

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2019-11-18

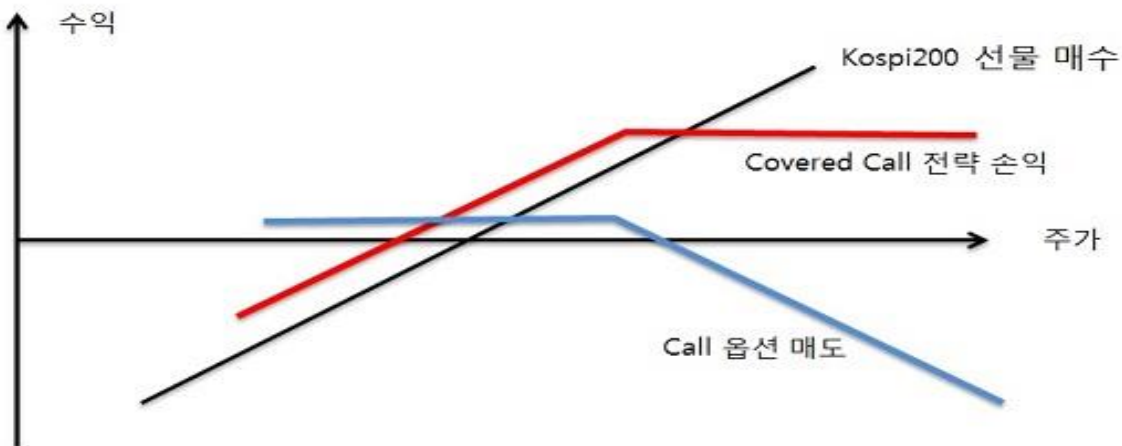
공시일: 2019-11-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	215	0	215	장내
누계	주가지수	선물	1,795	0	1,795	장내
신규	유가증권	선물	0	54	-54	장내
누계	유가증권	선물	0	107	-107	장내
신규	주가지수	옵션	7	359	-352	장내
누계	주가지수	옵션	2	1,436	-1,434	장내
합계			1,797	1,543	254	

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

191

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

114

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2019-11-18

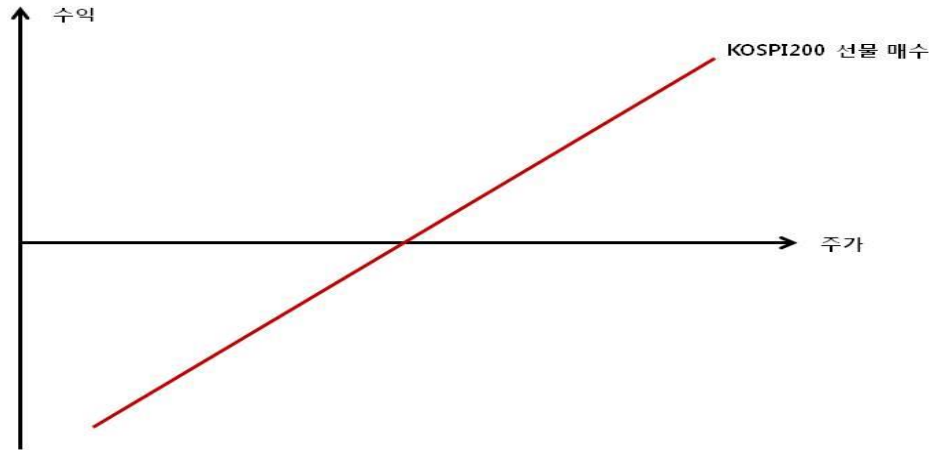
공시일: 2019-11-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	43	72	-29	장내
누계	주가지수	선물	129	0	129	장내
합계			129	0	129	

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 등 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권HEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2019-11-18

공시일: 2019-11-19

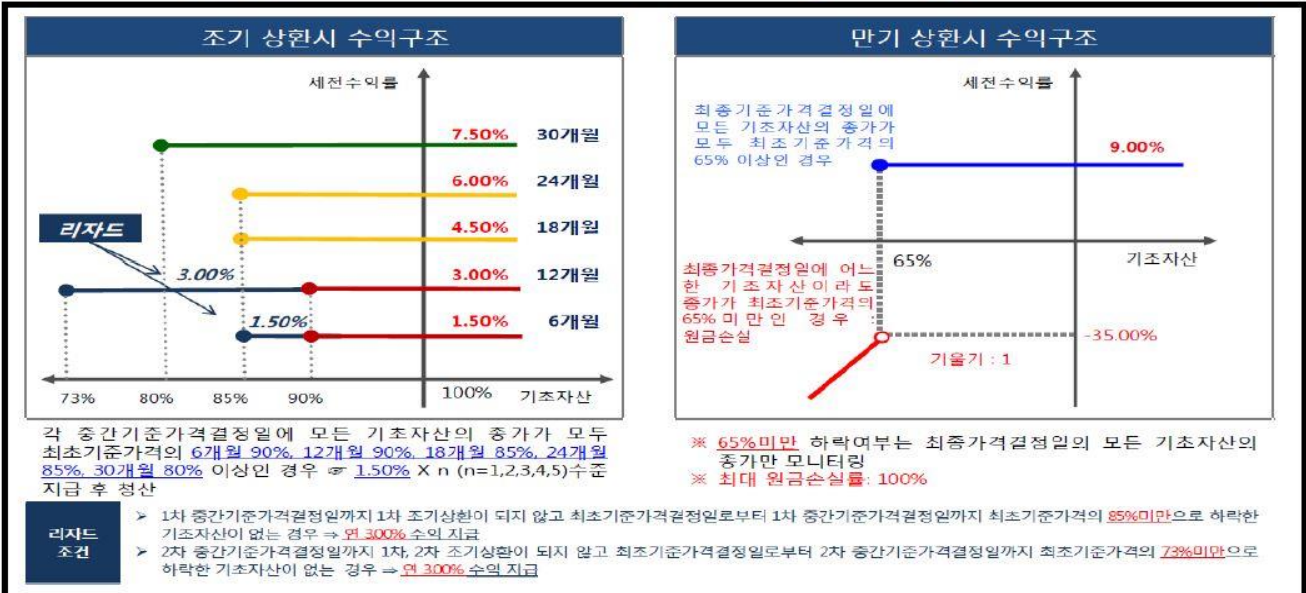
1. 계약금액

(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

47

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16