

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-03-18

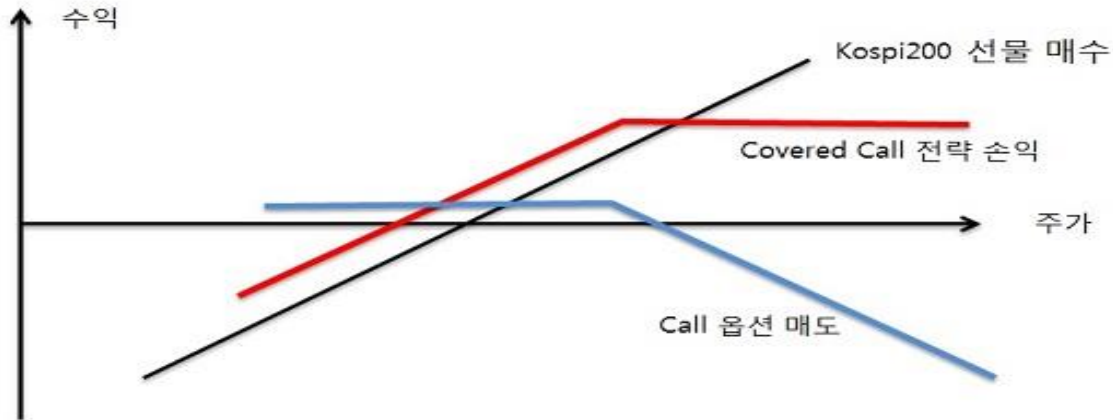
공시일: 2021-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 1,460 | 1,773 | -313 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 3,336 | 0 | 3,336 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 14 | 6,942 | -6,928 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 14 | 3,293 | -3,279 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 89 | 0 | 89 | 장내 |
| 합계 | | | 3,440 | 3,293 | 147 | |

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

344

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

516

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 1,147 | -1,147 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 11,990 | 0 | 11,990 | 장내 |
| 합계 | | | 11,990 | 0 | 11,990 | |

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

959

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,482

펀드명 : BNK3Index지수연계증권KSE-9호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 \Rightarrow 1.50% \times 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

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSK-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

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 $2.25\% \times n$ (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

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSK-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

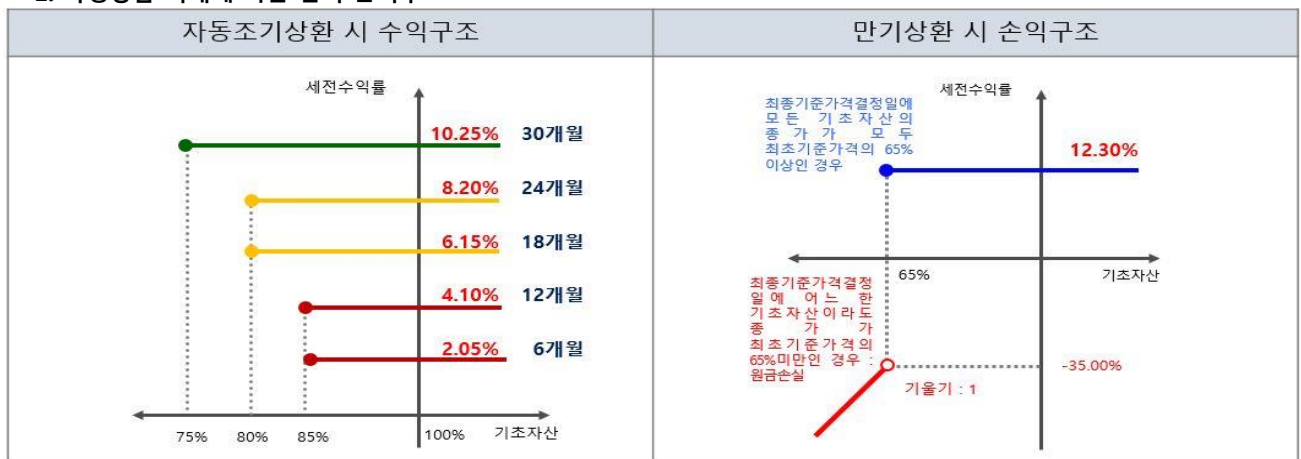
2021-03-19

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

4

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

2021-03-19

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 $1.55\% \times n$ (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

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK환헤지지원화플러스지수연계증권HSK-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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

35

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK환헤지지원화플러스지수연계증권HSK-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

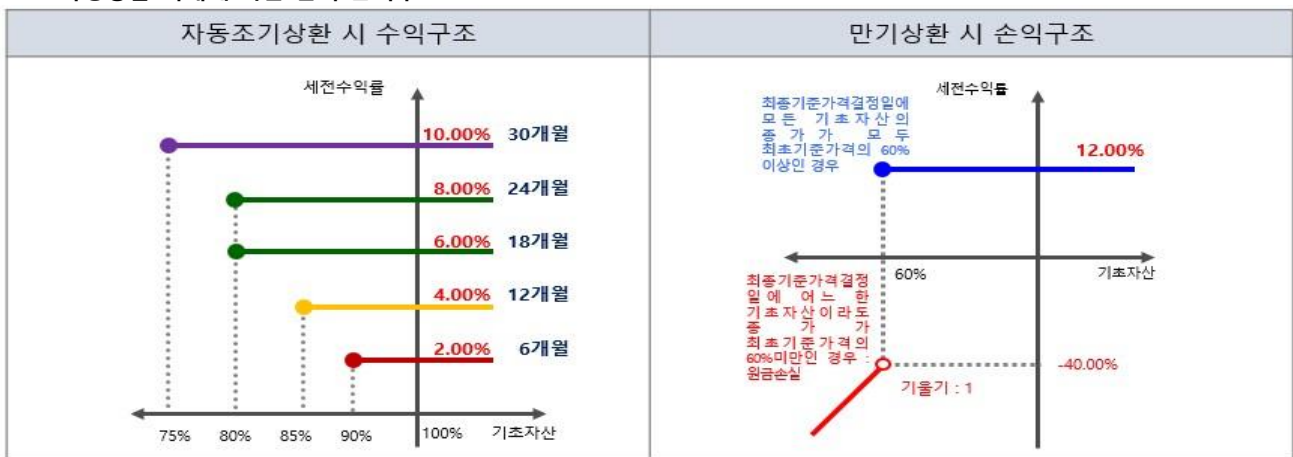
2021-03-19

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 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 ⇒ 2.00% 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

28

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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

3

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK리자드환헤지원화플러스지수연계증권HSN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 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 ※ 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

6

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

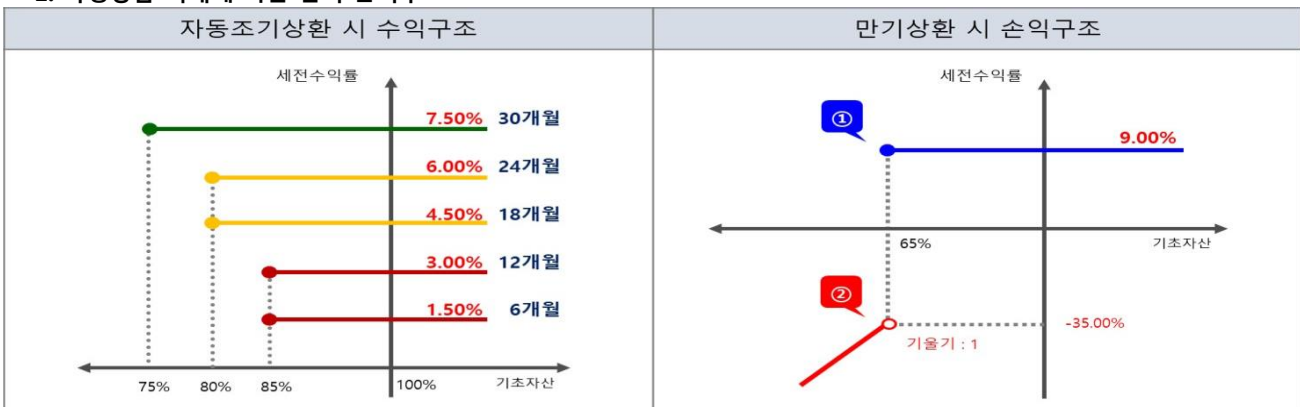
2021-03-19

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

2

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

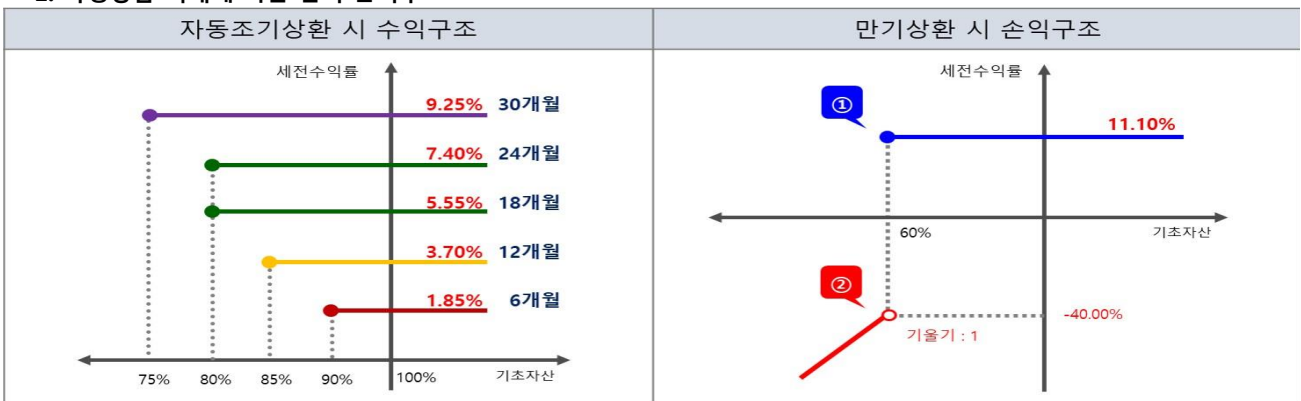
2021-03-19

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 |

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

38

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

펀드명 : BNK리자드환헤지원화플러스지수연계증권HSN-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

2021-03-19

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 | 3,818 | | 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"> ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% |
| 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 | 30개월 | | | | | | | | |
| 90% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | | | | | | | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

110

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

2021-03-19

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 | 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 |

| 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

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

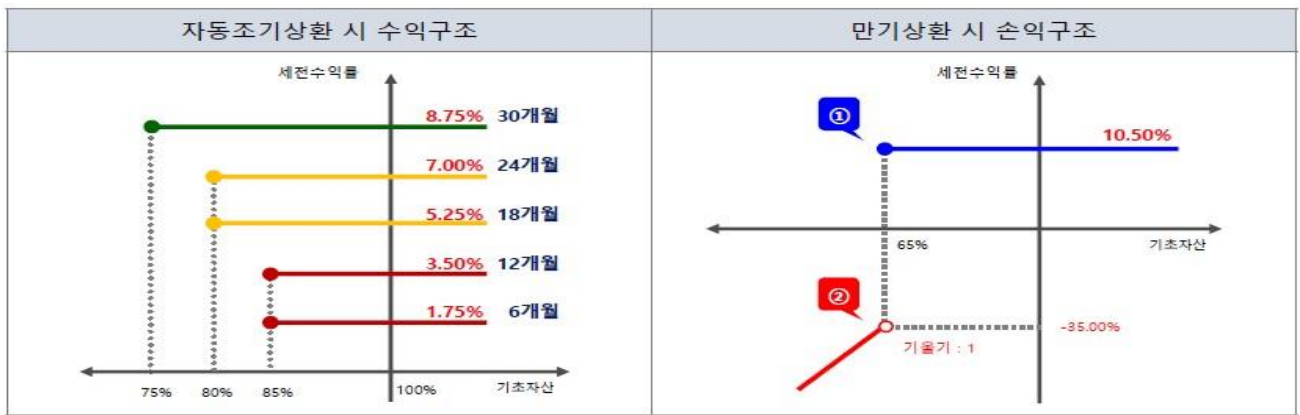
2021-03-19

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 | 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

79

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-8호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

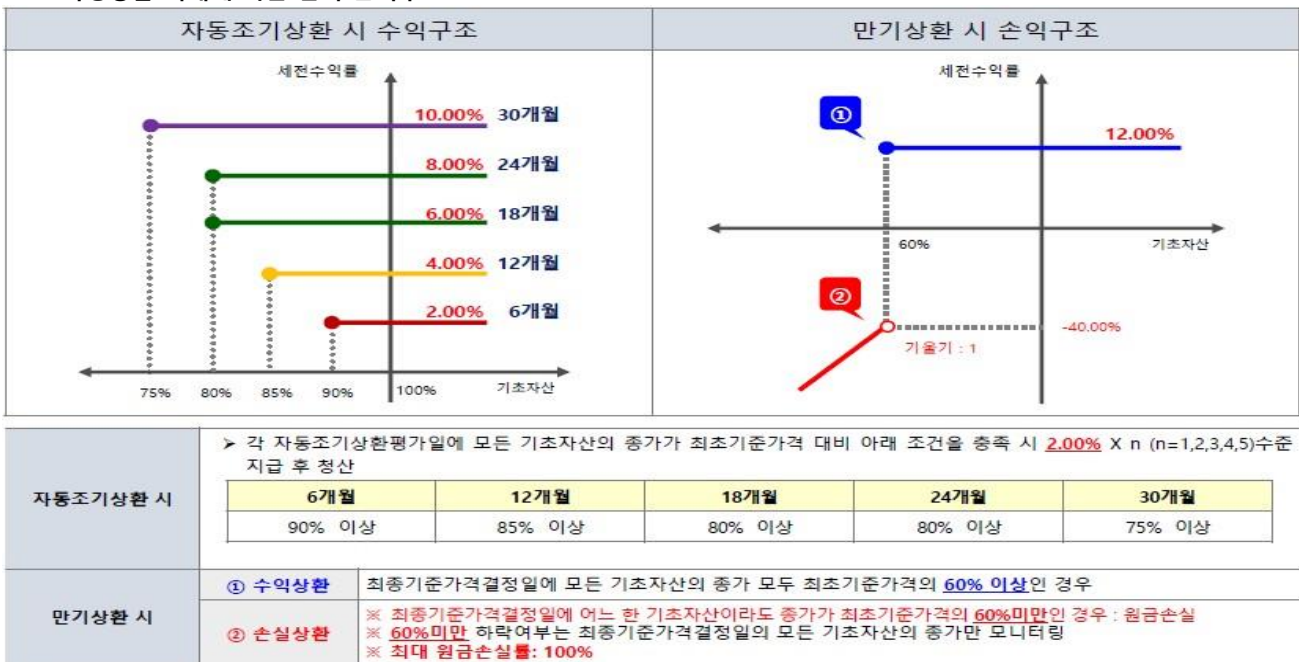
2021-03-19

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 | 3,022 | | 3,022 | 장외 |
| 합계 | | | 3,022 | | 3,022 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

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

기준일 : 2021-03-18

공시일:

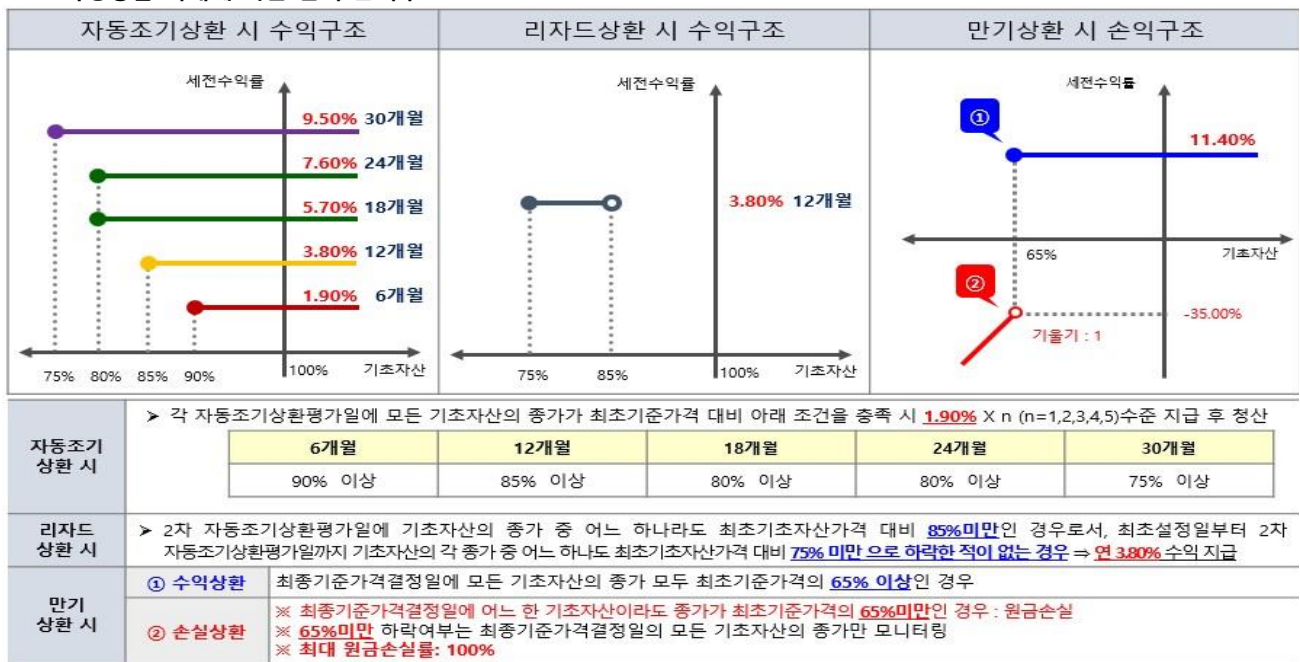
2021-03-19

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 | 4,020 | | 4,020 | 장외 |
| 합계 | | | 4,020 | | 4,020 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-10호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 373 | | 373 | 장외 |
| 합계 | | | 373 | | 373 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 $1.80\% \times n$ (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%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

기준일 : 2021-03-18

공시일:

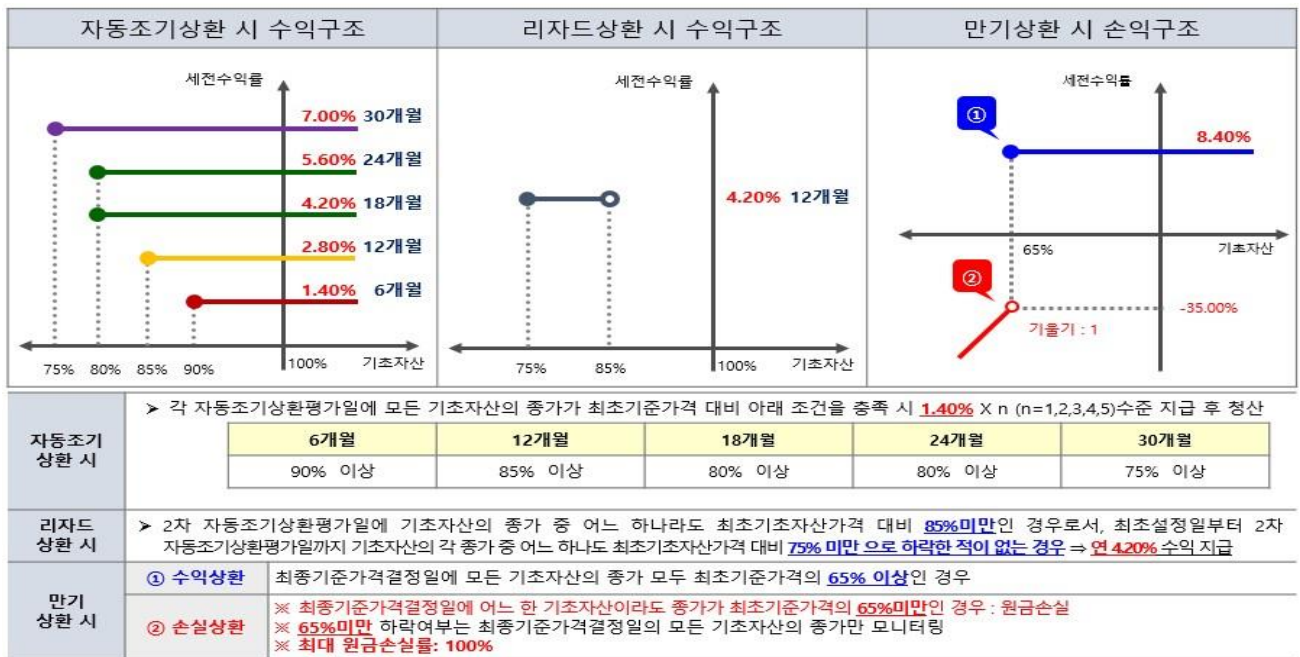
2021-03-19

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 | 622 | | 622 | 장외 |
| 합계 | | | 622 | | 622 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-11호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

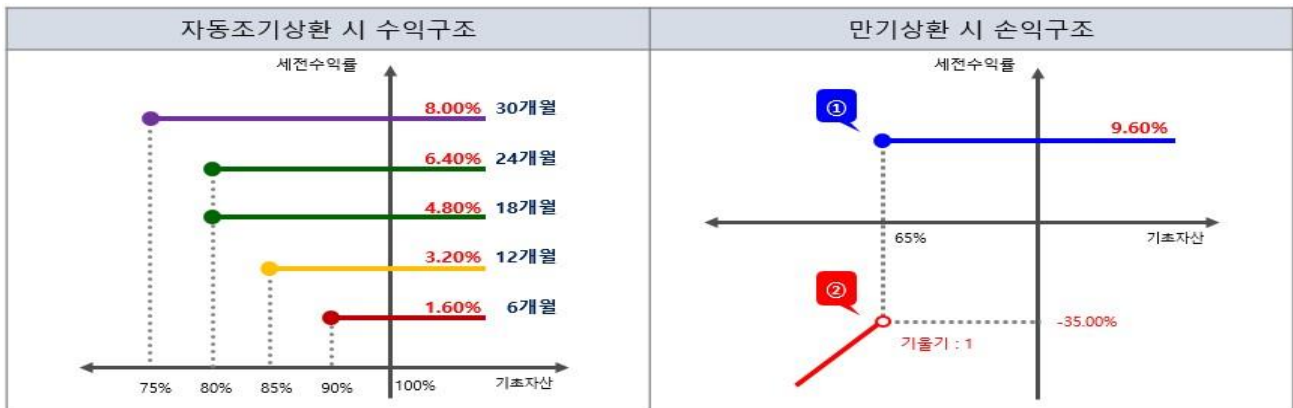
2021-03-19

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 | 1,269 | | 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 **1.60%** 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 **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

46

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

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

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 746 | | 746 | 장외 |
| 합계 | | | 746 | | 746 | |

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 $1.50\% \times n$ (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

30

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-12호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

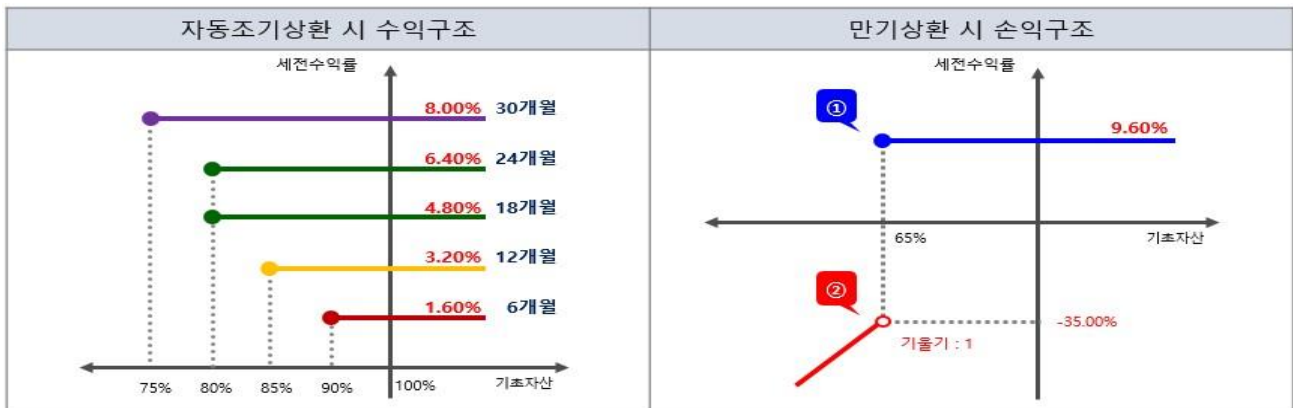
2021-03-19

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 | 1,562 | | 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 1.60% 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 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

65

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11

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

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 5,039 | | 5,039 | 장외 |
| 합계 | | | 5,039 | | 5,039 | |

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 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.70% 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> > 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 </p> | <p>만 기 상 환 시</p> <p> 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% </p> |
| 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 | | | | | | | |
| 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | | | | | | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

215

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

42

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

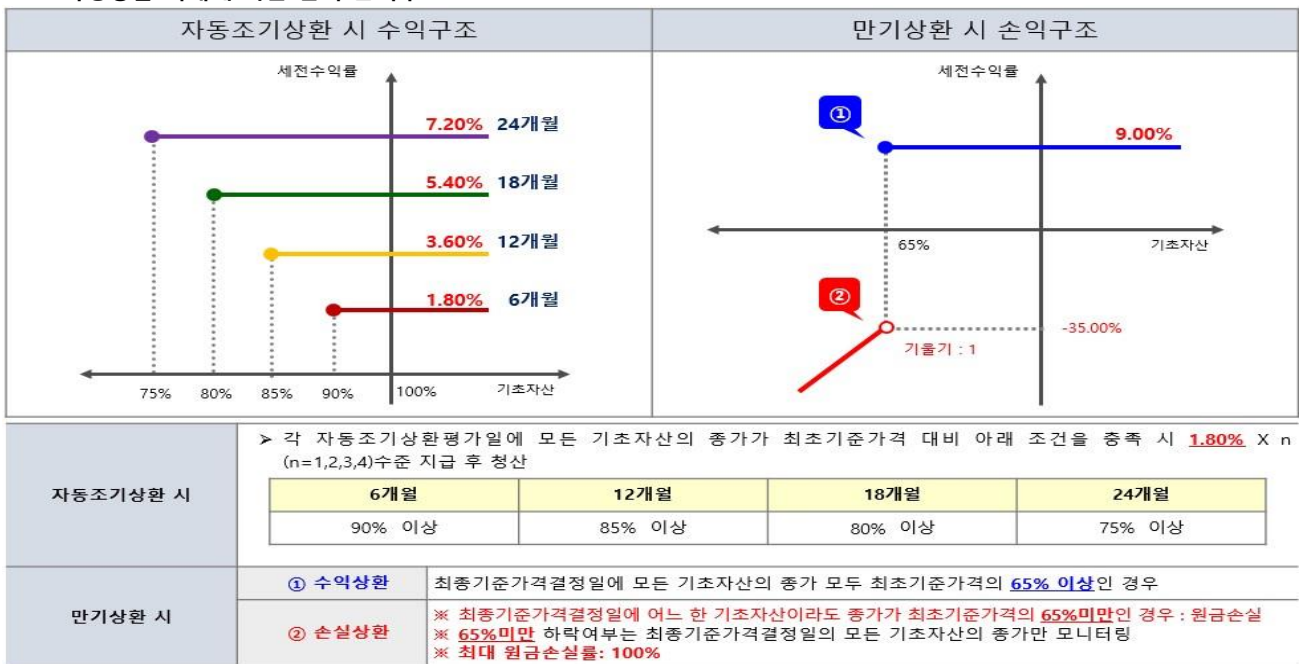
2021-03-19

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 | 5,679 | | 5,679 | 장외 |
| 합계 | | | 5,679 | | 5,679 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

241

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

72

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-10호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

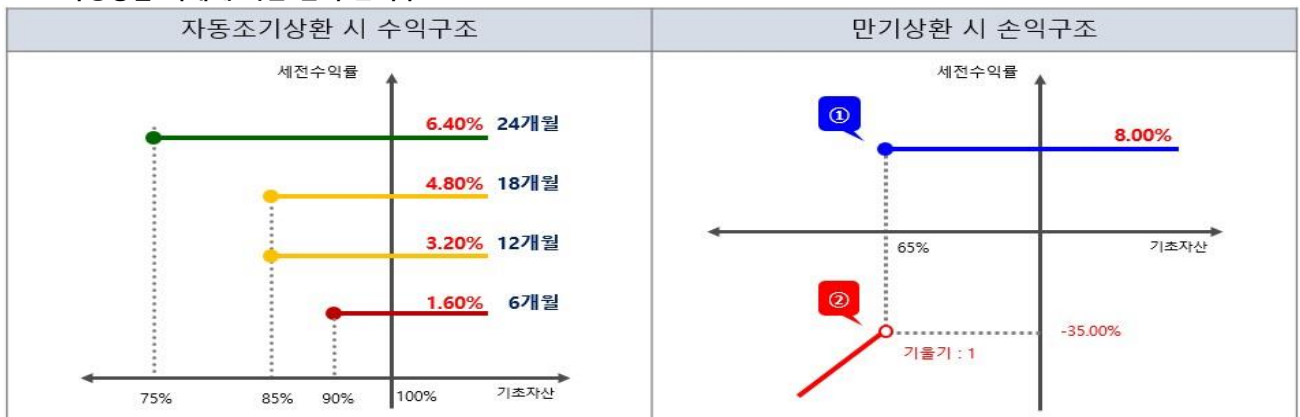
2021-03-19

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 | 489 | | 489 | 장외 |
| 합계 | | | 489 | | 489 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.60% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

| 자동조기상환 시 | 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 |
|----------|--------|--------|--------|--------|
| | 90% 이상 | 85% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 |

| 만기상환 시 | ① 수익상환 | ② 손실상환 |
|--------|--|--|
| | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우 | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

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

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 4,245 | | 4,245 | 장외 |
| 합계 | | | 4,245 | | 4,245 | |

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 1.65% 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>> 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

189

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

33

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

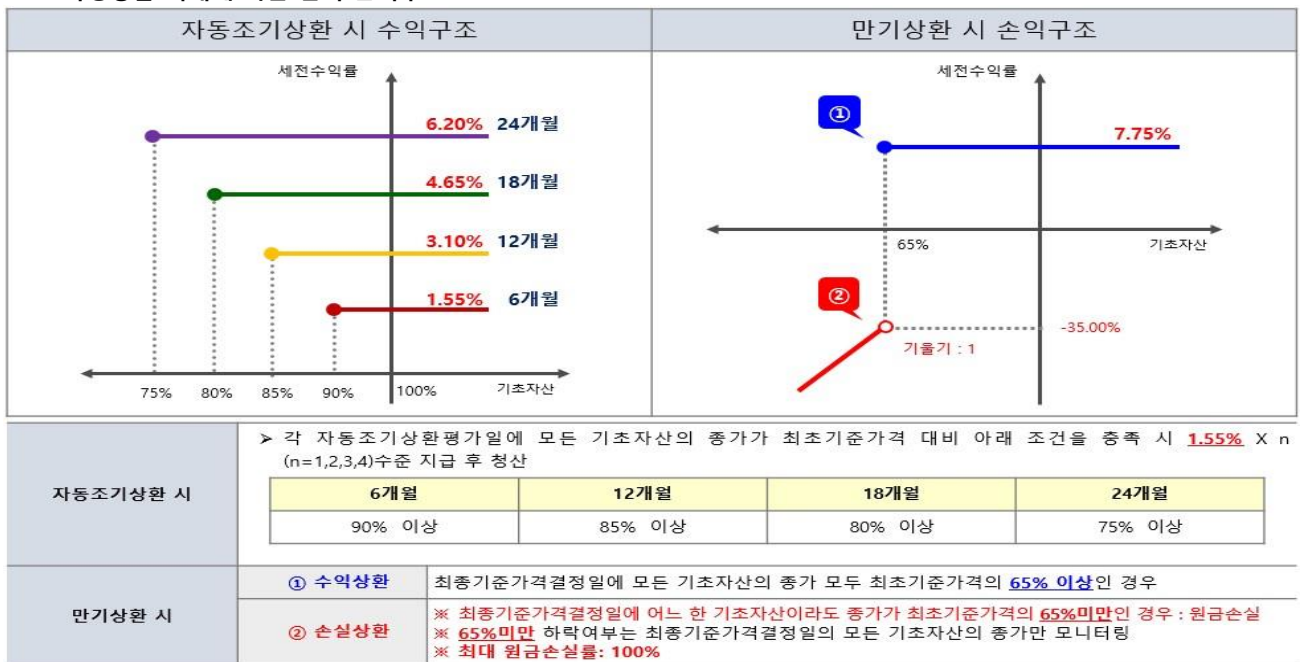
2021-03-19

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 | 592 | | 592 | 장외 |
| 합계 | | | 592 | | 592 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

27

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-18호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

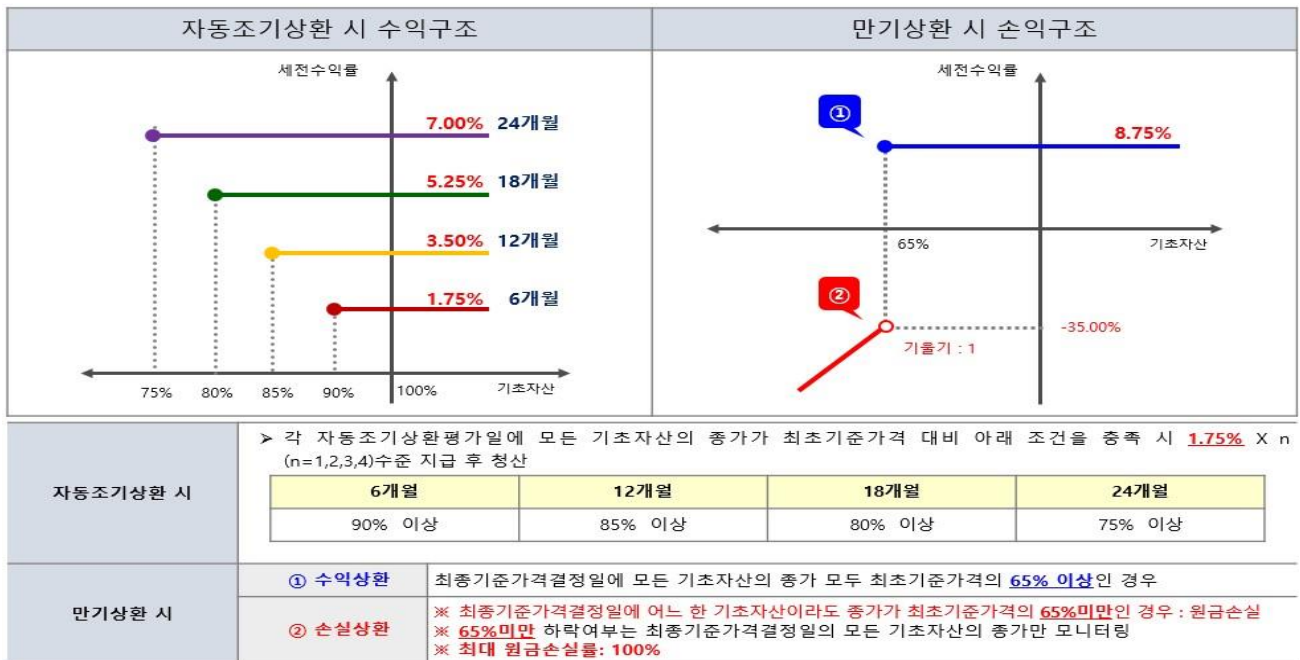
2021-03-19

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 | 5,887 | | 5,887 | 장외 |
| 합계 | | | 5,887 | | 5,887 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

246

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

45

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-19호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

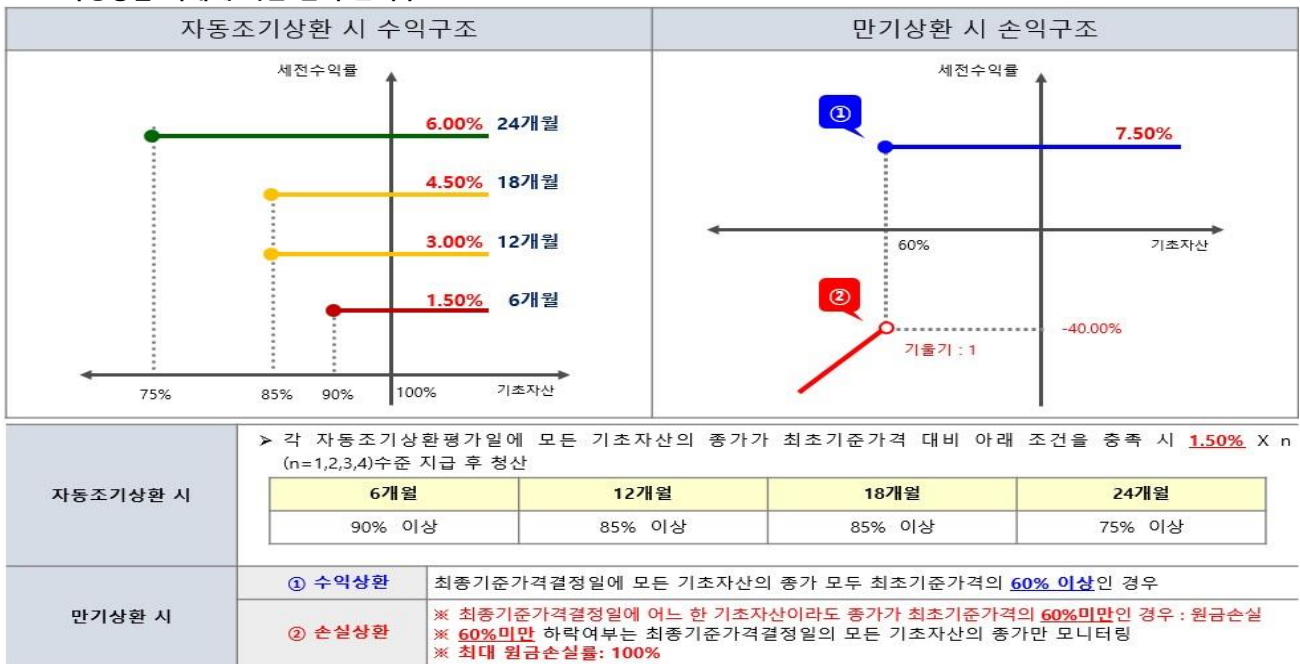
2021-03-19

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 | 2,494 | | 2,494 | 장외 |
| 합계 | | | 2,494 | | 2,494 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

101

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22

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

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 3,198 | | 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>> 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>> 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

152

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

29

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-21호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

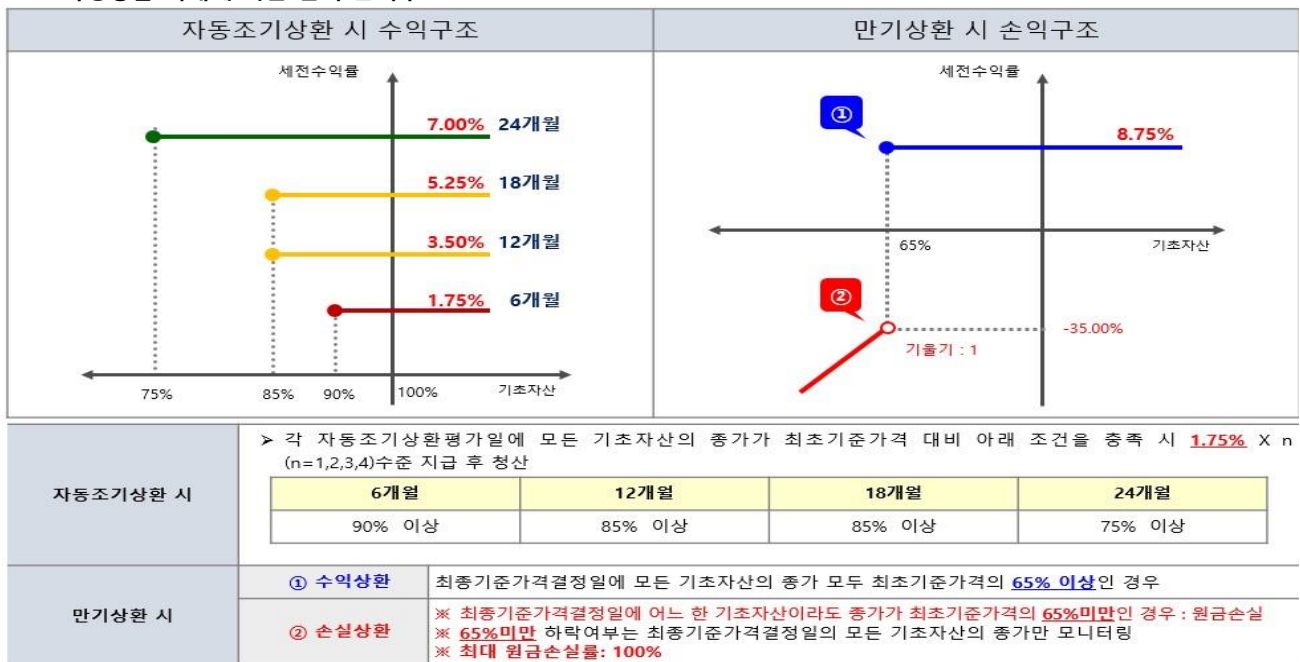
공시일: 2021-03-19

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 | 1,444 | | 1,444 | 장외 |
| 합계 | | | 1,444 | | 1,444 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-22호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

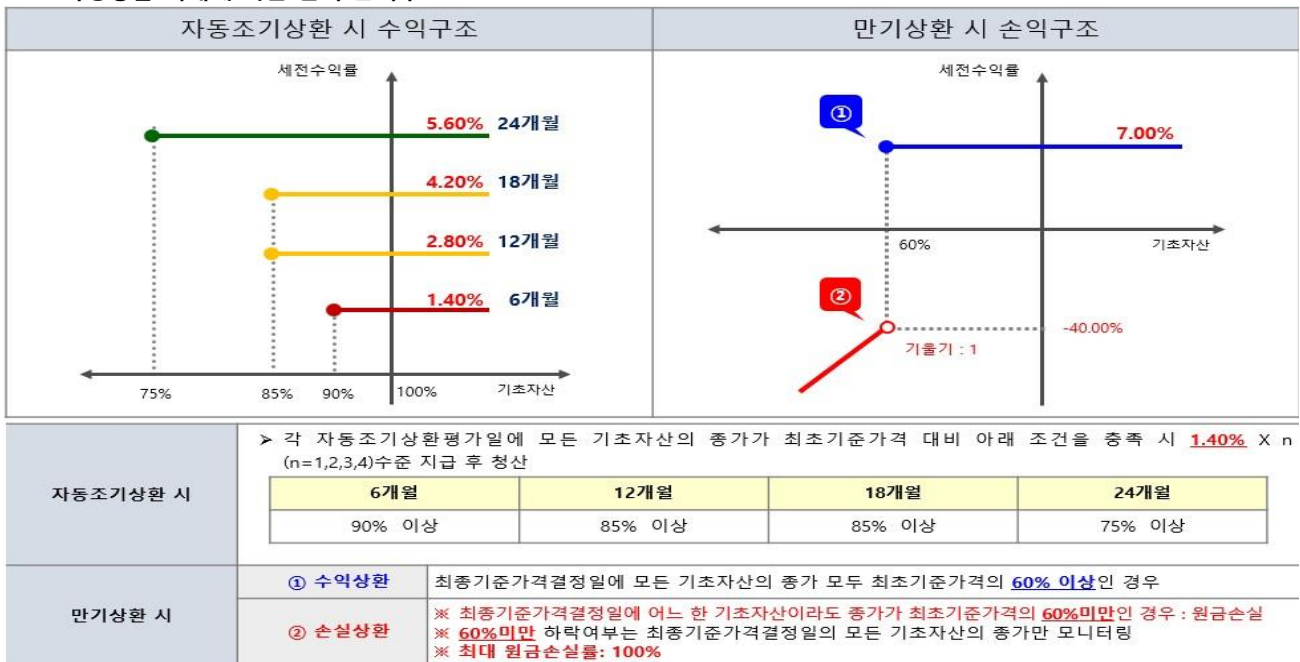
2021-03-19

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 | 216 | | 216 | 장외 |
| 합계 | | | 216 | | 216 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-12호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

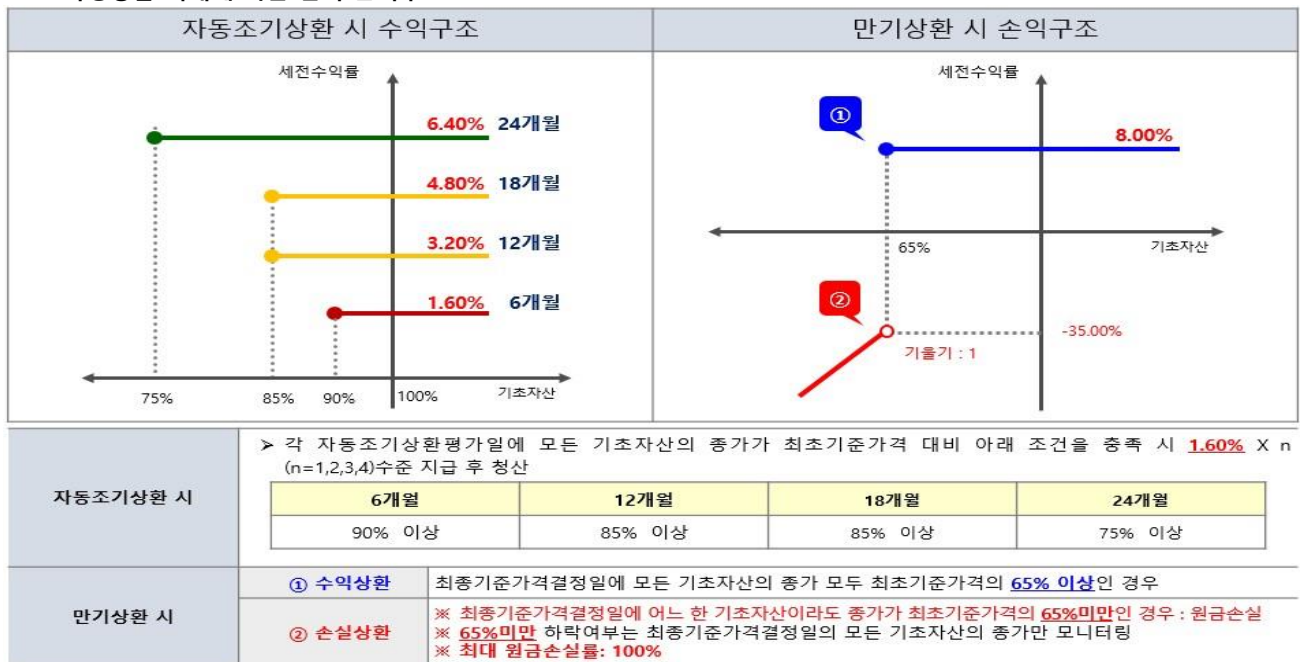
2021-03-19

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 | 589 | | 589 | 장외 |
| 합계 | | | 589 | | 589 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

30

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13

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

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 1,941 | | 1,941 | 장외 |
| 합계 | | | 1,941 | | 1,941 | |

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 1.65% 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>> 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

97

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

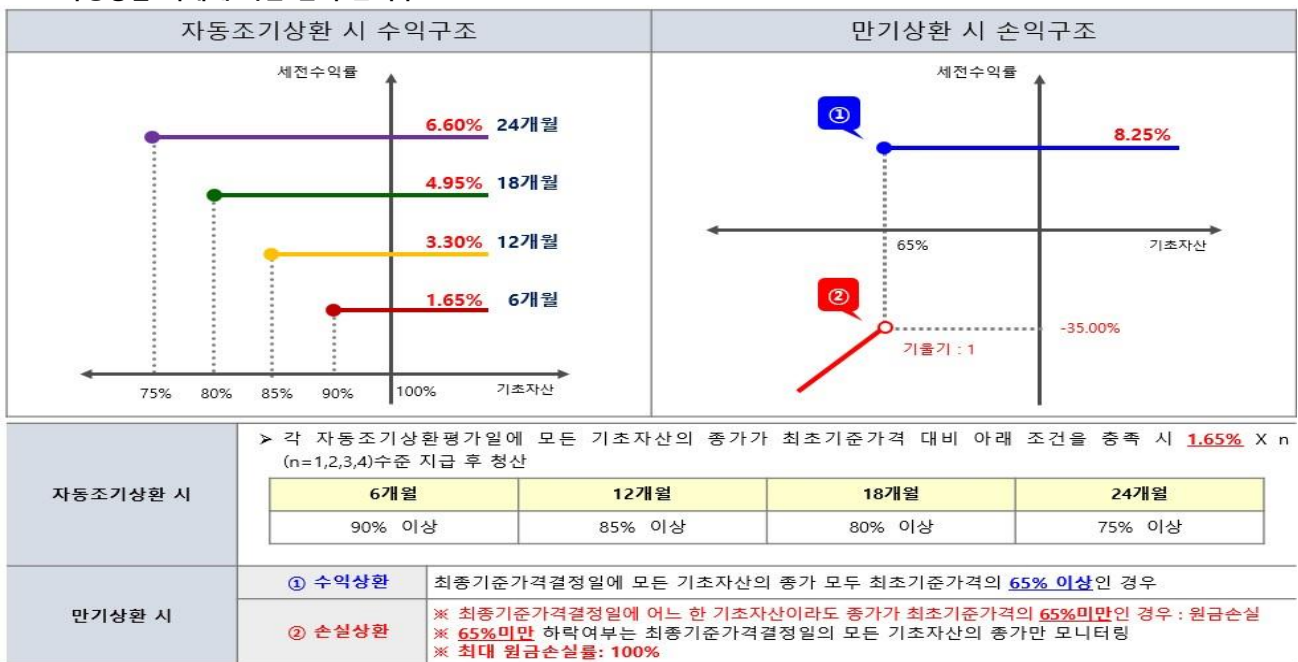
2021-03-19

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 | 747 | | 747 | 장외 |
| 합계 | | | 747 | | 747 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

24

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-24호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

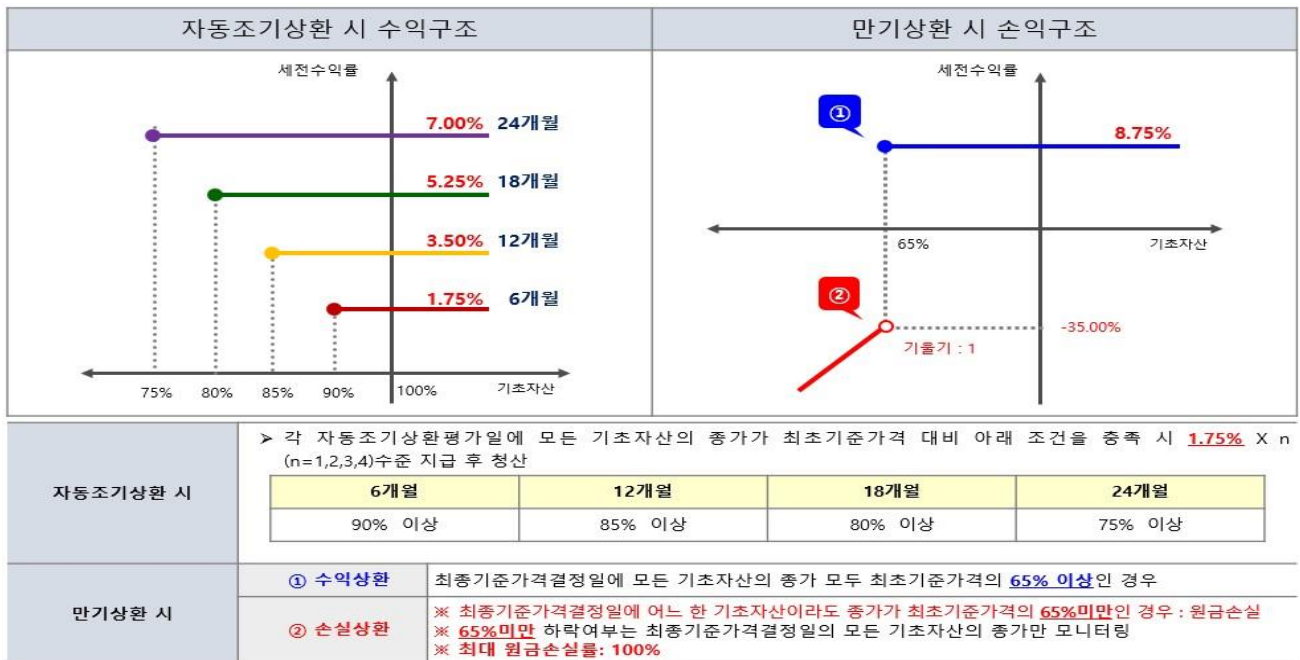
2021-03-19

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 | 1,166 | | 1,166 | 장외 |
| 합계 | | | 1,166 | | 1,166 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

57

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

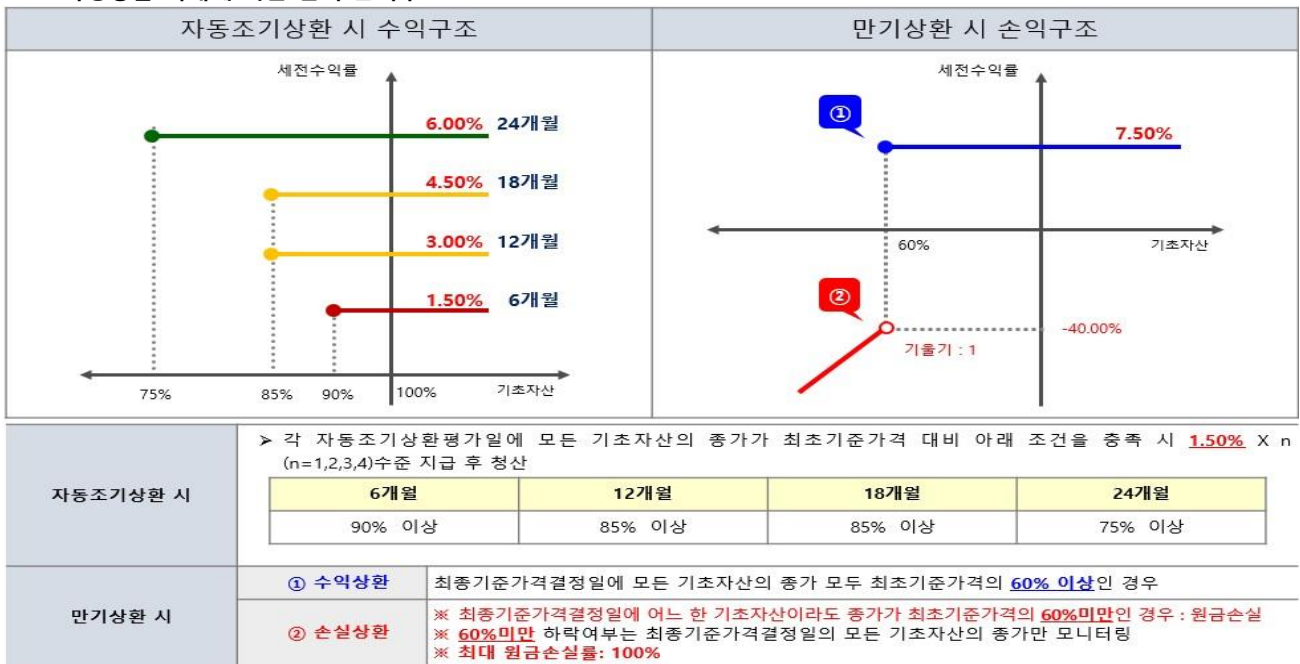
2021-03-19

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 | 604 | | 604 | 장외 |
| 합계 | | | 604 | | 604 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-26호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

2021-03-19

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 | 2,040 | | 2,040 | 장외 |
| 합계 | | | 2,040 | | 2,040 | |

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 1.65% 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>> 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

109

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

47

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

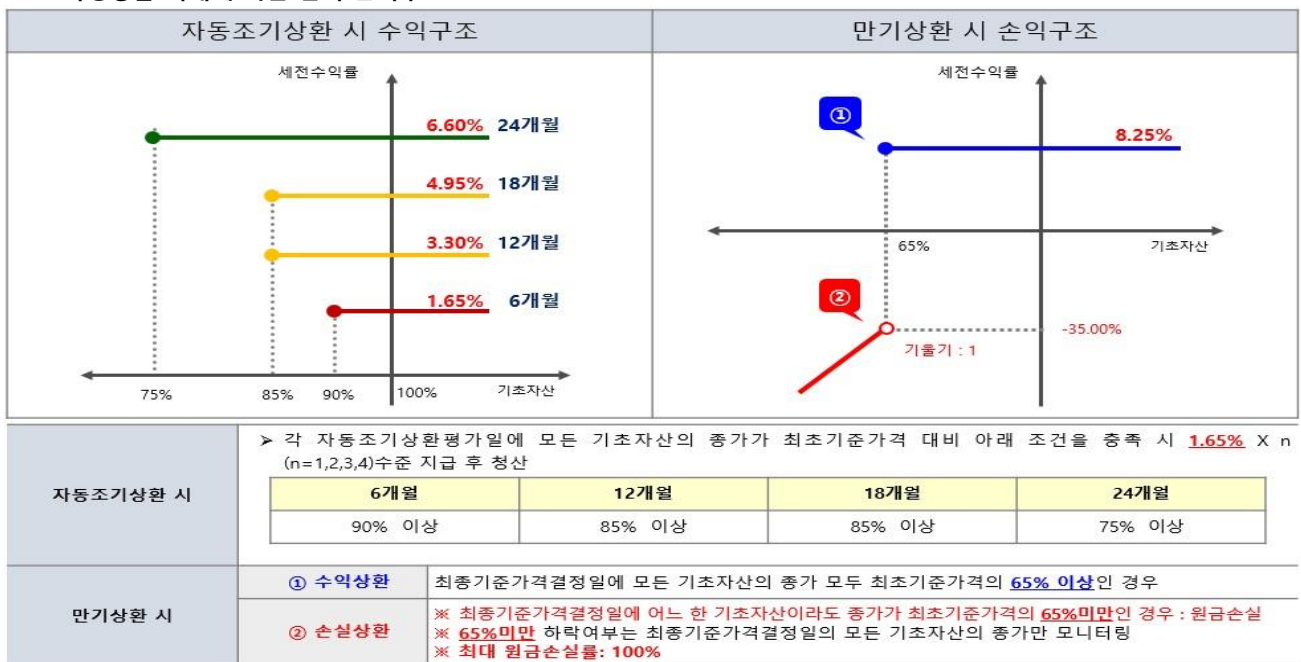
2021-03-19

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 | 556 | | 556 | 장외 |
| 합계 | | | 556 | | 556 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

28

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

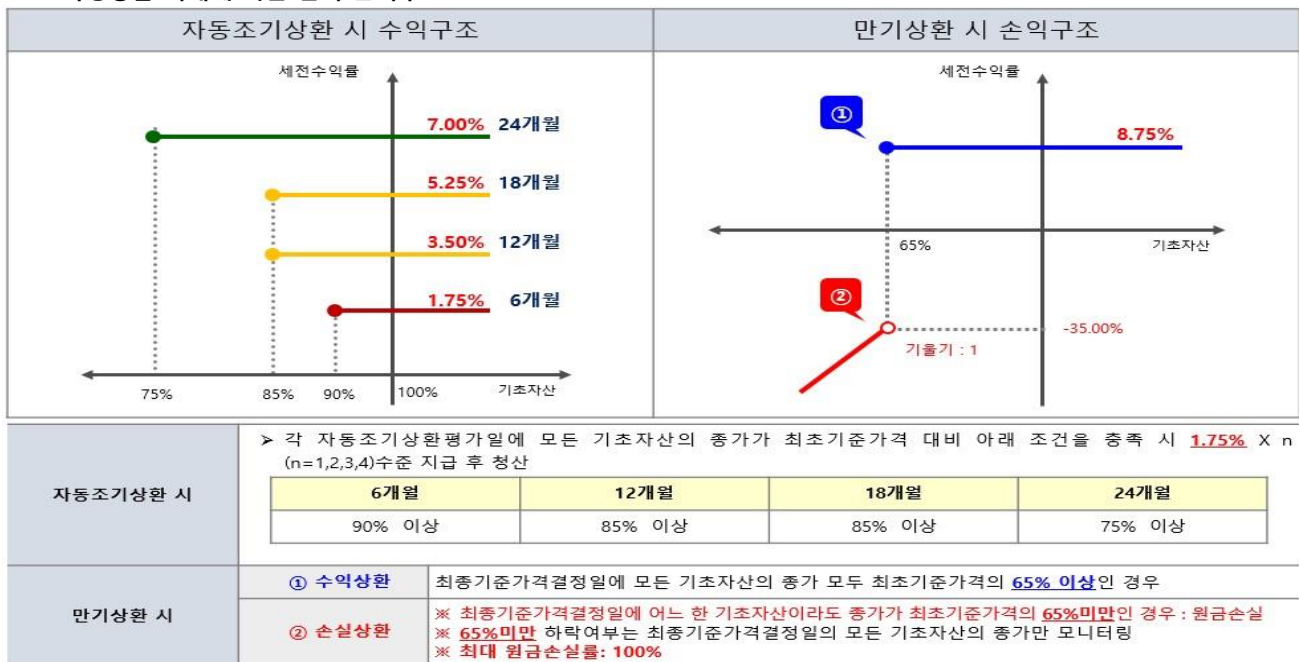
2021-03-19

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 | 2,053 | | 2,053 | 장외 |
| 합계 | | | 2,053 | | 2,053 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

45

펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-29호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

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 | 1,680 | | 1,680 | 장외 |
| 합계 | | | 1,680 | | 1,680 | |

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 1.65% 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>> 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

104

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

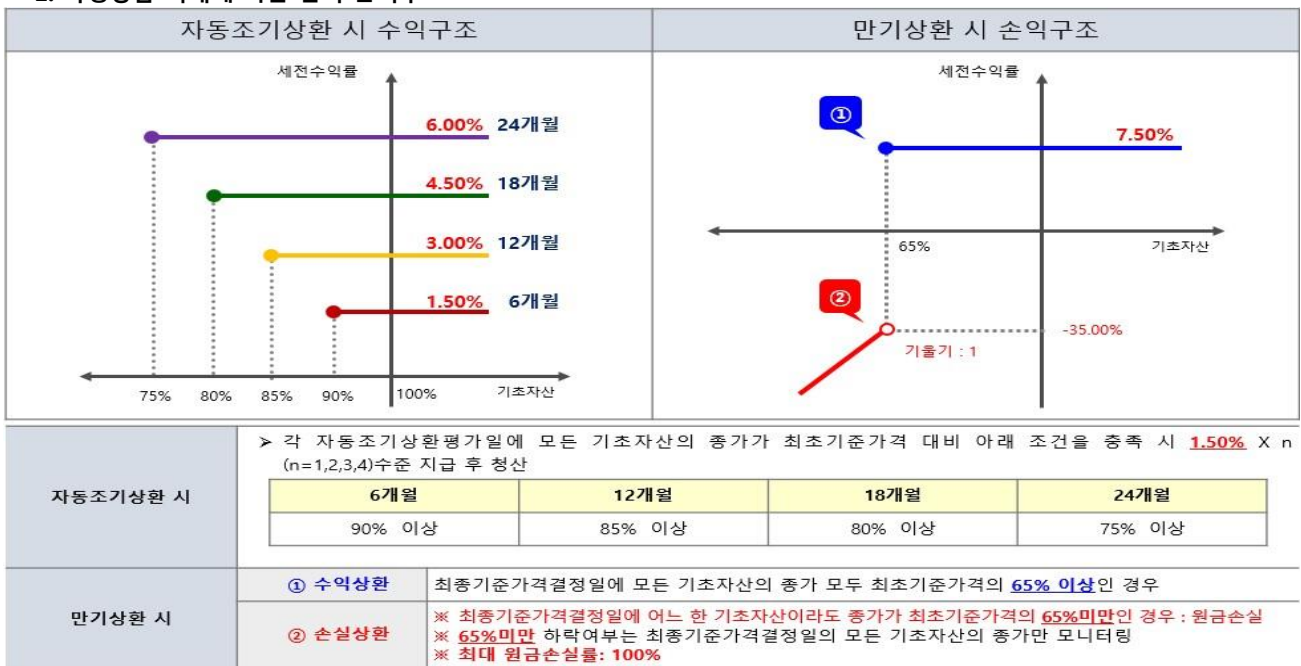
2021-03-19

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 | 419 | | 419 | 장외 |
| 합계 | | | 419 | | 419 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

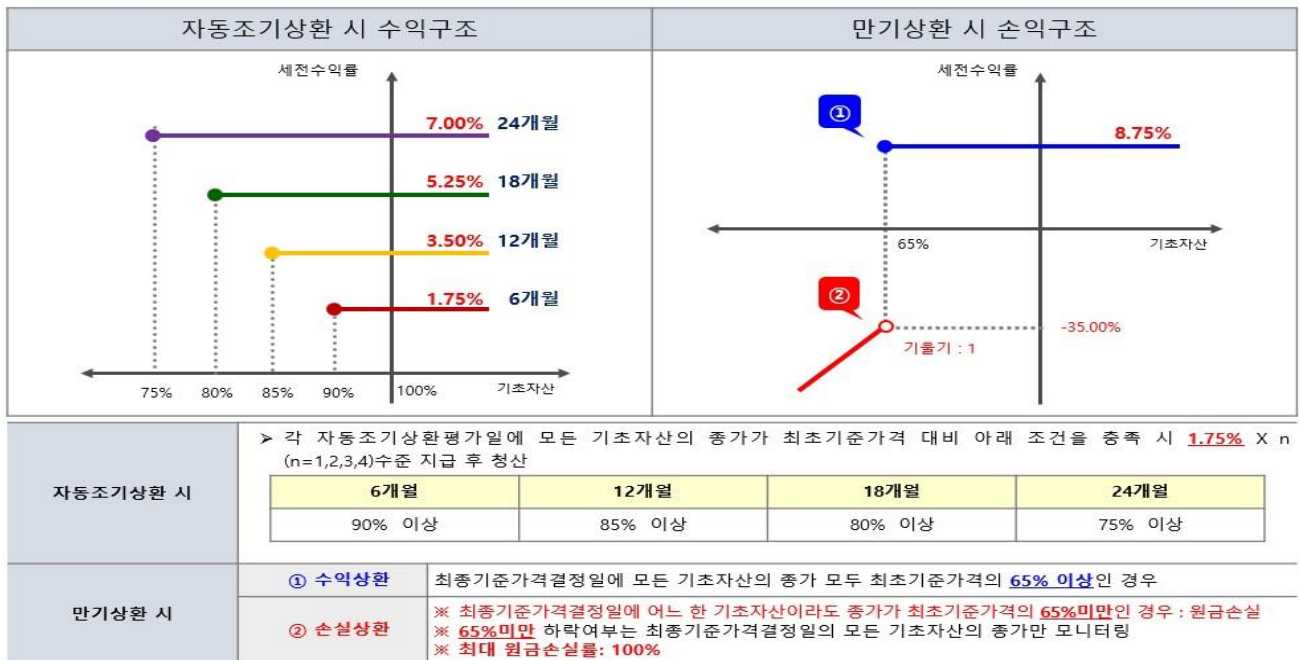
2021-03-19

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 | 1,967 | | 1,967 | 장외 |
| 합계 | | | 1,967 | | 1,967 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

112

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

27

펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-32호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

2021-03-19

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 | 1,114 | | 1,114 | 장외 |
| 합계 | | | 1,114 | | 1,114 | |

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 1.65% 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>> 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

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

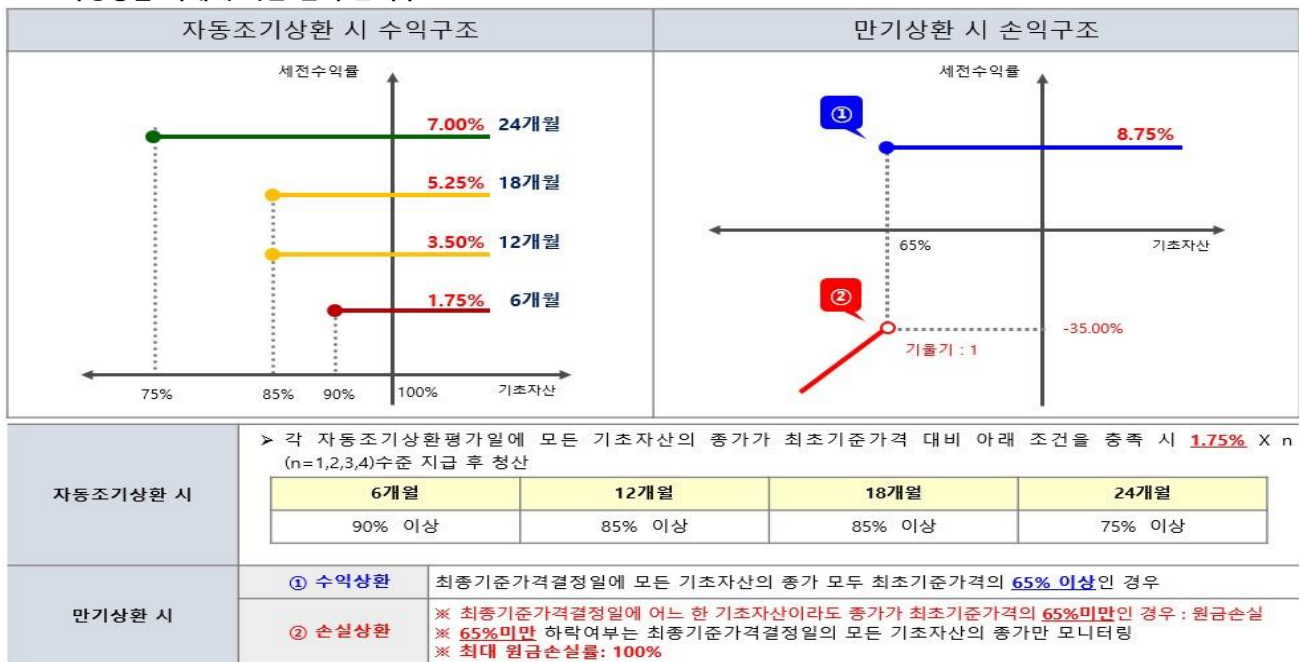
공시일: 2021-03-19

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 | 634 | | 634 | 장외 |
| 합계 | | | 634 | | 634 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

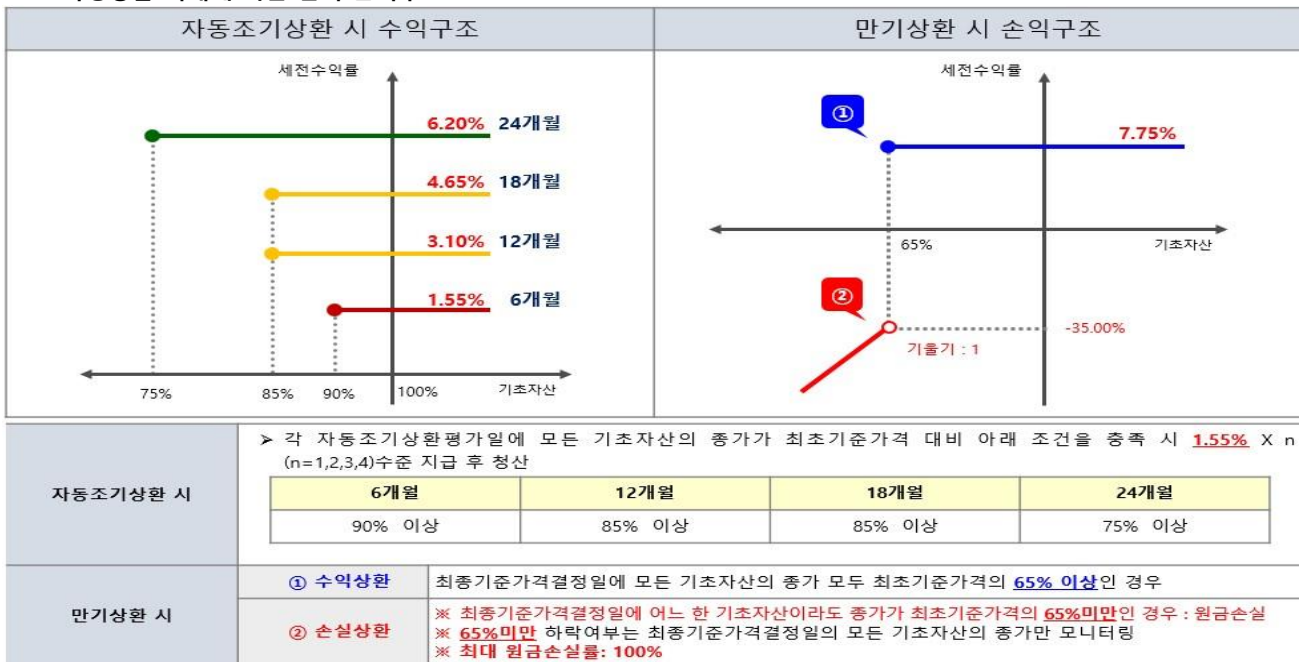
공시일: 2021-03-19

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 | 260 | | 260 | 장외 |
| 합계 | | | 260 | | 260 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)NK-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

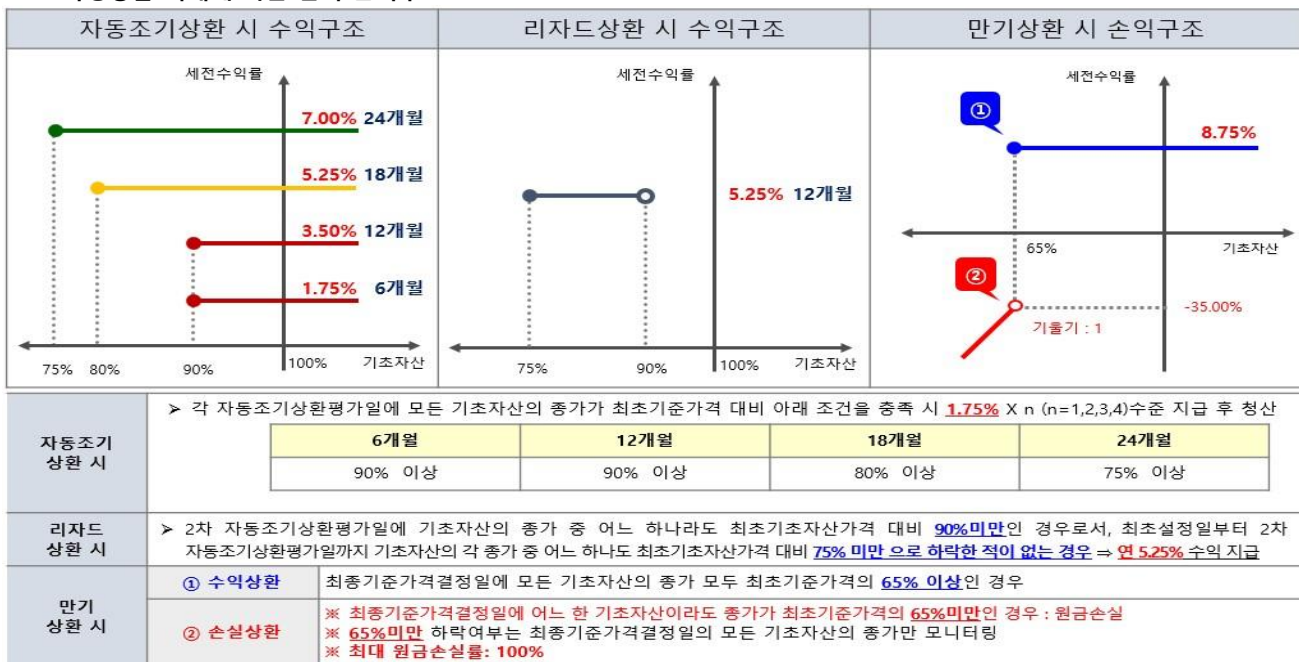
2021-03-19

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 | 1,219 | | 1,219 | 장외 |
| 합계 | | | 1,219 | | 1,219 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

84

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

84

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

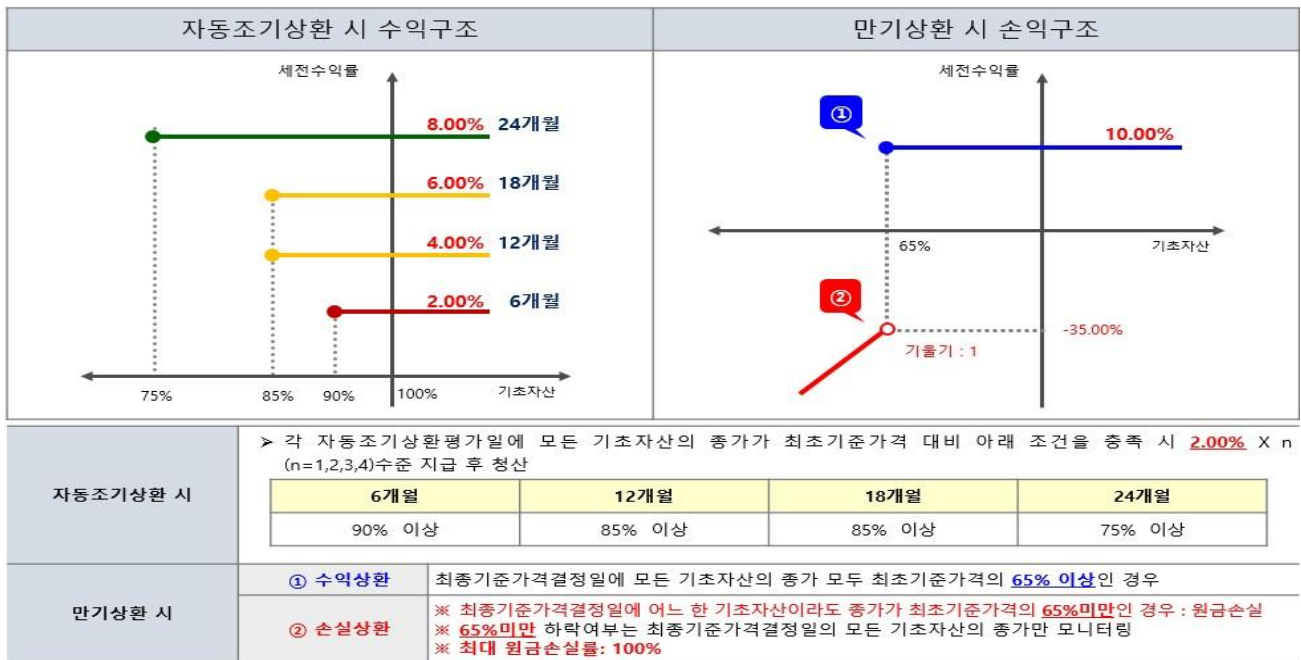
2021-03-19

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 | 2,128 | | 2,128 | 장외 |
| 합계 | | | 2,128 | | 2,128 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

136

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

111

펀드명 : BNK리자드지수연계증권E(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

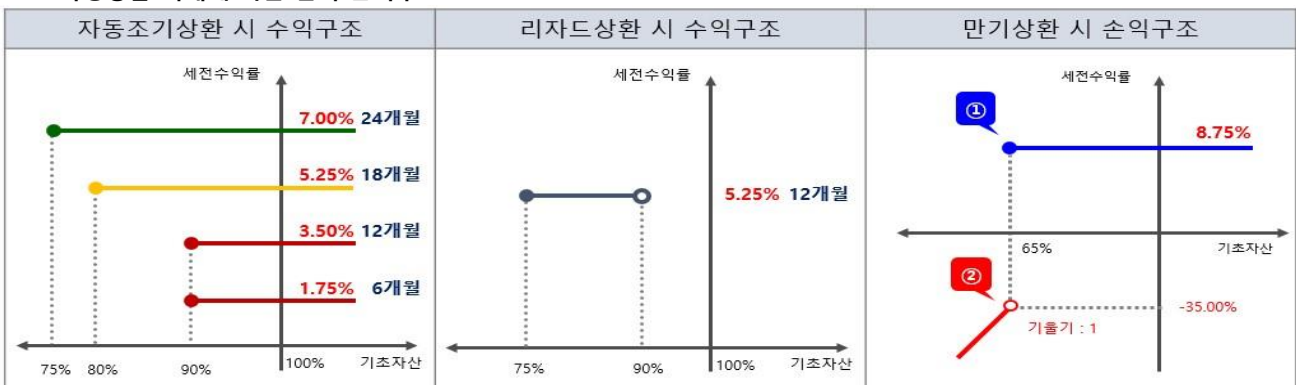
2021-03-19

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 | 334 | | 334 | 장외 |
| 합계 | | | 334 | | 334 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | | | | |
|----------|--|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산 | | | |
| | 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 5.25% 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

20

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

19

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 781 | | 781 | 장외 |
| 합계 | | | 781 | | 781 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조 | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 | | | | | | | | |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|--|---|
| | | | | | | | | | | |
| <p>자동조기상환 시</p> <p> > 각 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.50% 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>리자드상환 시</p> <p> > 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.50% 수익 지급 </p> | <p>만기상환 시</p> <p> ① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우 ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% </p> |
| 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 | | | | | | | |
| 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | | | | | | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

46

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

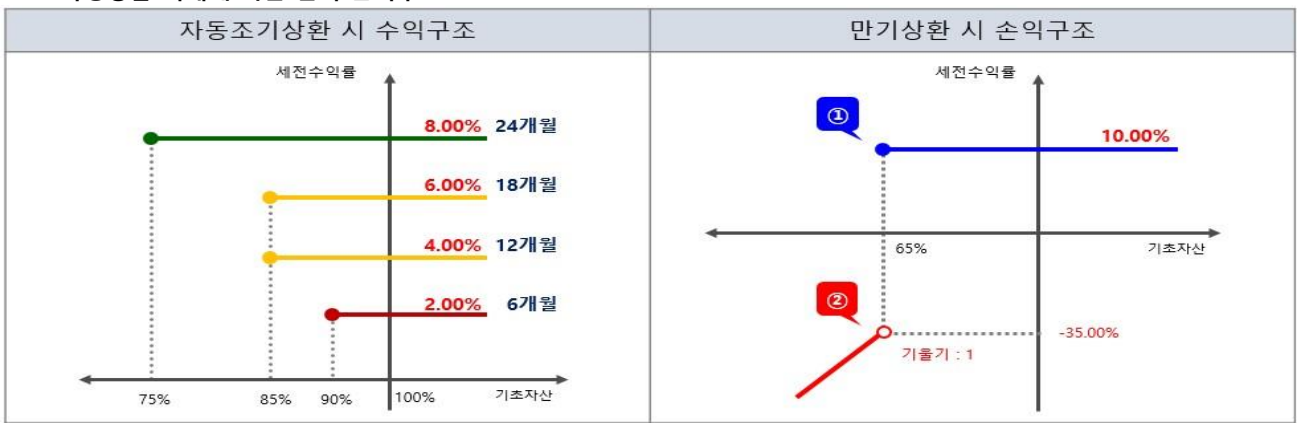
2021-03-19

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 | 1,264 | | 1,264 | 장외 |
| 합계 | | | 1,264 | | 1,264 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

| 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 |
|--------|--------|--------|--------|
| 90% 이상 | 85% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 |

만기상환 시

| | |
|--------|---|
| ① 수익상환 | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우 |
| ② 손실상환 | <ul style="list-style-type: none"> ※ 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

74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

82

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

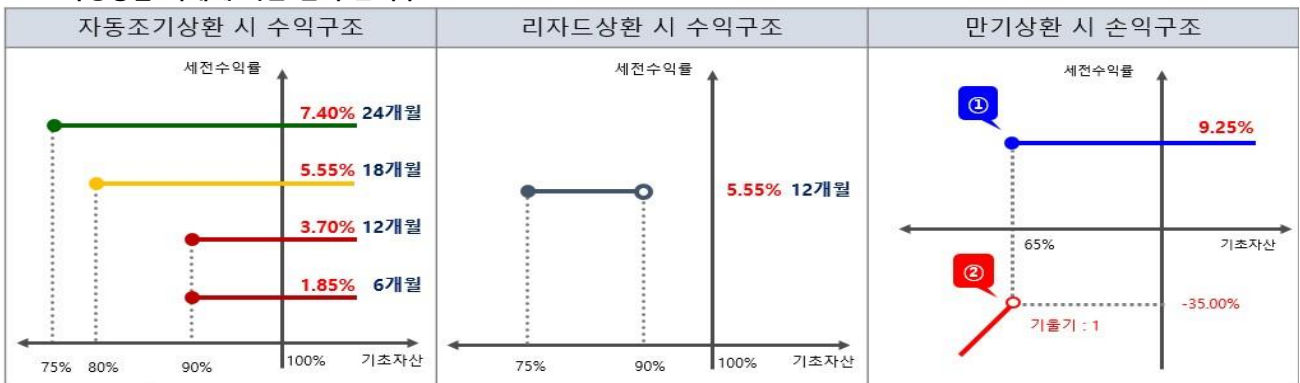
공시일: 2021-03-19

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 | 1,302 | | 1,302 | 장외 |
| 합계 | | | 1,302 | | 1,302 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | | | | |
|----------|---|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.85% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산 | | | |
| | 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 |
| | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |
| 리자드상환 시 | > 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.55% 수익 지급 | | | |
| 만기상환 시 | ① 수익상환 | 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우 | | |
| | ② 손실상환 | ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

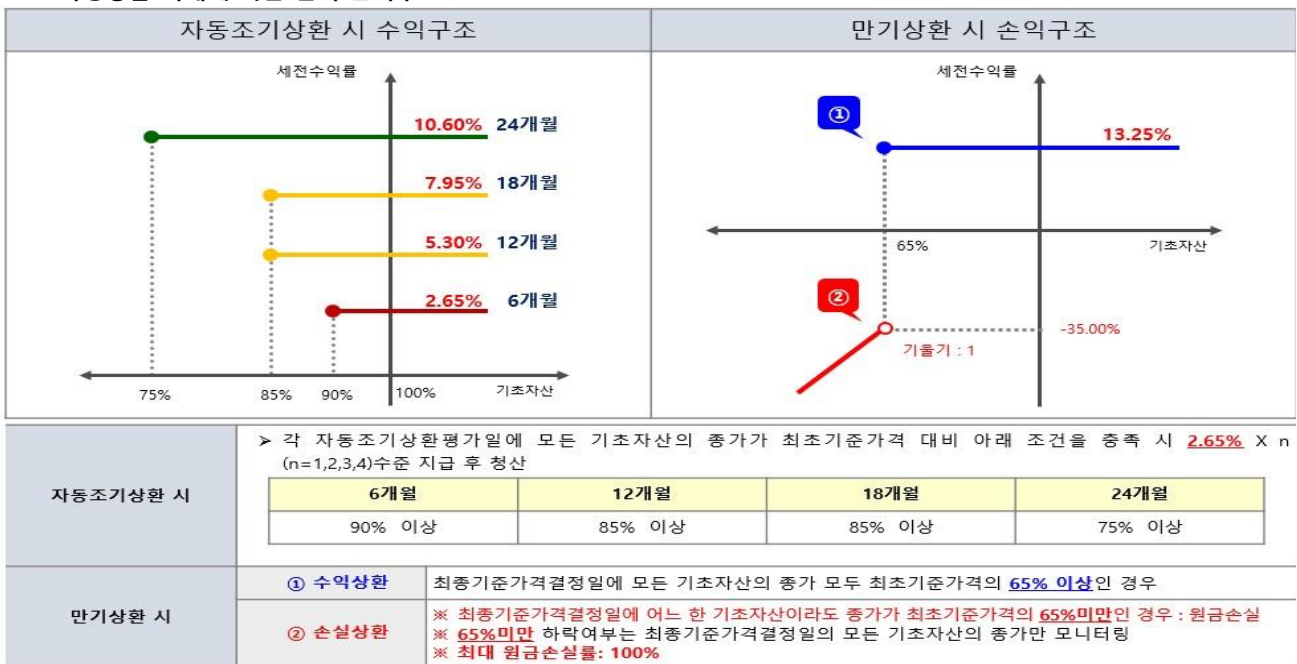
2021-03-19

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 | 5,621 | | 5,621 | 장외 |
| 합계 | | | 5,621 | | 5,621 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

375

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

323

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

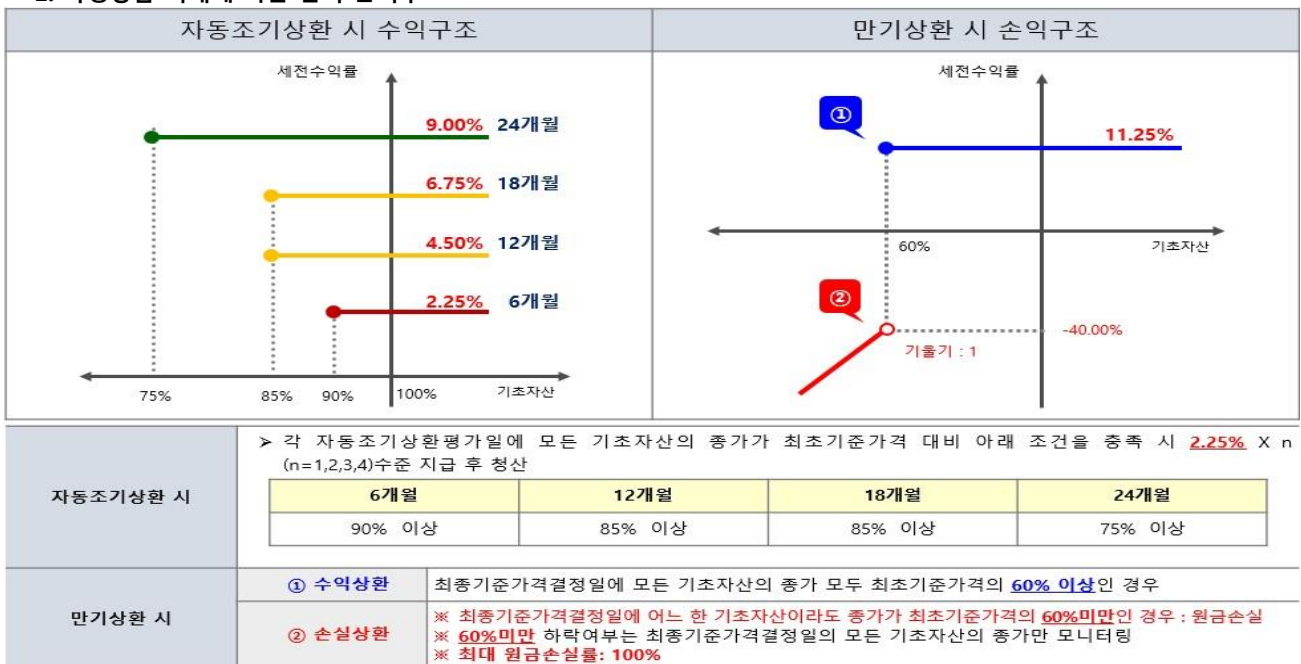
2021-03-19

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 | 548 | | 548 | 장외 |
| 합계 | | | 548 | | 548 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

36

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

30

펀드명 : BNK리자드지수연계증권SE(KRW)K-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

2021-03-19

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 | 1,989 | | 1,989 | 장외 |
| 합계 | | | 1,989 | | 1,989 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조 | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 | | | | | | | | |
|--|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|--|---|
| | | | | | | | | | | |
| <p>자동조기상환 시</p> <p> > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.25% 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>리자드 상환 시</p> <p> > 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 6.75% 수익 지급 </p> | <p>만기 상환 시</p> <p> ① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우 ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% </p> |
| 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 | | | | | | | |
| 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | | | | | | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

82

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

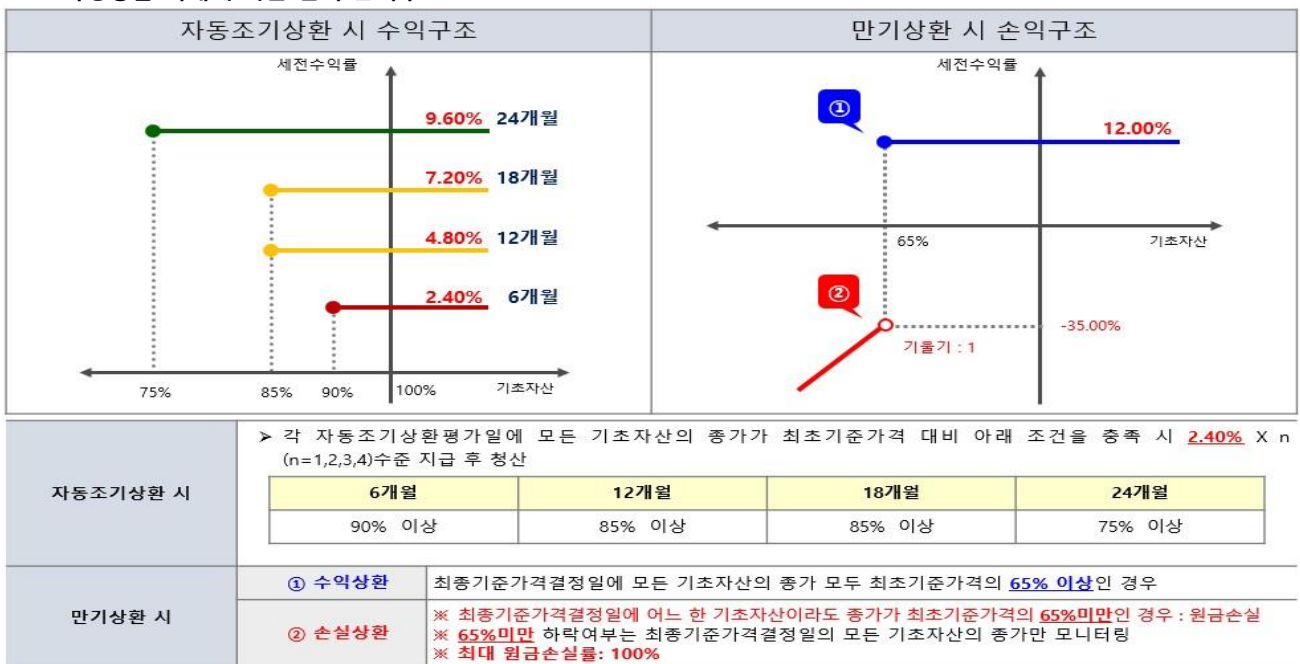
2021-03-19

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 | 1,551 | | 1,551 | 장외 |
| 합계 | | | 1,551 | | 1,551 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

36

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-5호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

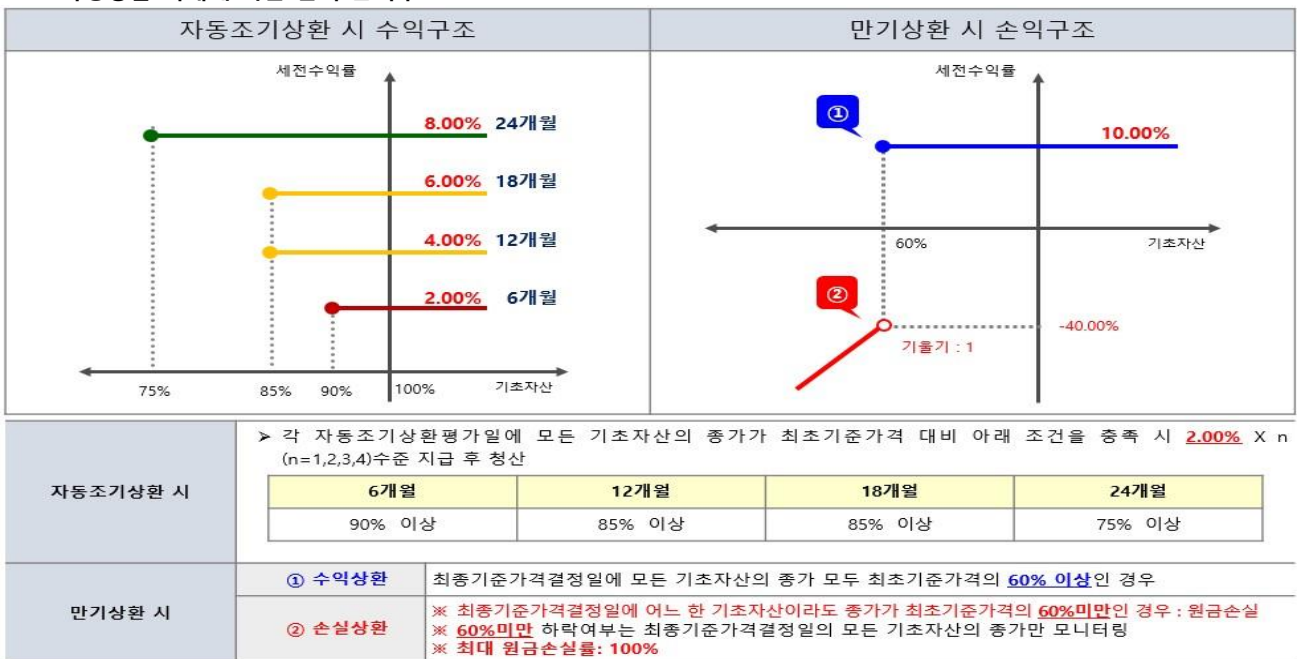
2021-03-19

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 | 903 | | 903 | 장외 |
| 합계 | | | 903 | | 903 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

47

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

30

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)NK-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

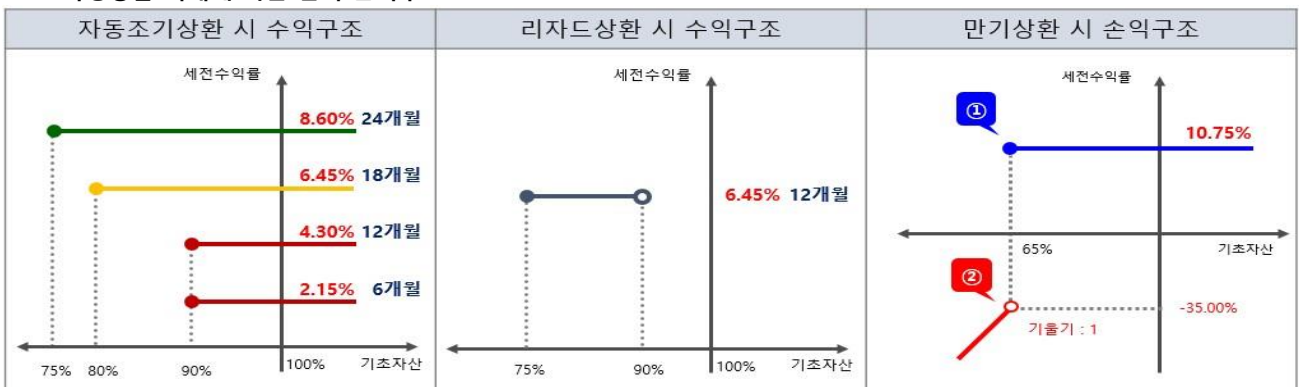
2021-03-19

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 | 714 | | 714 | 장외 |
| 합계 | | | 714 | | 714 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | | | | |
|----------|---|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.15% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산 | | | |
| | 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 |
| | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |
| 리자드상환 시 | > 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만 인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.45% 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

44

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

31

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

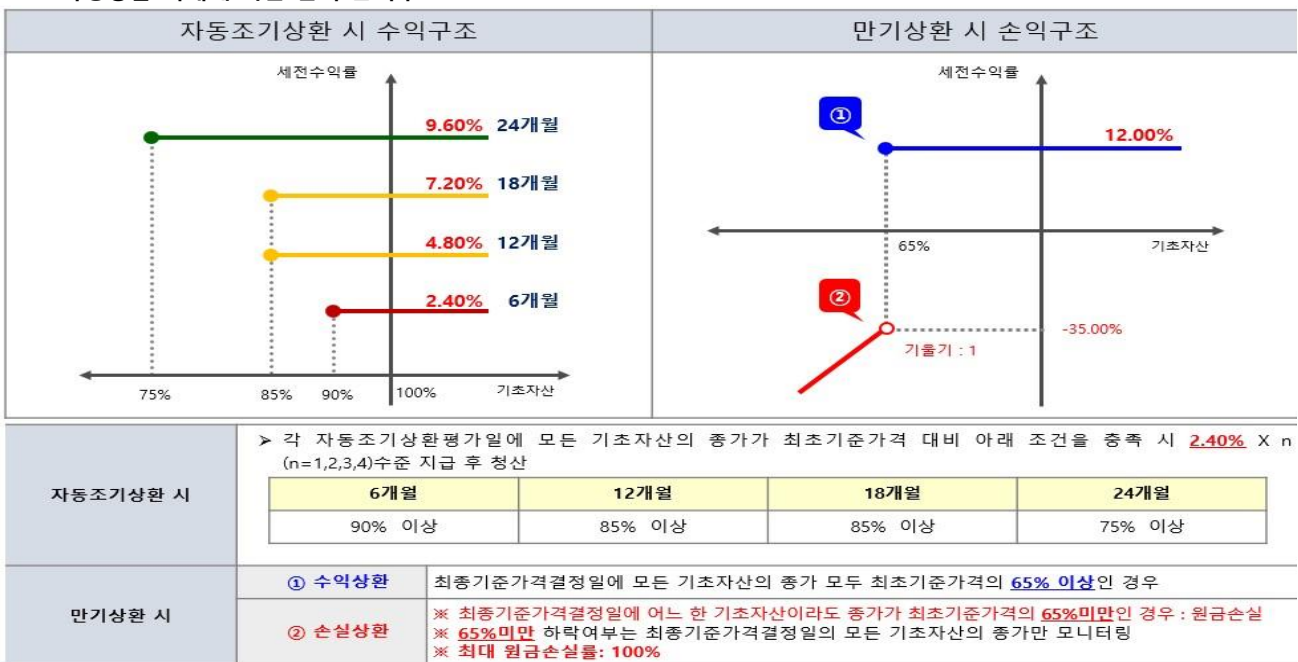
2021-03-19

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 | 1,913 | | 1,913 | 장외 |
| 합계 | | | 1,913 | | 1,913 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

113

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

87

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

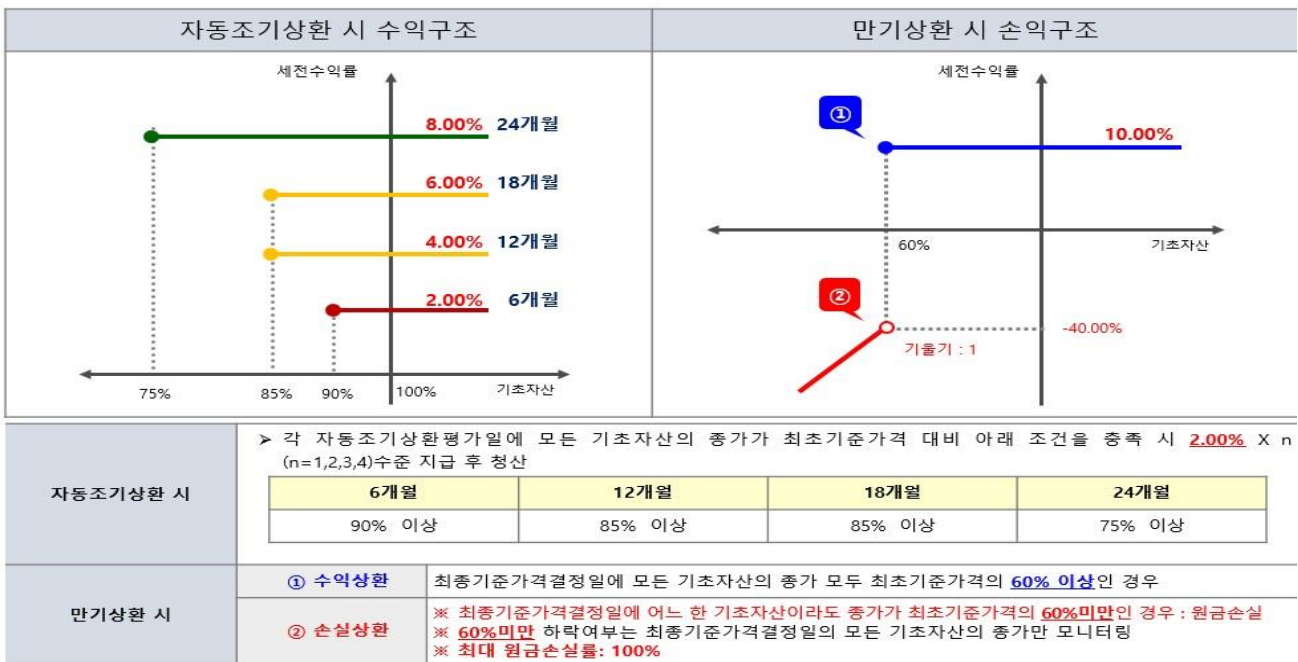
2021-03-19

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



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

9

펀드명 : BNK리자드지수연계증권SE(KRW)N-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일: 2021-03-19

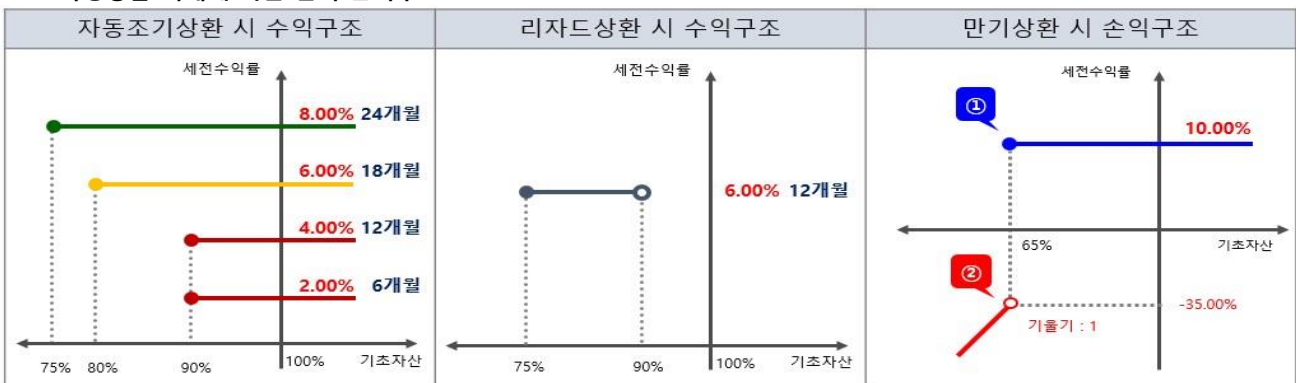
2021-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 207 | 0 | 207 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 207 | | 207 | 장외 |
| 합계 | | | 207 | | 207 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | | | | |
|----------|---|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산 | | | |
| | 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 |
| | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |
| 리자드상환 시 | > 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가가 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급 | | | |
| 만기상환 시 | ① 수익상환 | 최종기준가격결정일에 기초자산의 증가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우 | | |
| | ② 손실상환 | ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 월급손실률: 100% | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-38호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-18

공시일:

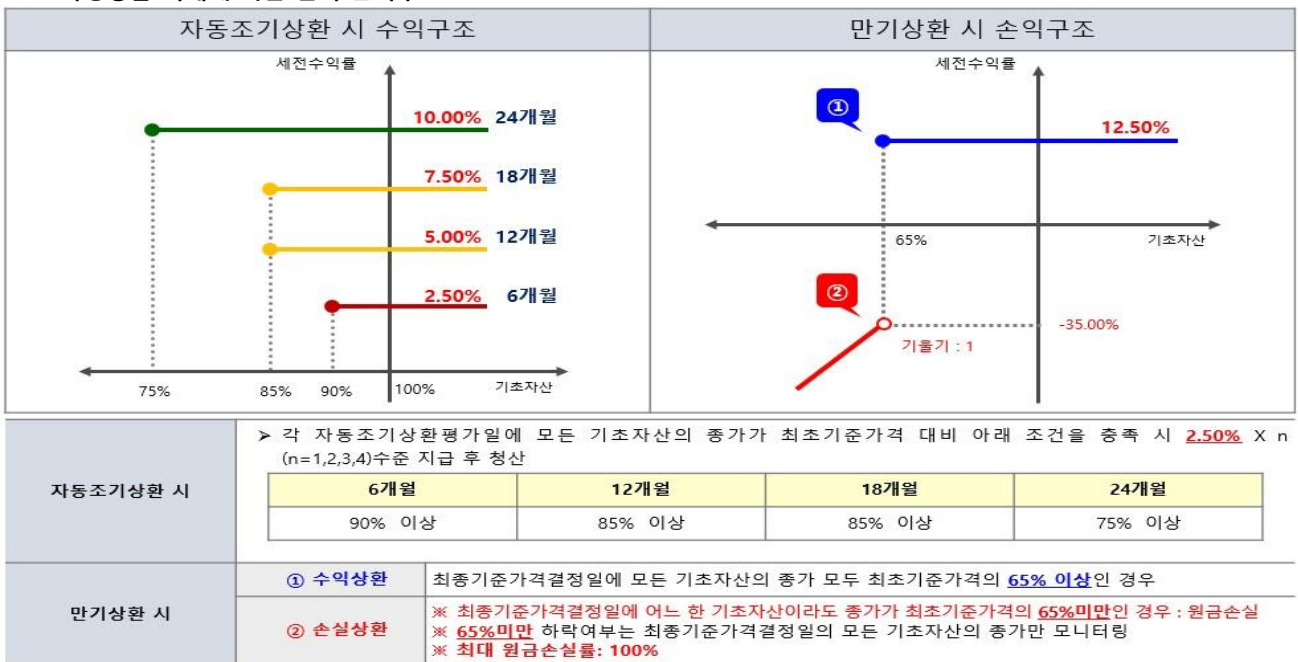
2021-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 958 | 0 | 958 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 958 | | 958 | 장외 |
| 합계 | | | 958 | | 958 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

55

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21