

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-11-18

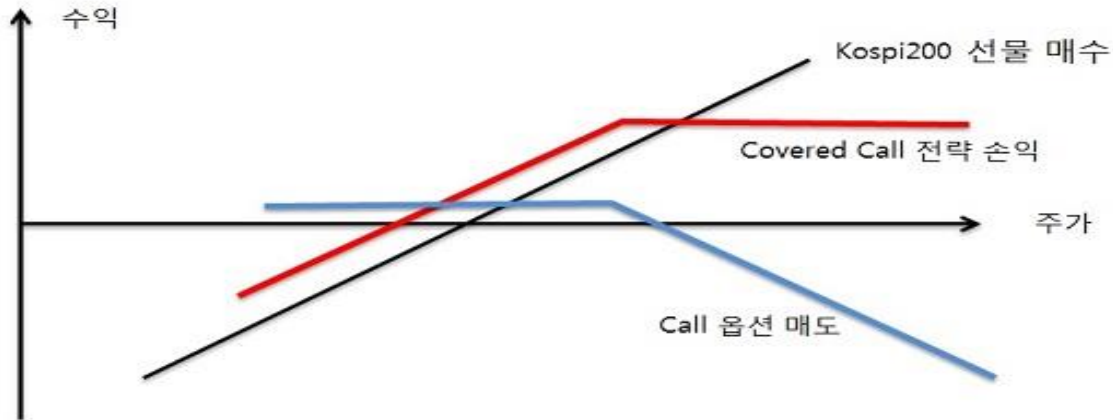
공시일: 2020-11-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,190	1,105	85	장내
누계	주가지수	선물	1,785	0	1,785	장내
신규	주가지수	옵션	44	4,162	-4,118	장내
누계	주가지수	옵션	0	3,824	-3,824	장내
신규	유가증권	선물	72	61	11	장내
누계	유가증권	선물	62	32	29	장내
합계			1,846	3,856	-2,010	

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

219

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

466

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	51	0	51	장내
누계	주가지수	선물	2,958	0	2,958	장내
합계			2,958	0	2,958	

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

237

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

391

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

2020-11-19

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	

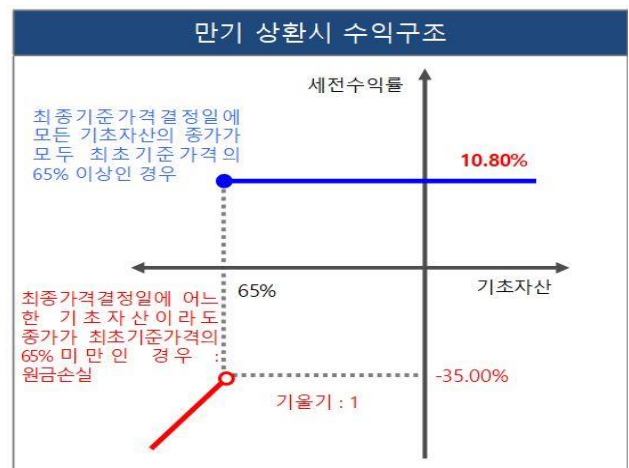
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

774

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

93

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

2020-11-19

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

220

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

30

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

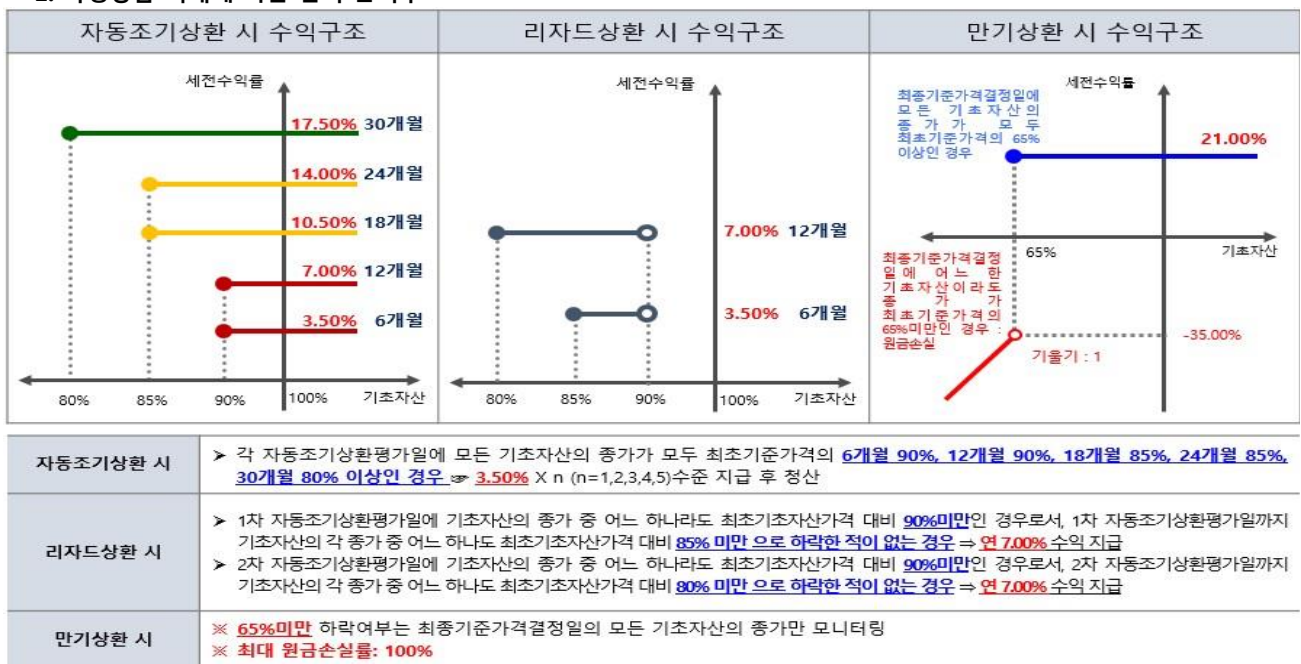
2020-11-19

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

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSH-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

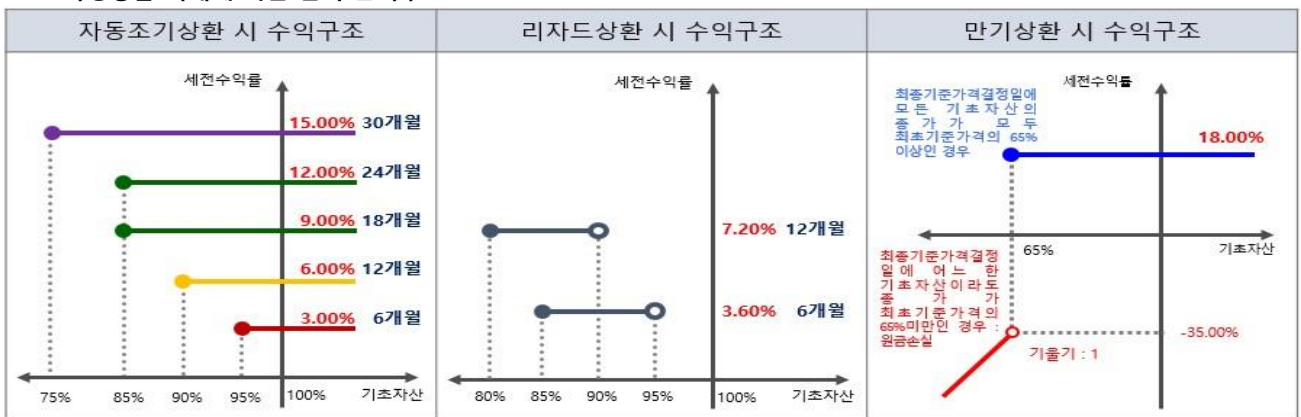
2020-11-19

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

9

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSH-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

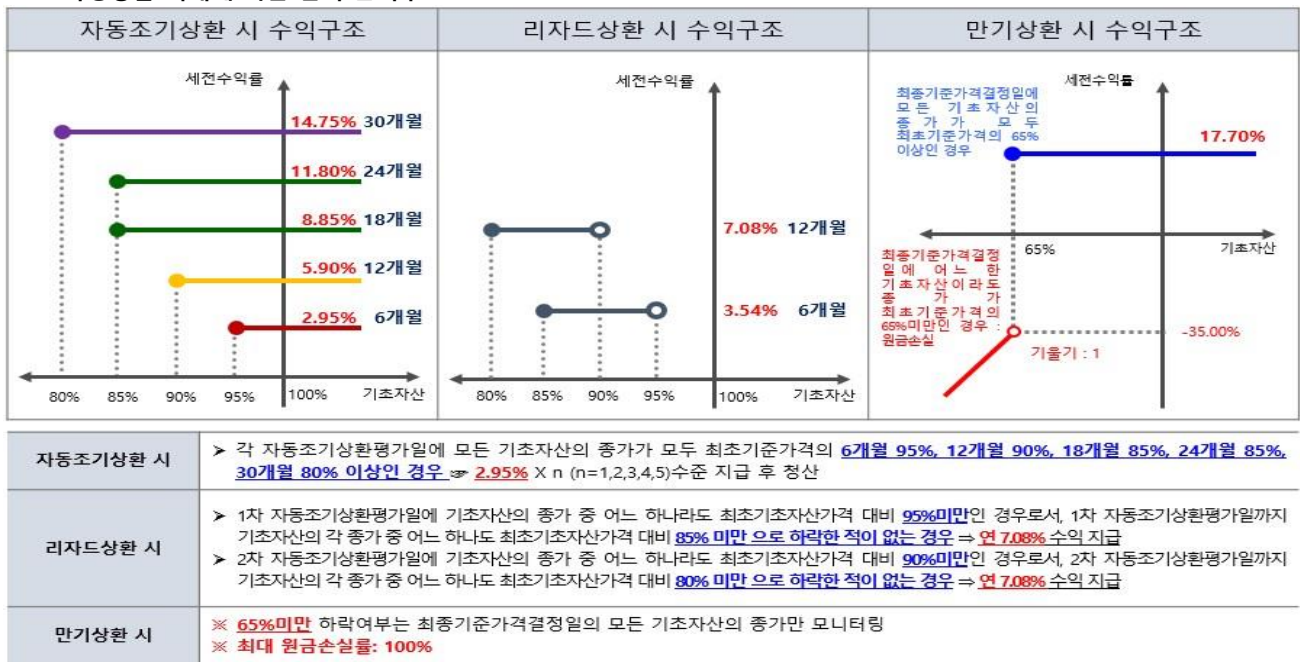
2020-11-19

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

8

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-8호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

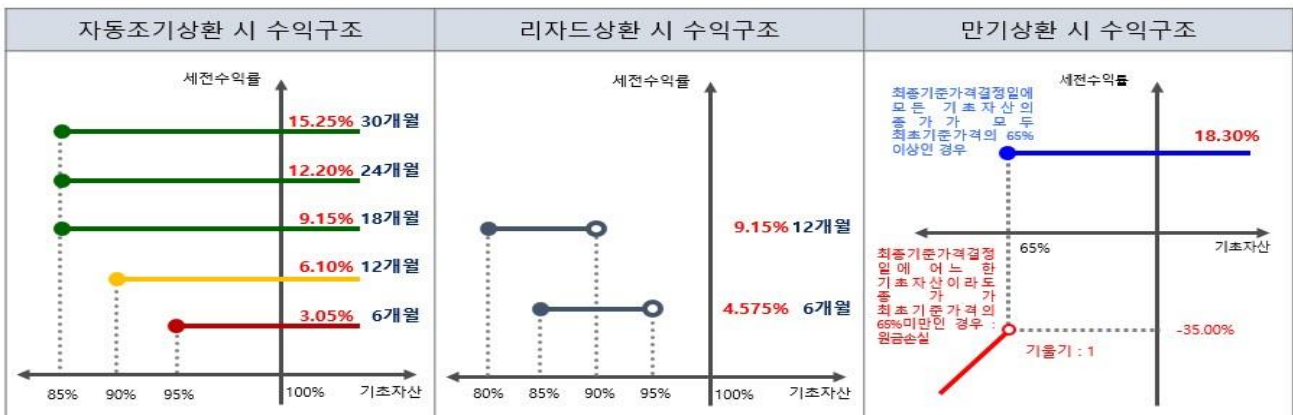
2020-11-19

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"> ▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 85% 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 85% 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 80% 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

28

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

펀드명 : BNK3Index더블리자드증권SHE-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

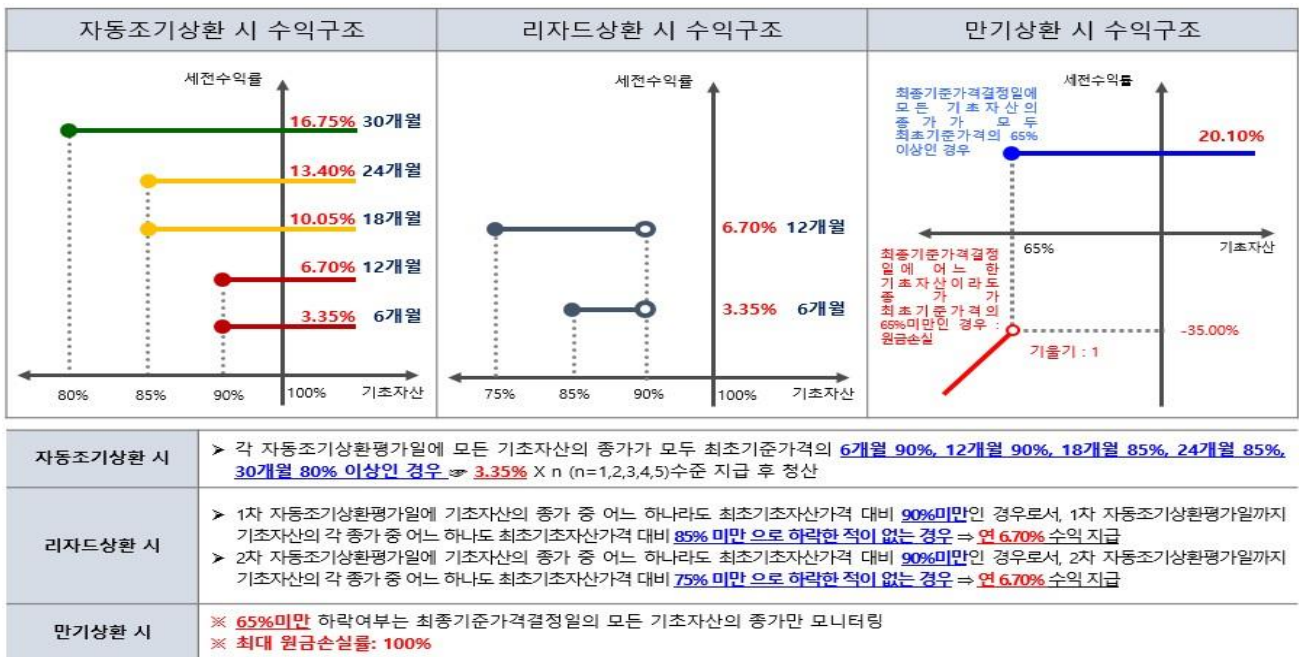
2020-11-19

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

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

펀드명 : BNK3Index더블리자드증권KSE-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

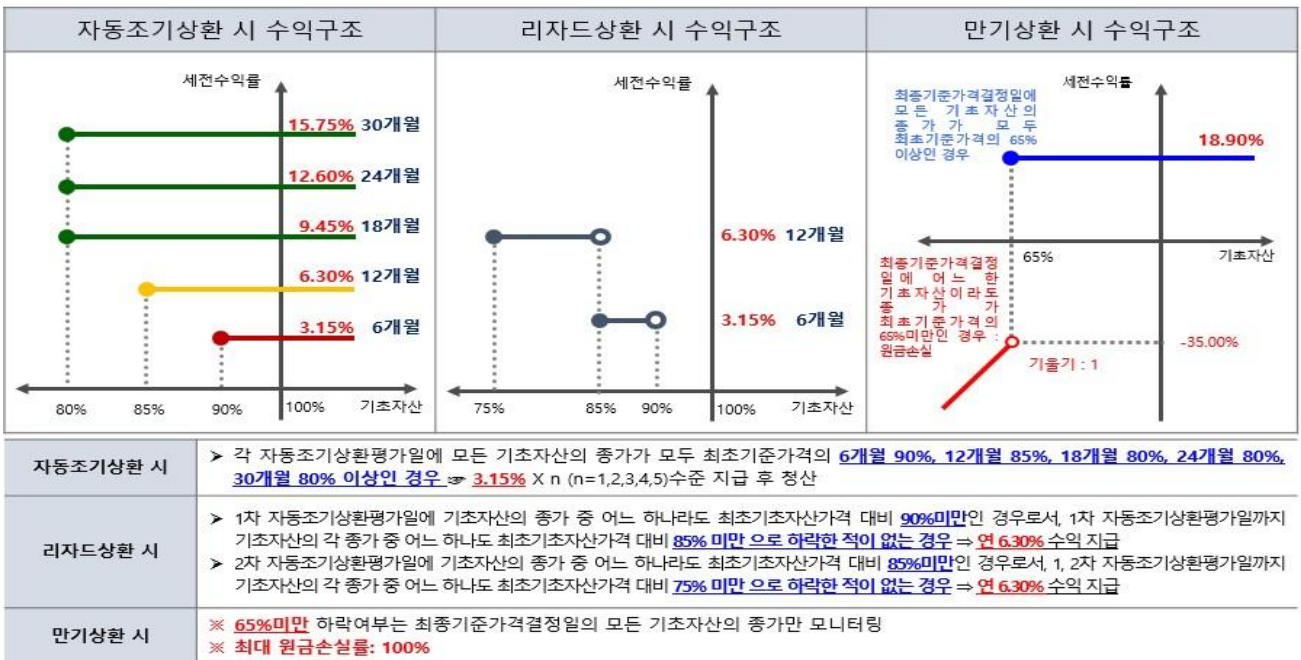
2020-11-19

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	1,137		1,137	장외
합계			1,137		1,137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

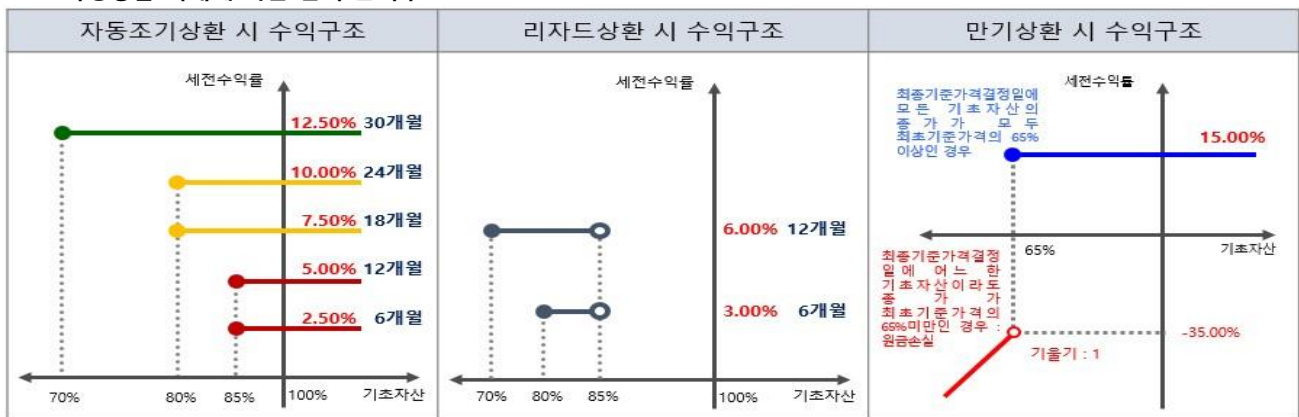
2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 70% 이상인 경우 ⇒ 2.50% 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 85%미만인 경우로서, 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 1, 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 70% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 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

4

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

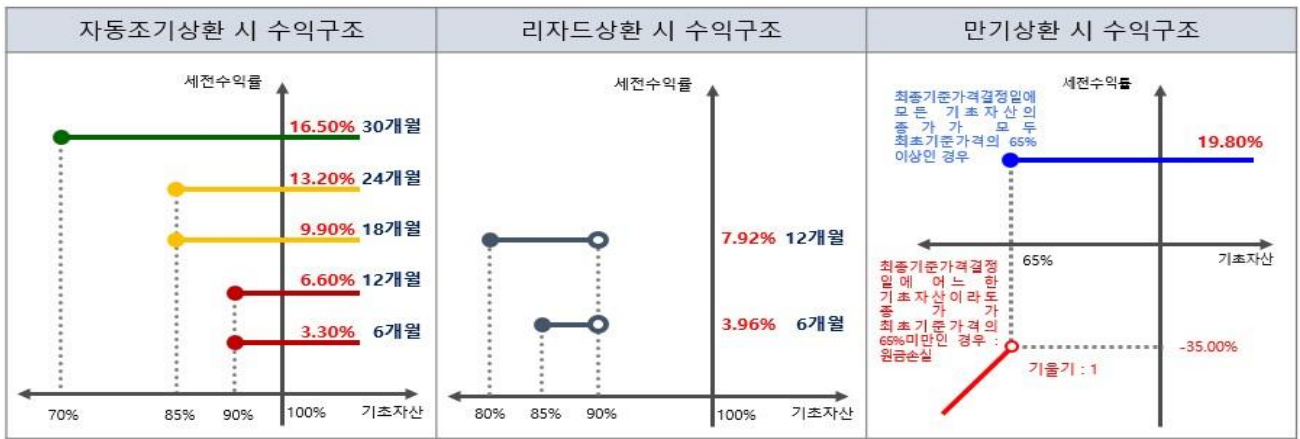
2020-11-19

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	235		235	장외
합계			235		235	

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 70% 이상인 경우 ⇒ 3.30% 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, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 7.92% 수익 지급 ▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 7.92% 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

13

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

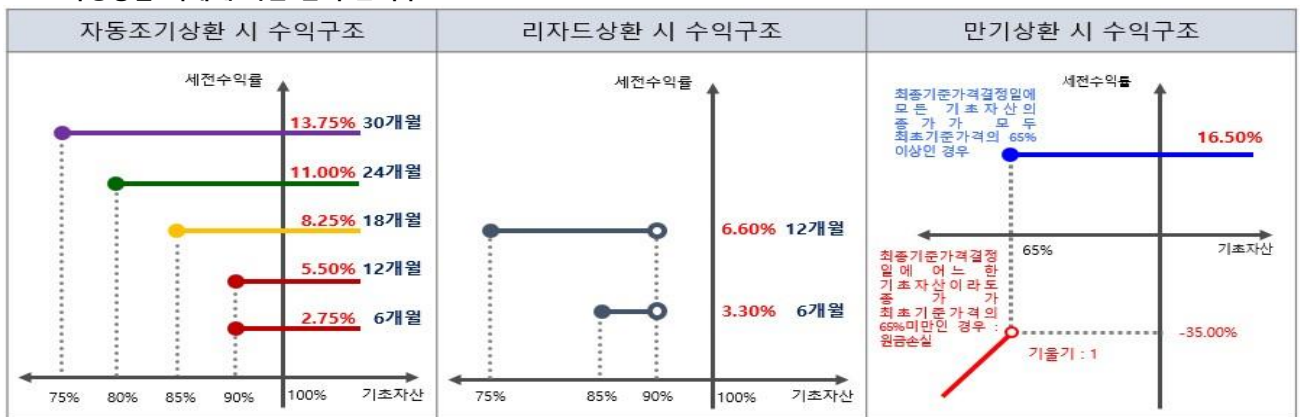
2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ $2.75\% \times n$ (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, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.60% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90% 미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.60% 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

80

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15

펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계증권KSN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

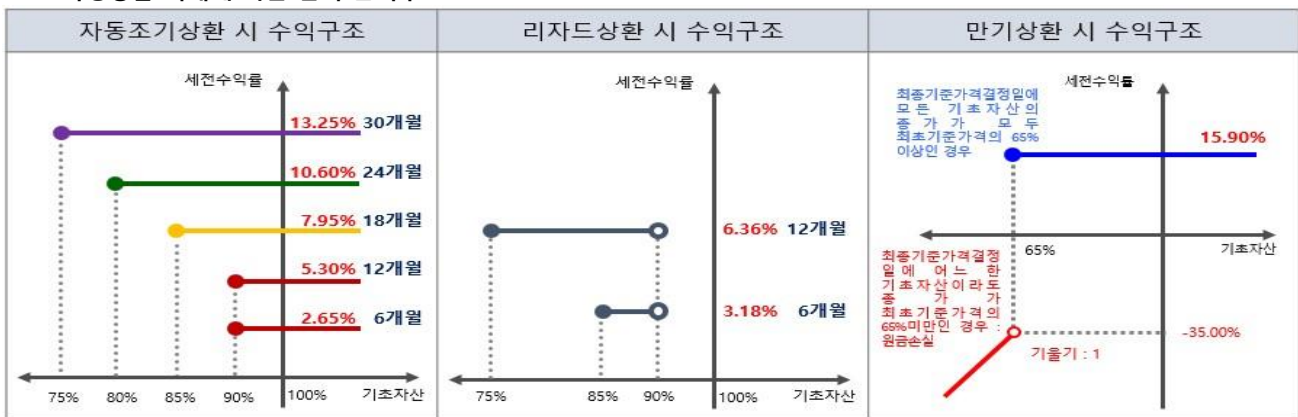
2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ $2.65\% \times n$ (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 최종기초자산가격 대비 90% 미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.36% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최종기초자산가격 대비 90% 미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최종기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.36% 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

32

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계KSE-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

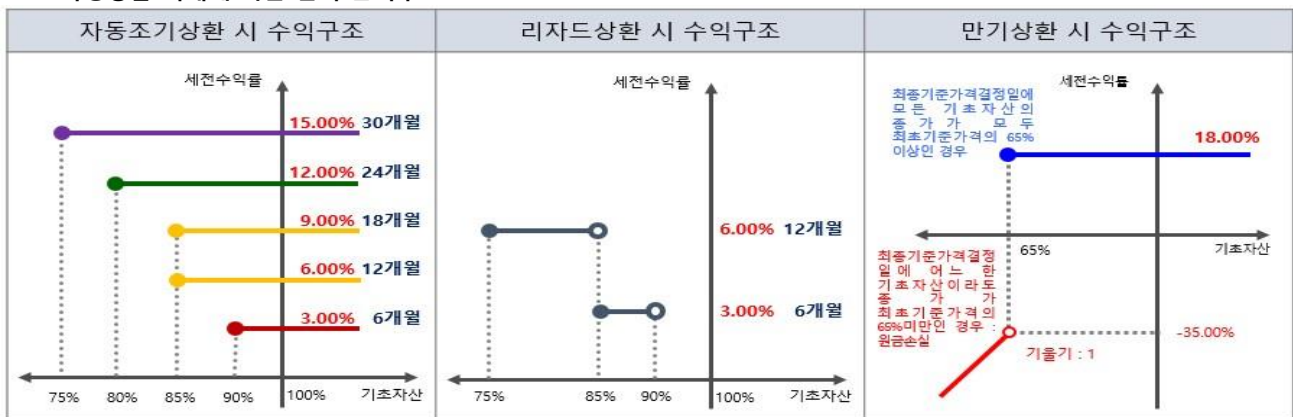
2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최저기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 80%, 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 최저기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 75%미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 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

309

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

79

펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계KSE-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

2020-11-19

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"> 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
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 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 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
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

94

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

28

펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계KSE-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

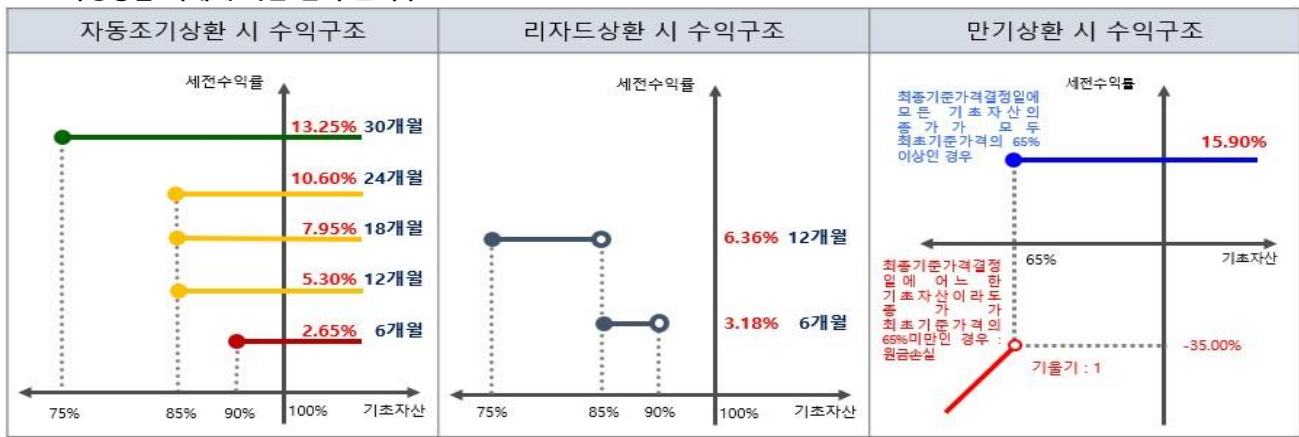
2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 모두 최저기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.65% × n (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.36% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.36% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

펀드명 : BNK3Index지수연계SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

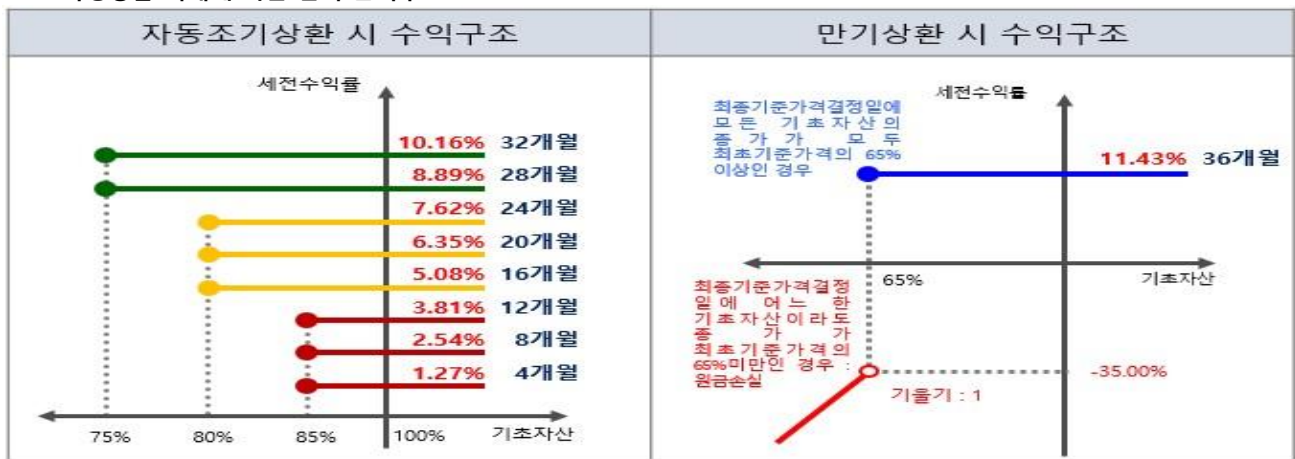
2020-11-19

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	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 4개월 85%, 8개월 85%, 12개월 85%, 16개월 80%, 20개월 80%, 24개월 80%, 28개월 75%, 32개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.27% X n (n=1,2,3,4,5,6,7,8)수준 지급 후 청산
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

53

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

펀드명 : BNK3Index지수연계증권SEN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

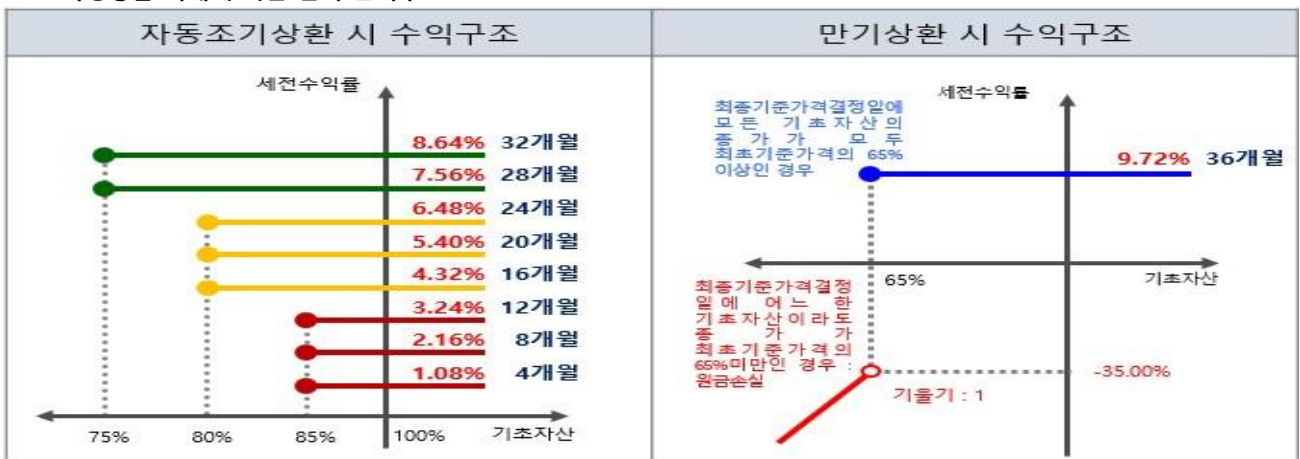
공시일: 2020-11-19

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	3,685		3,685	장외
합계			3,685		3,685	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 4개월 85%, 8개월 85%, 12개월 85%, 16개월 80%, 20개월 80%, 24개월 80%, 28개월 75%, 32개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.08% X n (n=1,2,3,4,5,6,7,8)수준 지급 후 청산
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

90

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

92

펀드명 : BNK3Index더블리자드지수연계증권KSE-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최저기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.00% 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 최저기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 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

74

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22

펀드명 : BNK3Index지수연계증권SEN-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

2020-11-19

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

펀드명 : BNK3Index지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

2020-11-19

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"> ▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.50% × n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
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

40

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

47

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSK-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

2020-11-19

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

136

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

60

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSK-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

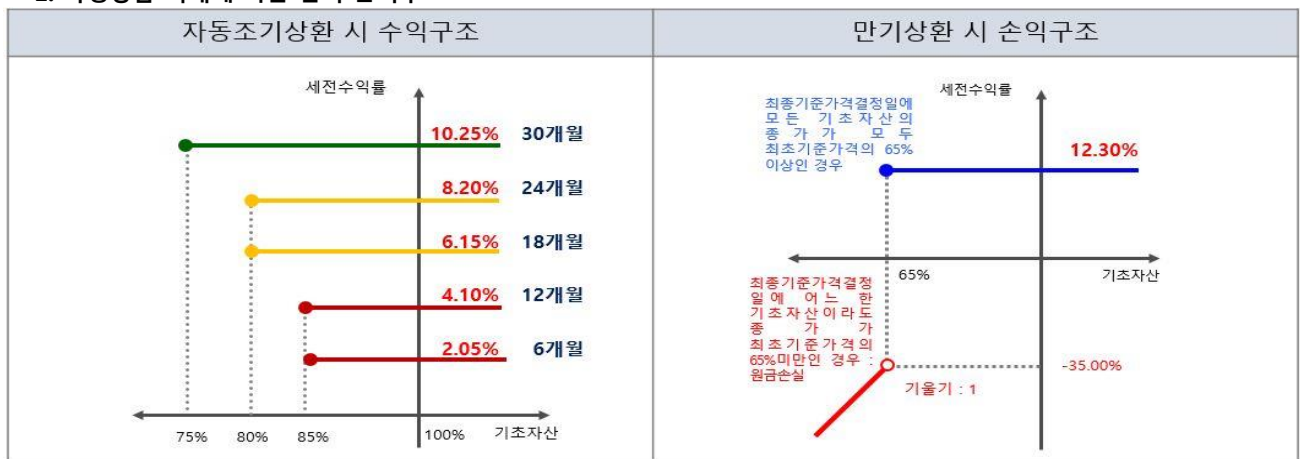
2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 2.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
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

78

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 80%, 12개월 80%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 1.55% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
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

23

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.25% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
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

250

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

38

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

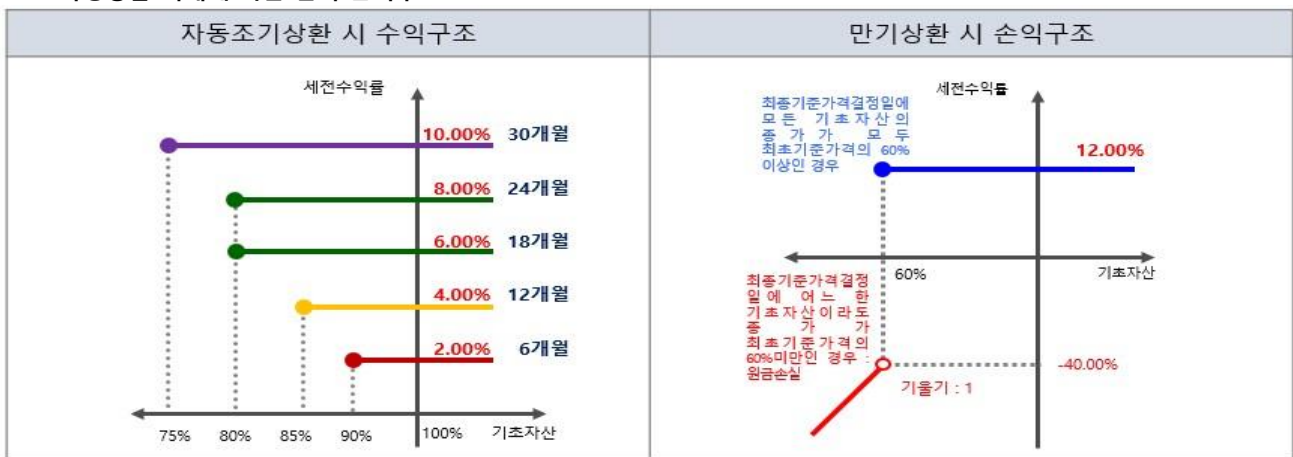
2020-11-19

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 수익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.00% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 60%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

207

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

42

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

2020-11-19

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"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 85%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.65% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
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

45

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

펀드명 : BNK리자드환헤지원화플러스지수연계증권HSN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일: 2020-11-19

2020-11-19

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	310		310	장외
합계			310		310	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산				
	6개월	12개월	18개월	24개월	30개월
	90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상
리자드상환 시	> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만 인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 70% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 => 연 3.50% 수익 지급				
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우			
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만 인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%			

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

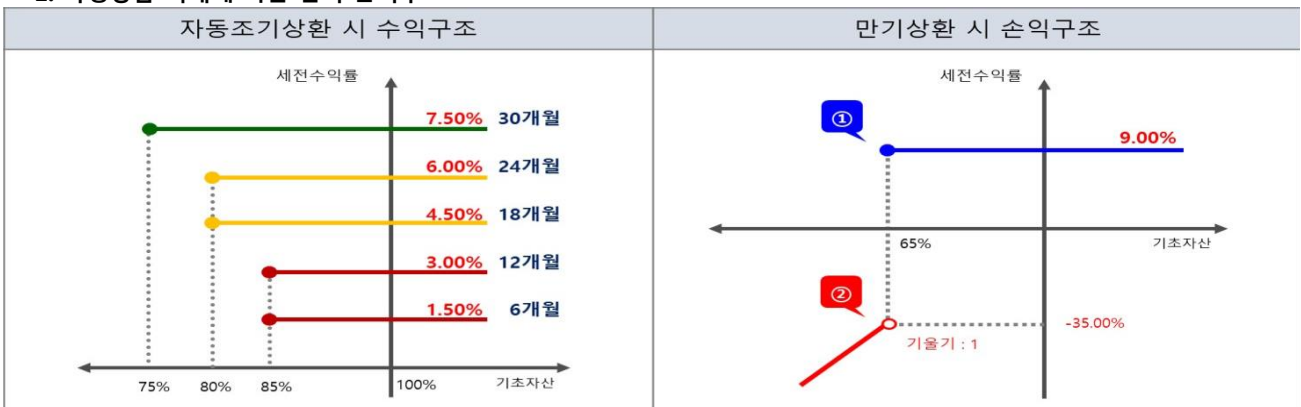
2020-11-19

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	145		145	장외
합계			145		145	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 **1.50%** X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산

자동조기상환 시	6개월	12개월	18개월	24개월	30개월
	85% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상

만기상환 시	① 수익상환	② 손실상환
	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만 인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

7

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2020-11-18

공시일:

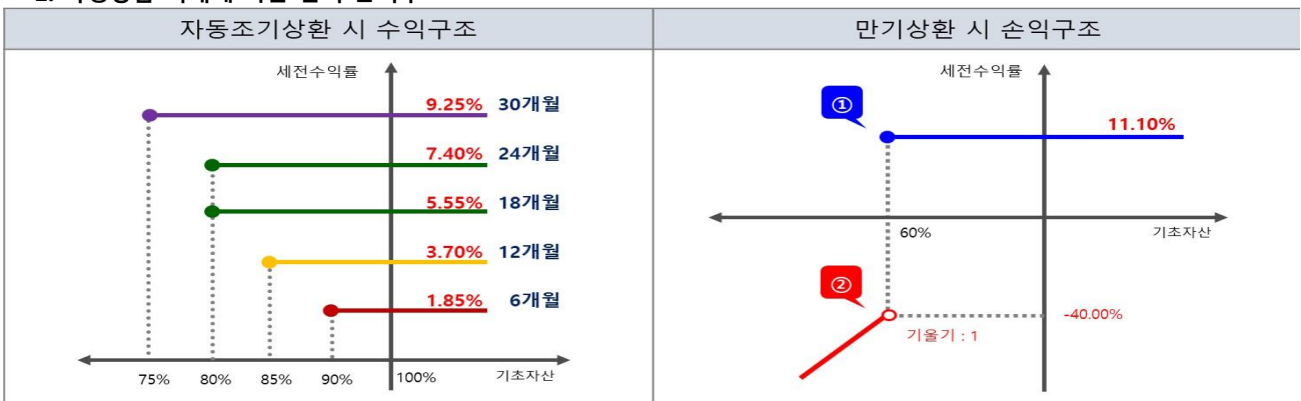
2020-11-19

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	1,737		1,737	장외
합계			1,737		1,737	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 $1.85\% \times n$ (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산

자동조기상환 시	6개월	12개월	18개월	24개월	30개월
	90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상

① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 **60% 이상**인 경우
② 손실상환 :

- ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 **60% 미만**인 경우 : 원금손실
- ※ **60% 미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링
- ※ **최대 원금손실률: 100%**

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

86

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

56