

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-05-27

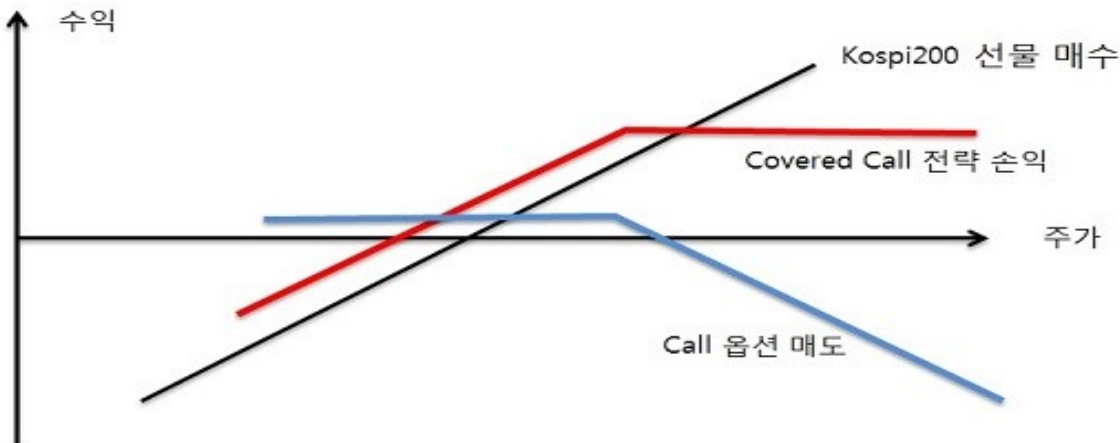
공시일: 2020-05-28

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,271	1,271	0	장내
누계	주가지수	선물	3,011	0	3,011	장내
신규	주가지수	옵션	4	671	-668	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,338	-1,338	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	125	0	125	장내
합계			3,136	1,338	1,798	

## 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

252

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

364

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-05-27

공시일: 2020-05-28

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	107	-107	장내
누계	주가지수	선물	3,279	0	3,279	장내
합계			3,279	0	3,279	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

262

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

394

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

공시일: 2020-05-28

## 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

590

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,274

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

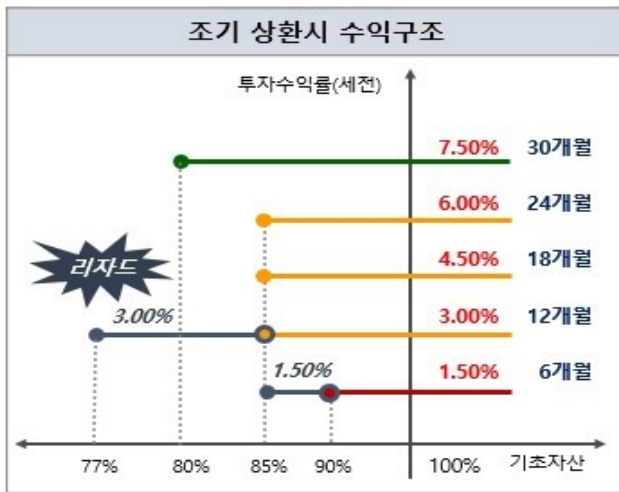
공시일: 2020-05-28

## 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 수익변동

159

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

302

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

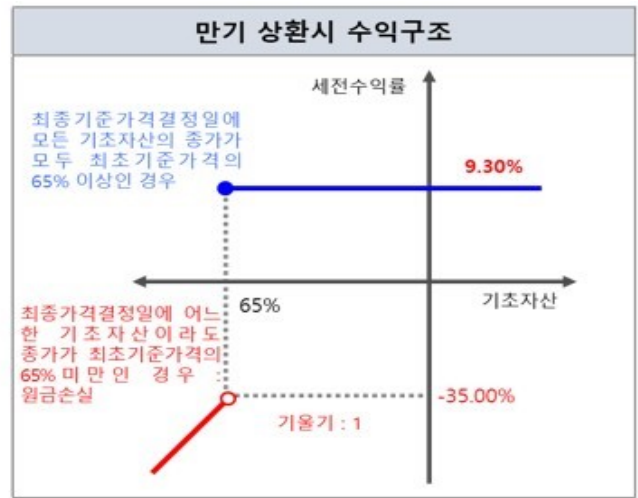
공시일: 2020-05-28

## 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

156

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

284

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

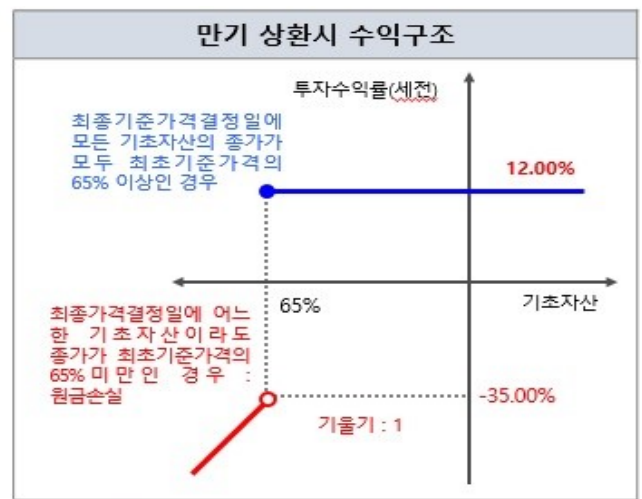
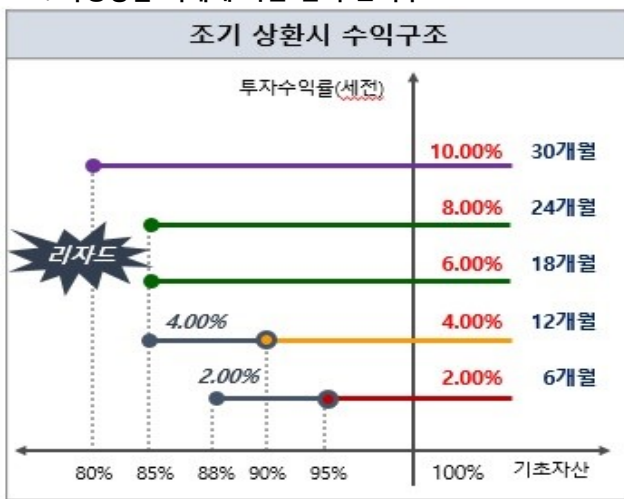
공시일: 2020-05-28

## 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

34

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

25

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

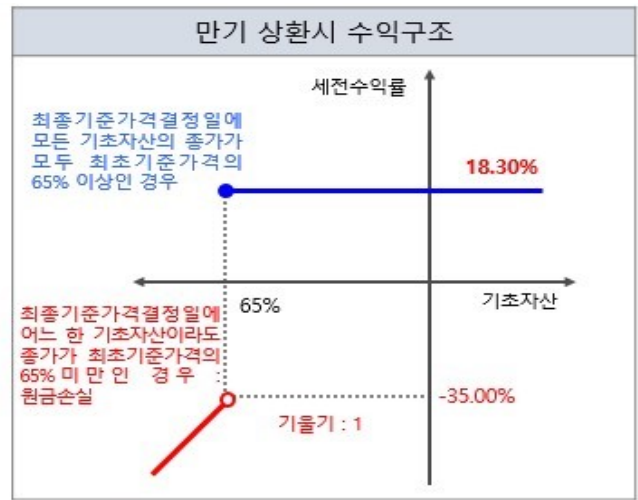
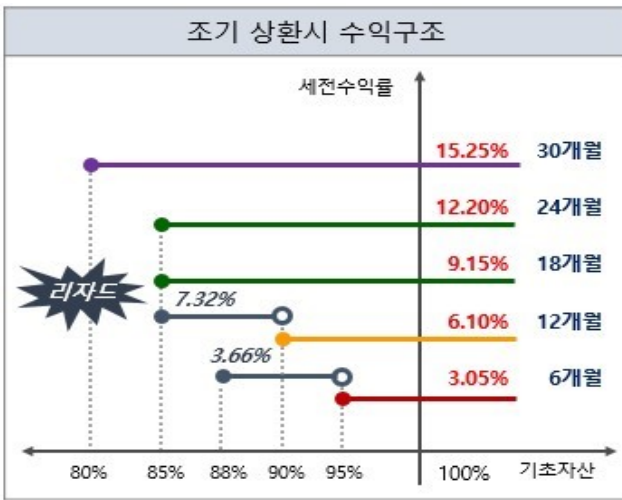
공시일: 2020-05-28

## 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	1,517		1,517	장외
합계			1,517		1,517	

## 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  $3.05\% \times n$  (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산

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

### 리자드 조건

- 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 88%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우  $\rightarrow$  연 7.32% 수익 지급
- 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우  $\rightarrow$  연 7.32% 수익 지급

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 수익변동

78

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

92

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

공시일: 2020-05-28

## 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	3,834		3,834	장외
합계			3,834		3,834	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 4.25% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 88% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 10.20% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 10.20% 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>최대 원금손실률: 100%</li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

224

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

336

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

공시일: 2020-05-28

## 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	774		774	장외
합계			774		774	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.05%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>88% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 9.15%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 9.15%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li><b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li><b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

45

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

81

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

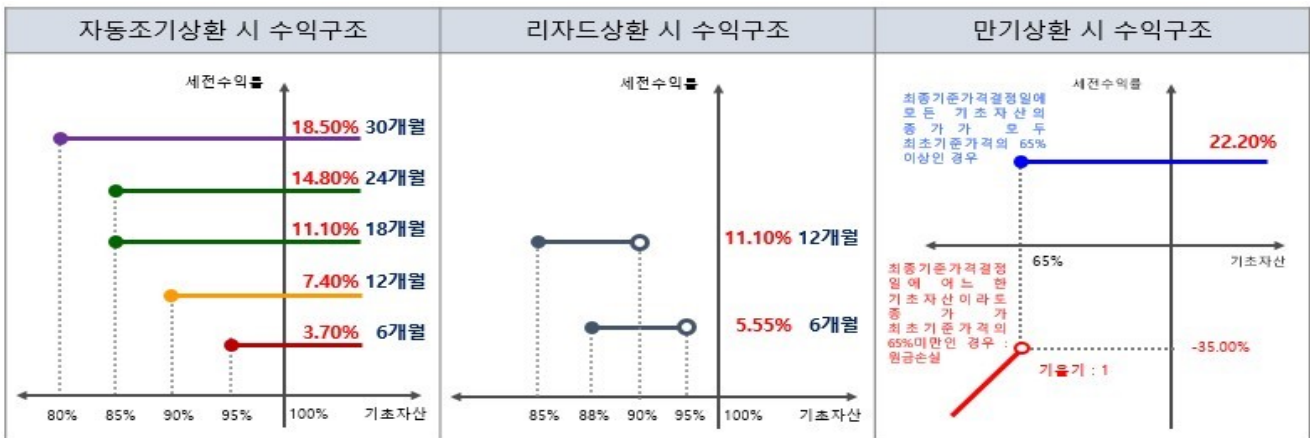
공시일: 2020-05-28

## 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	1,714		1,714	장외
합계			1,714		1,714	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> = 3.70% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b> 인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>88% 미만</b> 으로 하락한 적이 없는 경우 => 연 11.10% 수익 지급 > 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b> 인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b> 으로 하락한 적이 없는 경우 => 연 11.10% 수익 지급
만기상환 시	※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 수익변동

97

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

169

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

공시일: 2020-05-28

## 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	3,401		3,401	장외
합계			3,401		3,401	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.10%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 9.30%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>70% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 9.30%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li><b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li><b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

228

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

299

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

공시일: 2020-05-28

## 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	1,102		1,102	장외
합계			1,102		1,102	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ 3.40% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>82% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 8.16% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>77% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 8.16% 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>최대 원금손실률: 100%</li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

74

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

126

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

공시일: 2020-05-28

## 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	2,198		2,198	장외
합계			2,198		2,198	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>4.00%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>12.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>12.00%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

124

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

206

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-05-27

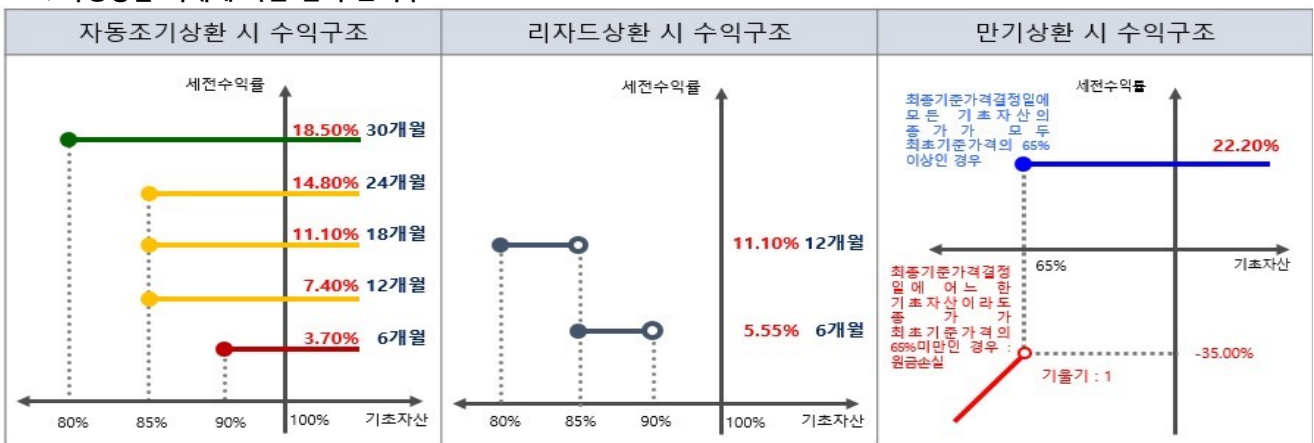
공시일: 2020-05-28

## 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	1,046		1,046	장외
합계			1,046		1,046	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ 3.70% X n (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 11.10% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 11.10% 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 수익변동

72

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

102