

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-05-18

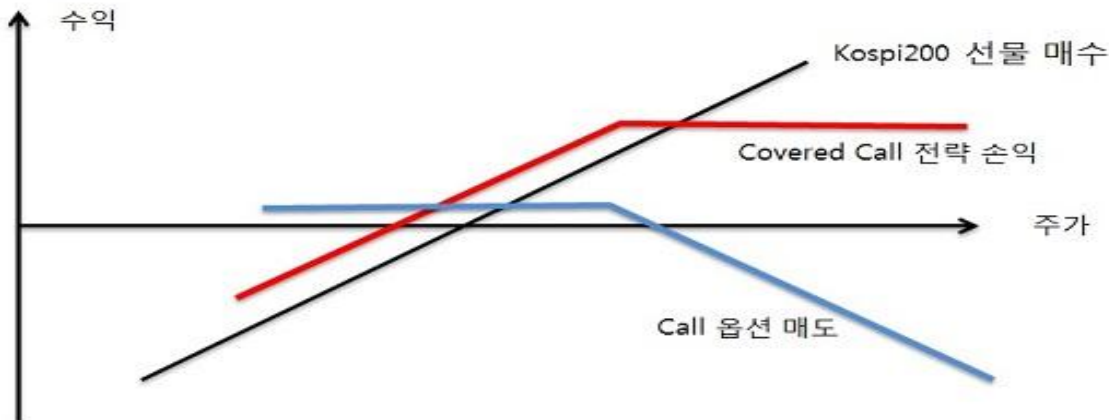
공시일: 2026-05-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 3,514 | 1,464 | 2,050 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 14,056 | 0 | 14,056 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 17,750 | 325 | 17,425 | 장내 |
| 합계 | | | 31,805 | 325 | 31,480 | |

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

1,125

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,146

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-05-18

공시일:

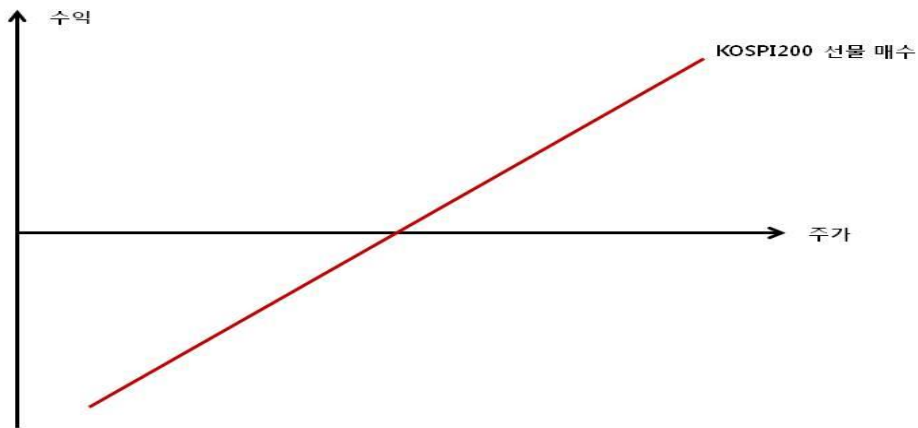
2026-05-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 1,640 | -1,640 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 65,593 | 117 | 65,476 | 장내 |
| 합계 | | | 65,593 | 117 | 65,476 | |

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

5,241

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11,744

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-05-18

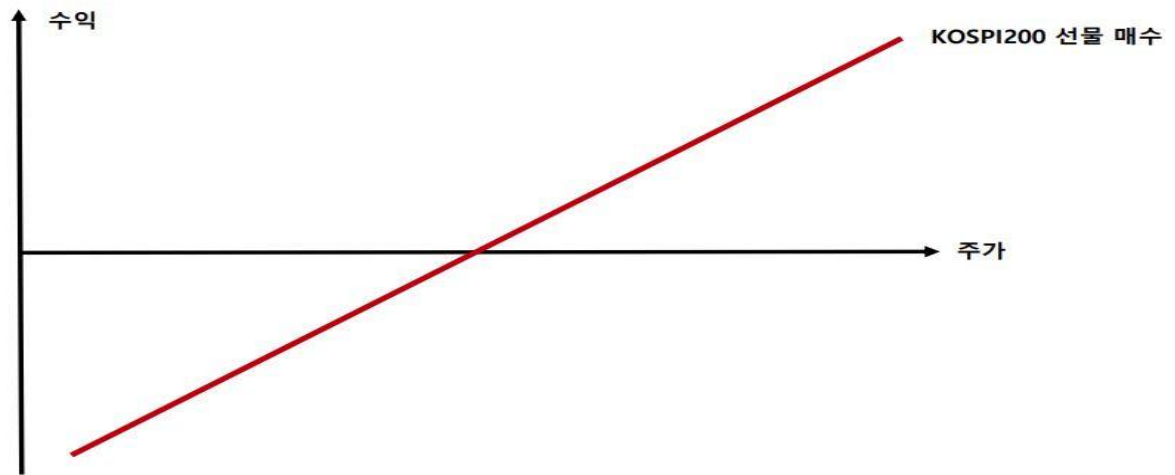
공시일: 2026-05-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 1,171 | 1,171 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 18,155 | 0 | 18,155 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 10,649 | 0 | 10,649 | 장내 |
| 합계 | | | 28,804 | 0 | 28,804 | |

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

1,453

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6,273