

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-11-01

공시일: 2024-11-04

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	506	422	84	장내
누계	주가지수	선물	2,784	0	2,784	장내
신규	유가증권	선물	28	15	13	장내
누계	유가증권	선물	666	84	582	장내
합계			3,450	84	3,366	

## 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

223

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

306

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-11-01

공시일:

2024-11-04

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	135	-135	장내
누계	주가지수	선물	23,591	0	23,591	장내
합계			23,591	0	23,591	

## 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

1,892

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,278

## 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-11-01

공시일: 2024-11-04

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	4,640	1,266	3,375	장내
누계	주가지수	선물	1,434	0	1,434	장내
신규	유가증권	선물	84	45	38	장내
누계	유가증권	선물	1,567	0	1,567	장내
합계			3,001	0	3,001	

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

115

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

282