

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,611	3,463	-1,852	장내
누계	주가지수	선물	8,053	0	8,053	장내
신규	주가지수	옵션	15	3,624	-3,609	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,611	-1,611	장내
신규	유가증권	선물	120	120	0	장내
누계	유가증권	선물	9	0	9	장내
합계			8,061	1,611	6,451	

## 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

644

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,060

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,530	-1,530	장내
누계	주가지수	선물	4,187	0	4,187	장내
합계			4,187	0	4,187	

## 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

335

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

554

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일:

2020-11-09

## 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	

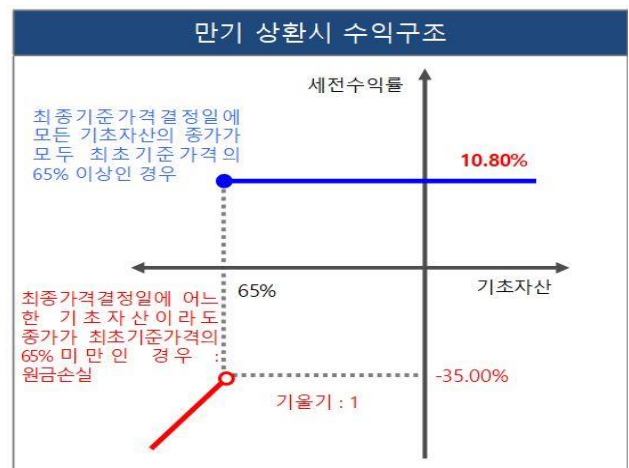
## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

775

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

80

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일:

2020-11-09

## 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

215

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

21

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

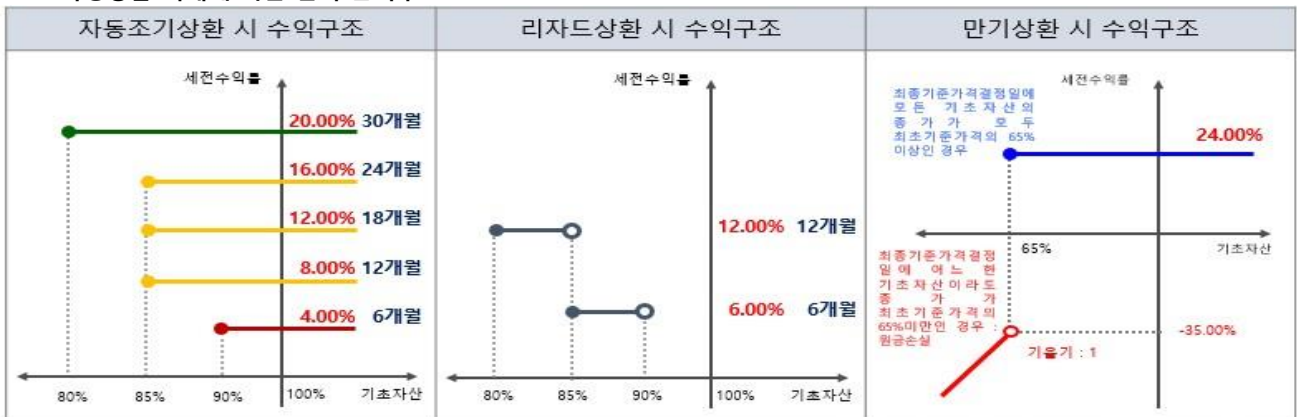
2020-11-09

## 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	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 <math>4.00\% \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 최종기준자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기준자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 12.00% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최종기준자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기준자산가격 대비 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 12.00% 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

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

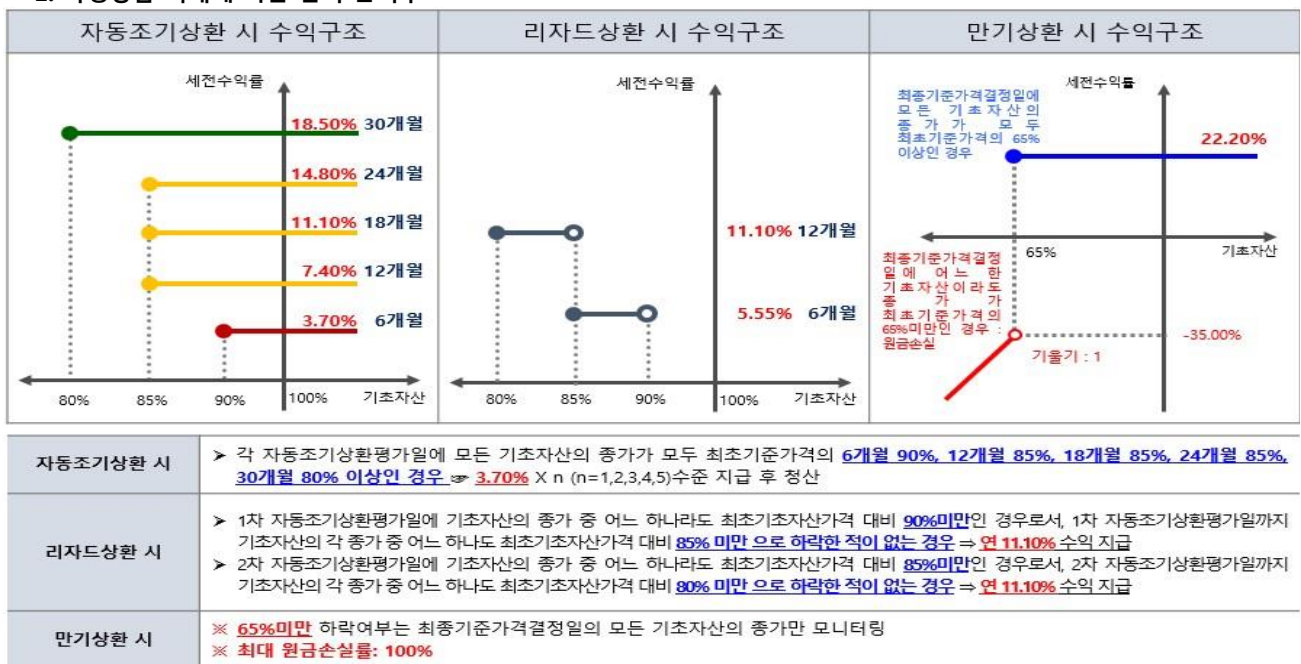
2020-11-09

## 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

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

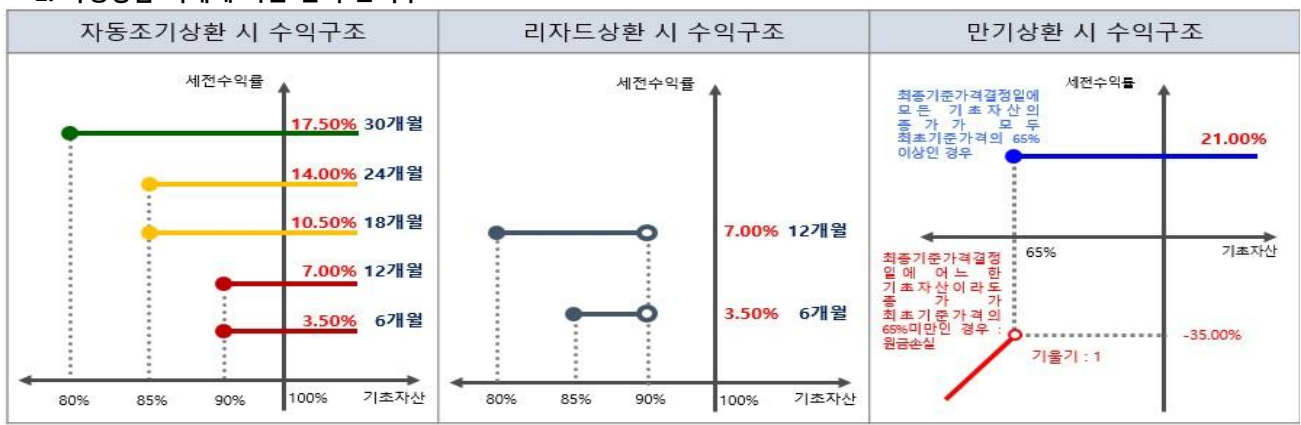
2020-11-09

## 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



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>3.50%</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%미만인 경우</b>로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 7.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 7.00%</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

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSH-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

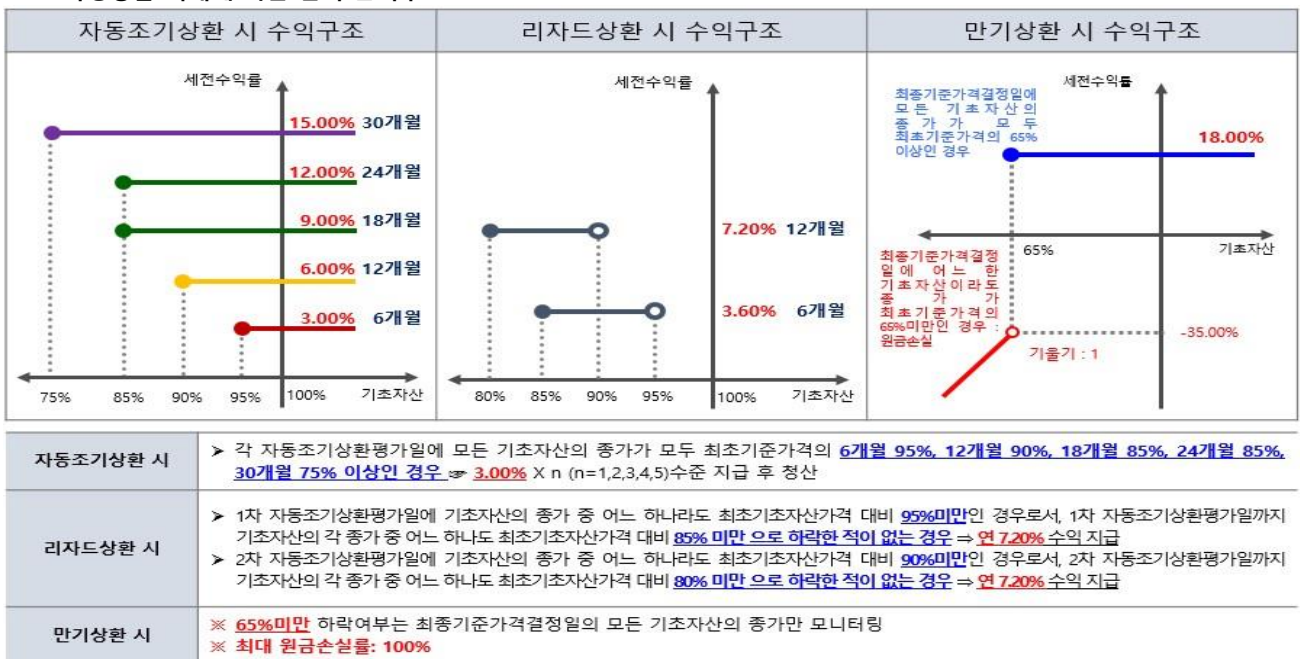
2020-11-09

## 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

28

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSH-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

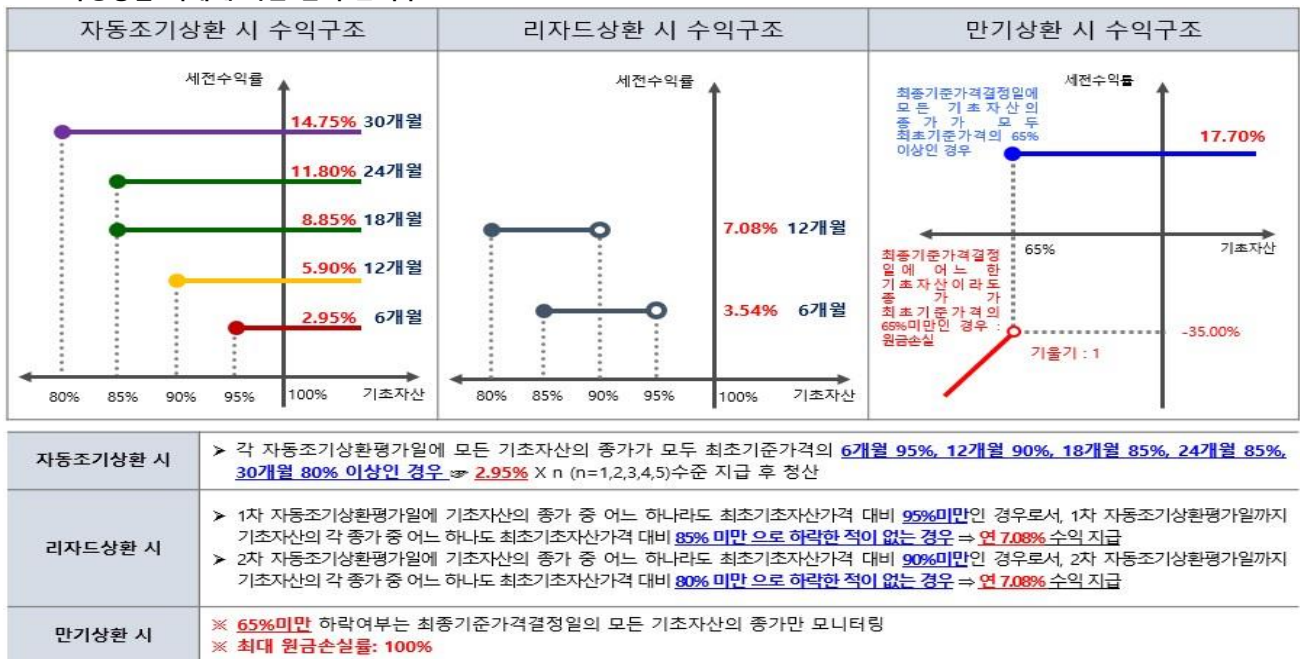
2020-11-09

## 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

19

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-8호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

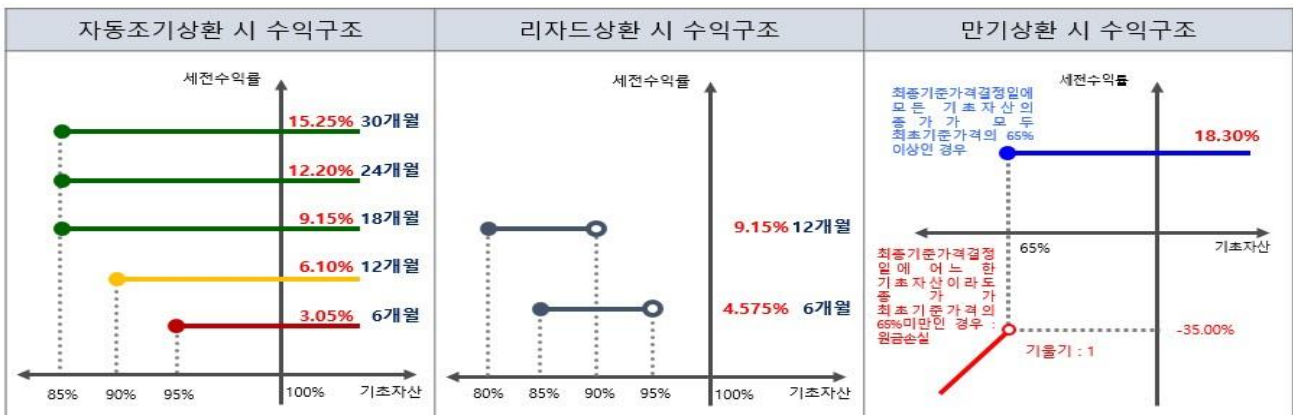
2020-11-09

## 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)

14

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

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

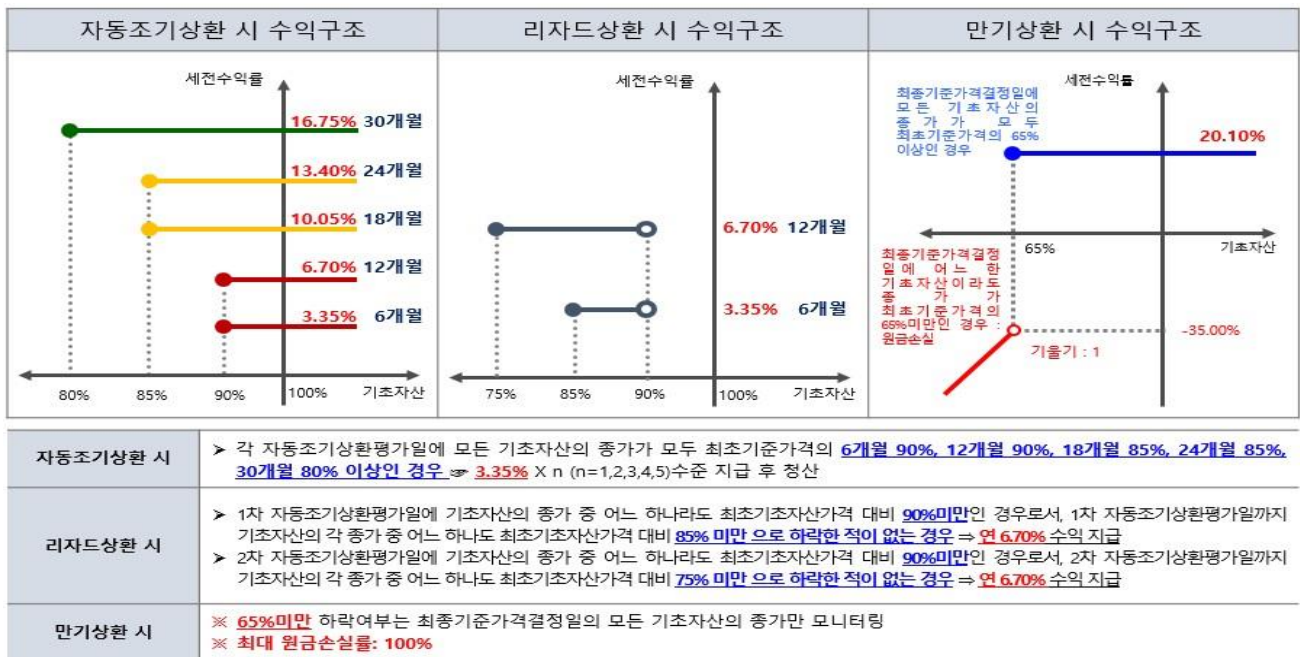
2020-11-09

## 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

167

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

36

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

기준일 : 2020-11-06

공시일:

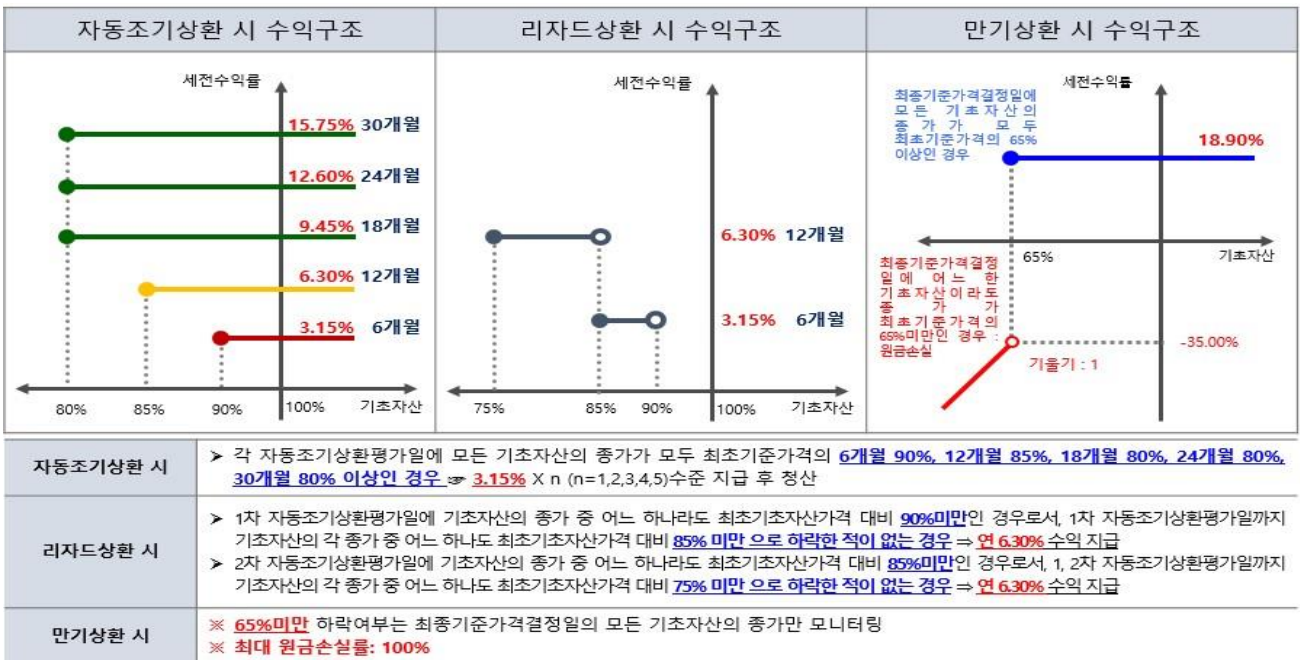
2020-11-09

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

85

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

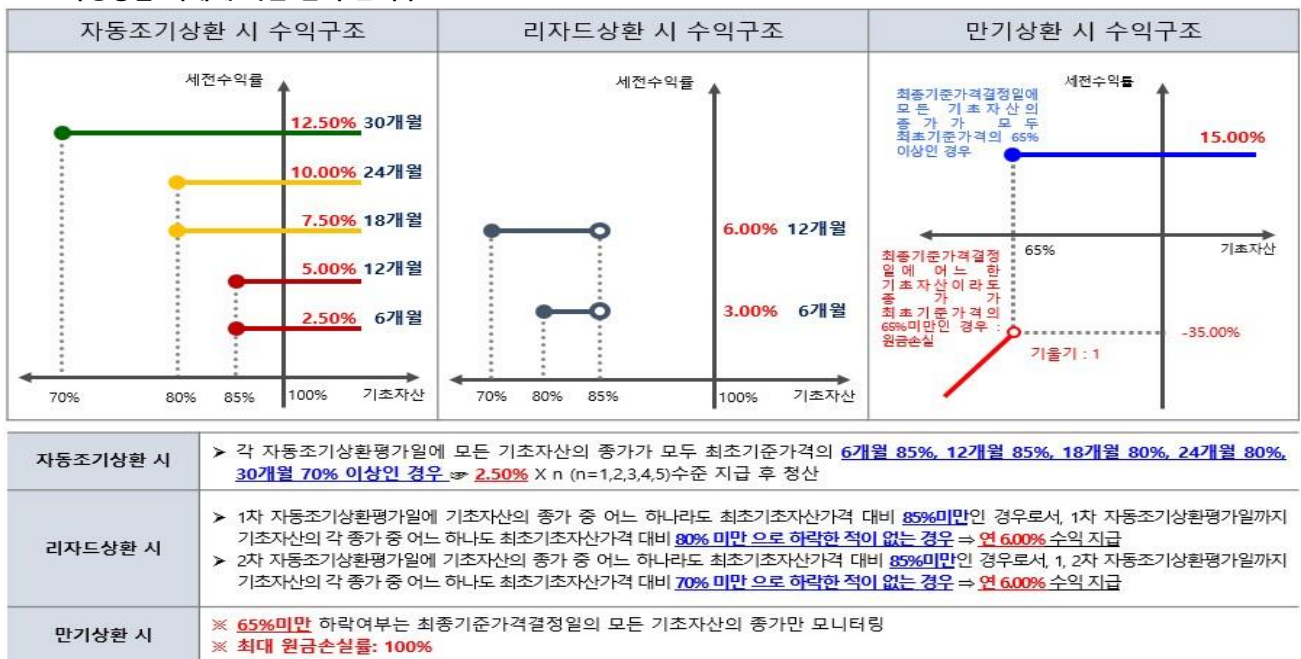
2020-11-09

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

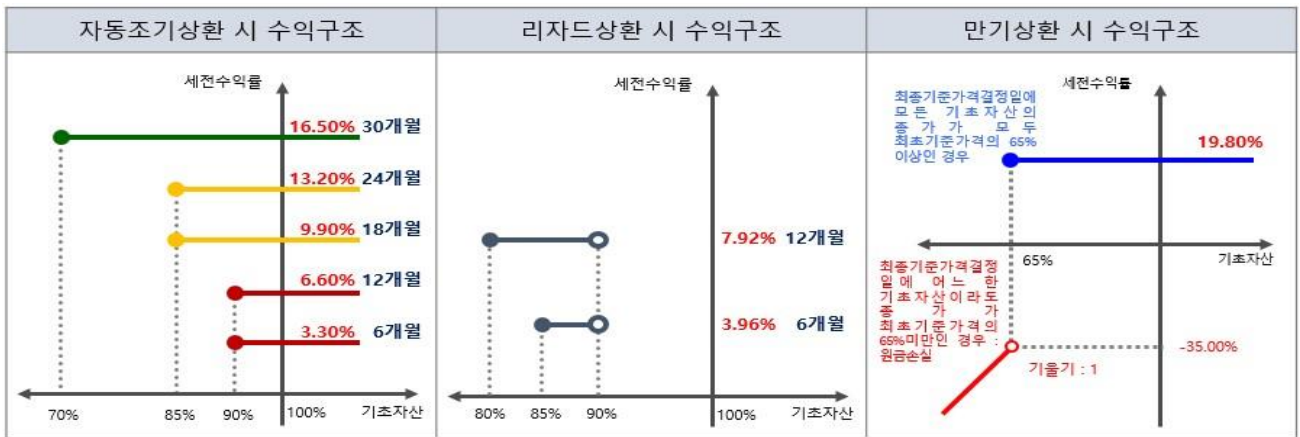
공시일: 2020-11-09

## 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

20

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

2020-11-09

## 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> ⇒ <math>2.75\% \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 <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

122

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

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

기준일 : 2020-11-06

공시일:

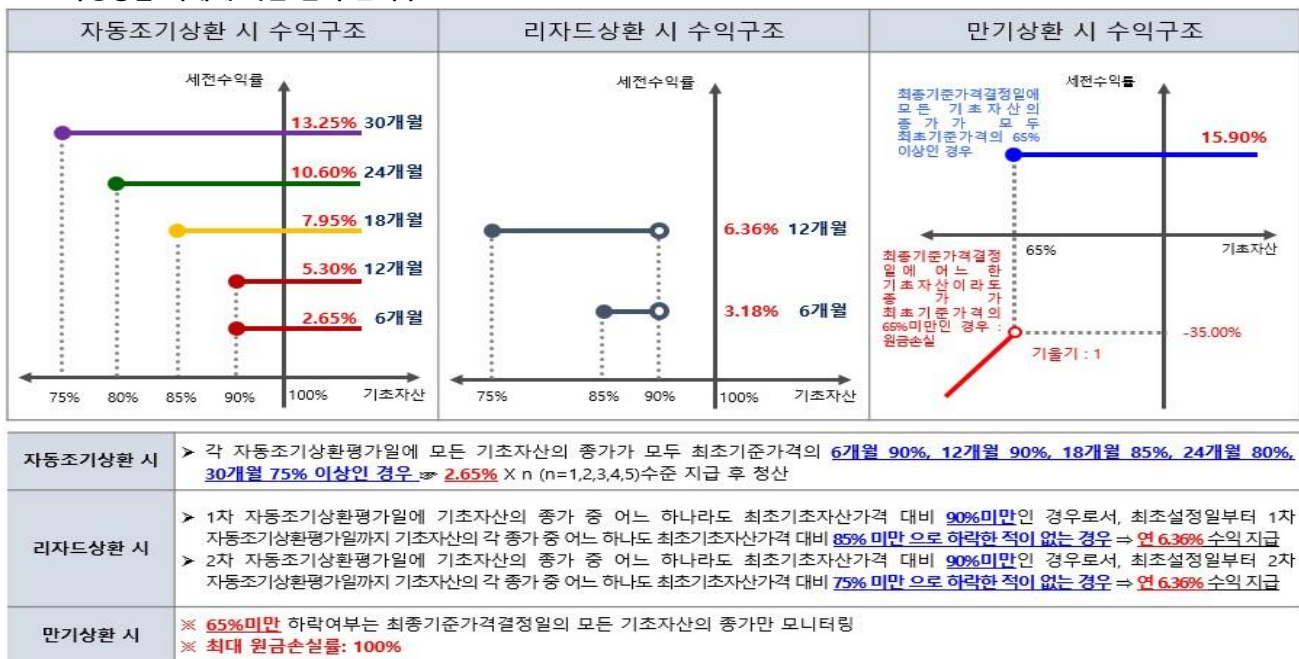
2020-11-09

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

48

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

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

기준일 : 2020-11-06

공시일:

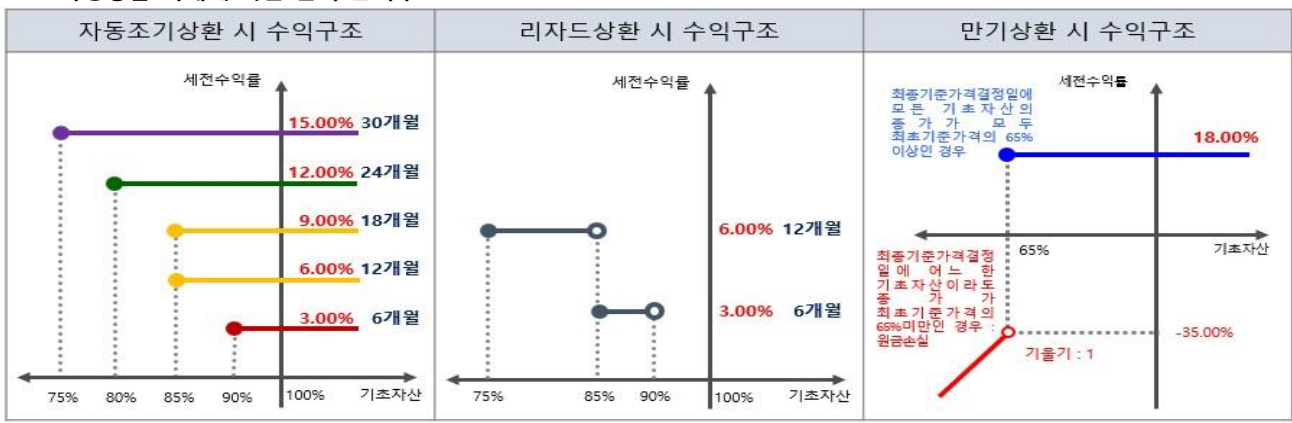
2020-11-09

## 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 최저기준가격의 <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 최저기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 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

509

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

120

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

기준일 : 2020-11-06

공시일:

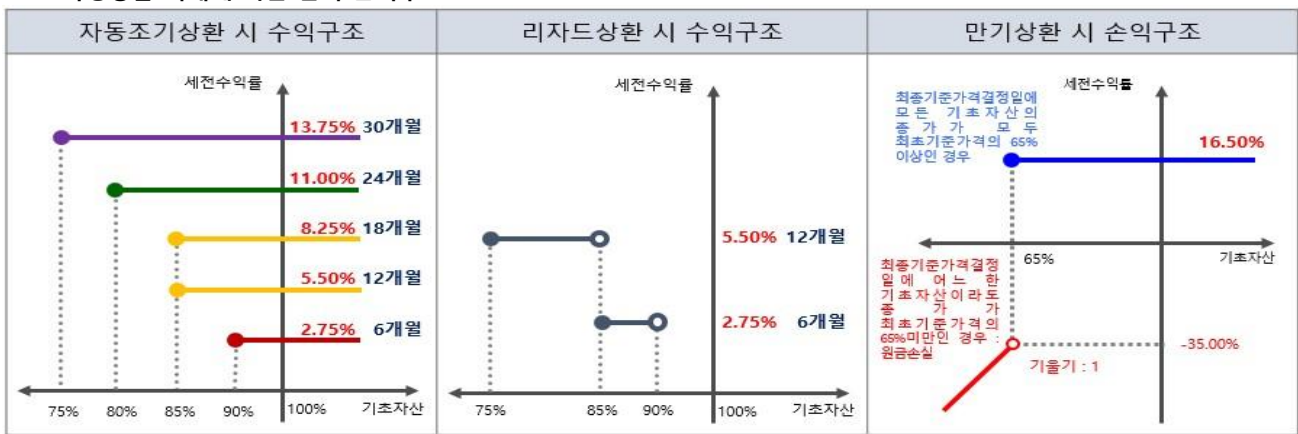
2020-11-09

## 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 최종기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 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 최종기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.50% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최종기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.50% 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

125

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

29

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

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

2020-11-09

## 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

16

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

# 펀드명 : BNK3Index지수연계SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

2020-11-09

## 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	3,503		3,503	장외
합계			3,503		3,503	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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>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 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

230

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

240

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

기준일 : 2020-11-06

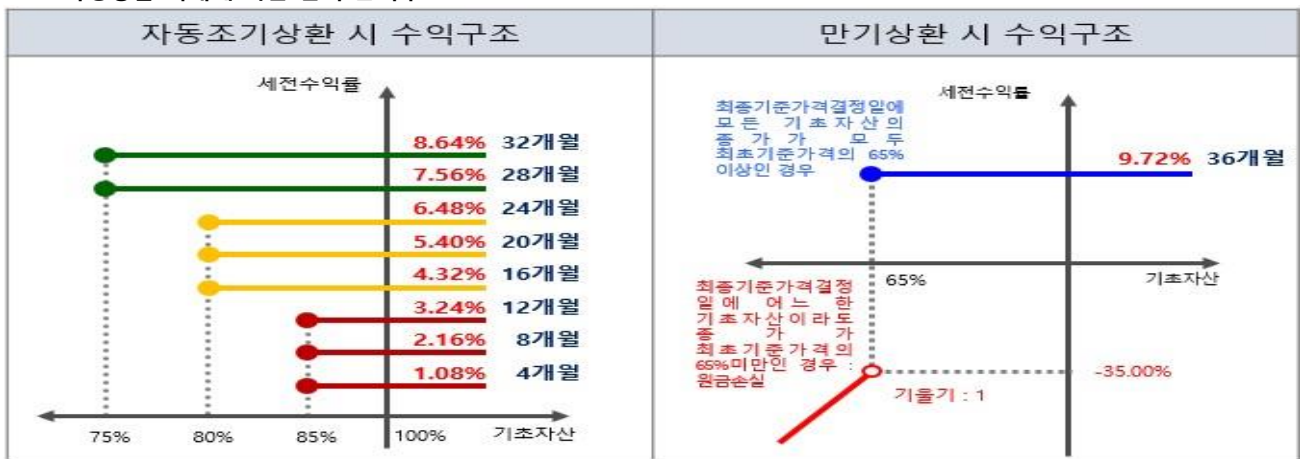
공시일: 2020-11-09

## 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	> 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> ⇒ <b>1.08%</b> X n (n=1,2,3,4,5,6,7,8)수준 지급 후 청산
만기상환 시	※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

258

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

427

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

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

2020-11-09

## 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> ⇒ <b>2.00%</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 최저기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.80%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 <b>75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.80%</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

96

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22

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

기준일 : 2020-11-06

공시일:

2020-11-09

## 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 손익구조



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

21

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

32

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

기준일 : 2020-11-06

공시일:

2020-11-09

## 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> ⇒ 1.50% × n (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

61

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

80

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

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

## 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	2,911		2,911	장외
합계			2,911		2,911	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 2.25% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>60%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

155

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

78

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

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

2020-11-09

## 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	1,703		1,703	장외
합계			1,703		1,703	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> <b>2.05%</b> X n (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

90

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

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

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

2020-11-09

## 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	564		564	장외
합계			564		564	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 <b>6개월 80%, 12개월 80%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> <math>1.55\% \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

26

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

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

기준일 : 2020-11-06

공시일:

2020-11-09

## 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	5,984		5,984	장외
합계			5,984		5,984	

## 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 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 2.25% X n (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

292

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

125

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

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

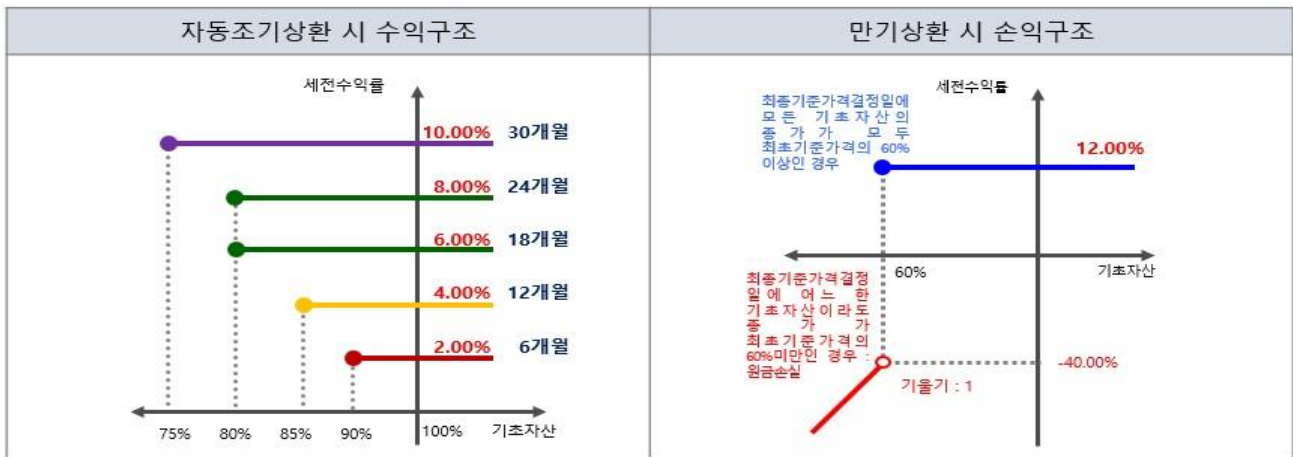
2020-11-09

## 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	5,074		5,074	장외
합계			5,074		5,074	

## 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 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.00%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>60%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

243

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

124

# 펀드명 : BNK환헤지지원화플러스지수연계증권HSK-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-06

공시일: 2020-11-09

## 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	1,160		1,160	장외
합계			1,160		1,160	

## 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 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ 1.65% X n (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

57

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

28