

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	797	1,001	-204	장내
누계	주가지수	선물	5,415	0	5,415	장내
신규	주가지수	옵션	17	5,515	-5,498	장내
누계	주가지수	옵션	21	8,372	-8,351	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	577	0	577	장내
합계			6,013	8,372	-2,359	

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

451

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

642

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	940	0	940	장내
누계	주가지수	선물	13,324	0	13,324	장내
합계			13,324	0	13,324	

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

1,064

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,457

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSK-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

24

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSK-2호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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

5

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지플러스지수연계증권HSN-1호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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

46

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK환헤지지원화플러스지수연계증권HSK-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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

38

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSK-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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

4

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK리자드환헤지원화플러스지수연계증권HSN-3호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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>자동조기상환 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>리자드상환 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>만기상환 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

8

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-4호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일:

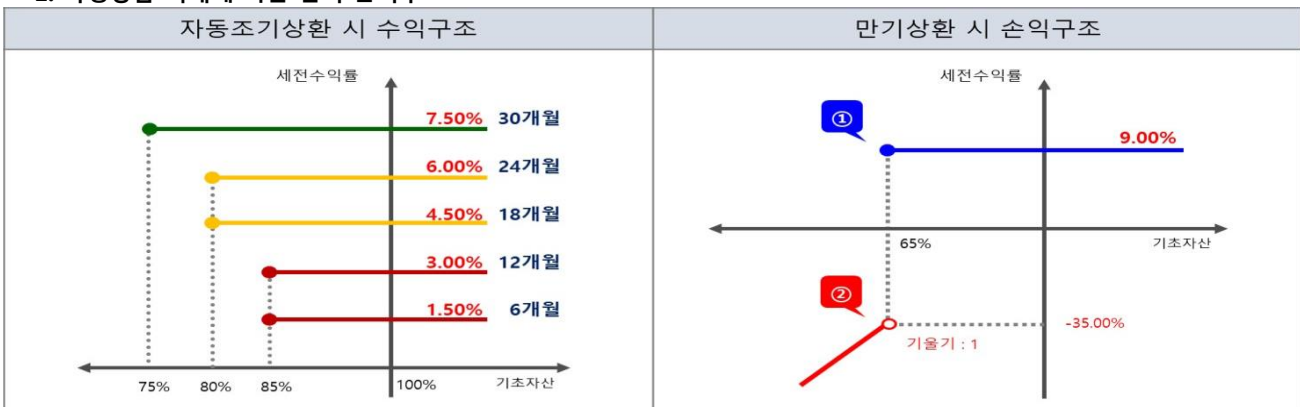
2021-03-24

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

3

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-5호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일:

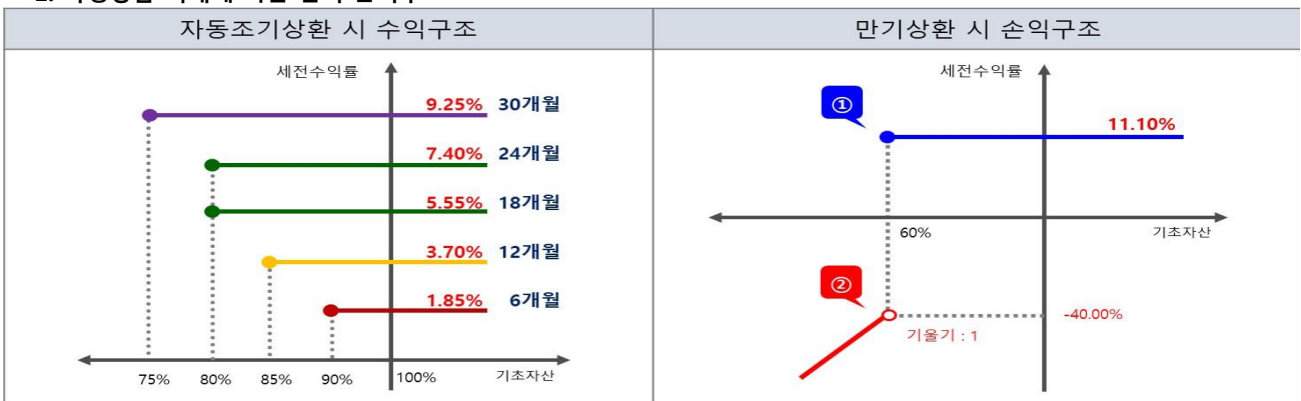
2021-03-24

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%

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

55

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

9

펀드명 : BNK리자드환헤지원화플러스지수연계증권HSN-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

141

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

펀드명 : BNK환헤지지원화플러스지수연계증권HSK-6호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-7호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일:

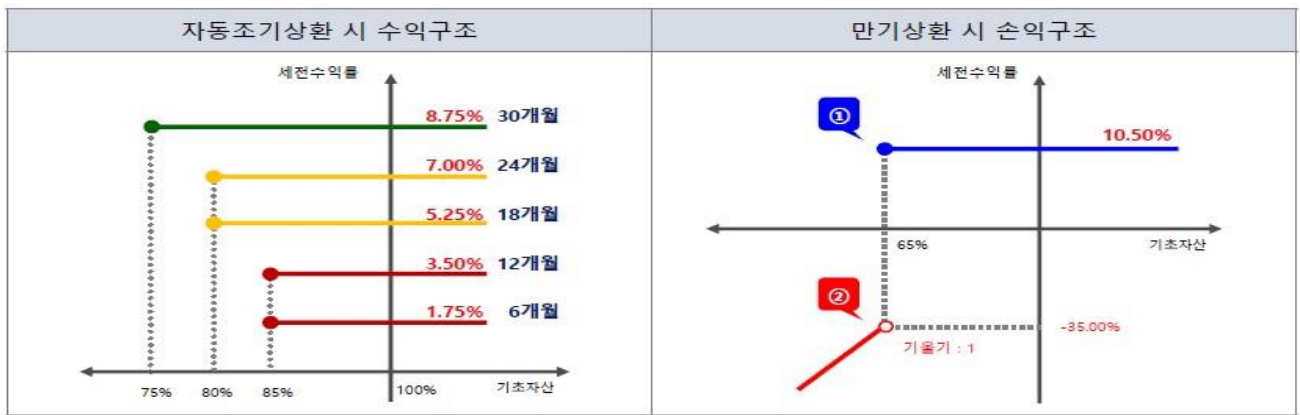
2021-03-24

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

116

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

펀드명 : BNK환헤지원화플러스지수연계증권HSN-8호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일:

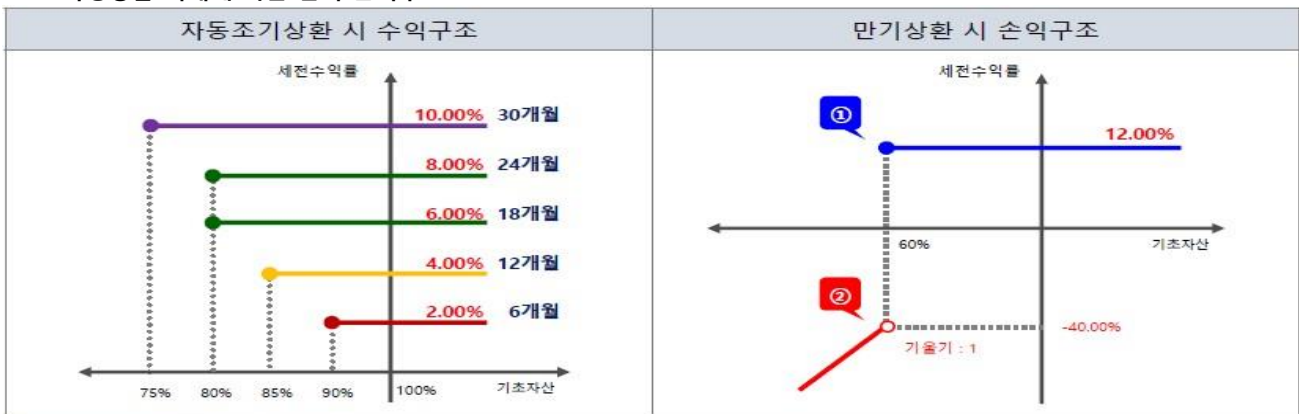
2021-03-24

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



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 $2.00\% \times n$ (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 총가 모두 최초기준가격의 60% 이상 인 경우			
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 60%미만 인 경우 : 원금손실 ※ 60%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%			

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

113

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

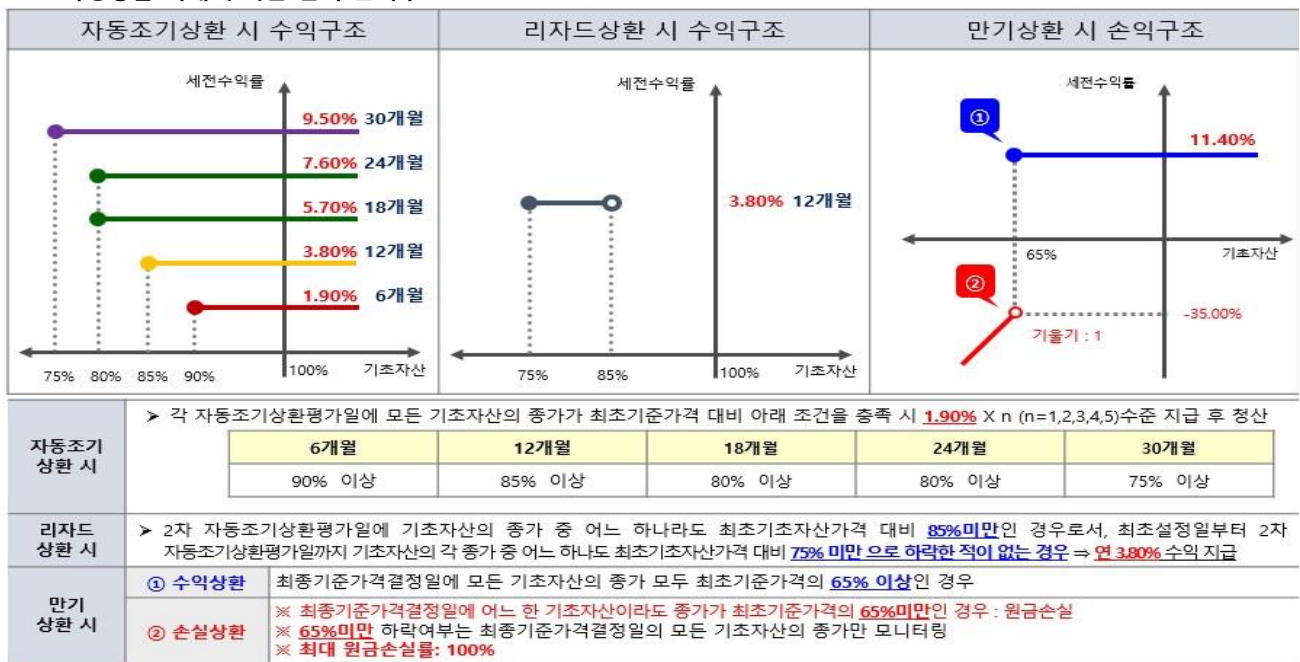
2021-03-24

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

155

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-10호(ELS-파생형)

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

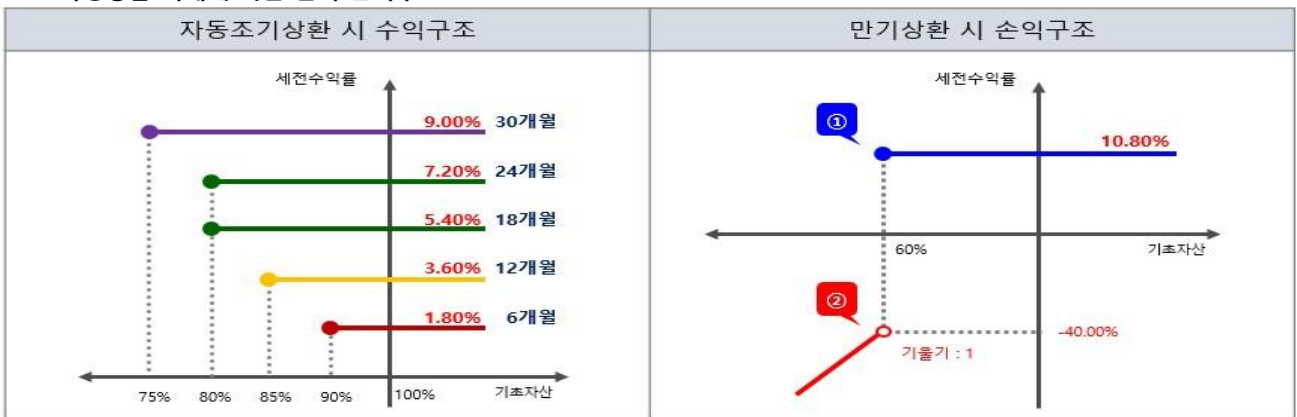
2021-03-24

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

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

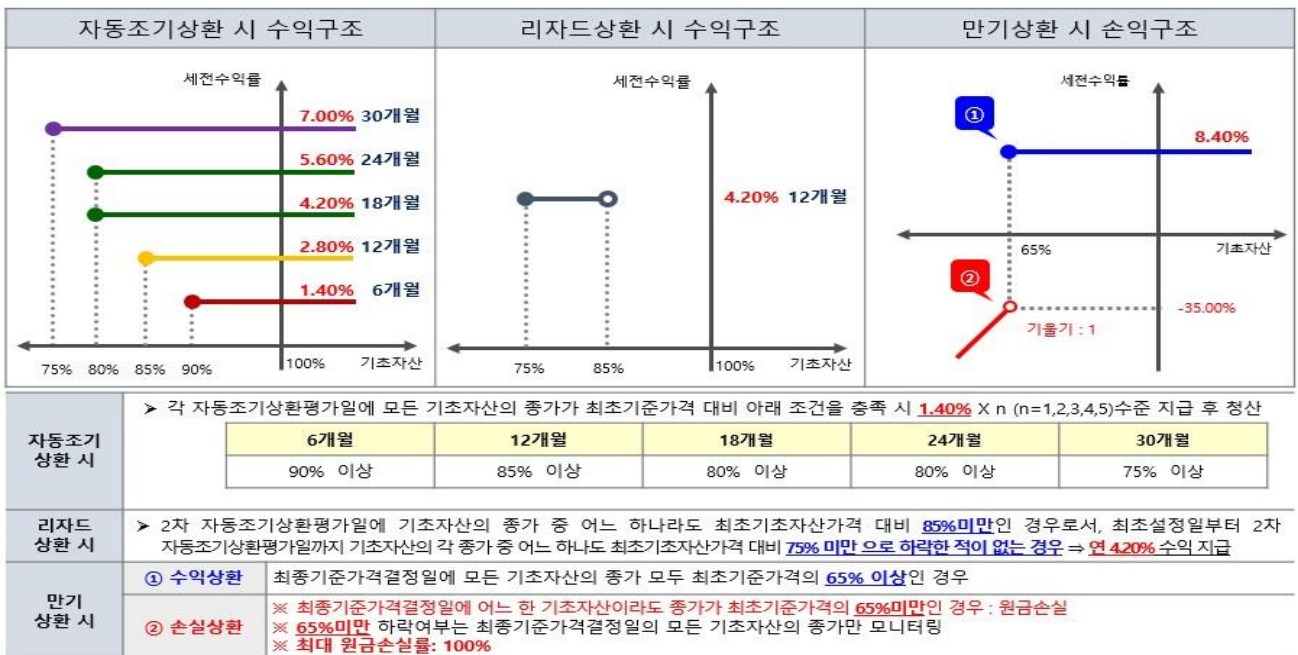
2021-03-24

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

24

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-11호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

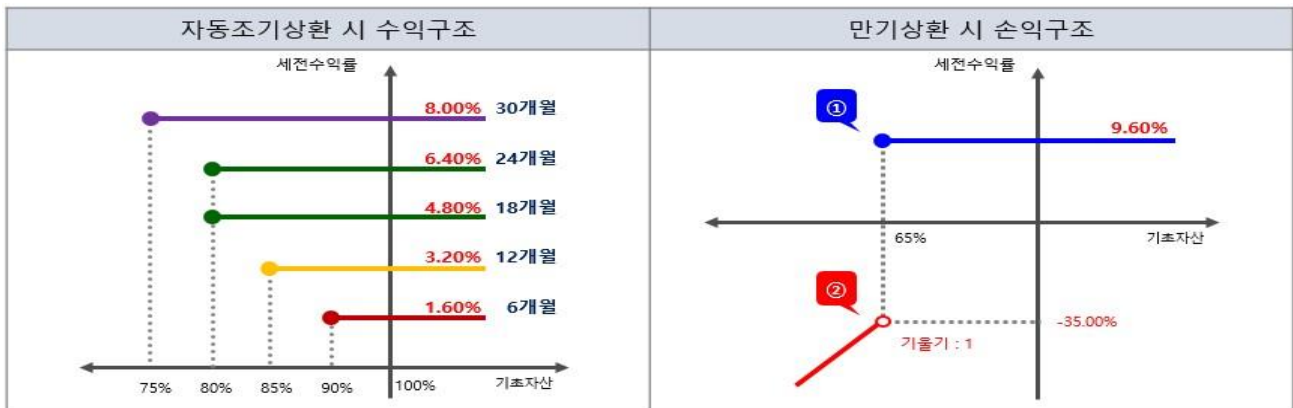
2021-03-24

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

51

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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% 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

32

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

12

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-12호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

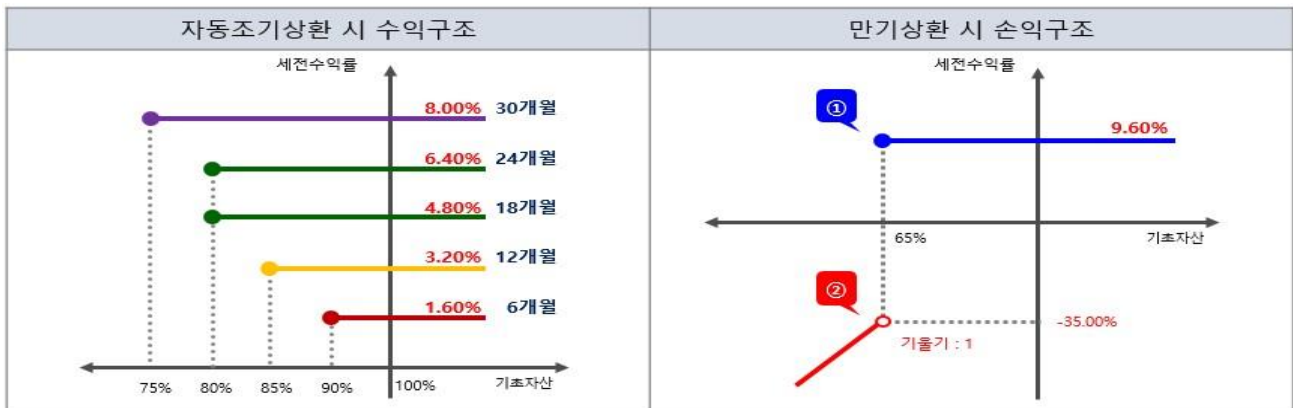
2021-03-24

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

69

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

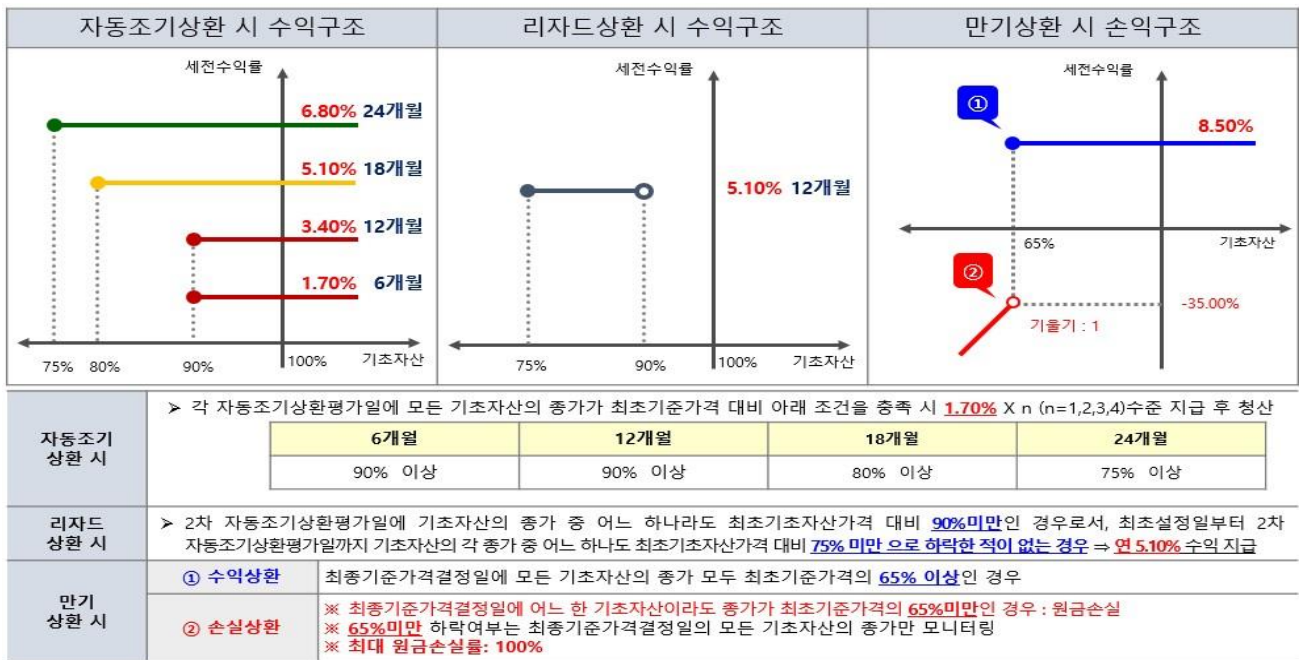
2021-03-24

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



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

229

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

58

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

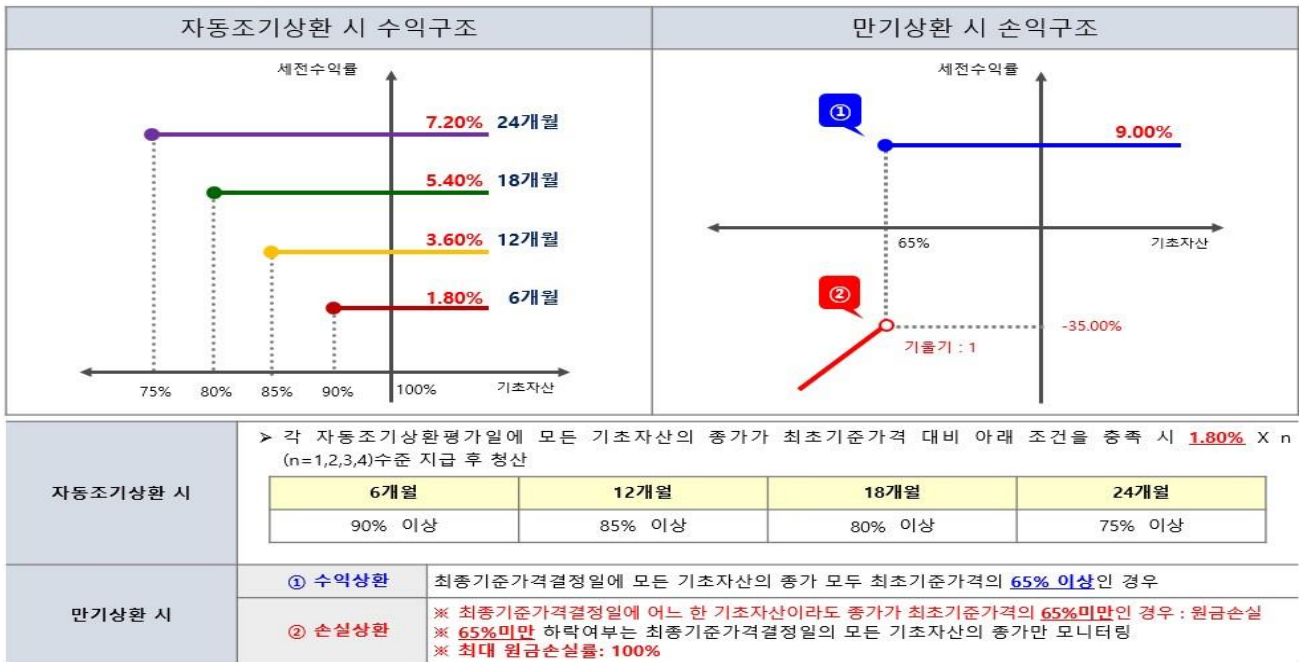
2021-03-24

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

256

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

86

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-10호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

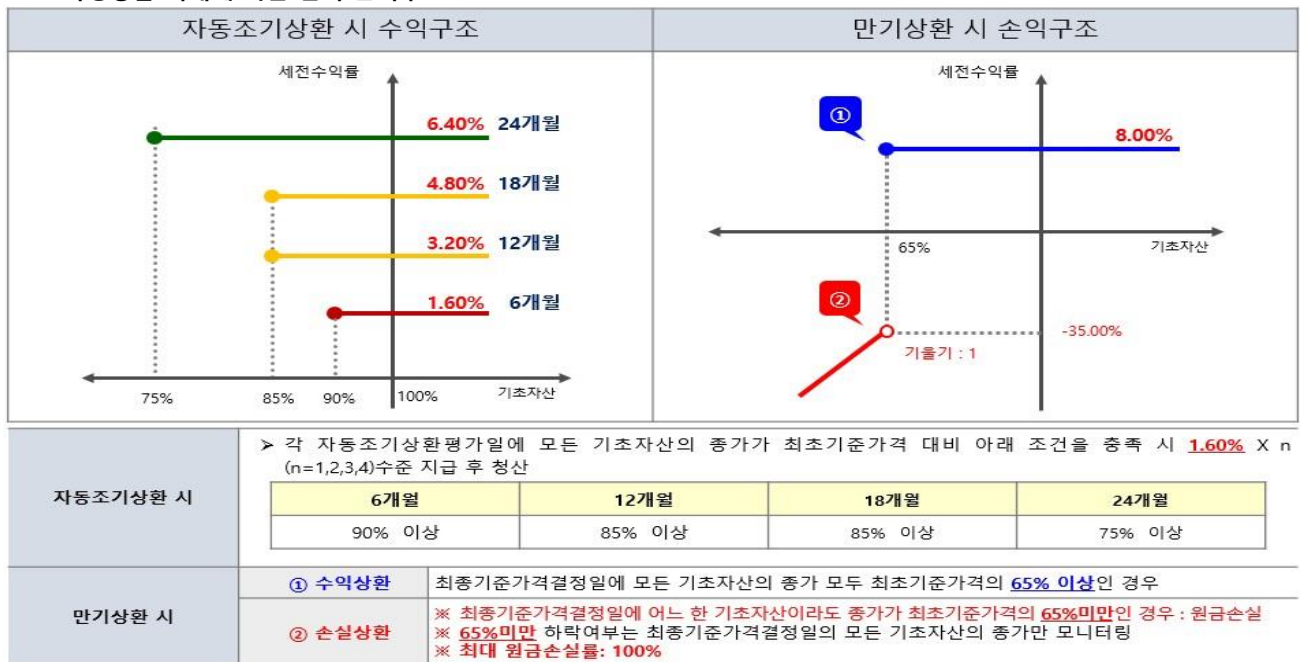
2021-03-24

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

24

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

197

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

58

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

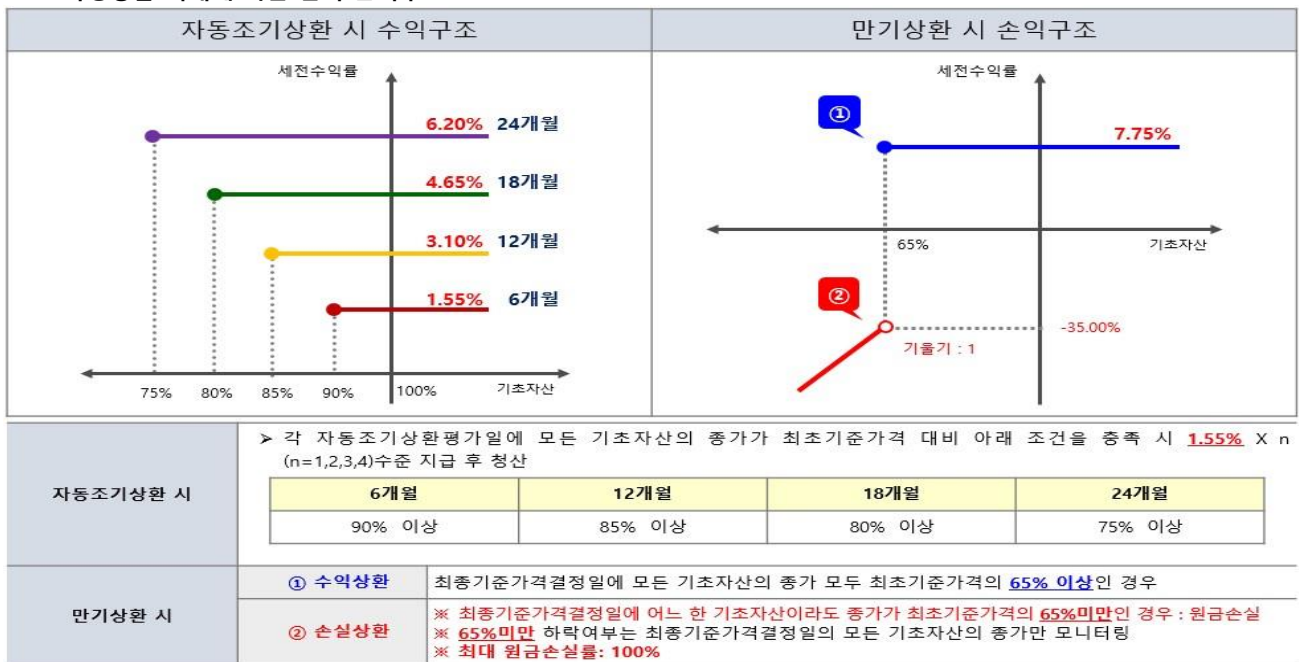
2021-03-24

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

28

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-18호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

270

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

113

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-19호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

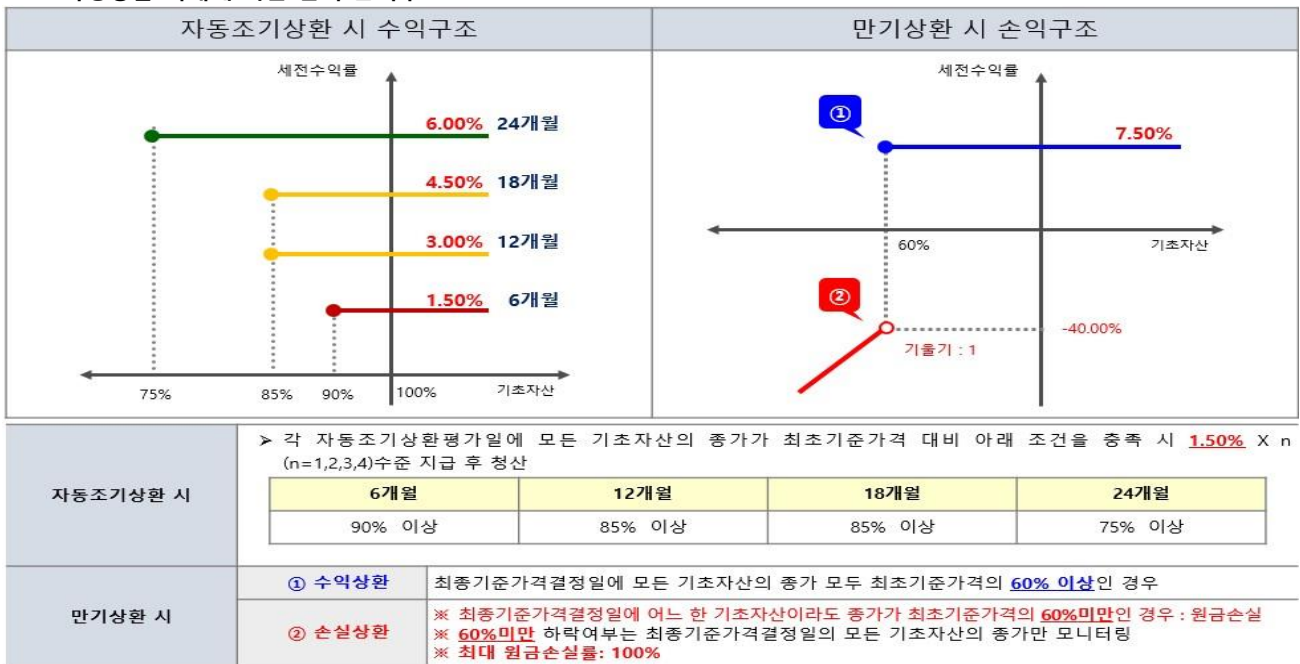
2021-03-24

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

110

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

36

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

166

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

65

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-21호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

74

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

32

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-22호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

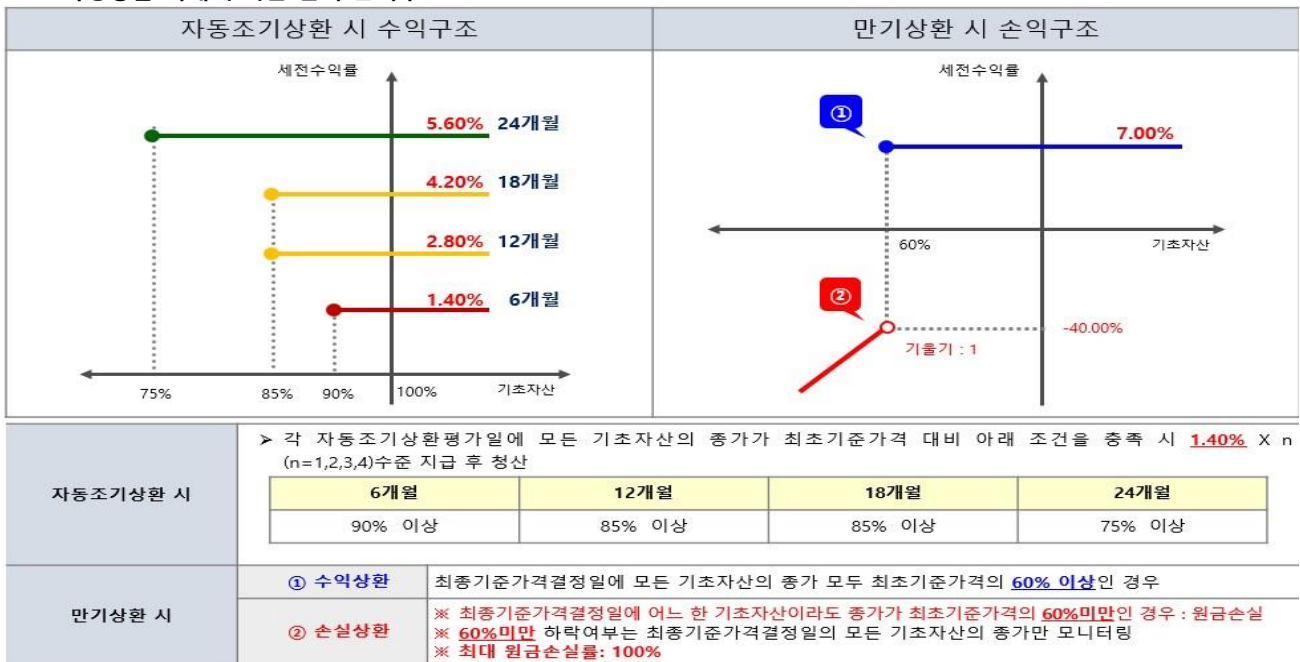
2021-03-24

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

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-12호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

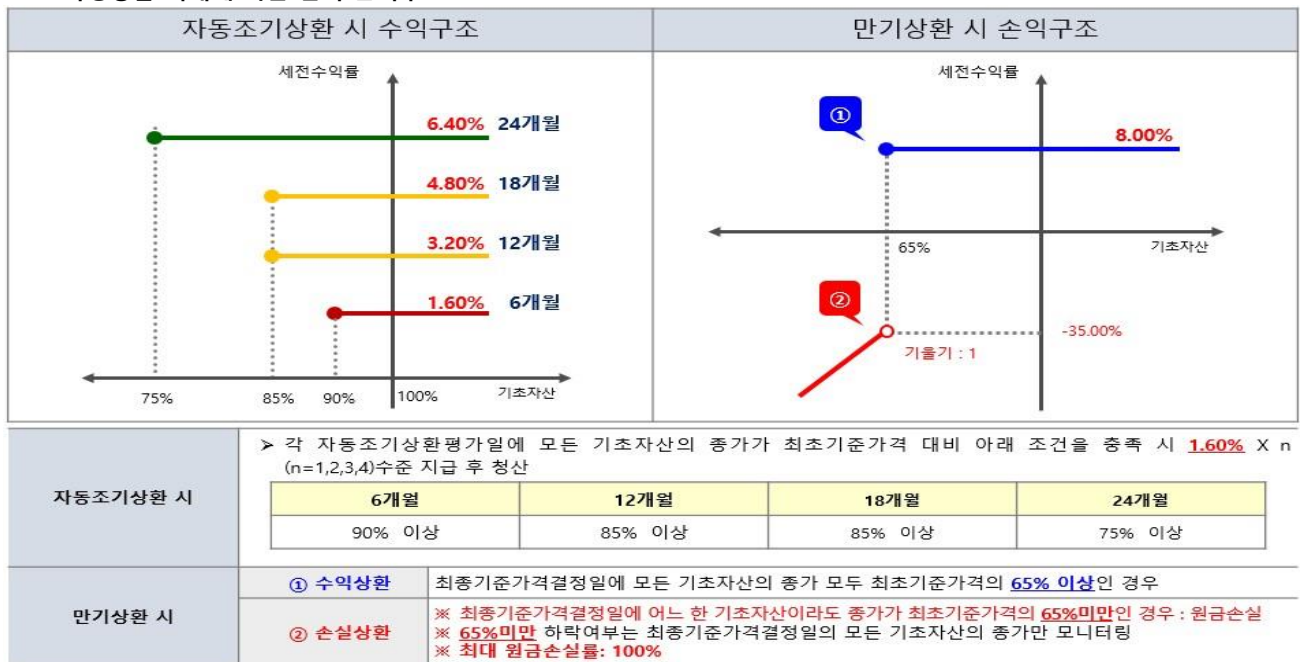
공시일: 2021-03-24

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

32

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14

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

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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>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

103

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

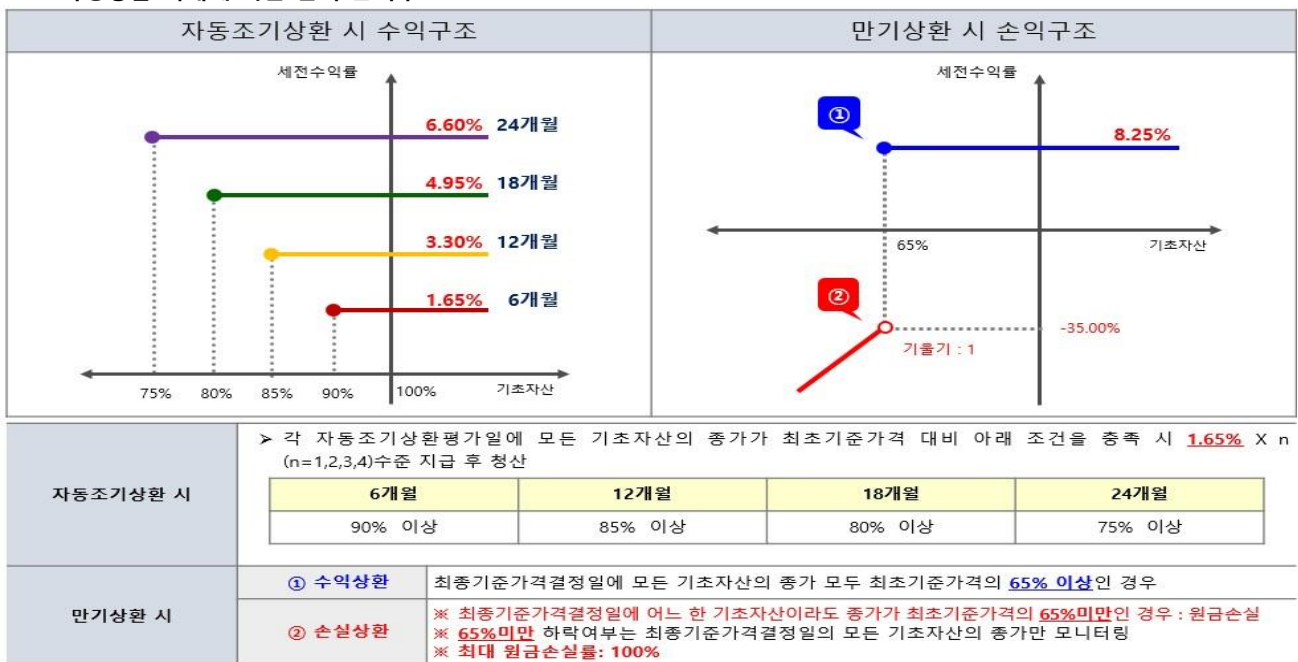
2021-03-24

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

43

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-24호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

60

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

30

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

119

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

53

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

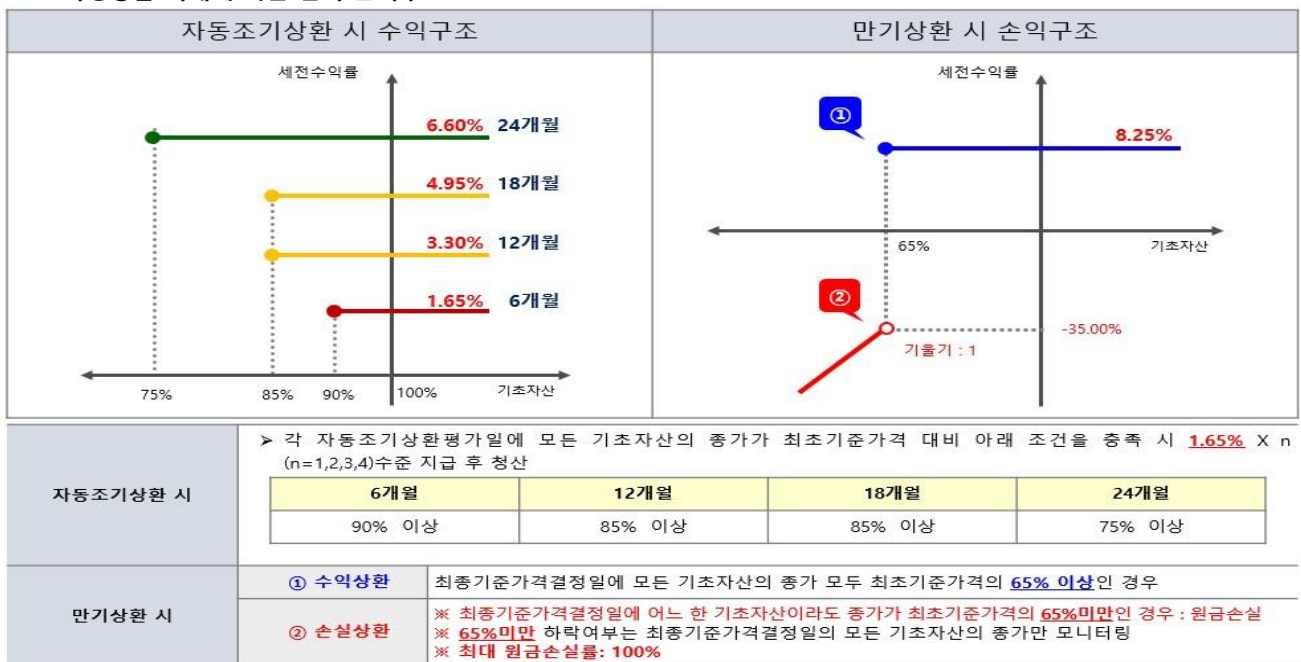
2021-03-24

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

38

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

23

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

116

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

74

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

112

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

43

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

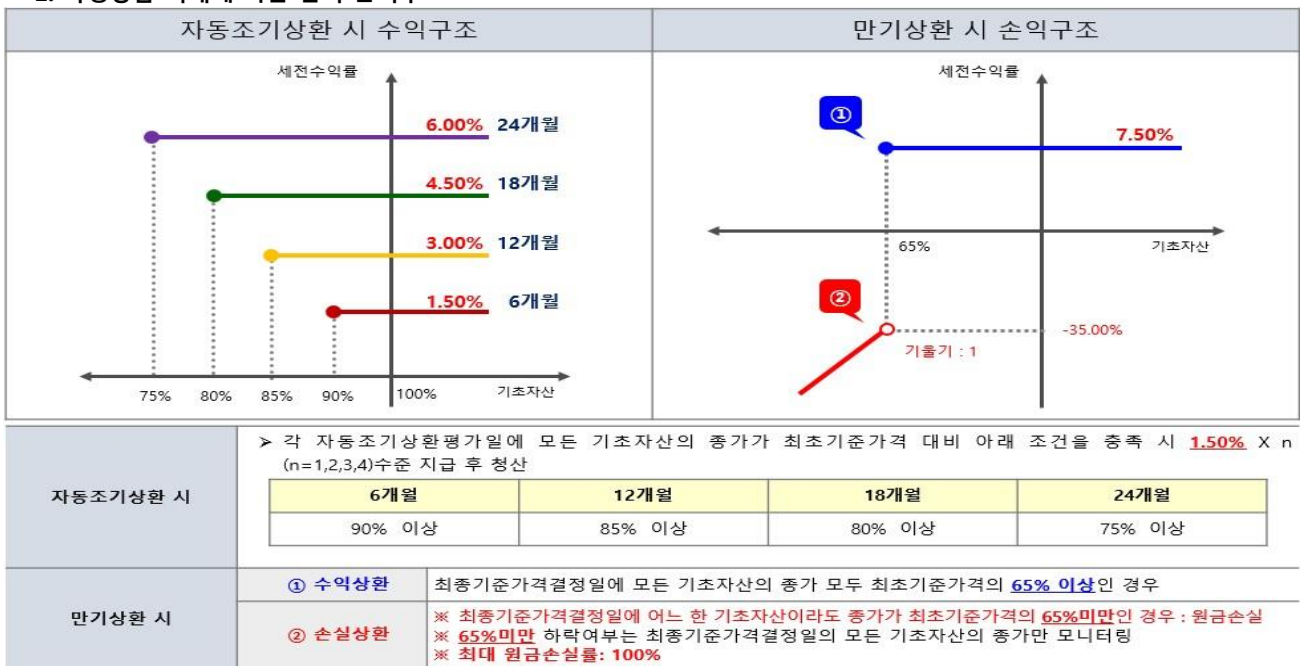
2021-03-24

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)

15

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

122

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

41

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

69

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

37

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

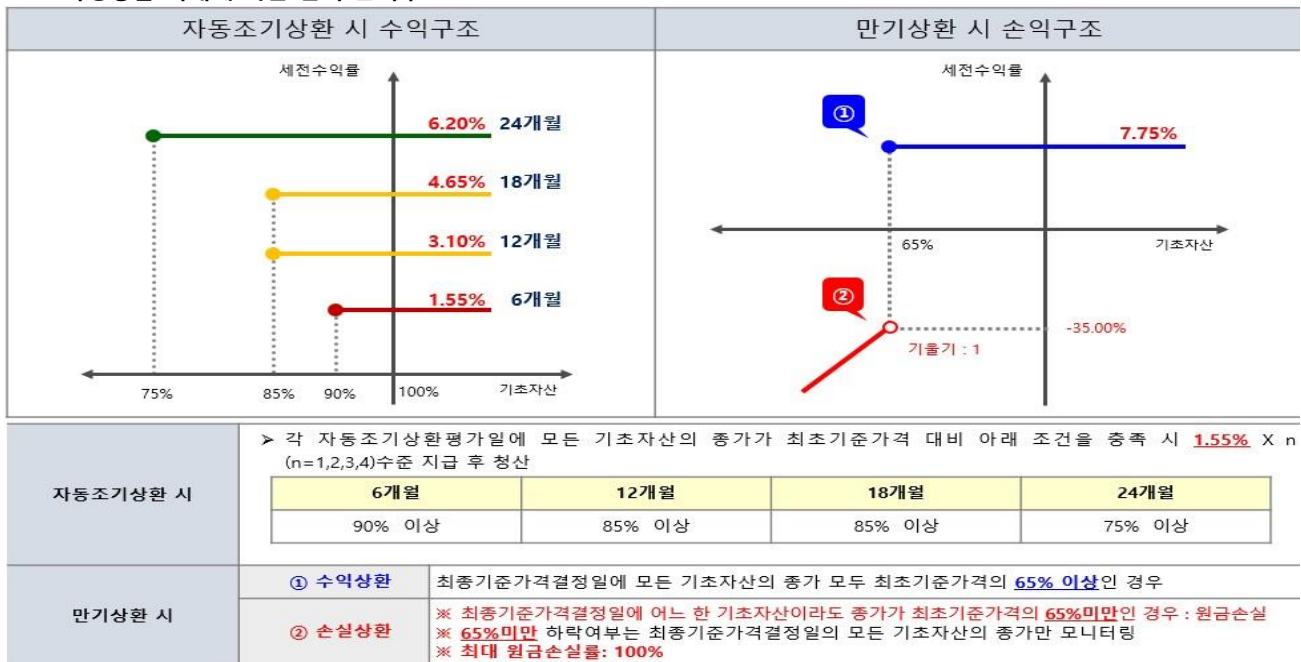
공시일: 2021-03-24

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

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

17

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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

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 1.75% 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 5.25% 수익 지급</p>	<p>만 기 상 환 시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>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

87

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

90

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

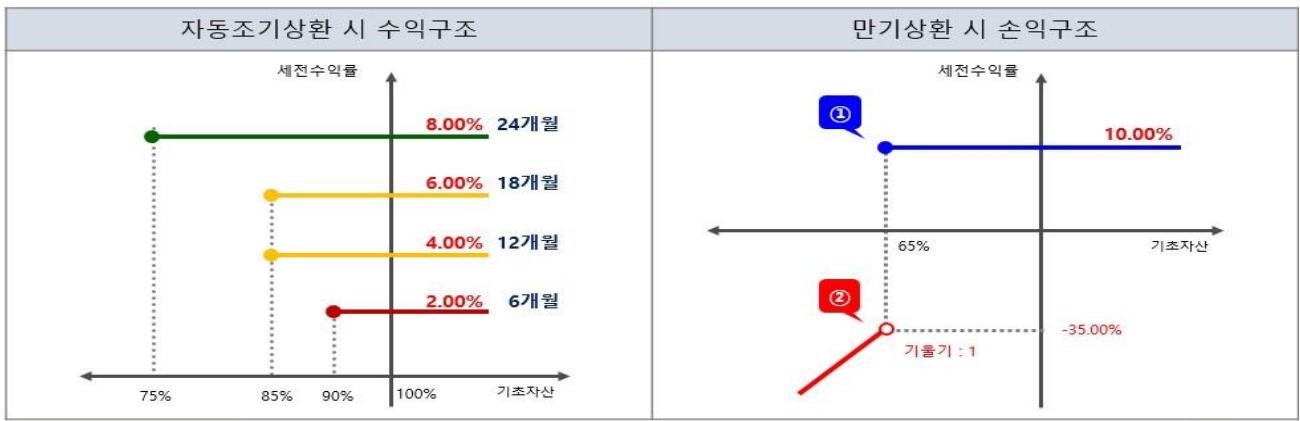
2021-03-24

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



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% 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

138

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

132

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

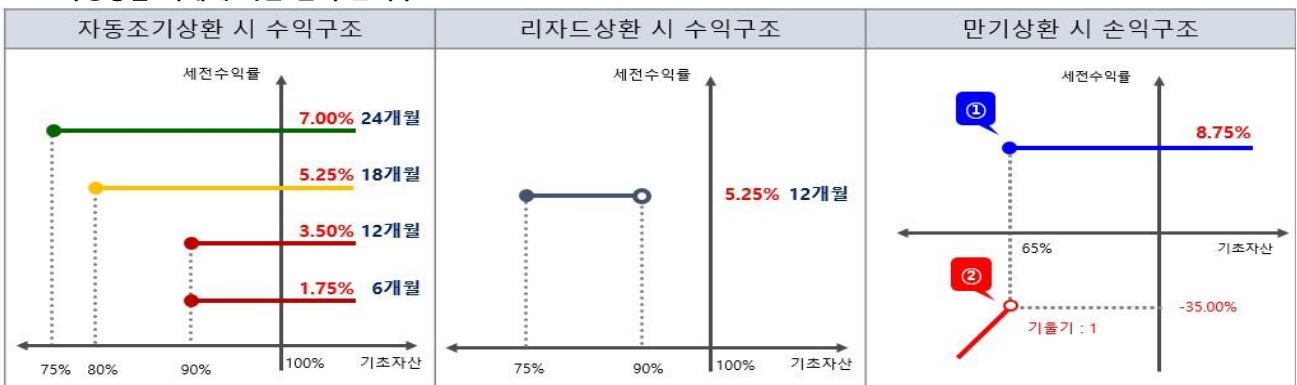
2021-03-24

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

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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>자 동 조 기 상 환 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>리 자 드 상 환 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>만 기 상 환 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

47

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

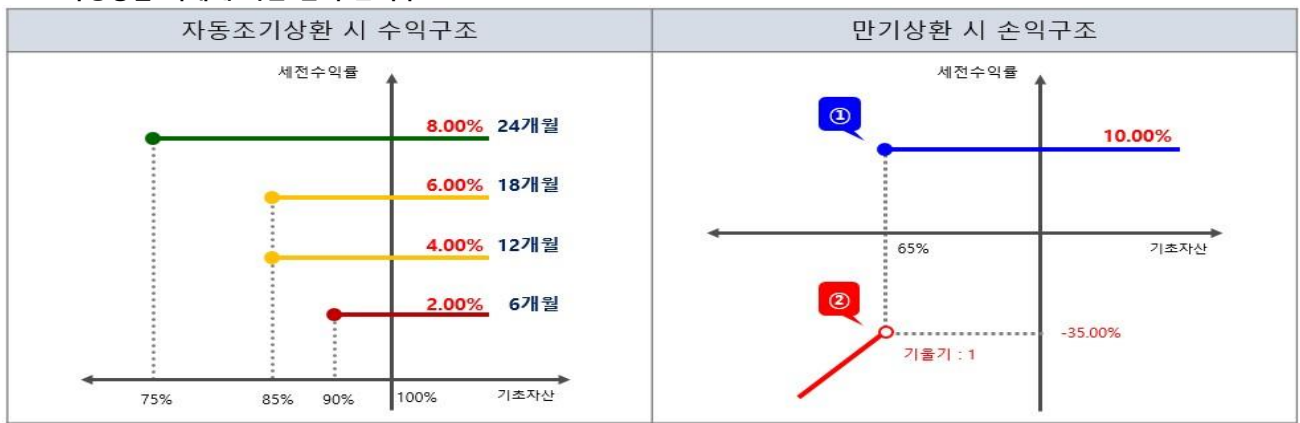
2021-03-24

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

자동조기상환 평가일에 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% 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

78

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

71

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

2021-03-24

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 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>> 각 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.85% 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 총가가 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 총가가 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.55% 수익 지급</p>	<p>만 기 상 환 시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 : ※ 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

78

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

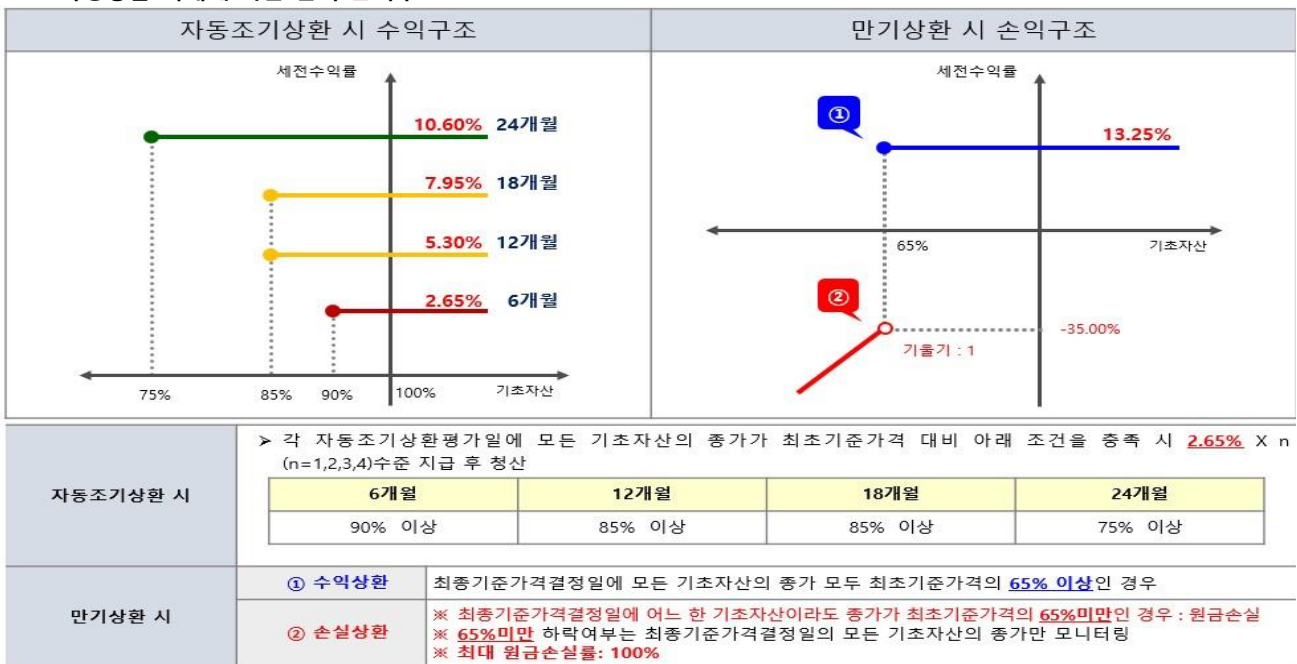
2021-03-24

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

380

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

226

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

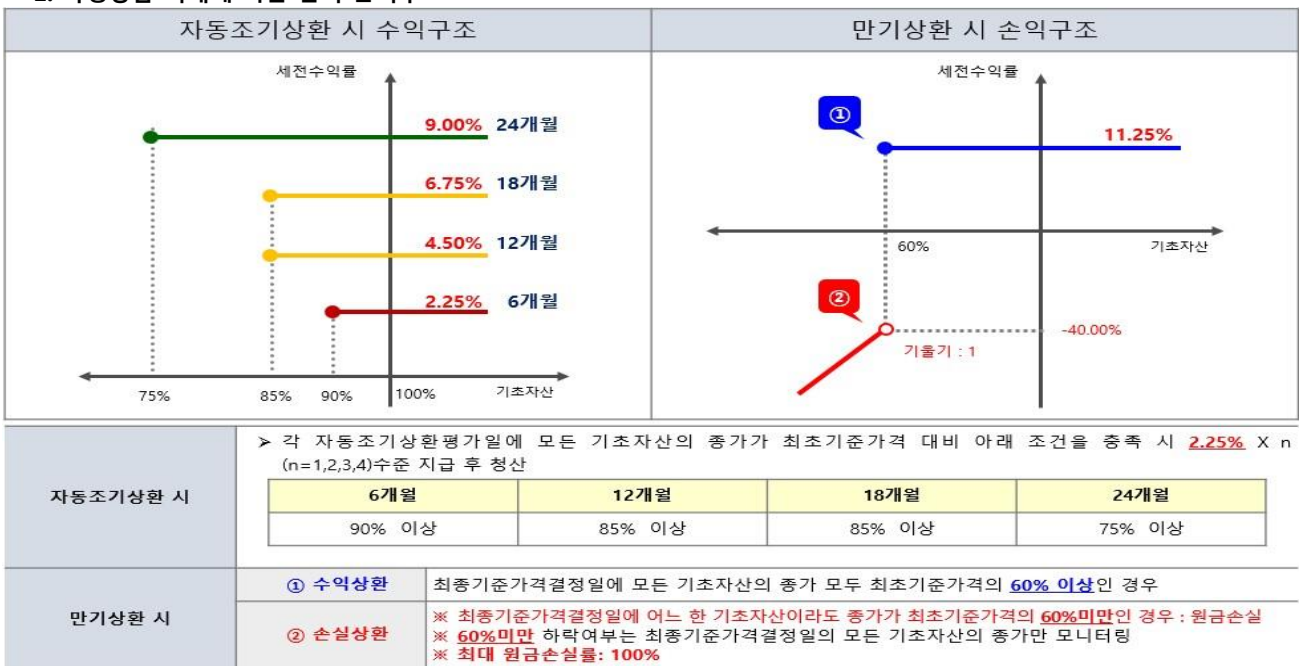
2021-03-24

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

35

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

2021-03-24

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 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.75% 수익 지급</p>	<p>만기 상환 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

135

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

81

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

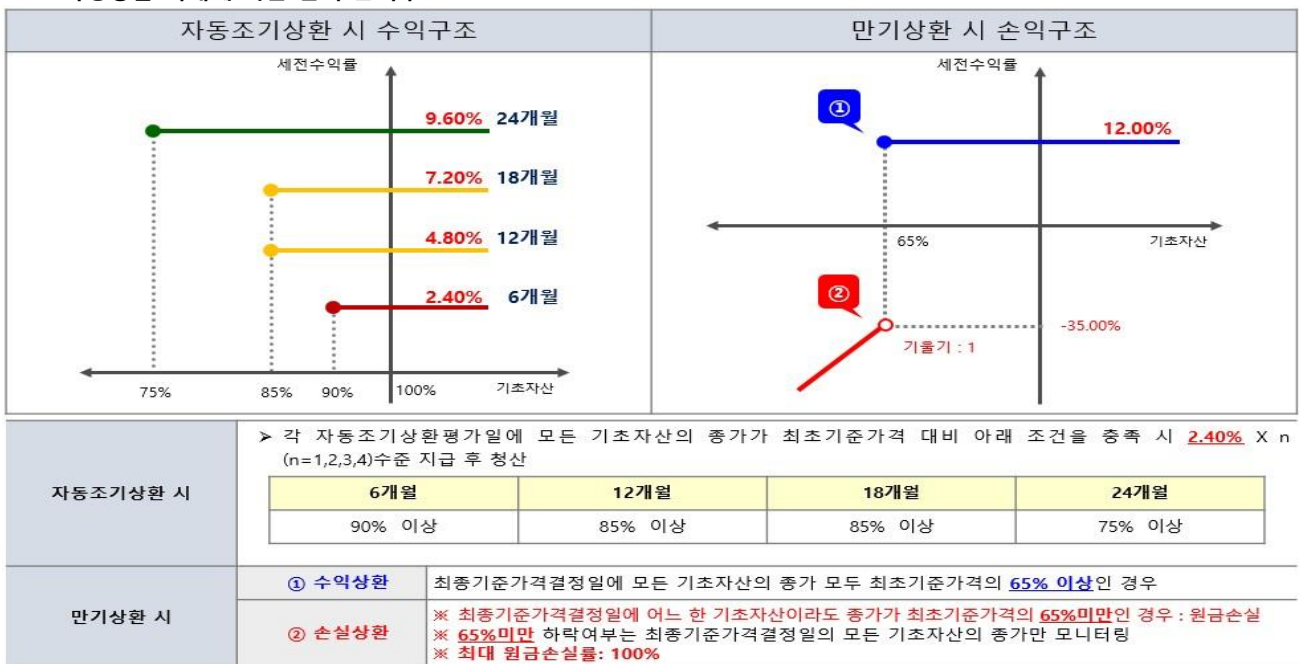
2021-03-24

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

86

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

45

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-5호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

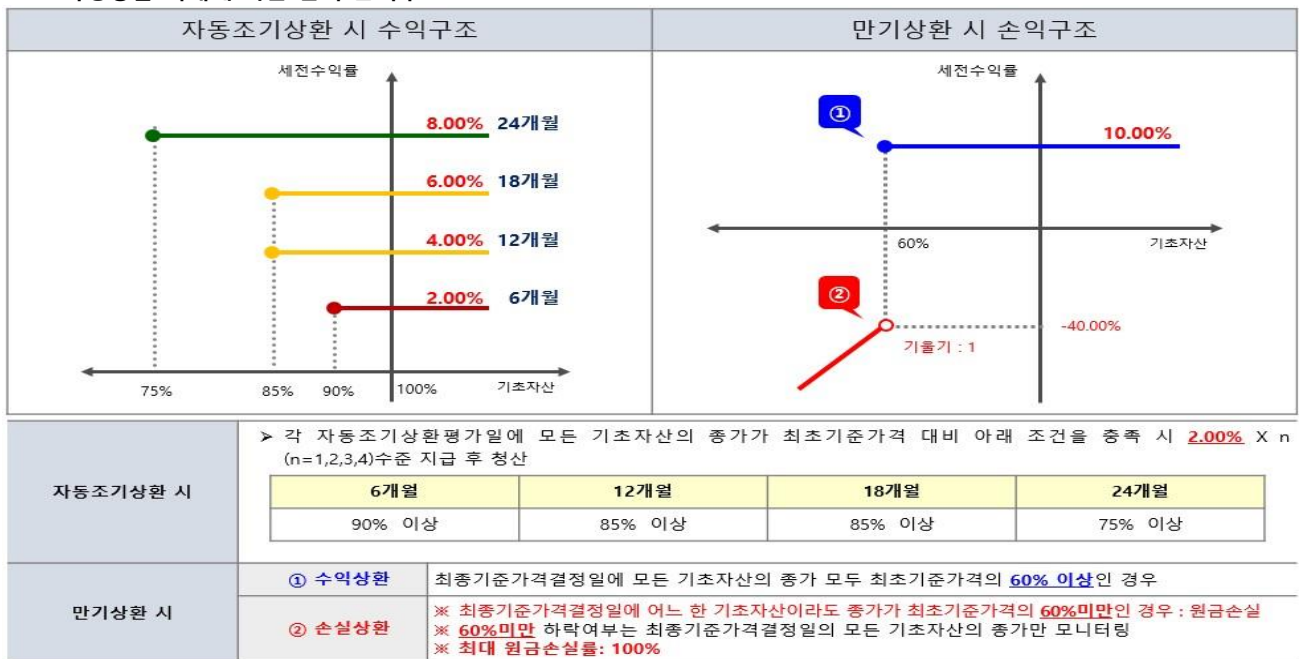
2021-03-24

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

50

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

28

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

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

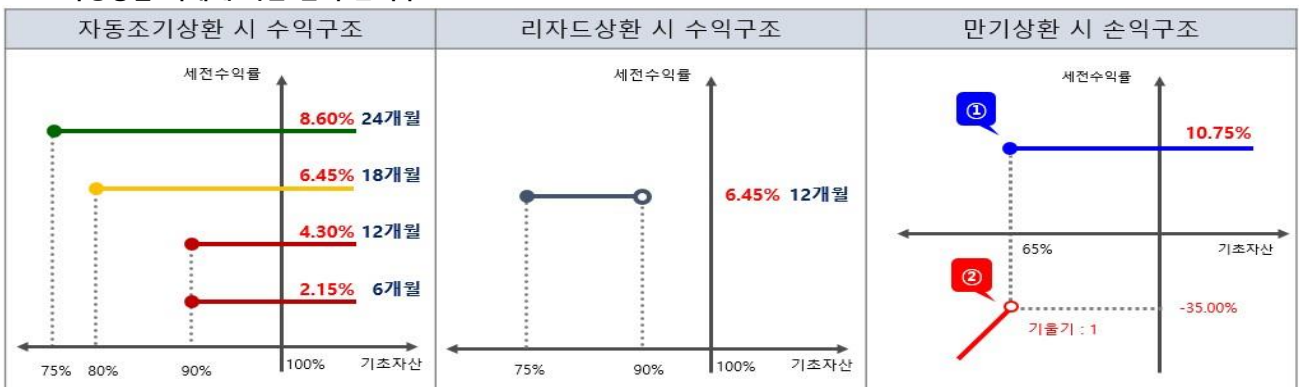
2021-03-24

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%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연6.45% 수익 지급			
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우		
	② 손실상환	※ 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

46

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

37

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

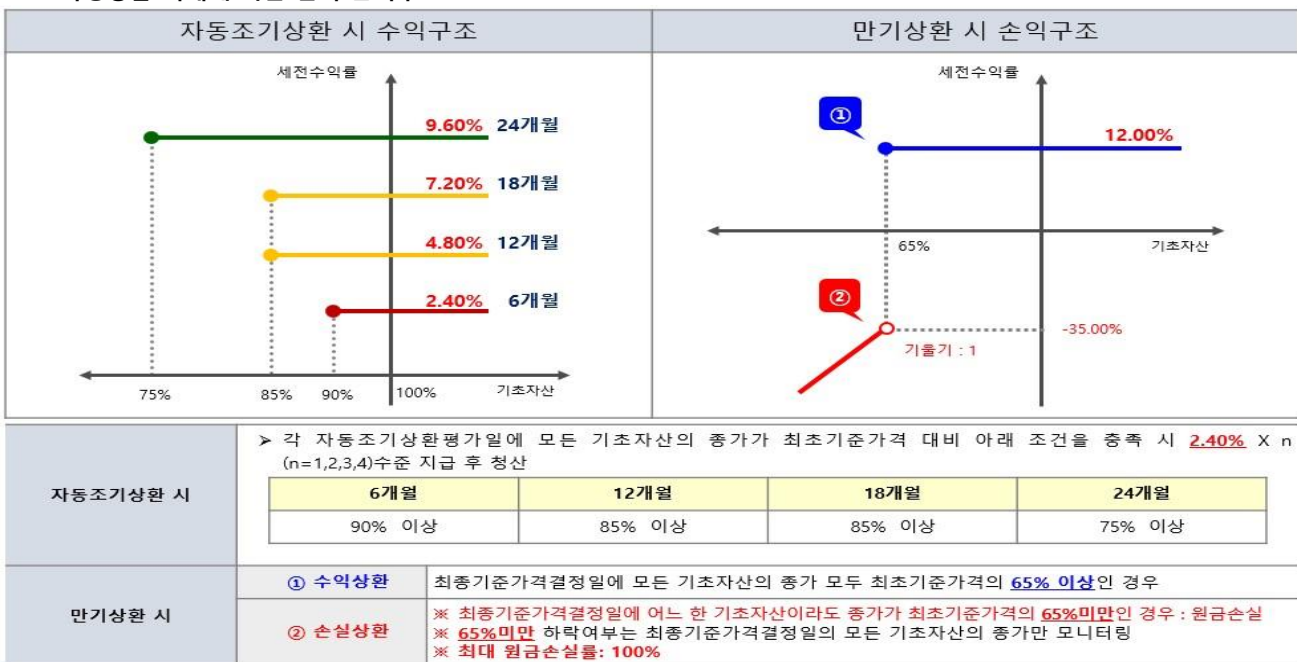
2021-03-24

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

115

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

98

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-03-23

공시일:

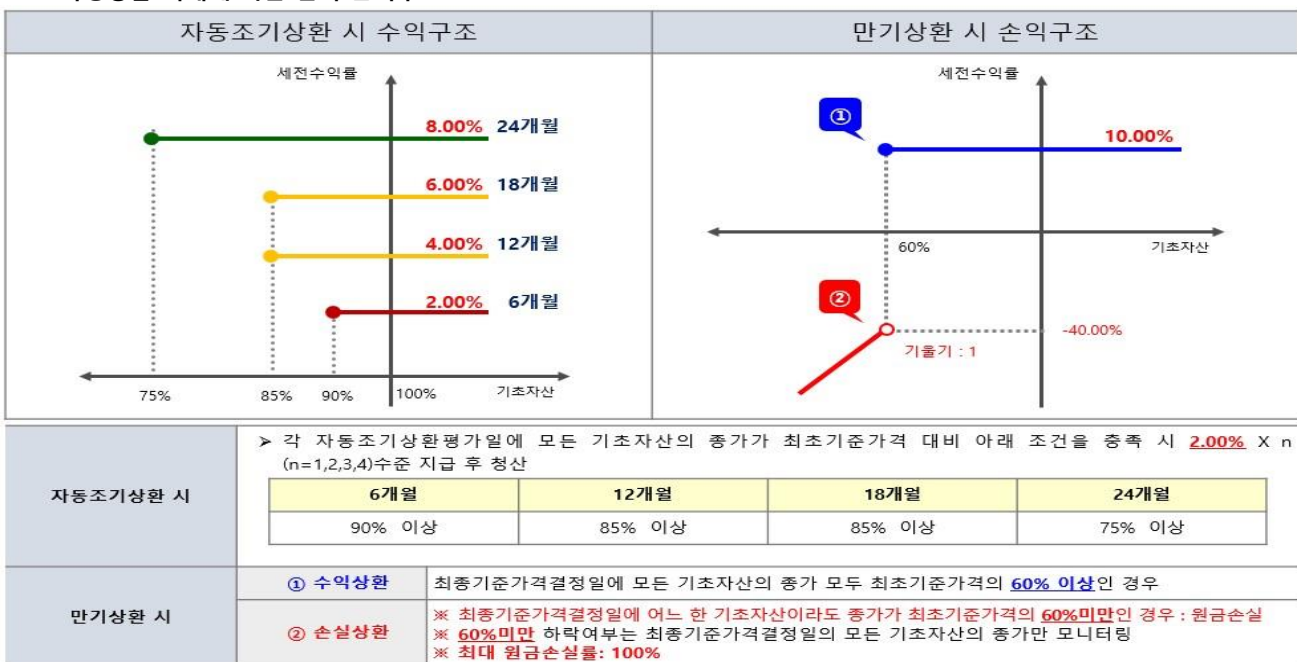
2021-03-24

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

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

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

기준일 : 2021-03-23

공시일: 2021-03-24

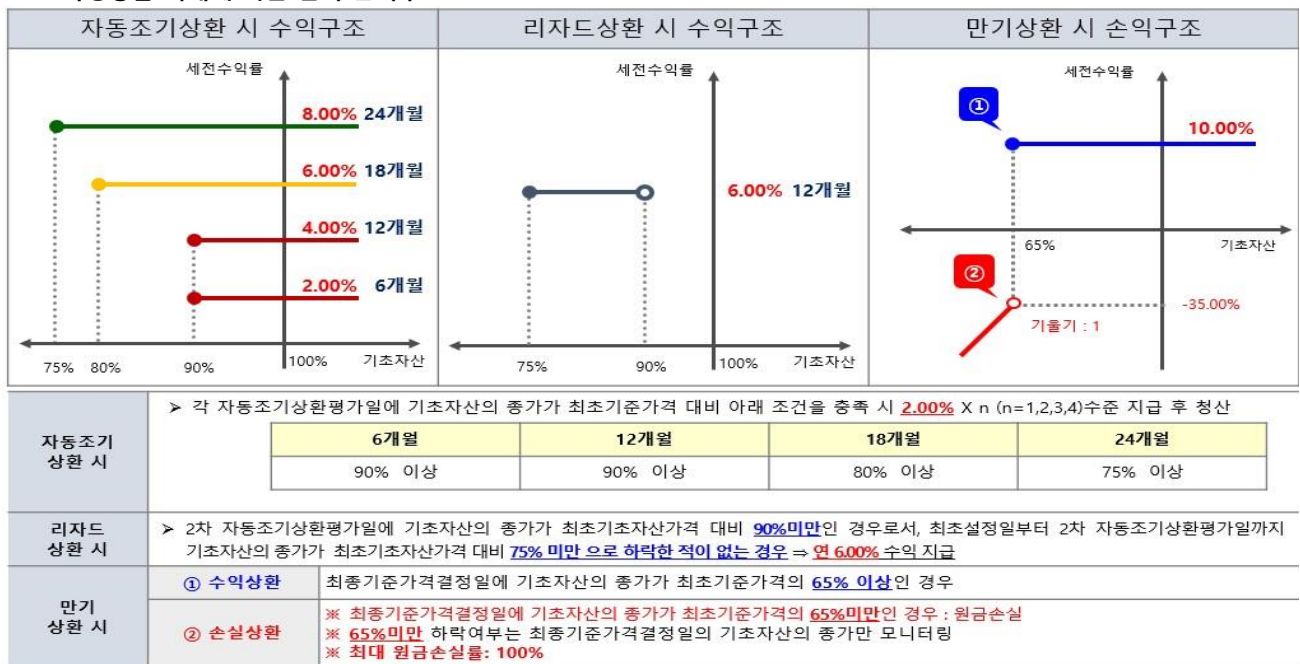
2021-03-24

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	207		207	장외
합계			207		207	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2021-03-23

공시일:

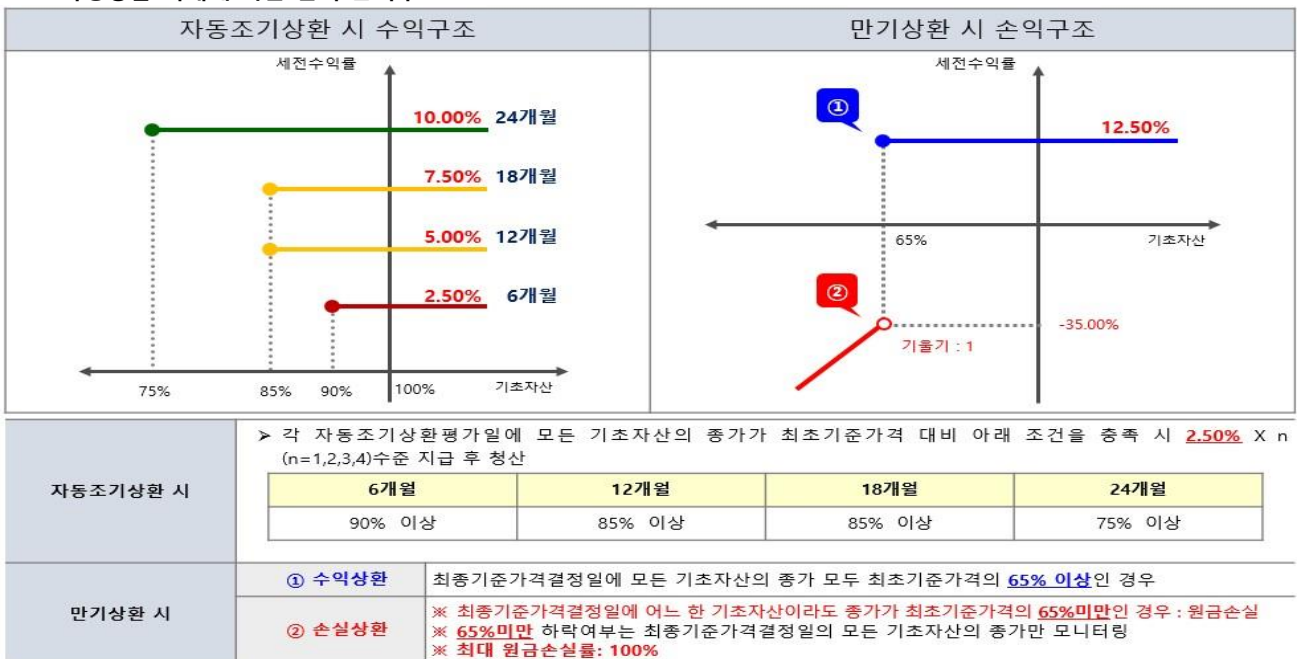
2021-03-24

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	958		958	장외
합계			958		958	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

31