

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2019-10-04

공시일: 2019-10-07

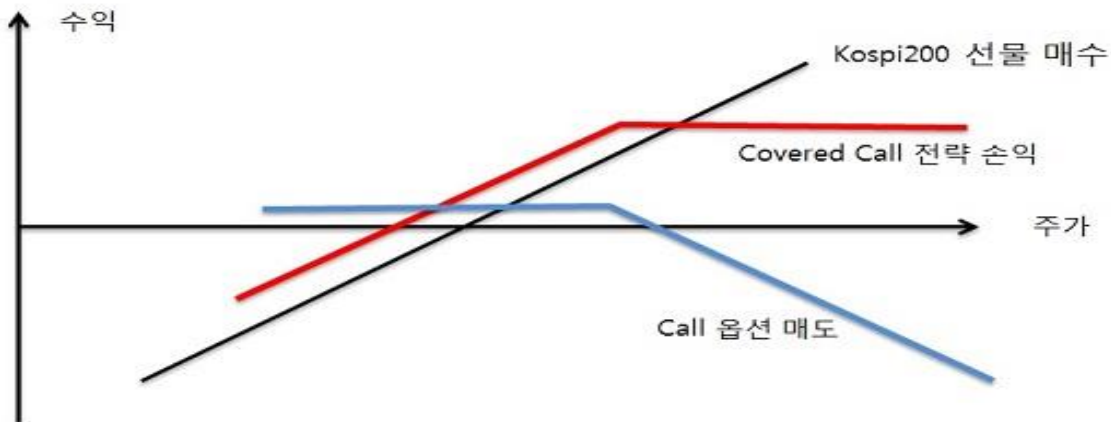
2019-10-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 1,136 | 1,003 | 134 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 1,738 | 0 | 1,738 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 48 | 0 | 48 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 192 | 0 | 192 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 8 | 1,404 | -1,396 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 6 | 1,070 | -1,064 | 장내 |
| 합계 | | | 1,936 | 1,070 | 866 | |

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

139

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

131

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2019-10-04

공시일:

2019-10-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 27 | 0 | 27 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 562 | 0 | 562 | 장내 |
| 합계 | | | 562 | 0 | 562 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

45

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

39

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권HEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2019-10-04

공시일:

2019-10-07

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 | 669 | | 669 | 장외 |
| 합계 | | | 669 | | 669 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| | |
|-----------|-------------------------------------|
| 기초자산 : | HSCEI지수, EUROSTOXX50지수, NIKKEI225지수 |
| 수익률(세전) : | 연 3.00% 수준 |



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

48