

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-11-06

공시일: 2023-11-07

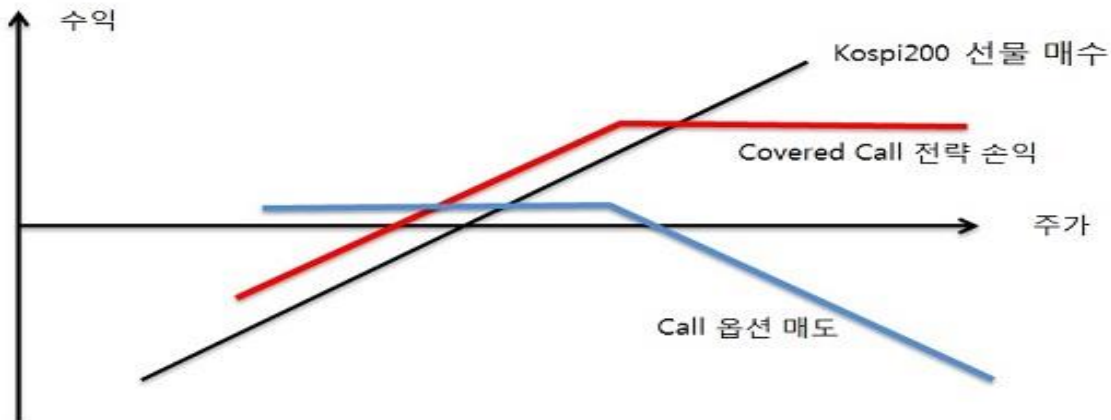
2023-11-07

## 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	3,509	0	3,509	장내
신규	유가증권	선물	420	92	328	장내
누계	유가증권	선물	679	0	679	장내
합계			4,188	0	4,188	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



위 그림은 투자자의 이해를 돕기 위하여 Kospi200지수를 기초자산으로 하는 선물 매수와 콜옵션 매도를 활용한 커버드콜 전략을 단순화하여 표시한 것입니다.

이 투자신탁은 Kospi200지수를 추종하는 인덱스펀드로 Kospi200 선물을 주로 투자하나, Kospi200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 동 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

282

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

302

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-11-06

공시일:

2023-11-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	718	0	718	장내
누계	주가지수	선물	23,775	0	23,775	장내
합계			23,775	0	23,775	

## 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

1,909

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,832

# 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-11-06

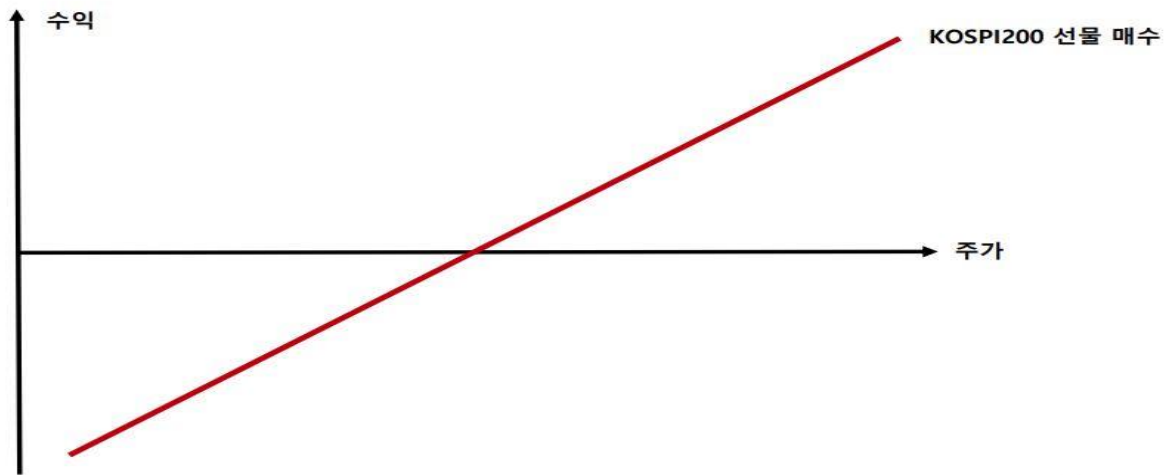
공시일: 2023-11-07

## 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	4,010	0	4,010	장내
신규	유가증권	선물	586	305	281	장내
누계	유가증권	선물	1,066	0	1,066	장내
합계			5,076	0	5,076	

## 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

322

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

365

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

기준일 : 2023-11-06

공시일: 2023-11-07

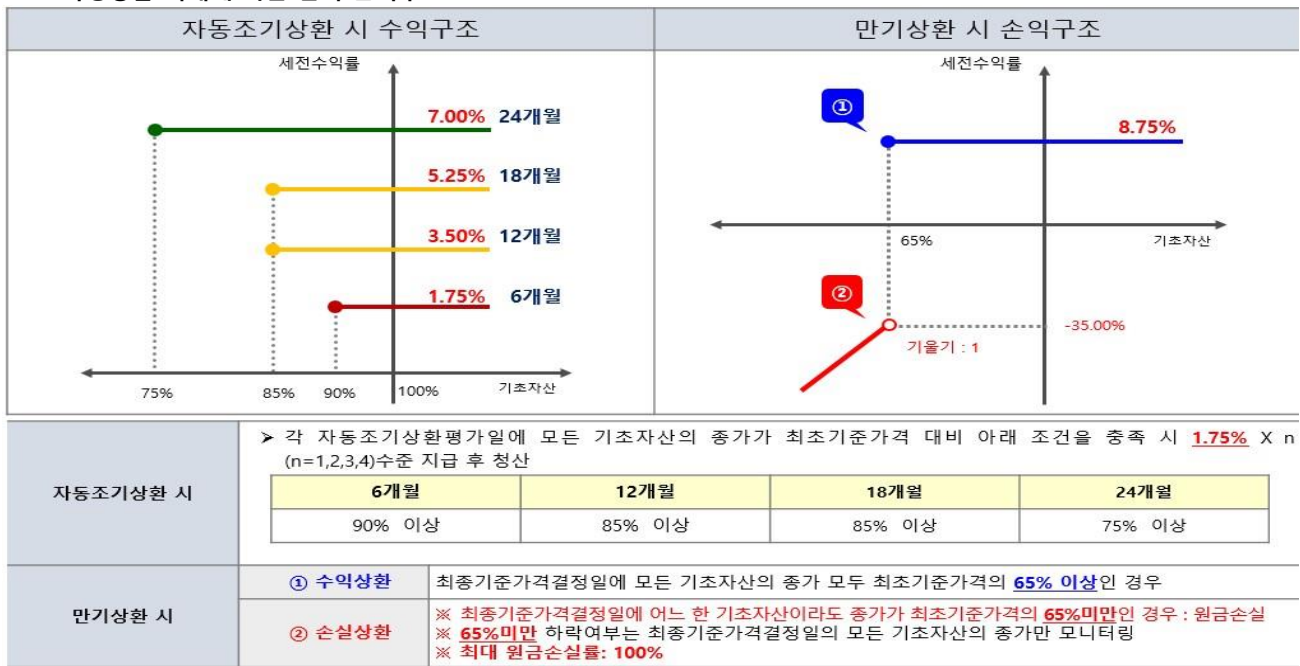
2023-11-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,850		2,850	장외
합계			2,850		2,850	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

124

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

191

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

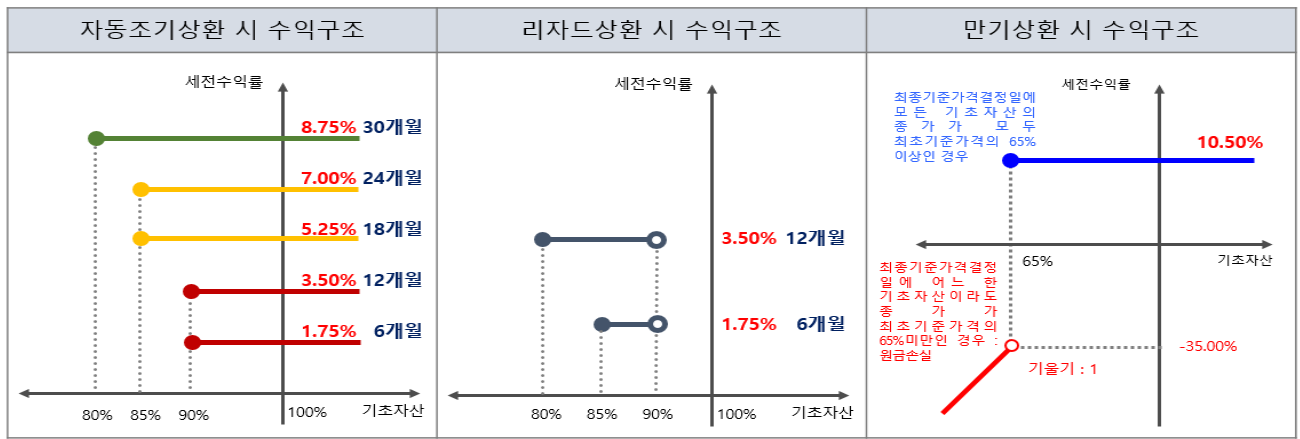
2023-11-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,850		1,850	장외
합계			1,850		1,850	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.75% X n (n=1,2,3,4,5)</b> 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>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

178

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

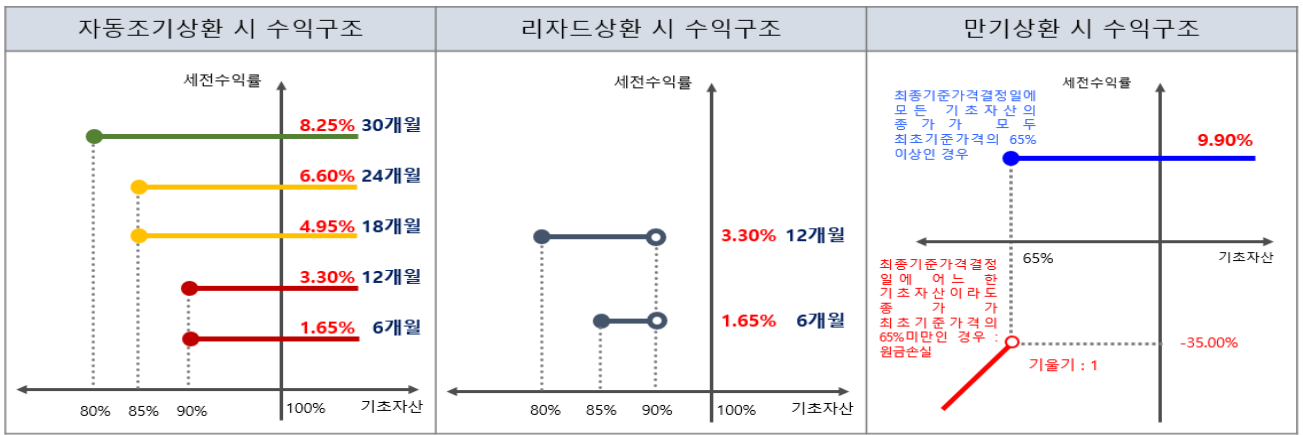
2023-11-07

## 1. 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%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.30%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.30%</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

43

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

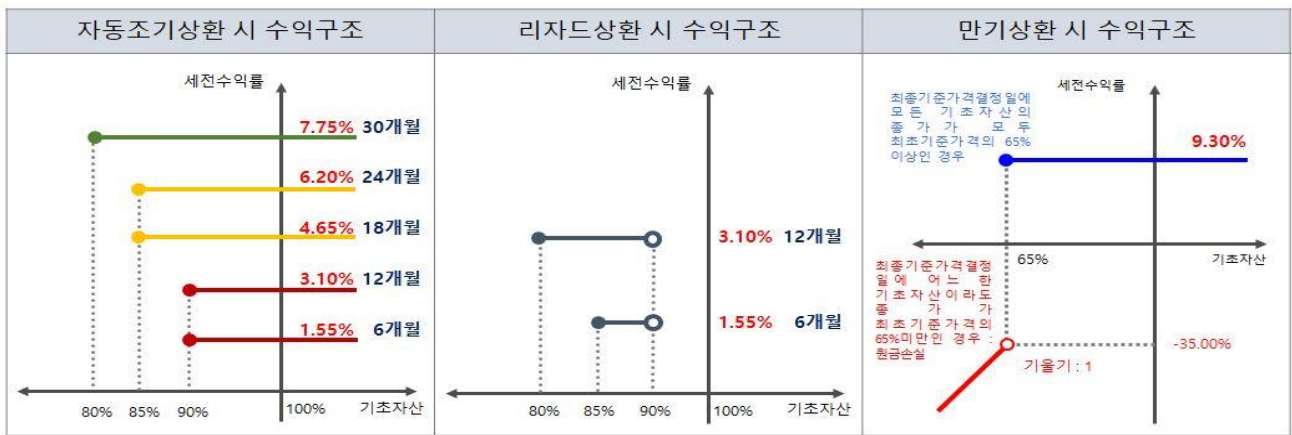
2023-11-07

## 1. 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> ⇒ 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% 미만</b>으로 하락한적이<b>없는</b> 경우 ⇒ 연 <b>3.10%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만</b>으로 하락한적이<b>없는</b> 경우 ⇒ 연 <b>3.10%</b> 수익지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

70

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

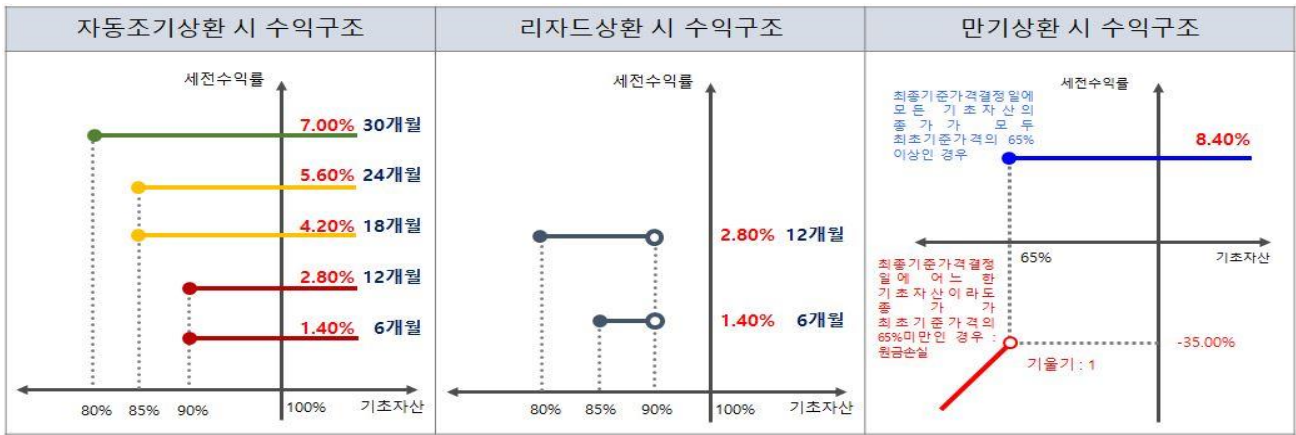
2023-11-07

## 1. 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 수익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

45

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

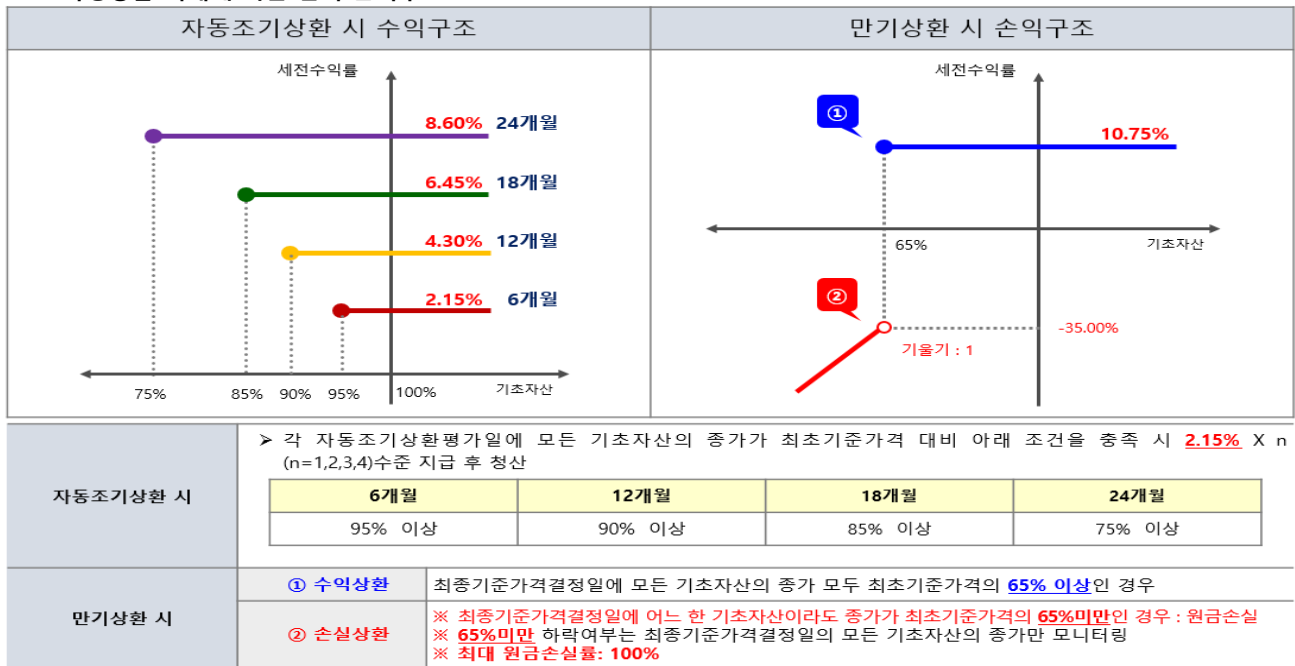
2023-11-07

## 1. 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

53

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

85

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

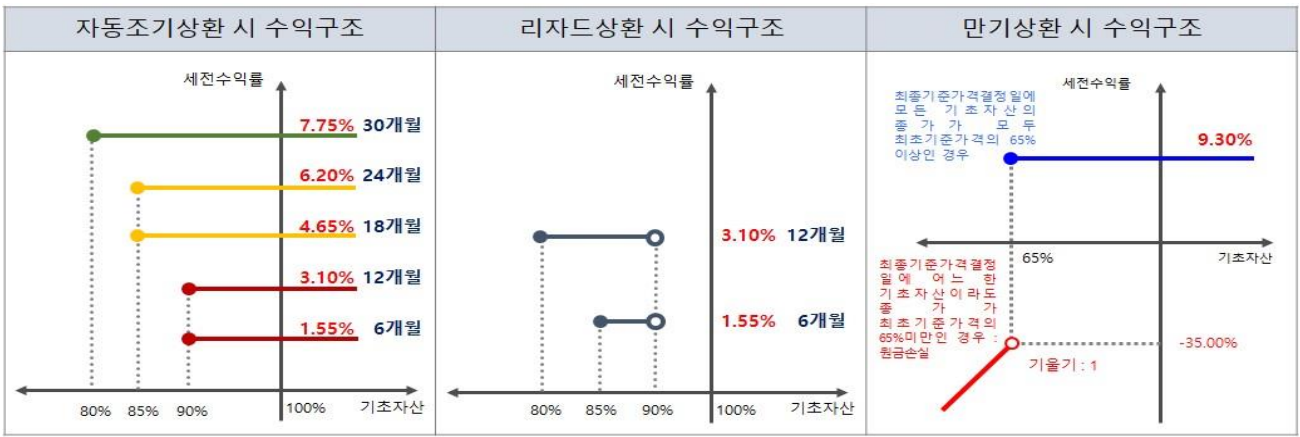
2023-11-07

## 1. 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 수익구조



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

45

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

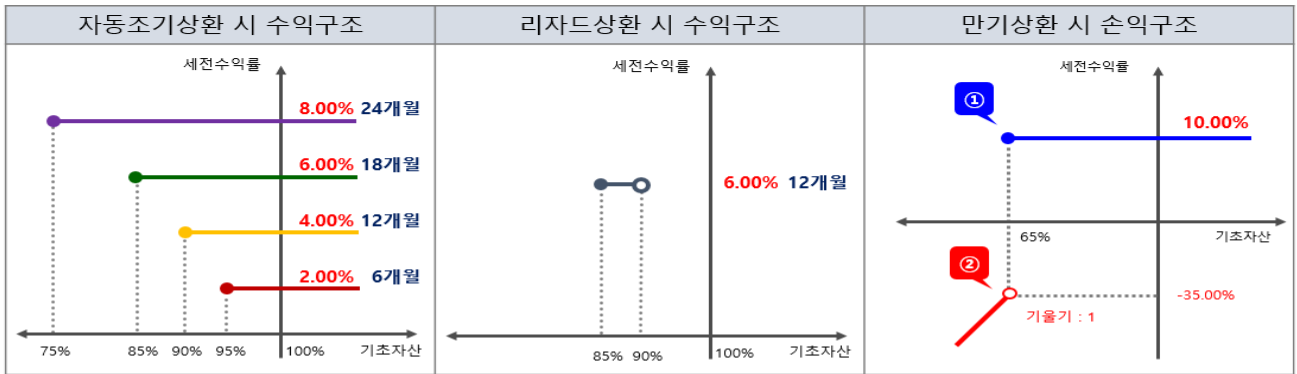
2023-11-07

## 1. 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 <b>2.00%</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> ⇒ 연 <b>6.00%</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 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

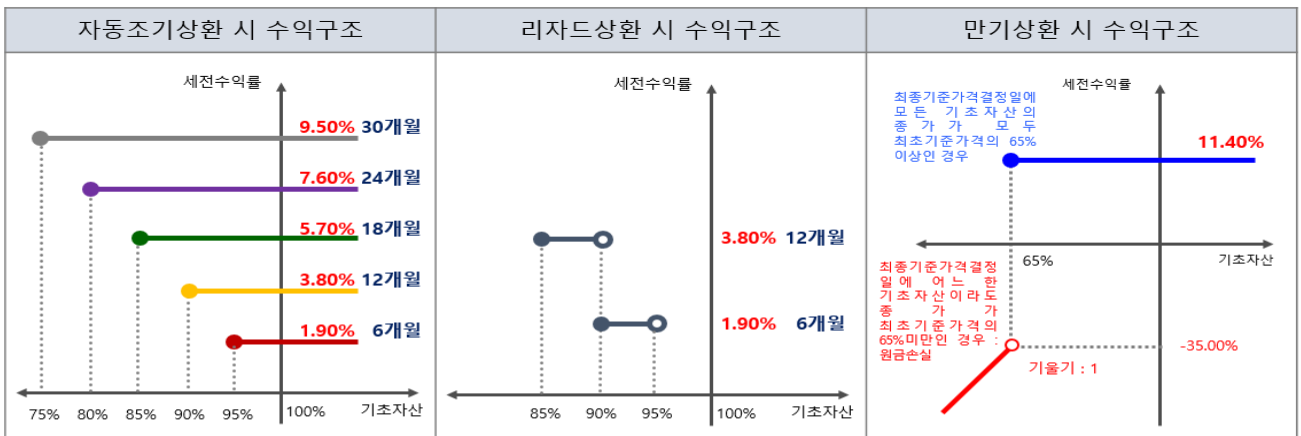
2023-11-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,395		1,395	장외
합계			1,395		1,395	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

171

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

2023-11-07

## 1. 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 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자동조기상환 시</p> <p>                     &gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>2.60%</b> X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산                 </p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>95% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상	<p>리자드상환 시</p> <p>                     &gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 7.80%</b> 수익 지급                 </p>	<p>만기상환 시</p> <p>                     ① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b>인 경우                      ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b>인 경우 : 원금손실                      ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링                      ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> </p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

39

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

17

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

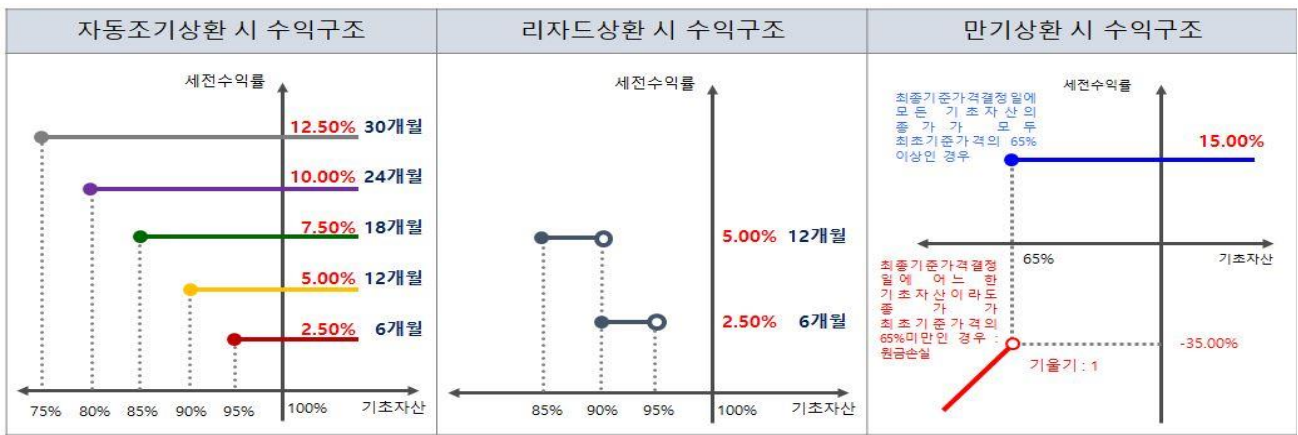
2023-11-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	376		376	장외
합계			376		376	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <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%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 5.00%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.00%</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

35

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2023-11-06

공시일:

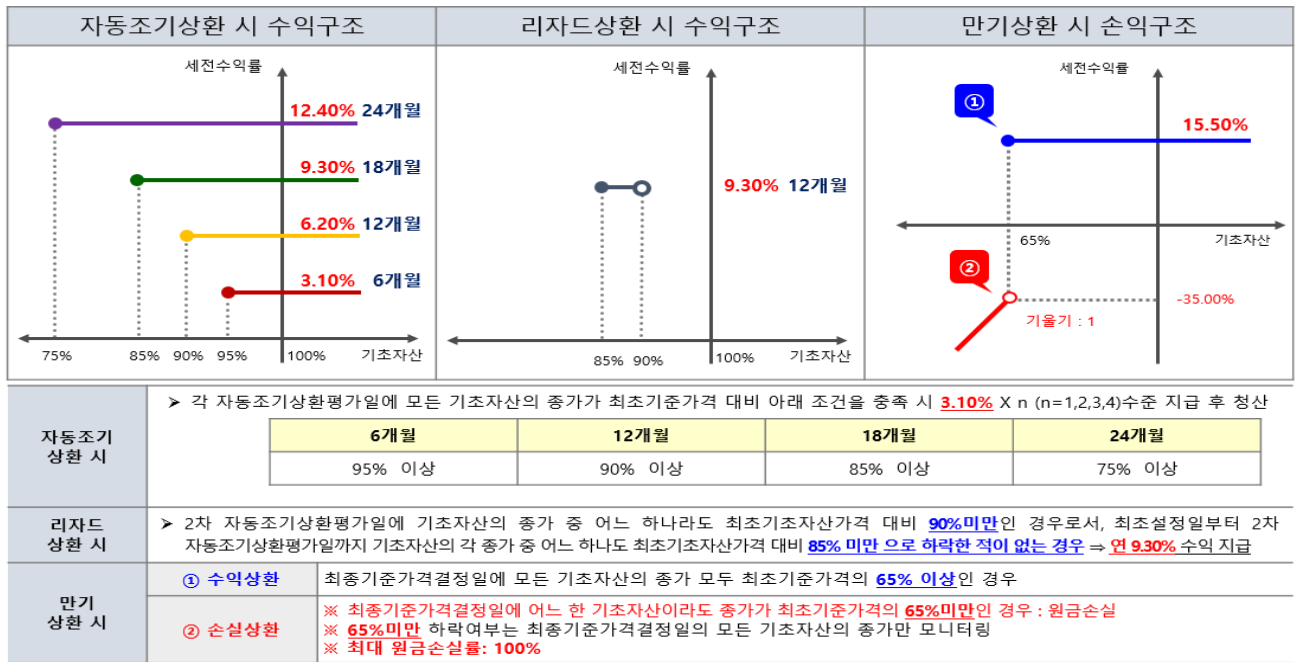
2023-11-07

## 1. 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

97

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

96