

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

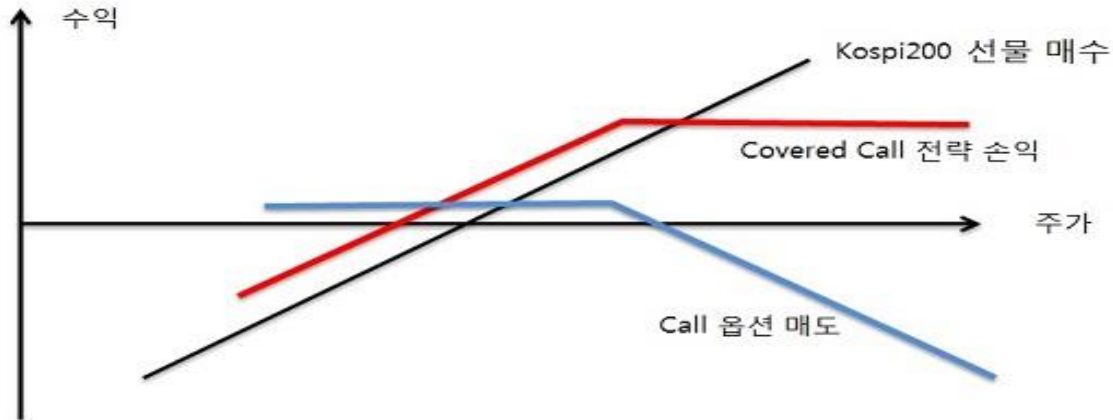
2020-10-06

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0      | 78    | -78       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 17,478 | 0     | 17,478    | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션   | 1      | 0     | 1         | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션   | 1      | 2,586 | -2,586    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 25     | 0     | 25        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 75     | 51    | 24        | 장내 |
| 합계 |      |      | 17,553 | 2,637 | 14,916    |    |

## 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

1,400

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,296

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0     | 705   | -705      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 7,226 | 0     | 7,226     | 장내 |
| 합계 |      |      | 7,226 | 0     | 7,226     |    |

## 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

579

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

948

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

2020-10-06

## 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     |    |

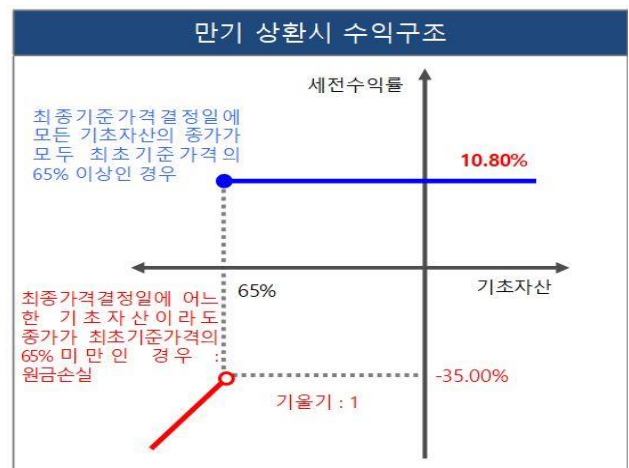
## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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 ⇒ 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



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

667

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

75

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

2020-10-06

## 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

193

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

29

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

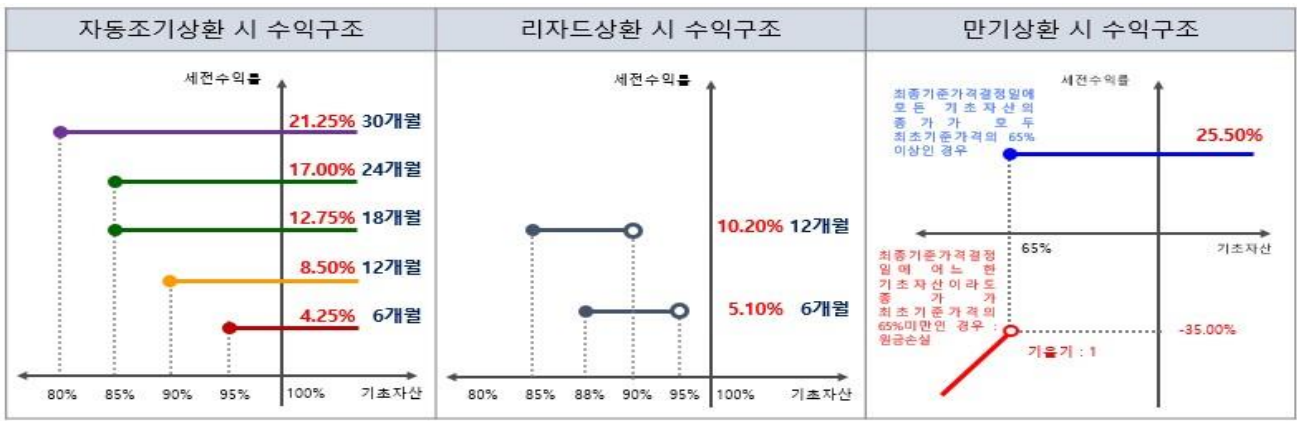
2020-10-06

## 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>4.25%</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 10.20%</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 10.20%</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

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

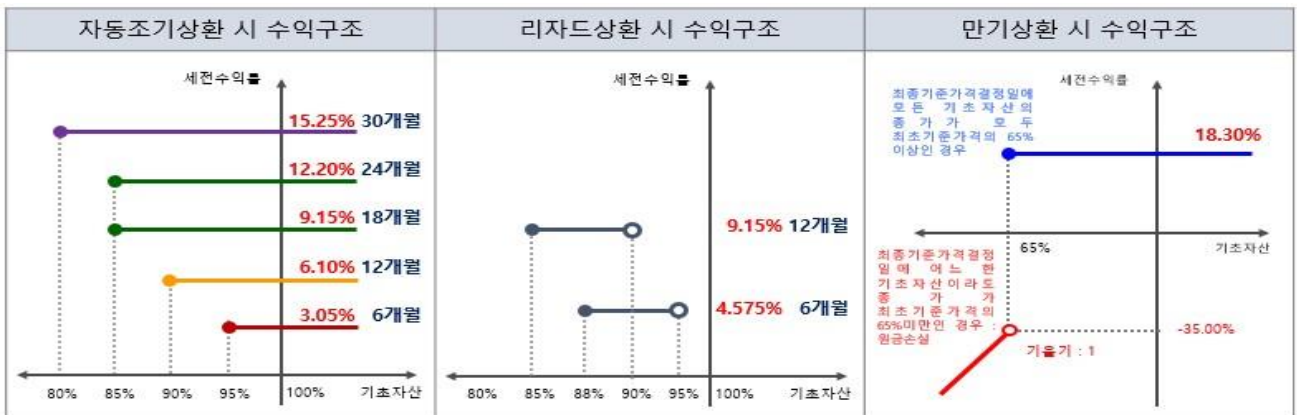
2020-10-06

## 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"> <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 ⇒ 연 <b>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 ⇒ 연 <b>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

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

2020-10-06

## 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



|          |  |
|----------|--|
| 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 ⇒ 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 최초기준가격 대비 95%미만인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 88% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 11.10% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 90%미만인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 11.10% 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

1

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

2020-10-06

## 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"> <li>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</li> </ul>  |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>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</li> <li>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</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

6

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

2020-10-06

## 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> ⇒ <b>3.40%</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>82% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 8.16%</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>77% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 8.16%</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

8

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

2020-10-06

## 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



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <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  |
| 리자드상환 시  | > 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최종기초자산가격 대비 <b>90%미만</b> 인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 12.00%</b> 수익 지급<br>> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최종기초자산가격 대비 <b>85%미만</b> 인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 12.00%</b> 수익 지급 |
| 만기상환 시   | ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

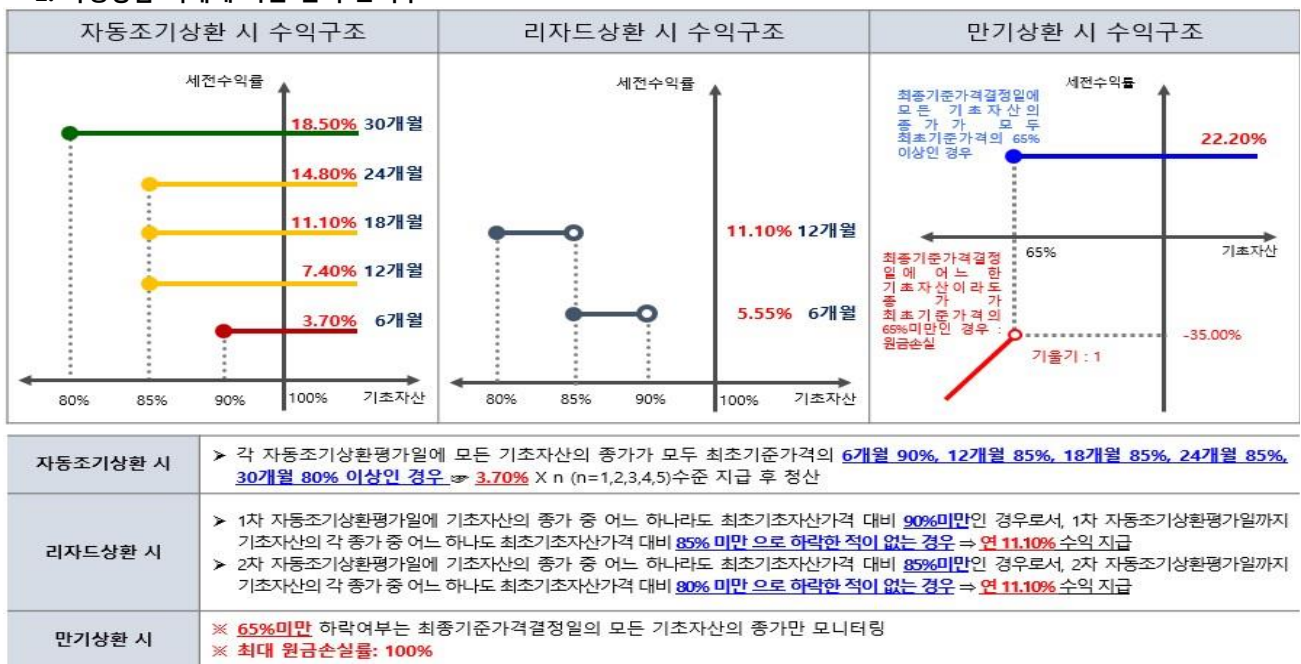
2020-10-06

## 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

22

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

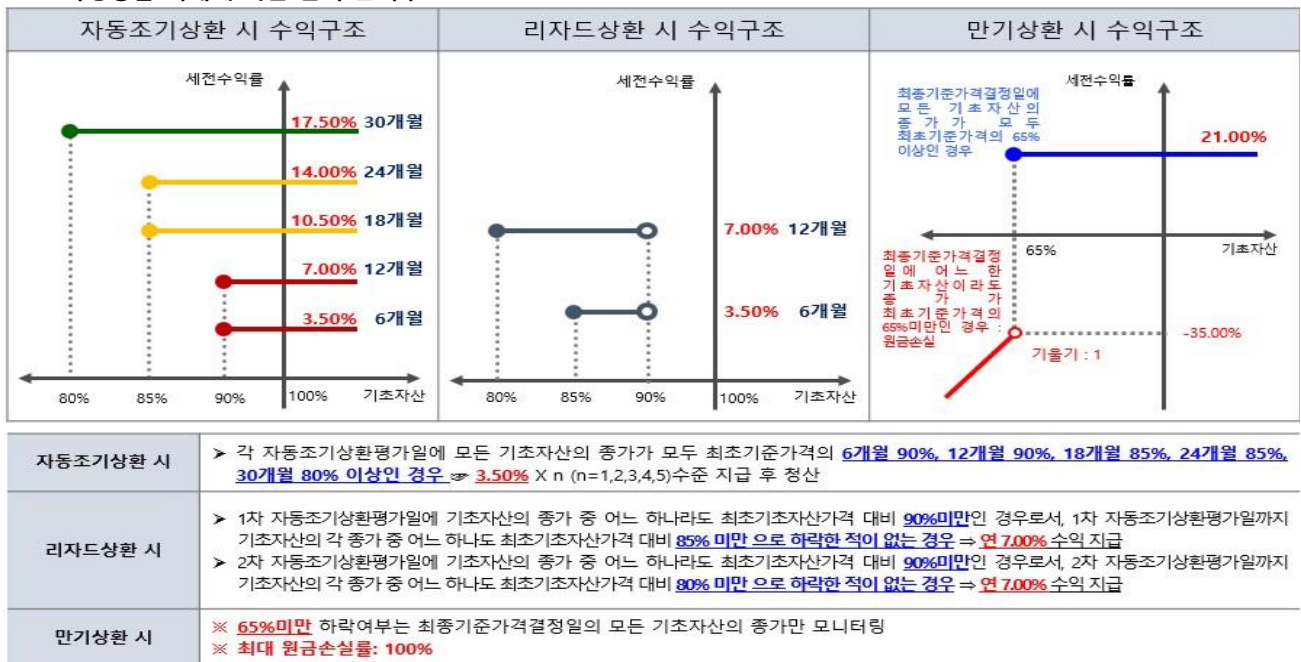
2020-10-06

## 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

17

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSH-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

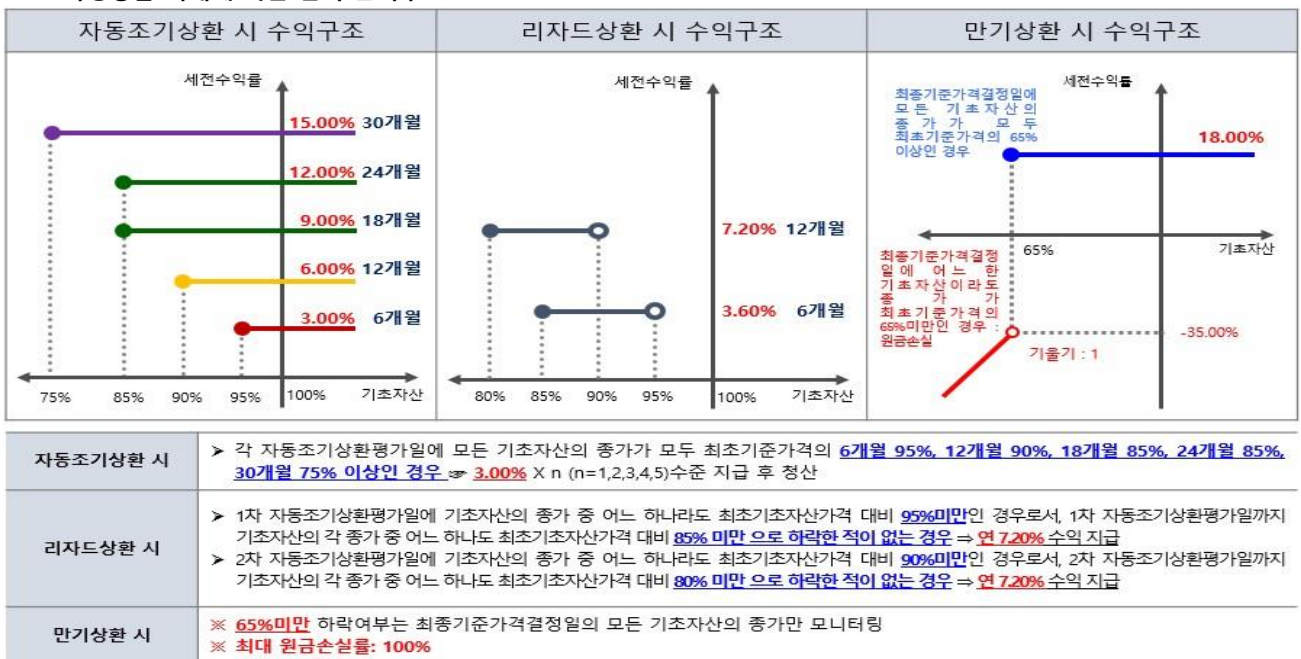
2020-10-06

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

67

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

9

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSH-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

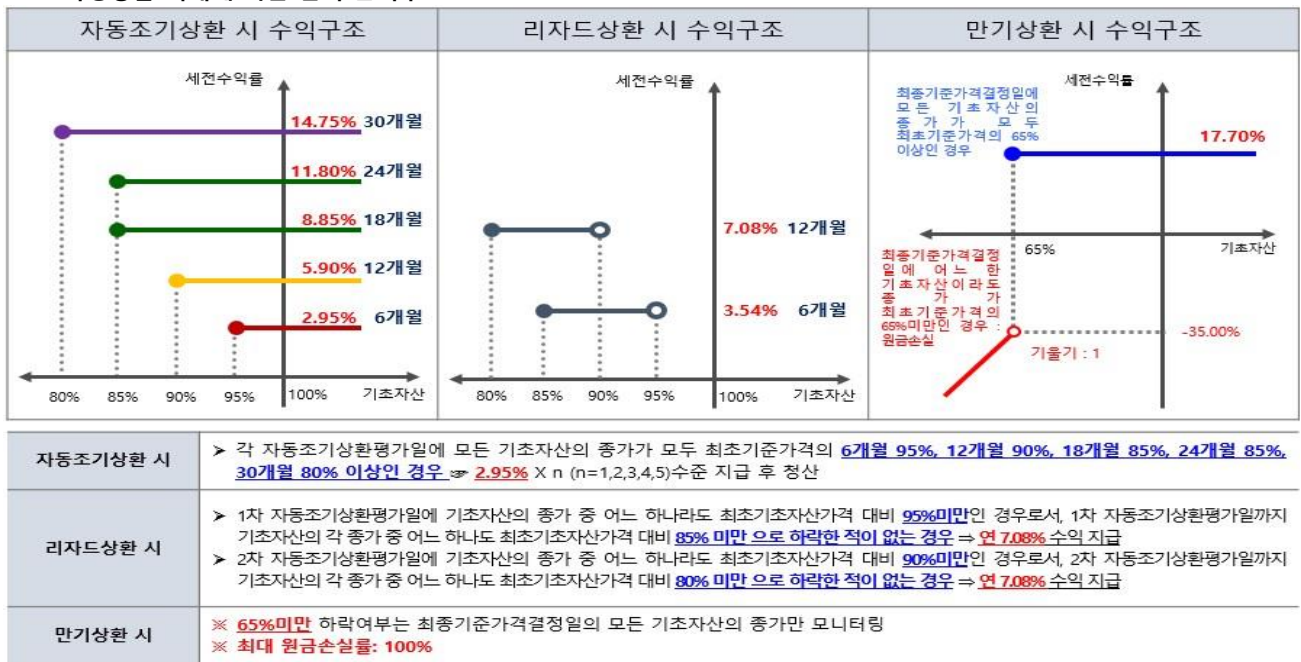
2020-10-06

## 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  | 392   |       | 392       | 장외 |
| 합계 |      |      | 392   |       | 392       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-8호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

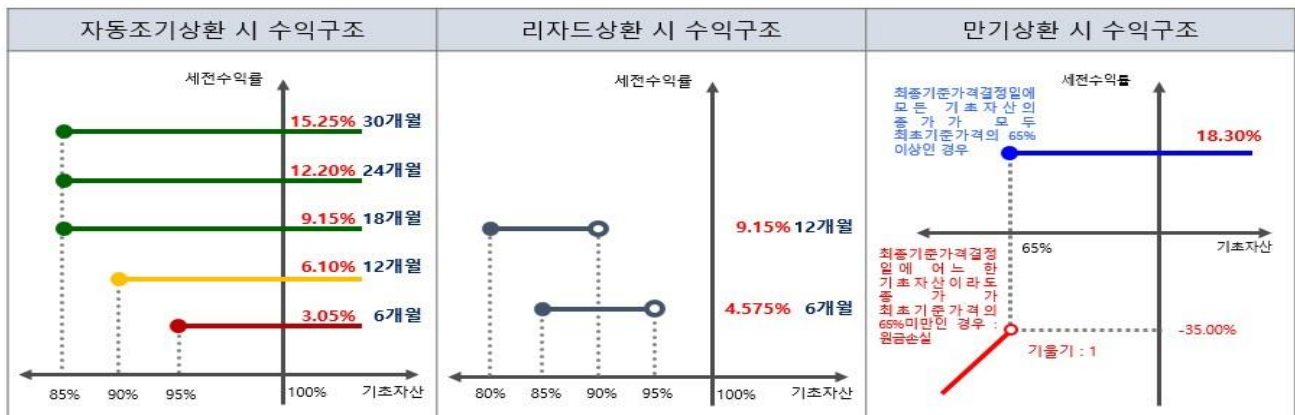
2020-10-06

## 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  | 933   |       | 933       | 장외 |
| 합계 |      |      | 933   |       | 933       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 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 85% 이상인 경우 <math>3.05\% \times n</math> (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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 9.15% 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 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 9.15% 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

80

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

# 펀드명 : BNK3Index더블리자드증권SHE-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

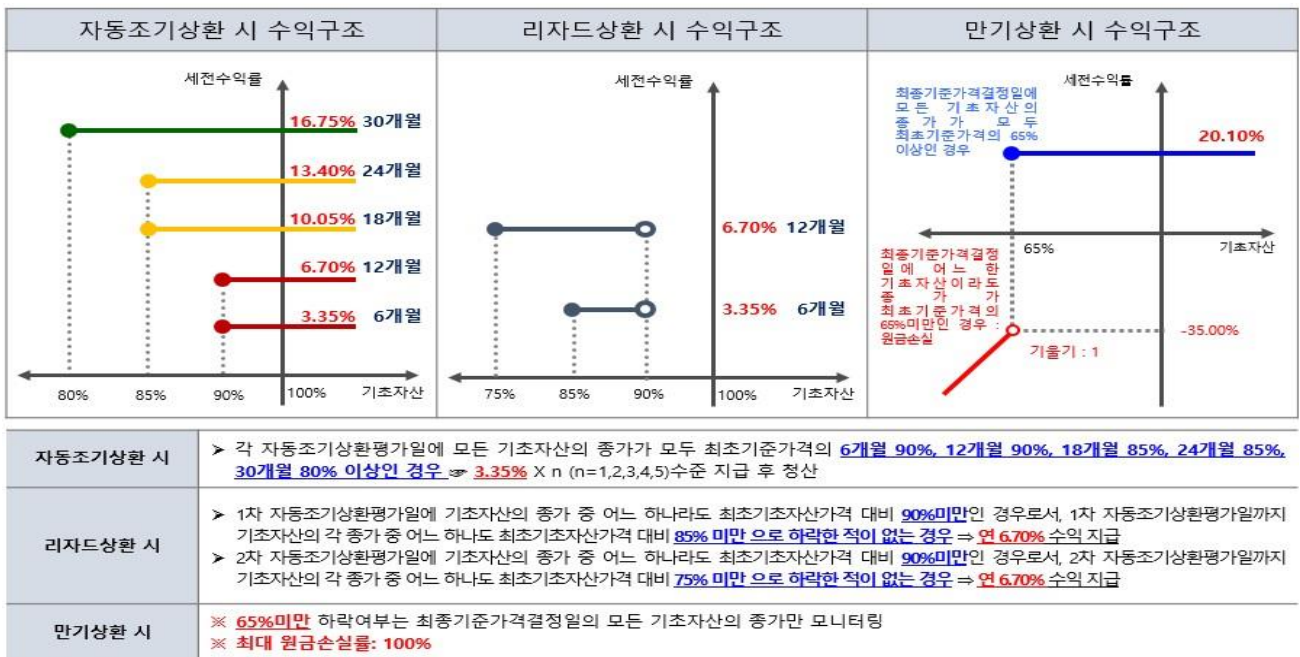
2020-10-06

## 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  | 2,173 |       | 2,173     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,173 |       | 2,173     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

166

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

36

# 펀드명 : BNK3Index더블리자드증권KSE-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

2020-10-06

## 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  | 1,141 |       | 1,141     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,141 |       | 1,141     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조  | 리자드상환 시 수익구조  | 만기상환 시 수익구조   |
|--|---|---|
| <p>세전수익률</p> <p>15.75% 30개월</p> <p>12.60% 24개월</p> <p>9.45% 18개월</p> <p>6.30% 12개월</p> <p>3.15% 6개월</p> <p>기초자산</p>                                      | <p>세전수익률</p> <p>6.30% 12개월</p> <p>3.15% 6개월</p> <p>기초자산</p>   | <p>세전수익률</p> <p>18.90%</p> <p>기초자산</p> <p>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>최종기준가격결정일에 어느 한도도 기초자산이 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실</p> <p>기율기 : 1</p> <p>-35.00%</p> |
| <p>자동조기상환 시</p> <p>➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 3.15% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</p> | <p>리자드상환 시</p> <p>➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익 지급</p> <p>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 1, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익 지급</p> | <p>만기상환 시</p> <p>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</p> <p>※ 최대 원금손실률: 100%</p>   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

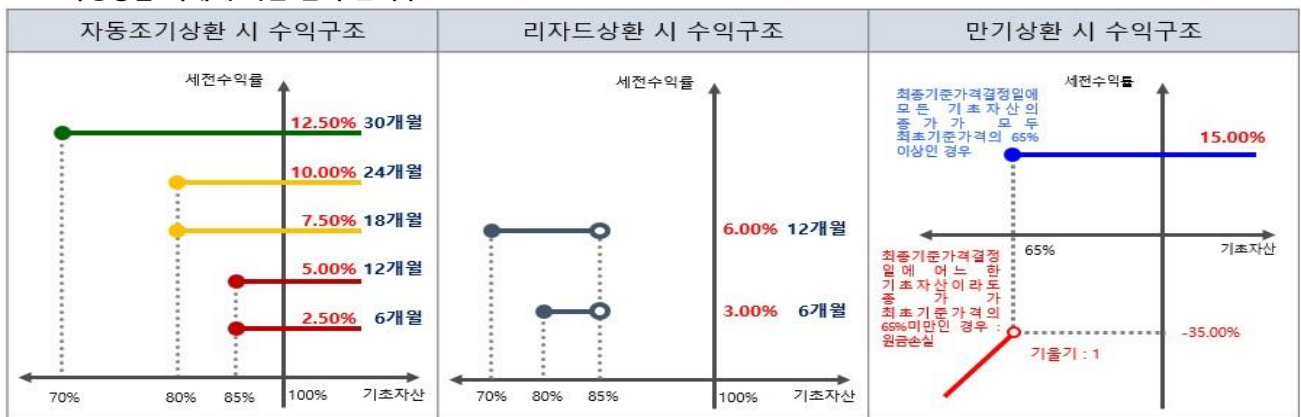
2020-10-06

## 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  | 615   |       | 615       | 장외 |
| 합계 |      |      | 615   |       | 615       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |   |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 70% 이상인 경우</b> ⇒ 2.50% 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>85%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 6.00%</b> 수익 지급</li> <li>▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>인 경우로서, 1, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>70% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.00%</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

32

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

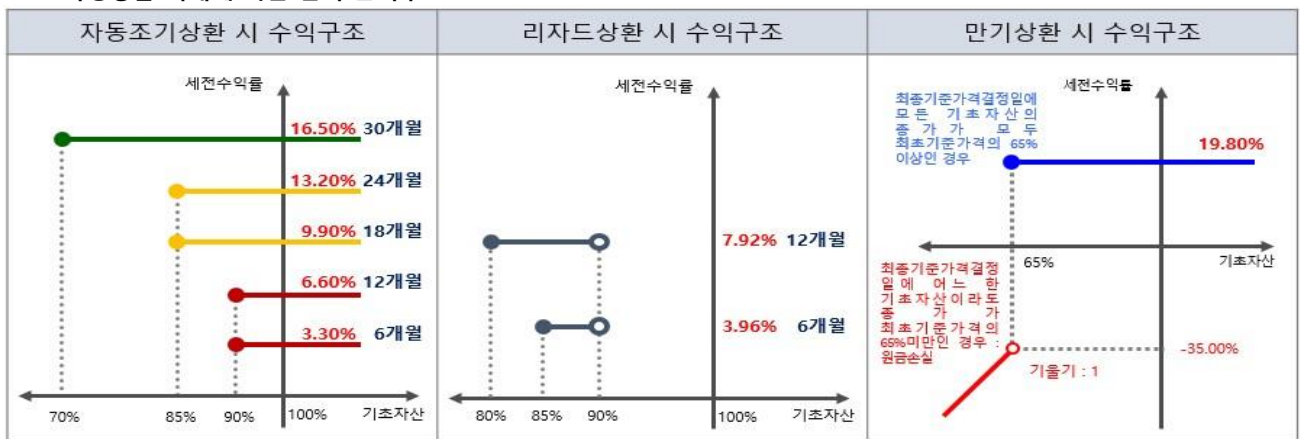
2020-10-06

## 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  | 236   |       | 236       | 장외 |
| 합계 |      |      | 236   |       | 236       |    |

## 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 70% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.30%</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, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>7.92%</b> 수익 지급</li> <li>▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>7.92%</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

18

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

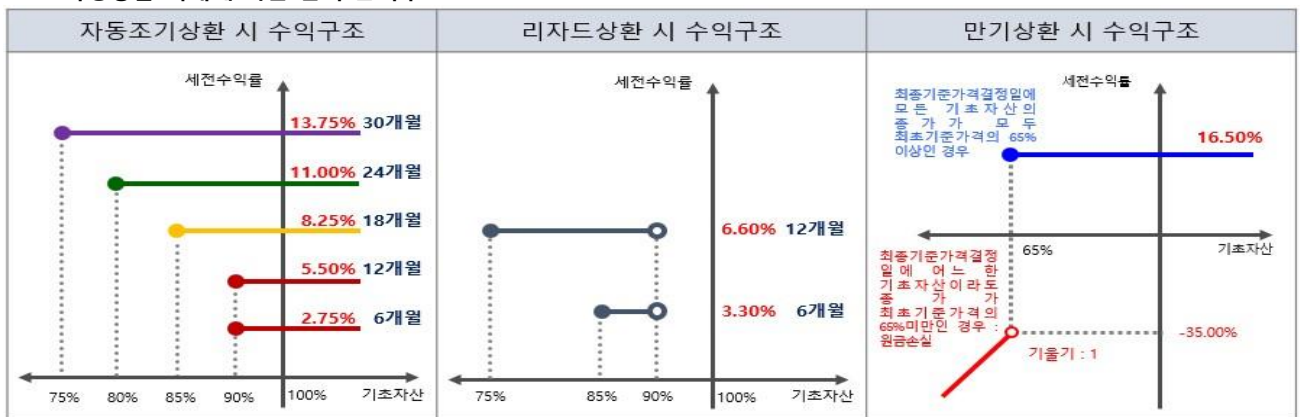
2020-10-06

## 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  | 2,404 |       | 2,404     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,404 |       | 2,404     |    |

## 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 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 2.75% 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, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>6.60%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>6.60%</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

178

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

# 펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계증권KSN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

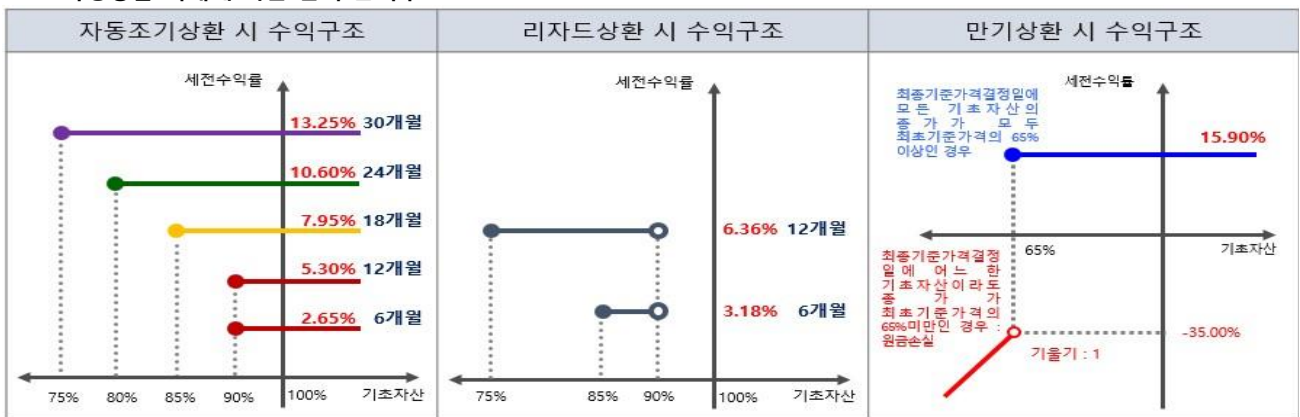
2020-10-06

## 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  | 930   |       | 930       | 장외 |
| 합계 |      |      | 930   |       | 930       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <math>2.65\% \times n</math> (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 최종기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>6.36%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최종기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 <b>75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 <b>6.36%</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

67

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

12

# 펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계KSE-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

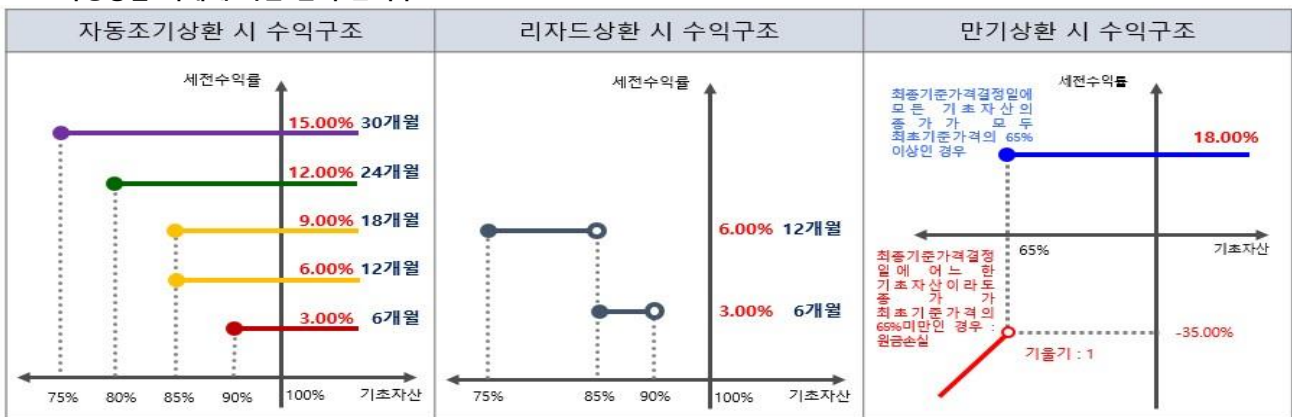
2020-10-06

## 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  | 6,991 |       | 6,991     | 장외 |
| 합계 |      |      | 6,991 |       | 6,991     |    |

## 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 85%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 3.00% 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, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>75%미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 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

449

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

108

# 펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계KSE-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

2020-10-06

## 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  | 1,671 |       | 1,671     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,671 |       | 1,671     |    |

## 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 85%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 2.75% 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%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 5.50% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 5.50% 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

110

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

28

# 펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계KSE-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

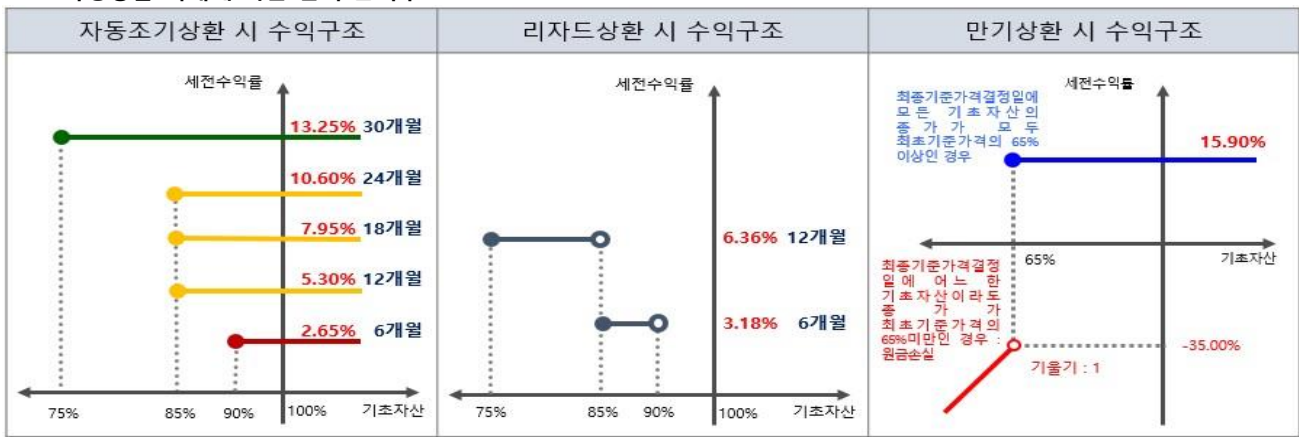
2020-10-06

## 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  | 220   |       | 220       | 장외 |
| 합계 |      |      | 220   |       | 220       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 모두 최저기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.65%</b> × 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 총가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 6.36%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 <b>75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 6.36%</b> 수익 지급</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK3Index지수연계SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

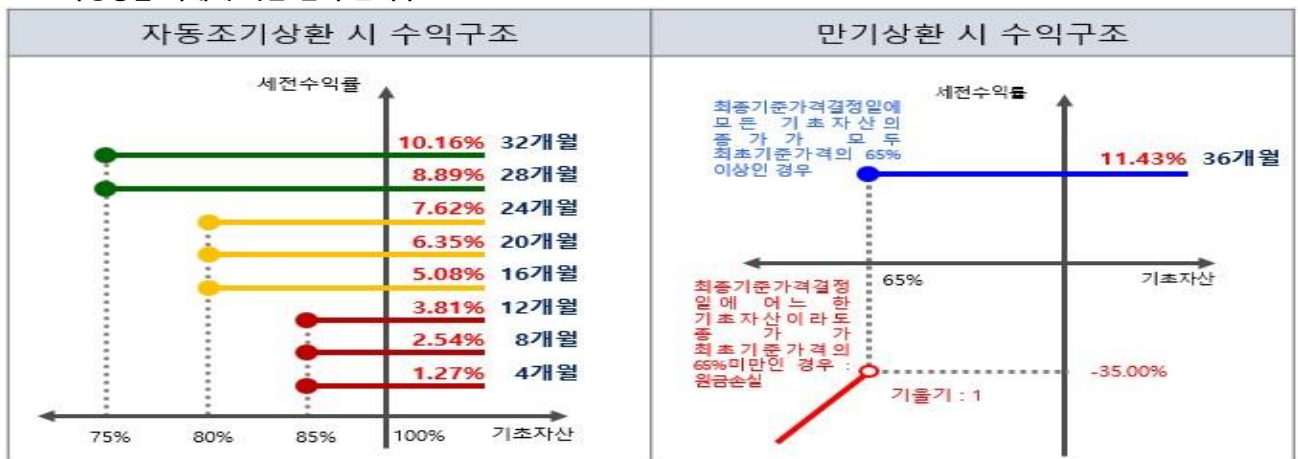
2020-10-06

## 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  | 3,507 |       | 3,507     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,507 |       | 3,507     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |   |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 <b>4개월 85%, 8개월 85%, 12개월 85%, 16개월 80%, 20개월 80%, 24개월 80%, 28개월 75%, 32개월 75% 이상인 경우</b></li> <li>⇒ <b>1.27%</b> X n (n=1,2,3,4,5,6,7,8)수준 지급 후 청산</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

225

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

424

# 펀드명 : BNK3Index지수연계증권SEN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

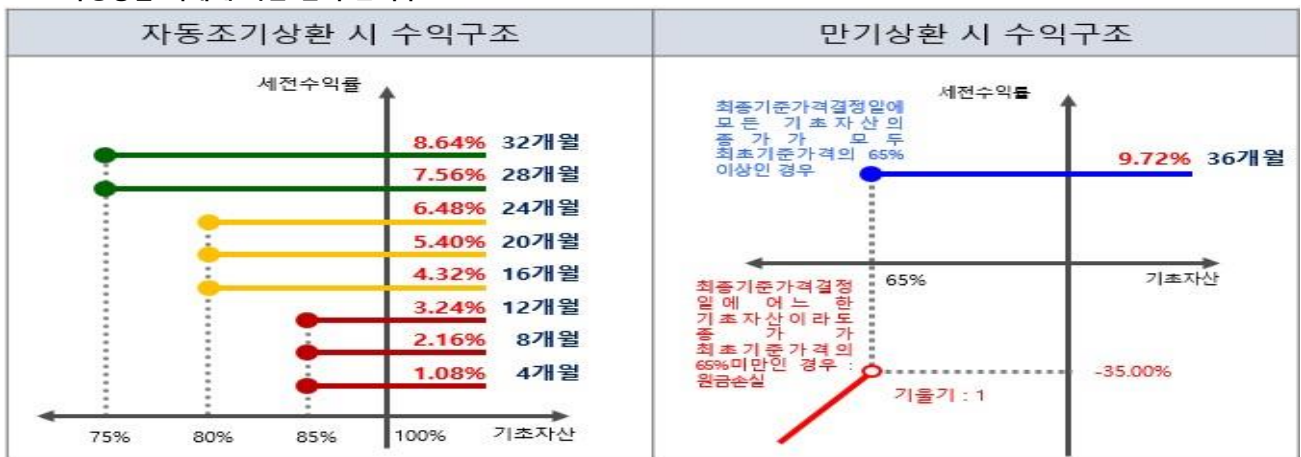
2020-10-06

## 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  | 3,687 |       | 3,687     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,687 |       | 3,687     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <p>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 <b>4개월 85%, 8개월 85%, 12개월 85%, 16개월 80%, 20개월 80%, 24개월 80%, 28개월 75%, 32개월 75% 이상인 경우</b></p> <p>⇒ <b>1.08%</b> X n (n=1,2,3,4,5,6,7,8)수준 지급 후 청산</p> |
| 만기상환 시   | <p>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링</p> <p>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></p>  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

235

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

493

# 펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계증권KSE-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

2020-10-06

## 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  | 1,285 |       | 1,285     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,285 |       | 1,285     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최저기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 2.00% 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 최저기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 4.80% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 <b>75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ 연 4.80% 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

83

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

20

# 펀드명 : BNK3Index지수연계증권SEN-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일: 2020-10-06

2020-10-06

## 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  | 301   |       | 301       | 장외 |
| 합계 |      |      | 301   |       | 301       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



|          |   |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>4개월 85%, 8개월 85%, 12개월 85%, 16개월 80%, 20개월 80%, 24개월 80%, 28개월 75%, 32개월 75% 이상인 경우</b></li> <li>☞ <b>0.87%</b> X n (n=1,2,3,4,5,6,7,8)수준 지급 후 청산</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최초기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

40

# 펀드명 : BNK3Index지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-10-05

공시일:

2020-10-06

## 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  | 1,009 |       | 1,009     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,009 |       | 1,009     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



|          |   |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우</b> <math>\Rightarrow 1.50\% \times n</math> (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</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

56

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

111