

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-03-24

공시일: 2020-03-25

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 992   | 1,267 | -275      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 7,326 | 0     | 7,326     | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션   | 93    | 1,653 | -1,559    | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션   | 20    | 2,314 | -2,294    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 9     | 130   | -121      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4     | 47    | -42       | 장내 |
| 합계 |      |      | 7,351 | 2,361 | 4,990     |    |

## 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

596

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

805

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-03-24

공시일: 2020-03-25

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 220   | 110   | 110       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 2,776 | 0     | 2,776     | 장내 |
| 합계 |      |      | 2,776 | 0     | 2,776     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

222

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

303

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-03-24

공시일: 2020-03-25

## 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 수익구조



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

### 리자드 조건

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



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 수익변동

410

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

799

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-03-24

공시일: 2020-03-25

## 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 수익구조



각 중간기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가가 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 증가만 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

109

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

195

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-03-24

공시일: 2020-03-25

## 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 수익구조



각 중간기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가가 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 증가만 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 수익변동

110

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

188

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-03-24

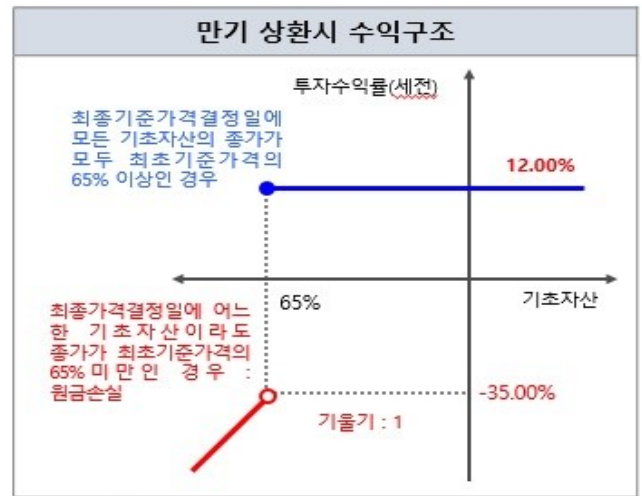
공시일: 2020-03-25

## 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  | 1,119 |       | 1,119     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,119 |       | 1,119     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



각 중간기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.00% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 정산

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

### 리자드 조건

- > 1차 중간기준가격결정일까지 1차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 1차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 88%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 4.00% 수준의 수익 지급
- > 2차 중간기준가격결정일까지 1차, 2차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 2차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 85%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 연 4.00% 수준의 수익 지급

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 수익변동

72

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

95