

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-11-12

공시일: 2024-11-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	409	245	164	장내
누계	주가지수	선물	5,237	0	5,237	장내
신규	유가증권	선물	106	53	53	장내
누계	유가증권	선물	659	76	583	장내
합계			5,896	76	5,820	

## 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

420

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

521

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-11-12

공시일:

2024-11-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	491	-491	장내
누계	주가지수	선물	22,290	0	22,290	장내
합계			22,290	0	22,290	

## 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

1,787

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,102

## 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-11-12

공시일: 2024-11-13

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	982	2,455	-1,473	장내
누계	주가지수	선물	82	0	82	장내
신규	유가증권	선물	265	212	53	장내
누계	유가증권	선물	1,458	0	1,458	장내
합계			1,540	0	1,540	

### 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

67

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

220