# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

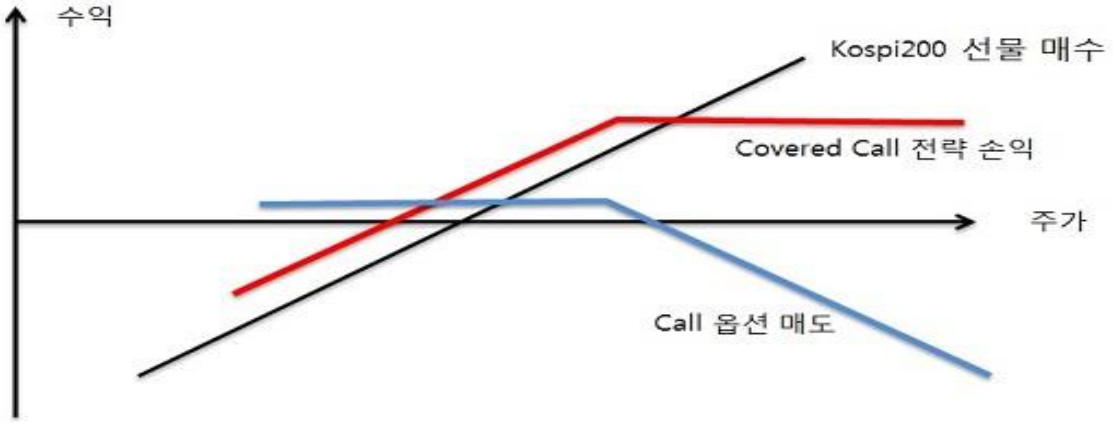
기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 186 | 186 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 93 | 0 | 93 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 169 | 504 | -336 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,091 | 0 | 1,091 | 장내 |
| 합계 | | | 1,184 | 0 | 1,184 | |

## 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

68

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

111

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

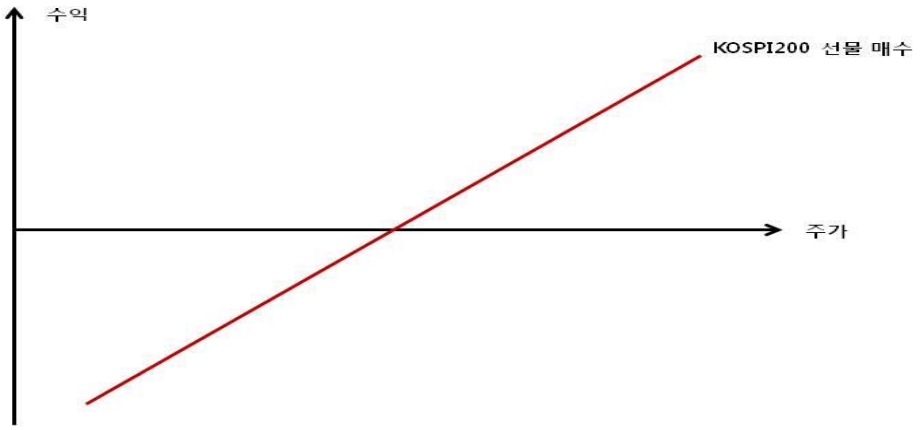
기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 10,985 | 11,226 | -241 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 25,849 | 0 | 25,849 | 장내 |
| 합계 | | | 25,849 | 0 | 25,849 | |

## 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 투자신탁은 KOSPI200지수 일간수익률 2배를 추종하는 레버리지 펀드로 KOSPI200 선물에 주로 투자하나, KOSPI200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 동 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,084

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,053

# 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

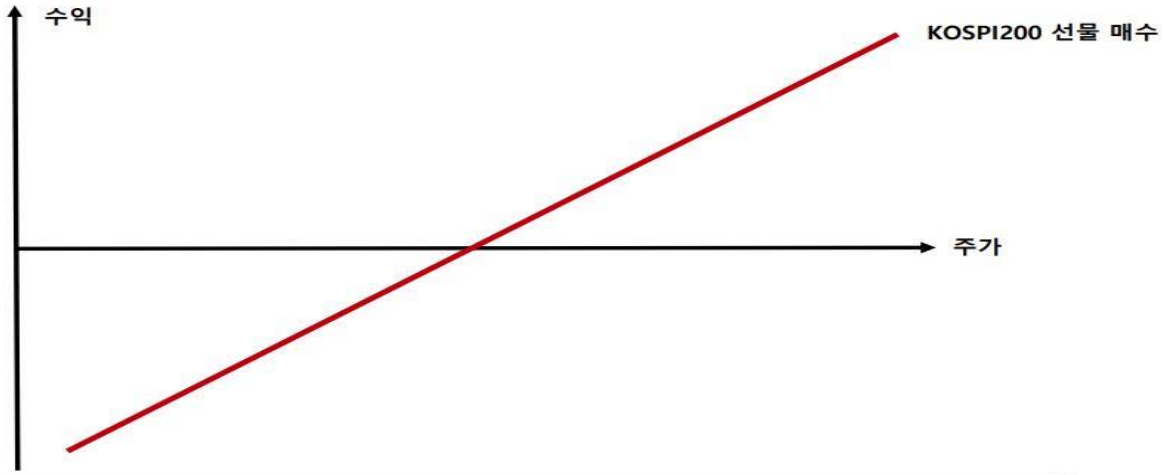
기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 186 | 186 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 278 | -278 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 77 | 652 | -575 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,248 | 0 | 2,248 | 장내 |
| 합계 | | | 2,248 | 278 | 1,969 | |

## 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

130

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

218

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

기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

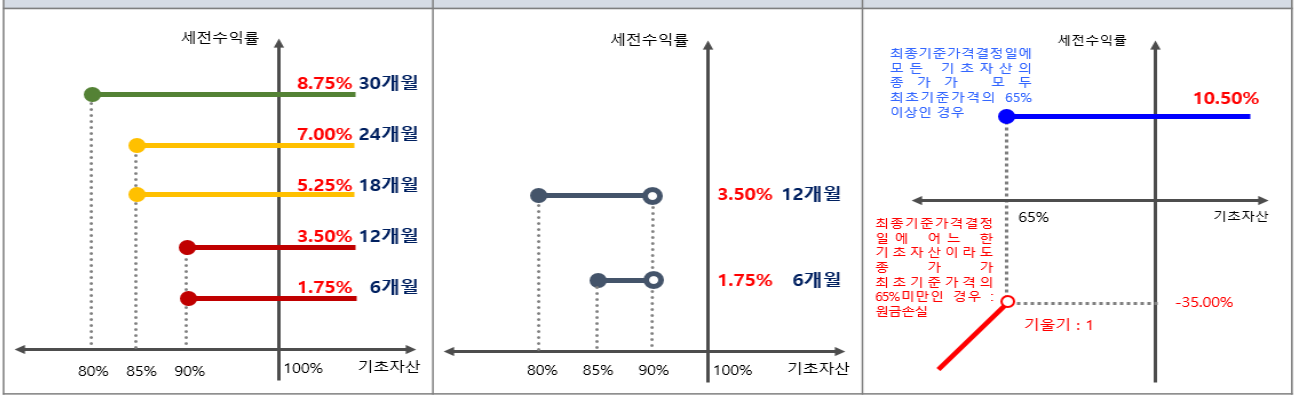
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,718 | | 1,718 | 장외 |
| 합계 | | | 1,718 | | 1,718 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조 | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 수익구조 |
|---|---|---|




| | |
|---|---|
| 자동조기상환 시 | ➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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 | ➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.50%** 수익 지급<br>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.50%** 수익 지급 |
| 만기상환 시 | ※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링<br>※ **최대 원금손실률: 100%** |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

88

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

기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

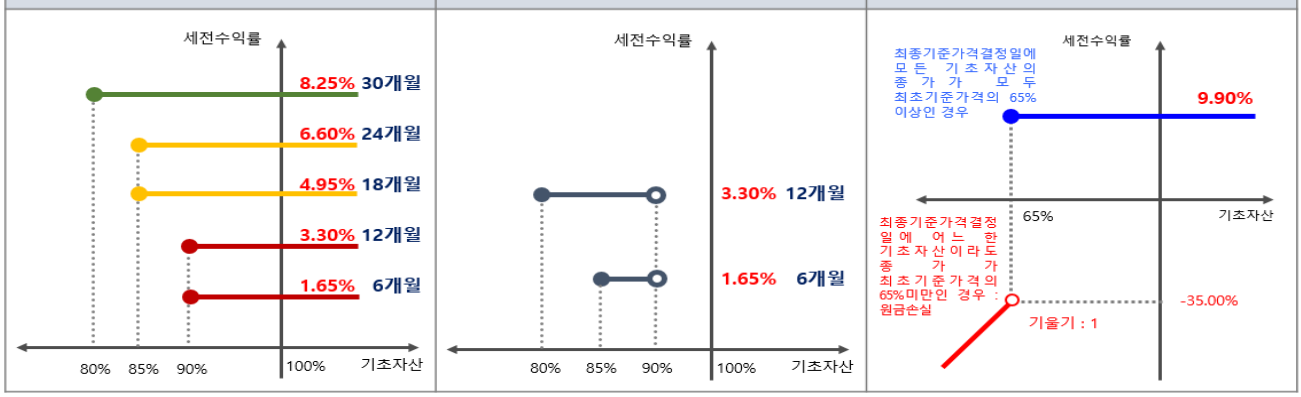
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 227 | | 227 | 장외 |
| 합계 | | | 227 | | 227 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조 | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 수익구조 |
|---|---|---|




| | |
|---|---|
| 자동조기상환 시 | ➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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 | ➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.30%** 수익 지급<br>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.30%** 수익 지급 |
| 만기상환 시 | ※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링<br>※ **최대 원금손실률: 100%** |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

| |
|---|
| 14 |

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

| |
|---|
| 8 |

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

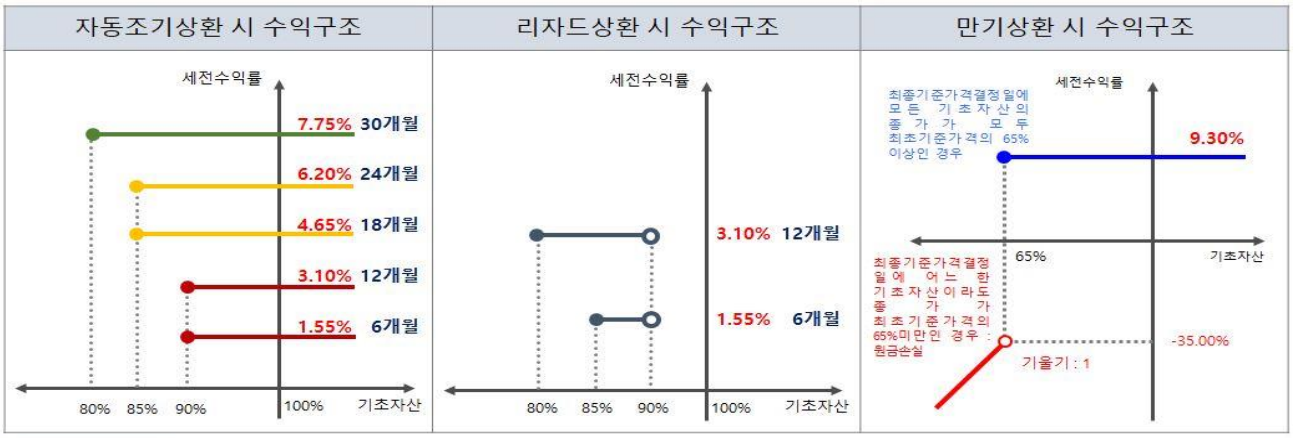
기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

## 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 | 722 | | 722 | 장외 |
| 합계 | | | 722 | | 722 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조




| | |
|---|---|
| 자동조기상환 시 | ➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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 | ➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.10%** 수익지급<br>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.10%** 수익지급 |
| 만기상환 시 | ※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링<br>※ **최대 원금손실률: 100%** |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

56

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

20

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

기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

## 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 수익구조 | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 수익구조 |
|---|---|---|

| | |
|---|---|
| 자동조기상환 시 | ➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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 | ➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 수익지급<br>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 수익지급 |
| 만기상환 시 | ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링<br>※ 최대 원금손실률: 100% |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

128

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

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

기준일 : 2024-06-12 공시일: 2024-06-13

## 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 | 460 | | 460 | 장외 |
| 합계 | | | 460 | | 460 | |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조 | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 수익구조 |
|---|---|---|

| | |
|---|---|
| 자동조기상환 시 | ➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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 | ➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.10%** 수익지급<br>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.10%** 수익지급 |
| 만기상환 시 | ※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링<br>※ **최대 원금손실률: 100%** |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

95

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1