펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

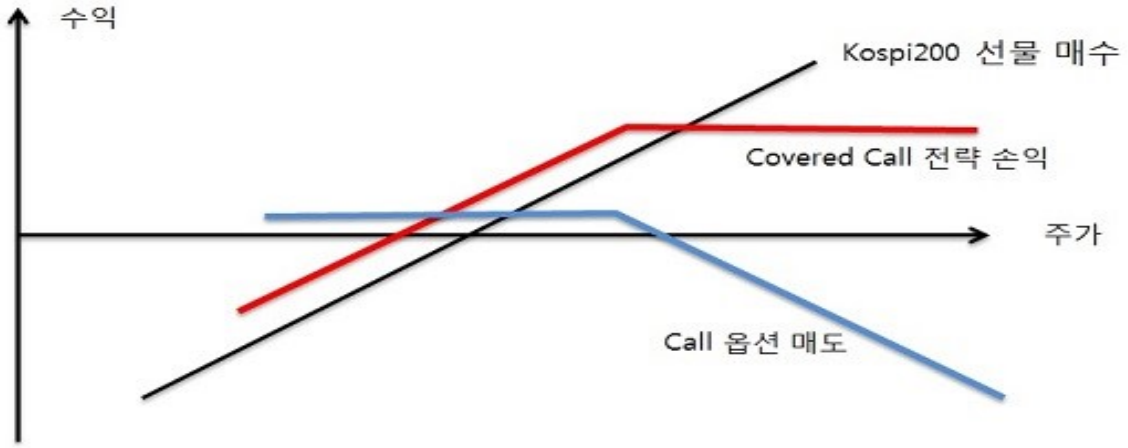
기준일 : 2020-03-09 공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,434	2,500	-66	장내
누계	주가지수	선물	2,960	0	2,960	장내
신규	유가증권	선물	108	108	0	장내
누계	유가증권	선물	163	0	163	장내
신규	주가지수	옵션	7	1,052	-1,045	장내
누계	주가지수	옵션	0	3,026	-3,026	장내
합계			3,123	3,026	97	

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

250

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

244

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

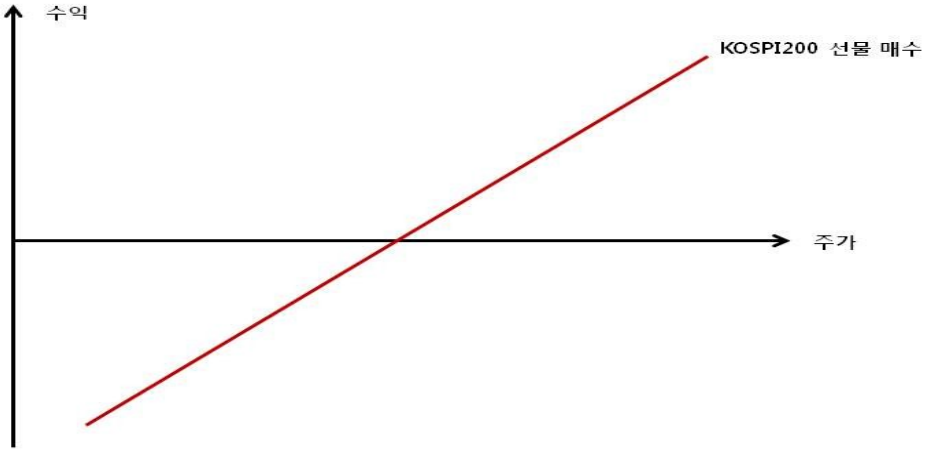
기준일 : 2020-03-09 공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	460	0	460	장내
누계	주가지수	선물	1,776	0	1,776	장내
합계			1,776	0	1,776	

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

142

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

133

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

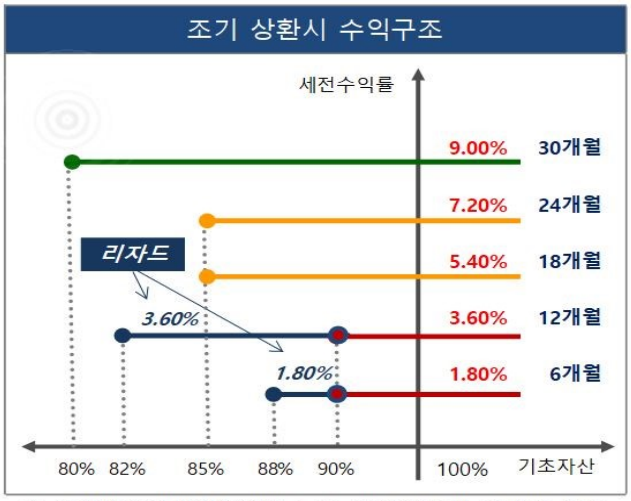
기준일 : 2020-03-09 공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

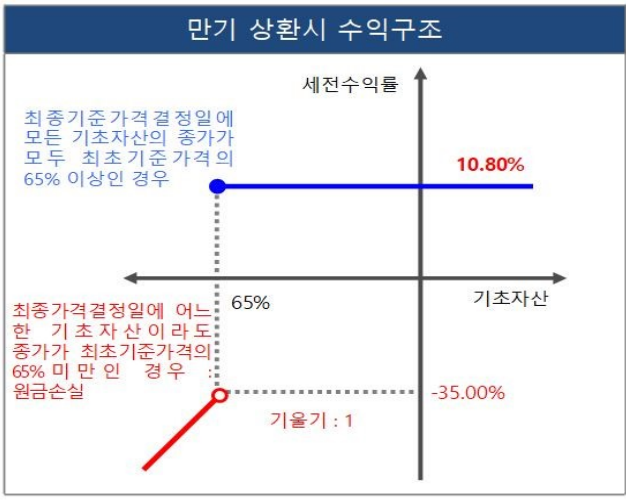
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	9,948		9,948	장외
합계			9,948		9,948	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



각 중간기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ☞ 1.80% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산



※ 65%미만 하락여부는 최종가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링
※ 최대 원금손실률: 100%

리자드 조건

- 1차 중간기준가격결정일까지 1차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 1차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 88%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 3.60% 수익 지급
- 2차 중간기준가격결정일까지 1차, 2차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 2차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 82%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 3.60% 수익 지급

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

540

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

550

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

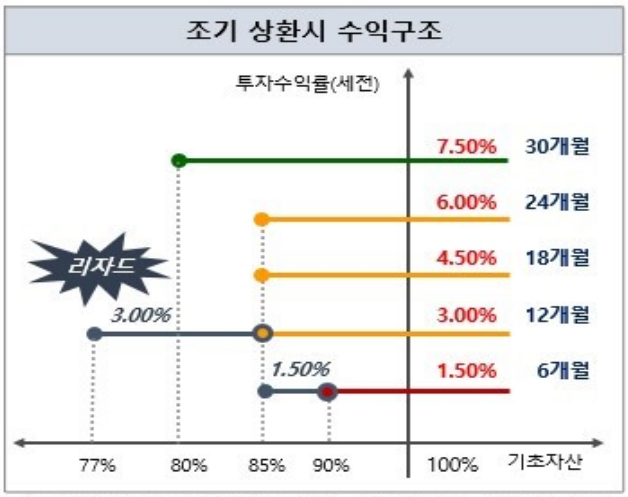
기준일 : 2020-03-09 공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

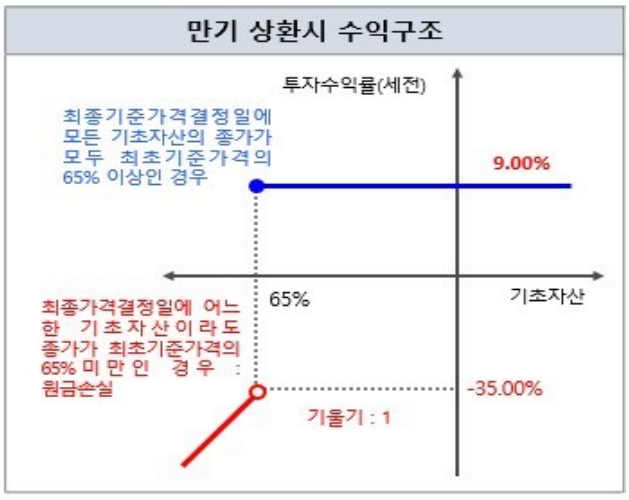
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,618		2,618	장외
합계			2,618		2,618	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



각 중간기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ☞ 1.50% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 정산



※ 65%미만 하락여부는 최종가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링
※ 최대 원금손실률: 100%

리자드 조건

- 1차 중간기준가격결정일까지 1차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 1차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 85%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 3.00% 수준의 수익 지급
- 2차 중간기준가격결정일까지 1차, 2차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 2차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 77%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 3.00% 수준의 수익 지급

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

157

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

169

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-3호(ELS-파생형)

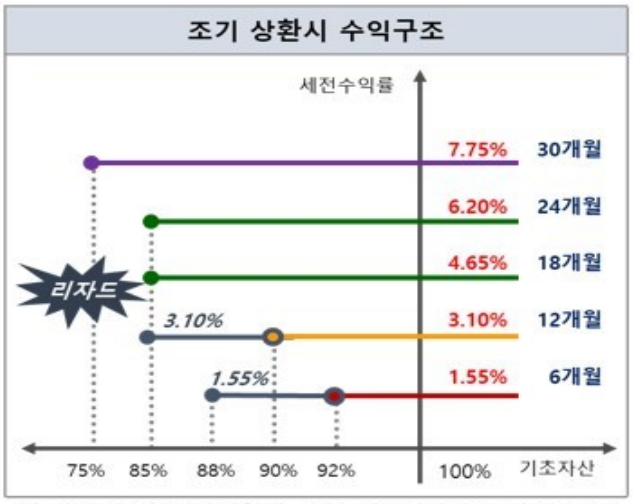
기준일 : 2020-03-09 공시일: 2020-03-10

1. 계약금액

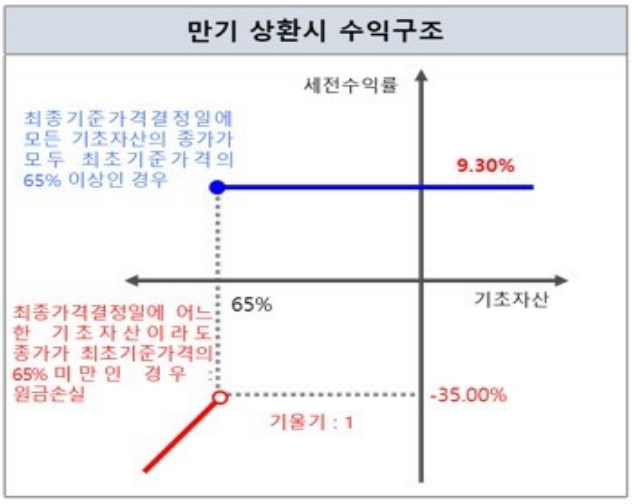
(단위: 백만원)

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

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



각 중간기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 6개월 92%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우 ☞ 1.55% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 정산



※ 65%미만 하락여부는 최종가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링

※ 최대 원금손실률: 100%

리자드 조건

- 1차 중간기준가격결정일까지 1차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 1차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 88%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급
- 2차 중간기준가격결정일까지 1차, 2차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 2차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 85%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

129

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

124