

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-07-12

공시일:

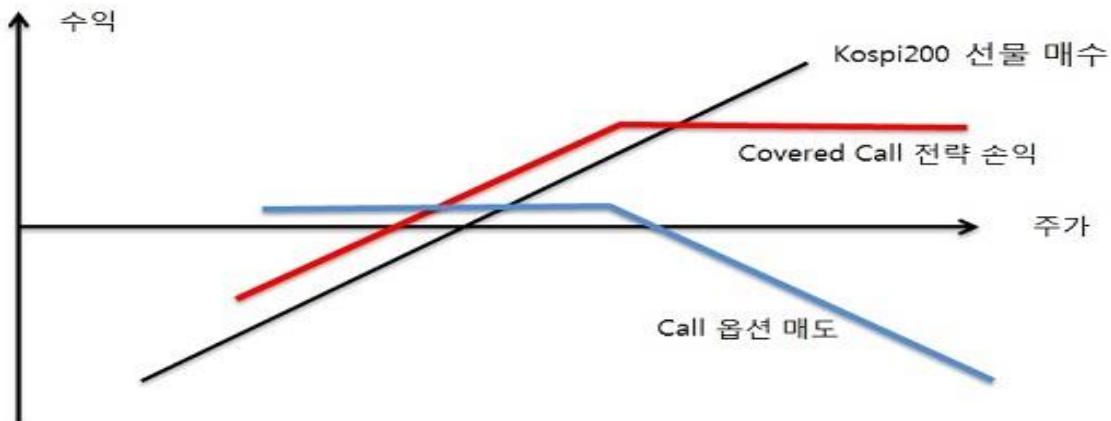
2021-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	216	431	-216	장내
누계	주가지수	선물	3,450	0	3,450	장내
신규	주가지수	옵션	1	434	-433	장내
누계	주가지수	옵션	0	541	-541	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	700	15	685	장내
합계			4,151	556	3,595	

## 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

285

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

325

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	129	0	129	장내
누계	주가지수	선물	9,596	43	9,553	장내
합계			9,596	43	9,553	

## 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

765

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

827

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

183

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

27

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

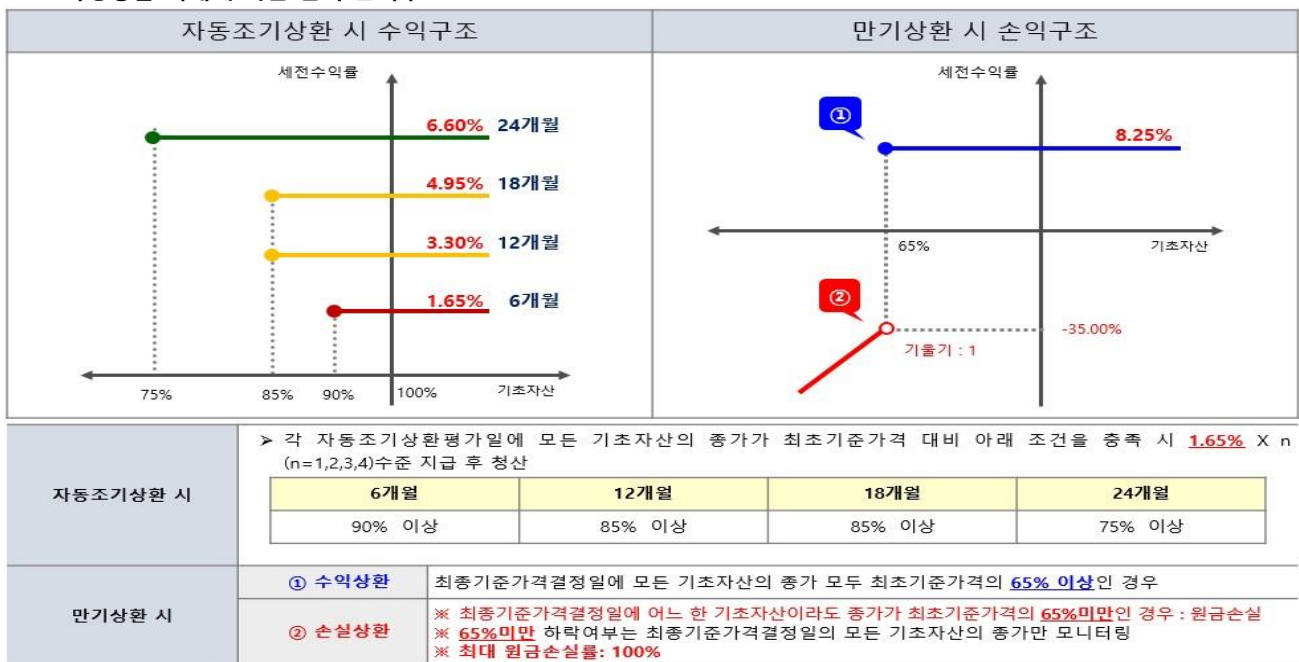
2021-07-13

## 1. 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

39

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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

145

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

30

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

2021-07-13

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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

165

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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

32

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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

153

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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

52

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-1호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

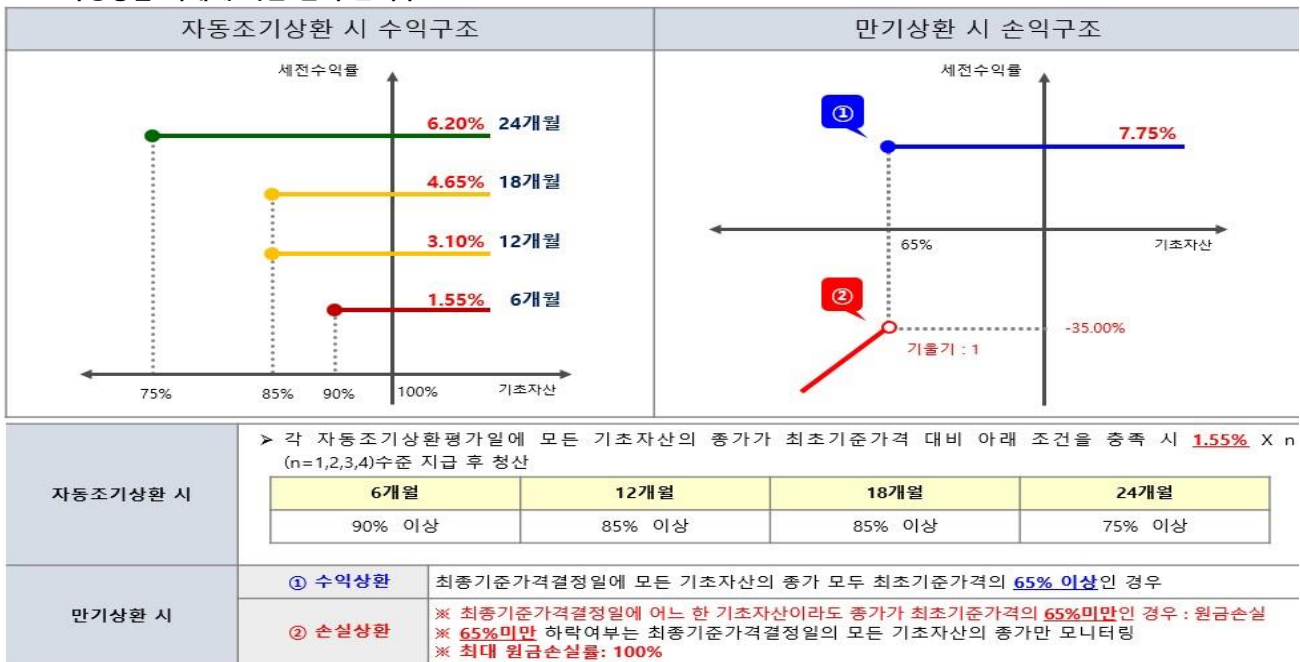
2021-07-13

## 1. 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

12

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

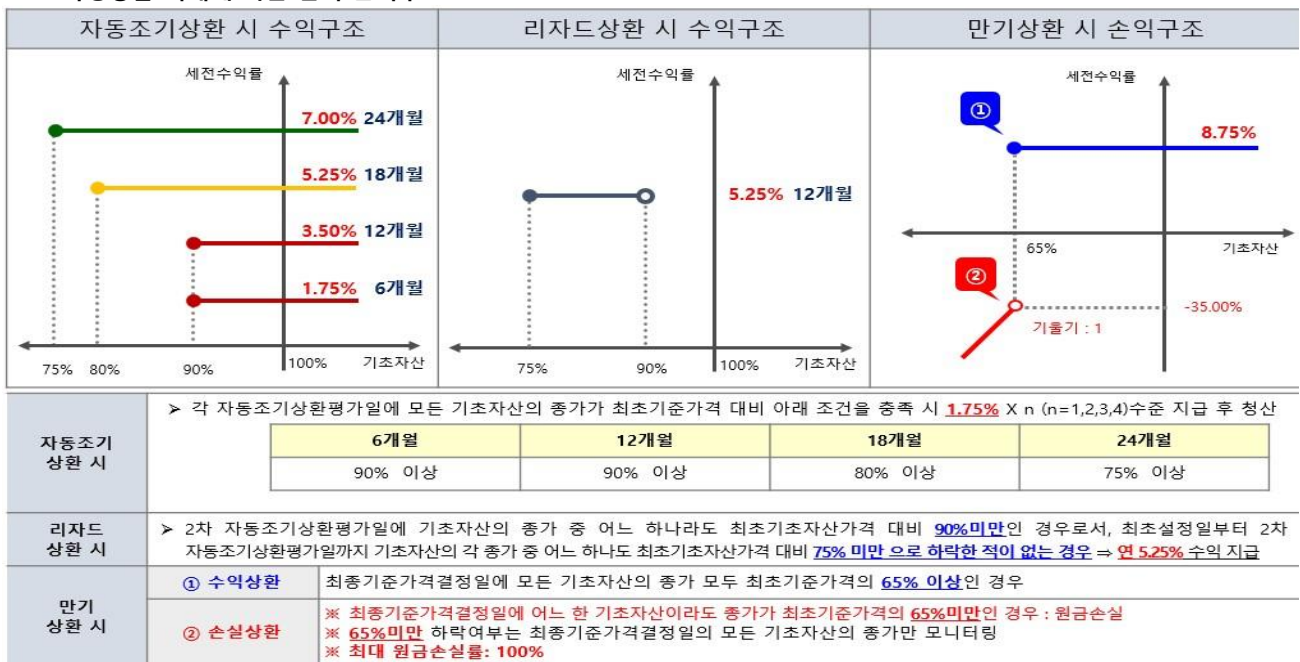
2021-07-13

## 1. 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

50

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

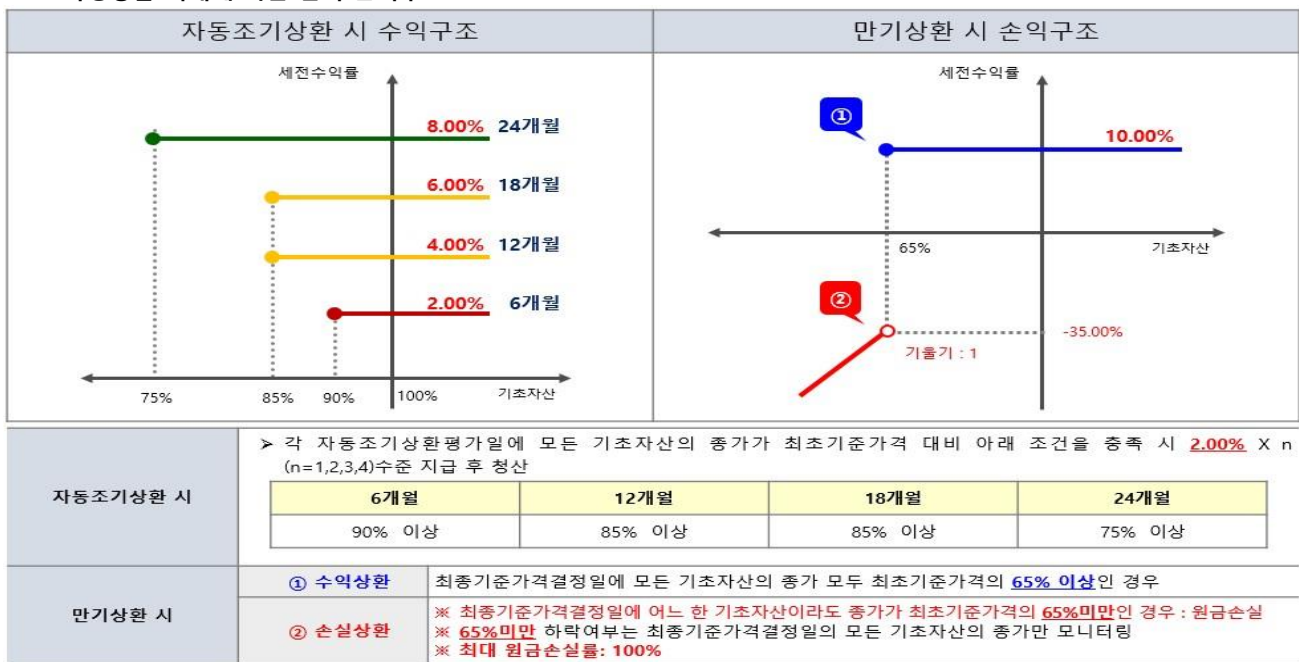
2021-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,128		2,128	장외
합계			2,128		2,128	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

35

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 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 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>리자드상환 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 5.25% 수익 지급</p>	<p>만기상환 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

20

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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>                     &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 자 드 상 환 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 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

5

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)NK-4호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

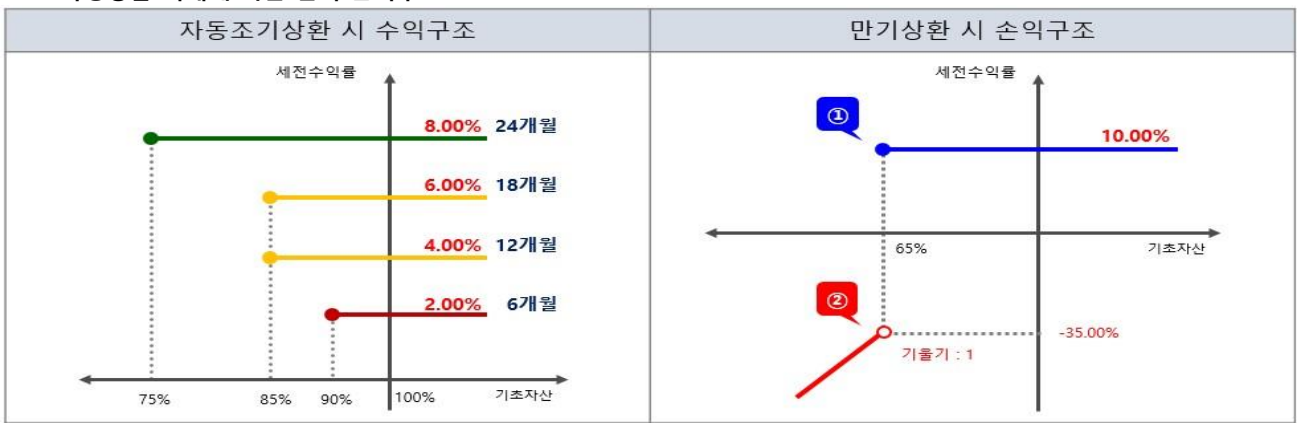
2021-07-13

## 1. 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	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실</li> <li>※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링</li> <li>※ 최대 원금손실률: 100%</li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

89

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

42

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

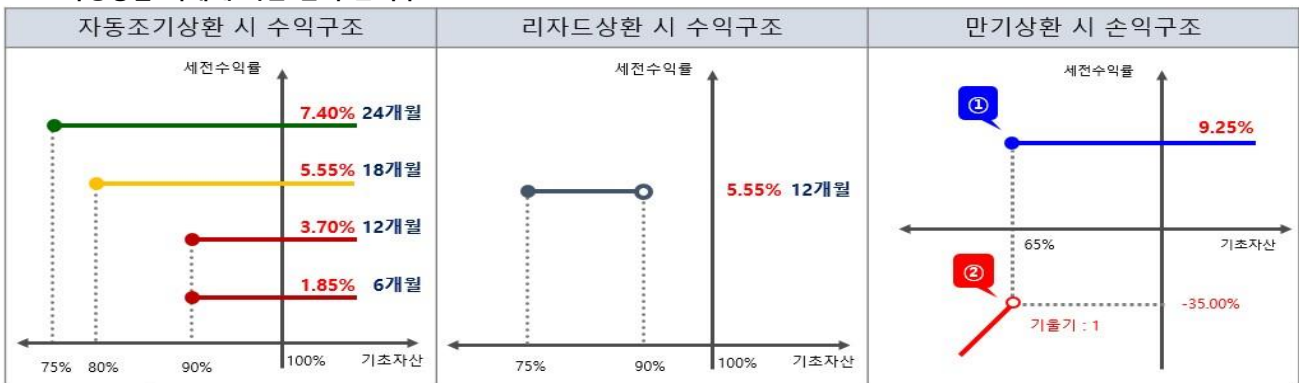
2021-07-13

## 1. 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	<p>&gt; 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
6개월	12개월	18개월	24개월						
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상						
리자드상환 시	<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 5.55% 수익 지급</p>								
만기상환 시	<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>								

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-2호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

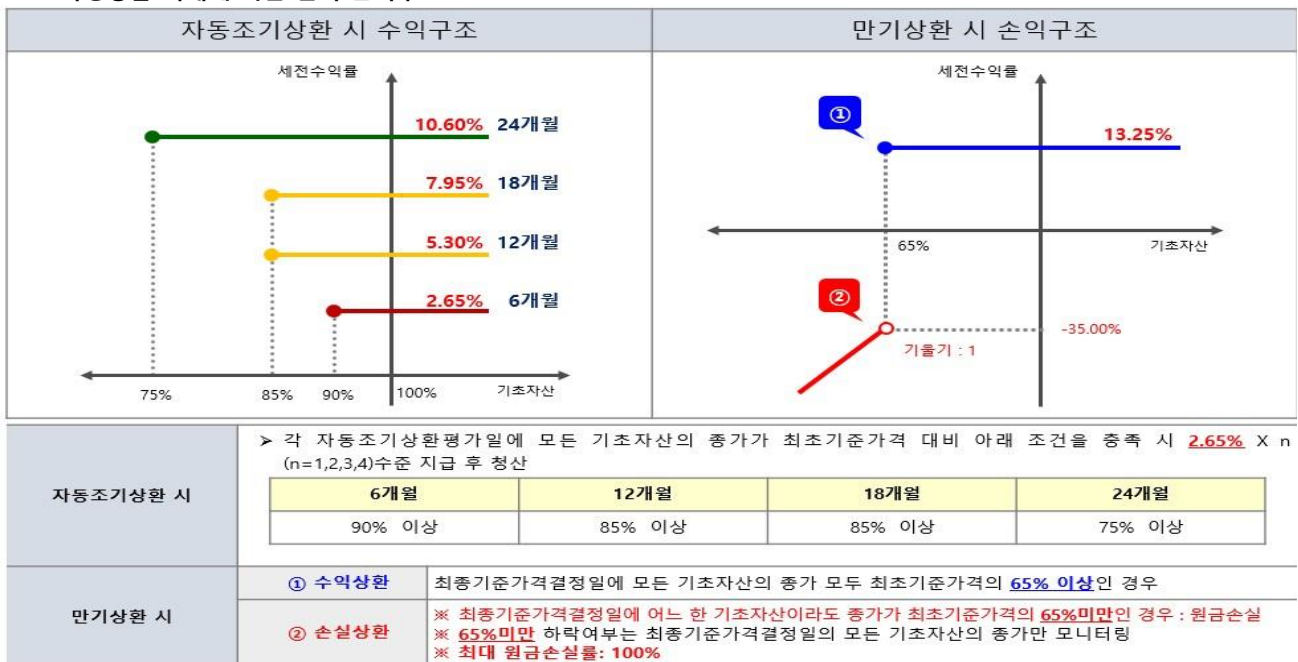
2021-07-13

## 1. 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

208

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

49

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-3호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

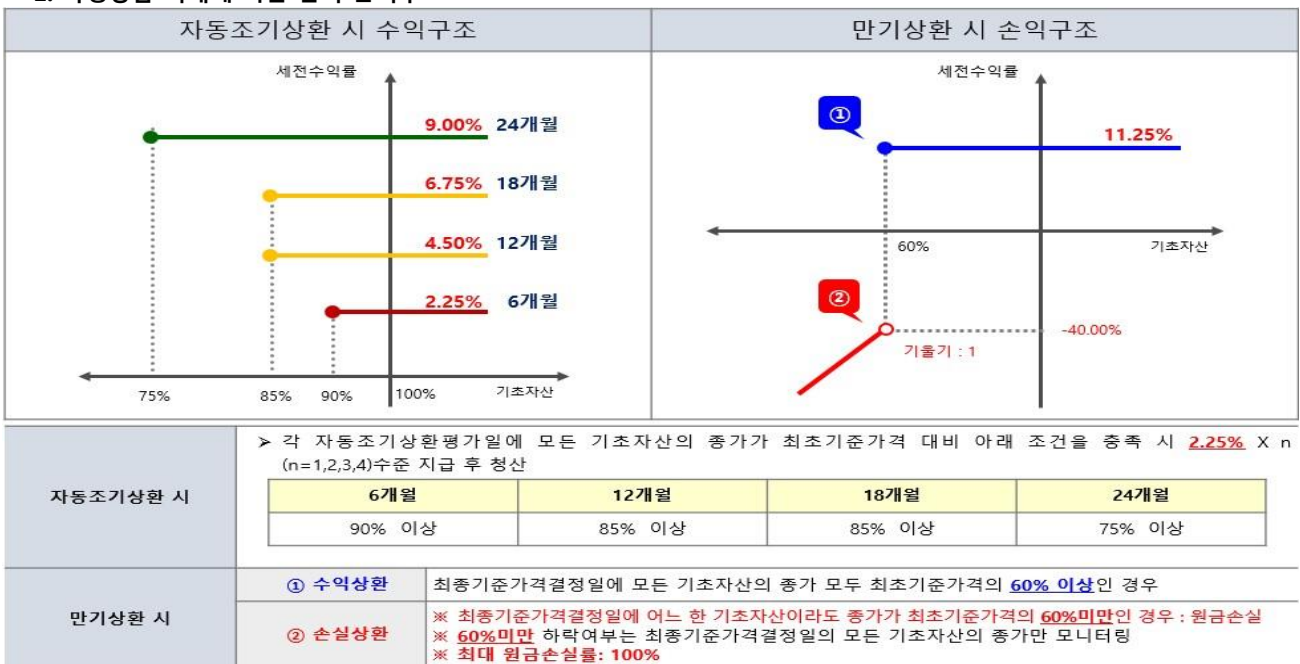
2021-07-13

## 1. 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

17

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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 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

43

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

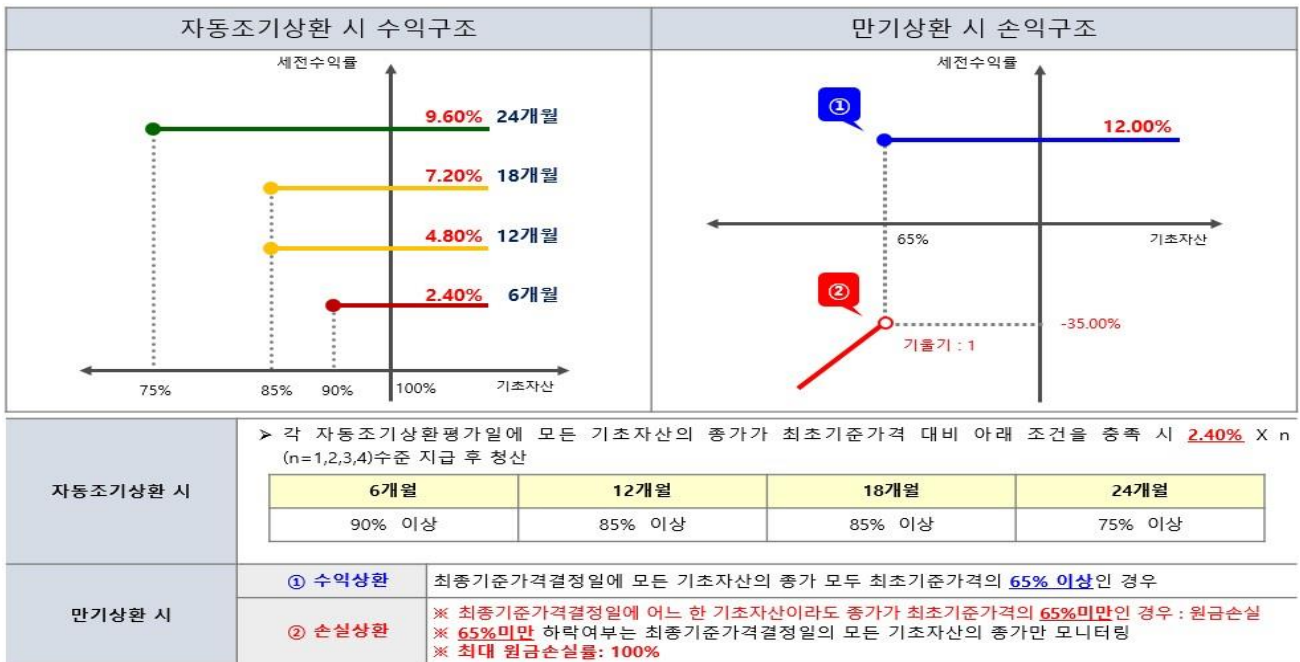
2021-07-13

## 1. 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)

33

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-5호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

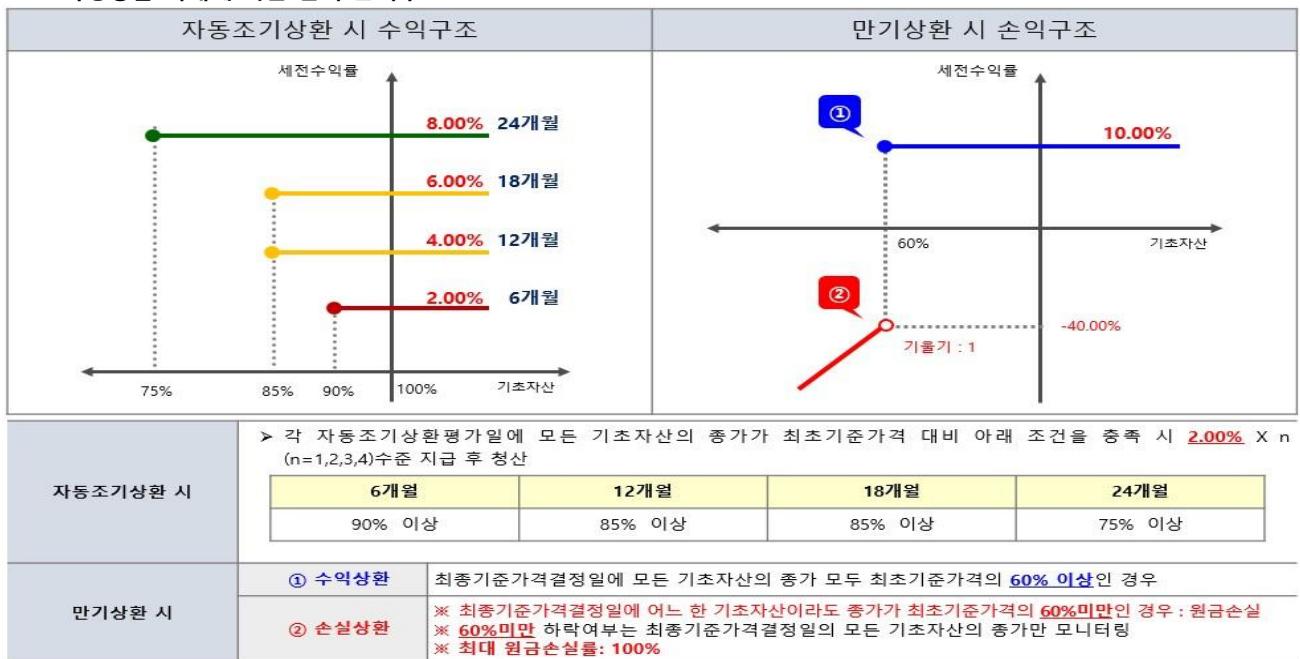
2021-07-13

## 1. 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

15

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

6

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

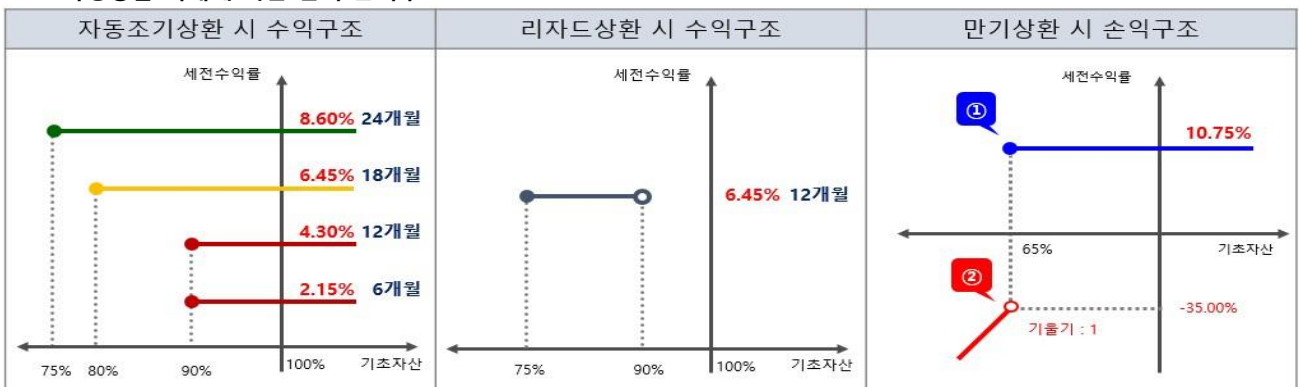
2021-07-13

## 1. 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 <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 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

41

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

18

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-6호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

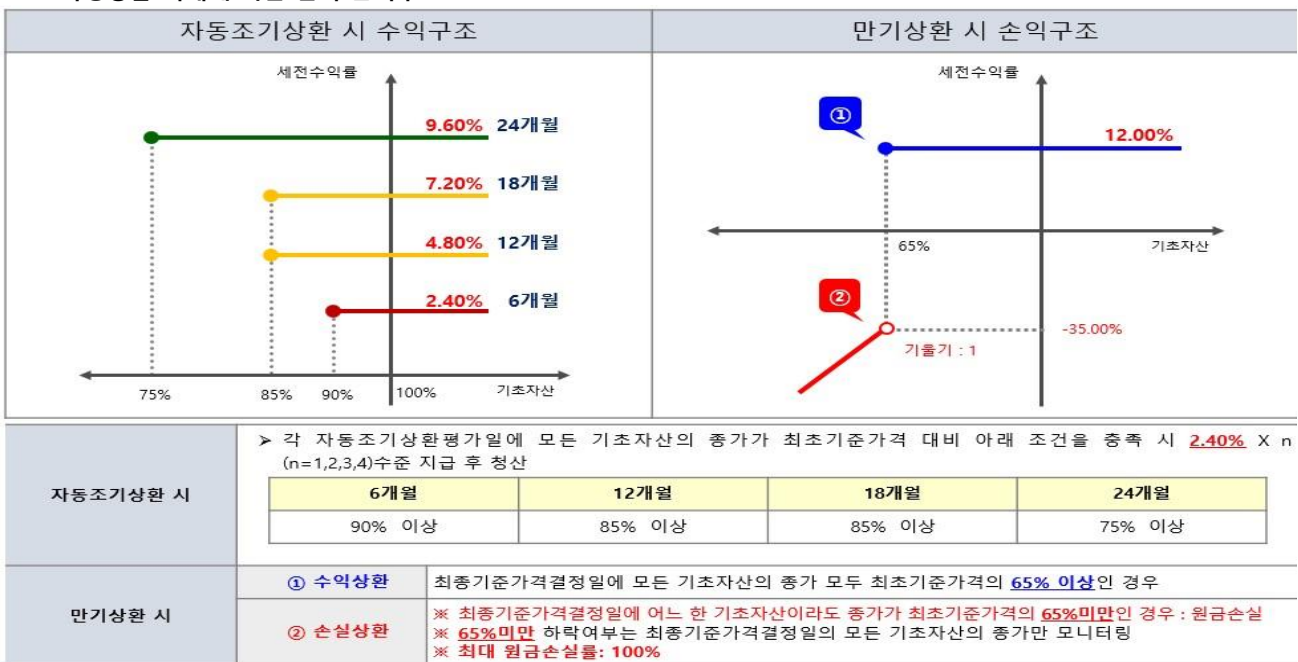
2021-07-13

## 1. 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

59

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

13

# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)K-7호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

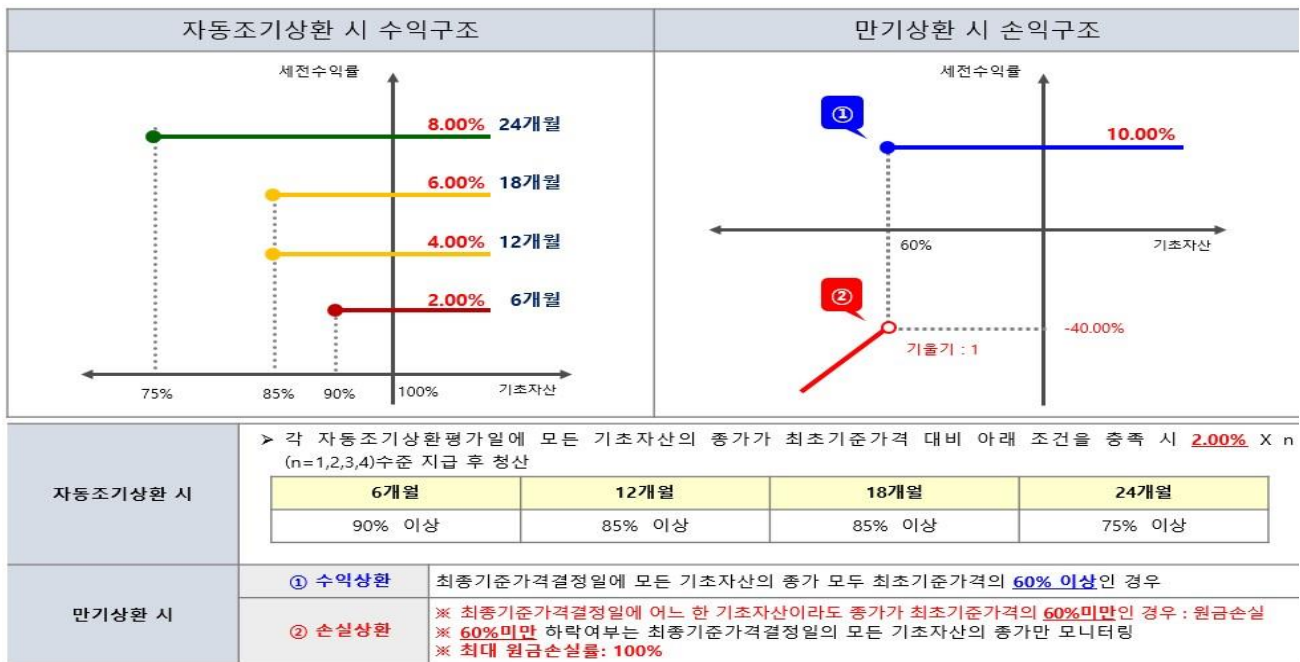
2021-07-13

## 1. 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

8

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

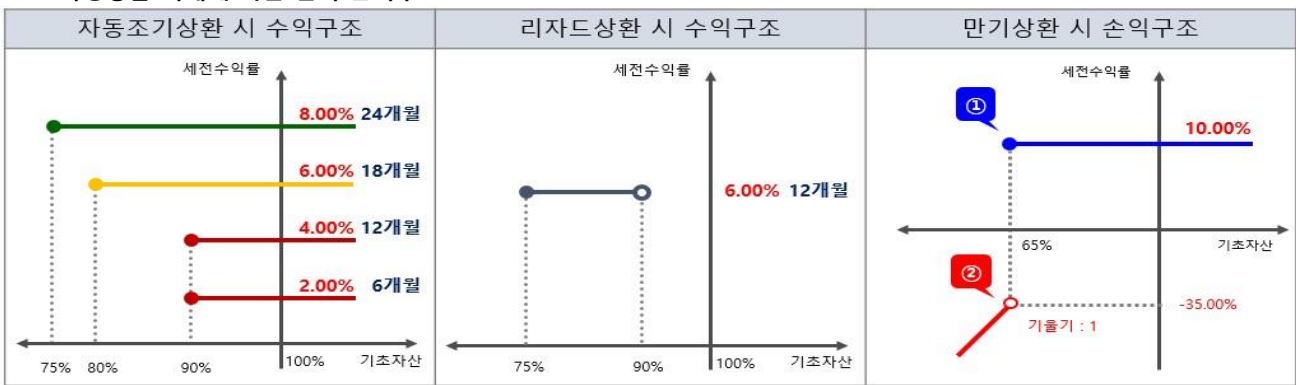
2021-07-13

## 1. 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 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 월급손실률: 100%		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

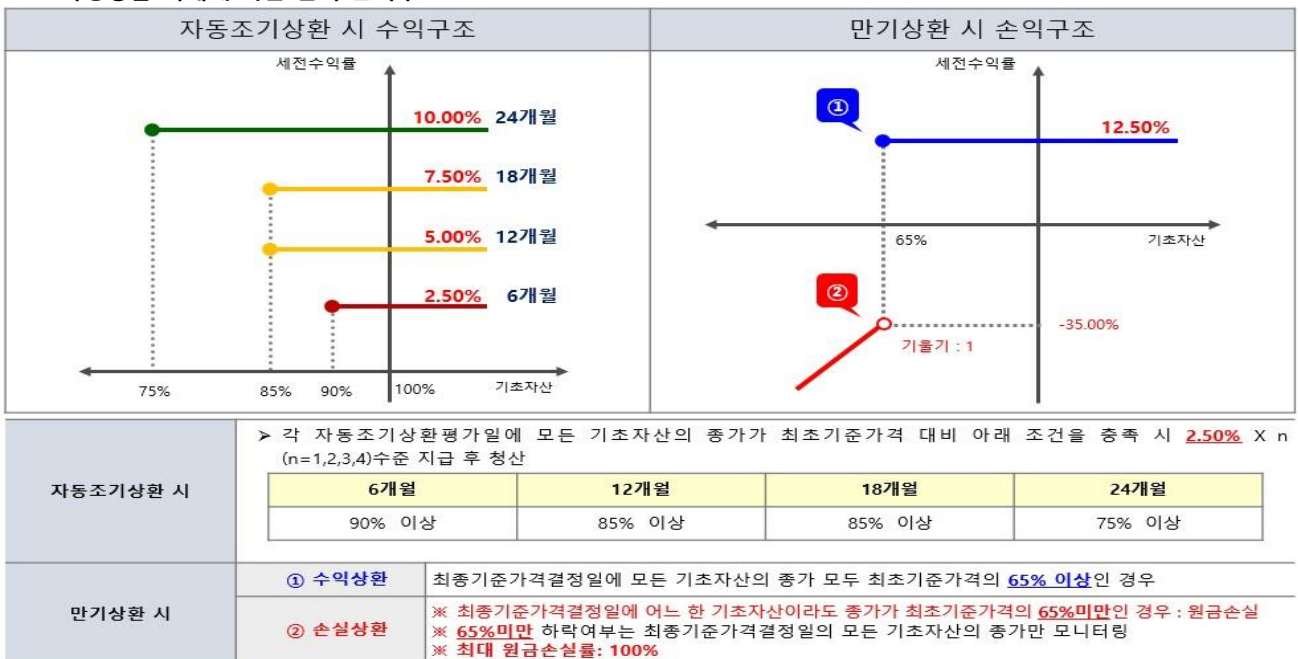
2021-07-13

## 1. 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

73

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

23

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

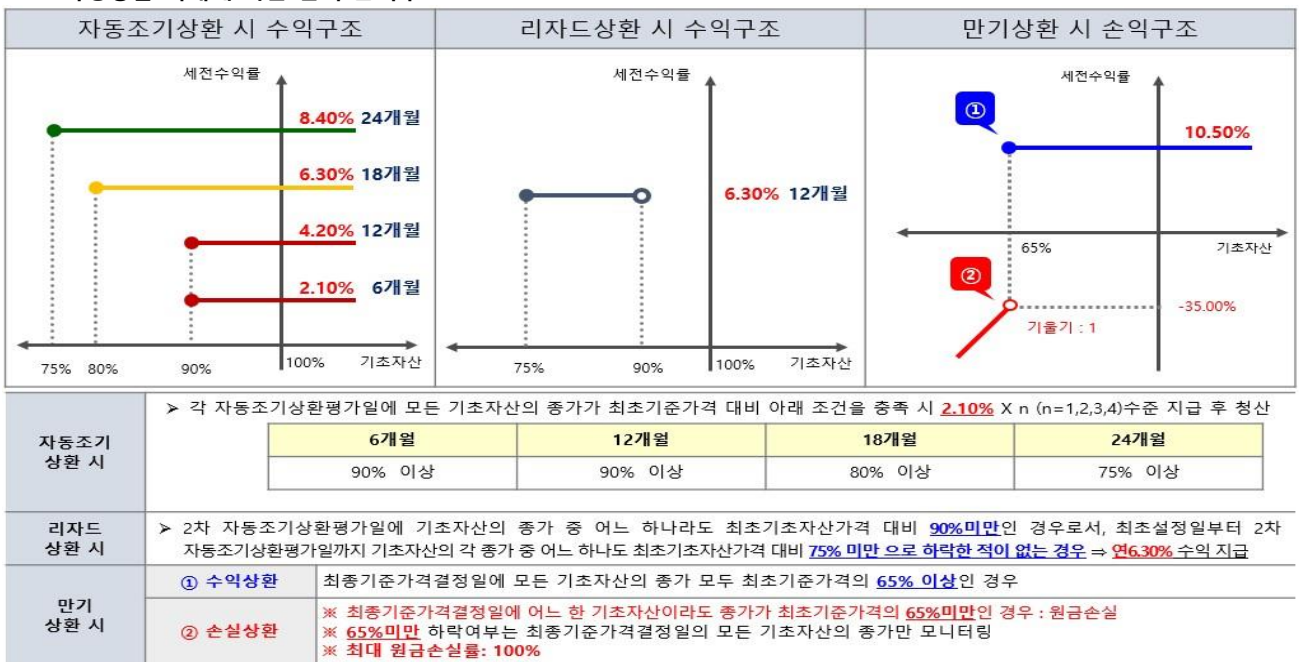
2021-07-13

## 1. 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 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

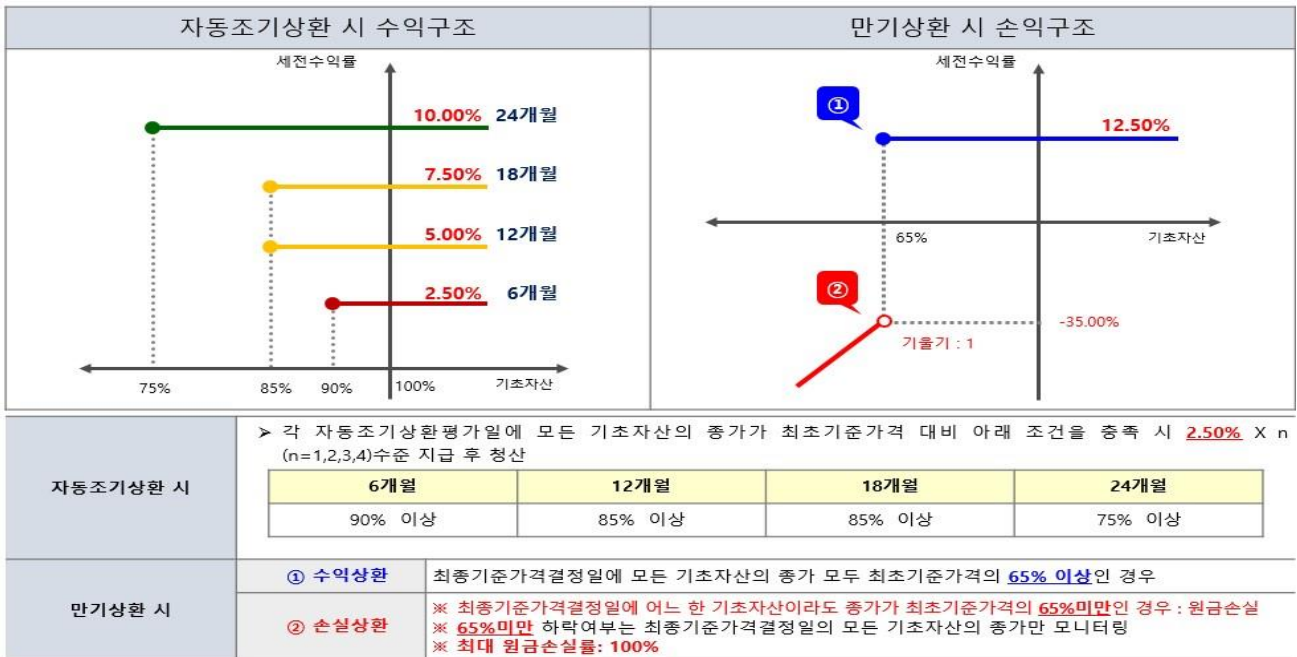
2021-07-13

## 1. 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

99

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

65

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

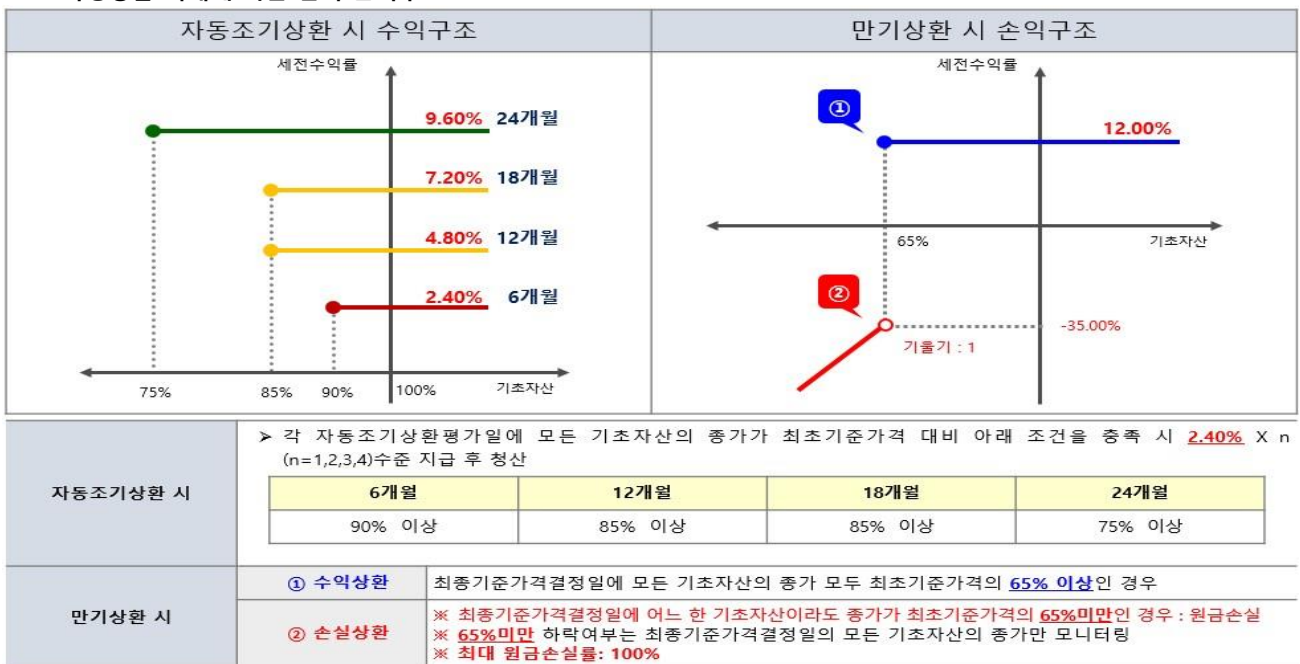
2021-07-13

## 1. 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

75

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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>&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 자 드 상 환 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>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

29

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

17

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

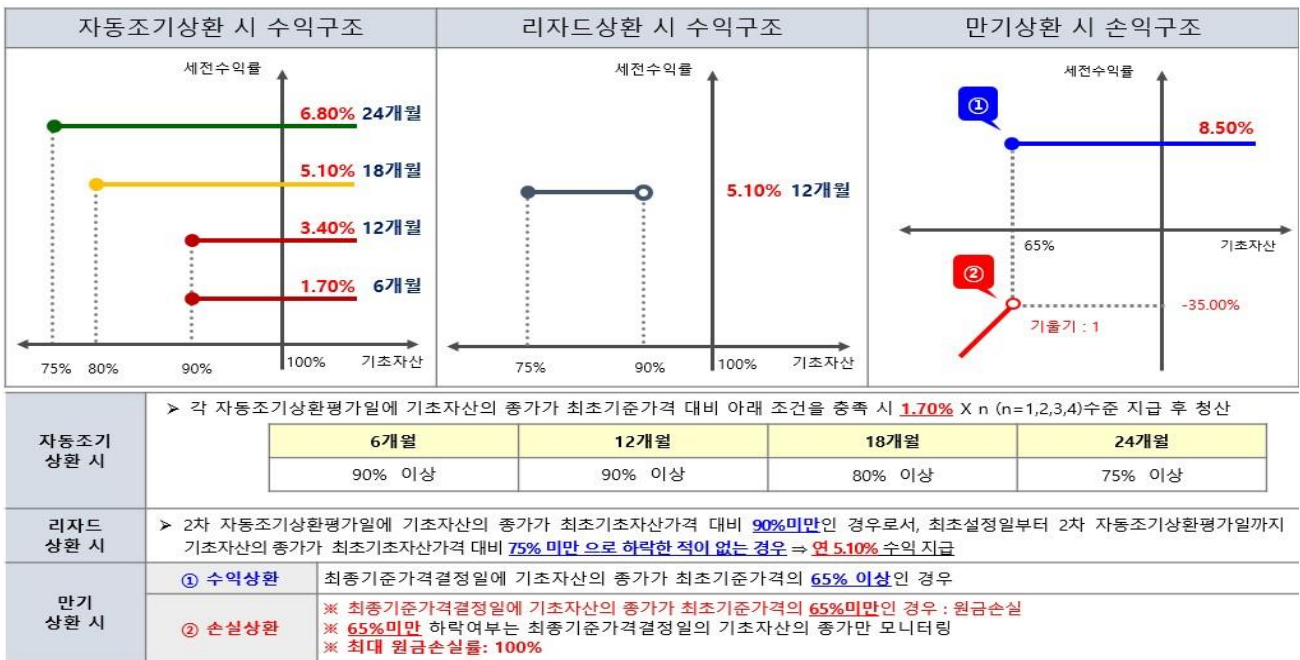
2021-07-13

## 1. 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

40

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

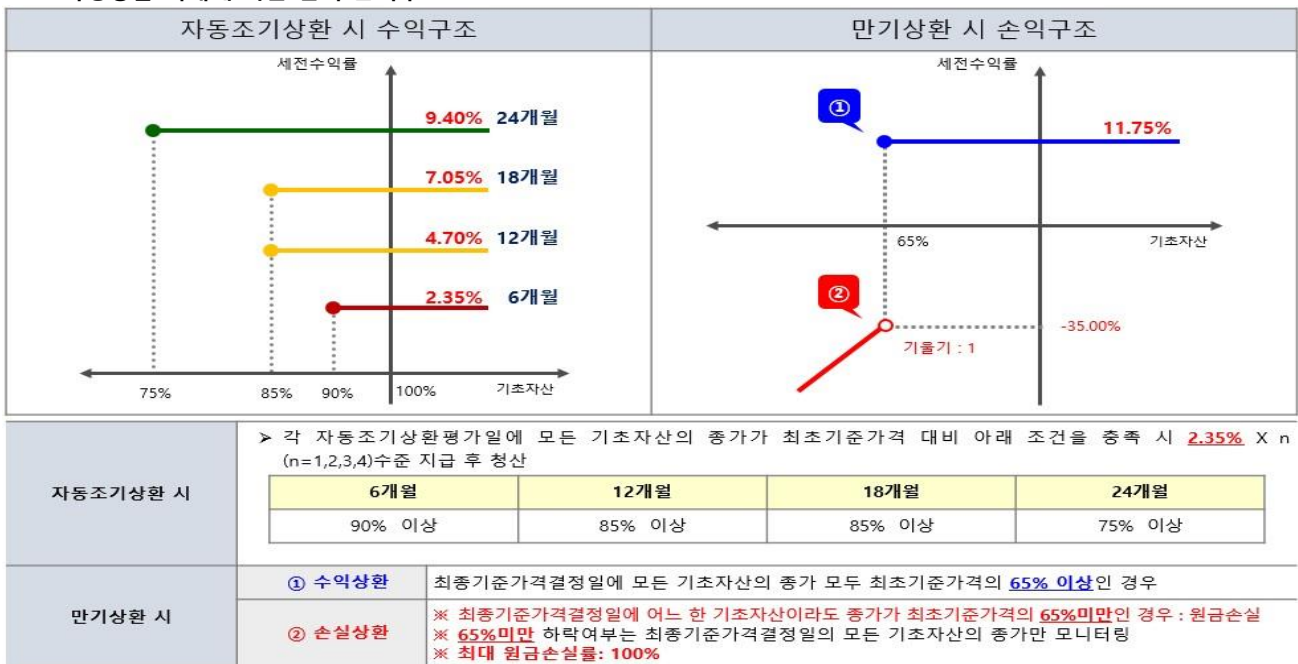
2021-07-13

## 1. 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

106

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

78

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

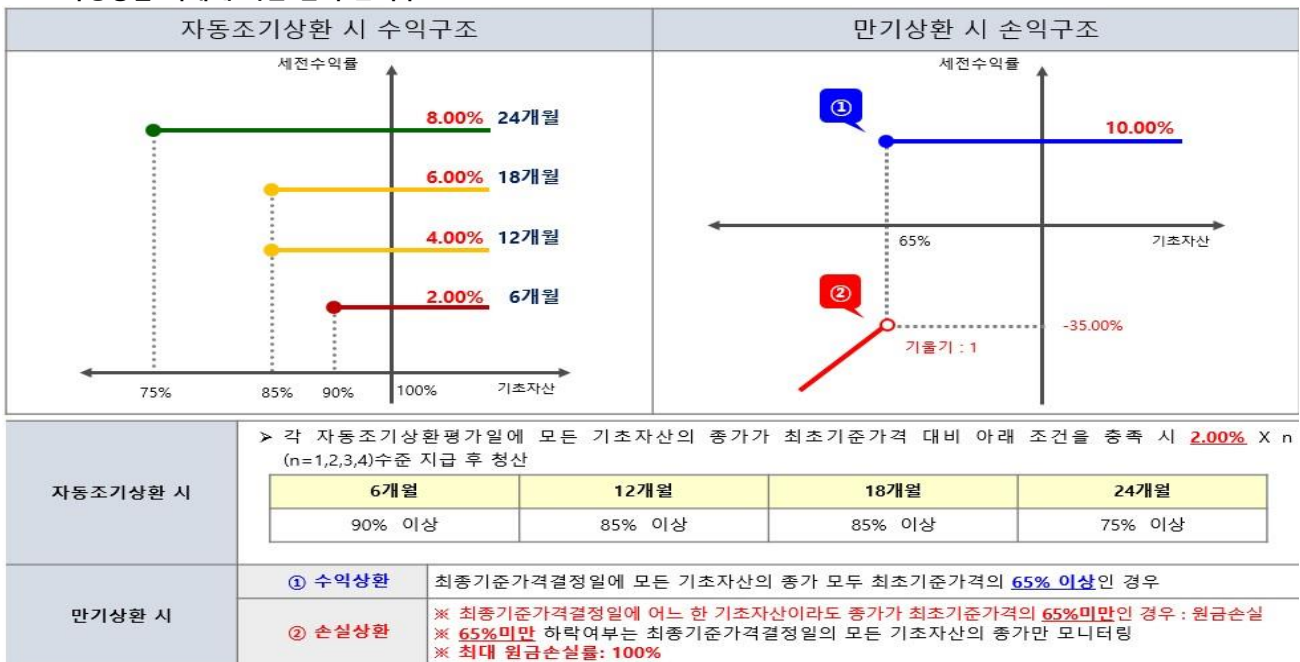
2021-07-13

## 1. 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

64

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

48

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

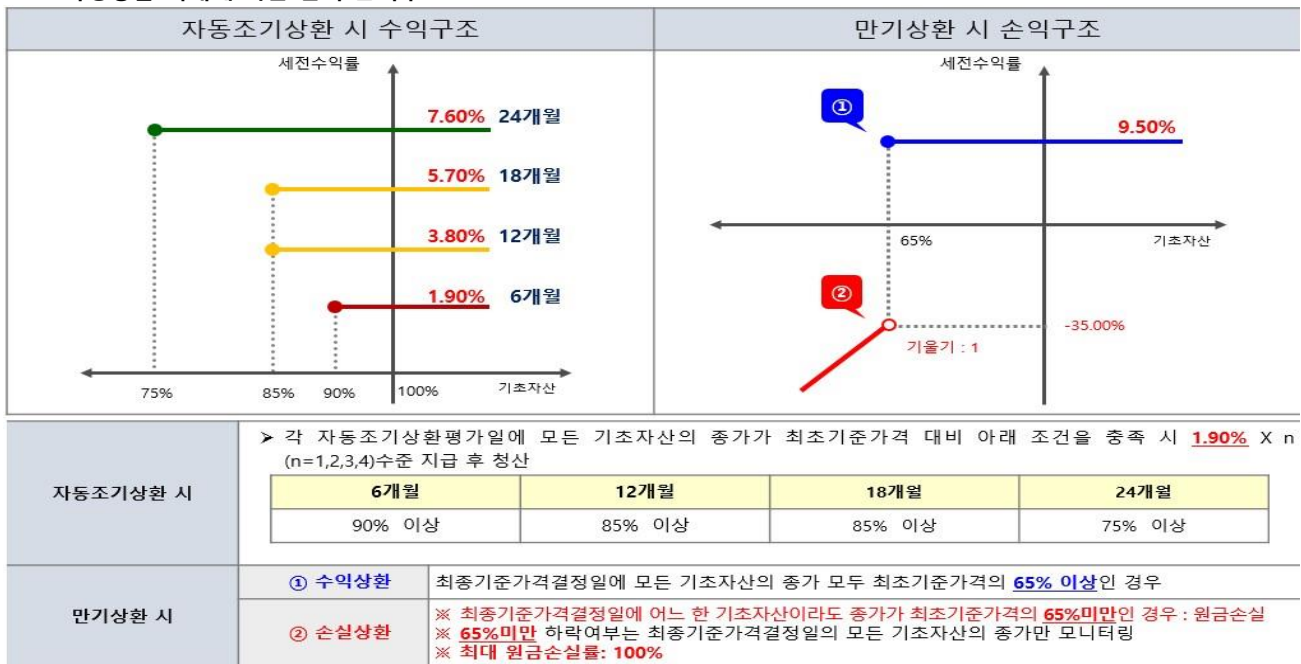
2021-07-13

## 1. 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)

48

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

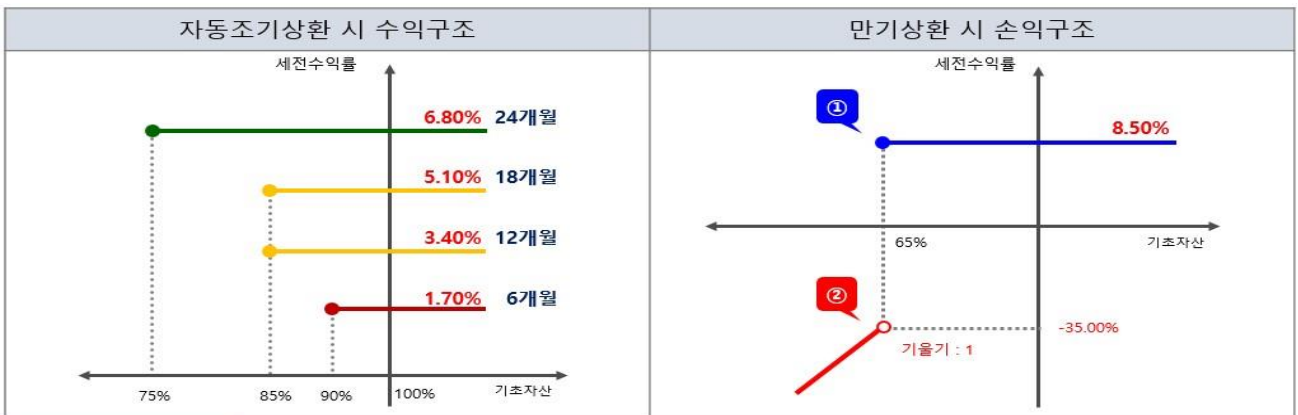
2021-07-13

## 1. 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 <b>1.70%</b> 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 <b>65% 이상</b> 인 경우		
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

21

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

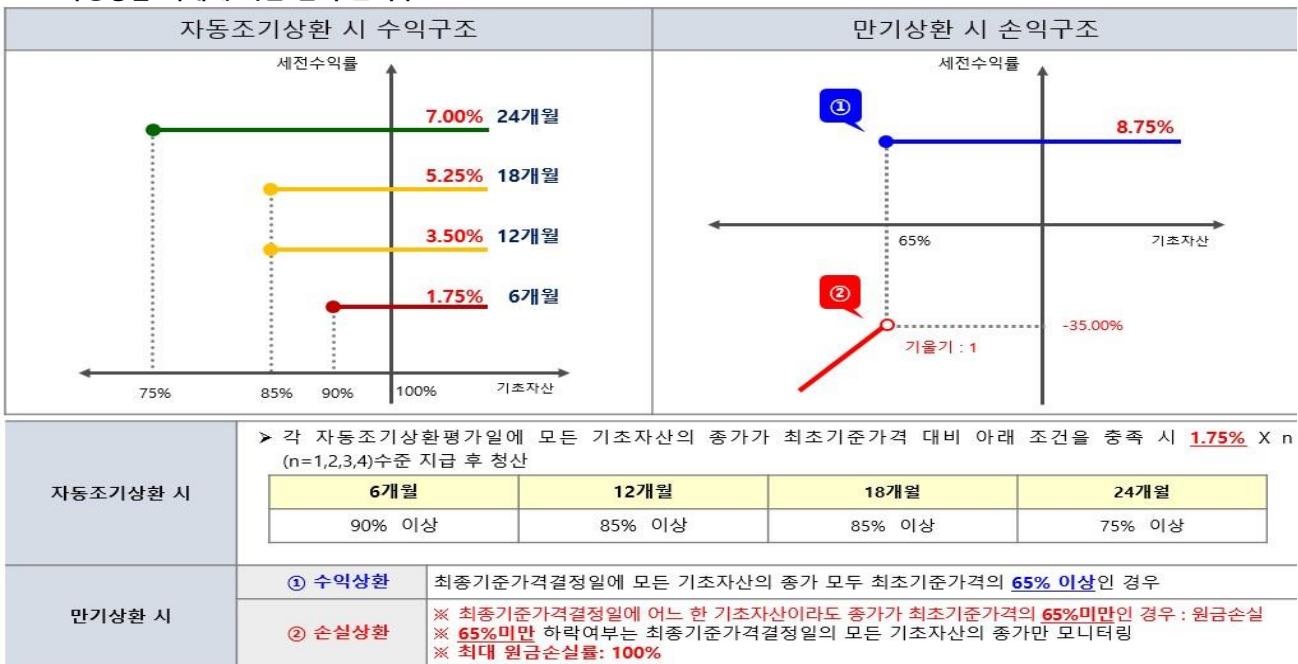
2021-07-13

## 1. 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

190

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

89

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-11호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

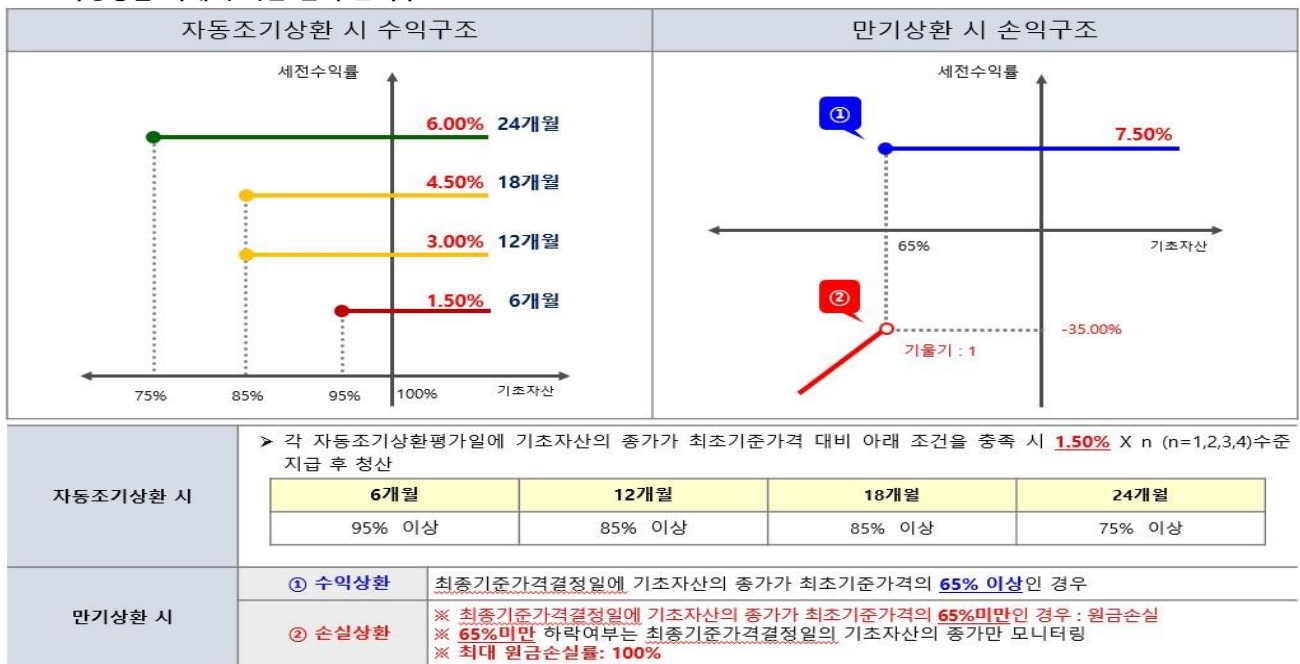
2021-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

71

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-12호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

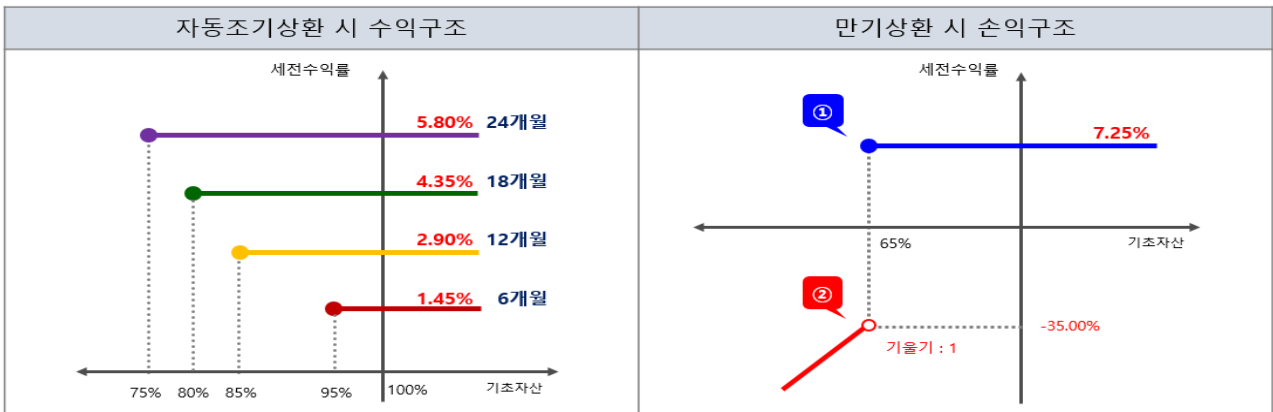
2021-07-13

## 1. 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 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-07-12

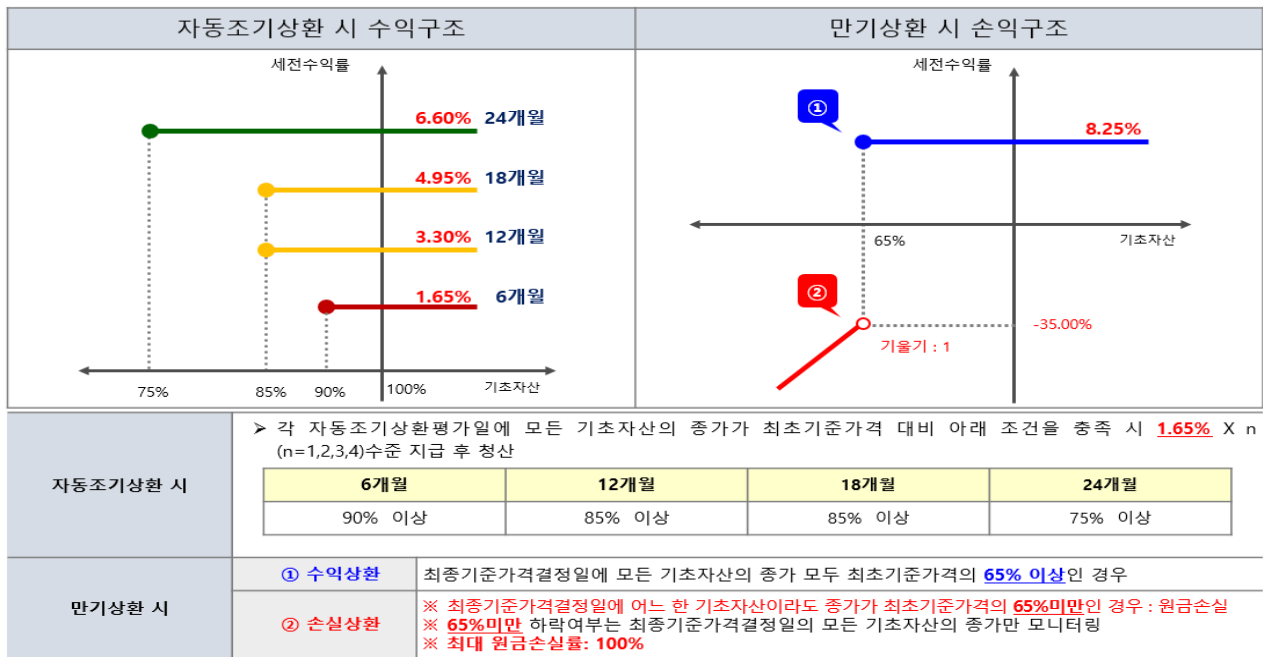
공시일: 2021-07-13

## 1. 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

143

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

100

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-13호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

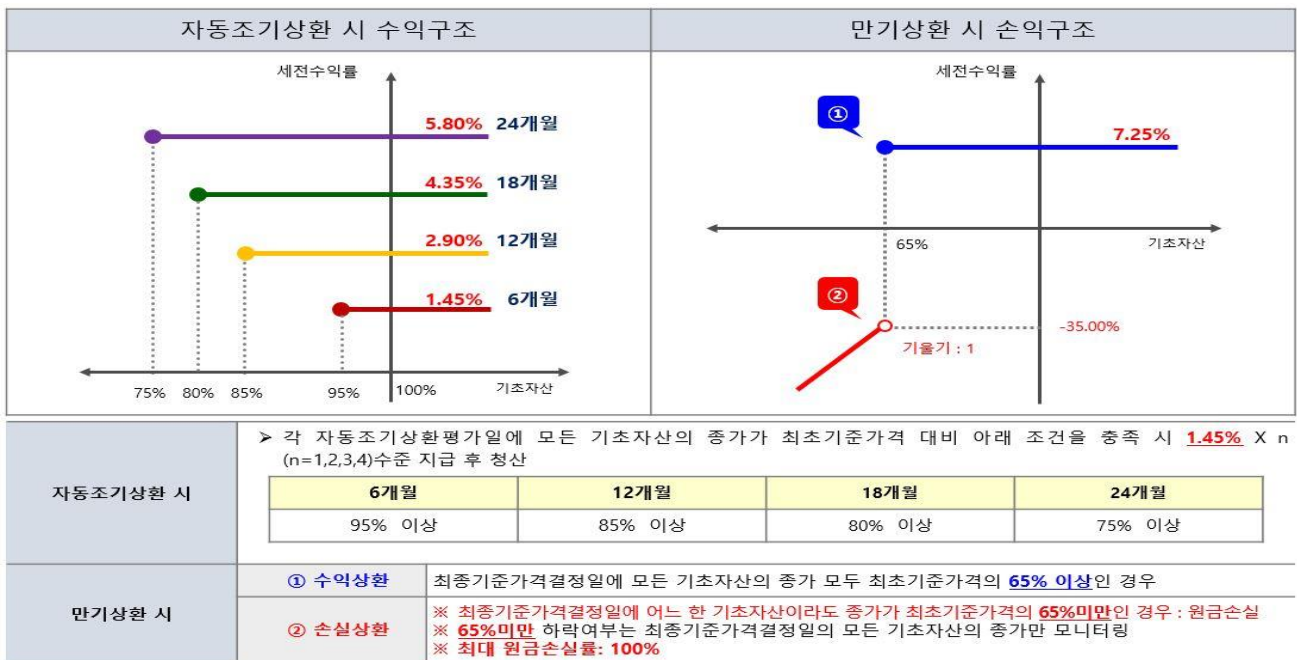
2021-07-13

## 1. 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

19

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

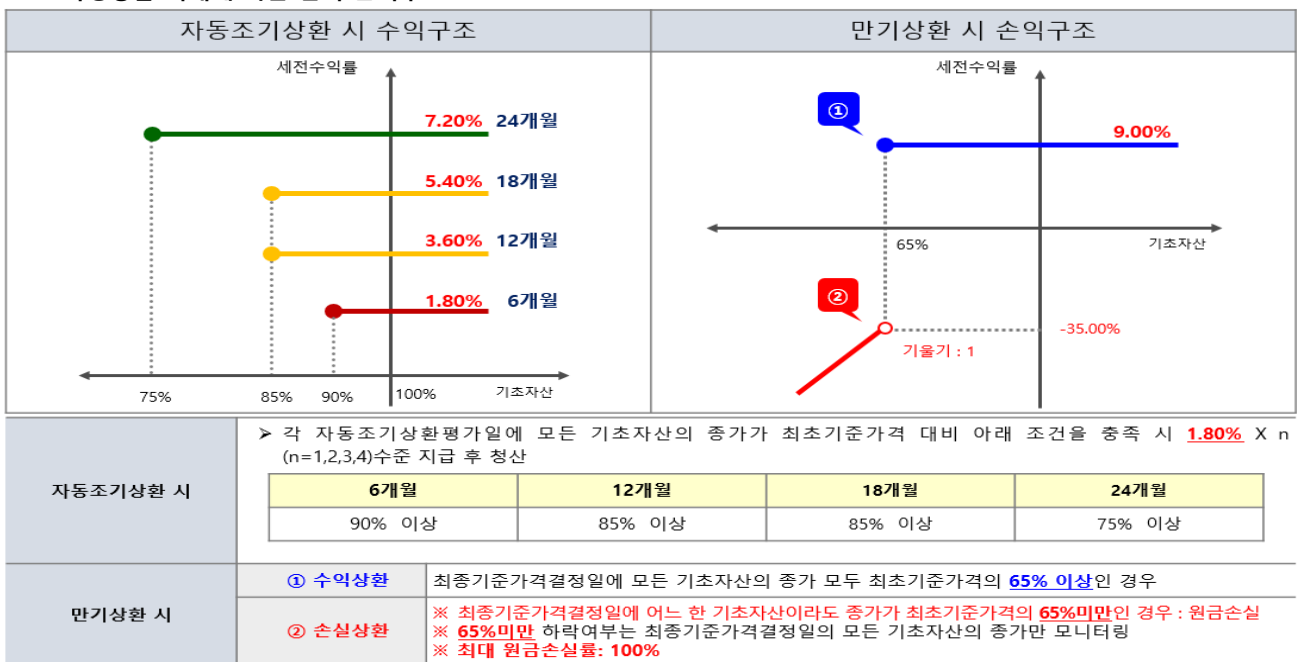
2021-07-13

## 1. 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

95

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

49

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-14호 [ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

2021-07-13

## 1. 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%

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

8

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

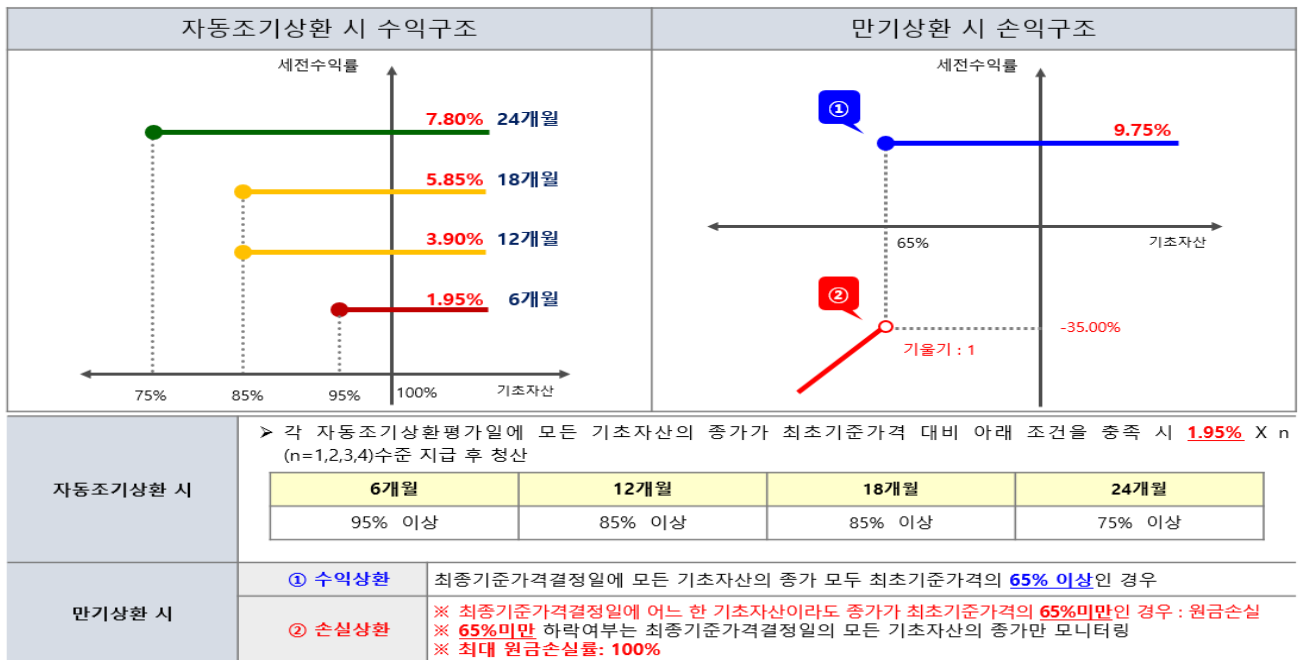
2021-07-13

## 1. 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

133

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

89

# 펀드명 : BNK지수연계증권S(KRW)-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일: 2021-07-13

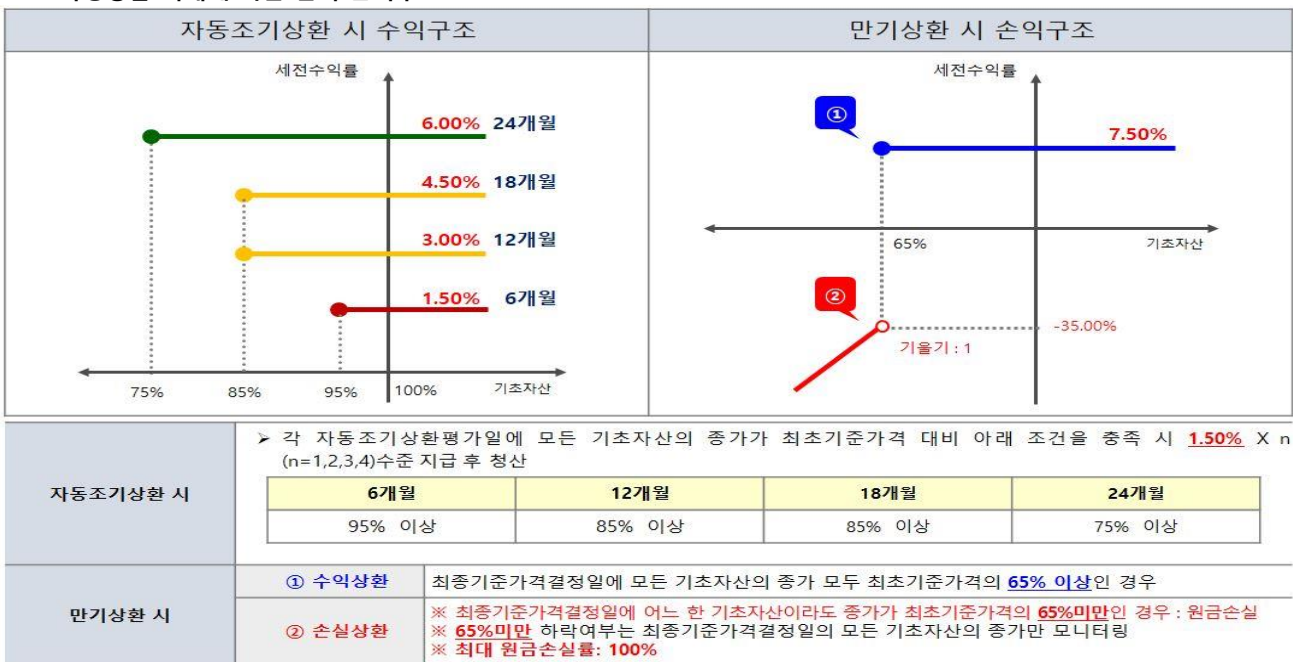
2021-07-13

## 1. 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



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

5

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

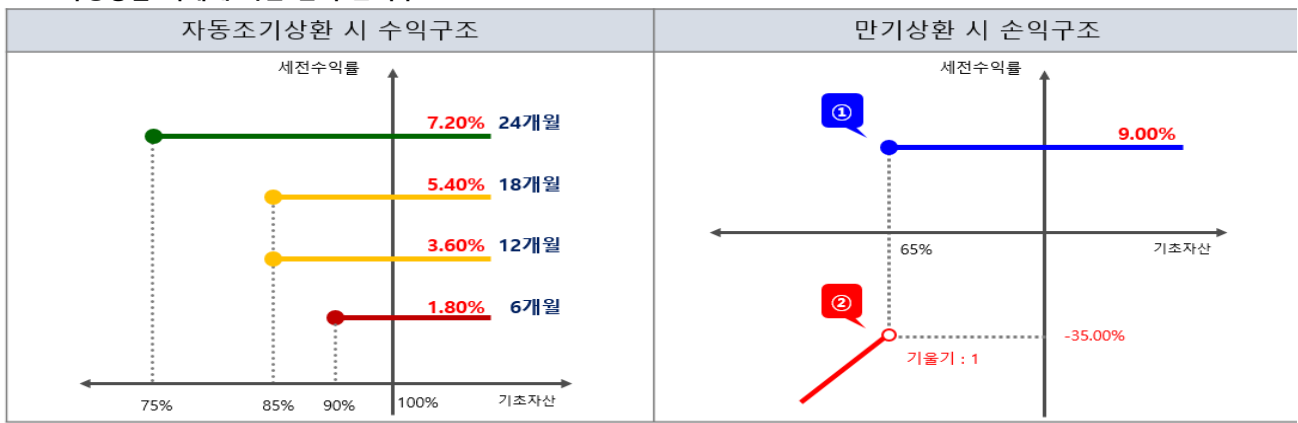
2021-07-13

## 1. 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%

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

35

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

16

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

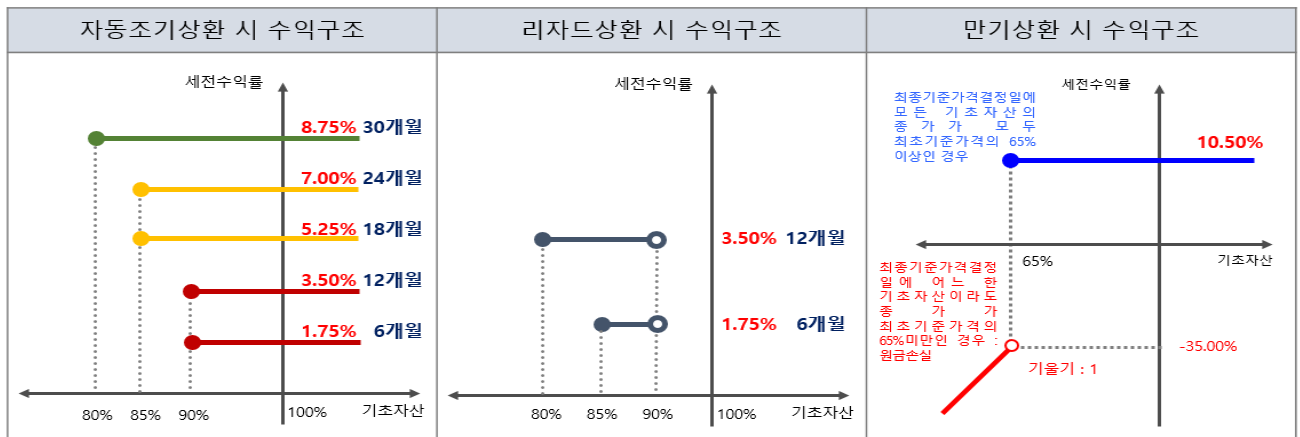
2021-07-13

## 1. 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"> <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

141

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

130

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

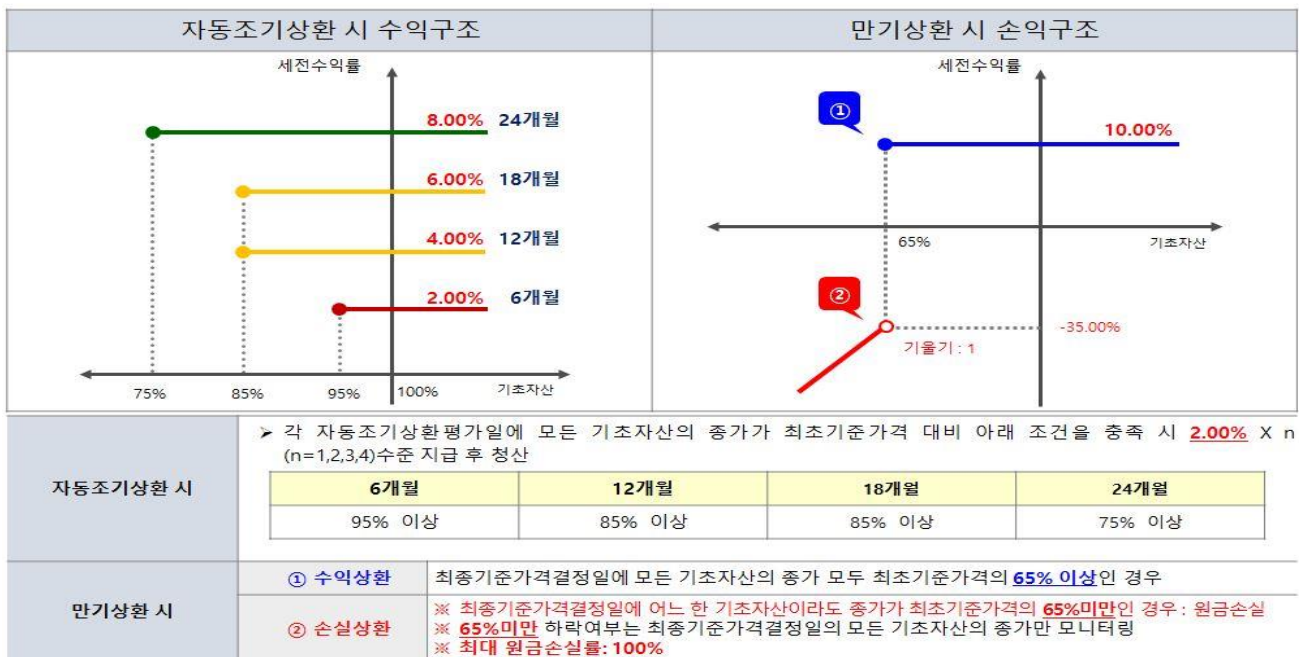
2021-07-13

## 1. 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

61

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

33

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

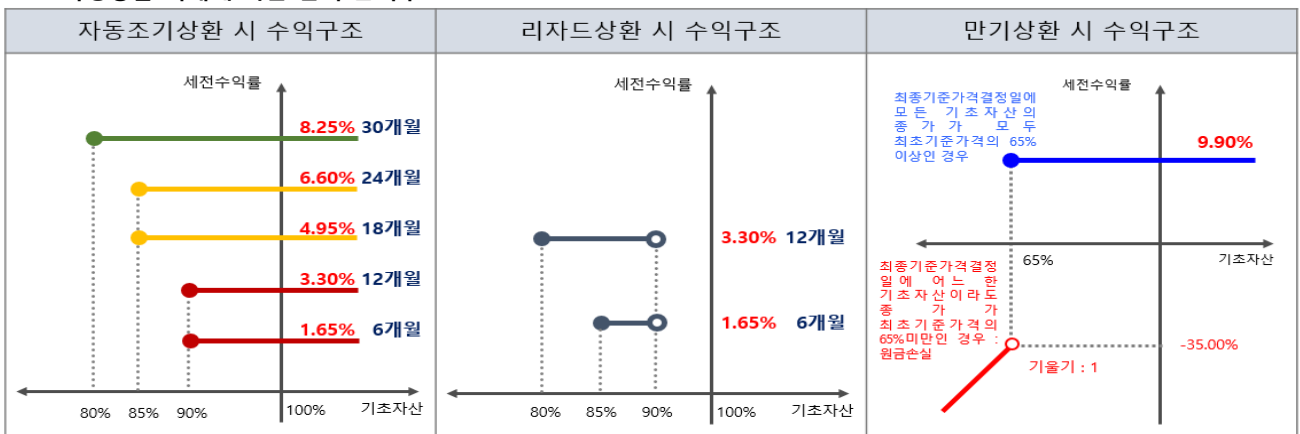
2021-07-13

## 1. 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"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.65%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.30%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.30%</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

34

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

30

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

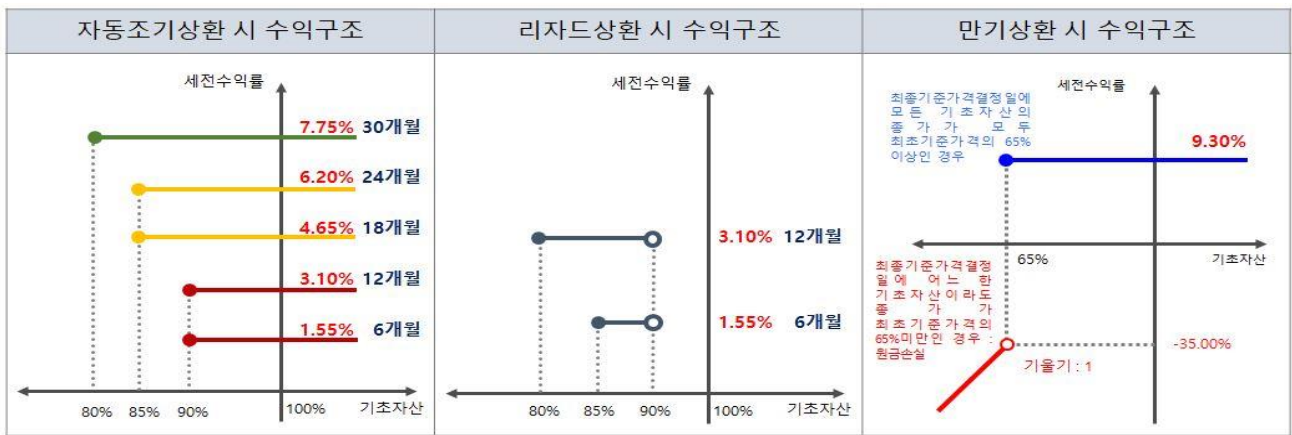
2021-07-13

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

59

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

53

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

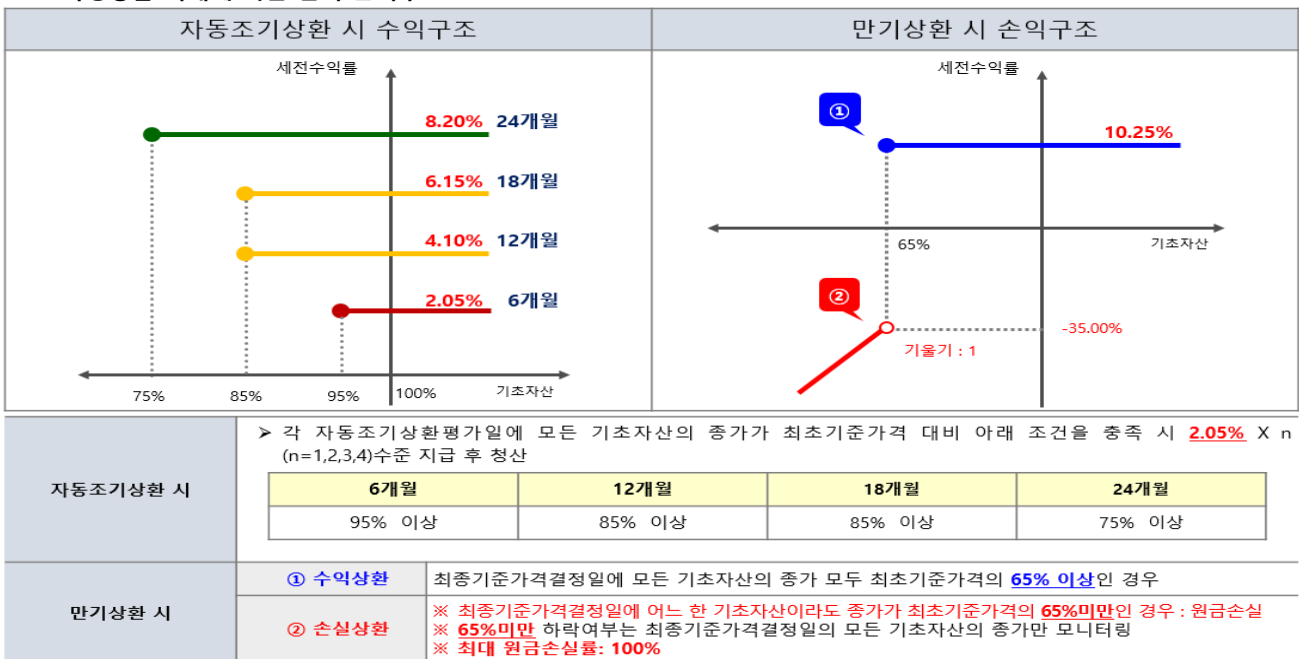
2021-07-13

## 1. 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



자동조기상환 시

> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 **2.05%** 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 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

81

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

31

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

기준일 : 2021-07-12

공시일:

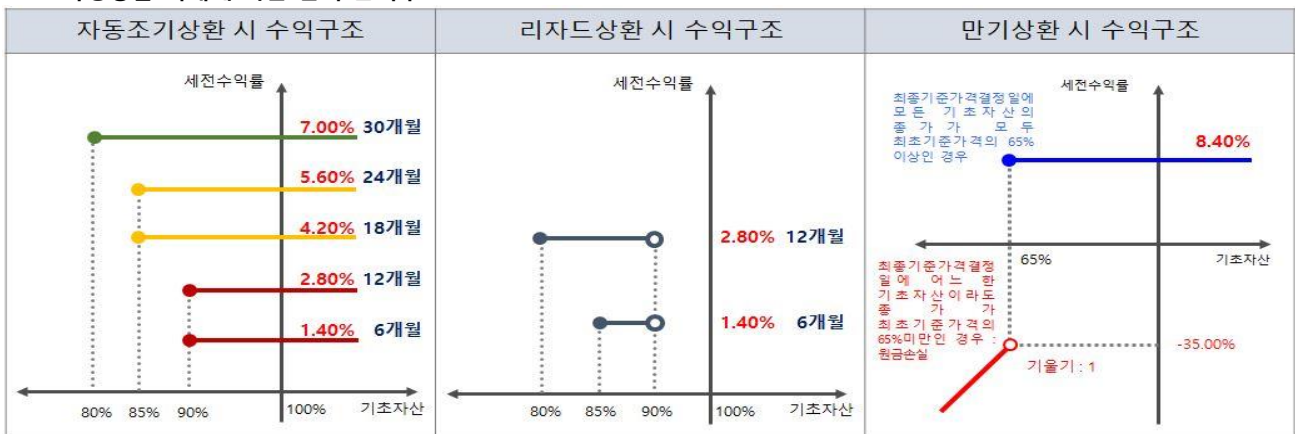
2021-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	512		512	장외
합계			512		512	

## 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> ⇒ 1.40% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 2.80% 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인 경우</b>로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ 연 2.80% 수익지급</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

34

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

33



# 펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)N-9호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2021-07-12

공시일:

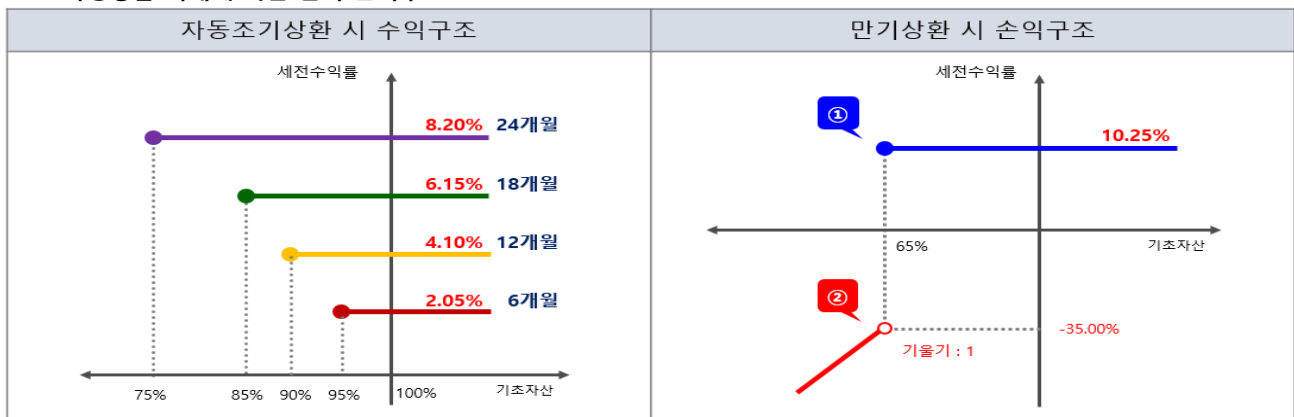
2021-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	750		750	장외
합계			750		750	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 **2.05%** X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상

만기상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우
② 손실상환	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b>인 경우 : 원금손실</li> <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

47

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

20