

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-09-01

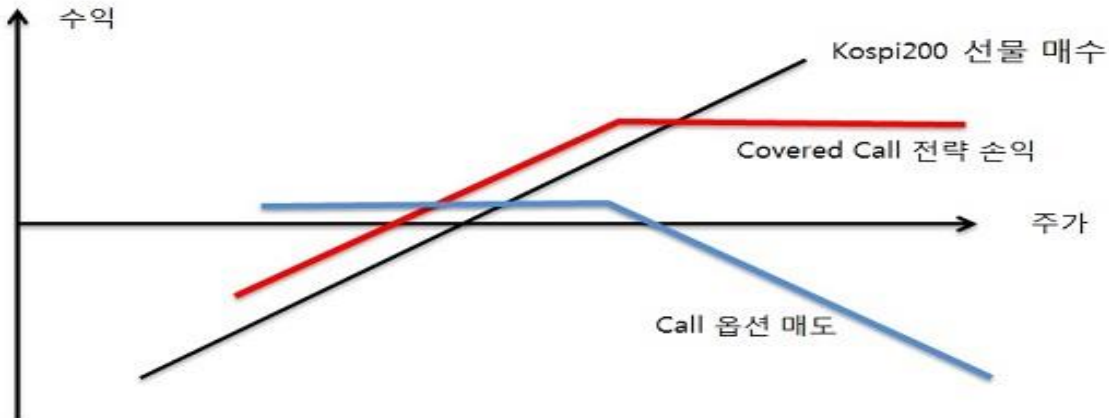
공시일: 2025-09-02

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 106   | 0     | 106       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 4,762 | 0     | 4,762     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,158 | 30    | 1,128     | 장내 |
| 합계 |      |      | 5,921 | 30    | 5,890     |    |

## 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

381

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

550

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-09-01

공시일:

2025-09-02

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 317    | 0     | 317       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 26,754 | 0     | 26,754    | 장내 |
| 합계 |      |      | 26,754 | 0     | 26,754    |    |

## 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 펀드 KOSPI200 선물에 주로 투자하나, KOSPI200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 둘 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,141

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,543

## 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-09-01

공시일:

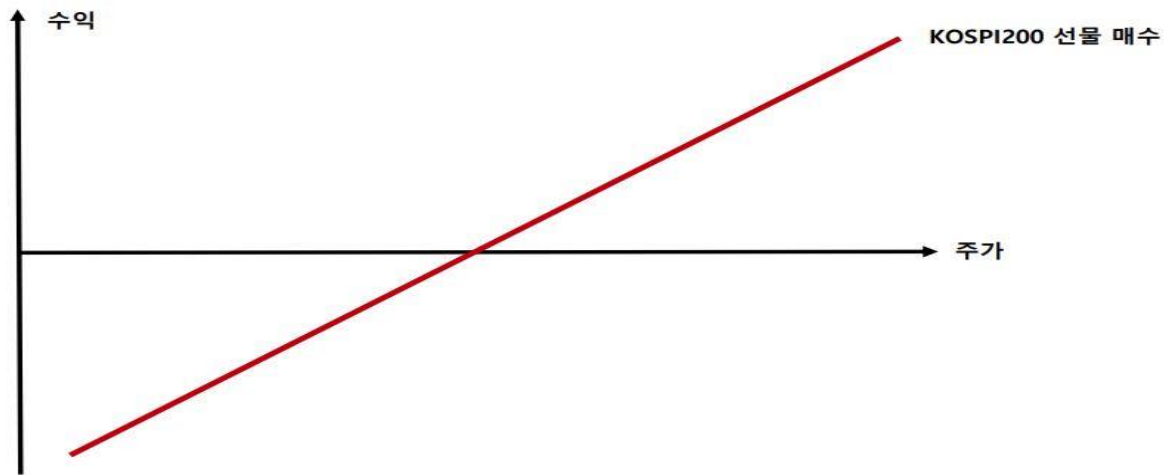
2025-09-02

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 106   | 0     | 106       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 6,032 | 0     | 6,032     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,424 | 0     | 1,424     | 장내 |
| 합계 |      |      | 7,457 | 0     | 7,457     |    |

### 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

483

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

645