

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 870   | 653   | 218       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 1,849 | 0     | 1,849     | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션   | 7     | 867   | -860      | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션   | 0     | 1,629 | -1,629    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 17    | 20    | -3        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 852   | 36    | 816       | 장내 |
| 합계 |      |      | 2,701 | 1,665 | 1,036     |    |

## 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

186

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

212

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-06-18

공시일:

2021-06-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 196   | 0     | 196       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 6,134 | 0     | 6,134     | 장내 |
| 합계 |      |      | 6,134 | 0     | 6,134     |    |

## 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

490

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

543

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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  | 4,216 |       | 4,216     | 장외 |
| 합계 |      |      | 4,216 |       | 4,216     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>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<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

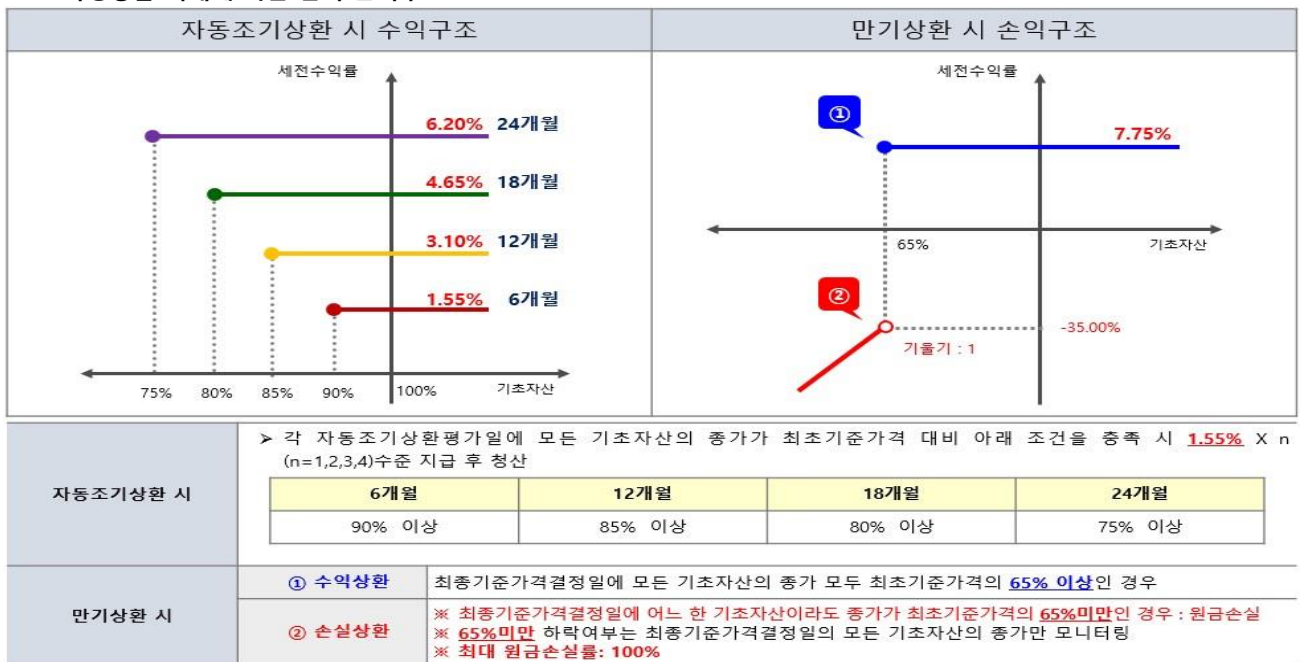
2021-06-21

## 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

4

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

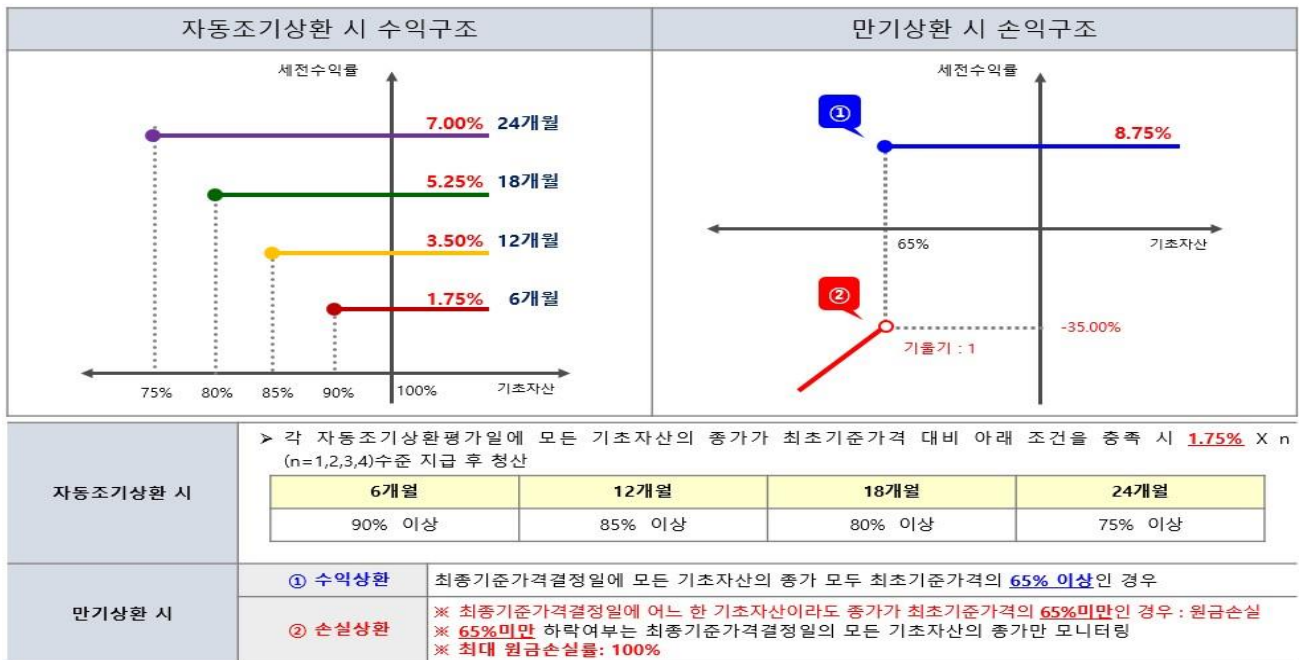
2021-06-21

## 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  | 5,868 |       | 5,868     | 장외 |
| 합계 |      |      | 5,868 |       | 5,868     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

45

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

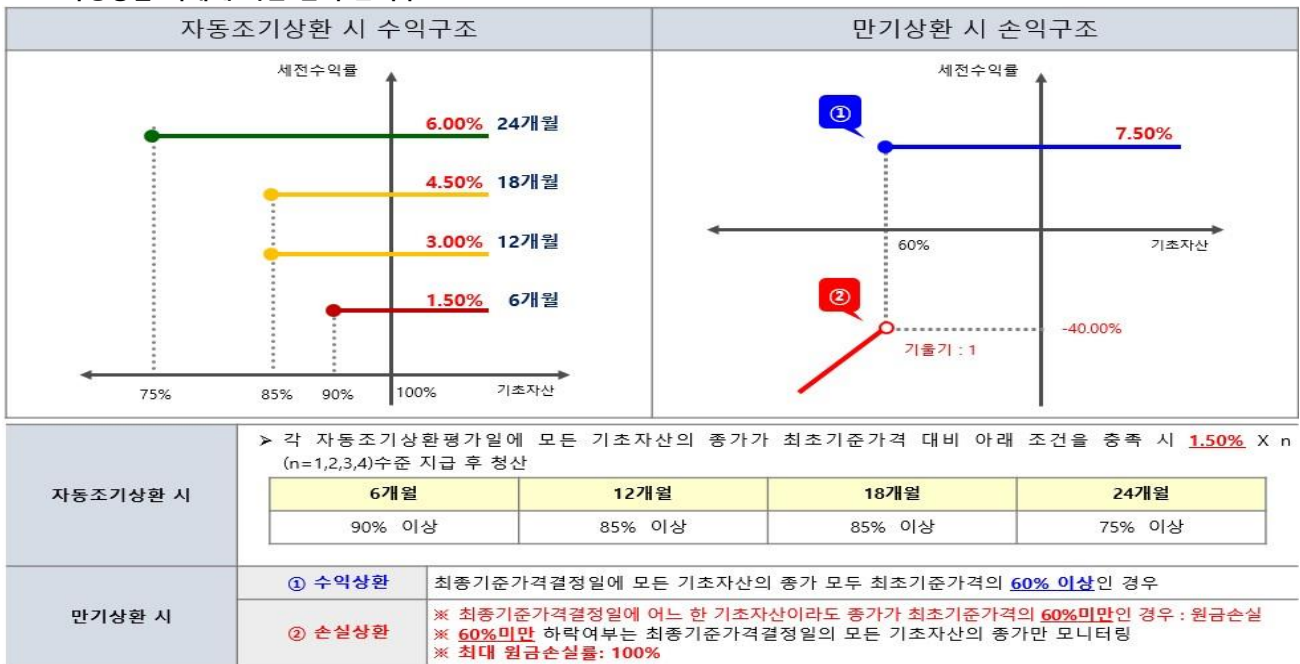
2021-06-21

## 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

18

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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  | 3,184 |       | 3,184     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,184 |       | 3,184     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |  |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |  |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>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<br/>                 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>                 ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

110

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

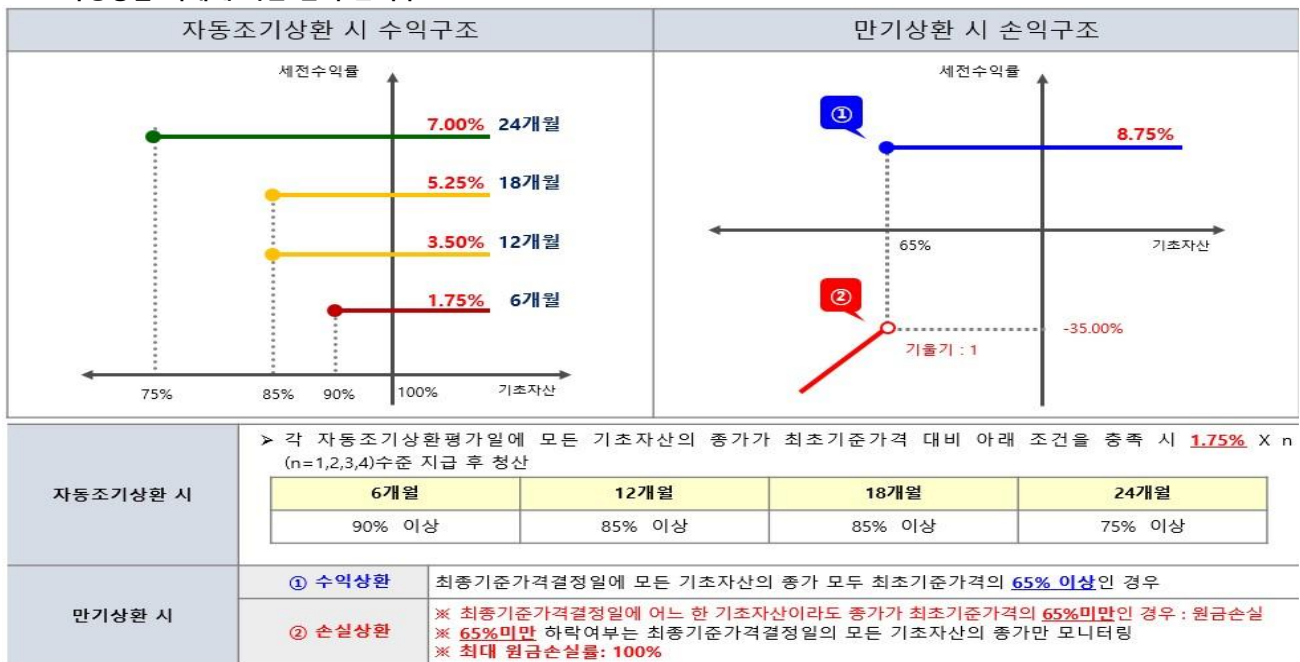
2021-06-21

## 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

61

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

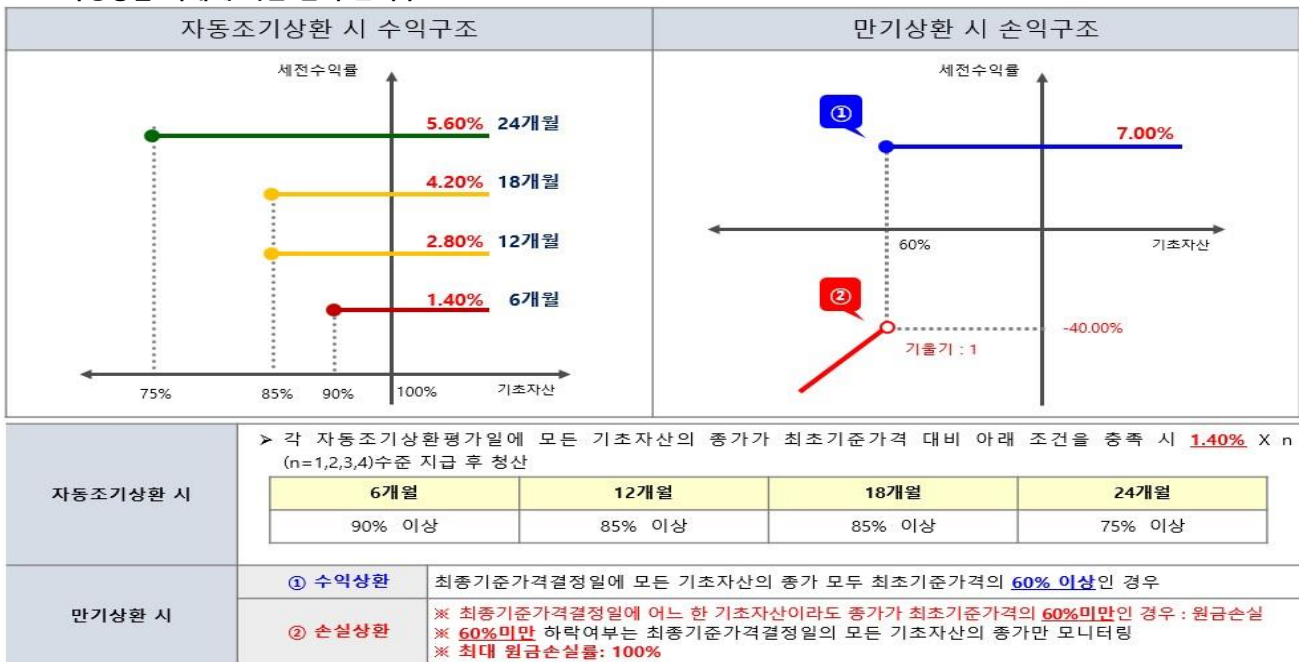
2021-06-21

## 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



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

8

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

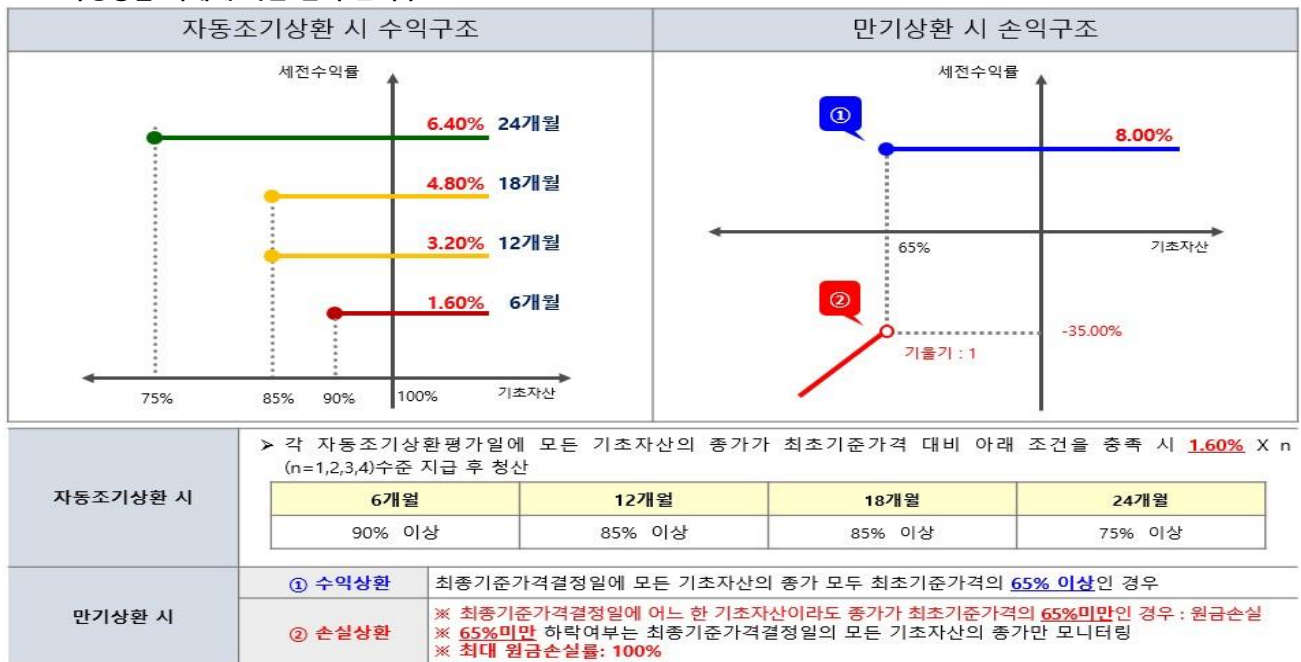
2021-06-21

## 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

24

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>① 수익상환</p> <p>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환</p> <p>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>                 ※ 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)

2

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

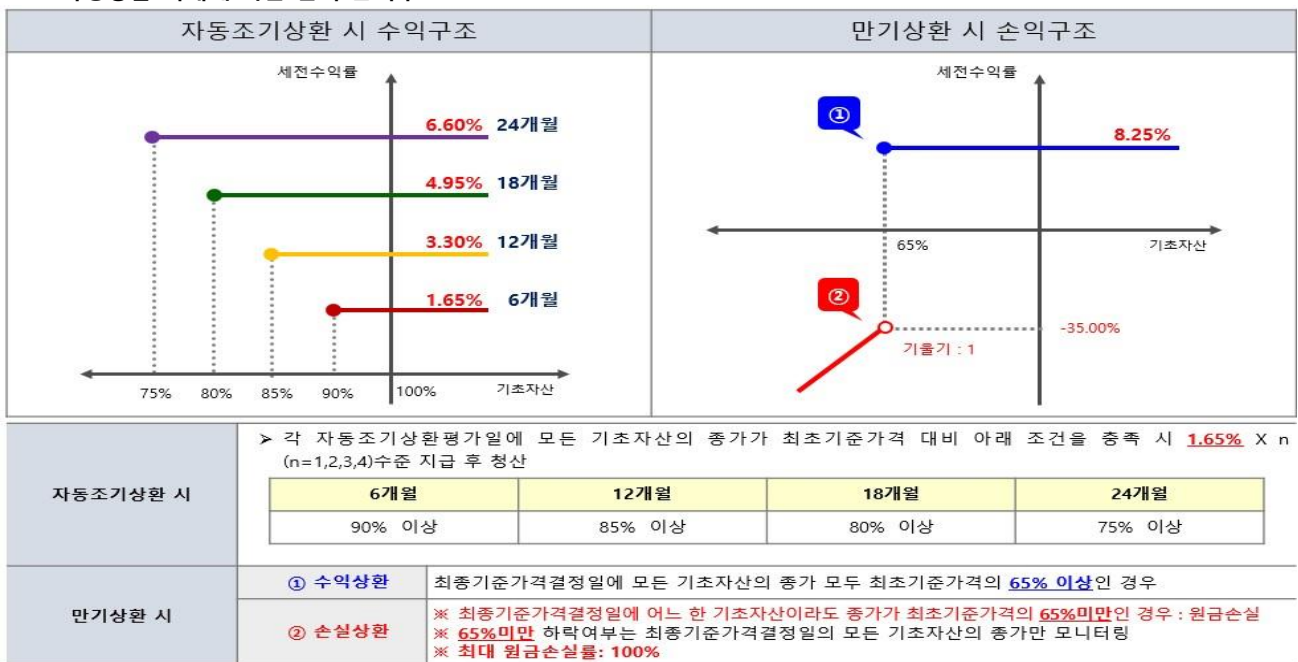
2021-06-21

## 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

47

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

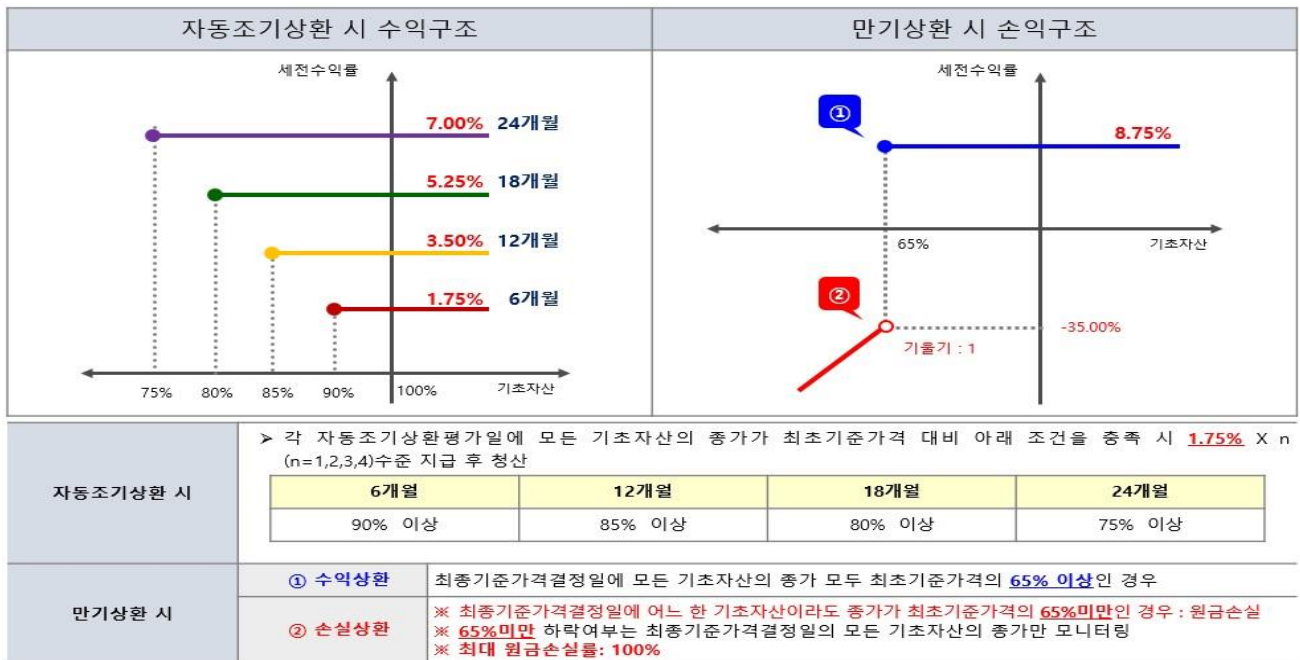
2021-06-21

## 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

75

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

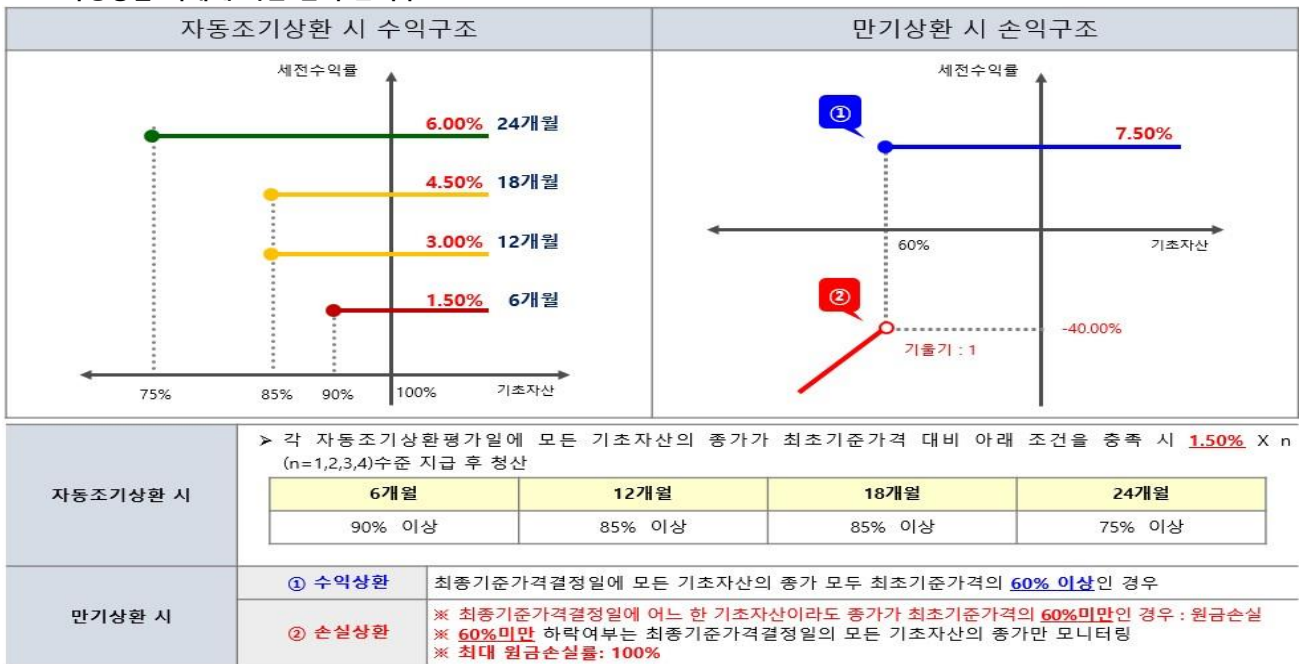
2021-06-21

## 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

36

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>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<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

161

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

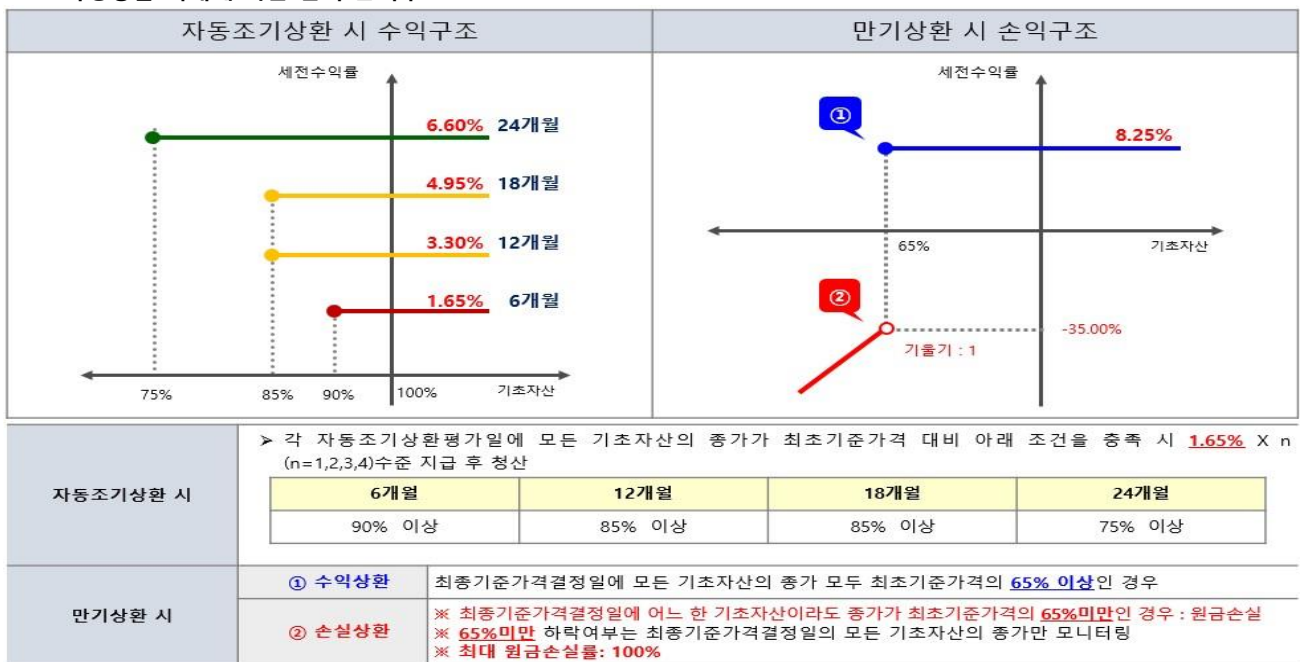
2021-06-21

## 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  | 547   |       | 547       | 장외 |
| 합계 |      |      | 547   |       | 547       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

47

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

5

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

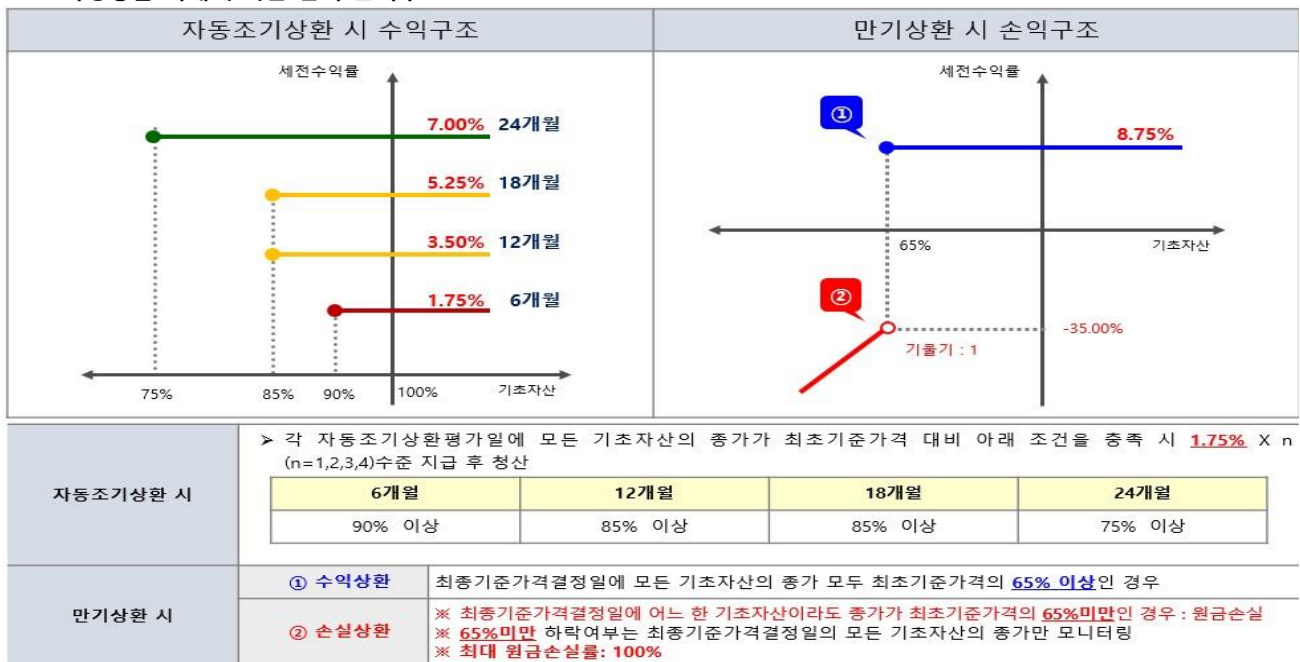
2021-06-21

## 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

177

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

19

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환<br/>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환<br/>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |  |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

167

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

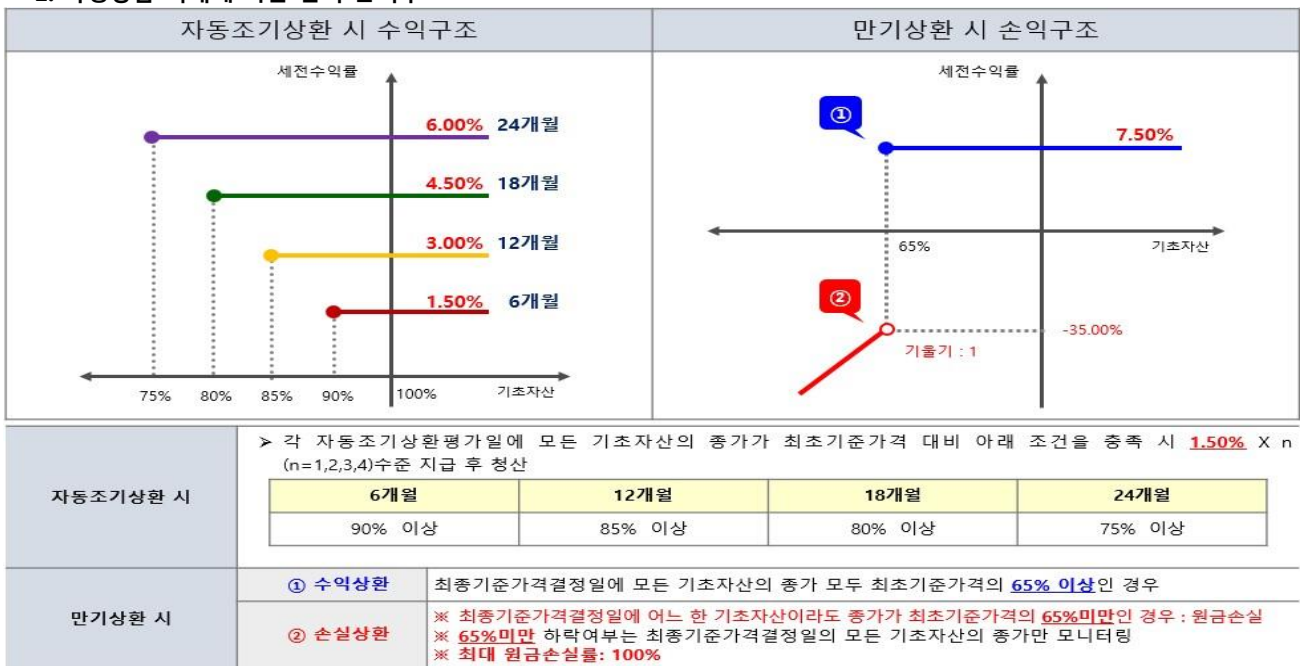
2021-06-21

## 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

38

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

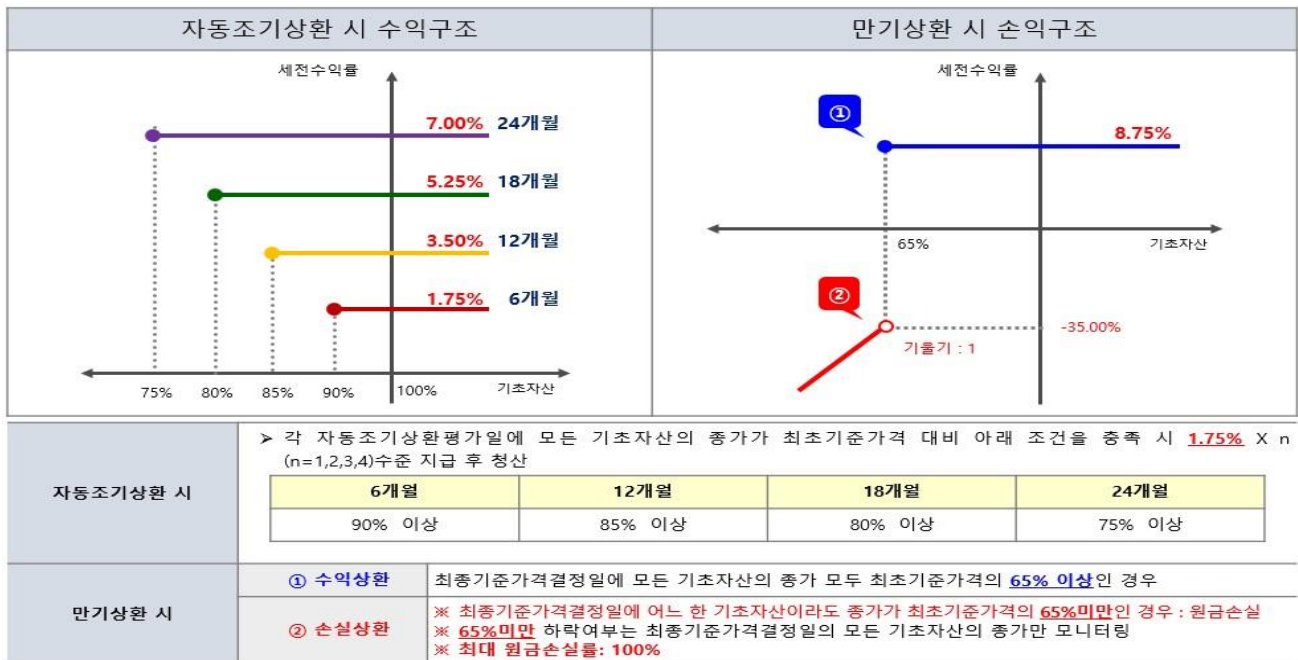
2021-06-21

## 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

181

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

28

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table> | 6개월          | 12개월        | 18개월   | 24개월 | 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | <p>리<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급</p> | <p>만<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 :<br/>                     ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                     ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br/>                     ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |   |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

101

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

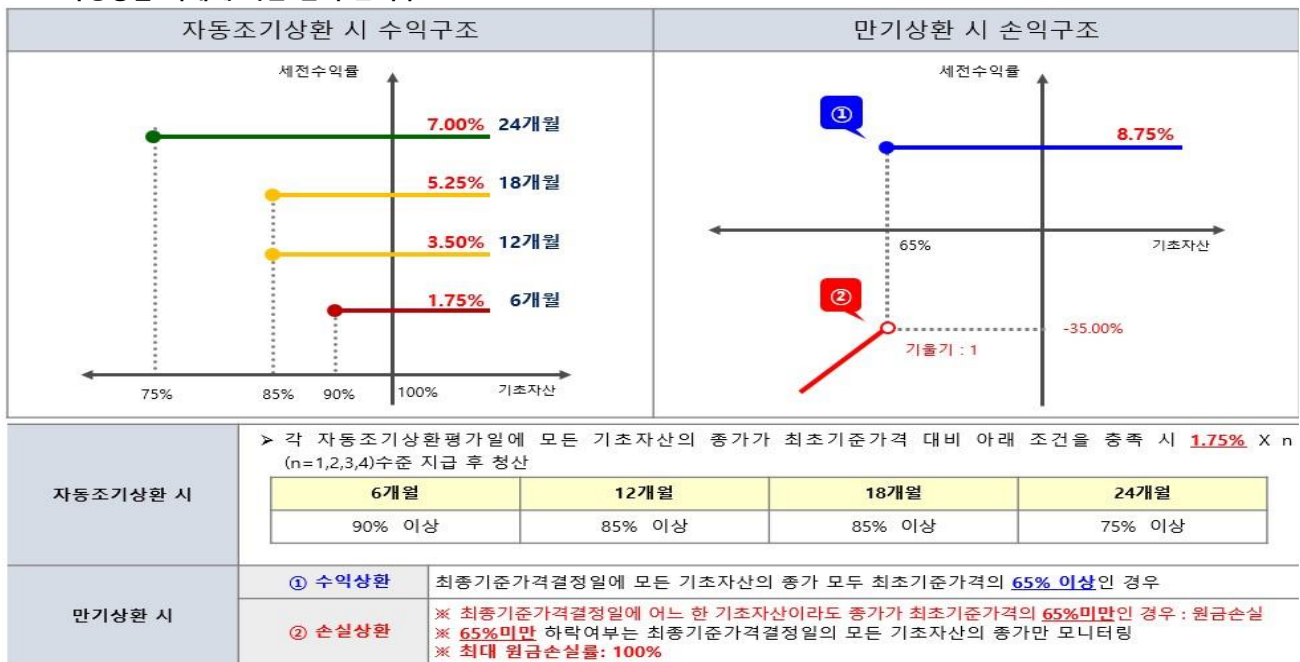
2021-06-21

## 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

56

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

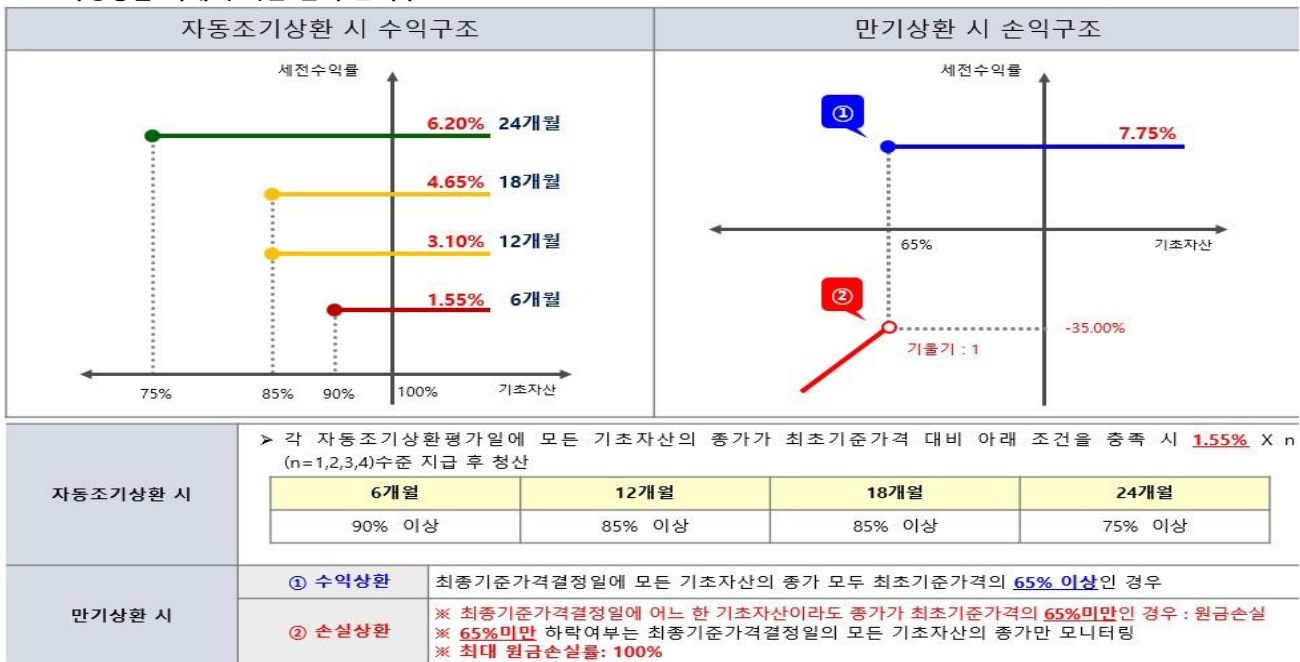
2021-06-21

## 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

13

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

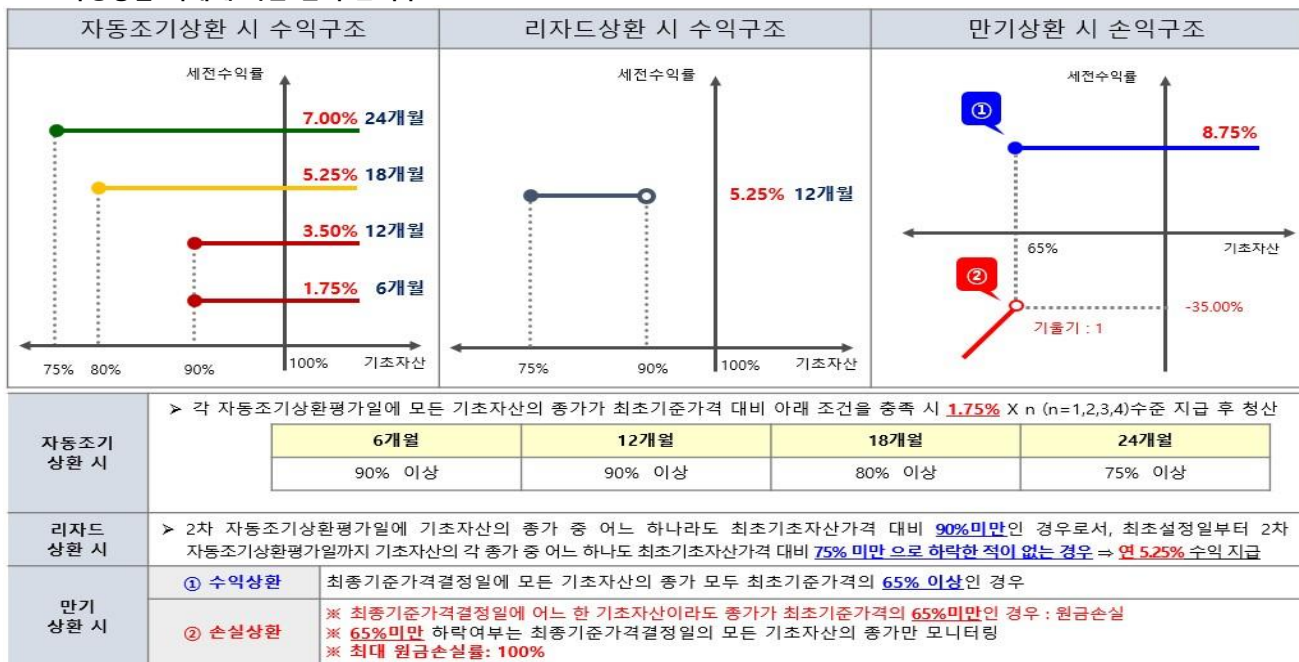
2021-06-21

## 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  | 1,218 |       | 1,218     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,218 |       | 1,218     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

56

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

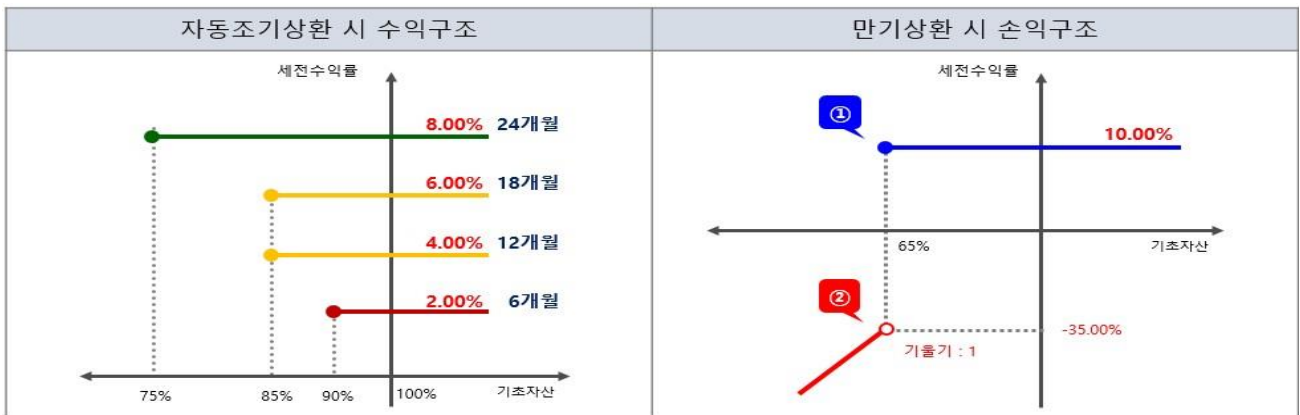
2021-06-21

## 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

103

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

54

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

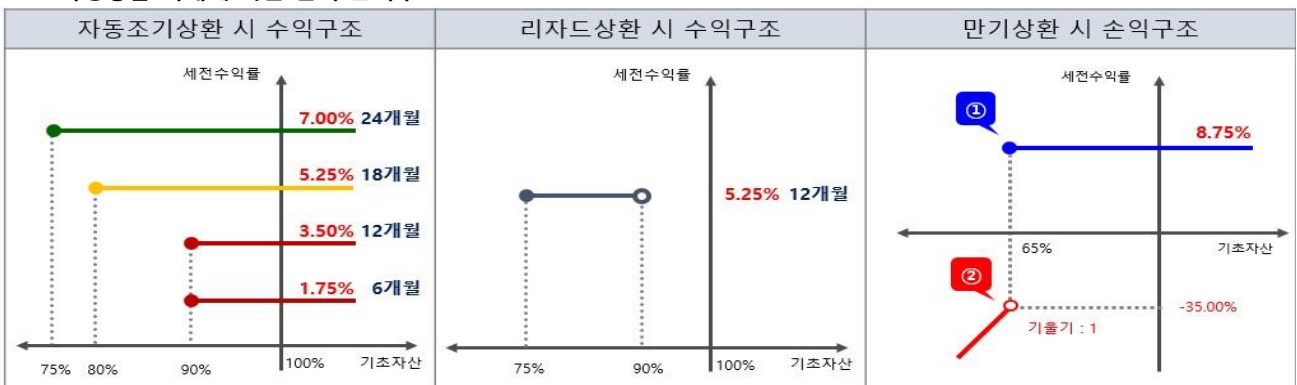
2021-06-21

## 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<br>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br>※ 최대 원금손실률: 100% |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

10

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

2021-06-21

## 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<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>                     &gt; 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<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>                     &gt; 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<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>                     ① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우<br/>                     ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                     ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 총가만 모니터링<br/>                     ※ 최대 원금손실률: 100%                 </p> |
| 6개월  | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |  |  |
| 90% 이상   | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |  |  |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

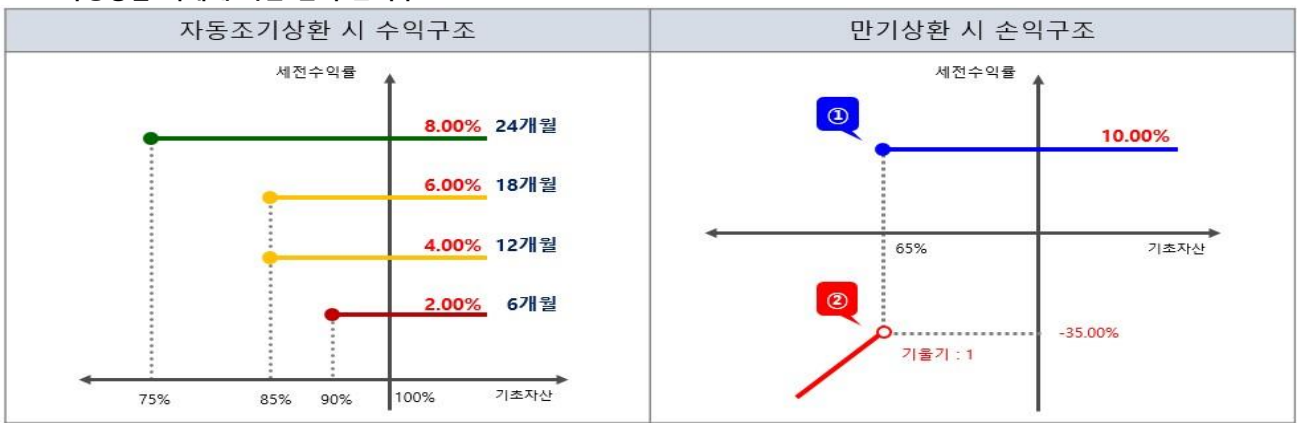
2021-06-21

## 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% 이상인 경우   |
| ② 손실상환 | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br>※ 최대 원금손실률: 100% |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

80

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

50

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

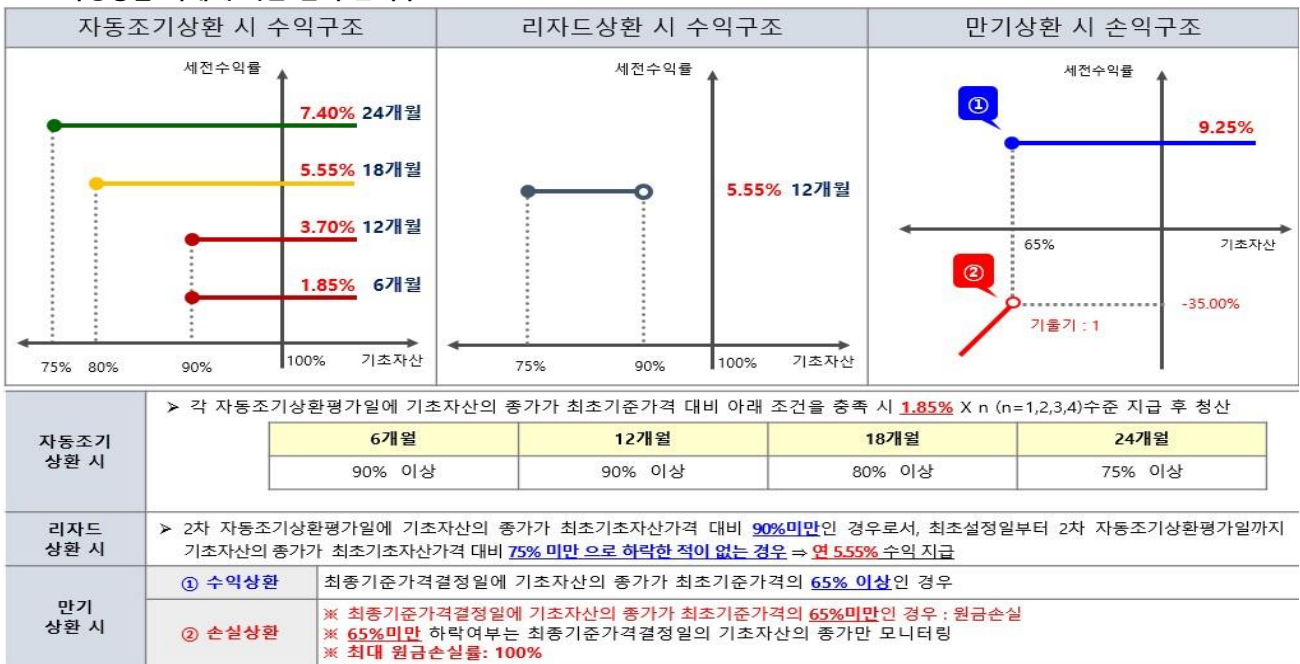
2021-06-21

## 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

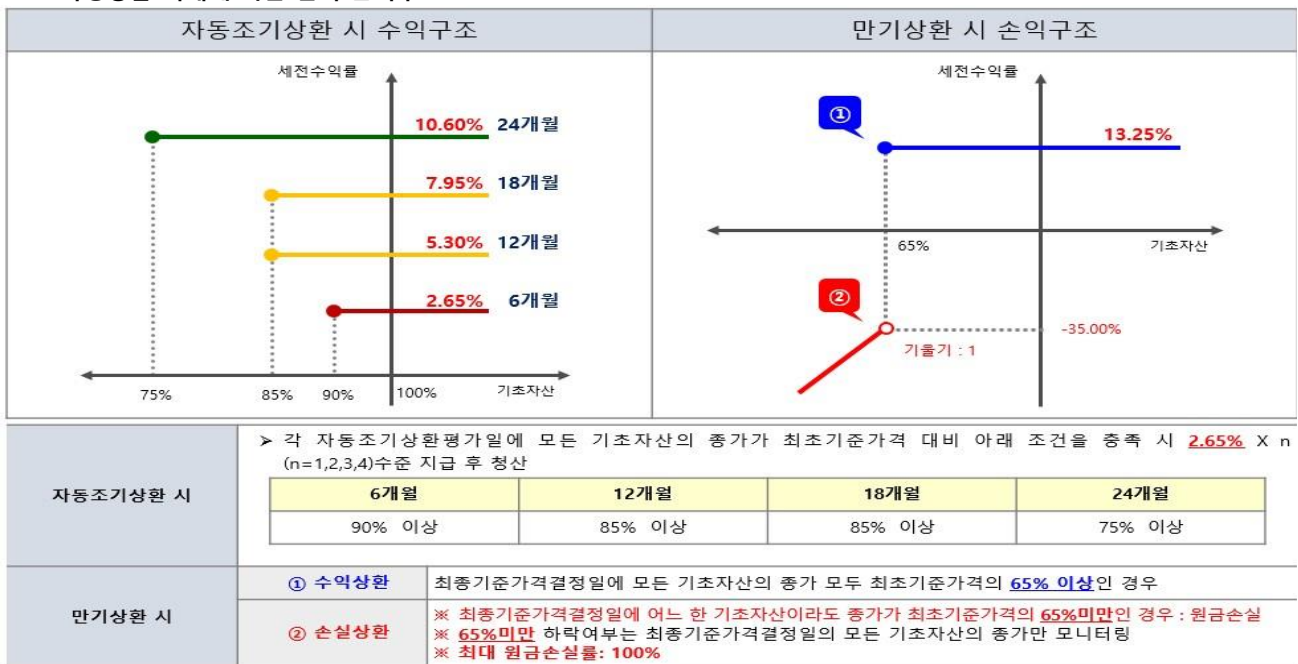
2021-06-21

## 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

245

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

104

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

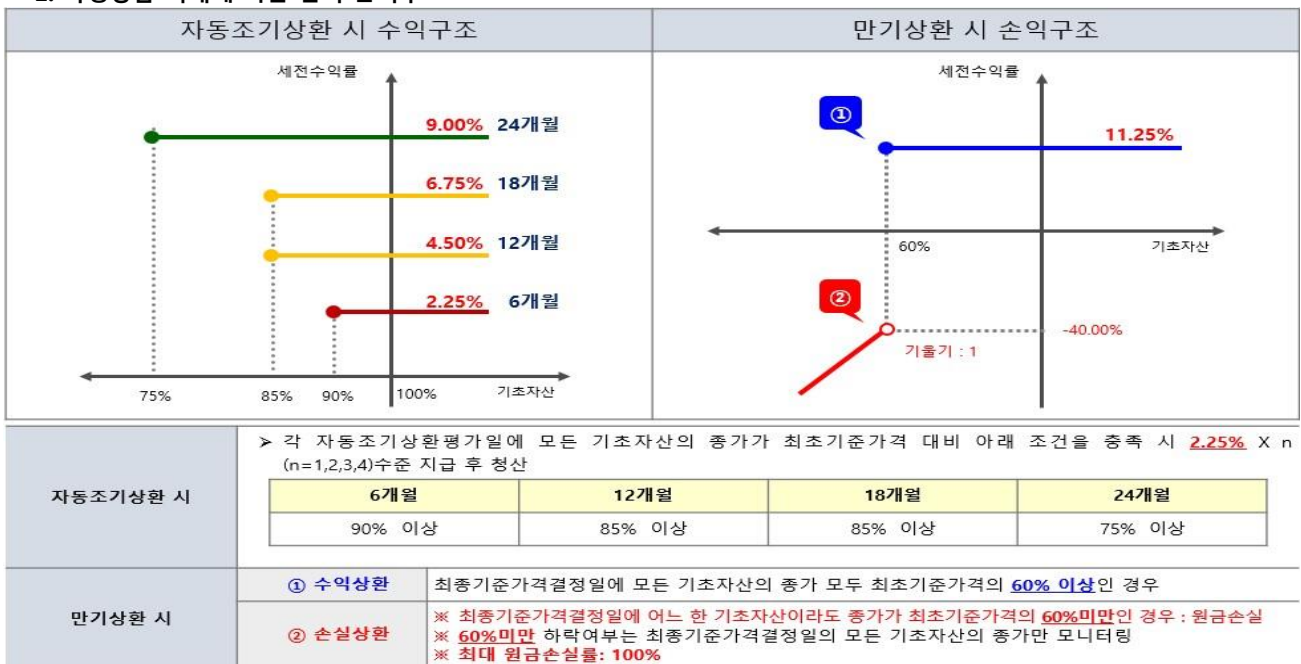
2021-06-21

## 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

21

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

2021-06-21

## 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>&gt; 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>&gt; 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</p> <p>② 손실상환 :<br/>                     ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                     ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br/>                     ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월  | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |  |   |
| 90% 이상   | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |  |   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

63

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

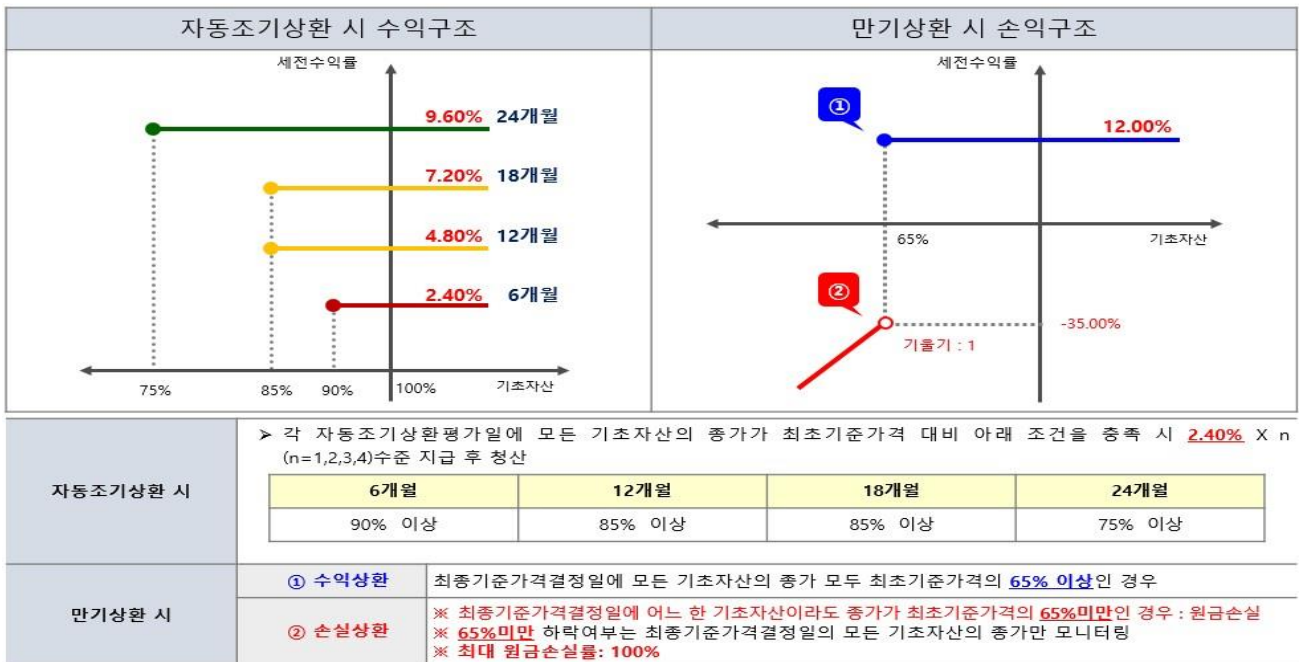
2021-06-21

## 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  | 1,550 |       | 1,550     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,550 |       | 1,550     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

113

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

38

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-5호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

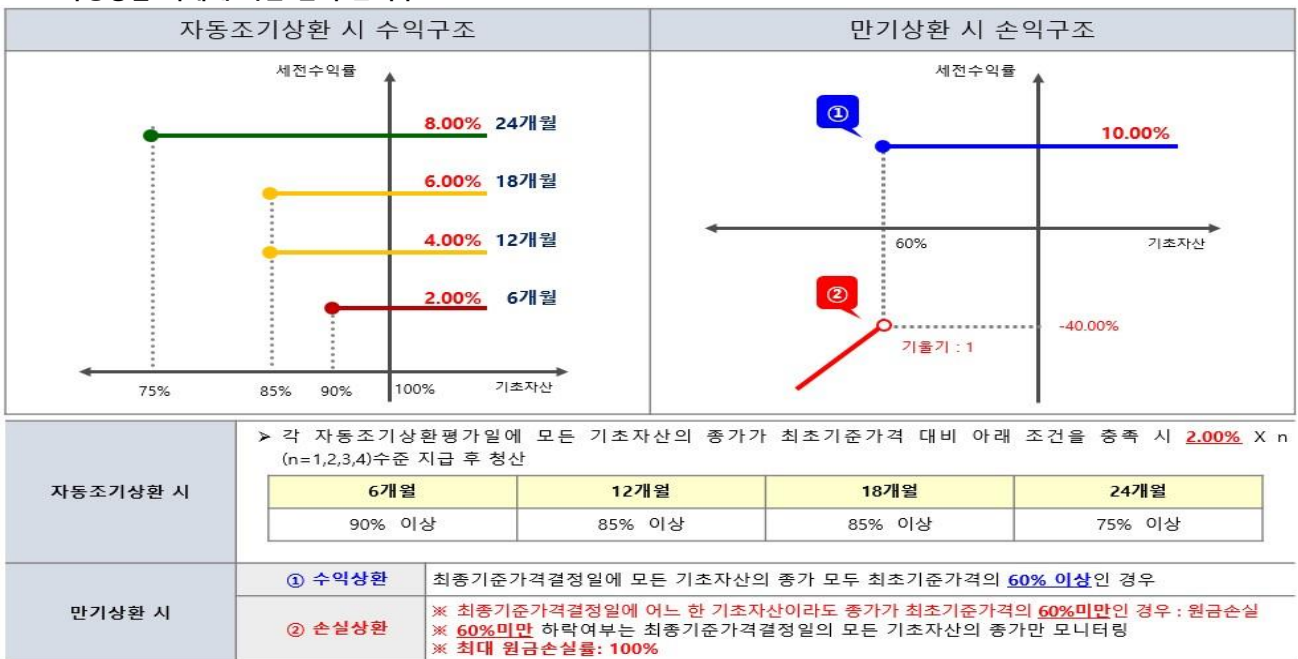
2021-06-21

## 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  | 902   |       | 902       | 장외 |
| 합계 |      |      | 902   |       | 902       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

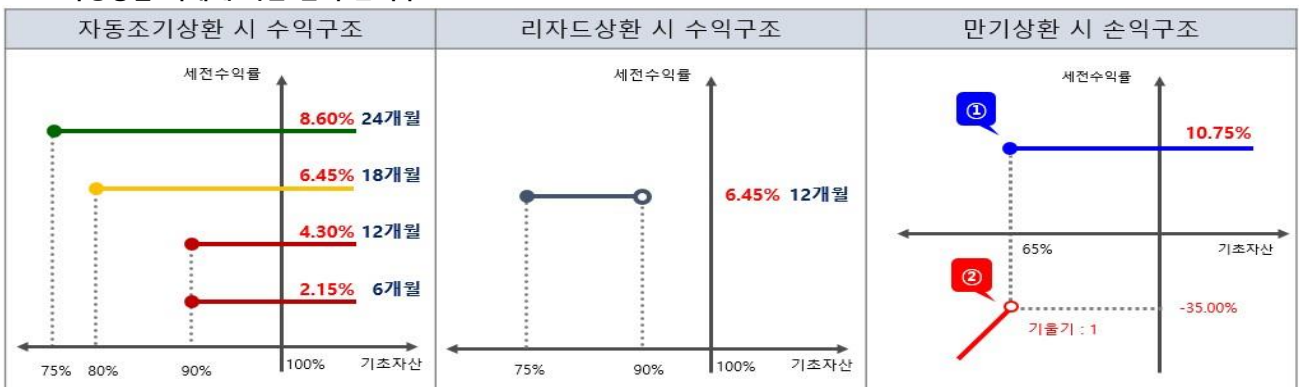
2021-06-21

## 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 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>2.15%</b> 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 <b>90%미만</b> 인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>75% 미만</b> 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>6.45%</b> 수익 지급 |  |        |        |
| 만기상환 시   | ① 수익상환  | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우   |        |        |
|          | ② 손실상환  | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실<br>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

39

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

17

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

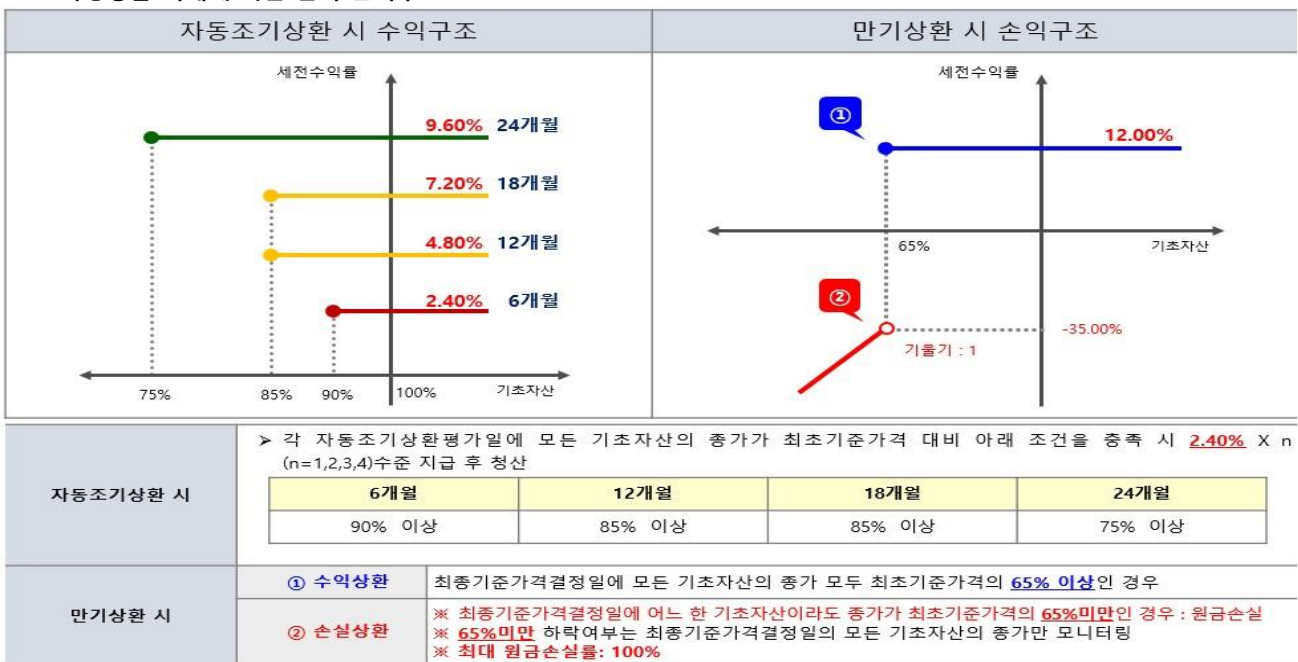
2021-06-21

## 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

74

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

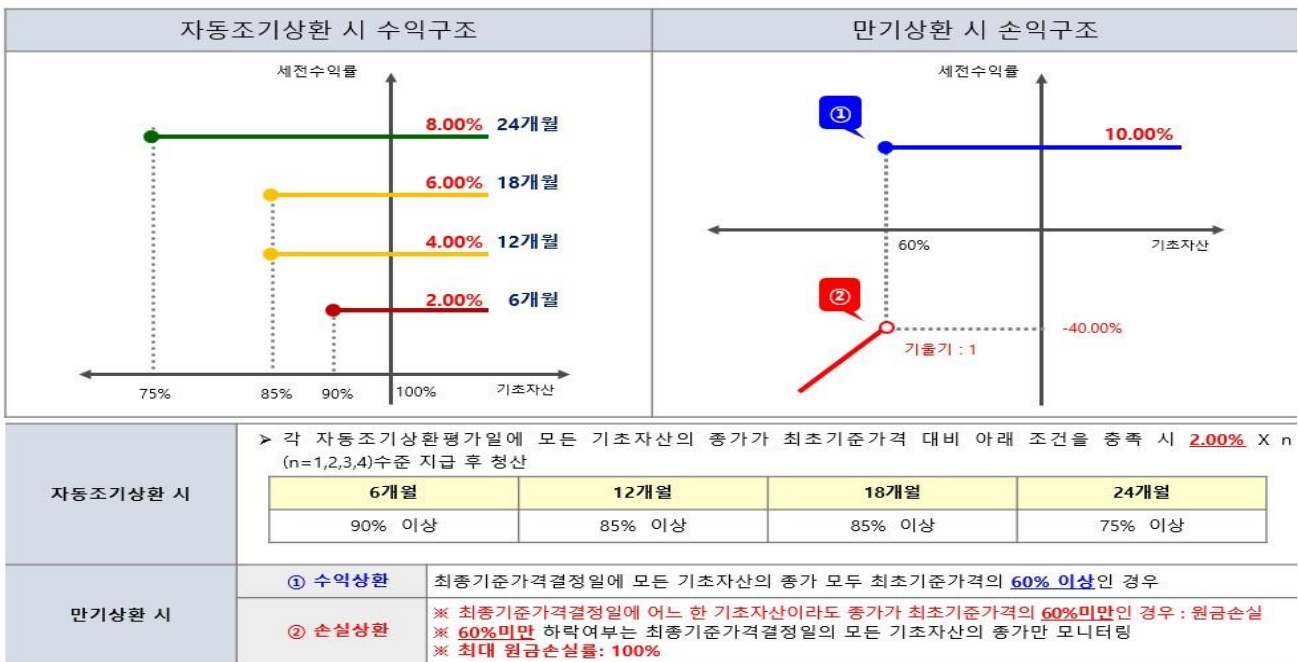
2021-06-21

## 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

10

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

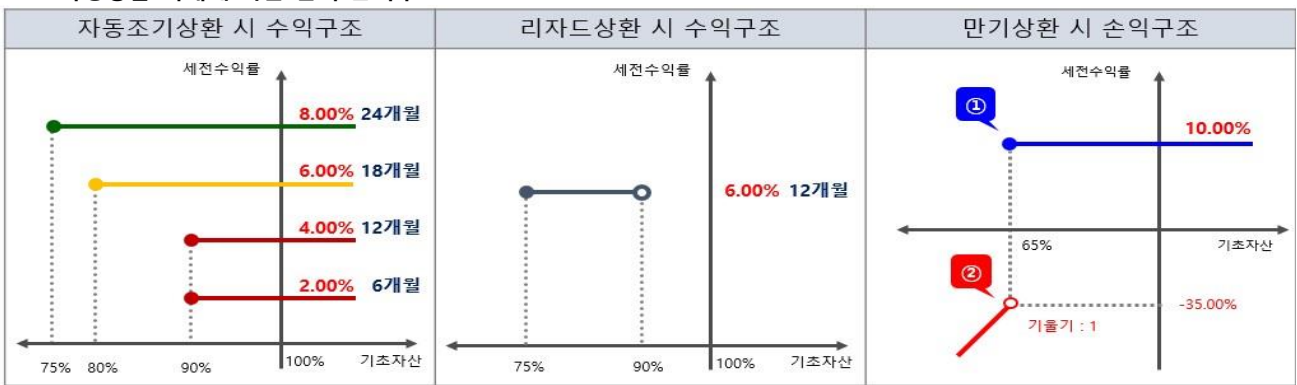
2021-06-21

## 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



|          |   |  |        |        |
|----------|---|--|--------|--------|
| 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<br>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ 최대 월급손실률: 100% |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

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

기준일 : 2021-06-18

공시일:

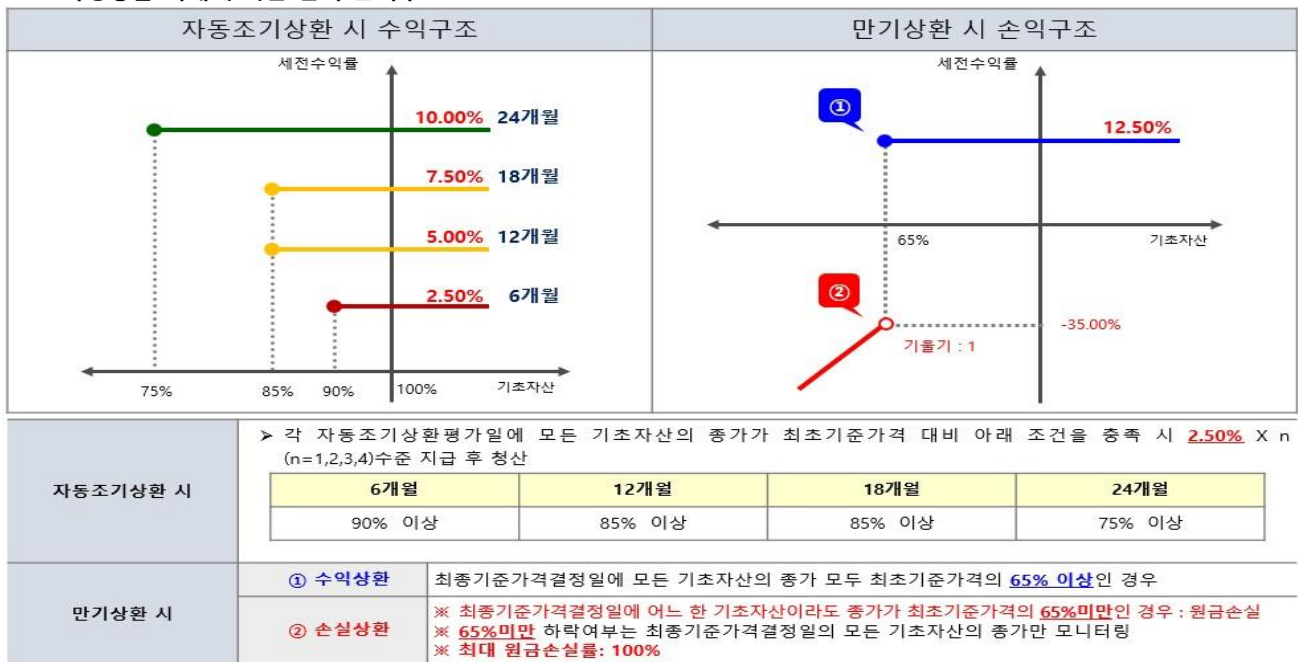
2021-06-21

## 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

65

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

27

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권SHE(KRW)-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

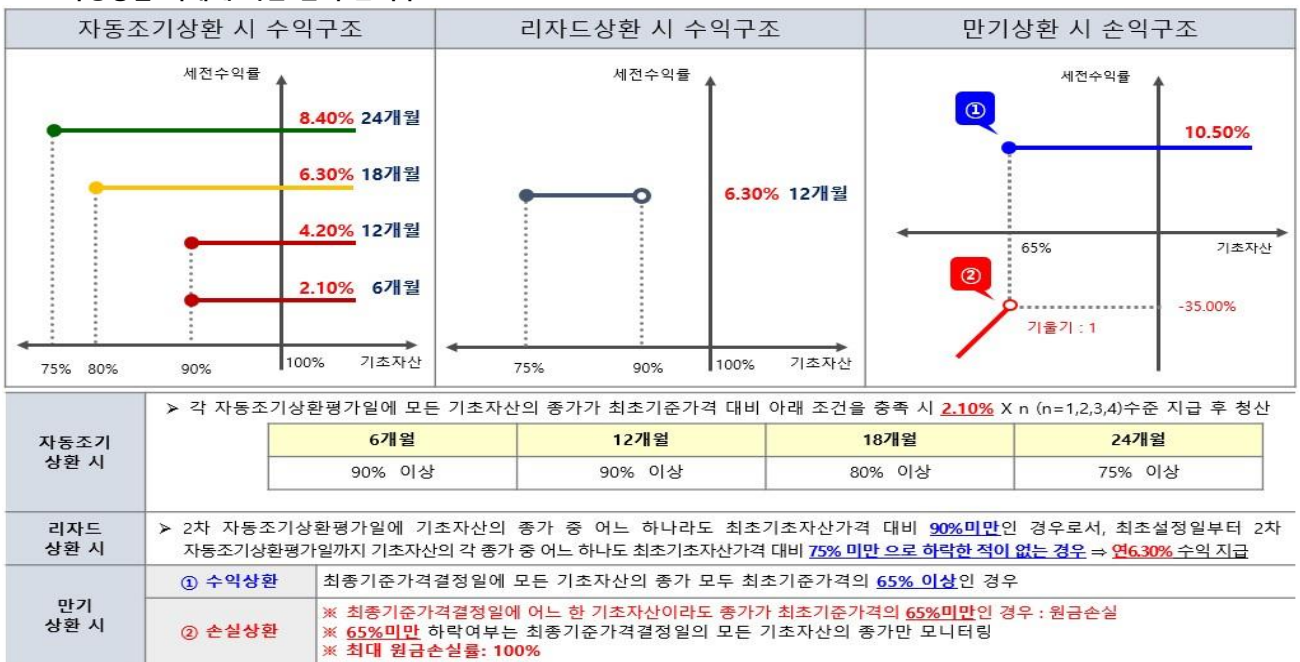
2021-06-21

## 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  | 200   |       | 200       | 장외 |
| 합계 |      |      | 200   |       | 200       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-7호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

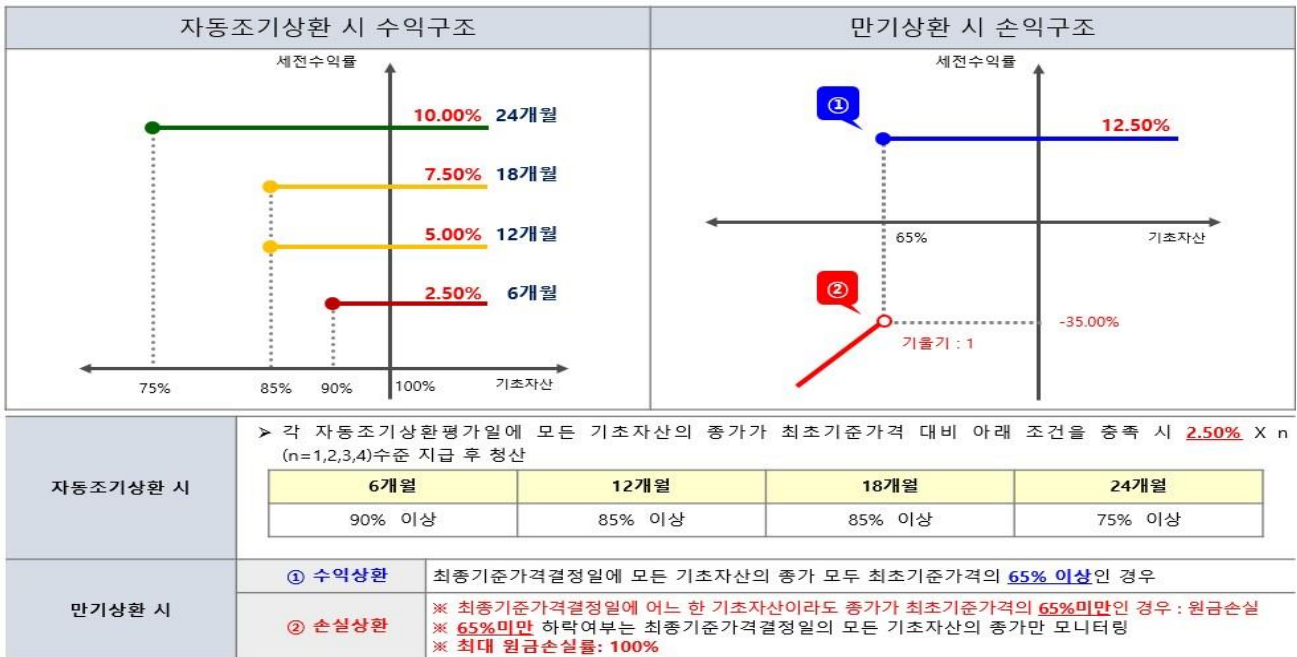
2021-06-21

## 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  | 1,888 |       | 1,888     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,888 |       | 1,888     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

96

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

58

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-40호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

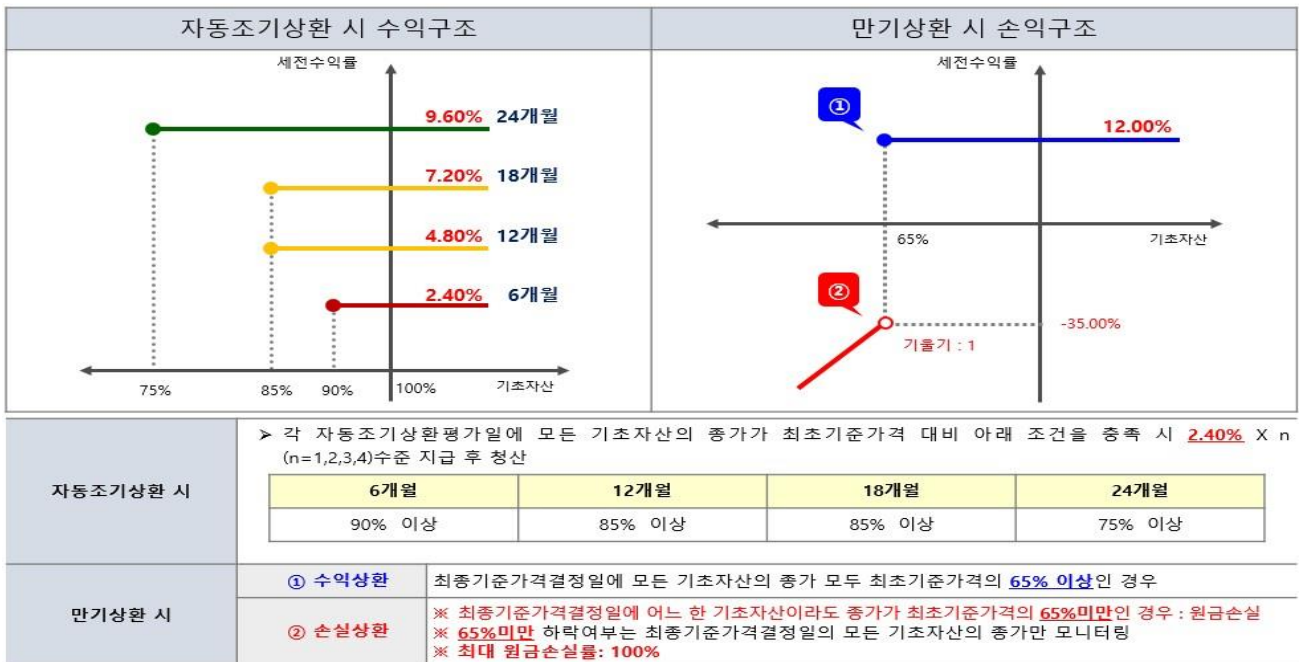
2021-06-21

## 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  | 1,017 |       | 1,017     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,017 |       | 1,017     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

65

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

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

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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  | 441   |       | 441       | 장외 |
| 합계 |      |      | 441   |       | 441       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조   | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 |        |      |        |        |        |        |   |   |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|---|
|   |              |             |        |      |        |        |        |        |   |   |
| <p>자<br/>동<br/>조<br/>기<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% 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<br/>자<br/>드<br/>상<br/>환<br/>시</p> <p>&gt; 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 6.00% 수익 지급</p> | <p>① 수익상환</p> <p>최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환</p> <p>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실<br/>                 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링<br/>                 ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월   | 12개월         | 18개월        | 24개월   |      |        |        |        |        |   |   |
| 90% 이상  | 90% 이상       | 80% 이상      | 75% 이상 |      |        |        |        |        |   |   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

# 펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

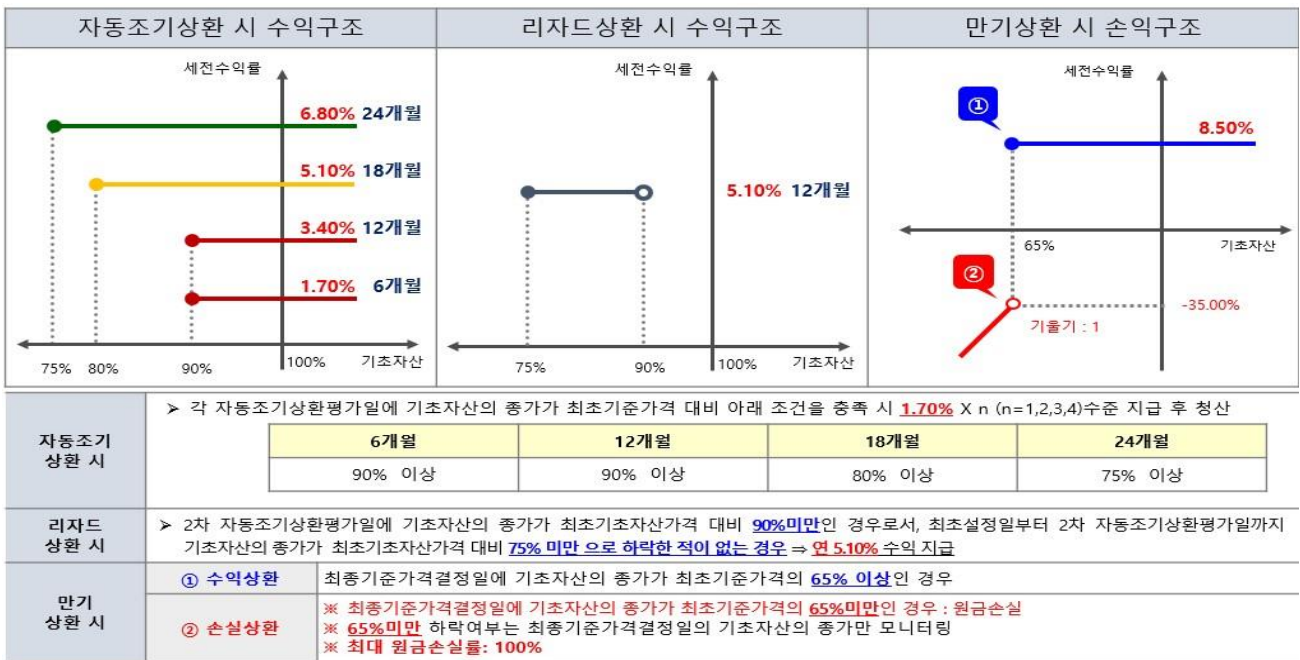
2021-06-21

## 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  | 1,155 |       | 1,155     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,155 |       | 1,155     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권E(KRW)NK-3호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

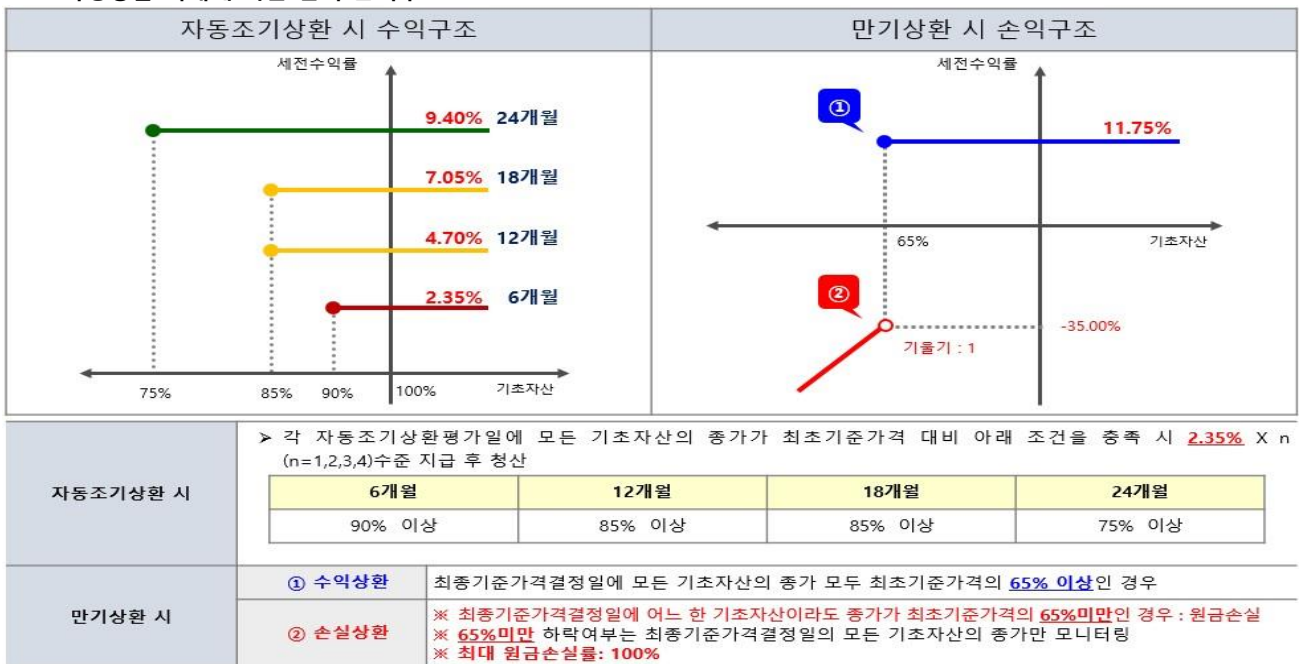
2021-06-21

## 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  | 1,673 |       | 1,673     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,673 |       | 1,673     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

57

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-8호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

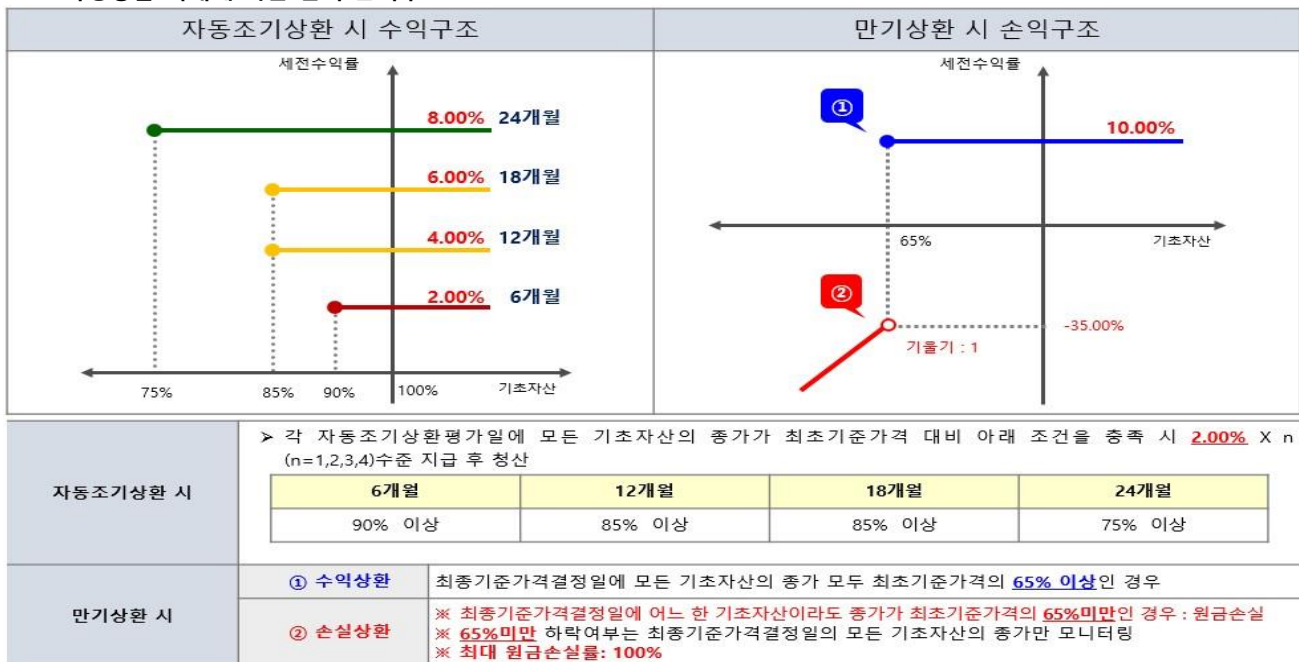
2021-06-21

## 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  | 1,016 |       | 1,016     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,016 |       | 1,016     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

45

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-10호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

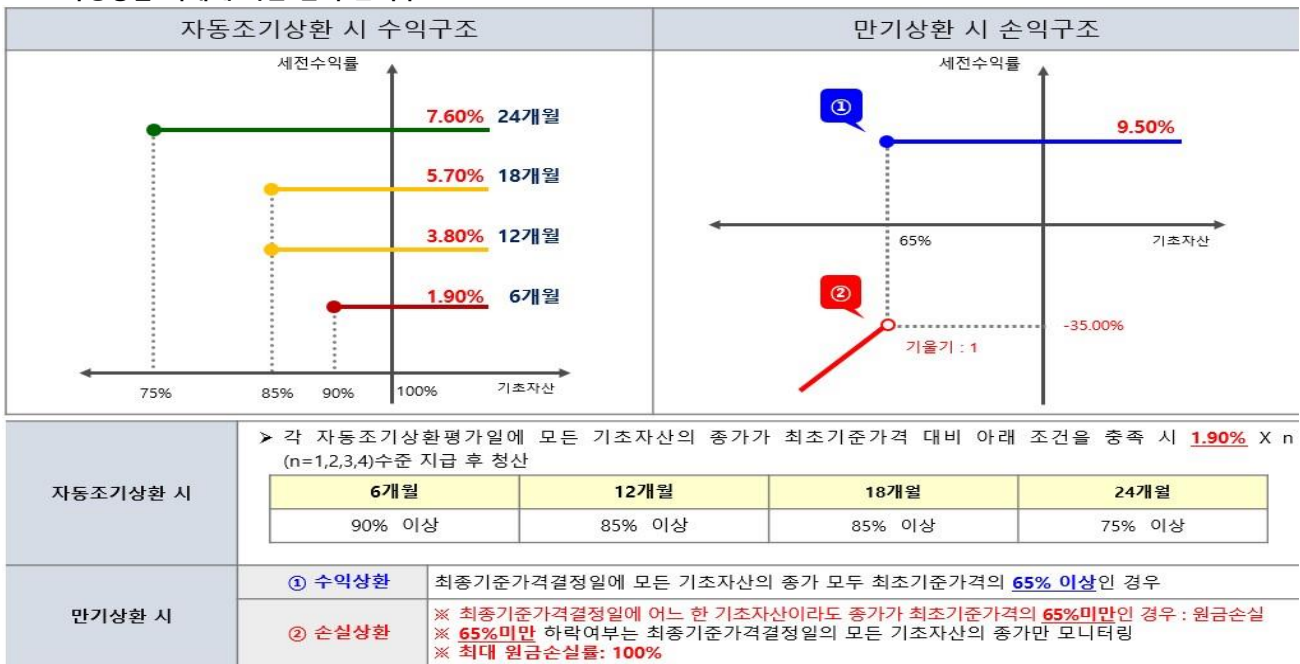
2021-06-21

## 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  | 1,253 |       | 1,253     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,253 |       | 1,253     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

75

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

33

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-16호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

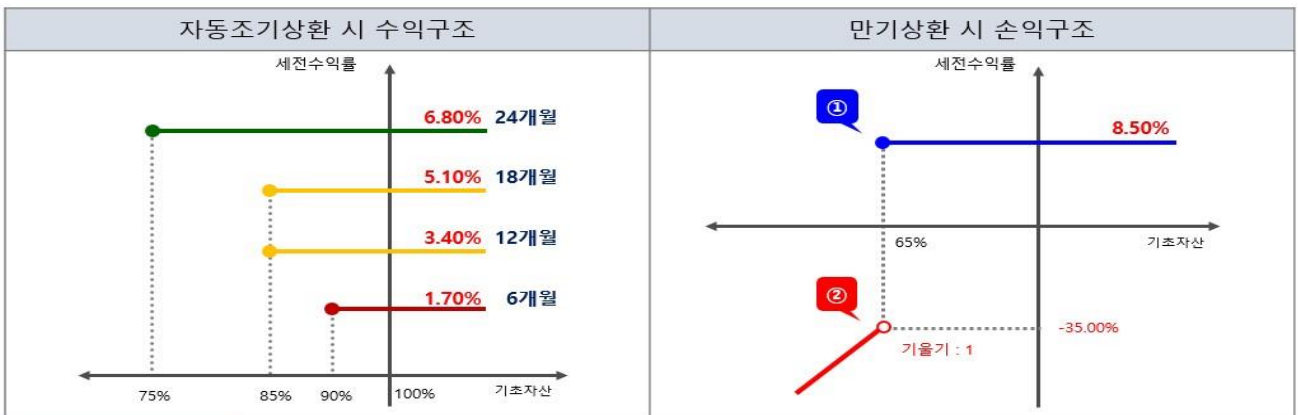
2021-06-21

## 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  | 972   |       | 972       | 장외 |
| 합계 |      |      | 972   |       | 972       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.70% 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 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

62

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

25

# 펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-42호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

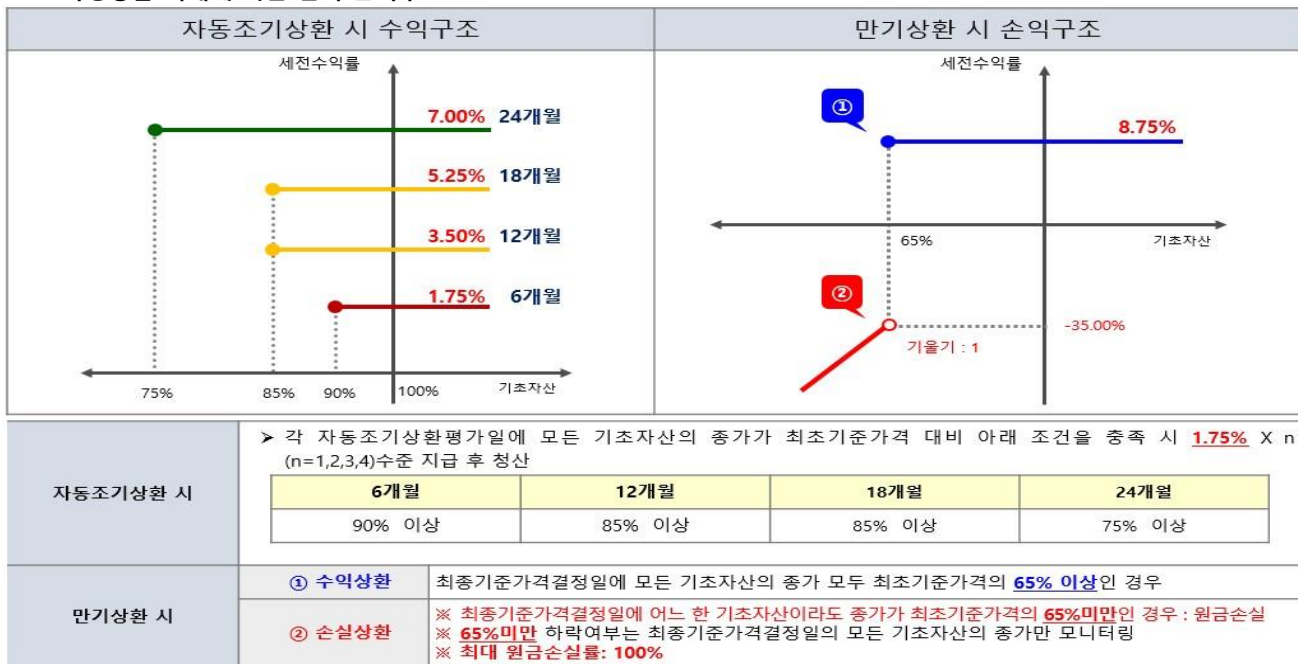
2021-06-21

## 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  | 2,896 |       | 2,896     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,896 |       | 2,896     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

179

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

77

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

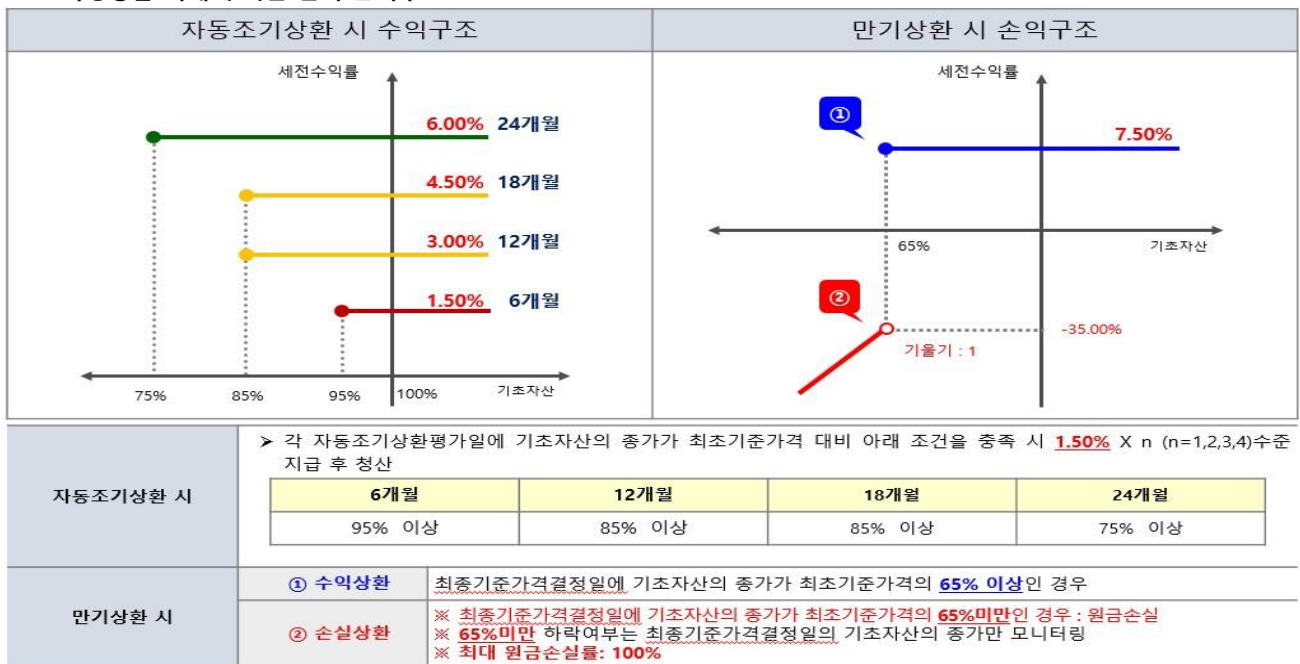
2021-06-21

## 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  | 1,353 |       | 1,353     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,353 |       | 1,353     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

86

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-12호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

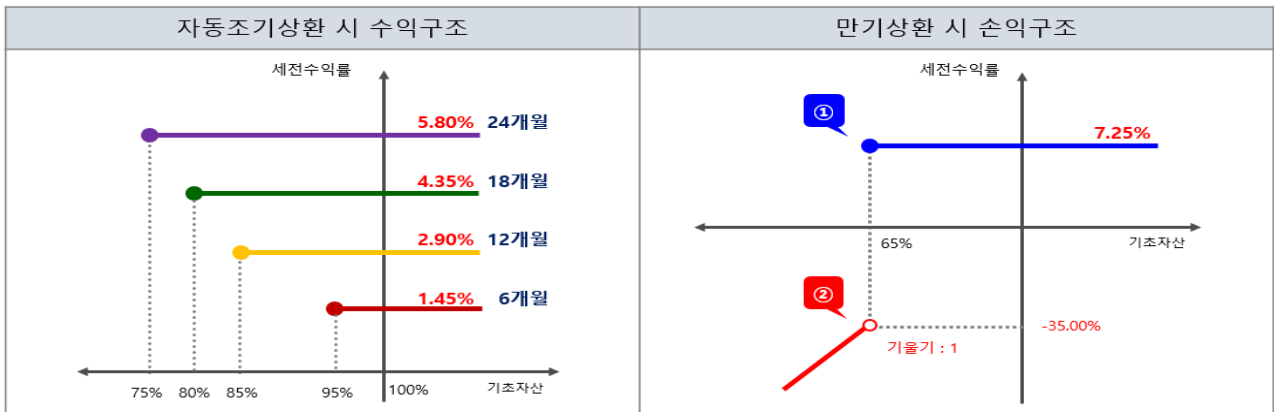
2021-06-21

## 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  | 511   |       | 511       | 장외 |
| 합계 |      |      | 511   |       | 511       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |  |        |        |
|----------|--|--|--------|--------|
| 자동조기상환 시 | > 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>1.45%</b> X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산 |  |        |        |
|          | 6개월  | 12개월   | 18개월   | 24개월   |
|          | 95% 이상   | 85% 이상   | 80% 이상 | 75% 이상 |
| 만기상환 시   | ① 수익상환   | 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우   |        |        |
|          | ② 손실상환   | ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실<br>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링<br>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b> |        |        |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

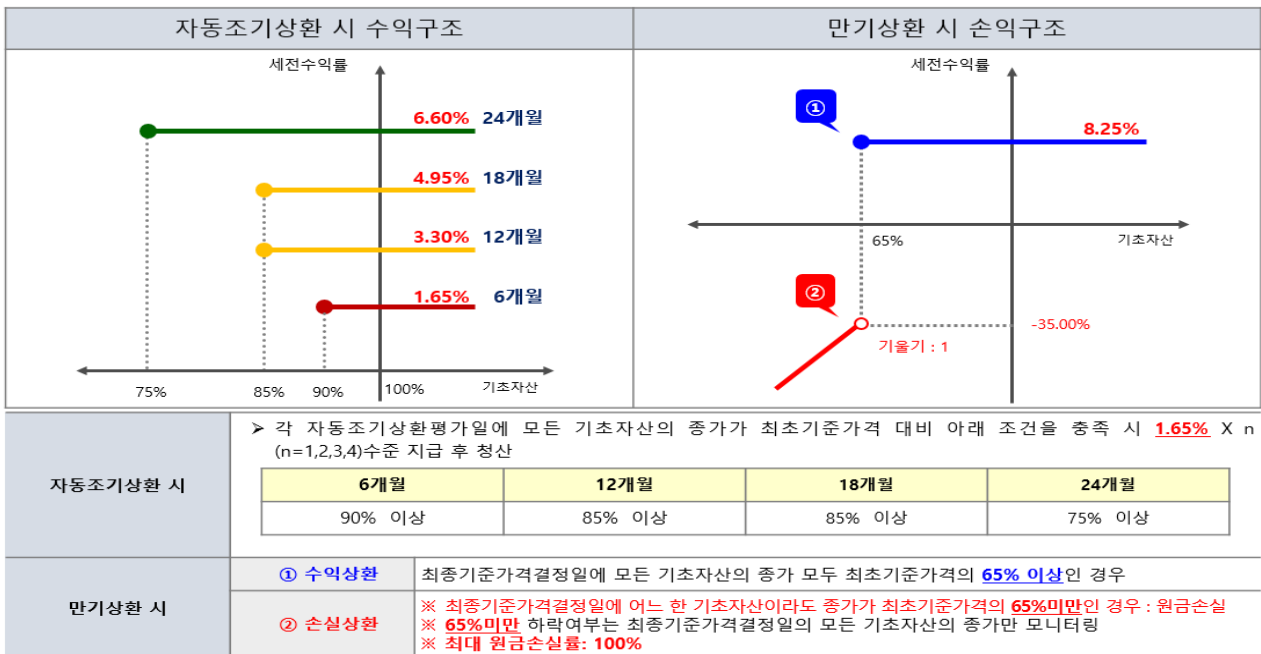
2021-06-21

## 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  | 2,429 |       | 2,429     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,429 |       | 2,429     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

150

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

92

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

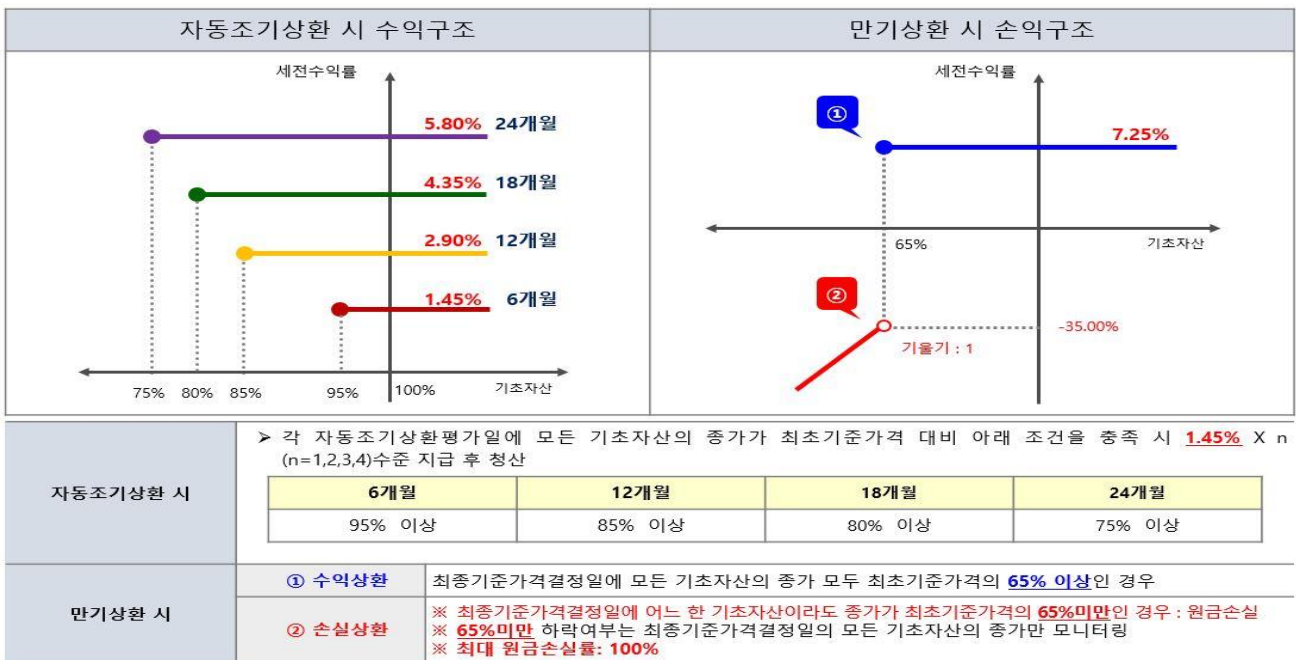
2021-06-21

## 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  | 370   |       | 370       | 장외 |
| 합계 |      |      | 370   |       | 370       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-6호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

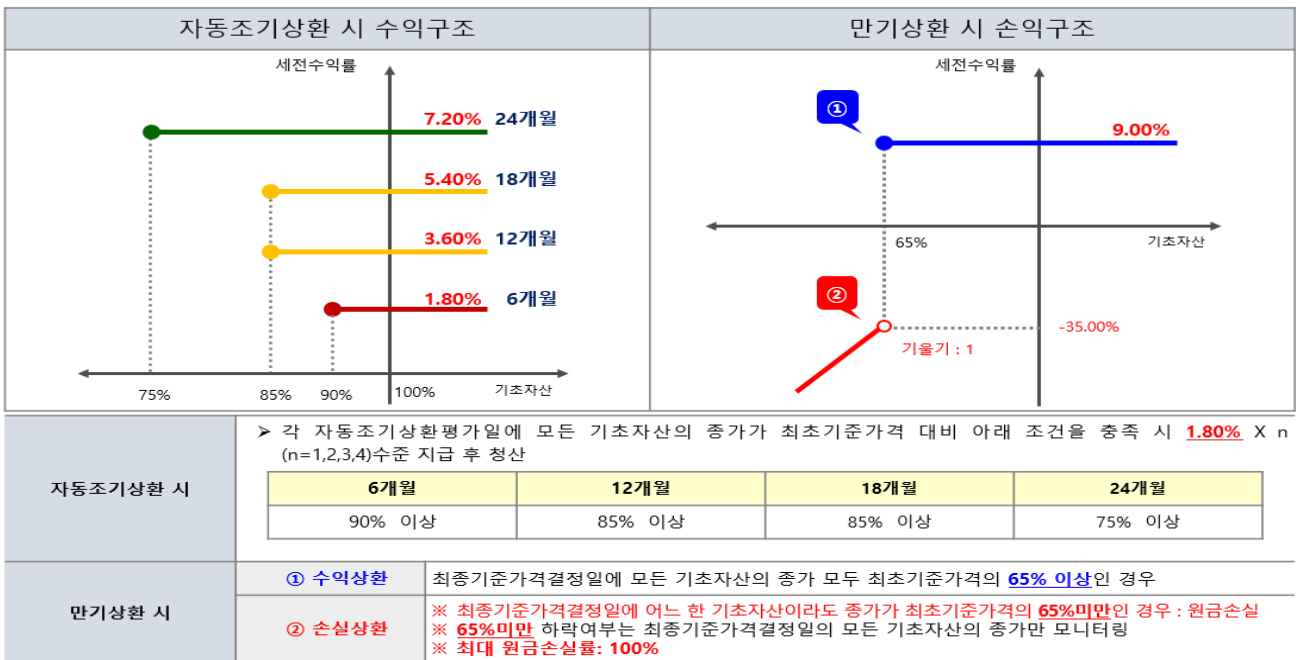
2021-06-21

## 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  | 1,448 |       | 1,448     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,448 |       | 1,448     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-14호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

2021-06-21

## 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  | 141   |       | 141       | 장외 |
| 합계 |      |      | 141   |       | 141       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

세전수익률

기초자산

75% 80% 85% 95% 100%

5.80% 24개월

4.35% 18개월

2.90% 12개월

1.45% 6개월

만기상환 시

세전수익률

기초자산

65%

7.25%

-35.00%

기율기: 1

① 수익상환

② 손실상환

기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.45% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

| 6개월    | 12개월   | 18개월   | 24개월   |
|--------|--------|--------|--------|
| 95% 이상 | 85% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

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%

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

9

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권E(KRW)NK-6호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

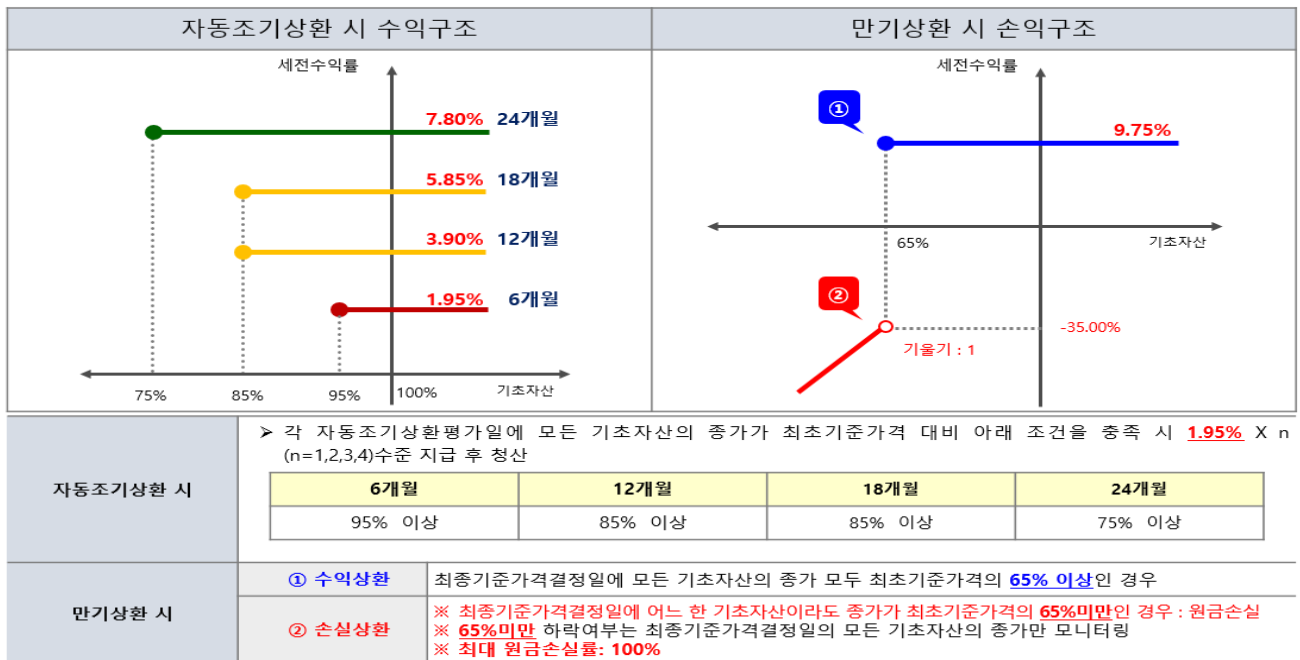
2021-06-21

## 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  | 2,116 |       | 2,116     | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,116 |       | 2,116     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

69

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일: 2021-06-21

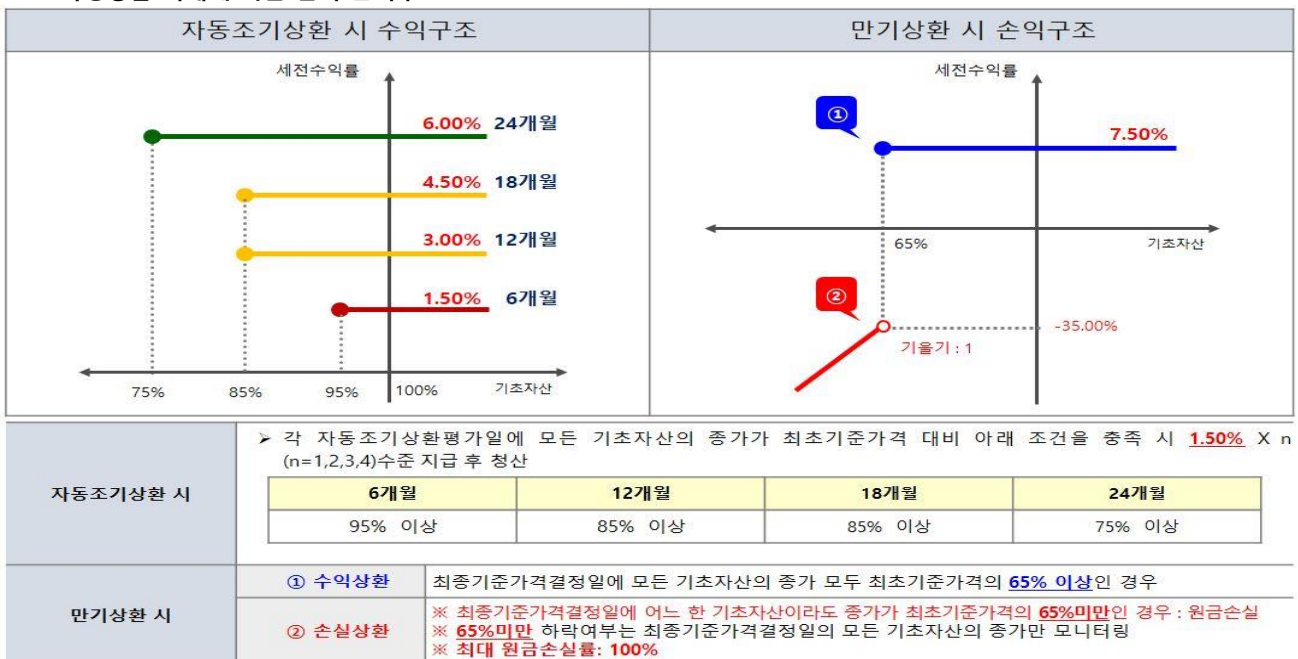
2021-06-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 100   | 0     | 100       | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 100   |       | 100       | 장외 |
| 합계 |      |      | 100   |       | 100       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-7호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

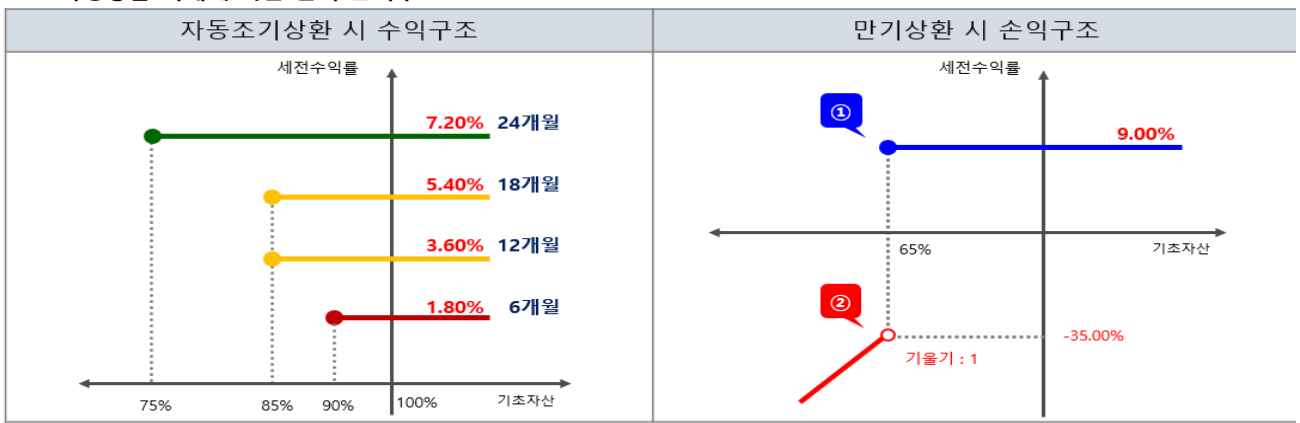
2021-06-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 537   | 0     | 537       | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 537   |       | 537       | 장외 |
| 합계 |      |      | 537   |       | 537       |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.80% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

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

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

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

30

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권HSN-1호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-06-18

공시일:

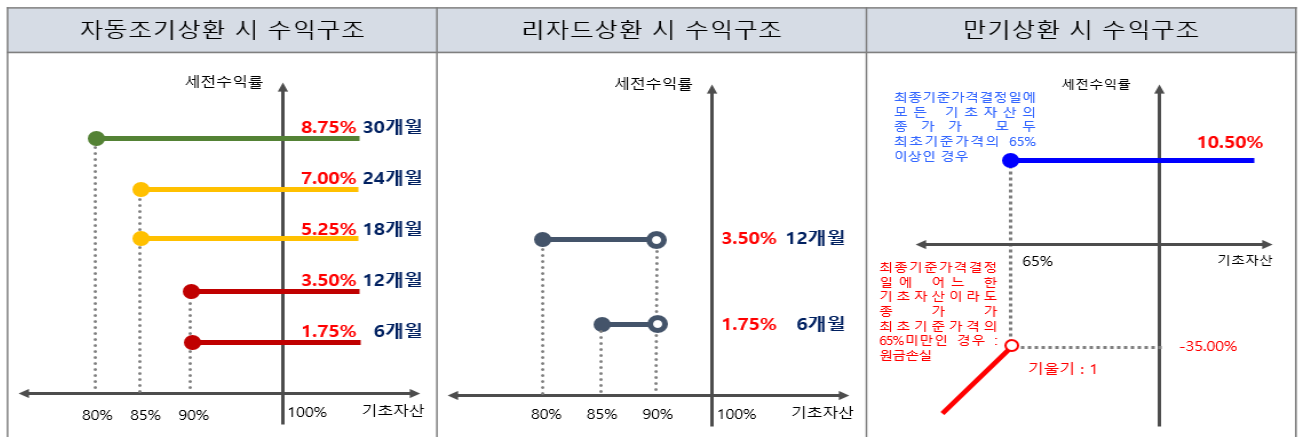
2021-06-21

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 1,850 | 0     | 1,850     | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 1,850 |       | 1,850     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,850 |       | 1,850     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



|          |  |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.75% X n (n=1,2,3,4,5)</b> 수준 지급 후 청산</li> </ul>   |
| 리자드상환 시  | <ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.50%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.50%</b> 수익 지급</li> </ul> |
| 만기상환 시   | <ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>   |

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

128

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

124