

## 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2019-06-04

공시일: 2019-06-05

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 669   | 535   | 134       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 3,948 | 0     | 3,948     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 289   | 130   | 159       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 550   | 0     | 550       | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션   | 5     | 0     | 5         | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션   | 0     | 268   | -268      | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,498 | 268   | 4,230     |    |

### 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

315

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

321