

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	328	218	109	장내
누계	주가지수	선물	2,403	0	2,403	장내
신규	주가지수	옵션	2	218	-217	장내
누계	주가지수	옵션	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	39	12	27	장내
누계	유가증권	선물	760	31	729	장내
합계			3,163	31	3,132	

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

192

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

242

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-07-07

공시일:

2021-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,092	0	1,092	장내
누계	주가지수	선물	6,882	66	6,817	장내
합계			6,882	66	6,817	

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

545

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

588

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

2021-07-08

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

231

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

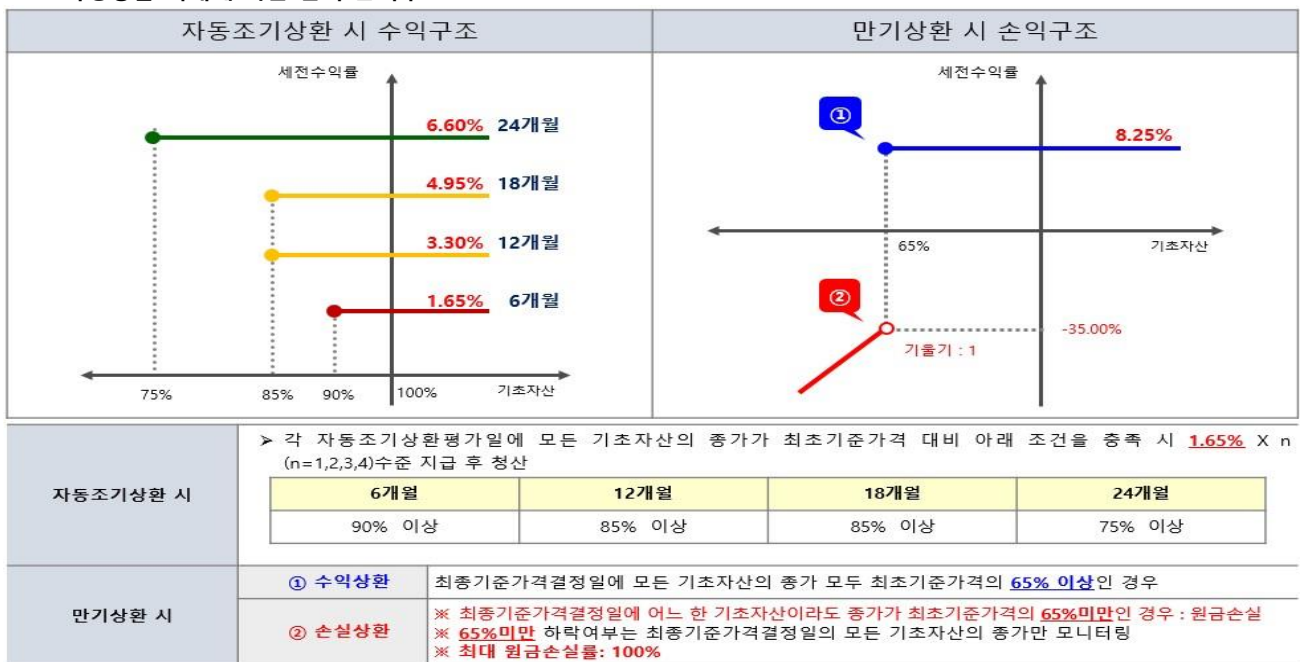
공시일: 2021-07-08

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

63

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

2021-07-08

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

244

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

22

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

2021-07-08

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

177

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

33

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

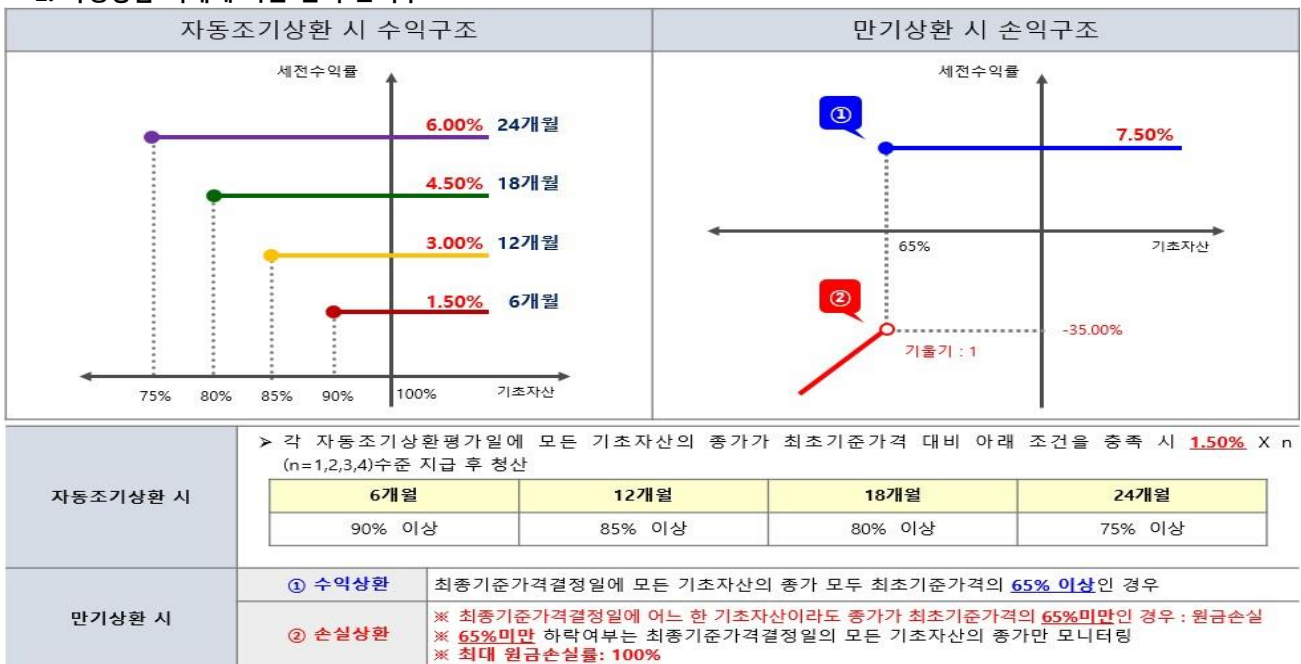
2021-07-08

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

35

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

2021-07-08

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

165

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

35

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

2021-07-08

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>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

115

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

2021-07-08

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

59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

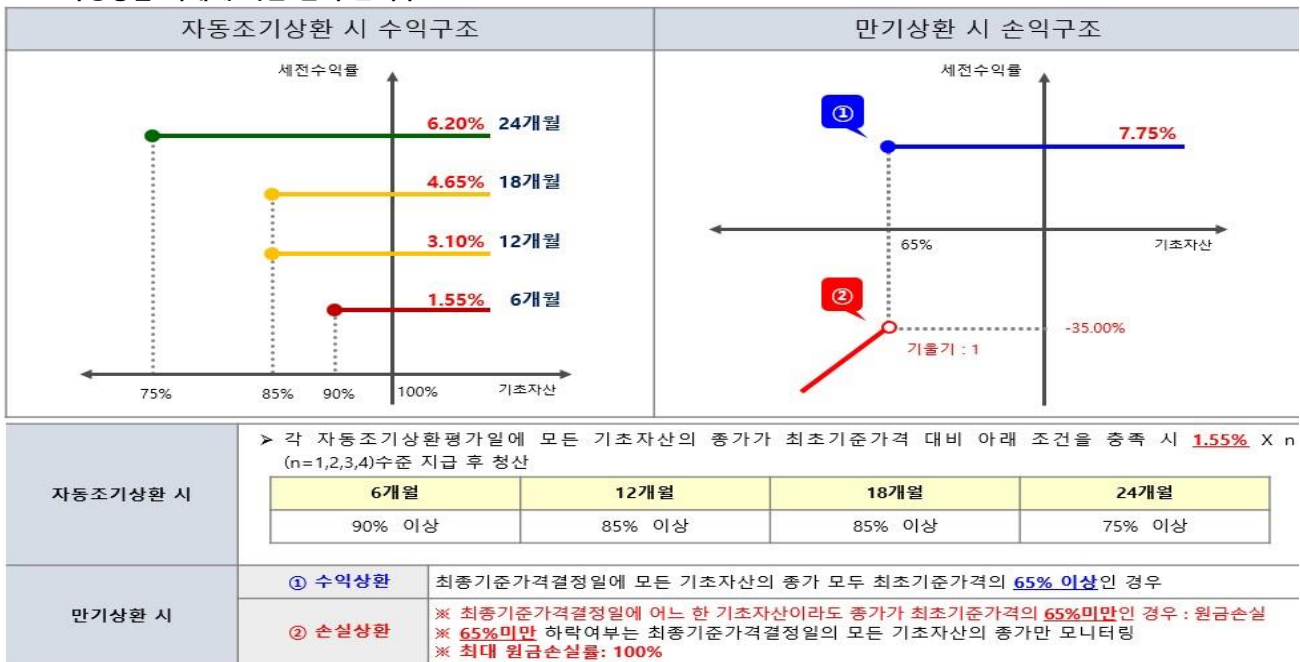
2021-07-08

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)

3

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

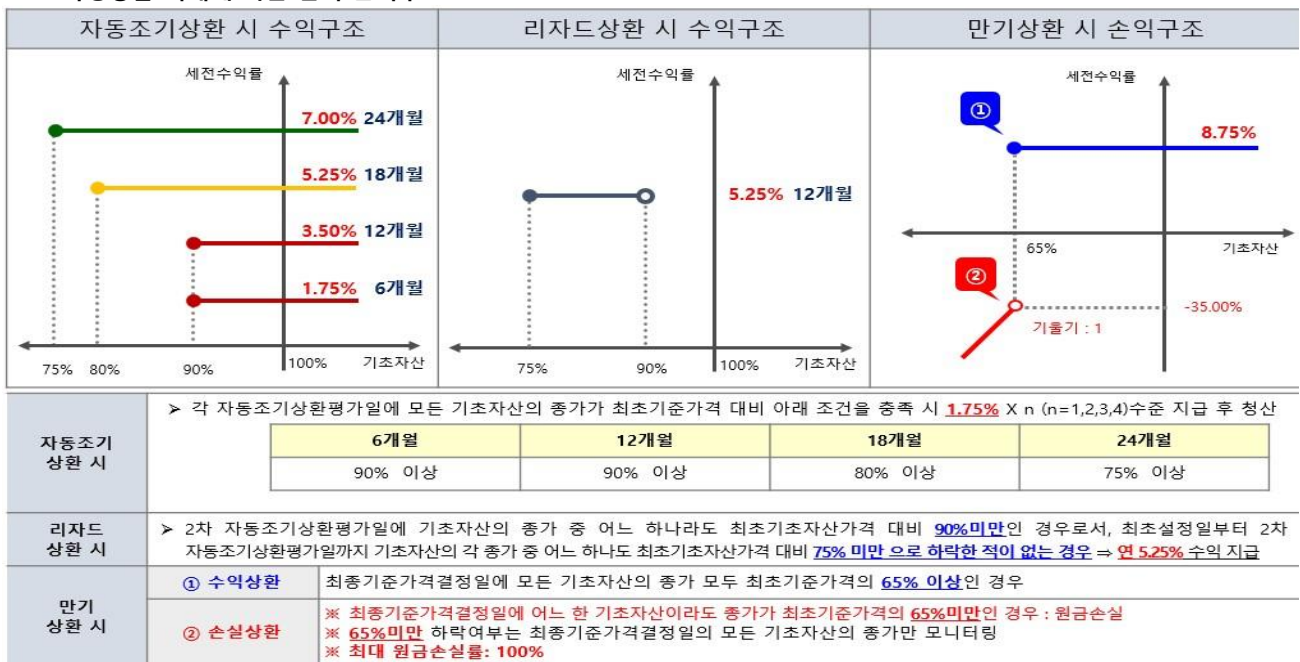
2021-07-08

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

54

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

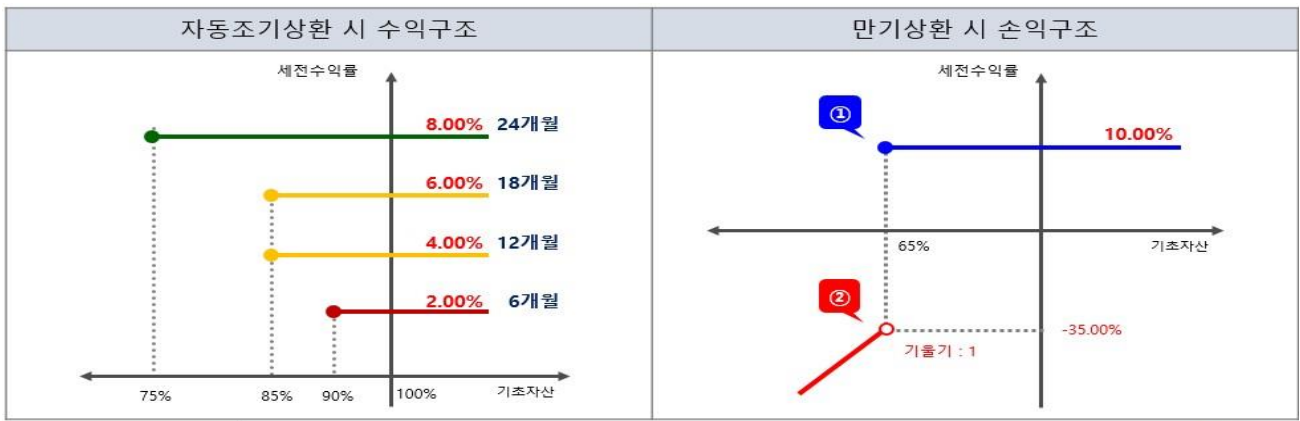
공시일: 2021-07-08

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

113

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

44

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

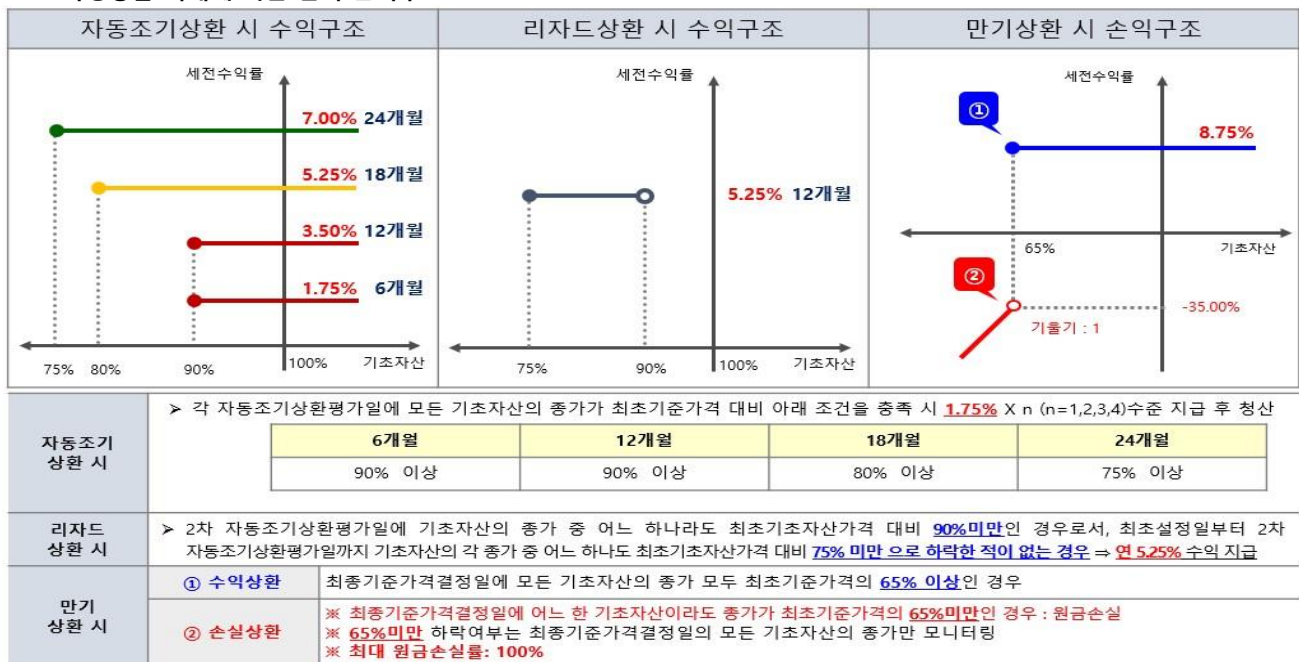
2021-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	3	-3	장외
누계	주식	ELS	331		331	장외
합계			331		331	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

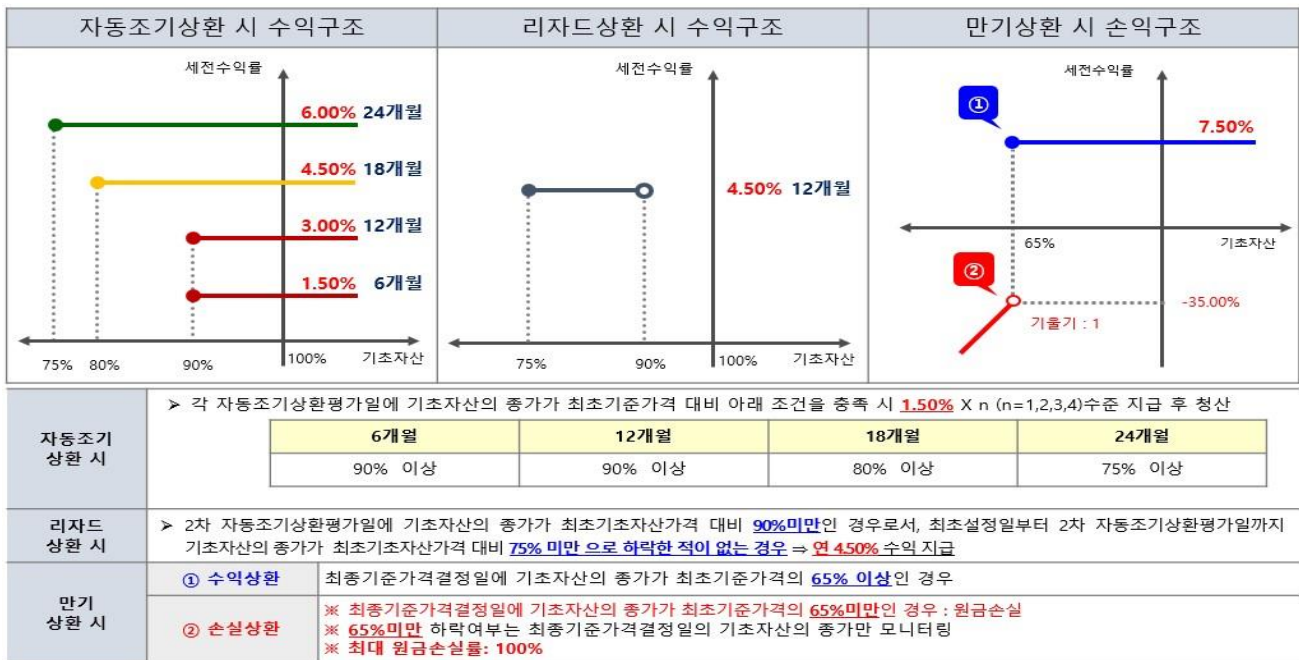
2021-07-08

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



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

8

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

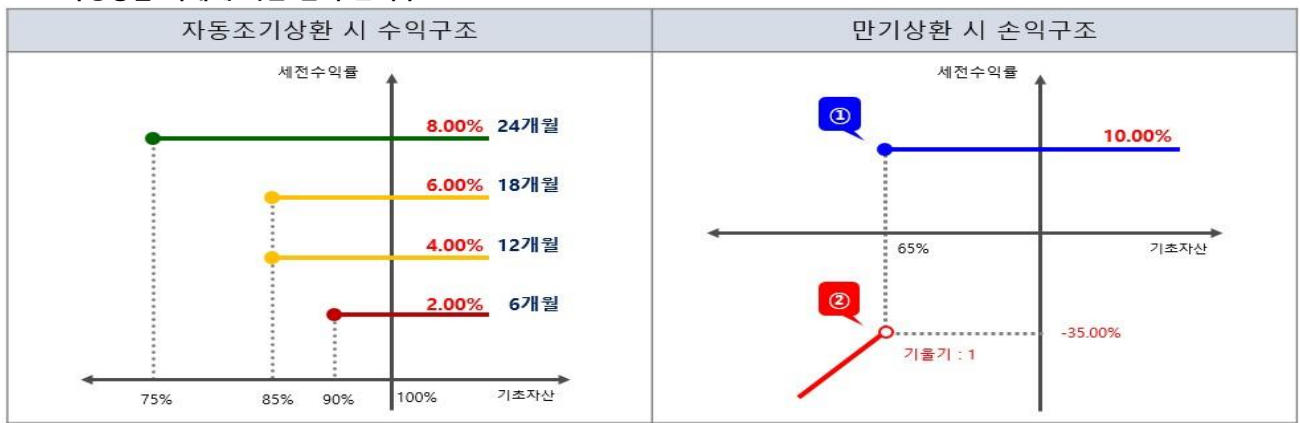
2021-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,264		1,264	장외
합계			1,264		1,264	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

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

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

만기상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상 인 경우
② 손실상환	<ul style="list-style-type: none"> ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

90

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

49

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

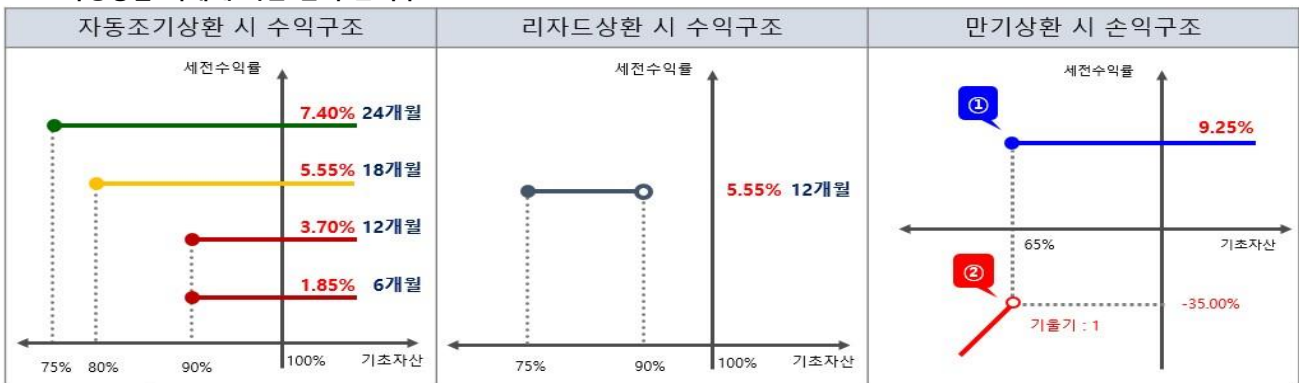
2021-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,302		1,302	장외
합계			1,302		1,302	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

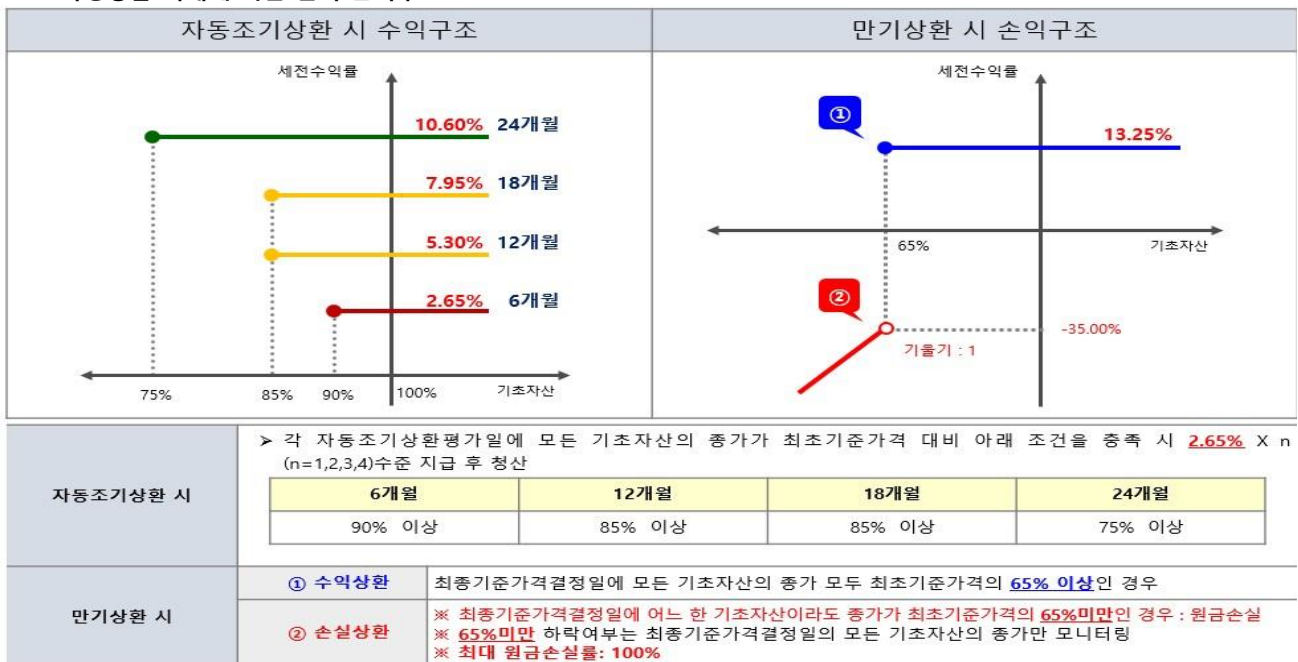
2021-07-08

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

188

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

45

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

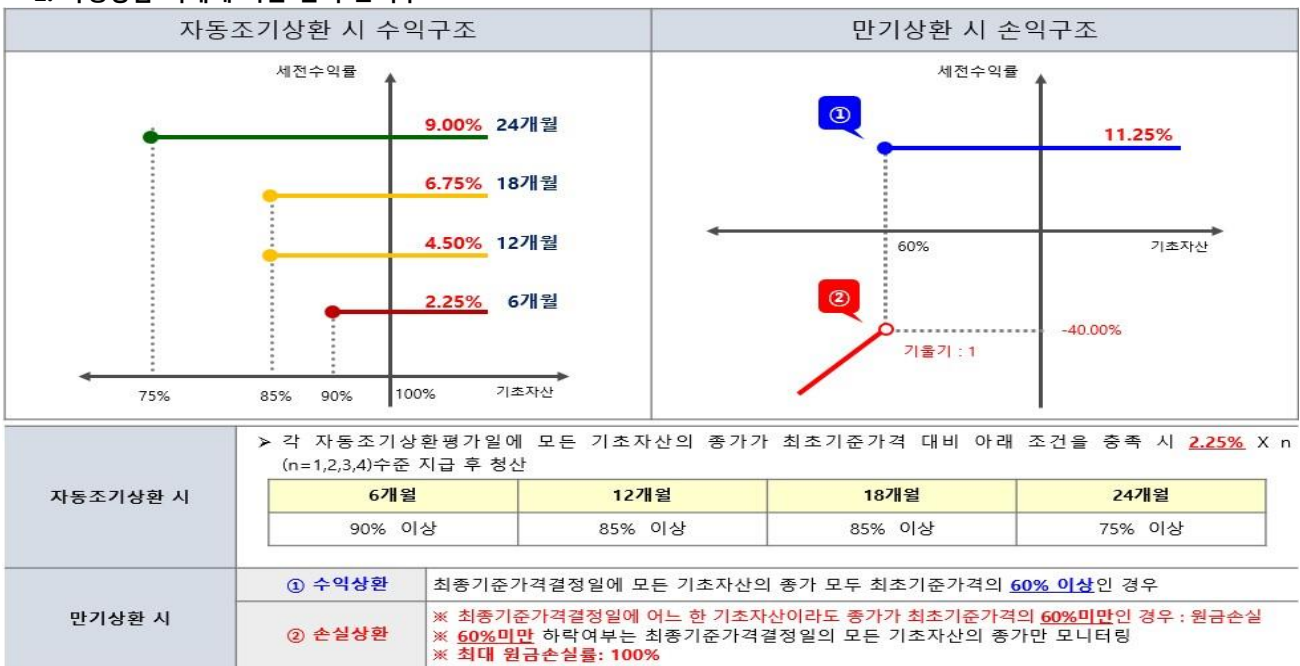
2021-07-08

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

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

2021-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,989		1,989	장외
합계			1,989		1,989	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조								
<p>자동조기상환 시</p> <p>> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.25% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>80% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </tbody> </table>	6개월	12개월	18개월	24개월	90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상	<p>리자드 상환 시</p> <p>> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 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 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

40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

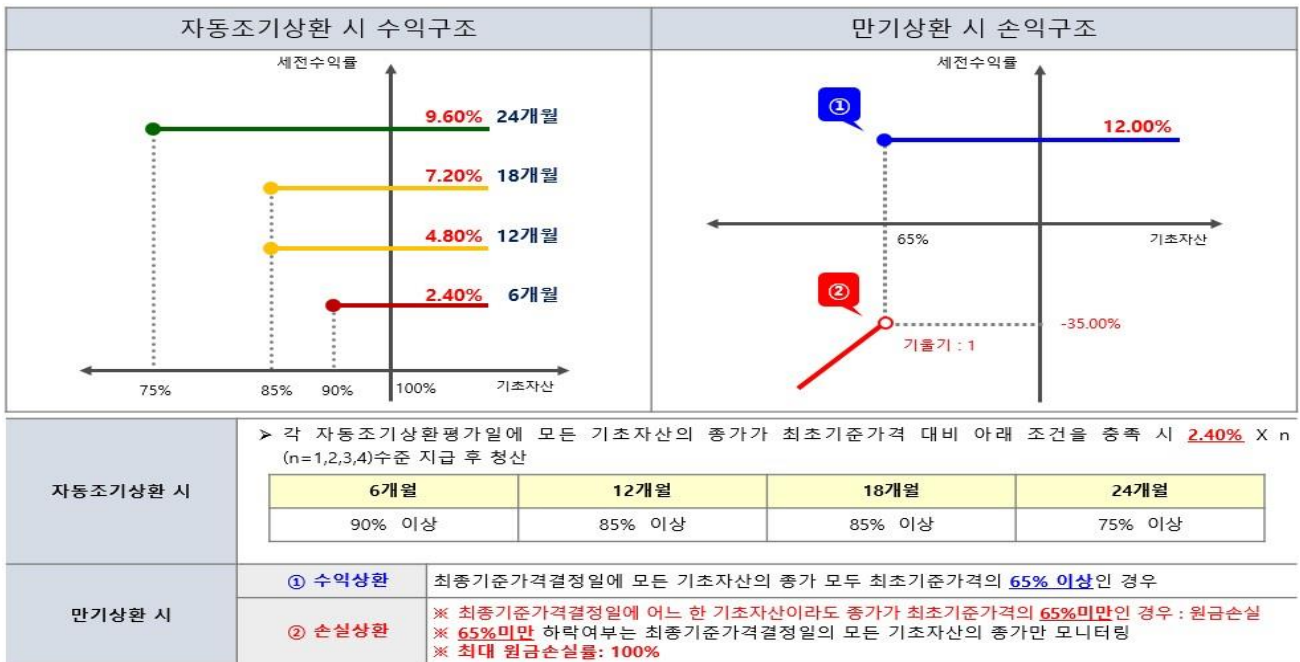
2021-07-08

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

129

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-5호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

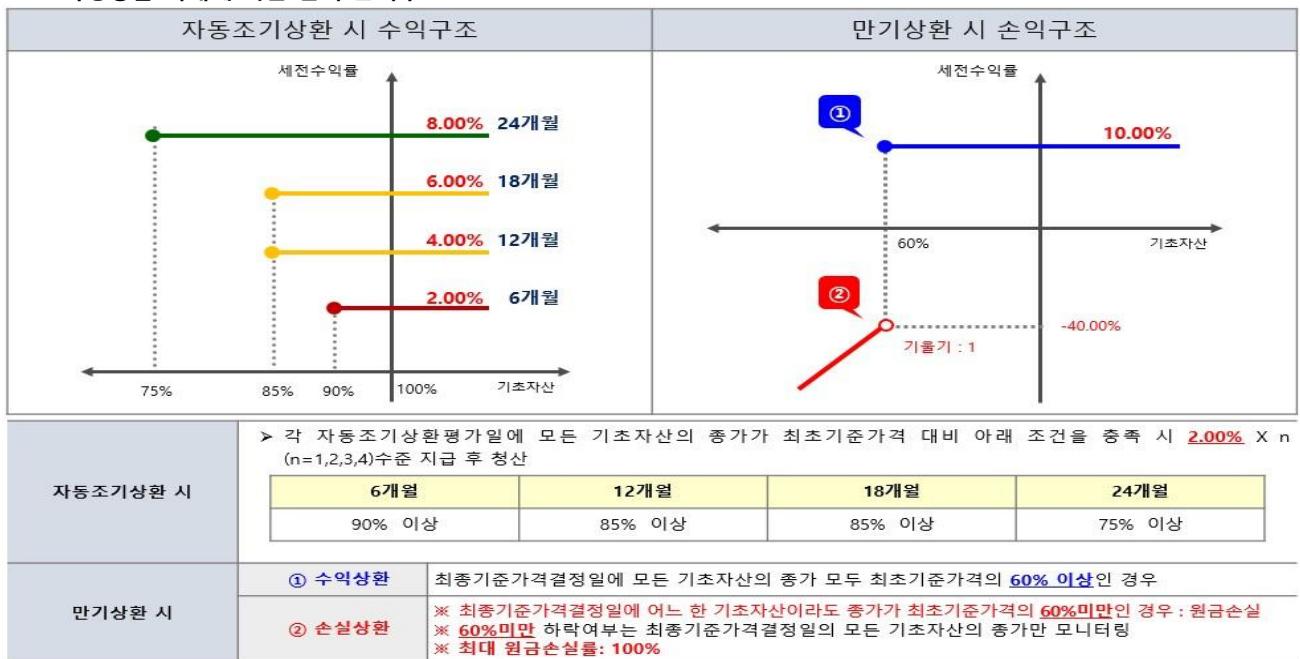
2021-07-08

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

14

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

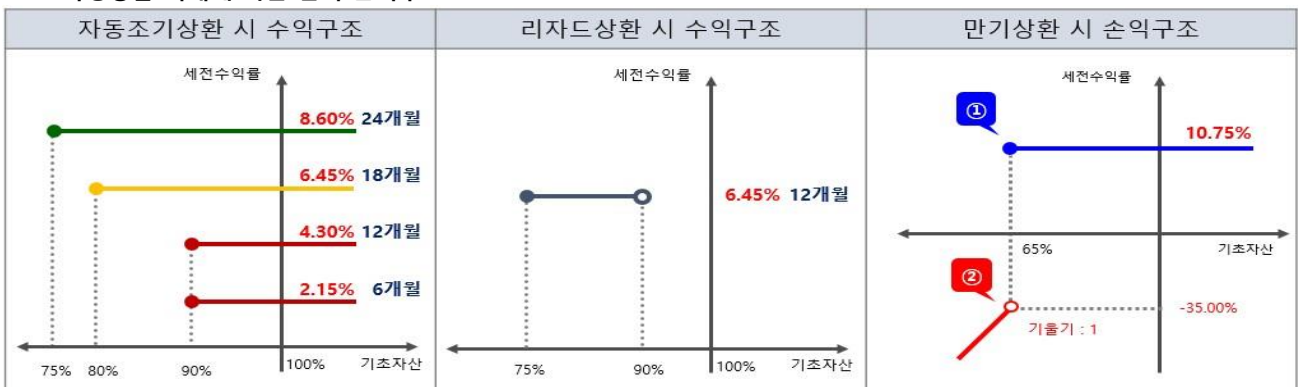
2021-07-08

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

43

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

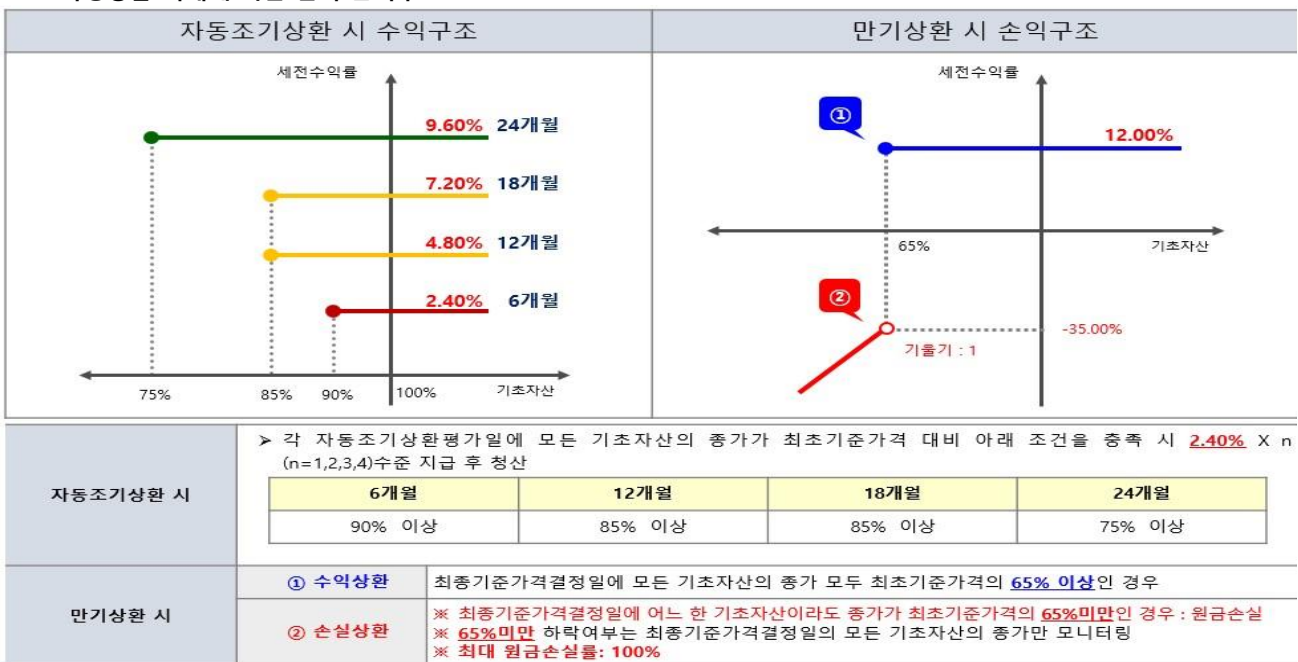
2021-07-08

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

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

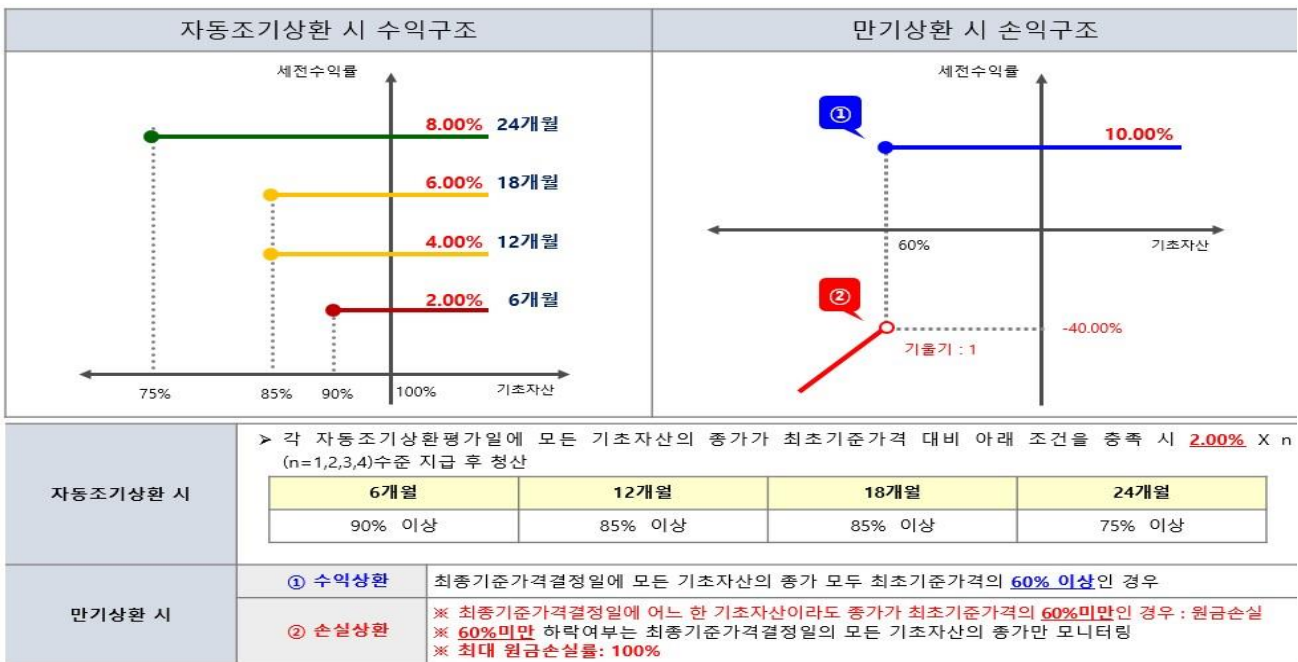
2021-07-08

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

9

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

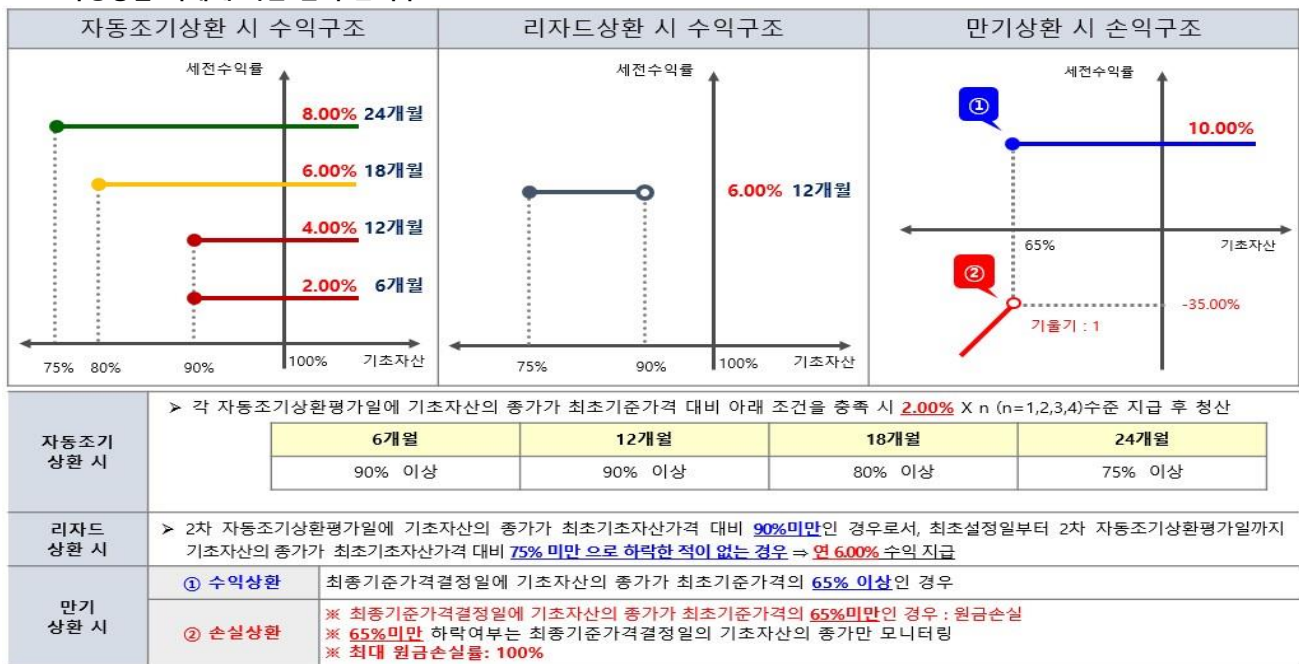
2021-07-08

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

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

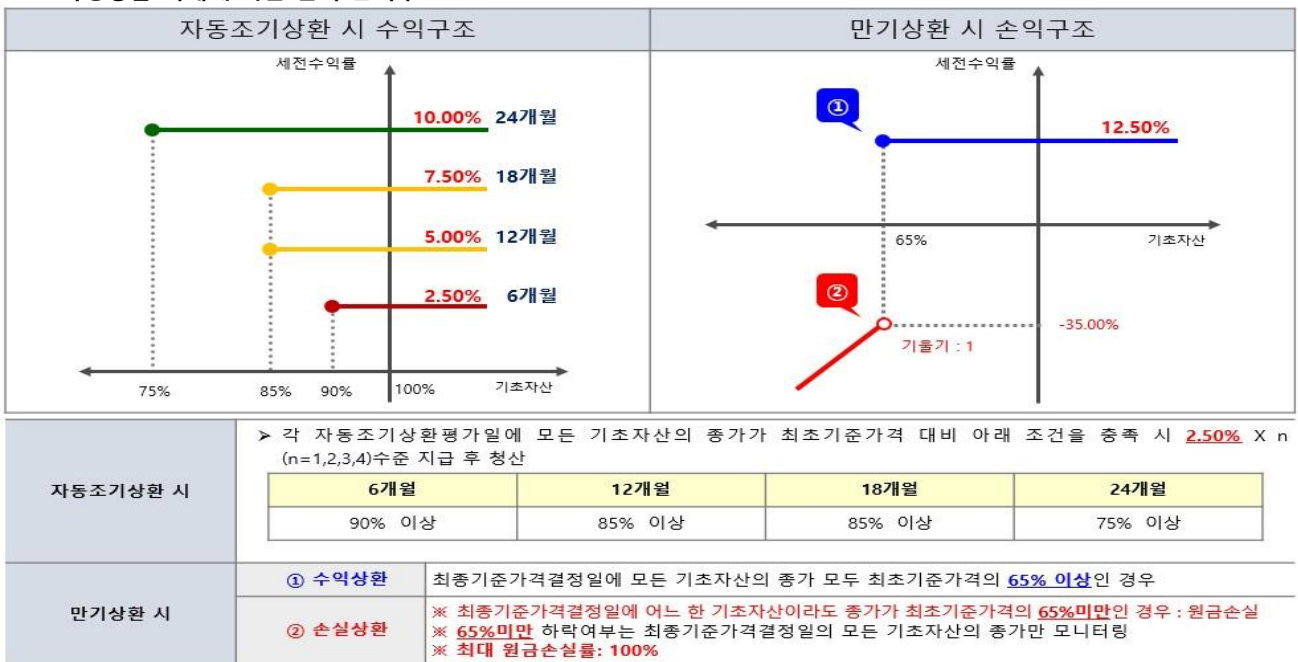
2021-07-08

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

77

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

27

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

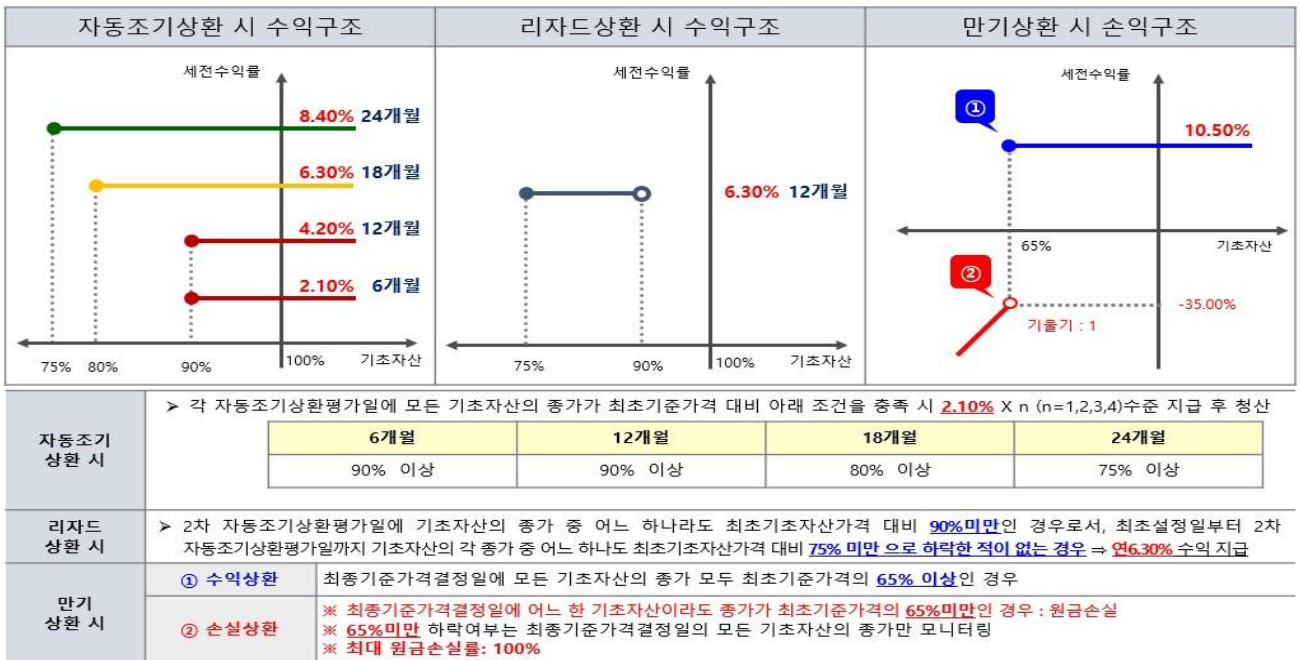
2021-07-08

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

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

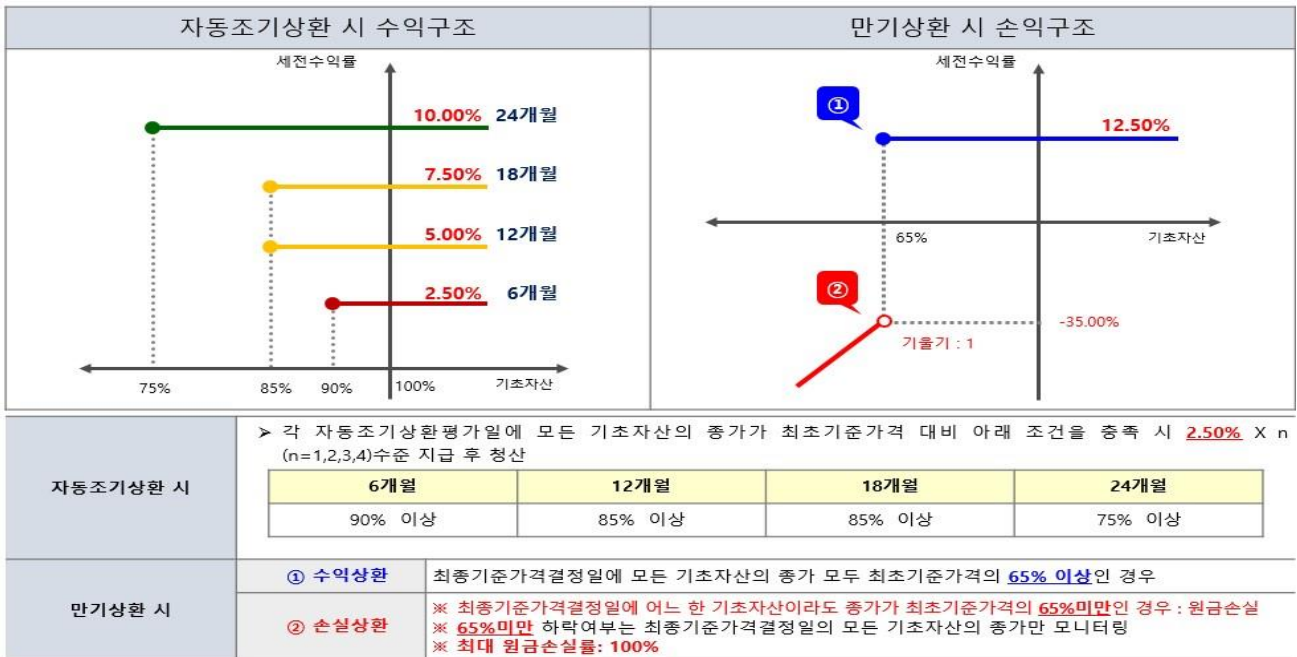
2021-07-08

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

101

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

46

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-40호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

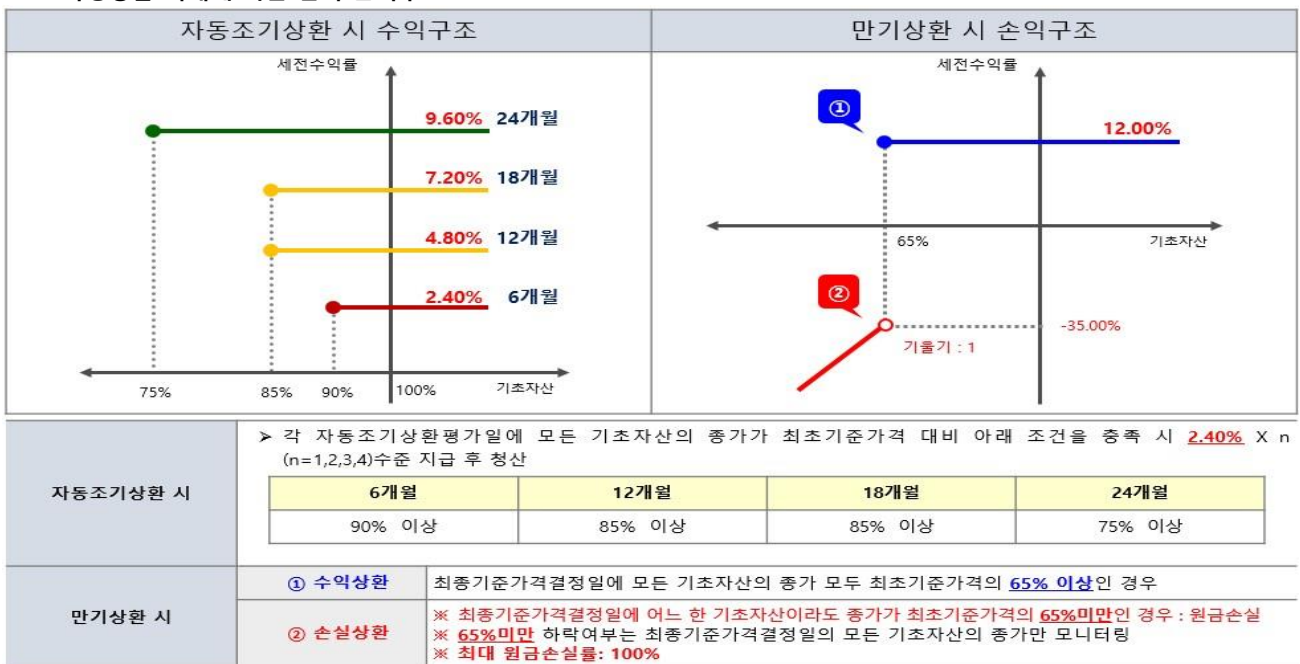
2021-07-08

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

79

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

37

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

2021-07-08

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 동 조 기 상 환 시</p> <p>> 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 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 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 ※ 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

30

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

펀드명 : BNK리자드지수연계증권S(KRW)-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

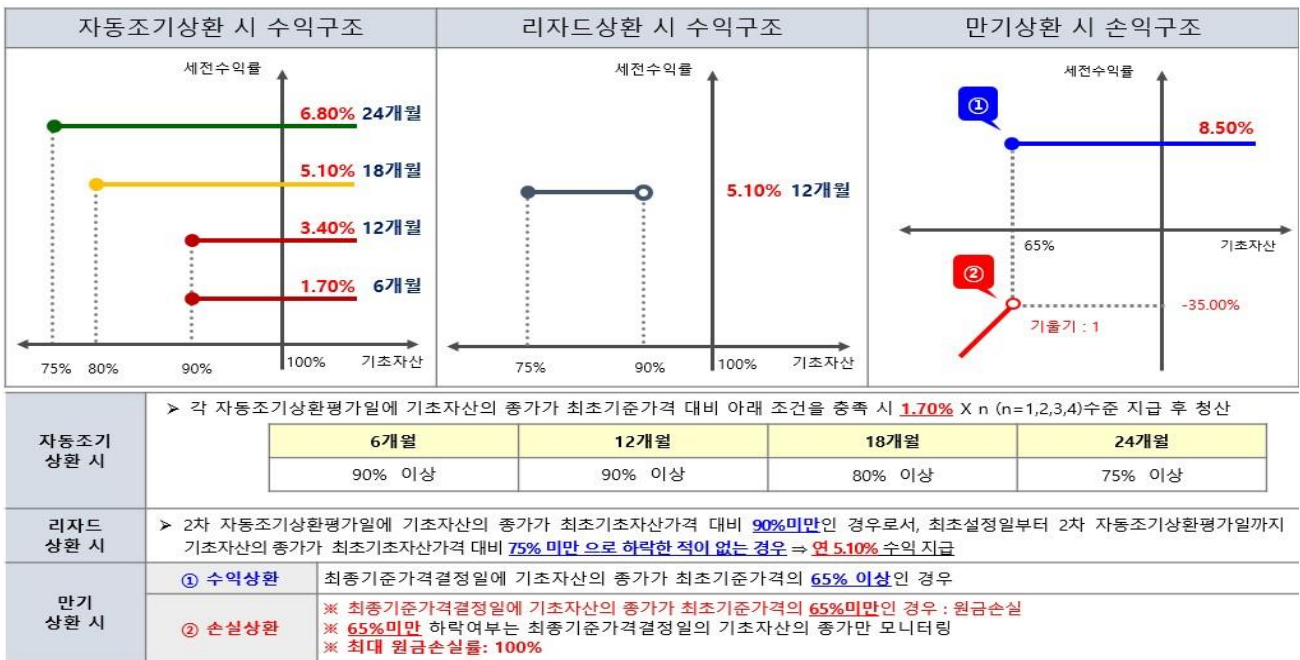
2021-07-08

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

44

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

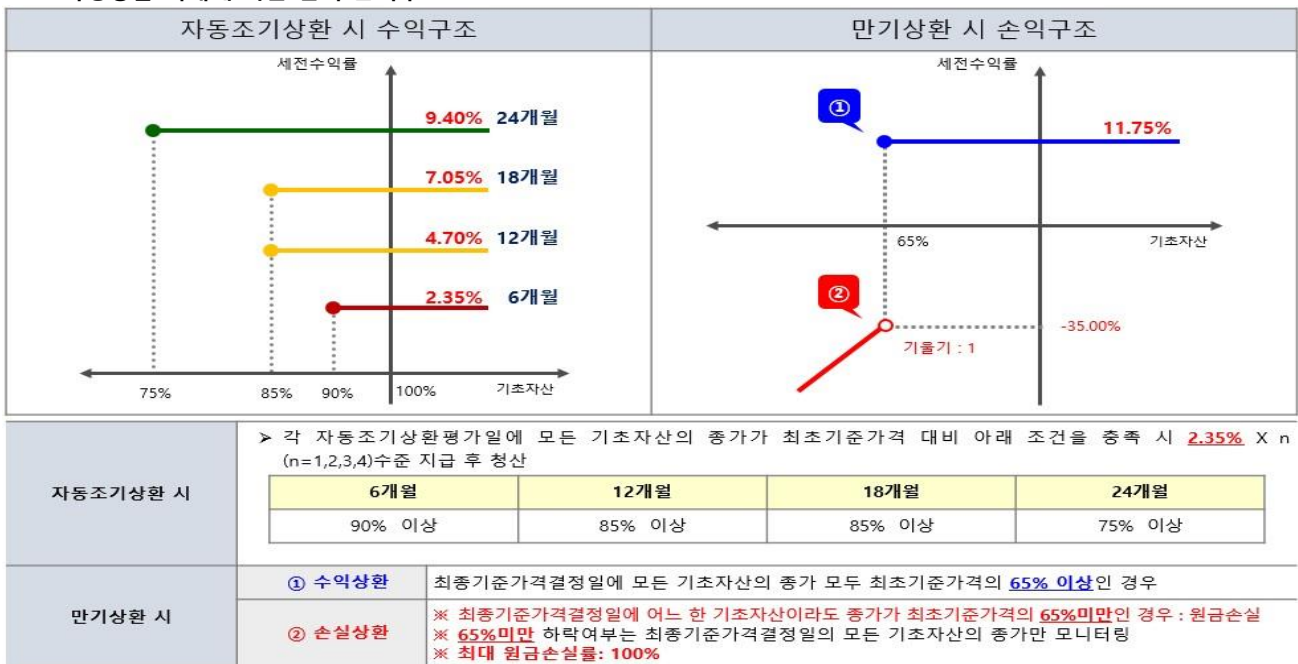
2021-07-08

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

105

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

70

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

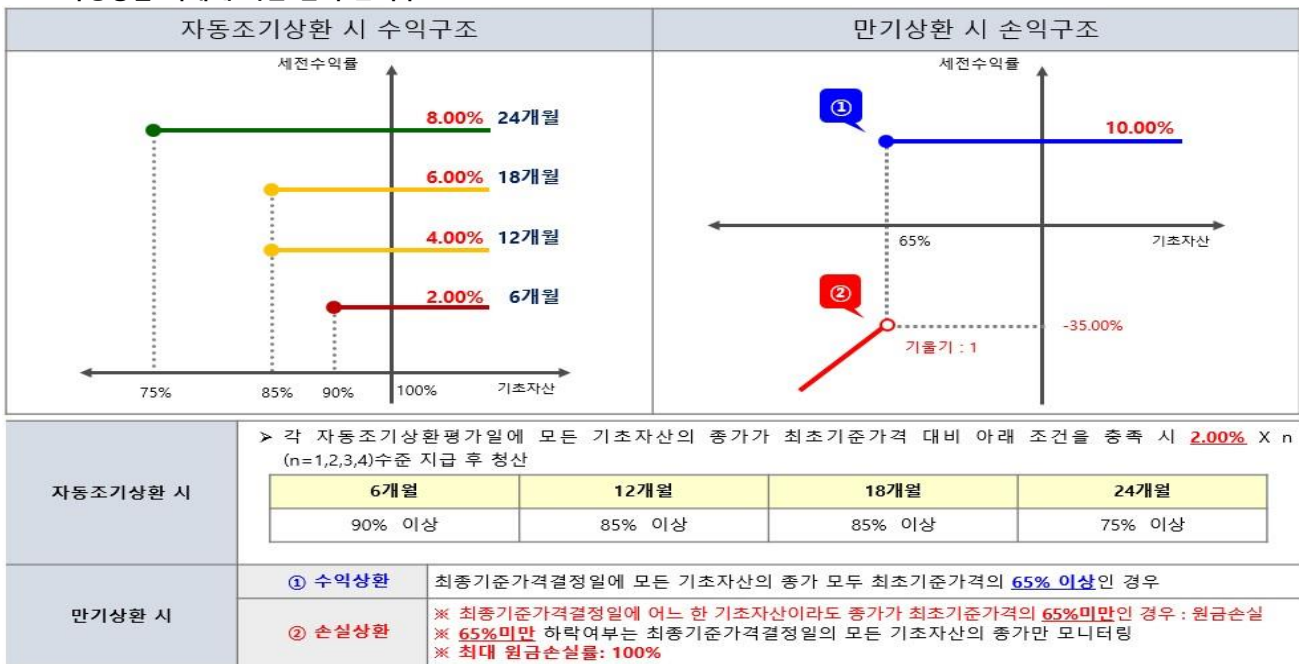
2021-07-08

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

65

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

43

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

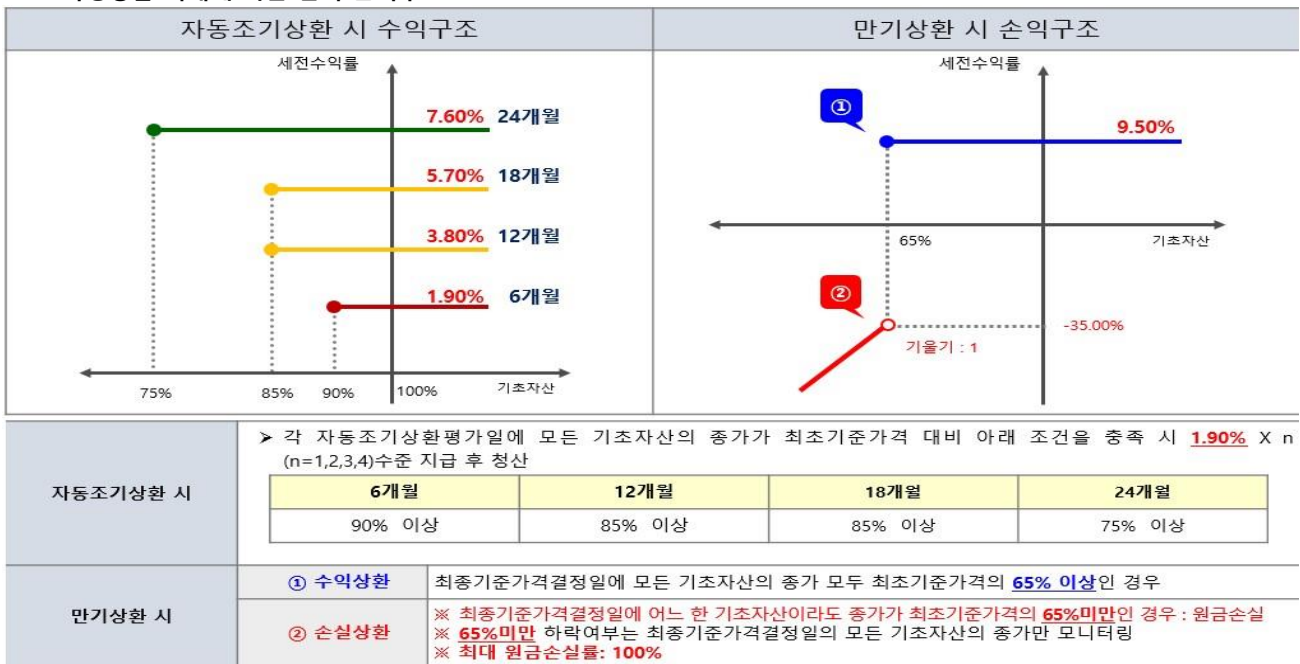
2021-07-08

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

70

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

49

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

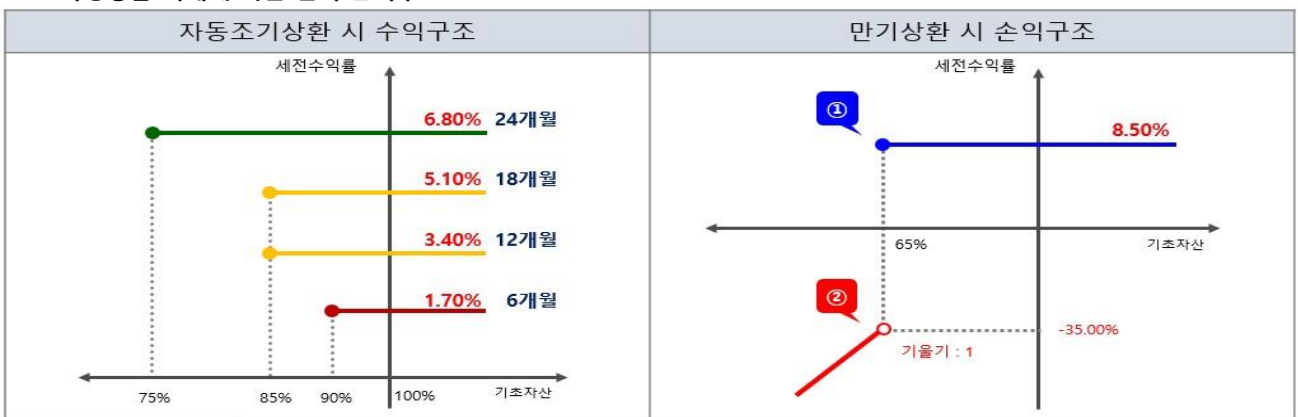
2021-07-08

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

73

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

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

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

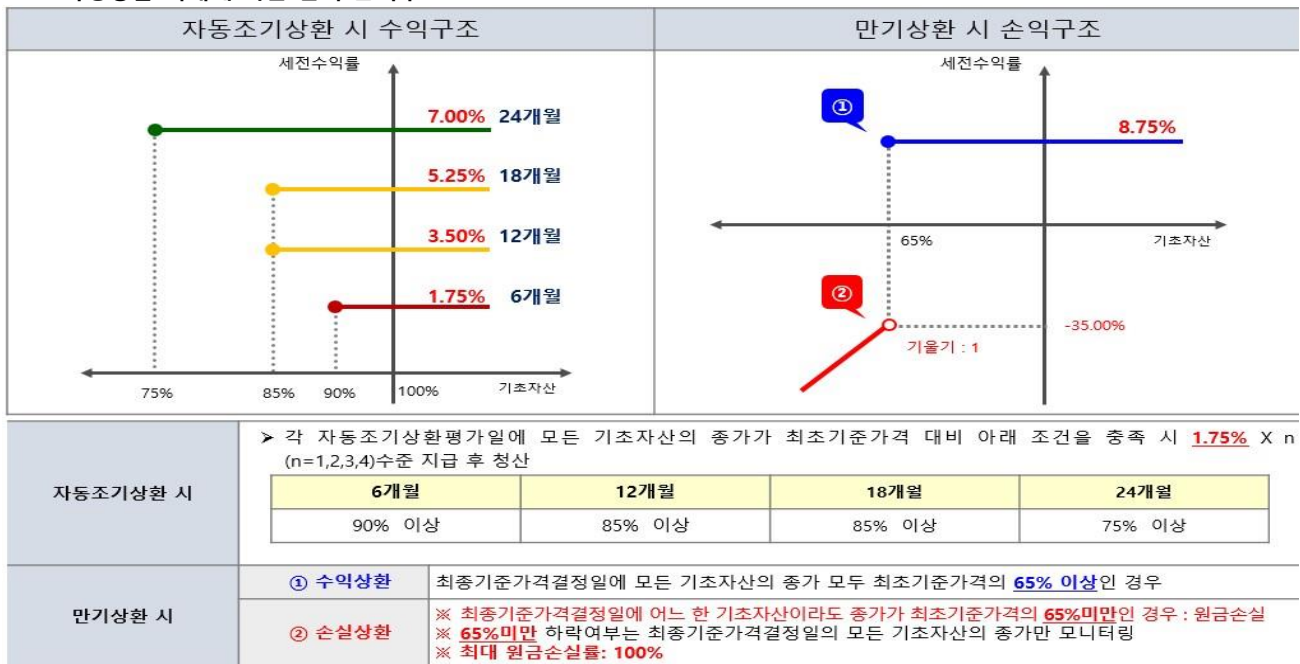
2021-07-08

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

193

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

69

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

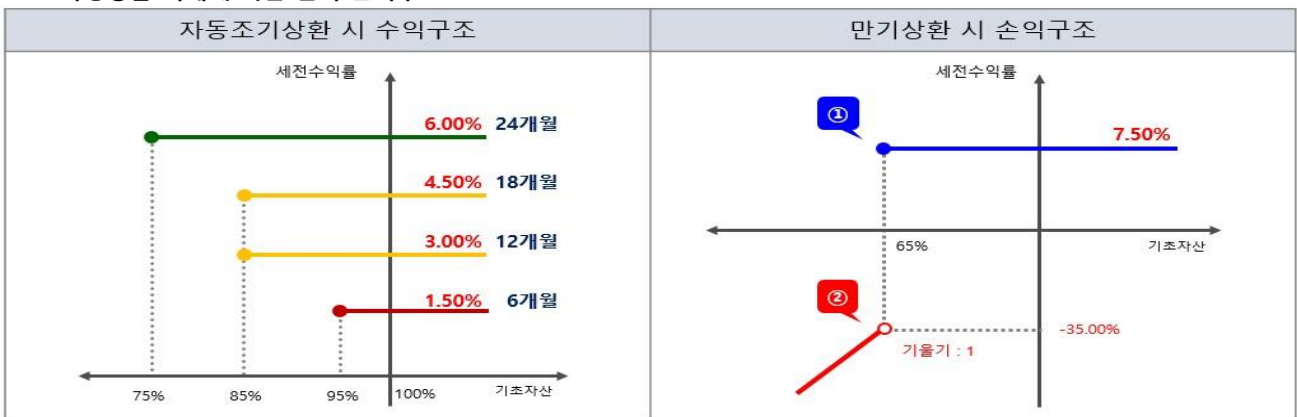
2021-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	10	-10	장외
누계	주식	ELS	1,344		1,344	장외
합계			1,344		1,344	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

▶ 각 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.50% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
95% 이상	85% 이상	85% 이상	75% 이상

만기상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 기초자산의 증가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우
② 손실상환	<ul style="list-style-type: none"> ※ 최종기준가격결정일에 기초자산의 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

73

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-12호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

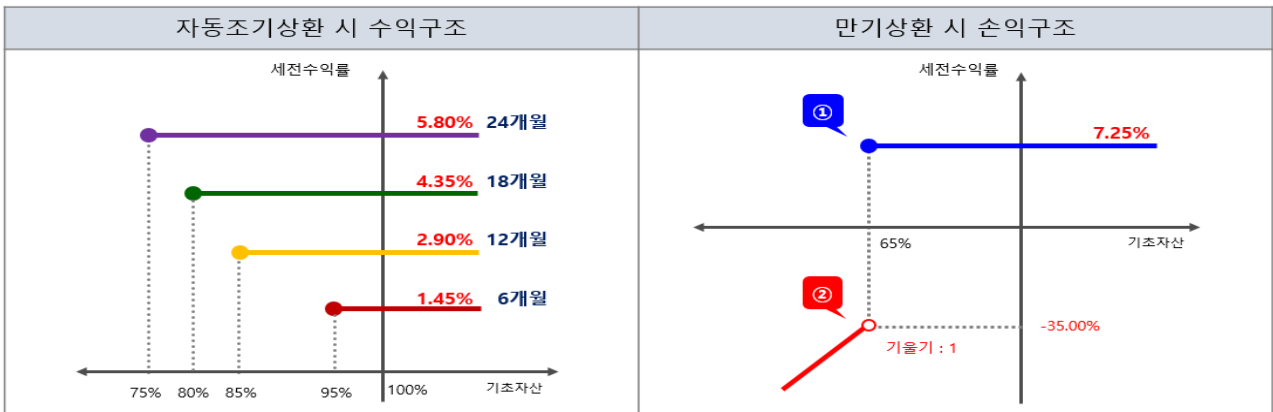
2021-07-08

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 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
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

27

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

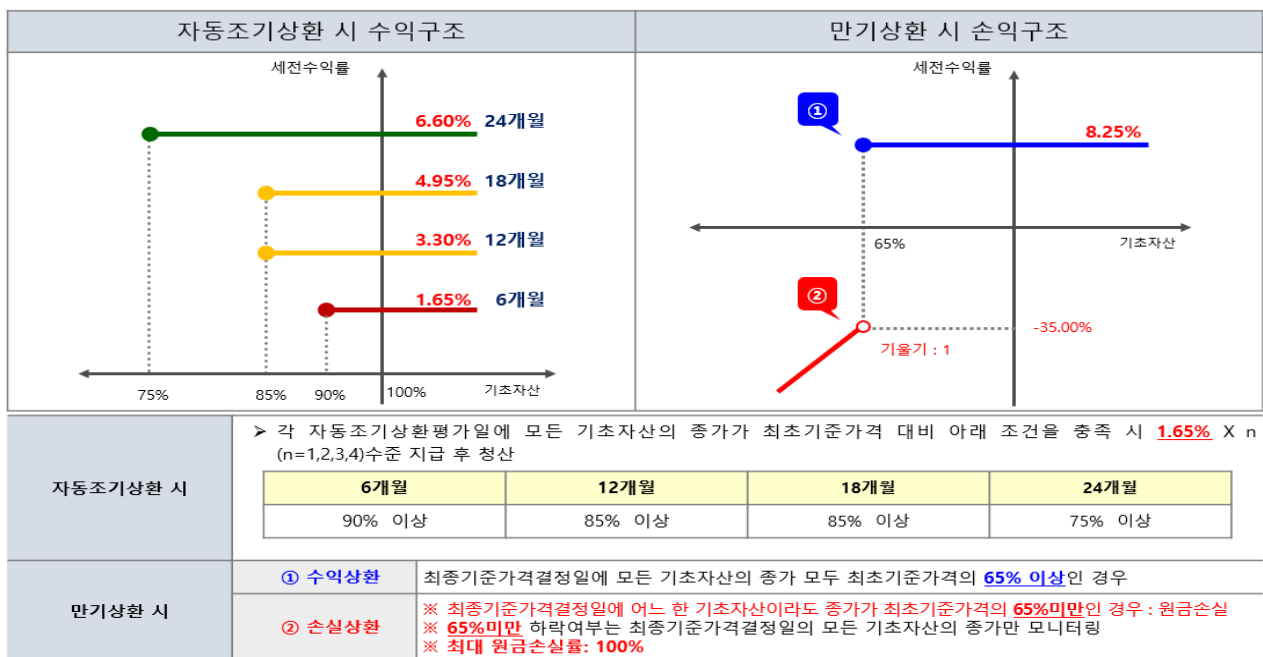
2021-07-08

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

142

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

105

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

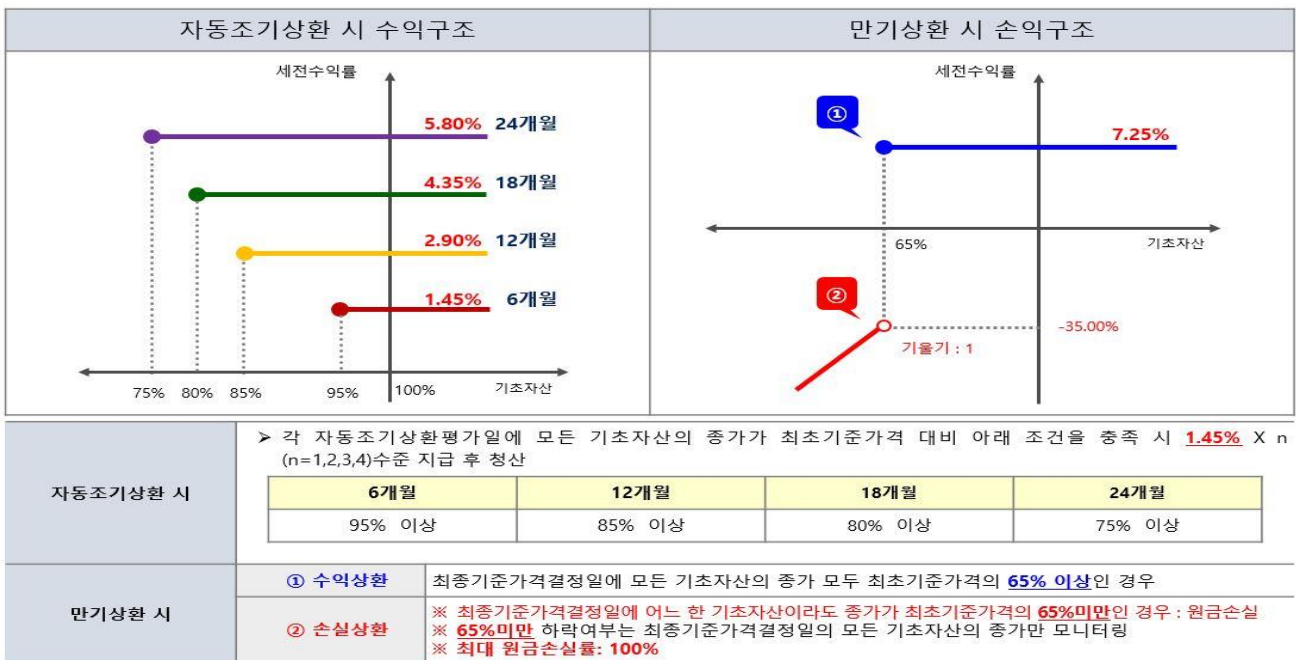
2021-07-08

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

20

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

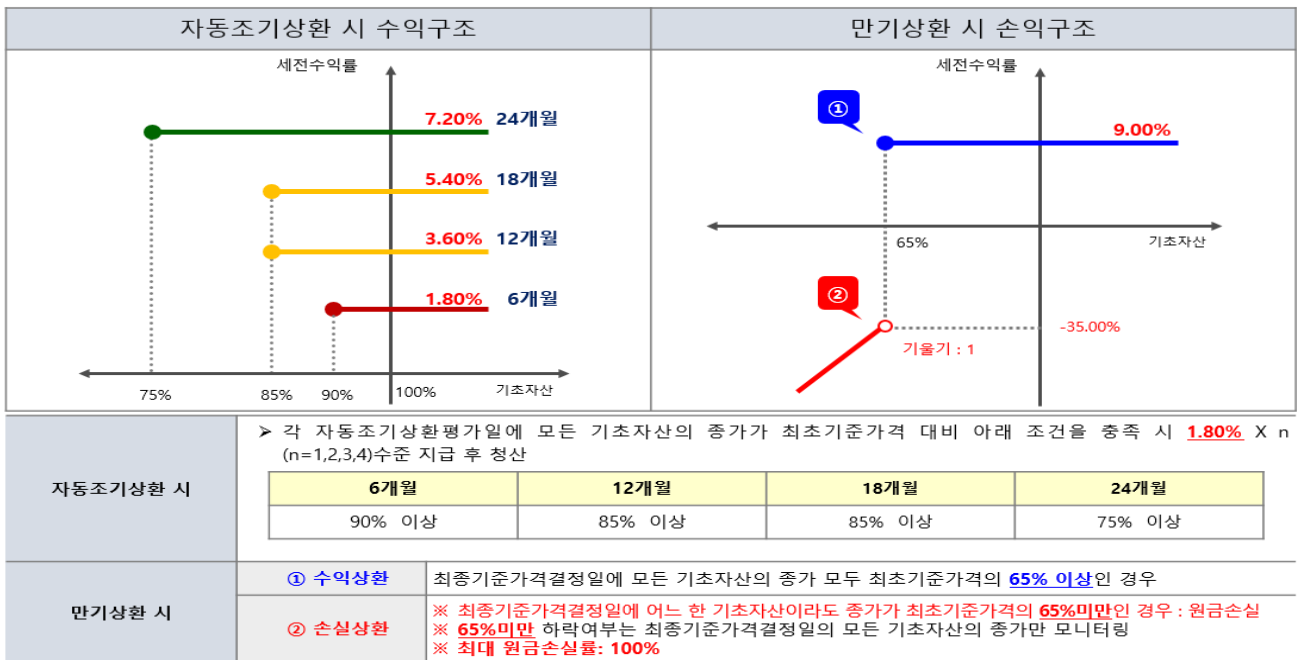
2021-07-08

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

94

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

47

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-14호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

2021-07-08

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

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 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

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

8

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

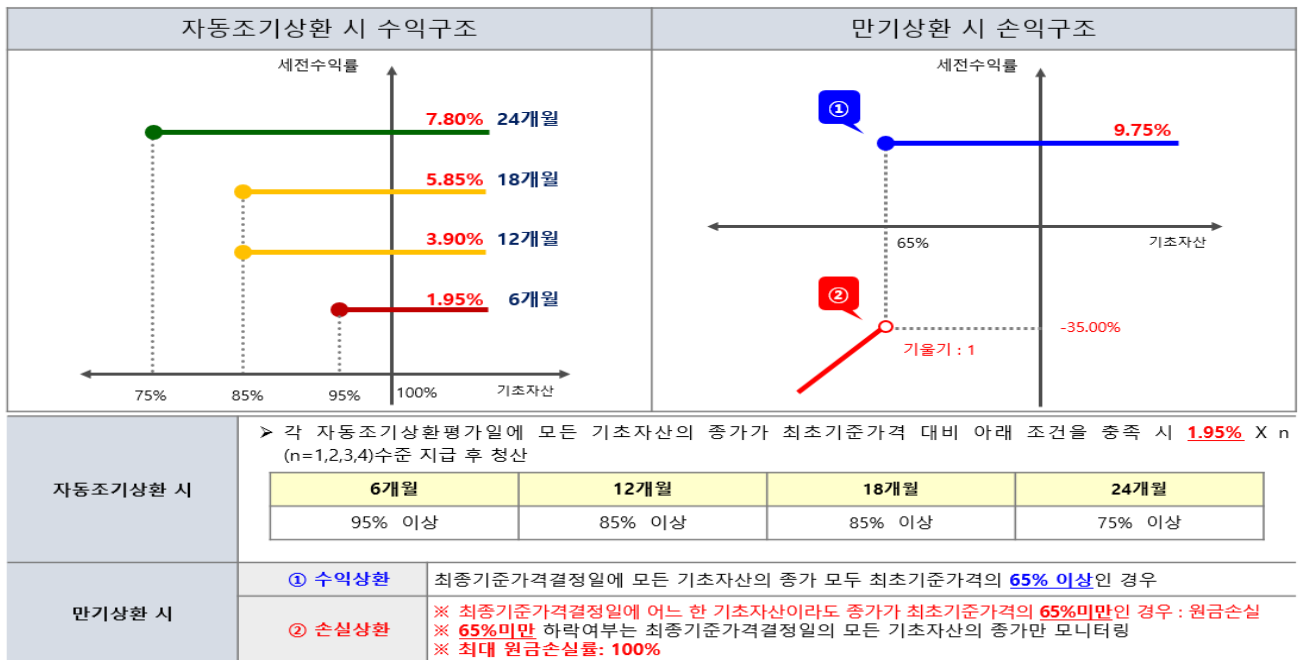
2021-07-08

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

134

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

69

펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일: 2021-07-08

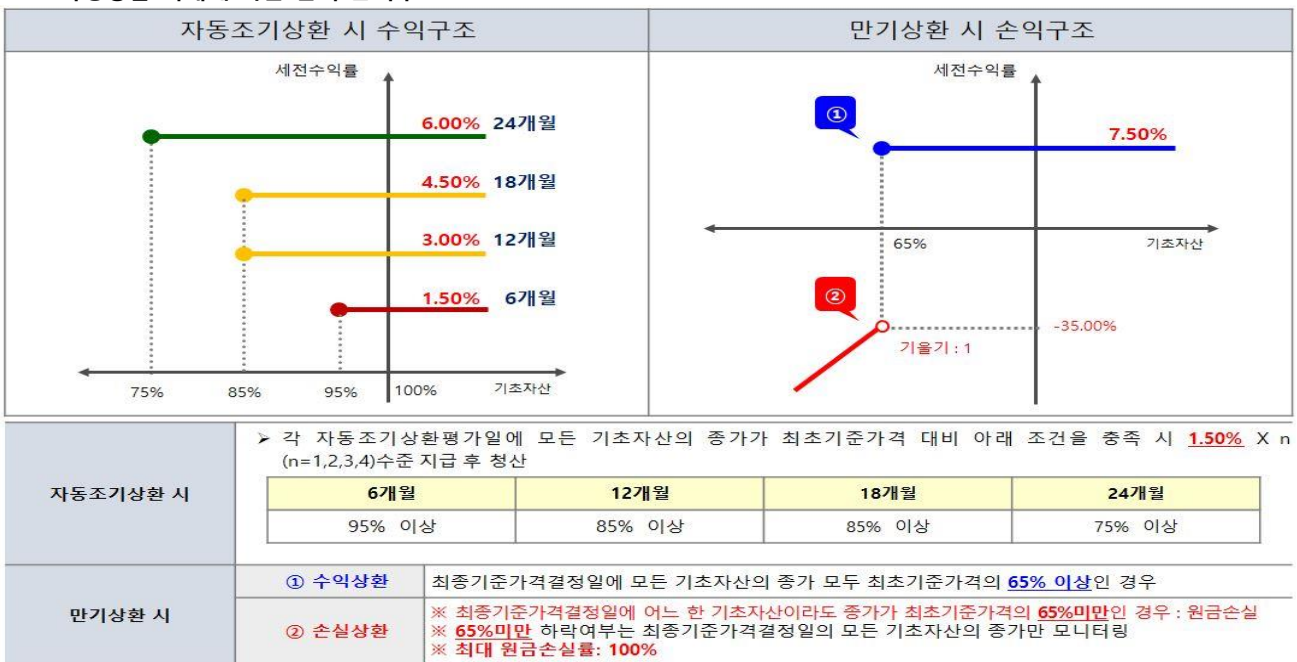
2021-07-08

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	97		97	장외
합계			97		97	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

6

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

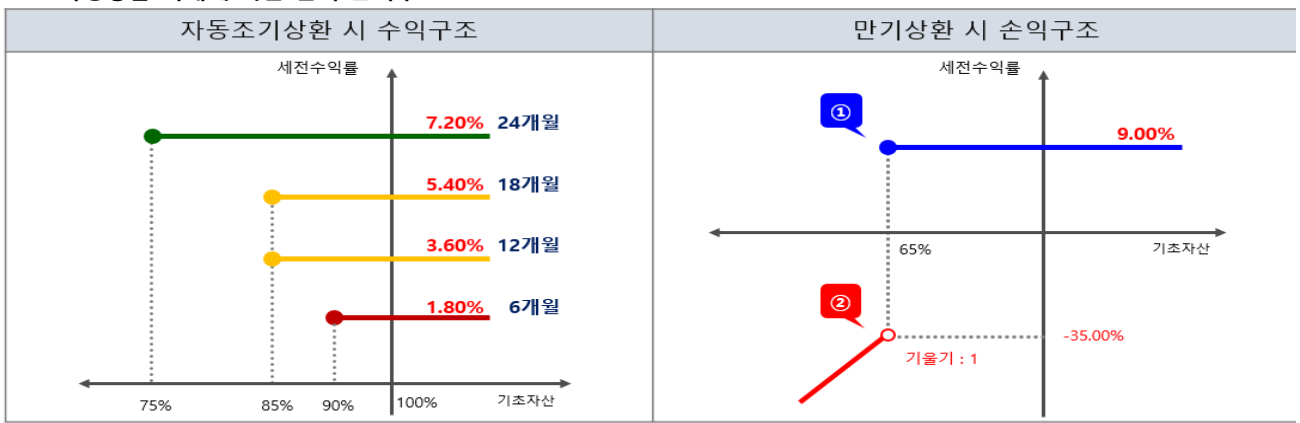
2021-07-08

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

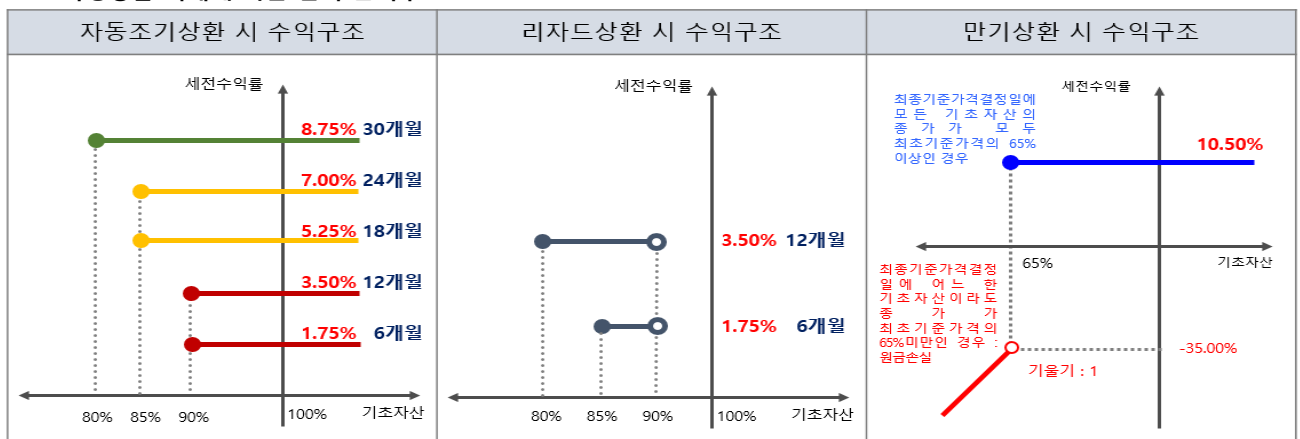
2021-07-08

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	1,850		1,850	장외
합계			1,850		1,850	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

109

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

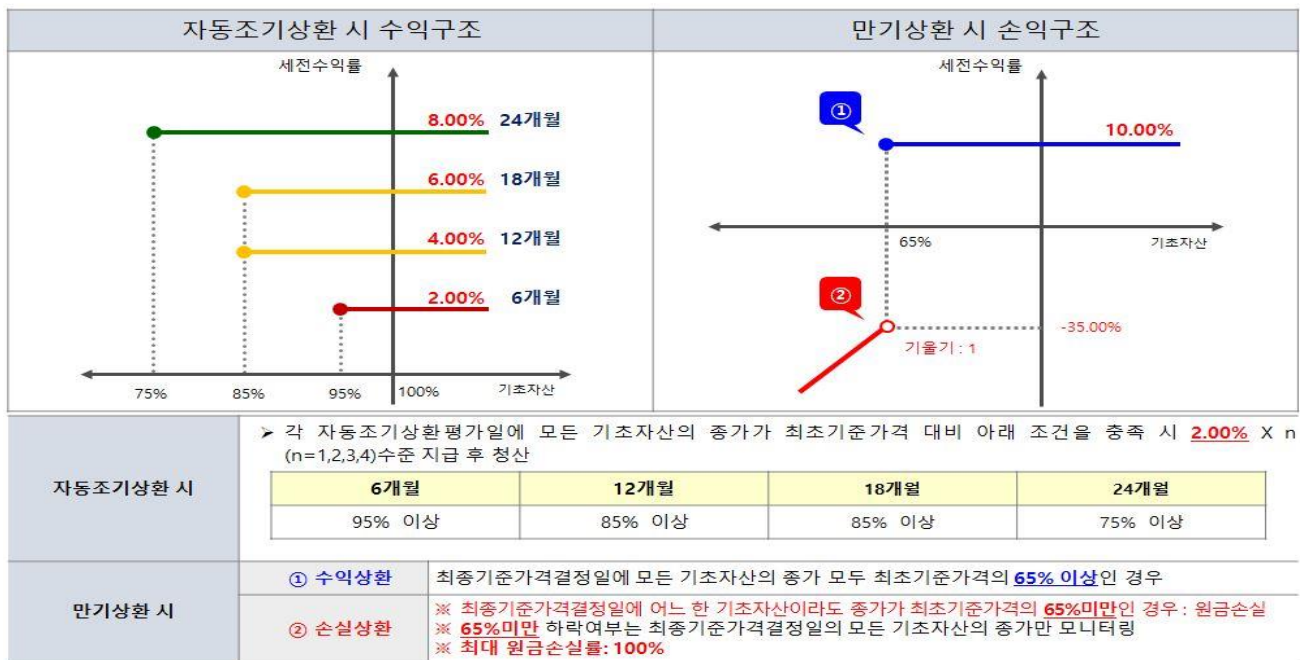
2021-07-08

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	942		942	장외
합계			942		942	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

34

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권HSN-2호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

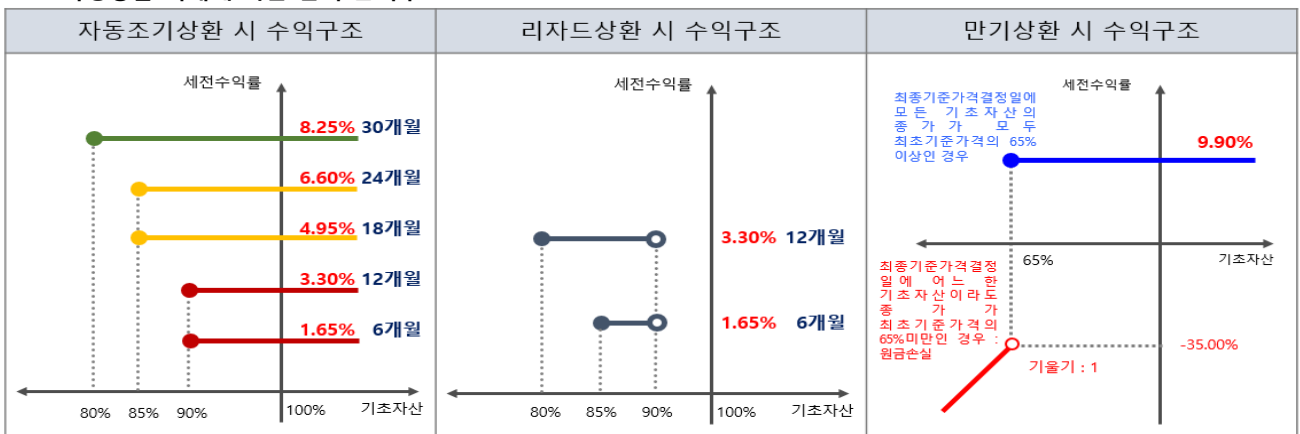
2021-07-08

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	450		450	장외
합계			450		450	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 1.65% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.30% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.30% 수익 지급
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

29

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

기준일 : 2021-07-07

공시일:

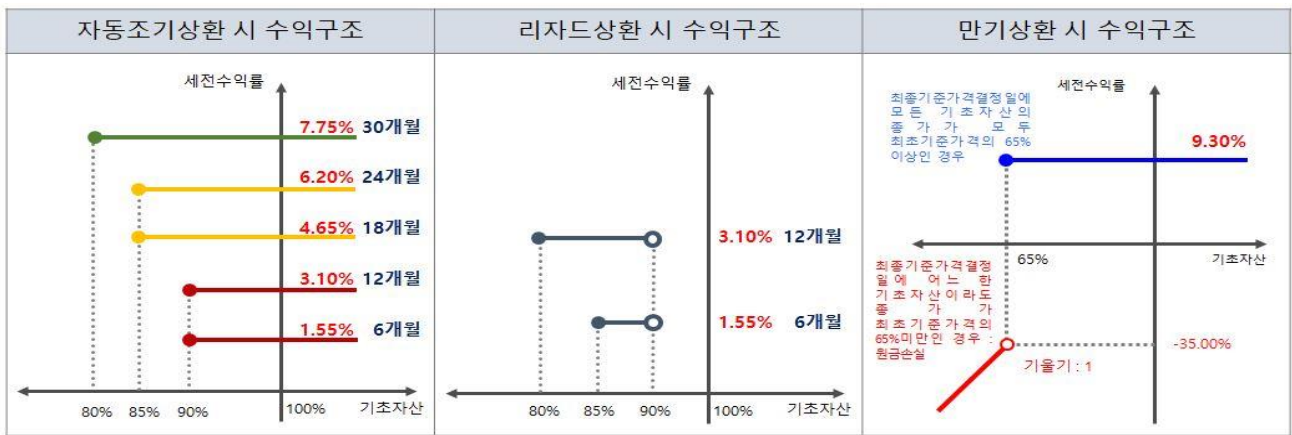
2021-07-08

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	777		777	장외
합계			777		777	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 1.55% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급
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

56

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

49

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-8호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-07

공시일:

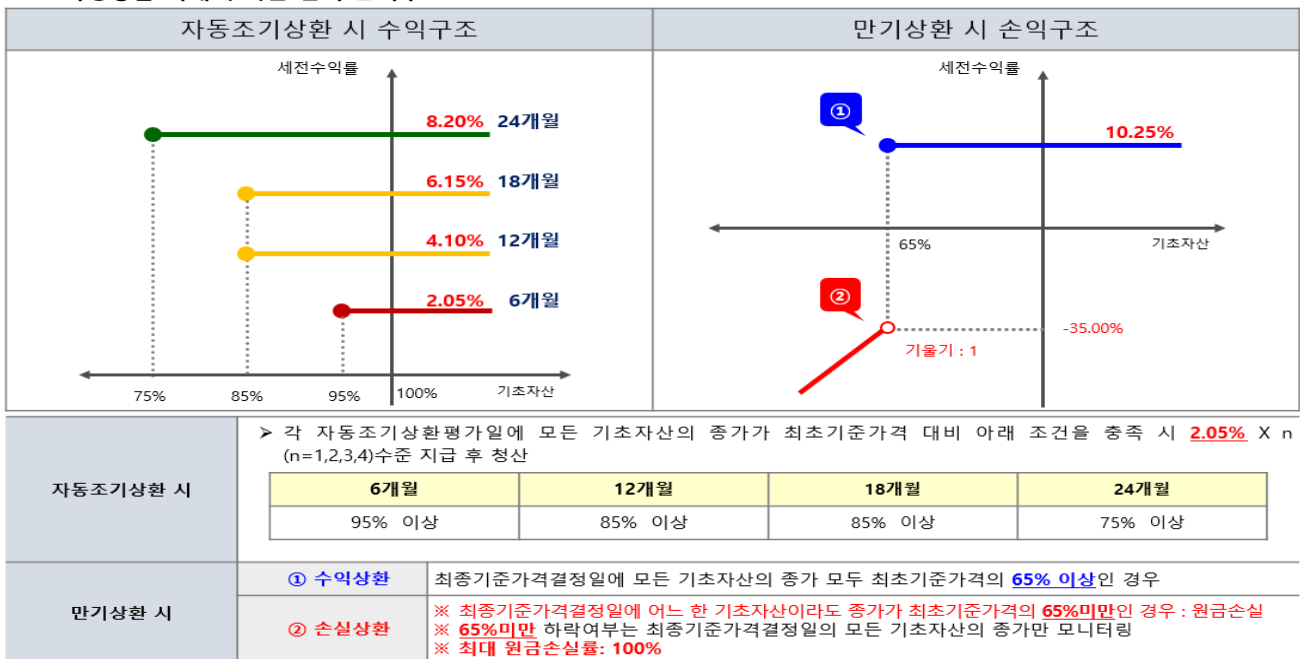
2021-07-08

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	1,286		1,286	장외
합계			1,286		1,286	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

40