펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

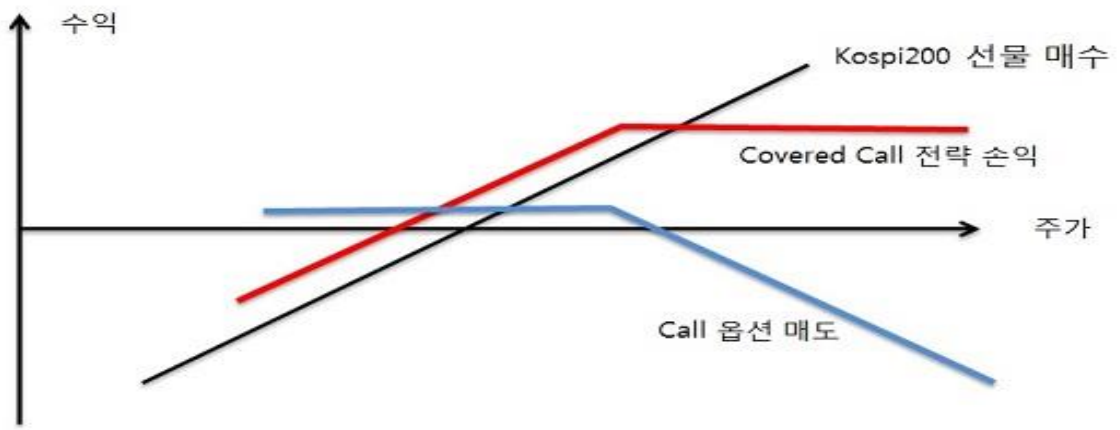
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,183	1,183	0	장내
누계	주가지수	선물	2,872	0	2,872	장내
신규	유가증권	선물	219	219	0	장내
누계	유가증권	선물	1,361	26	1,335	장내
합계			4,234	26	4,208	

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	230

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	273

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

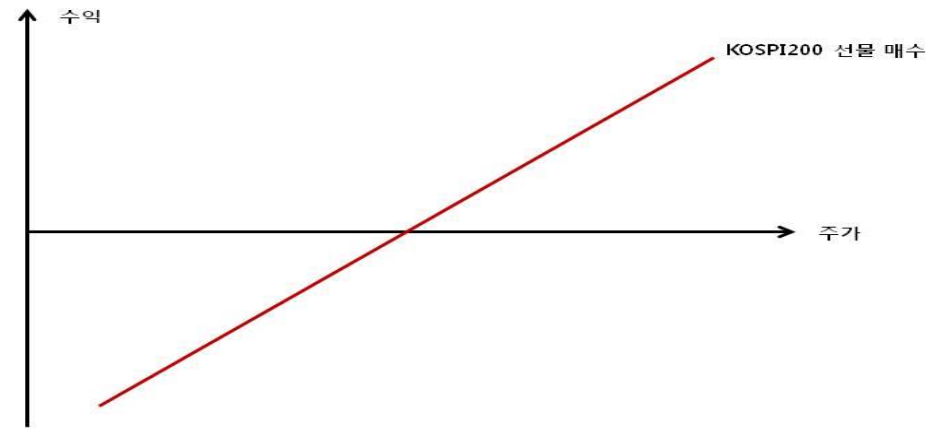
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	5,576	5,593	-17	장내
누계	주가지수	선물	23,520	0	23,520	장내
합계			23,520	0	23,520	

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

1,882

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,740

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

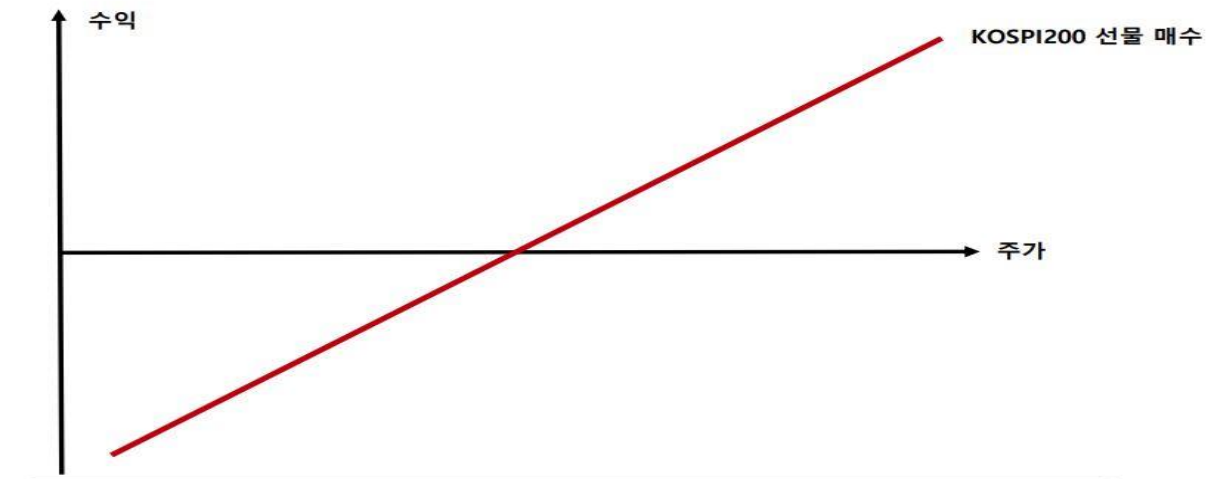
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,183	1,183	0	장내
누계	주가지수	선물	3,971	0	3,971	장내
신규	유가증권	선물	365	365	0	장내
누계	유가증권	선물	1,671	0	1,671	장내
합계			5,642	0	5,642	

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	318

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	369

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

기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

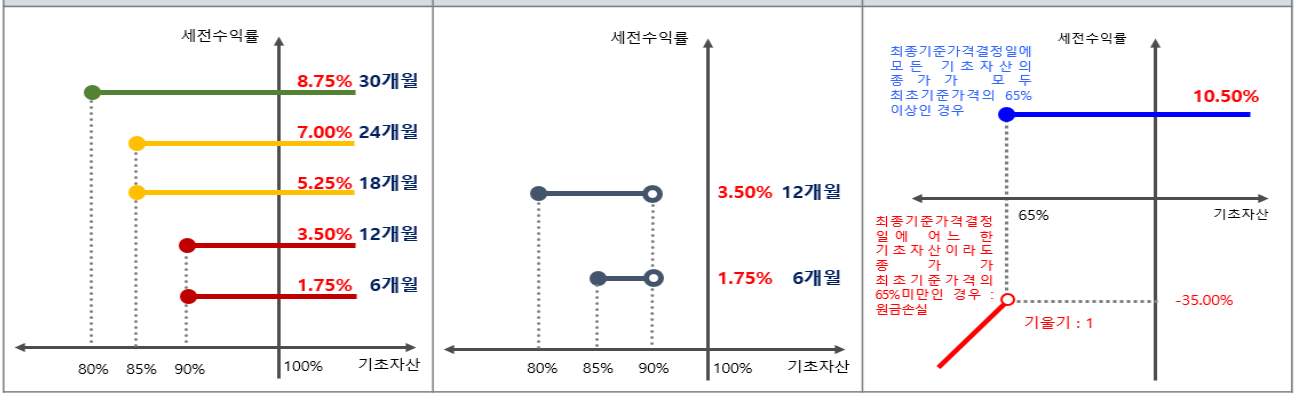
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,840		1,840	장외
합계			1,840		1,840	

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 ➢ 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 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

153

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

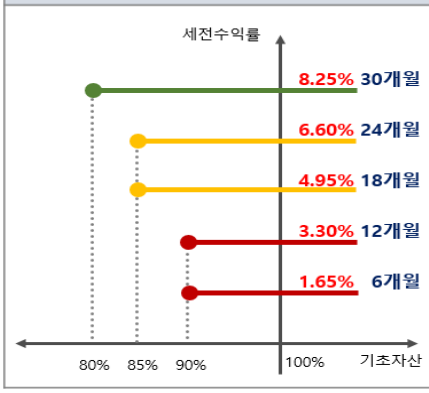
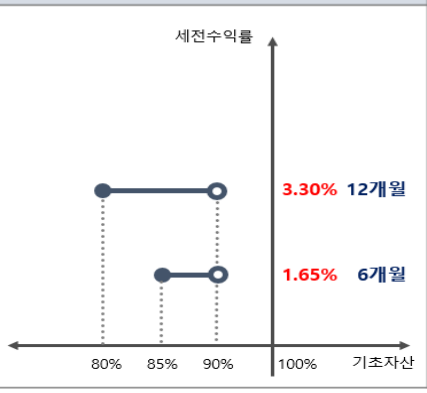
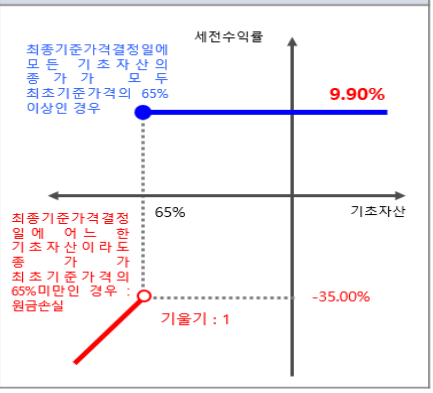
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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	450		450	장외
합계			450		450	

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 ➢ 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 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

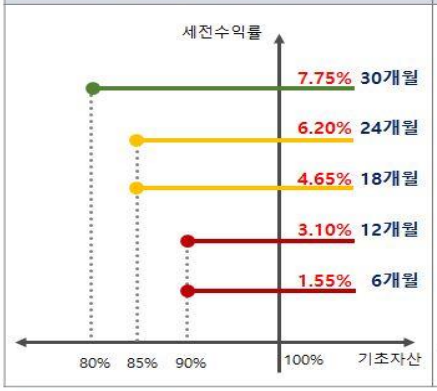
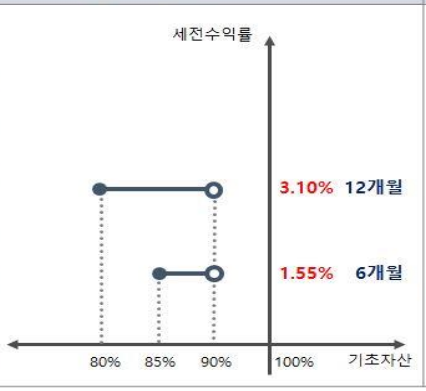
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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 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 ➢ 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 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

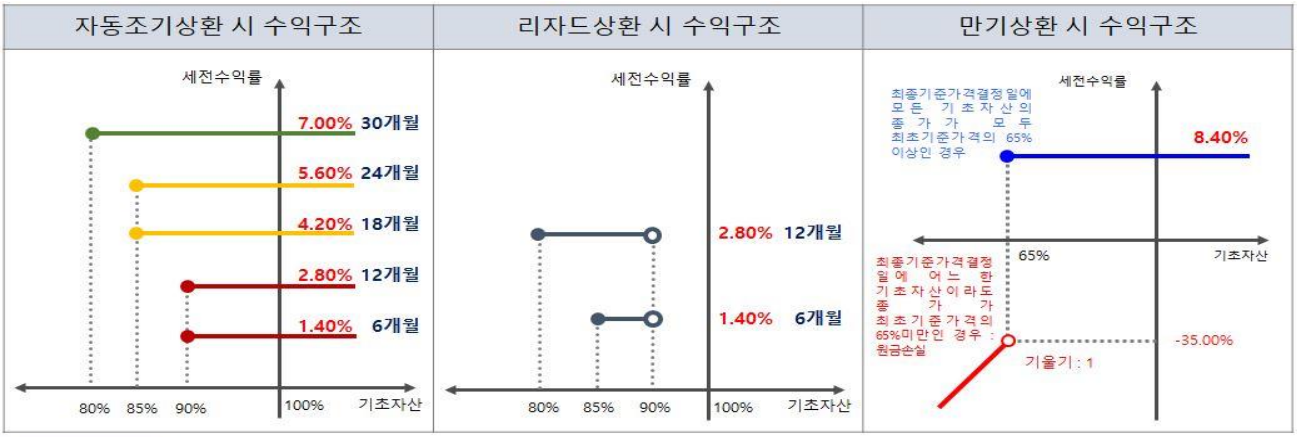
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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	➢ 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 ➢ 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 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

48

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)H-1호(온라인전용)[ELS-파생형]

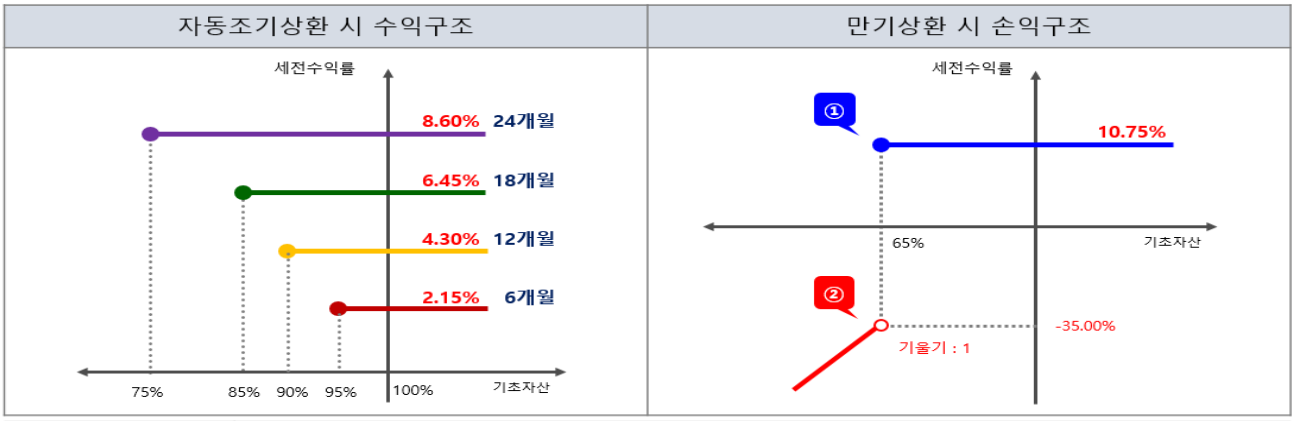
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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	414		414	장외
합계			414		414	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.15% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

6개월	12개월	18개월	24개월
95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

43

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

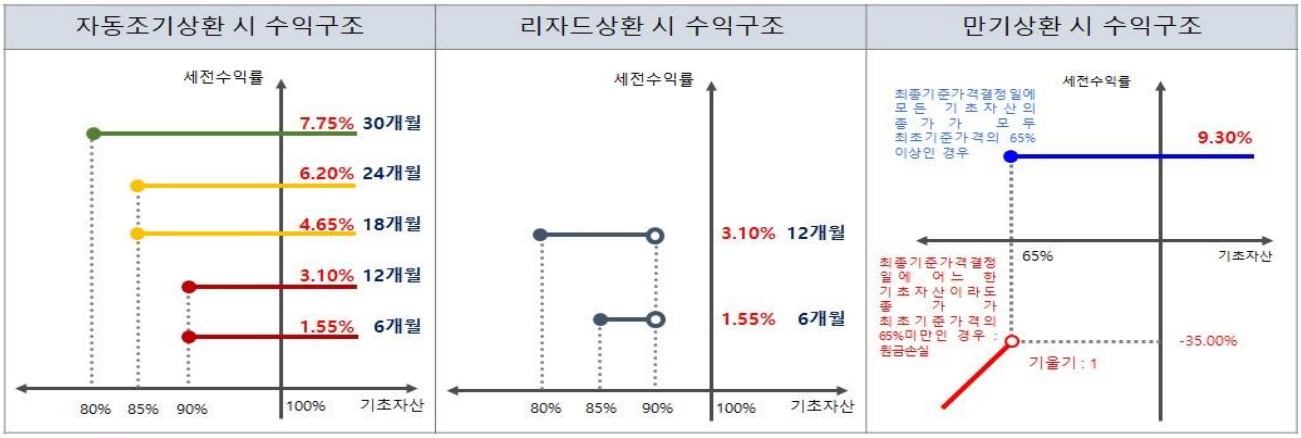
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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	498		498	장외
합계			498		498	

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 ➢ 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 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

46

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK리자드지수연계증권SHE(KRW)-7호[ELS-파생형]

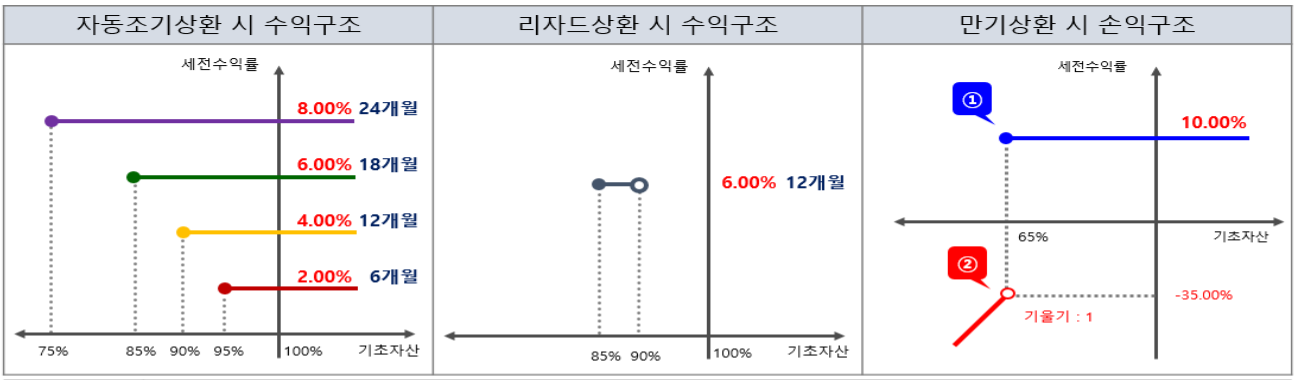
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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	167		167	장외
합계			167		167	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기 상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상

리자드 상환 시

➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급

만기 상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-11호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

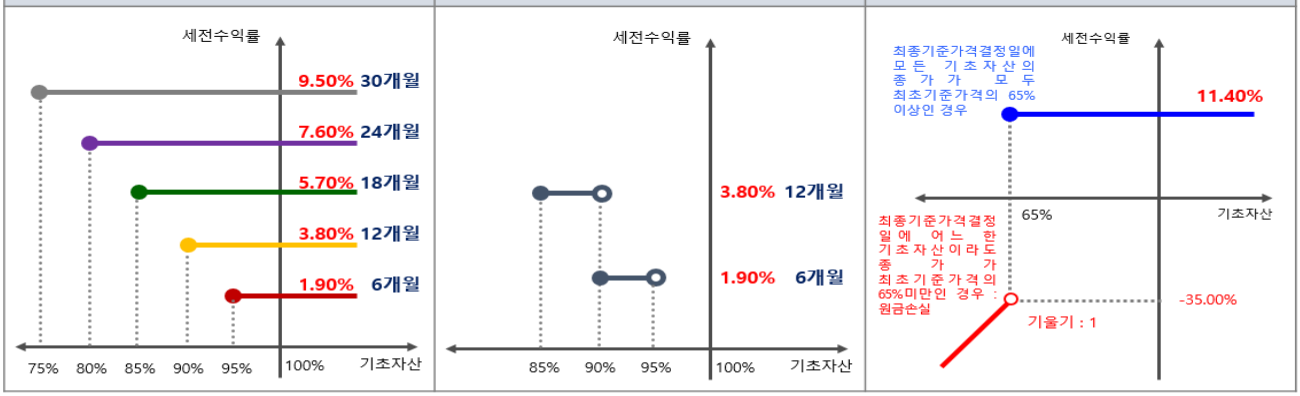
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,395		1,395	장외
합계			1,395		1,395	

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 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우** ☞ **1.90%** X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **95%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.80%** 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.80%** 수익 지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

166

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-44호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

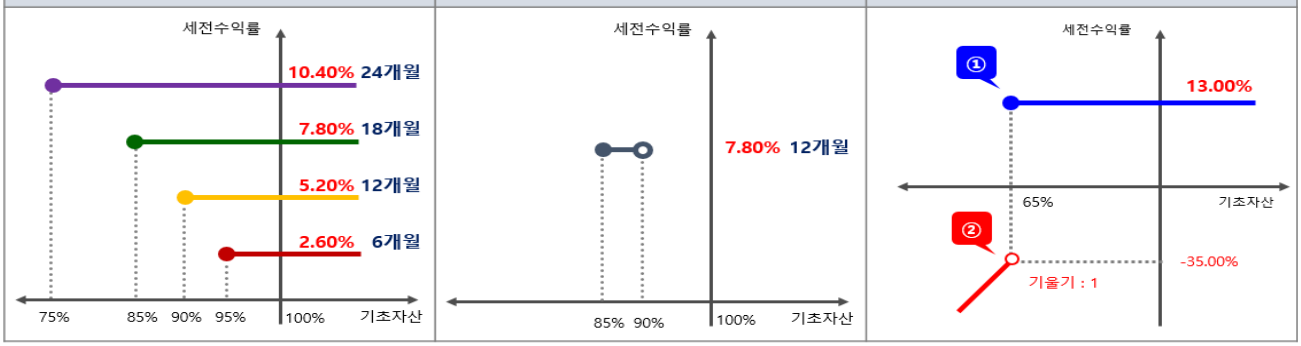
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	320		320	장외
합계			320		320	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조



자동조기 상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.60% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
리자드 상환 시	➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 7.80% 수익 지급	
만기 상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

46

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-23호[ELS-파생형]

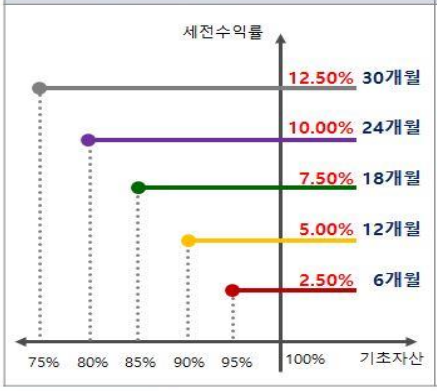
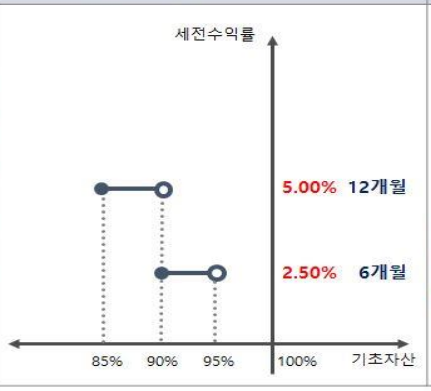
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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	376		376	장외
합계			376		376	

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 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우** ☞ **2.50%** X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **95%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 5.00%** 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 5.00%** 수익지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

펀드명 : BNK리자드지수연계증권SHE(KRW)-12호[ELS-파생형]

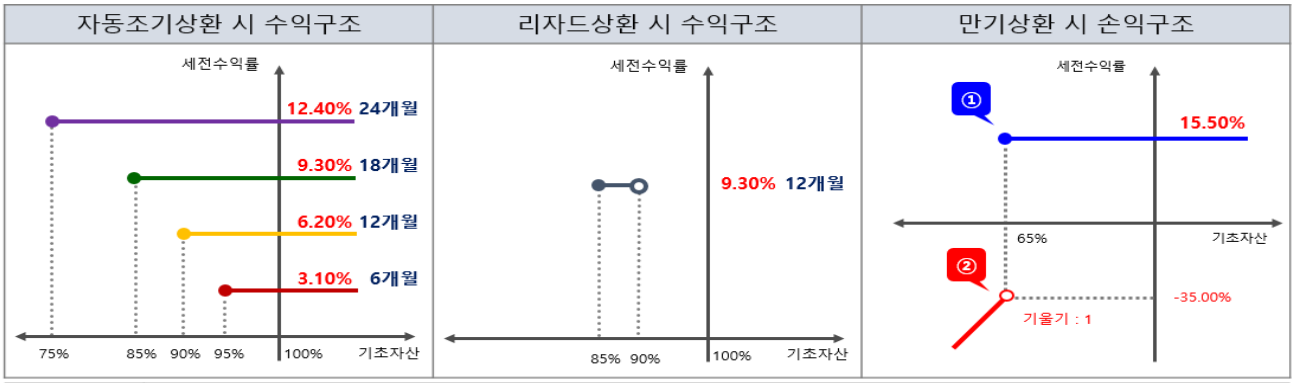
기준일 : 2023-12-11 공시일: 2023-12-12

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	823		823	장외
합계			823		823	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기 상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 3.10% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상

리자드 상환 시

➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 9.30% 수익 지급

만기 상환 시

① 수익상환: 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환:
※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실
※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링
※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

100

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

48