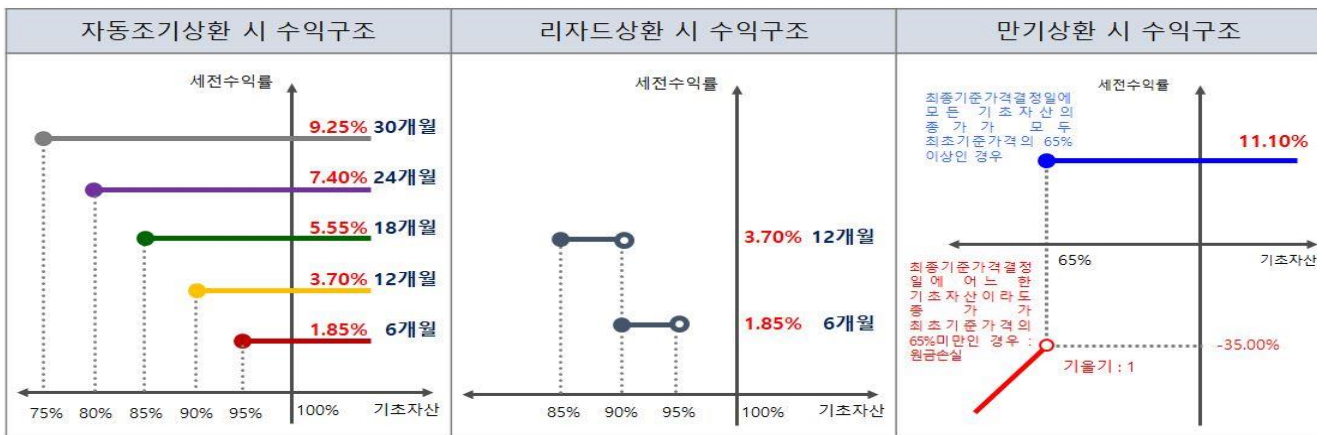
기준일 : 2023-03-14 공시일: 2023-03-15

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 1 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 2 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

105

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 ※ 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)

1

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

기준일 : 2023-03-14

공시일:

2023-03-15

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 1: 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 2: 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

115

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

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

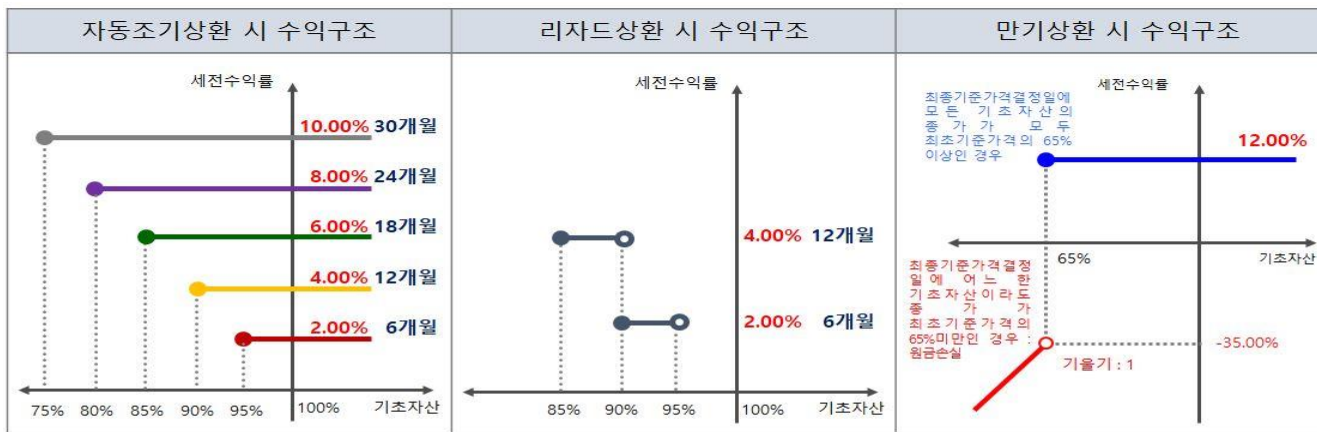
기준일 : 2023-03-14 공시일: 2023-03-15

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 $2.00\% \times n$ (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 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 \Rightarrow 연 4.00% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 \Rightarrow 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

207

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 하락한적이 없는 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 하락한적이 없는 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

78

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

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

기준일 : 2023-03-14

공시일:

2023-03-15

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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 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

125

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2023-03-14

공시일:

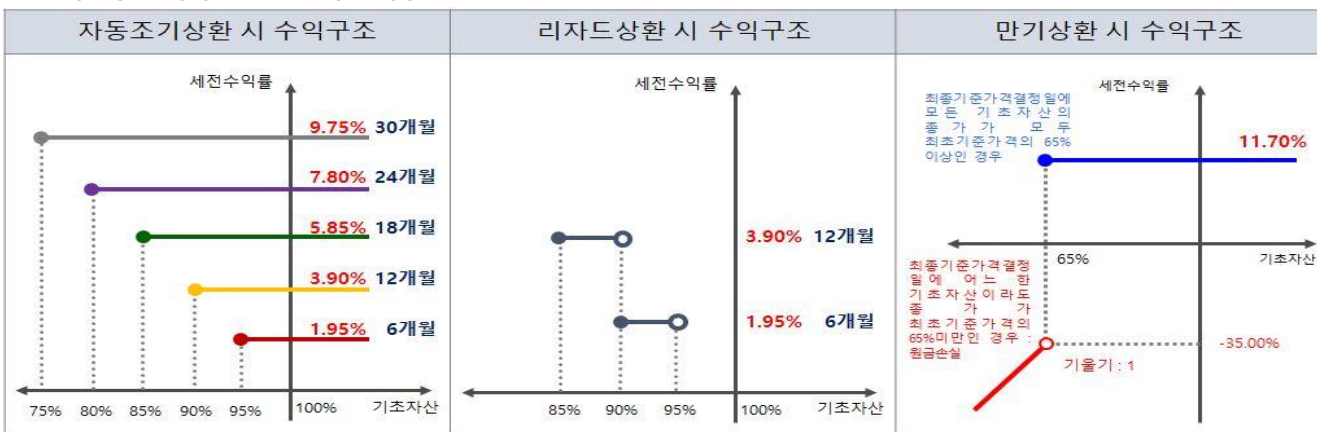
2023-03-15

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"> 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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 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

148

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 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 원금손실: 100% |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

250

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

16

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 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 자동조기상환평가일까지 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

102

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

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

기준일 : 2023-03-14

공시일:

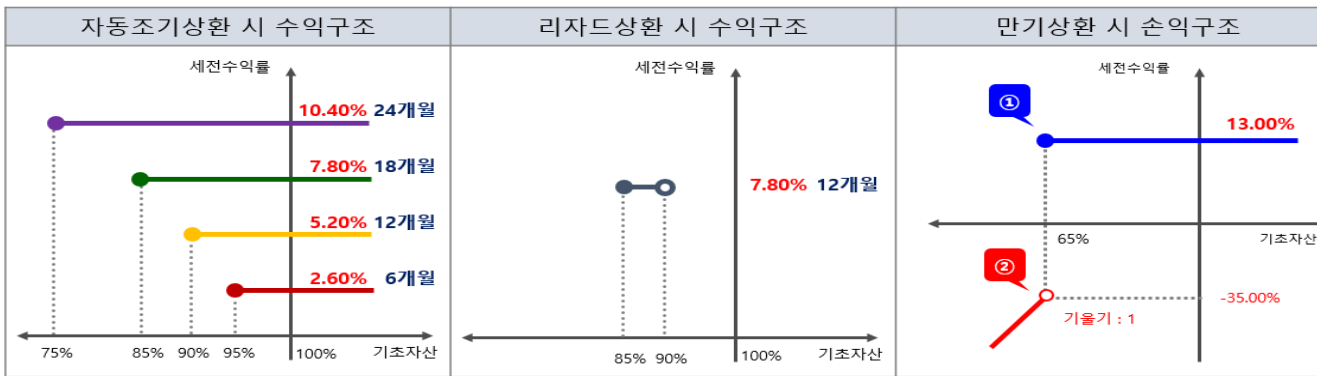
2023-03-15

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 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.60% 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 7.80% 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

26

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 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

147

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2023-03-14

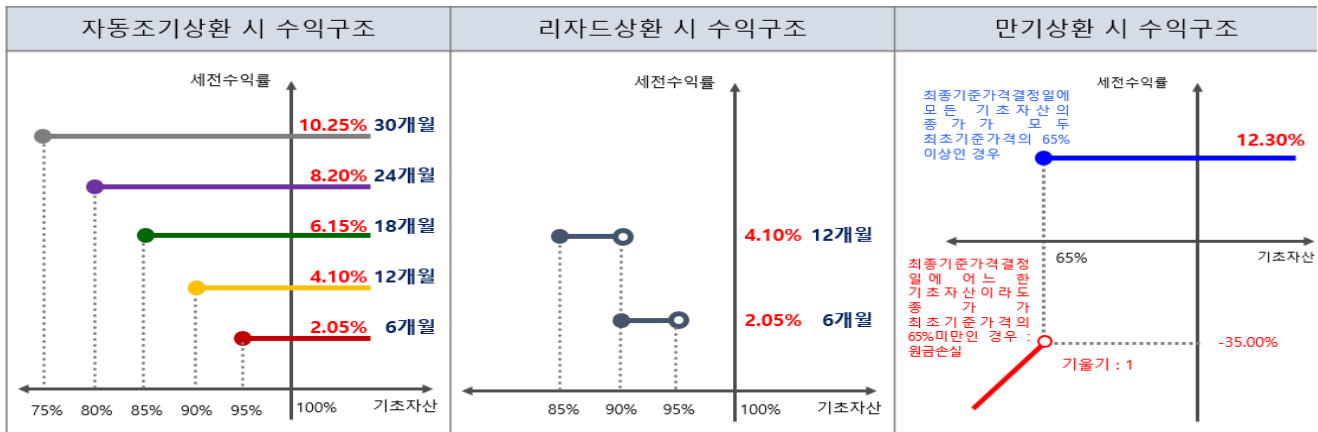
공시일: 2023-03-15

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

234

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 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

316

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

14

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

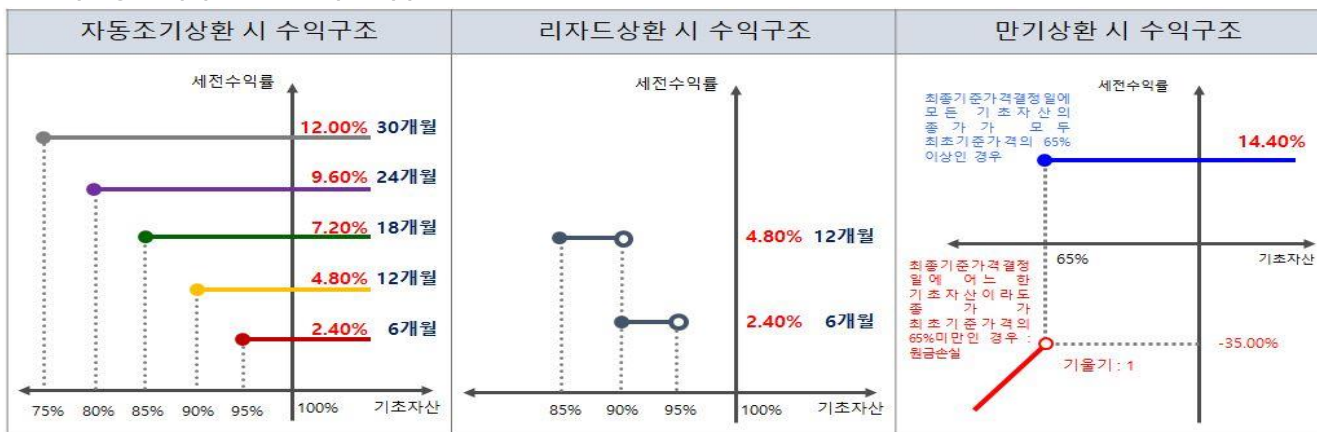
기준일 : 2023-03-14 공시일: 2023-03-15

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% 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 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

212

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 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 하나도 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

98

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-23호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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"> 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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 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

29

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-24호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 4.30% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 4.30% 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

147

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

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

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 3.10% 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 9.30% 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% | | |

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

70

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 | 2,223 | | 2,223 | 장외 |
| 합계 | | | 2,223 | | 2,223 | |

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 자동조기상환평가일까지 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

173

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

10

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-26호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 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

99

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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

74

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-28호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.70% 수익 지급 ▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.70% 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

104

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-29호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85% 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 3.10% 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 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.20% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.20% 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

50

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

기준일 : 2023-03-14 공시일: 2023-03-15

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



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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-31호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

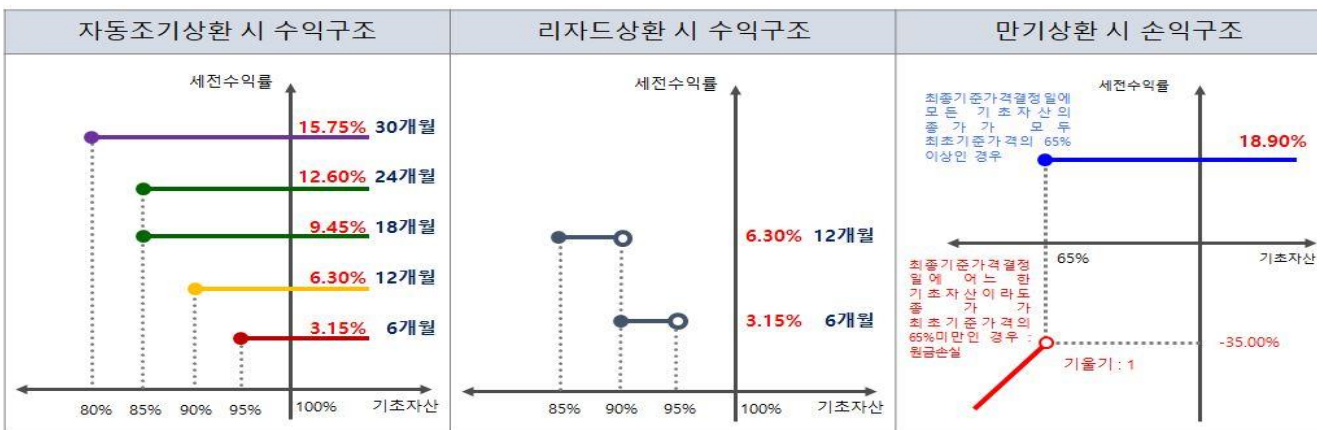
공시일: 2023-03-15

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 3.15% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 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

56

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-32호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.80% 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 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.60% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.60% 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

75

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-34호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-14

공시일: 2023-03-15

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85% 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.90% 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 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.80% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.80% 수익 지급 |
| 만기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% |

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

73

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-35호[ELS-파생형]

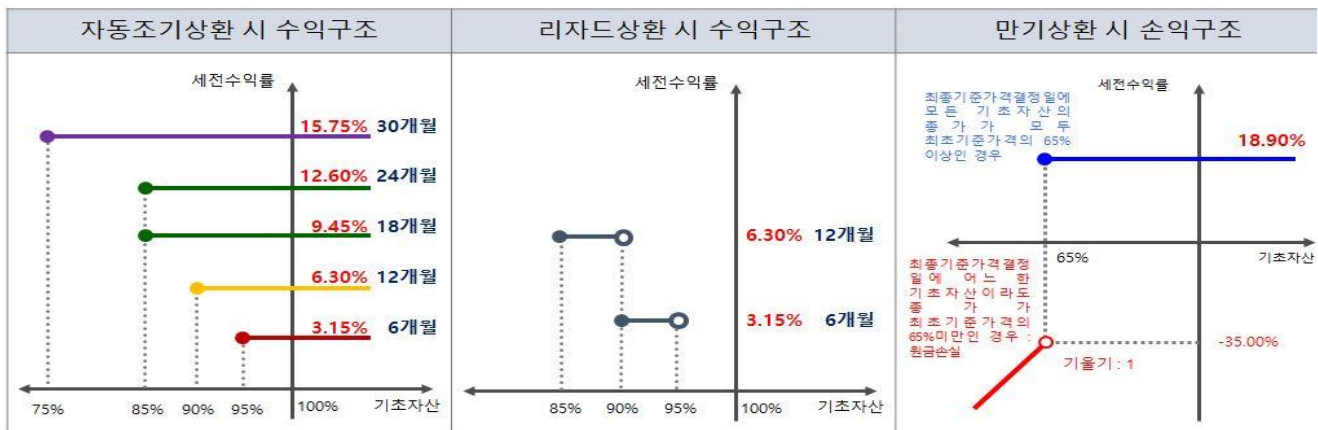
기준일 : 2023-03-14 공시일: 2023-03-15

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85% 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 3.15% 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 95%미만인 경우로서, 최초결제일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초결제일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 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

24

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2