

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-06-23

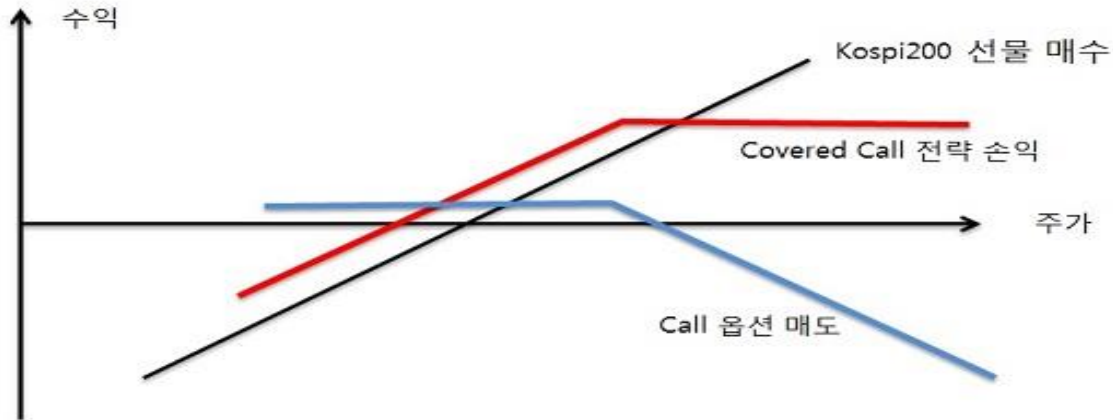
공시일: 2020-06-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,396	3,947	-1,551	장내
누계	주가지수	선물	7,119	0	7,119	장내
신규	주가지수	옵션	1	282	-281	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,551	-1,551	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	514	0	514	장내
합계			7,633	1,551	6,082	

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

582

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

955

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	70	-70	장내
누계	주가지수	선물	3,778	0	3,778	장내
합계			3,778	0	3,778	

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 투자전략은 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

302

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

478

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일:

2020-06-24

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	

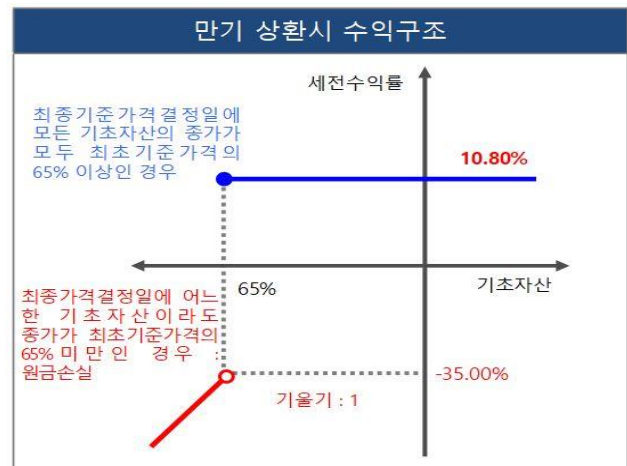
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



각 중간기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 $1.80\% \times n$ (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 손익변동

721

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,611

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

2020-06-24

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 청산

※ 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

186

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

402

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일:

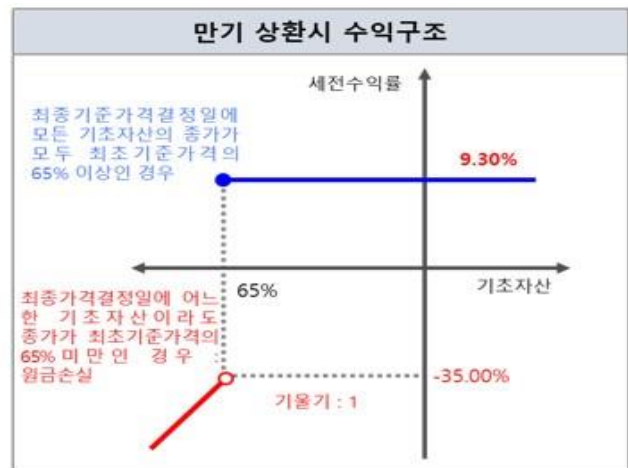
2020-06-24

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 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 청산

※ 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 손익변동

163

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

326

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일:

2020-06-24

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 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

2020-06-24

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 손익구조



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 손익변동

41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

28

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

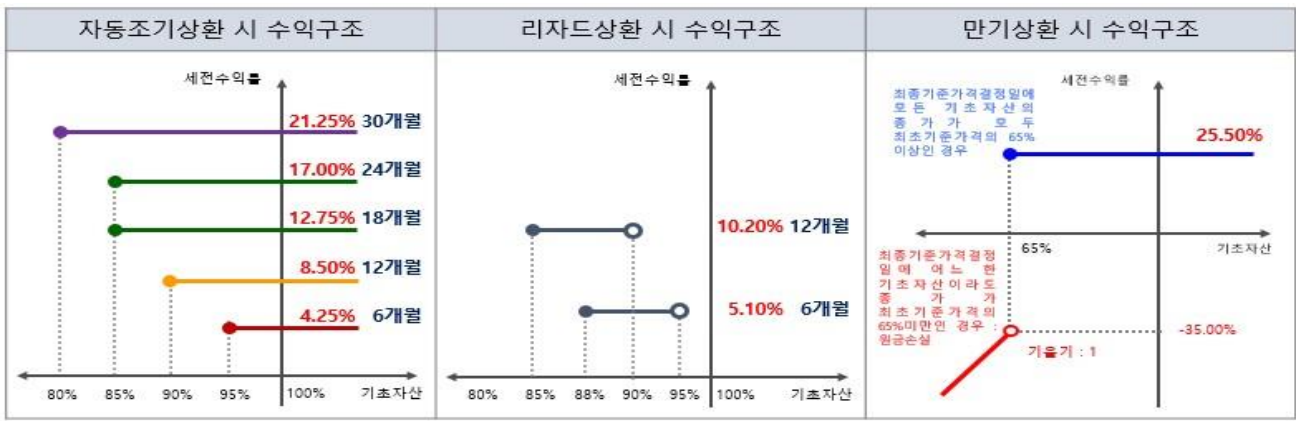
2020-06-24

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 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 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
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 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 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
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

185

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

213

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일:

2020-06-24

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 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 3.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 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 9.15% 수익 지급 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 9.15% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

44

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

70

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일:

2020-06-24

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 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

93

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

143

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

2020-06-24

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 손익구조



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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

209

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

244

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

2020-06-24

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

70

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

88

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

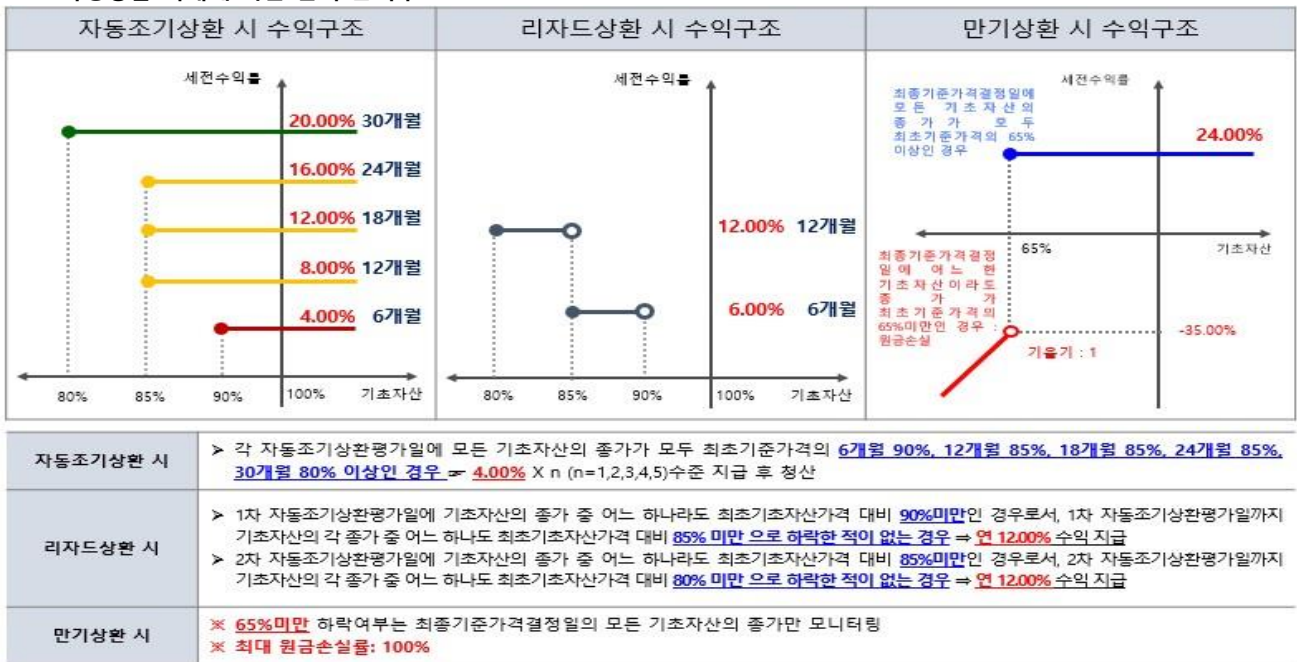
2020-06-24

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 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

110

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

139

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

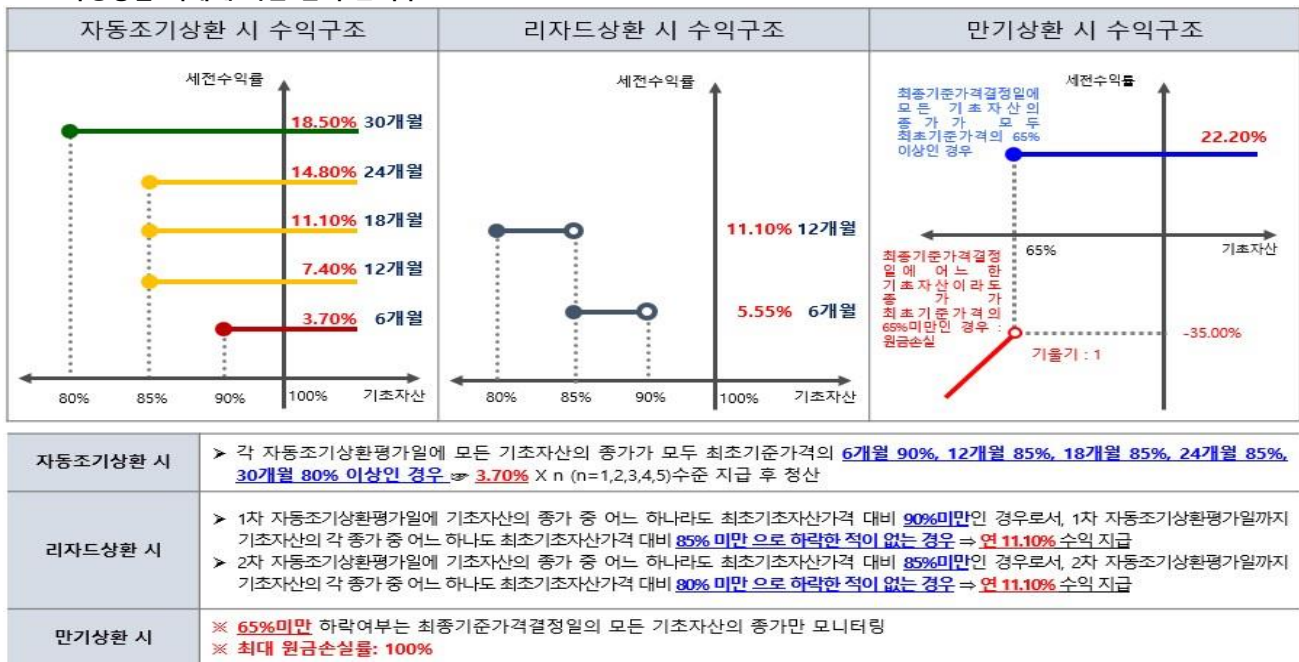
2020-06-24

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 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

67

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

83

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

2020-06-24

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	443		443	장외
합계			443		443	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

38

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSH-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-06-23

공시일: 2020-06-24

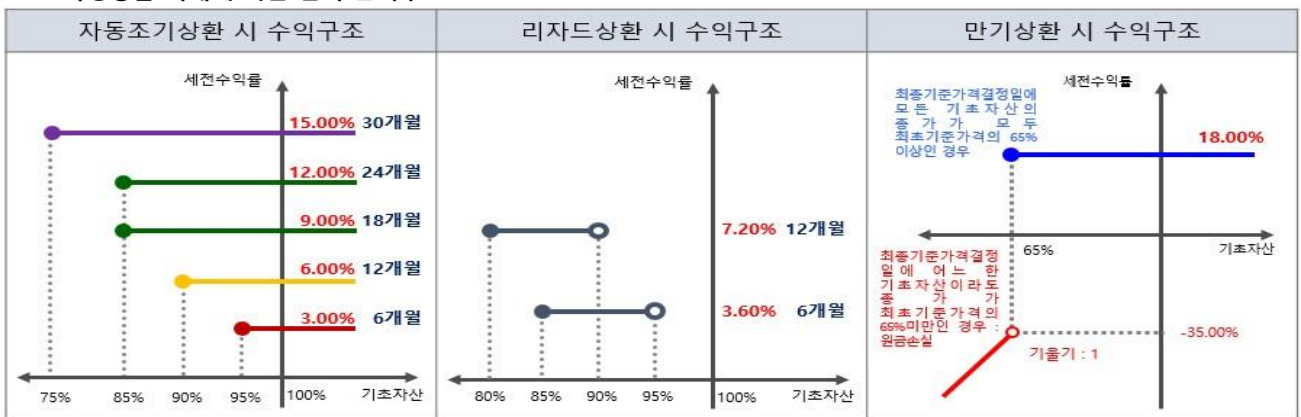
2020-06-24

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	663		663	장외
합계			663		663	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 3.00% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 7.20% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 7.20% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

46

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

81