

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	5,808	2,689	3,119	장내
누계	주가지수	선물	6,561	0	6,561	장내
신규	주가지수	옵션	35	5,106	-5,071	장내
누계	주가지수	옵션	40	4,633	-4,593	장내
신규	유가증권	선물	744	1,104	-360	장내
누계	유가증권	선물	88	444	-356	장내
합계			6,689	5,077	1,611	

## 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

514

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

823

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	688	0	688	장내
누계	주가지수	선물	8,325	0	8,325	장내
합계			8,325	0	8,325	

## 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

666

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,134

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

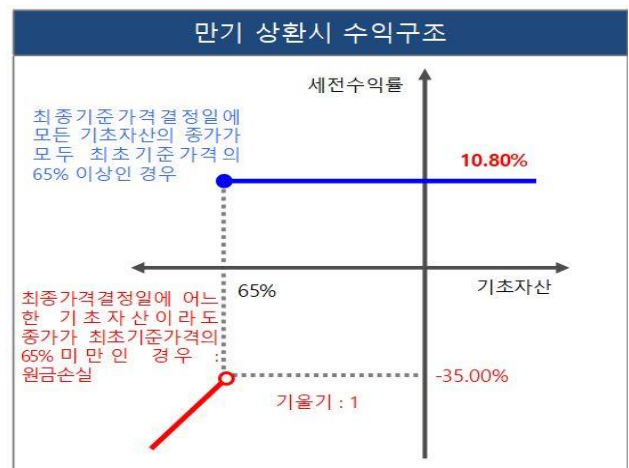
2021-01-11

## 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% X n (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산

### 리자드 조건

- 1차 중간기준가격결정일까지 1차 조기상환이 되지 않고 최초기준가격결정일로부터 1차 중간기준가격결정일까지 최초기준가격의 88%미만으로 하락한 기초자산이 없는 경우 ⇒ 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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

852

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,195

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SEN-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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	

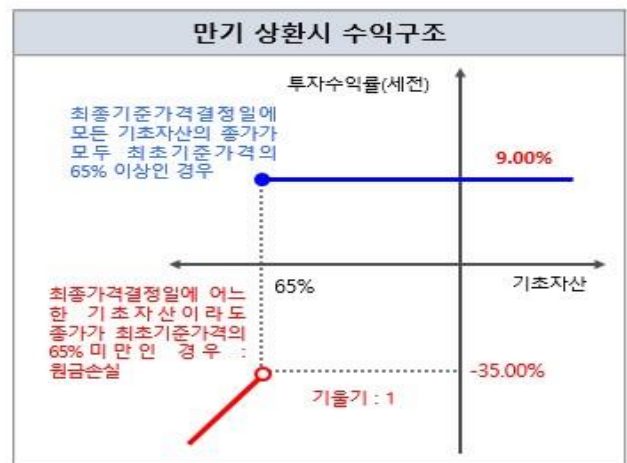
## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



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

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



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

215

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

254

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

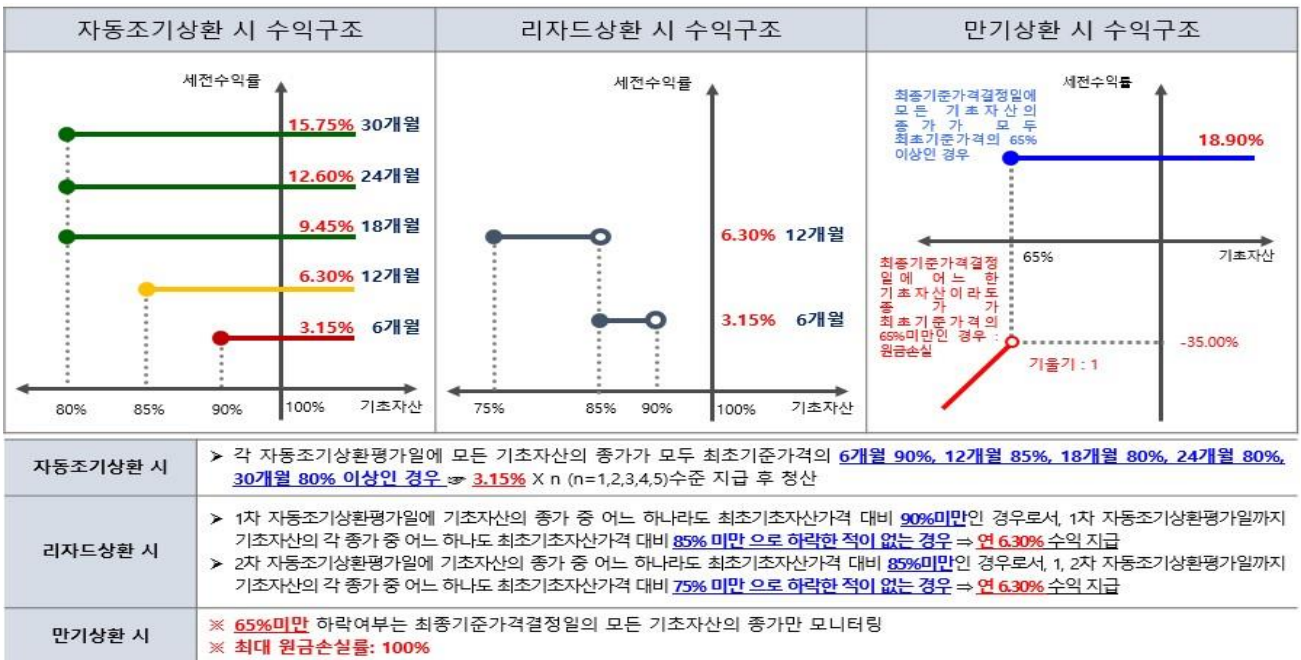
2021-01-11

## 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

0

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

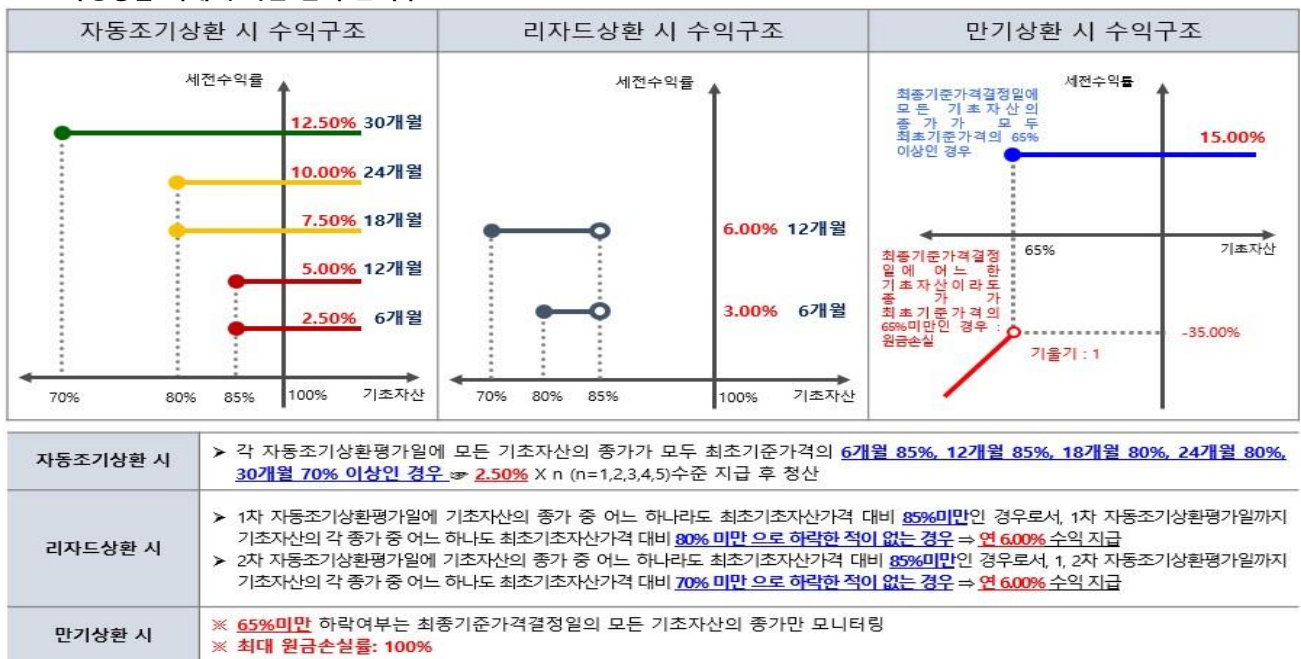
2021-01-11

## 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

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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"> <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

0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일:

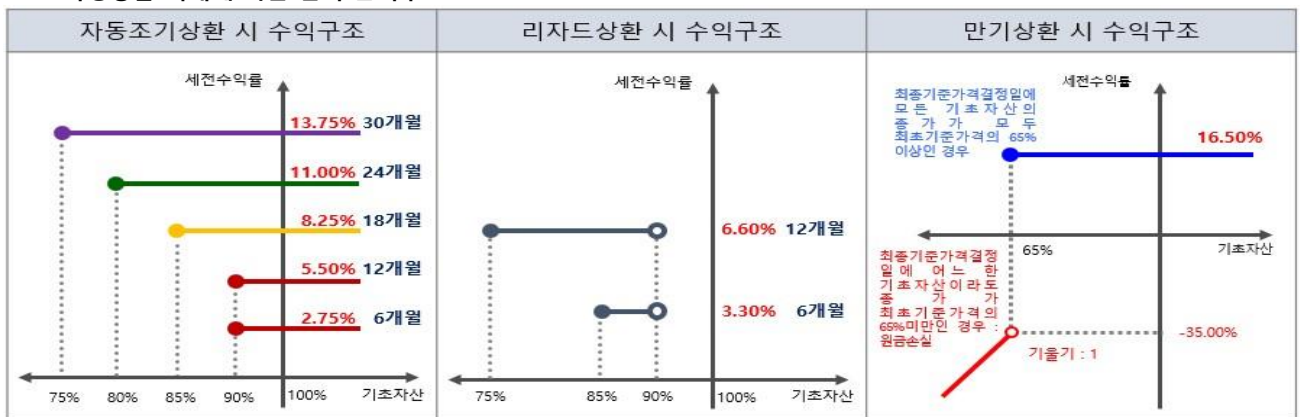
2021-01-11

## 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

1

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

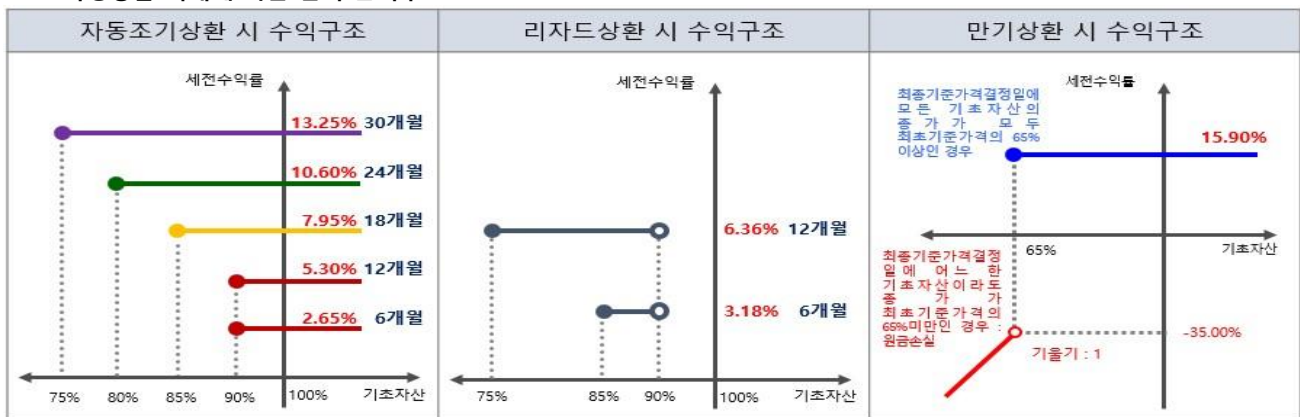
2021-01-11

## 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

1

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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> ⇒ <b>3.00%</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%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>6.00%</b> 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 <b>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

57

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

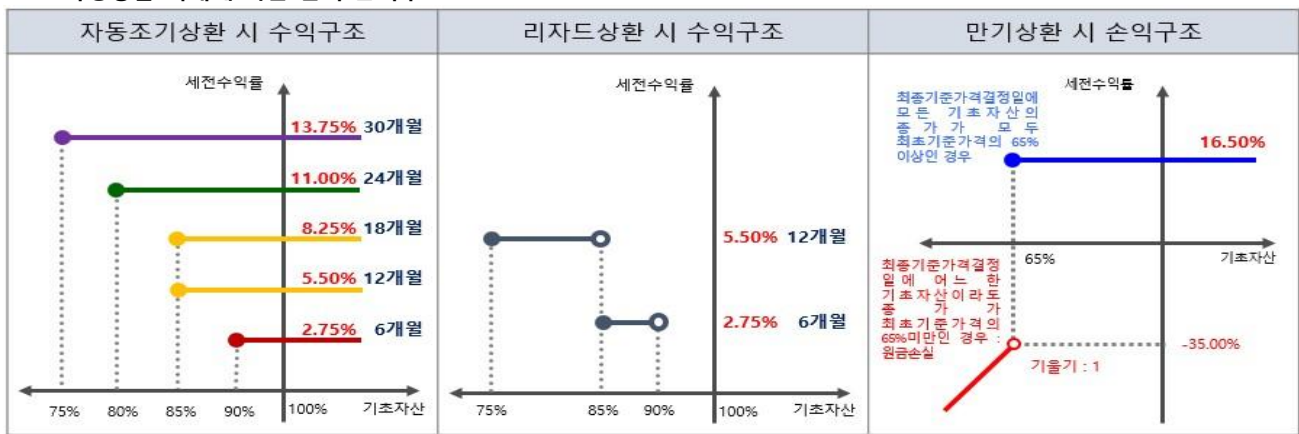
2021-01-11

## 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

26

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

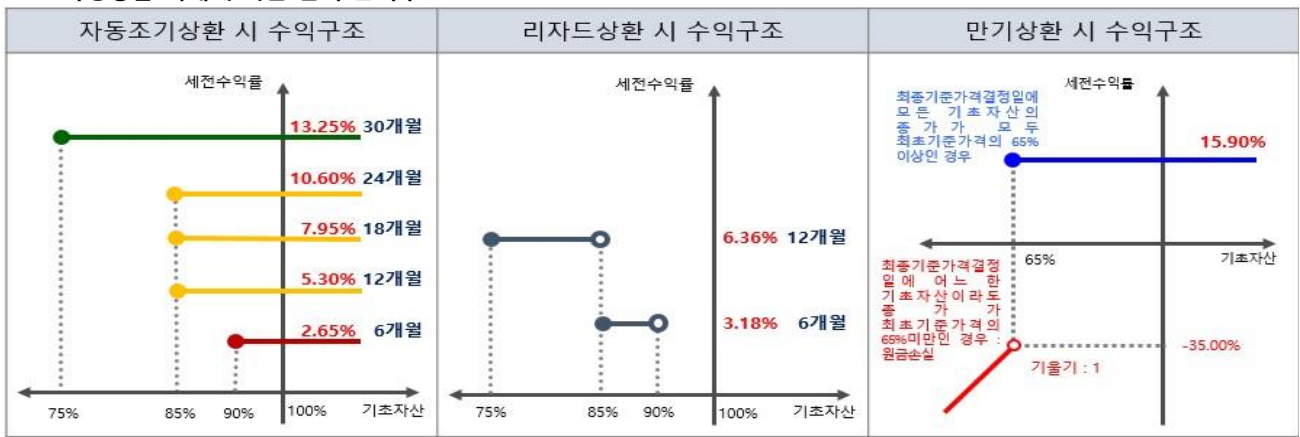
2021-01-11

## 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> 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 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

4

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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

38

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

23

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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 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 : BNK3Index지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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</math> 1.50% <math>\times</math> 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

19

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

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

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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 6개월 90%, 12개월 85%, 18개월 80%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 <math>2.25\% \times n</math> (n=1,2,3,4,5) 수준 지급 후 청산</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>60%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>최대 원금손실률: 100%</li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

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

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

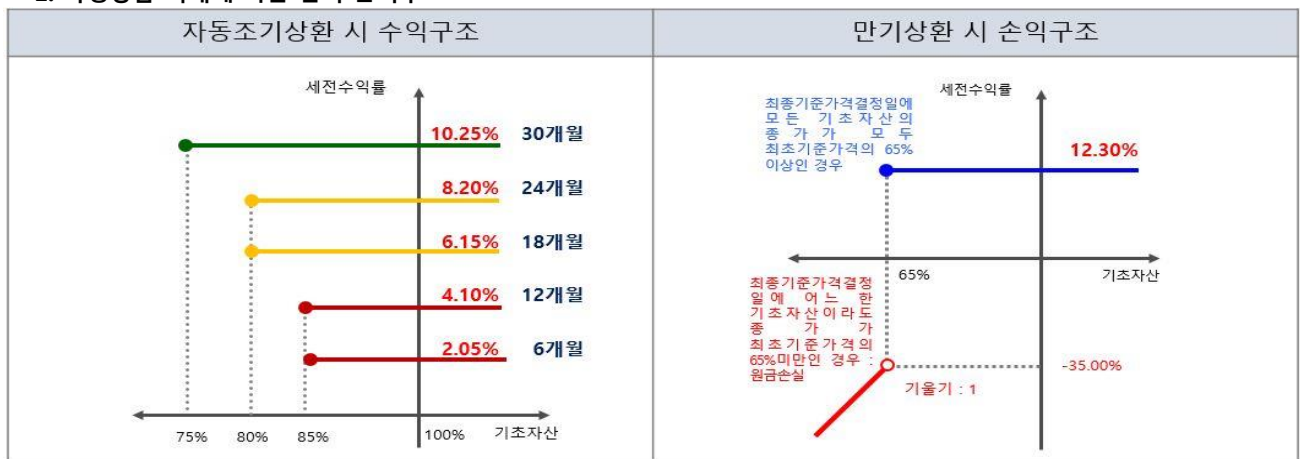
2021-01-11

## 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

58

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

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

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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

13

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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

205

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

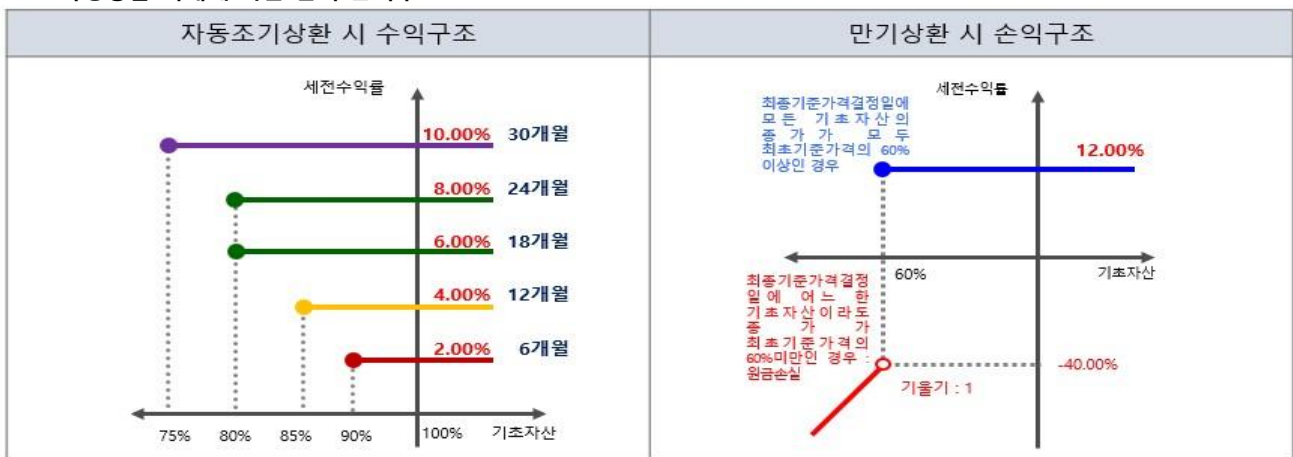
2021-01-11

## 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> ⇒ 2.00% 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

164

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

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

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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

32

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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	309		309	장외
합계			309		309	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조										
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>▶ 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</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> <th>30개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	30개월	90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상	<p>리 자 드 상 환 시</p> <p>▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 70% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.50% 수익 지급</p>	<p>만 기 상 환 시</p> <p>① 수익상환 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월	30개월								
90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상								

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

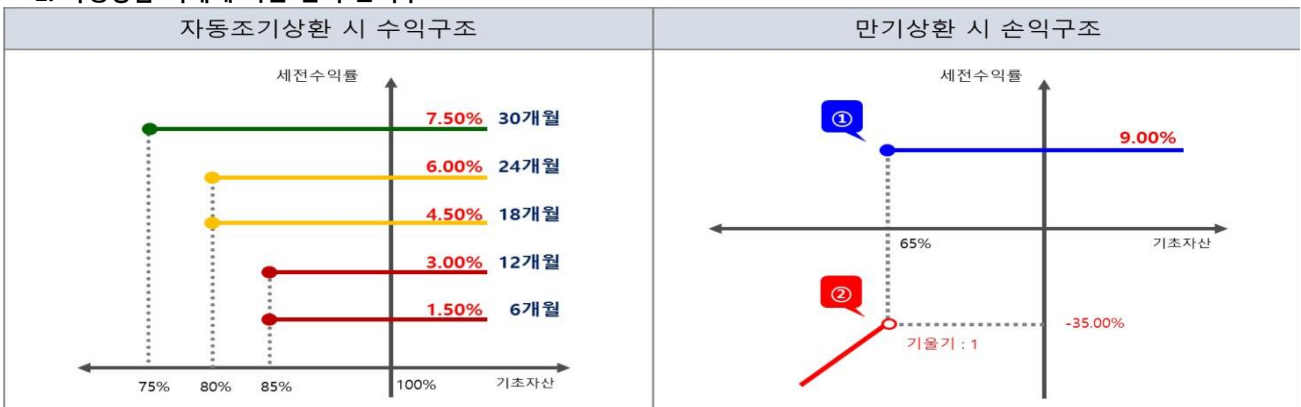
2021-01-11

## 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 <b>65% 이상</b> 인 경우	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

7

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

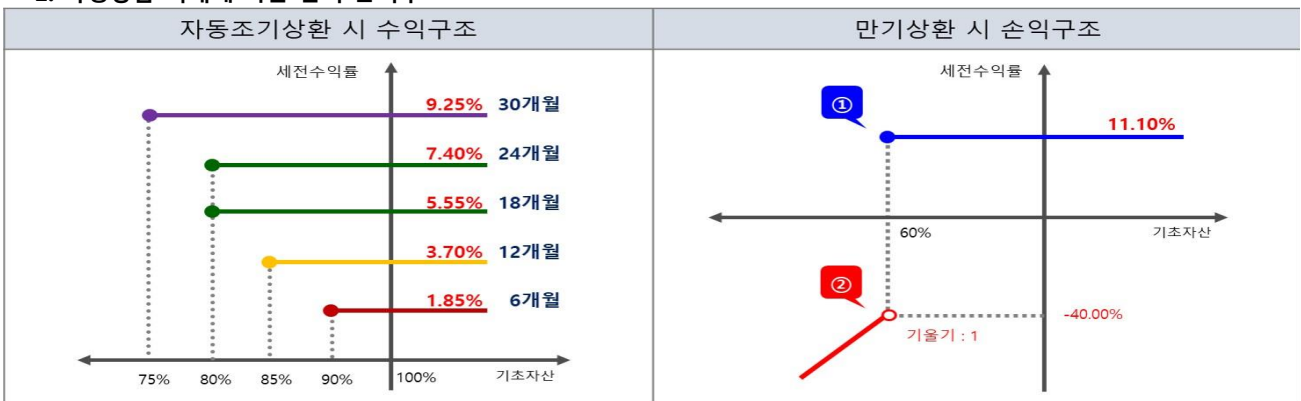
2021-01-11

## 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

만기상환 시	① 수익상환	② 손실상환
	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>60% 이상</b> 인 경우	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>60% 미만</b> 인 경우 : 원금손실 ※ <b>60% 미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

88

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

29

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

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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	3,818		3,818	장외
합계			3,818		3,818	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조										
<p>자동조기상환 시</p> <p>➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> <th>30개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	30개월	90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상	<p>리자드 상환 시</p> <p>➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.15% 수익 지급</p>	<p>만기 상환 시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실</li> <li>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ 최대 원금손실률: 100%</li> </ul>
6개월	12개월	18개월	24개월	30개월								
90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상								

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

214

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

63

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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	252		252	장외
합계			252		252	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X 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	최초기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우
② 손실상환	※ 최초기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최초기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2021-01-08

공시일:

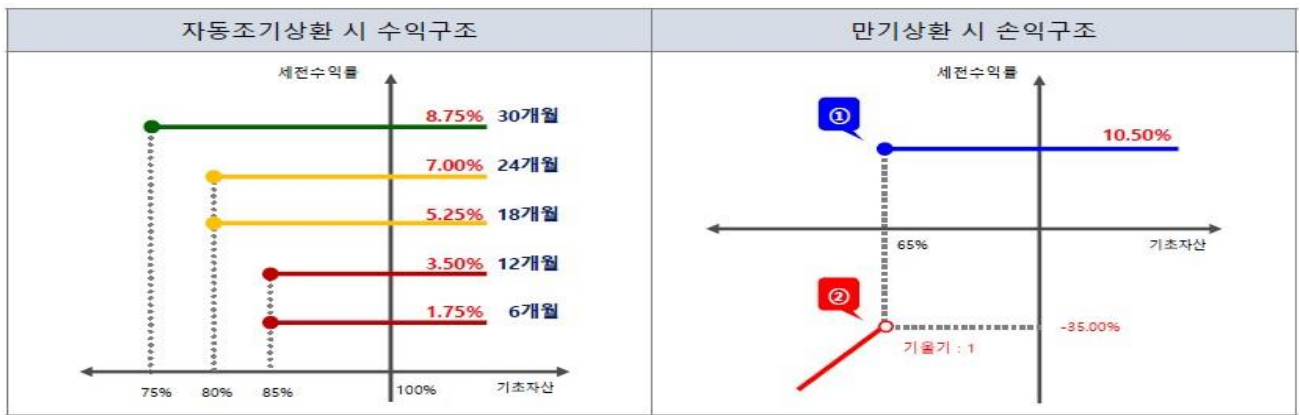
2021-01-11

## 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	4,292		4,292	장외
합계			4,292		4,292	

## 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
	85% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우			
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 현금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 현금손실률: 100%			

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

220

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

71

# 펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-8호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일:

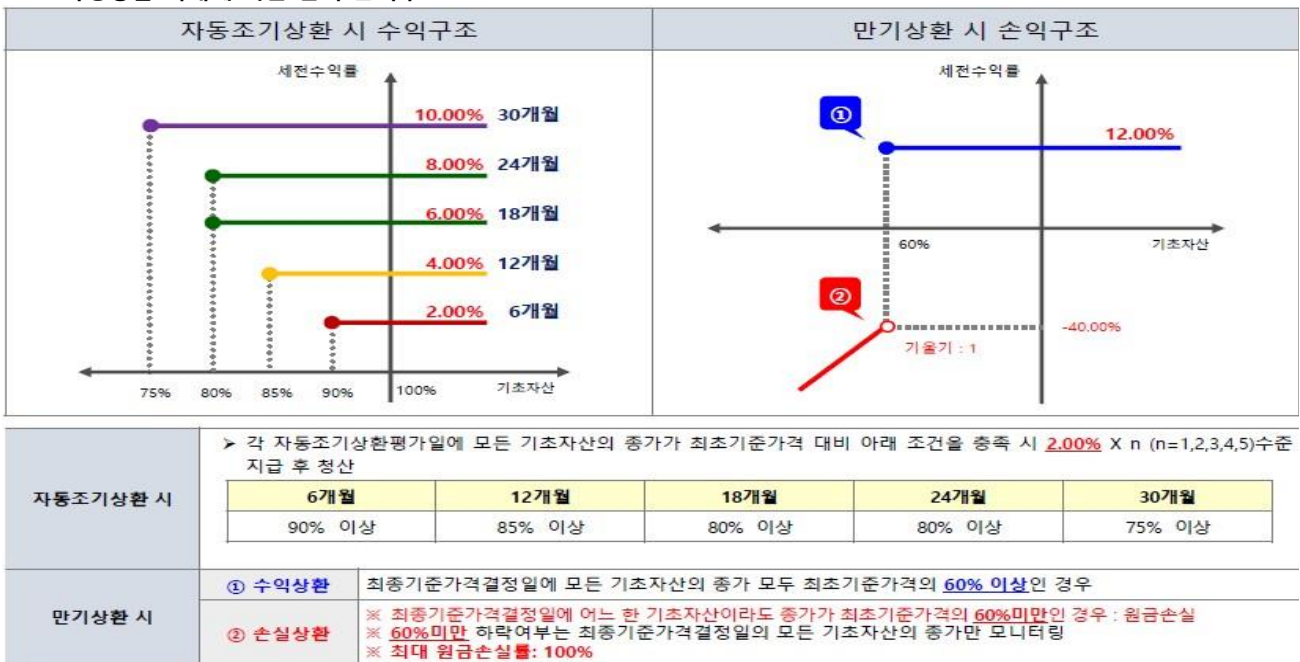
2021-01-11

## 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	3,022		3,022	장외
합계			3,022		3,022	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

156

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

56

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일:

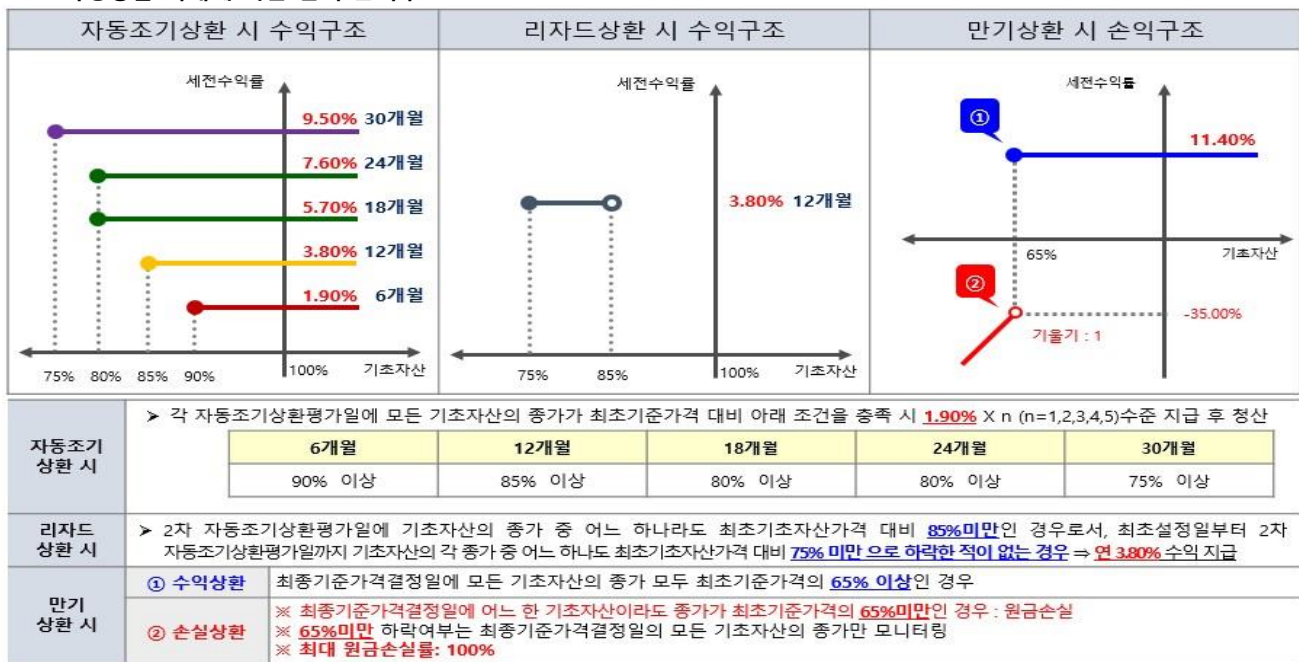
2021-01-11

## 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	4,020		4,020	장외
합계			4,020		4,020	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

219

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

91

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-10호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

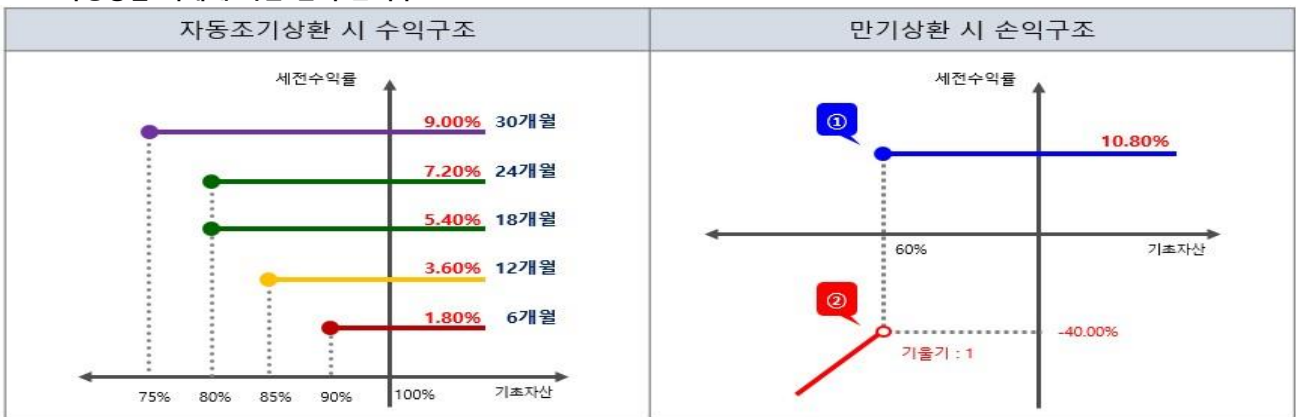
2021-01-11

## 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	373		373	장외
합계			373		373	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.80% 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

만기상환 시

- ① 수익상환: 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 60% 이상인 경우
- ② 손실상환:
  - ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 60%미만인 경우: 원금손실
  - ※ 60%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링
  - ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

20

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)K-8호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일:

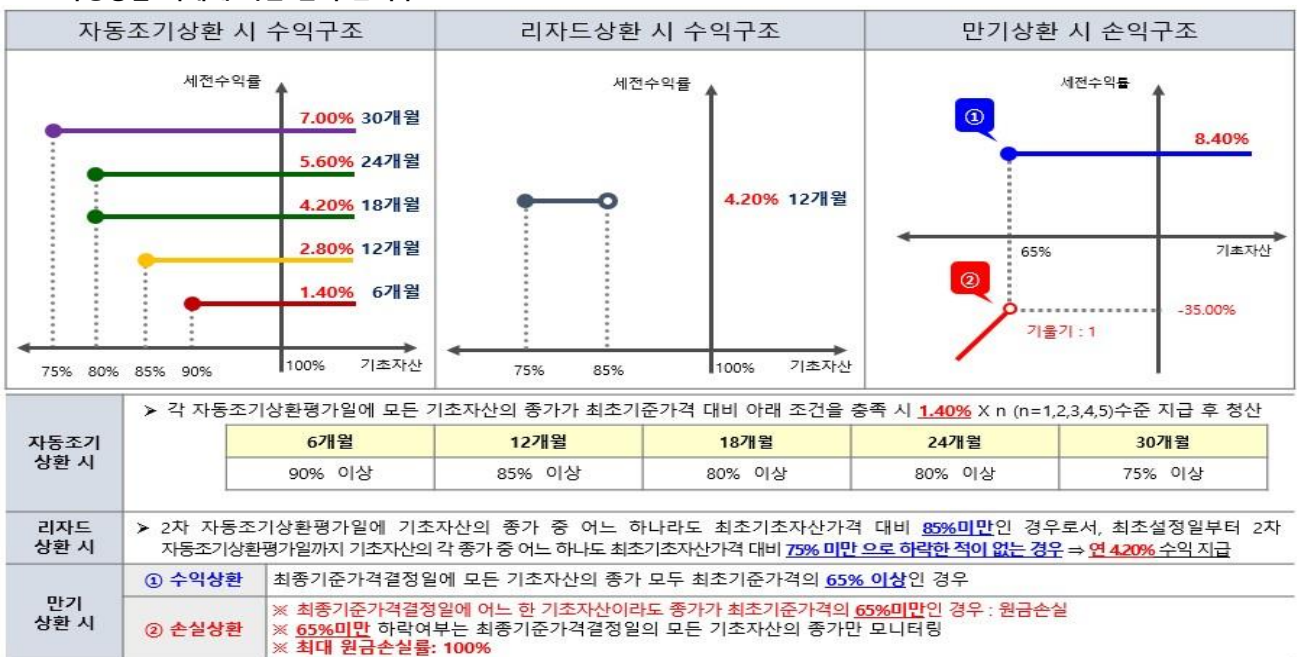
2021-01-11

## 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	622		622	장외
합계			622		622	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

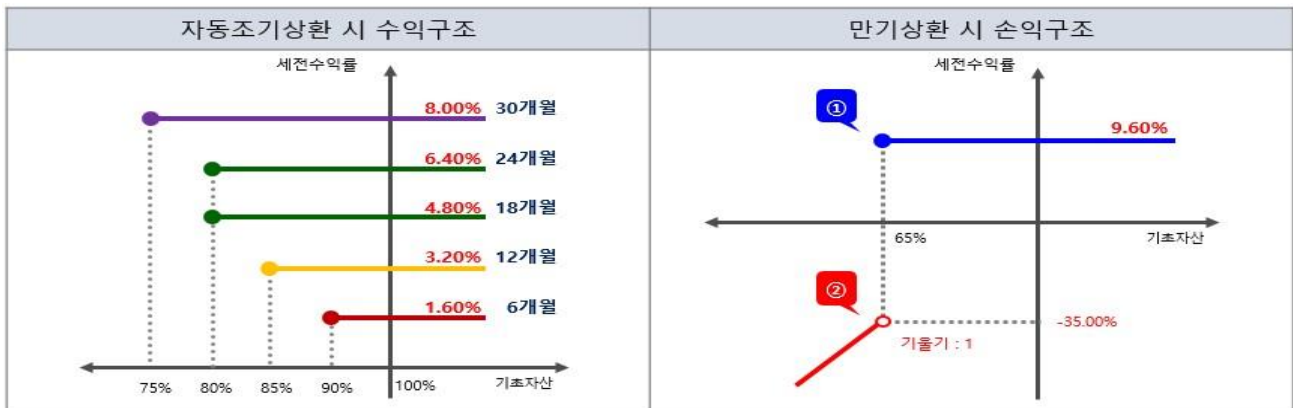
2021-01-11

## 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	1,269		1,269	장외
합계			1,269		1,269	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>1.60%</b> 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
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우			
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>			

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

31

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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	746		746	장외
합계			746		746	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조										
<p>세전수익률</p> <p>7.50% 30개월</p> <p>6.00% 24개월</p> <p>4.50% 18개월</p> <p>3.00% 12개월</p> <p>1.50% 6개월</p> <p>75% 80% 85% 90% 100% 기초자산</p>	<p>세전수익률</p> <p>3.00% 12개월</p> <p>75% 85% 100% 기초자산</p>	<p>세전수익률</p> <p>9.00%</p> <p>65%</p> <p>기초자산</p> <p>-35.00%</p> <p>가율기 : 1</p>										
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.50% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> <th>30개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	30개월	90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상	<p>리 자 드 상 환 시</p> <p>▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.00% 수익 지급</p>	<p>만 기 상 환 시</p> <p>① 수익상환 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월	30개월								
90% 이상	85% 이상	80% 이상	80% 이상	75% 이상								

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

43

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

20

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-12호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

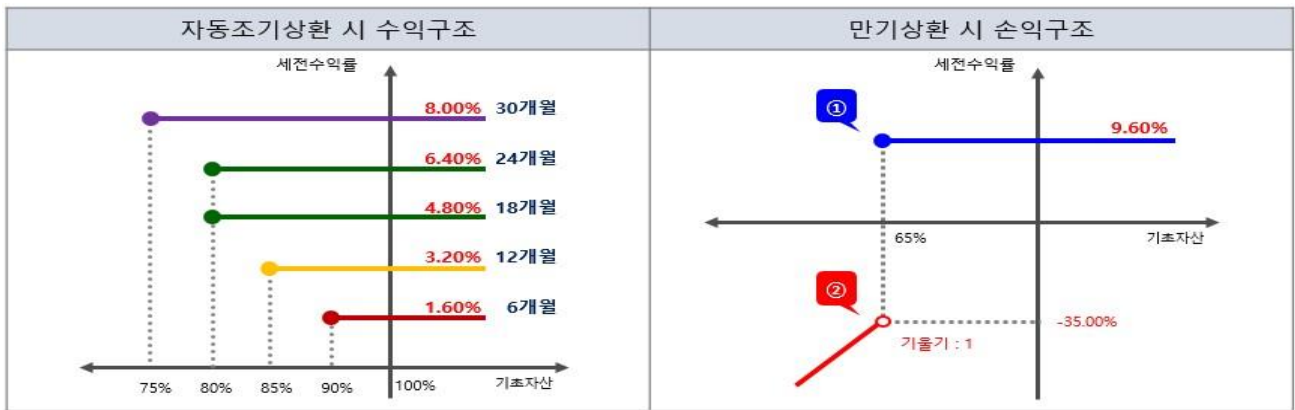
2021-01-11

## 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	1,562		1,562	장외
합계			1,562		1,562	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>1.60%</b> 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
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우			
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>			

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

53

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일:

2021-01-11

## 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	5,039		5,039	장외
합계			5,039		5,039	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.70% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산 <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>				6개월	12개월	18개월	24개월	90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상
6개월	12개월	18개월	24개월									
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상									
리자드상환 시	> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.10% 수익 지급											
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우										
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%										

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

299

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

187

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

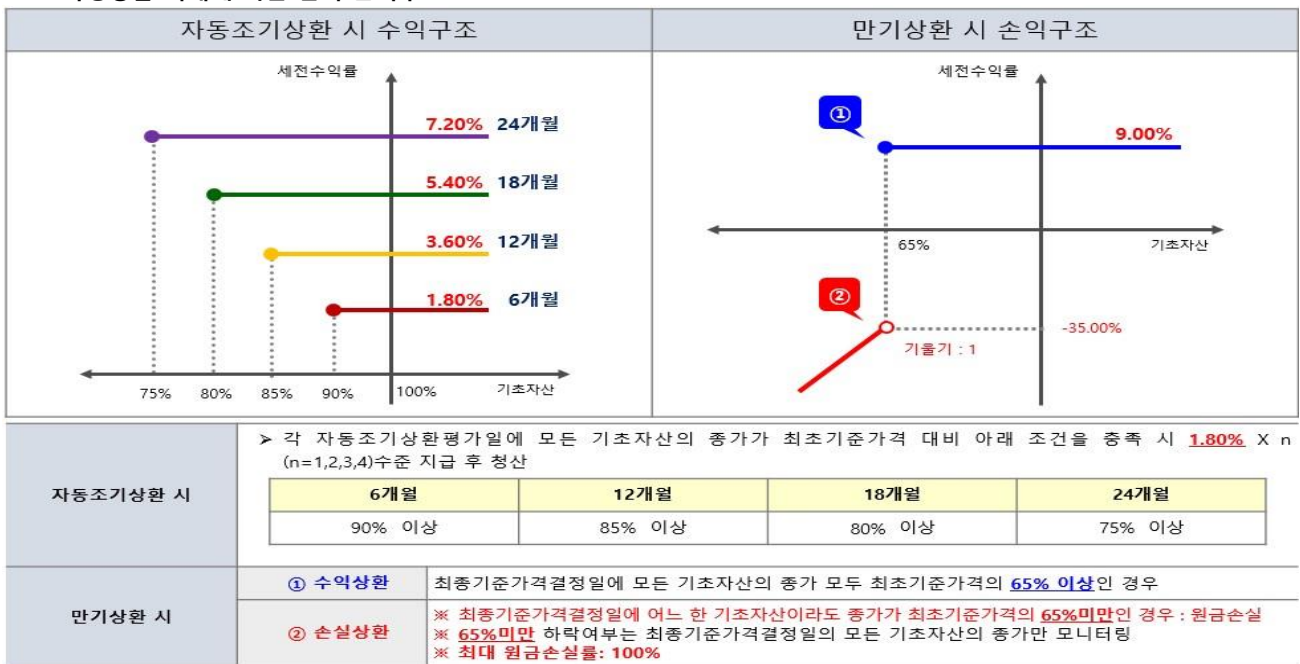
2021-01-11

## 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	5,700		5,700	장외
합계			5,700		5,700	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

317

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

193

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-10호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

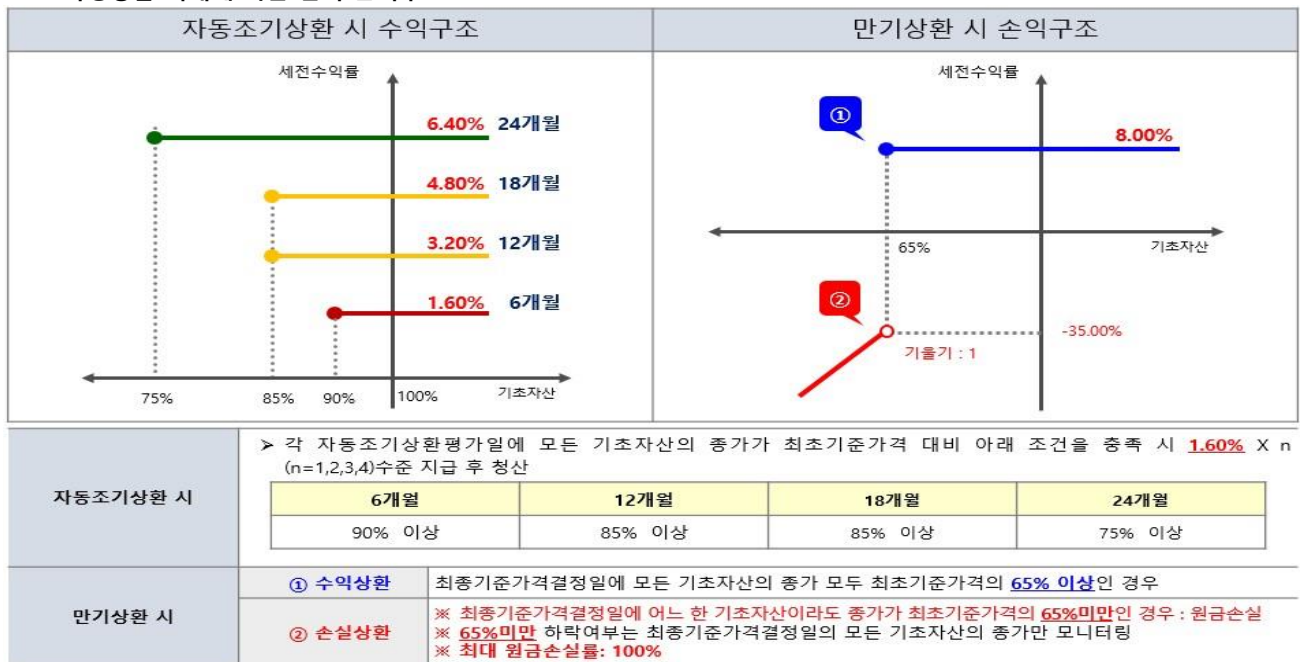
2021-01-11

## 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	489		489	장외
합계			489		489	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

29

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-17호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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	4,247		4,247	장외
합계			4,247		4,247	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상	<p>리 자 드 상 환 시</p> <p>&gt; 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 4.95% 수익 지급</p>	<p>① 수익상환</p> <p>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환</p> <p>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실                  ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링                  ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

246

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

112

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

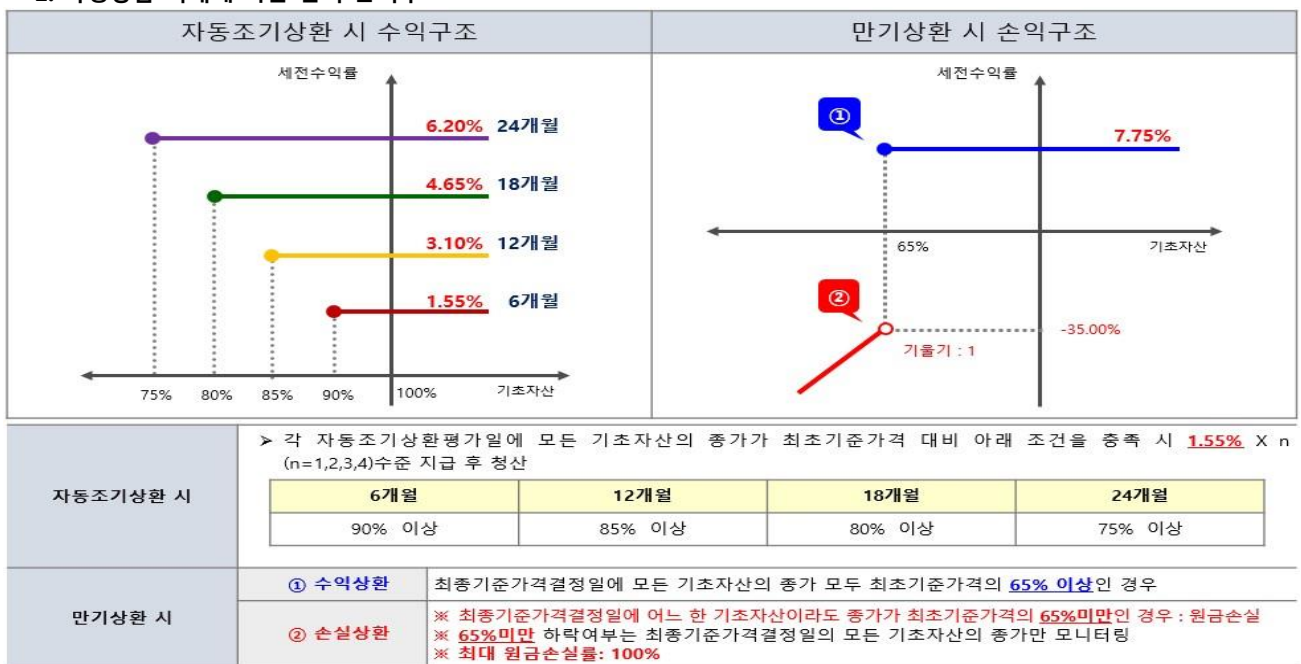
2021-01-11

## 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	592		592	장외
합계			592		592	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-18호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일:

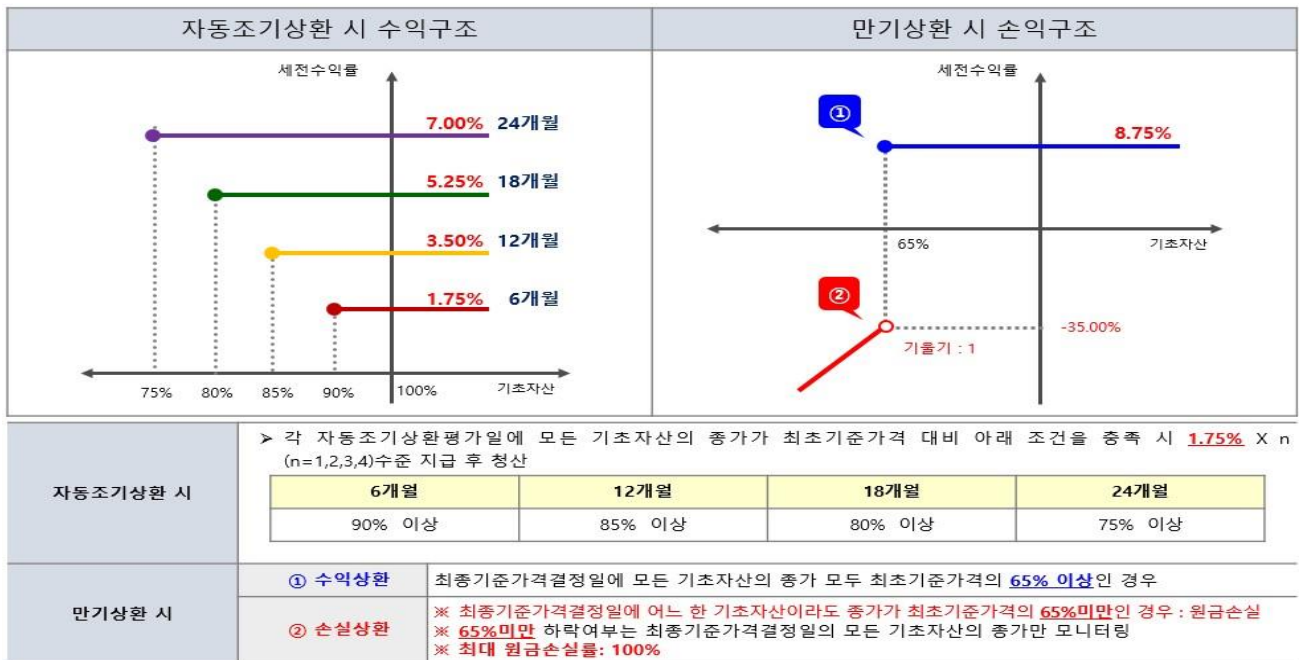
2021-01-11

## 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	5,887		5,887	장외
합계			5,887		5,887	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

325

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

119

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-19호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

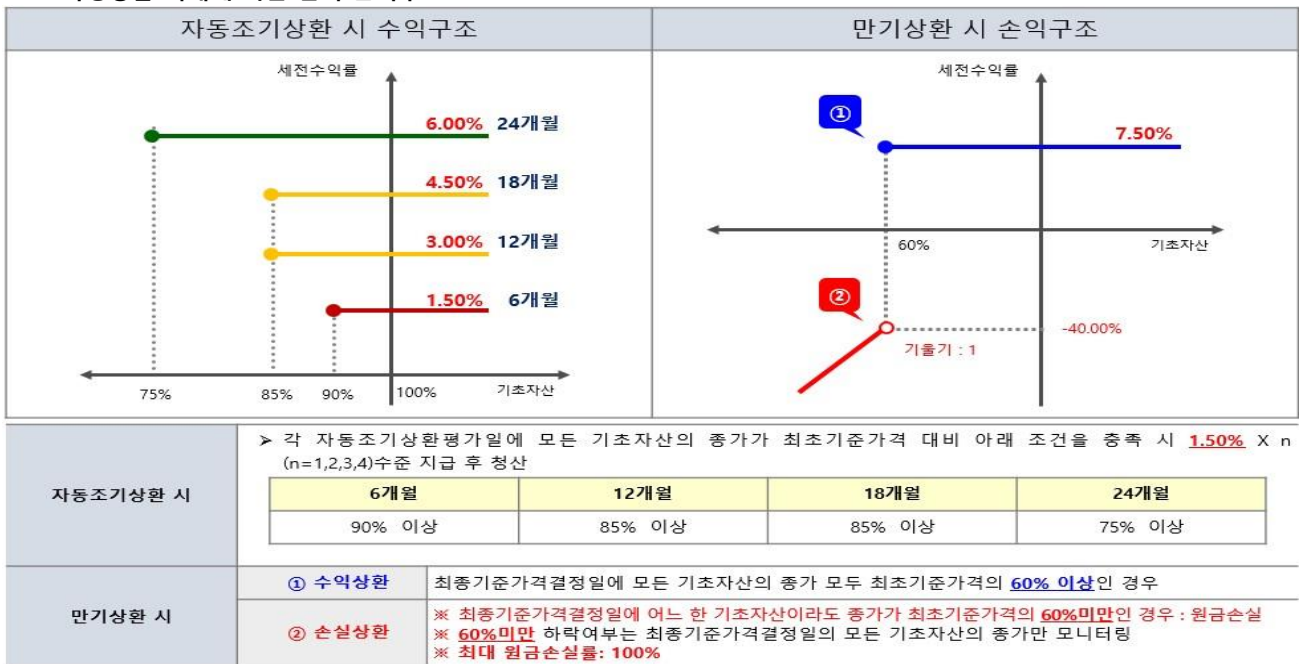
2021-01-11

## 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	2,494		2,494	장외
합계			2,494		2,494	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

134

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

62

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-20호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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	3,198		3,198	장외
합계			3,198		3,198	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상	<p>리 자 드 상 환 시</p> <p>&gt; 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 4.95% 수익 지급</p>	<p>만 기 상 환 시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 : ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

190

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

85

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-21호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

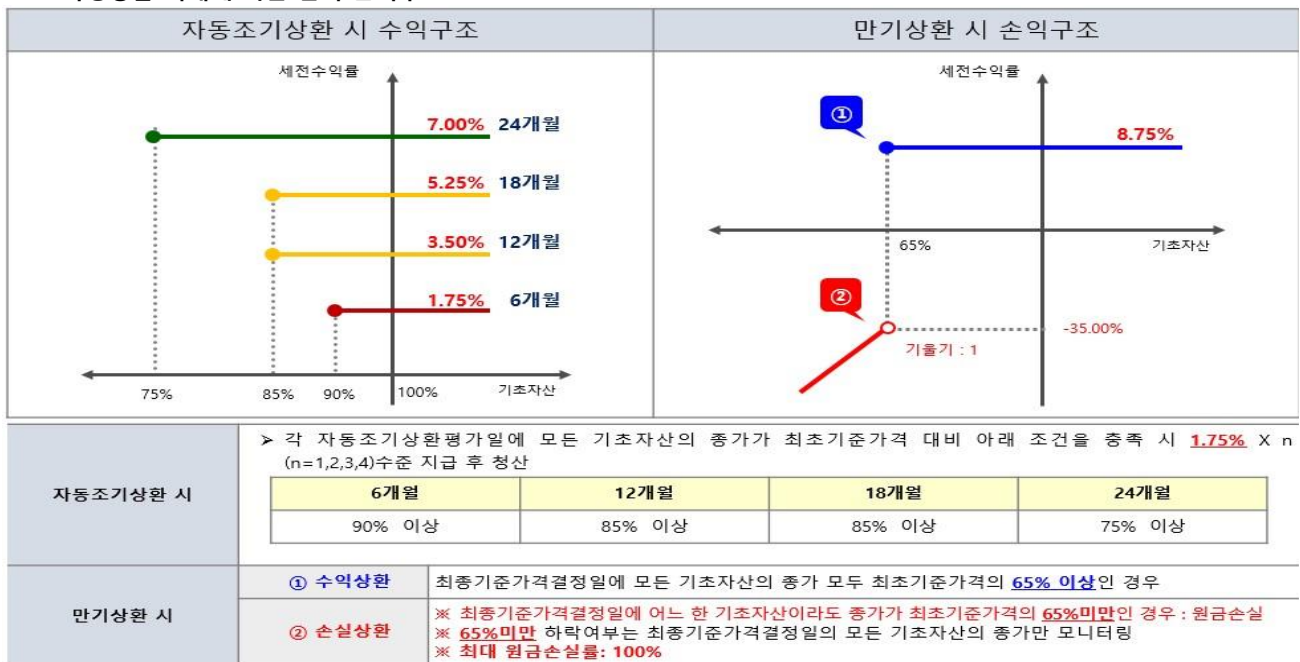
2021-01-11

## 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	1,444		1,444	장외
합계			1,444		1,444	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

82

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

47

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-22호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

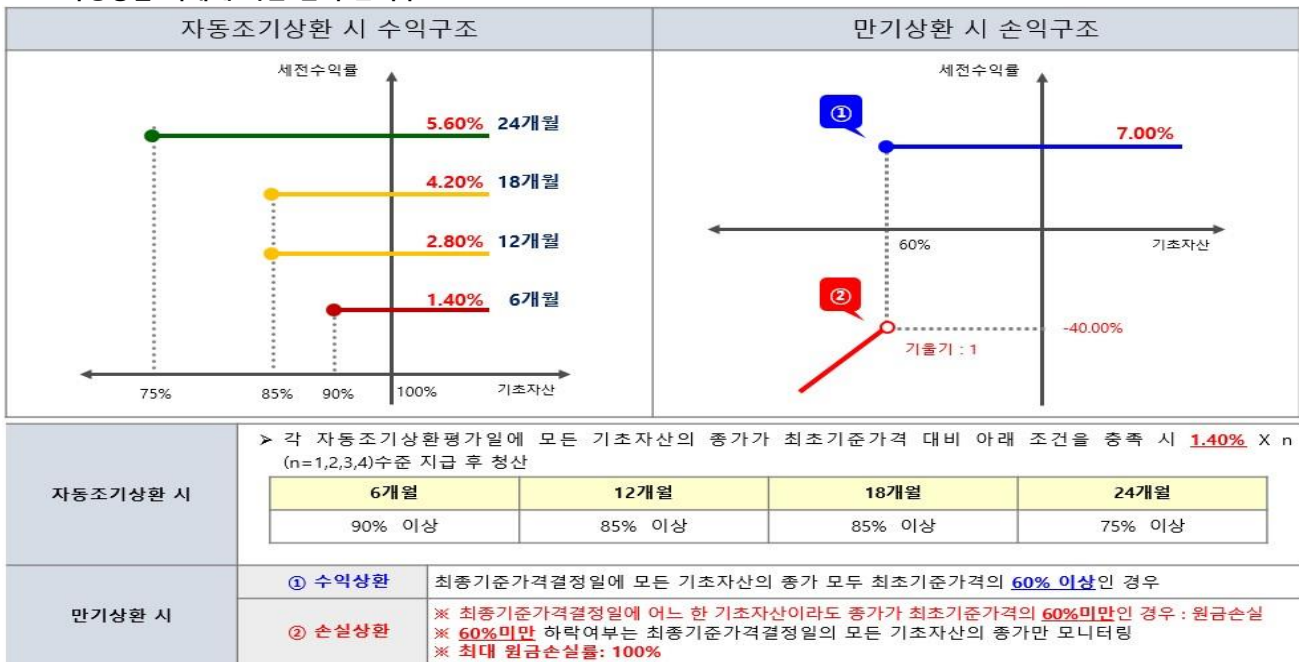
2021-01-11

## 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	216		216	장외
합계			216		216	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-12호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

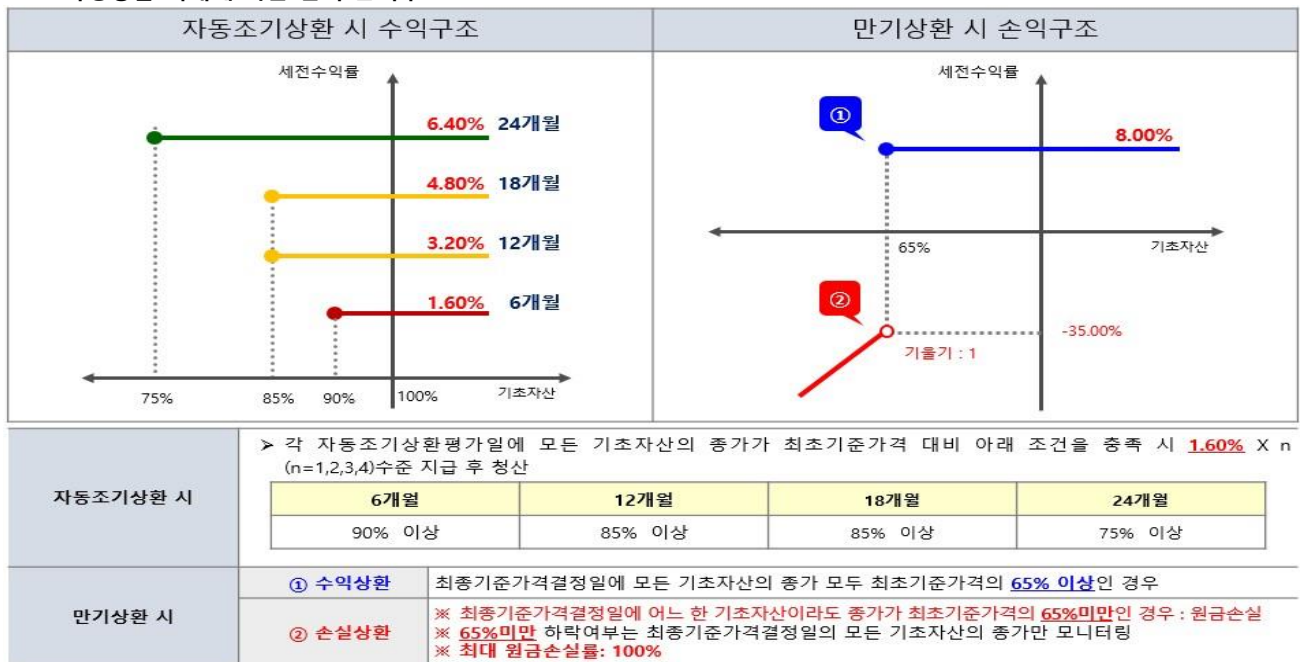
공시일: 2021-01-11

## 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	589		589	장외
합계			589		589	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

19

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-23호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

2021-01-11

## 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	1,943		1,943	장외
합계			1,943		1,943	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상	<p>리 자 드 상 환 시</p> <p>&gt; 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 4.95% 수익 지급</p>	<p>① 수익상환</p> <p>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환</p> <p>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실                  ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링                  ※ 최대 원금손실률: 100%</p>
6개월	12개월	18개월	24개월							
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상							

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

116

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

40

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일: 2021-01-11

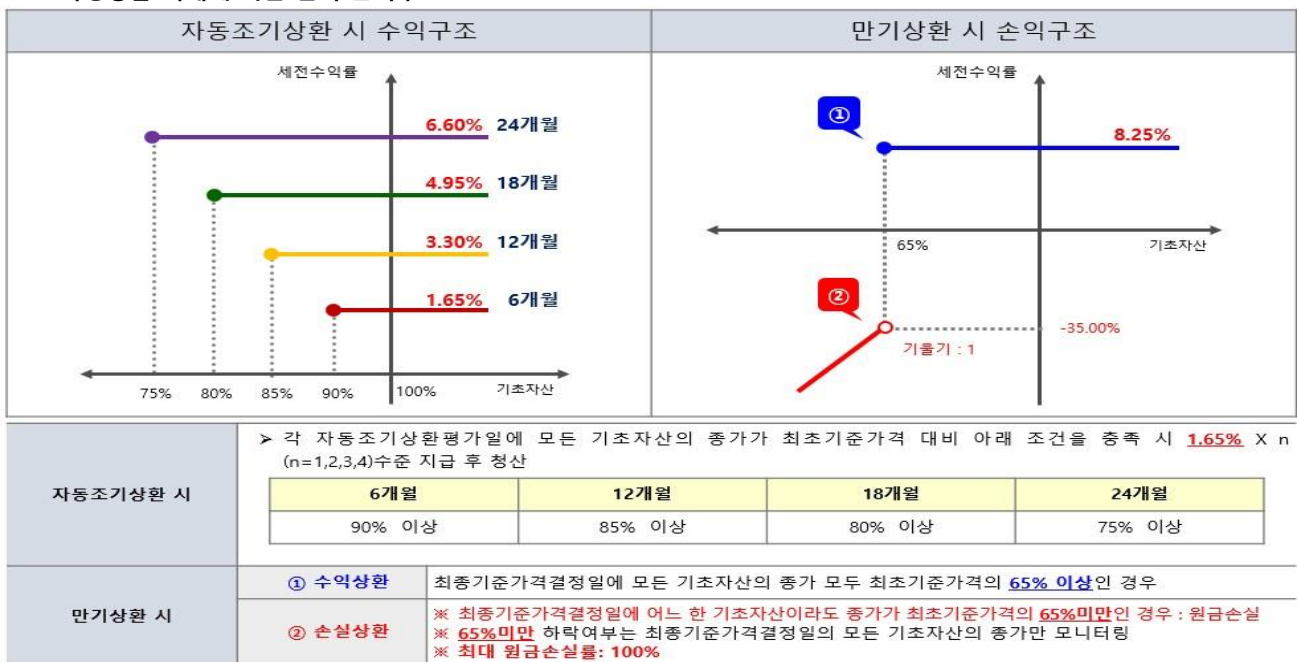
2021-01-11

## 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	747		747	장외
합계			747		747	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

44

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-24호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일:

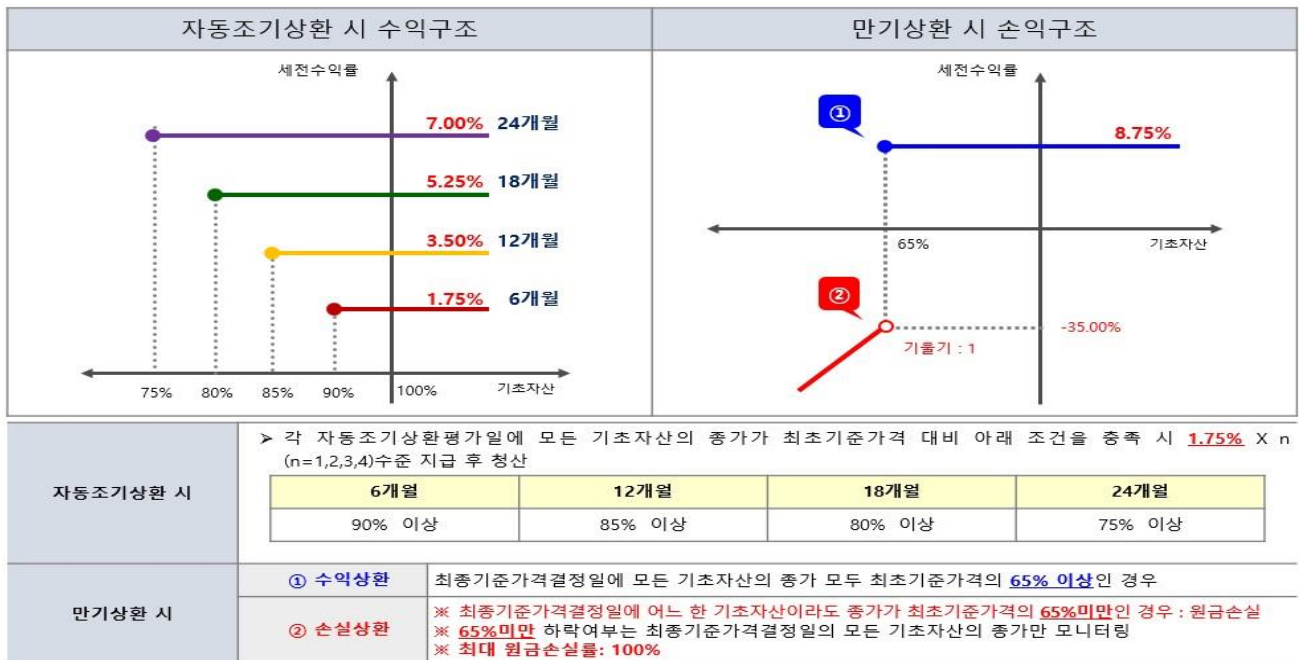
2021-01-11

## 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	1,166		1,166	장외
합계			1,166		1,166	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

29

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-01-08

공시일:

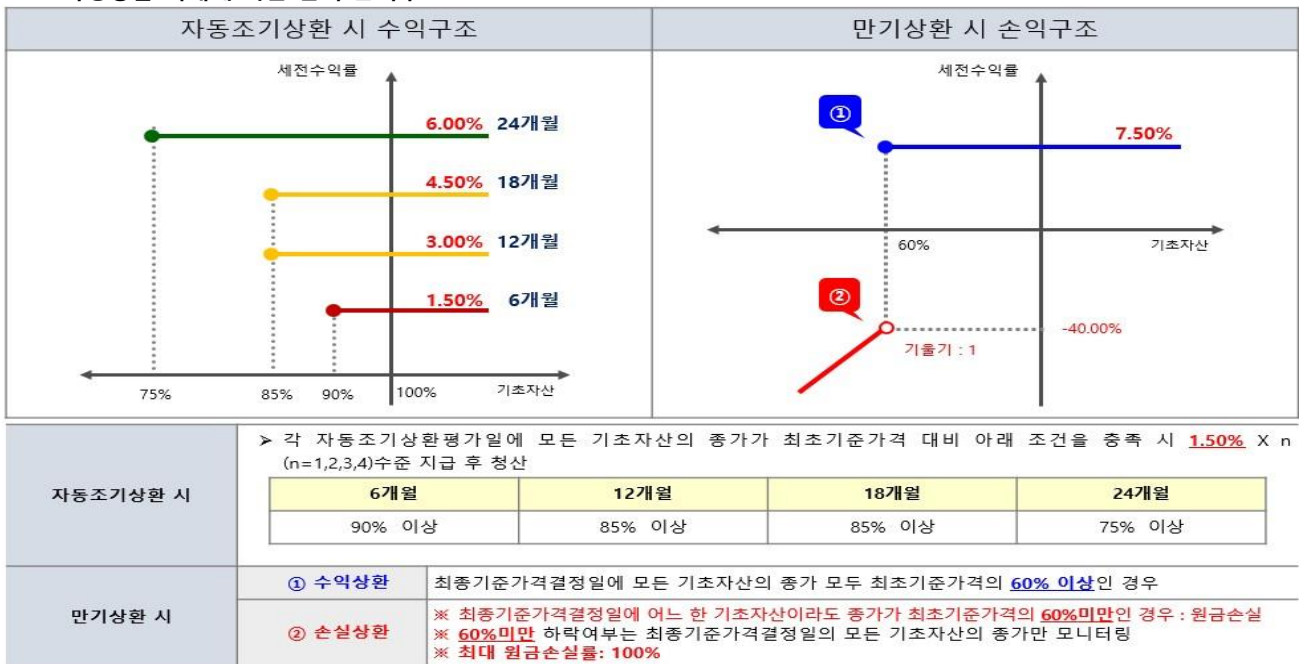
2021-01-11

## 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	604		604	장외
합계			604		604	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16