

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 346 | 606 | -260 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 4,501 | 0 | 4,501 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 옵션 | 1 | 173 | -172 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 196 | 343 | -148 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 636 | 0 | 636 | 장내 |
| 합계 | | | 5,137 | 0 | 5,137 | |

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

360

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

387

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 5,453 | 5,366 | 87 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 21,725 | 0 | 21,725 | 장내 |
| 합계 | | | 21,725 | 0 | 21,725 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



위 그림은 투자자의 이해를 돕기 위하여 레버리지 펀드 추종을 위한 KOSPI200지수를 기초자산으로 하는 선물 매수 그림을 단순화하여 표시한 것입니다.
 이 투자전략은 KOSPI200지수 일간수익률 2배를 추종하는 레버리지 펀드로 KOSPI200 선물에 주로 투자하나, KOSPI200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 등 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,739

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,629

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

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

2022-06-09

1. 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 총가가 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 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 4.95% 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

177

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

300

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 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

42

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

65

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

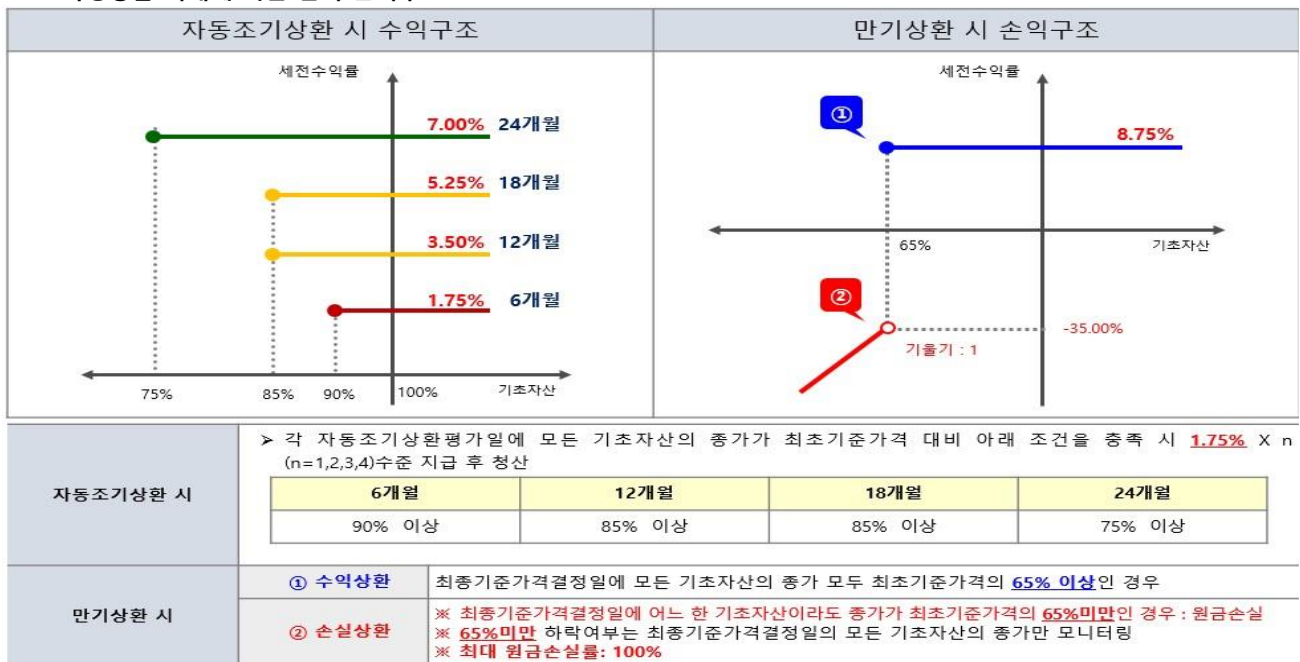
공시일: 2022-06-09

1. 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

176

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

274

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

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

1. 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 총가가 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 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 4.95% 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

133

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

221

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

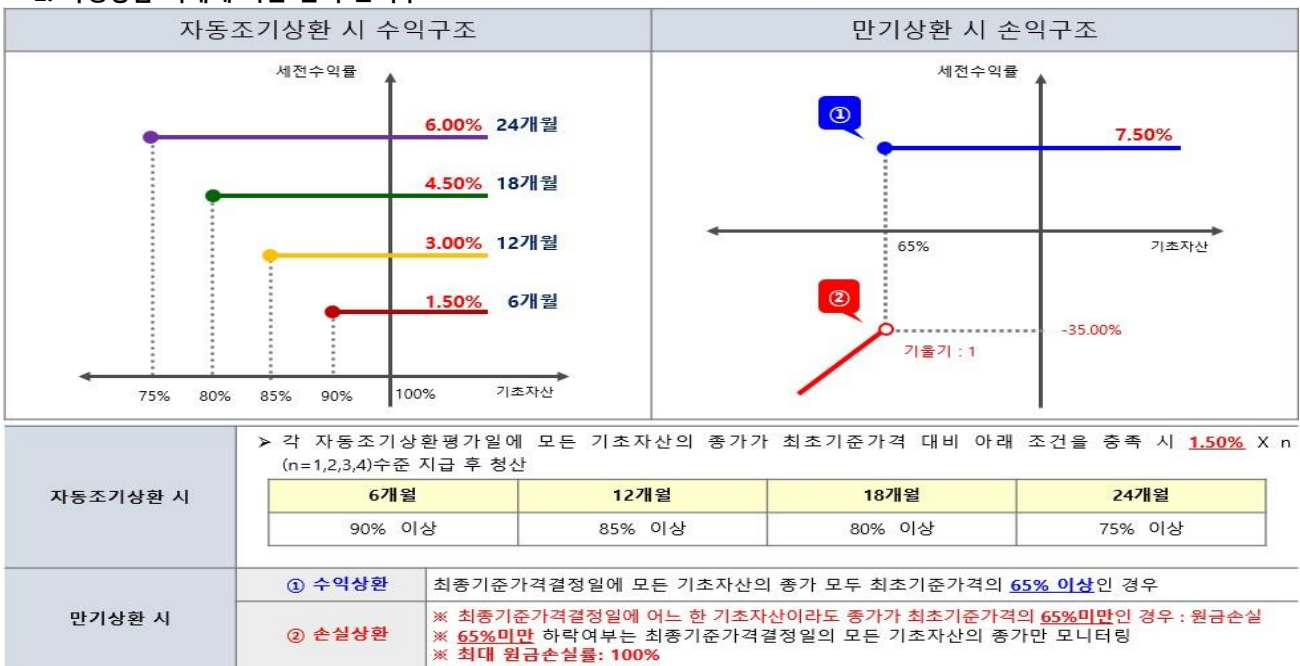
공시일: 2022-06-09

1. 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)

51

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 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



자동조기상환 시

> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 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 | 85% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 |

만기상환 시

① 수익상환

② 손실상환

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

156

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

260

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

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,068 | | 1,068 | 장외 |
| 합계 | | | 1,068 | | 1,068 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

| 자동조기상환 시 수익구조 | 리자드상환 시 수익구조 | 만기상환 시 손익구조 | | | | | | | | |
|---|--------------|-------------|--------|------|--------|--------|--------|--------|---|--|
| | | | | | | | | | | |
| <p>자 동 조 기 상 환 시</p> <p>> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% 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 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 4.95% 수익 지급</p> | <p>만 기 상 환 시</p> <p>① 수익상환 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 총가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우</p> <p>② 손실상환 : ※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 총가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%</p> |
| 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 | | | | | | | |
| 90% 이상 | 90% 이상 | 80% 이상 | 75% 이상 | | | | | | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

87

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

131

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

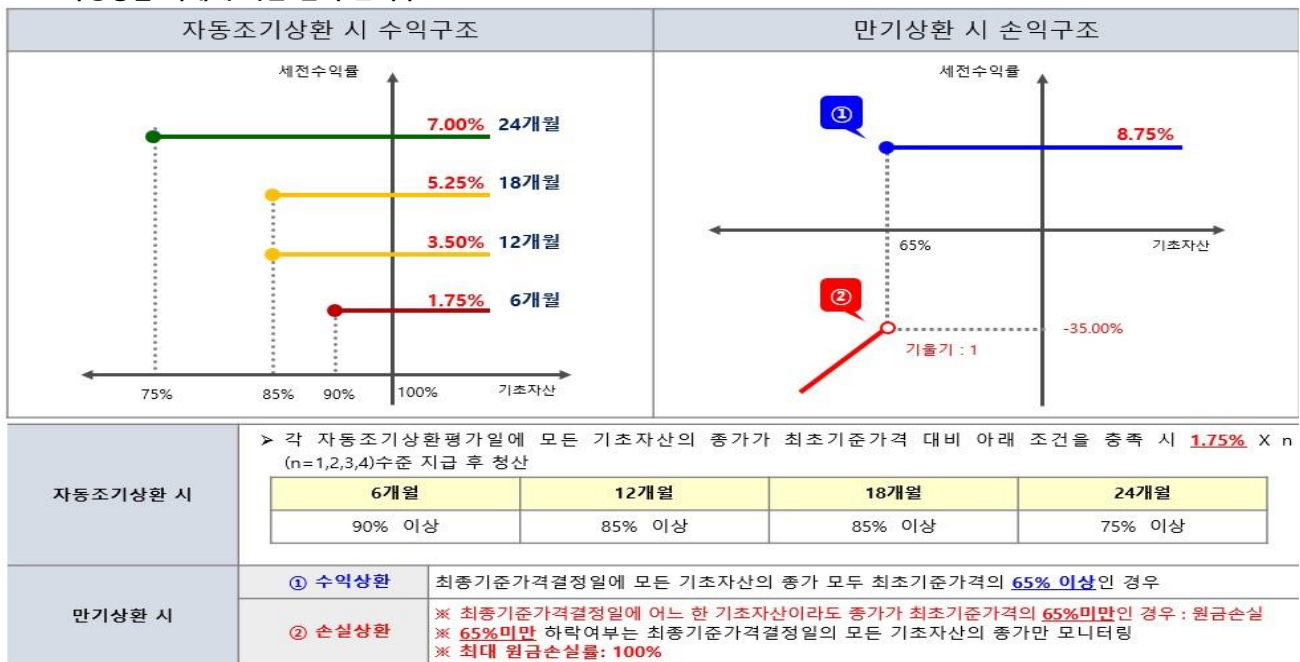
공시일: 2022-06-09

1. 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

49

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

77

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

2022-06-09

1. 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

131

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

201

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 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

79

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

128

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 195 | | 195 | 장외 |
| 합계 | | | 195 | | 195 | |

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 2.10% 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 하나라도 최초기초자산가격 대비 75% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연6.30% 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

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

26

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-40호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

2022-06-09

1. 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

86

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

129

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,015 | | 1,015 | 장외 |
| 합계 | | | 1,015 | | 1,015 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

66

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

기준일 : 2022-06-08

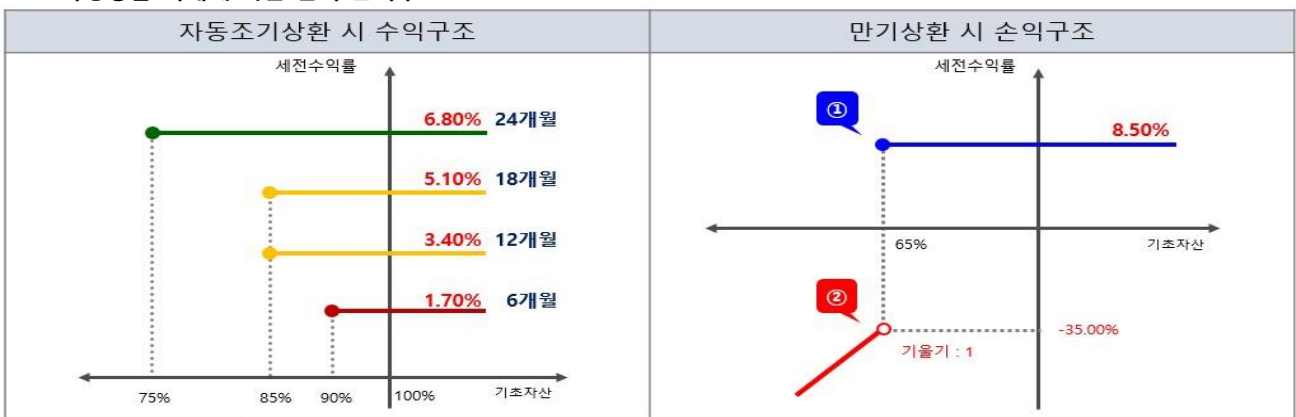
공시일: 2022-06-09

1. 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% 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

70

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

120

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

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

2022-06-09

1. 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

224

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

283

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 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

164

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

120

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 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

128

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

183

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

기준일 : 2022-06-08

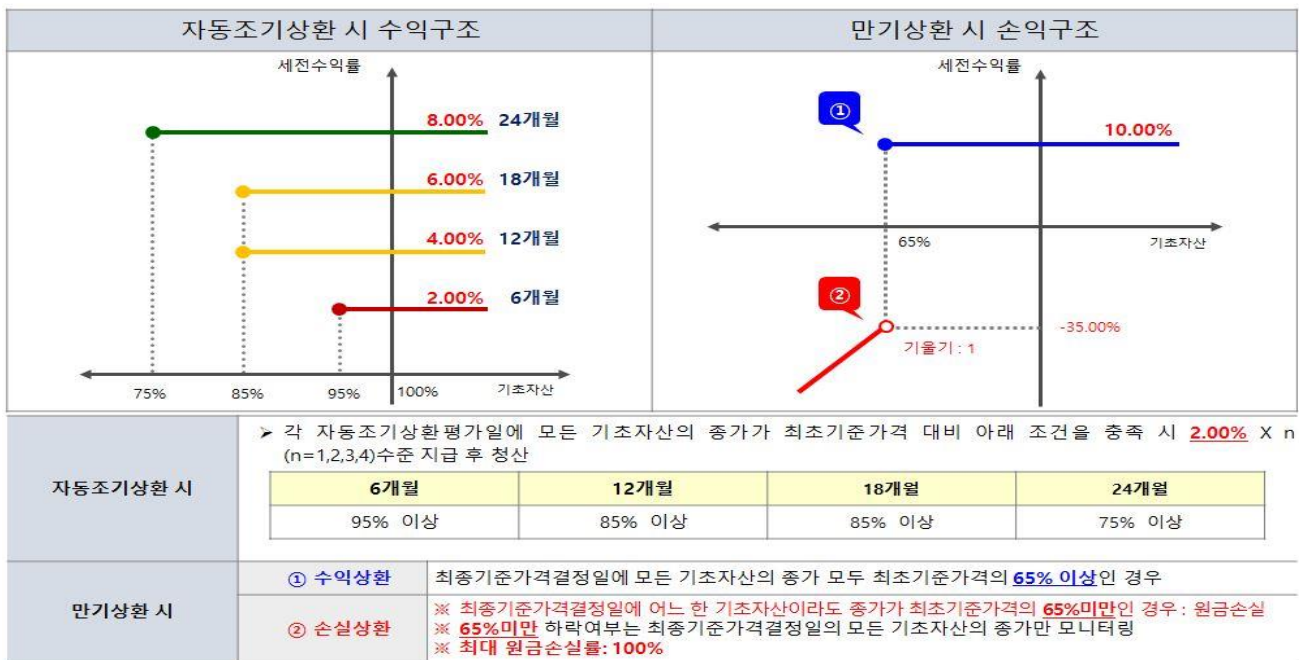
공시일: 2022-06-09

1. 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

75

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

76

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

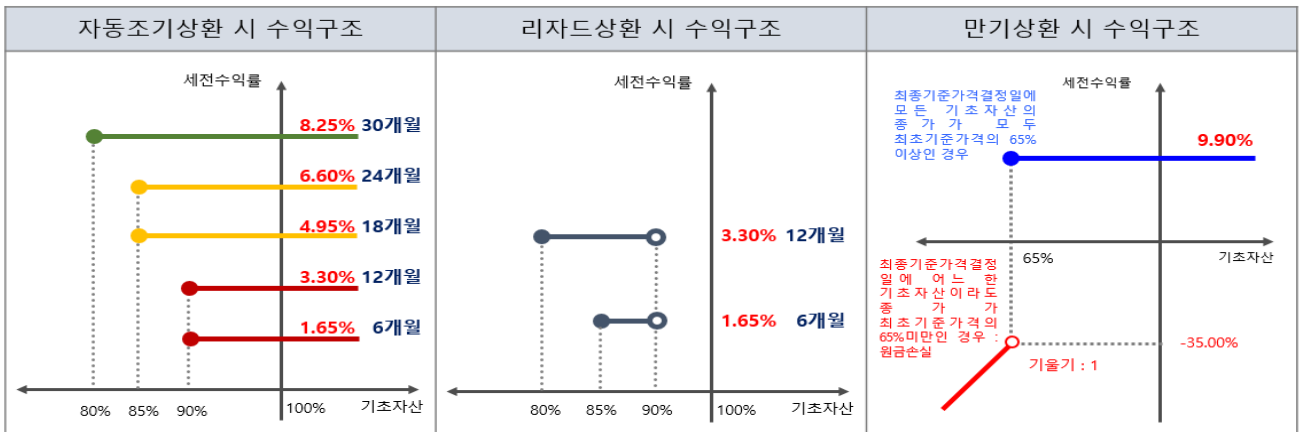
2022-06-09

1. 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

31

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

43

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 766 | | 766 | 장외 |
| 합계 | | | 766 | | 766 | |

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 하락한적이 없는 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 하락한적이 없는 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

51

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

76

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

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 502 | | 502 | 장외 |
| 합계 | | | 502 | | 502 | |

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 ⇒ 1.40% 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 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

36

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

57

펀드명 : BNK지수연계증권SE(KRW)H-1호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

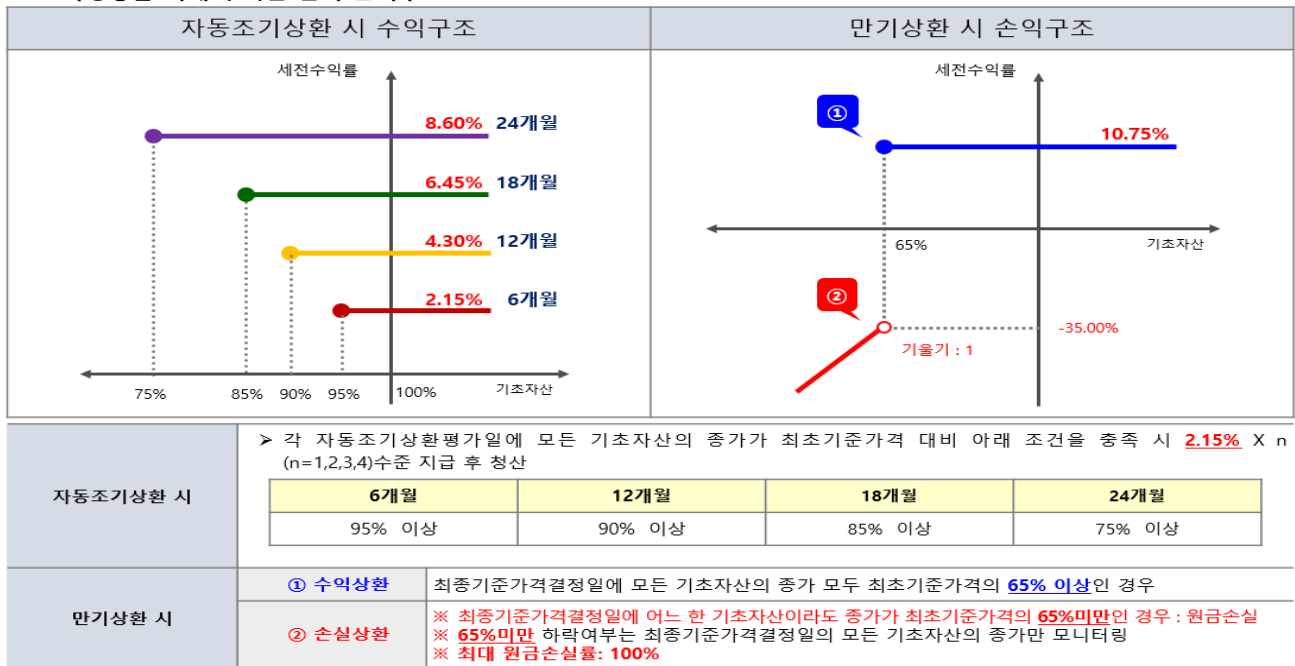
공시일: 2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 424 | | 424 | 장외 |
| 합계 | | | 424 | | 424 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

43

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권SHE-3호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 498 | | 498 | 장외 |
| 합계 | | | 498 | | 498 | |

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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 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

35

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-10호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

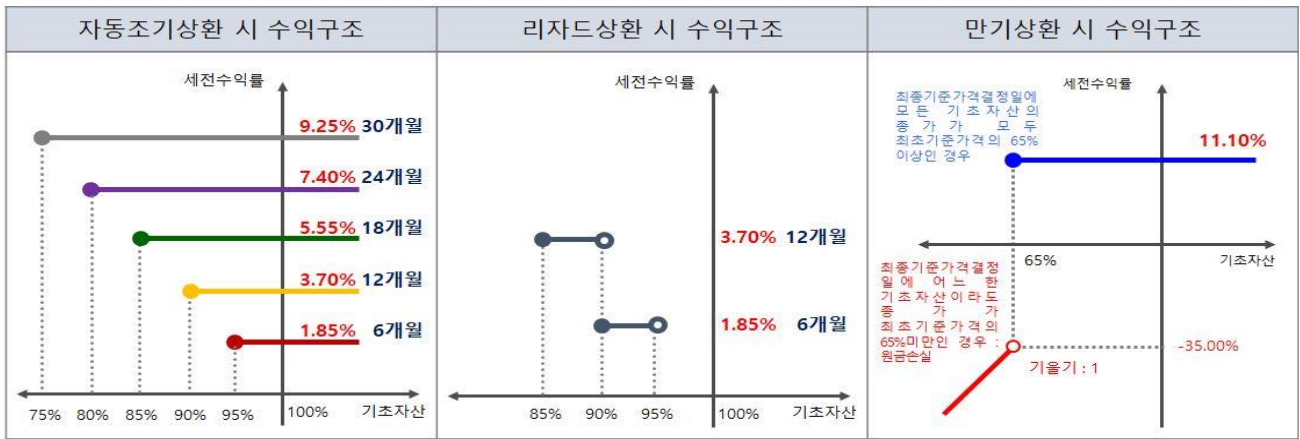
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,241 | | 1,241 | 장외 |
| 합계 | | | 1,241 | | 1,241 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.85% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.70% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.70% 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

87

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

99

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

기준일 : 2022-06-08

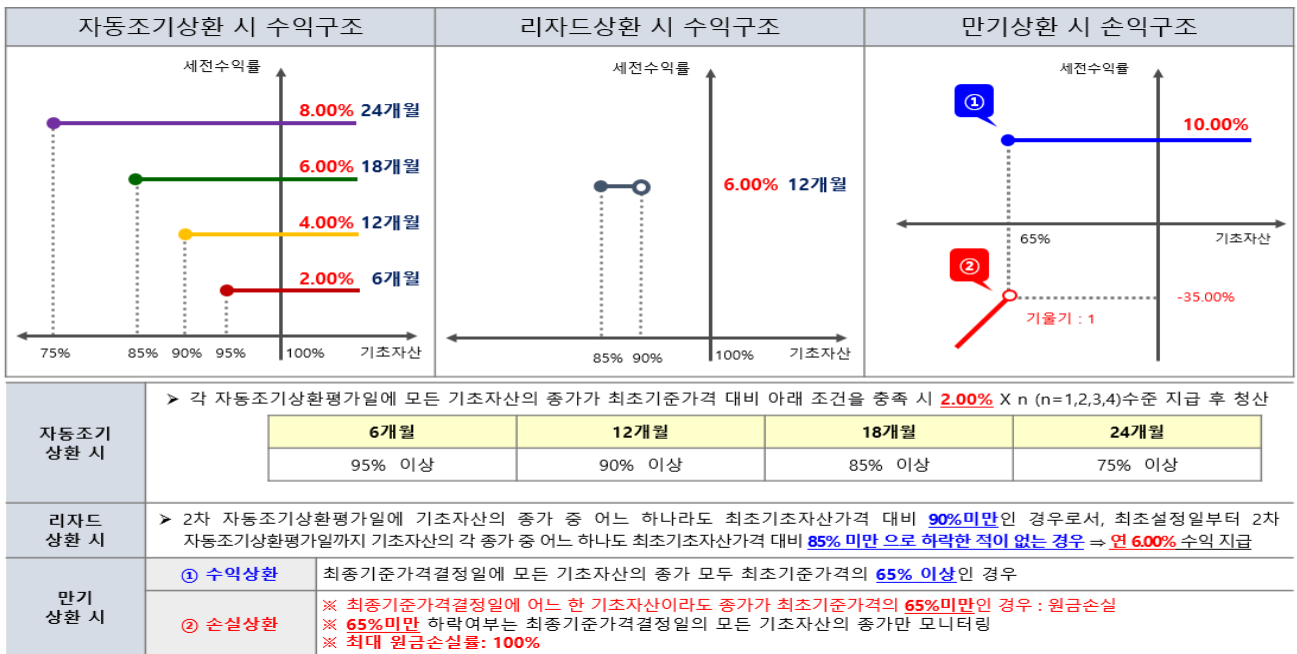
공시일: 2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 167 | | 167 | 장외 |
| 합계 | | | 167 | | 167 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

18

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-11호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,395 | | 1,395 | 장외 |
| 합계 | | | 1,395 | | 1,395 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.90% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.80% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.80% 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

96

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

98

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-12호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

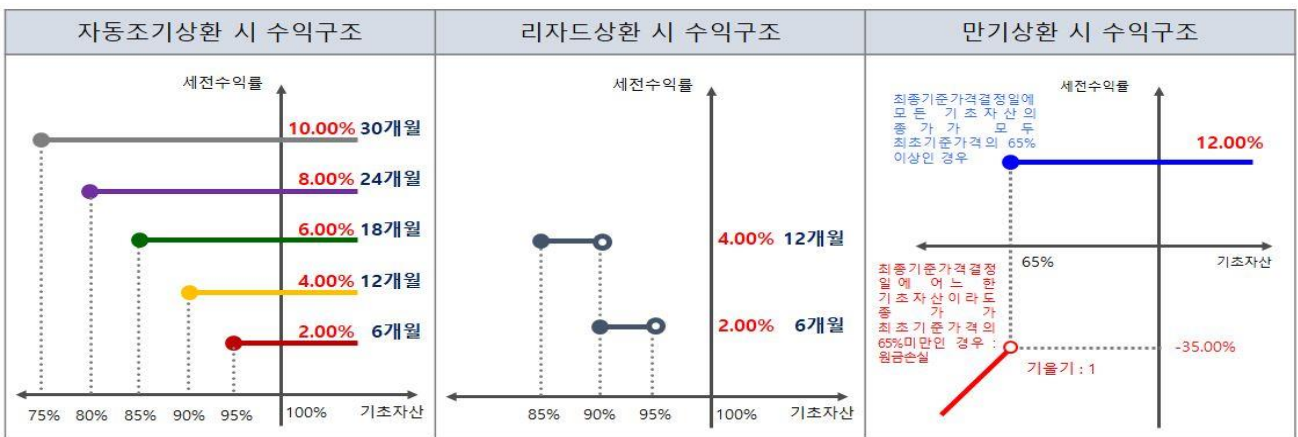
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 2,464 | | 2,464 | 장외 |
| 합계 | | | 2,464 | | 2,464 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.00% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.00% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.00% 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

165

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

214

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-13호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

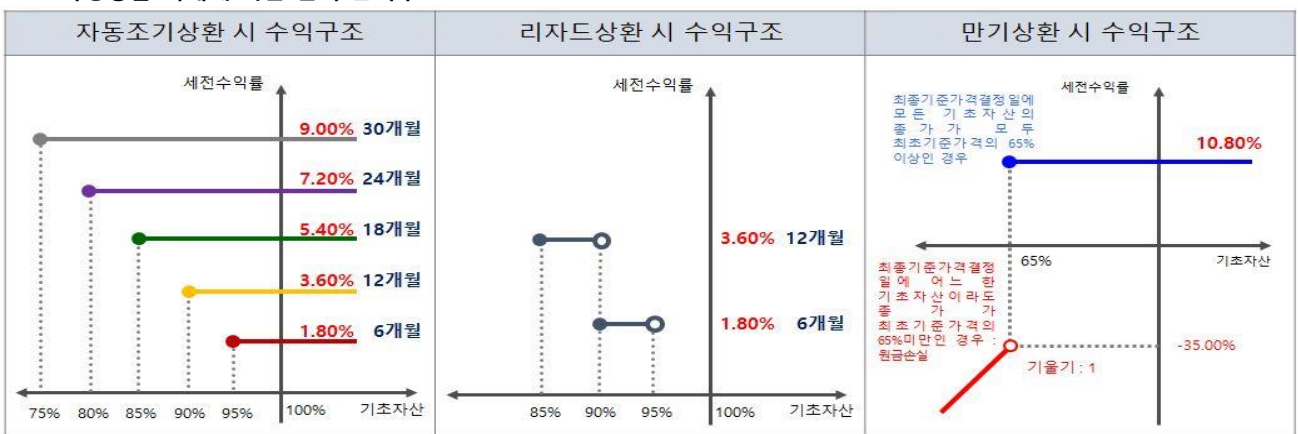
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 936 | | 936 | 장외 |
| 합계 | | | 936 | | 936 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.80% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.60% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.60% 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

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

86

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-14호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,523 | | 1,523 | 장외 |
| 합계 | | | 1,523 | | 1,523 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.95% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 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

101

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

121

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-15호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,890 | | 1,890 | 장외 |
| 합계 | | | 1,890 | | 1,890 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.95% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 3.90% 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

120

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

156

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-16호(온라인)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 3,115 | | 3,115 | 장외 |
| 합계 | | | 3,115 | | 3,115 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 1.95% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산 |
| 리자드상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 |
| 만기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

201

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

258

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-17호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,287 | | 1,287 | 장외 |
| 합계 | | | 1,287 | | 1,287 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.05% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 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

82

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

99

펀드명 : BNK리자드지수연계증권HS(KRW)N-44호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 320 | | 320 | 장외 |
| 합계 | | | 320 | | 320 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| 자동조기상환 시 | <p>▶ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.60% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산</p> <table border="1"> <tr> <th>기간</th> <th>6개월</th> <th>12개월</th> <th>18개월</th> <th>24개월</th> </tr> <tr> <td>기준</td> <td>95% 이상</td> <td>90% 이상</td> <td>85% 이상</td> <td>75% 이상</td> </tr> </table> | 기간 | 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 | 기준 | 95% 이상 | 90% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 |
|----------|--|--------|--------|--------|------|------|----|--------|--------|--------|--------|
| 기간 | 6개월 | 12개월 | 18개월 | 24개월 | | | | | | | |
| 기준 | 95% 이상 | 90% 이상 | 85% 이상 | 75% 이상 | | | | | | | |
| 리자드상환 시 | <p>▶ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 7.80% 수익 지급</p> | | | | | | | | | | |
| 만기상환 시 | <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> | | | | | | | | | | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

31

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-18호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,840 | | 1,840 | 장외 |
| 합계 | | | 1,840 | | 1,840 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 총가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.05% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산 |
| 리자드상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 총가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 총가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 수익 지급 |
| 만기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 총가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100% |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

121

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

154

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-19호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

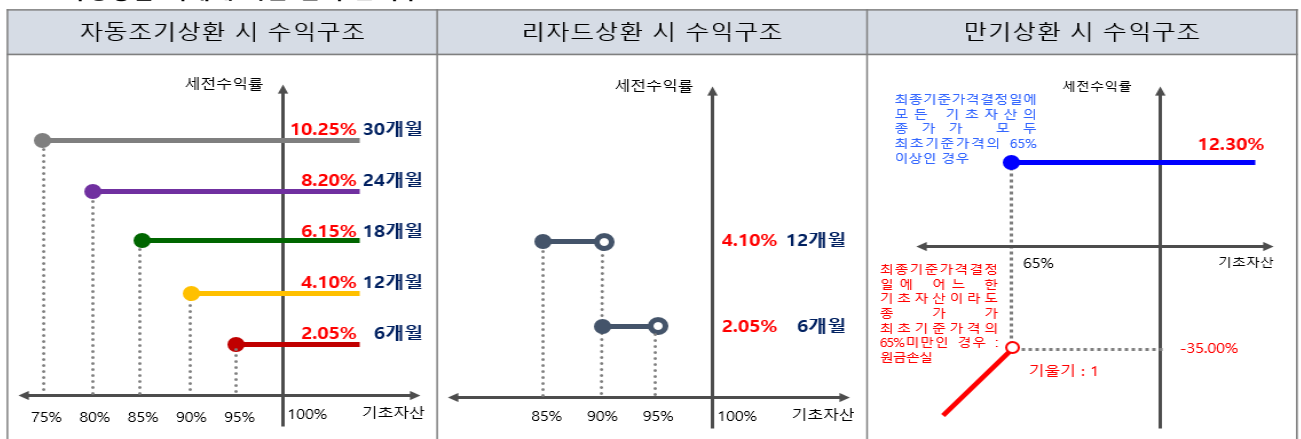
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 2,548 | | 2,548 | 장외 |
| 합계 | | | 2,548 | | 2,548 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최종기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.05% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.10% 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

170

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

213

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-20호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 3,710 | | 3,710 | 장외 |
| 합계 | | | 3,710 | | 3,710 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.20% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산 |
| 리자드상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 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

221

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

290

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-21호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

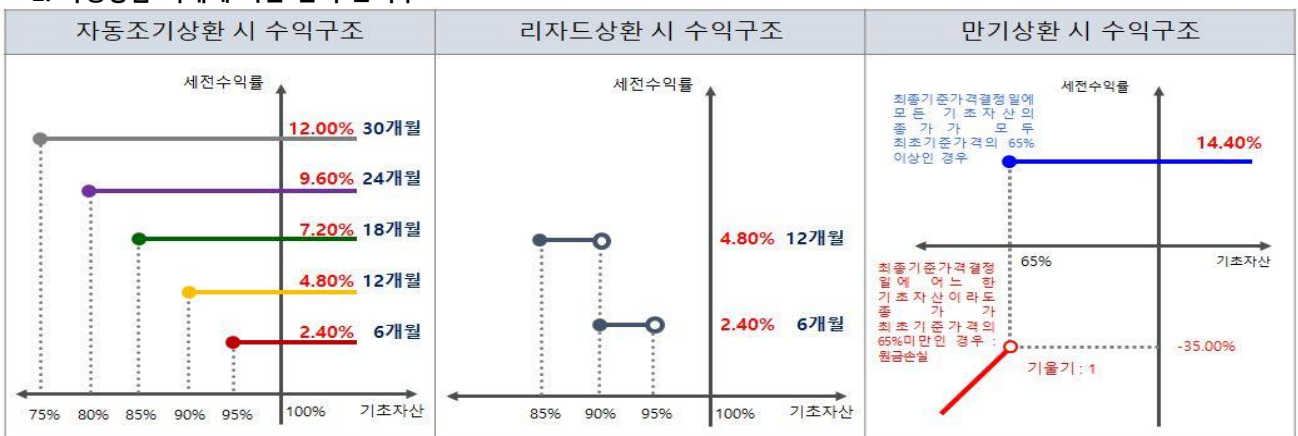
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 2,503 | | 2,503 | 장외 |
| 합계 | | | 2,503 | | 2,503 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.40% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 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 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 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

148

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

159

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-22호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,204 | | 1,204 | 장외 |
| 합계 | | | 1,204 | | 1,204 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.50% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 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

70

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

87

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-23호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 376 | | 376 | 장외 |
| 합계 | | | 376 | | 376 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.50% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 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

22

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

30

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-24호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,842 | | 1,842 | 장외 |
| 합계 | | | 1,842 | | 1,842 | |

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 ⇒ 2.15% 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 4.30% 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 4.30% 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

132

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

143

펀드명 : BNK리자드지수연계증권SHE(KRW)-12호 [ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 823 | | 823 | 장외 |
| 합계 | | | 823 | | 823 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

73

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-25호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 2,262 | | 2,262 | 장외 |
| 합계 | | | 2,262 | | 2,262 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 2.60% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 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

134

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

174

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-26호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

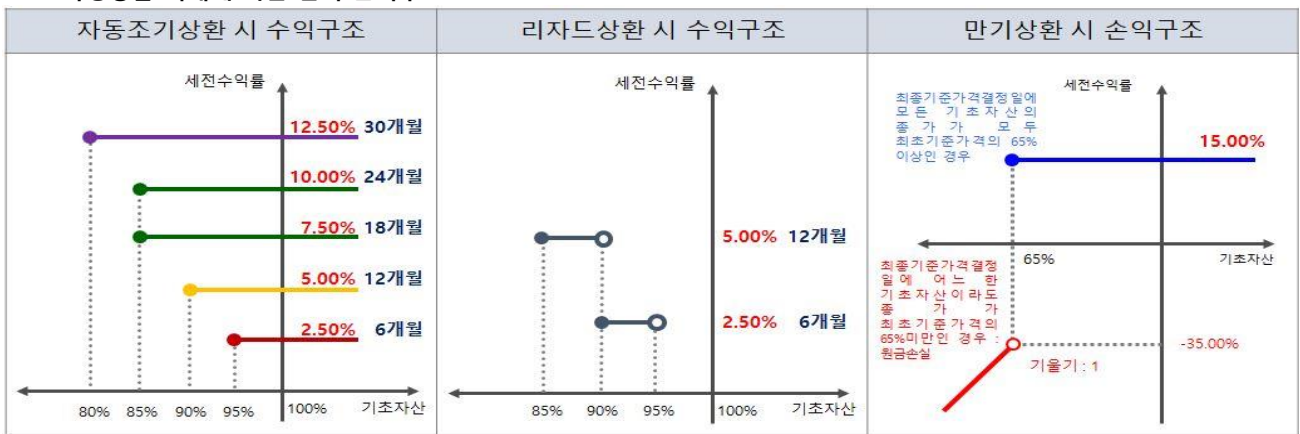
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,277 | | 1,277 | 장외 |
| 합계 | | | 1,277 | | 1,277 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.50% X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산 |
| 리자드상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.00% 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

72

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

74

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-27호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

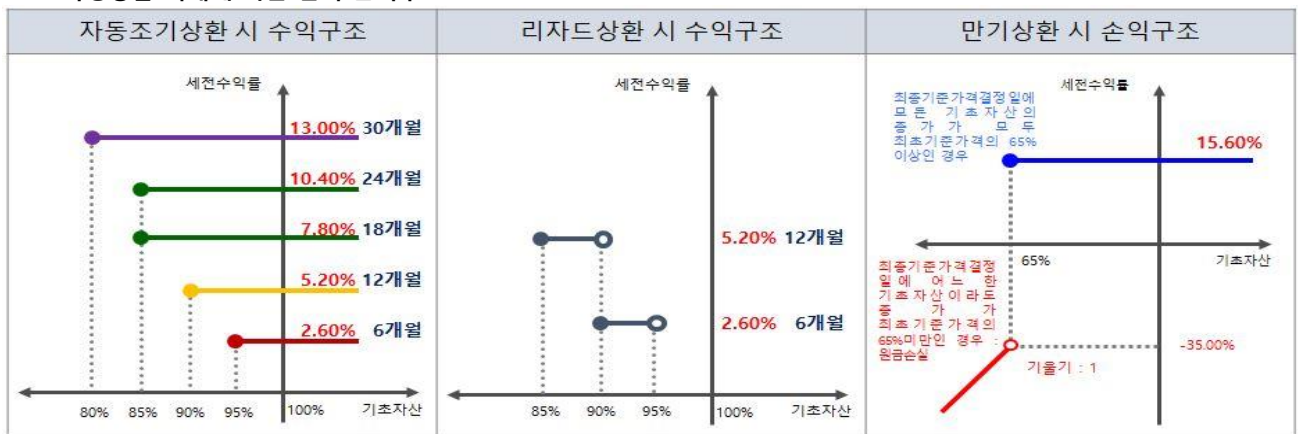
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 966 | | 966 | 장외 |
| 합계 | | | 966 | | 966 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.60% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 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 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 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

55

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

67

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-28호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

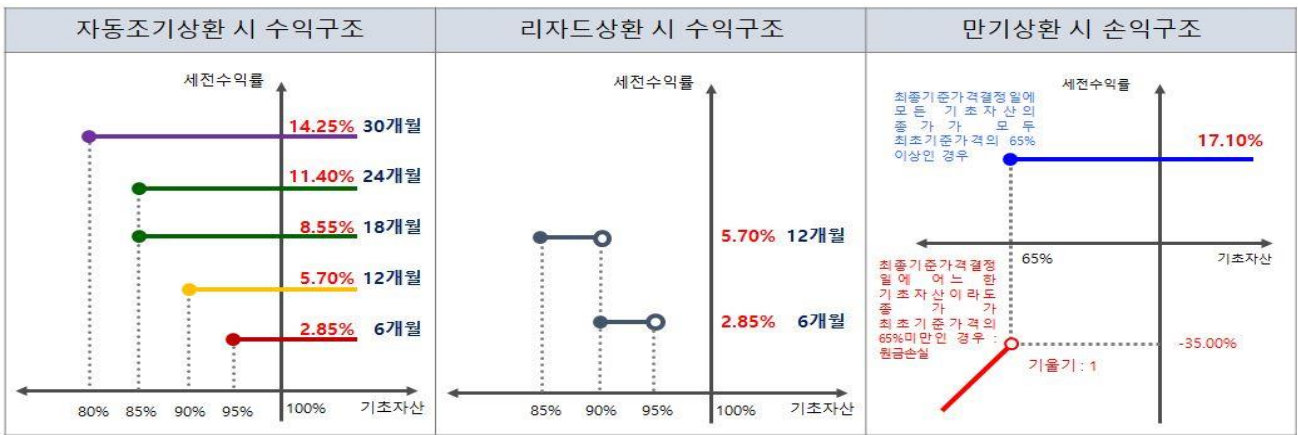
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,371 | | 1,371 | 장외 |
| 합계 | | | 1,371 | | 1,371 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|---|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 2.85% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.70% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 5.70% 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

78

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

105

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-29호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

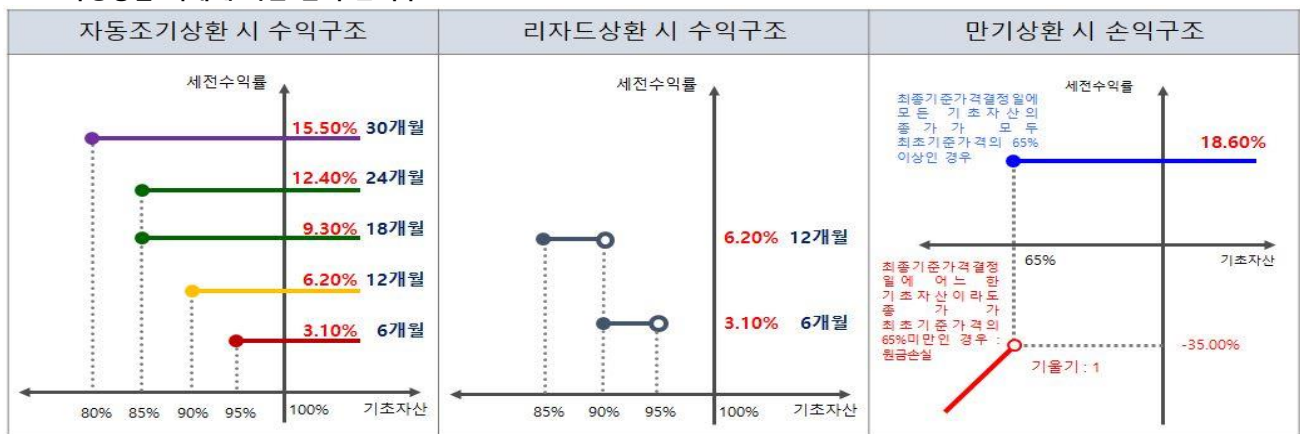
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 672 | | 672 | 장외 |
| 합계 | | | 672 | | 672 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 3.10% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.20% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.20% 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

39

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

51

펀드명 : BNK지수연계지우개증권SHE(KRW)-18호(온라인전용)[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 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



| 상환시 | 기간 | 상환조건 | | 손익률(세전) |
|------------------|-------|---|-----------------|---------|
| | | 조건 | 수준 | |
| 자동 조기 상환 시 | 6개월 | 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 90% 이상인 경우 | 3.25% 수준 | |
| | 12개월 | 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 85% 이상인 경우 2차 자동조기상환평가일에 조기상환이 되지 않을 경우, 단독관찰기초자산 결정 | 6.50% 수준 | |
| | 18개월 | 3차 자동조기상환평가일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 85% 이상인 경우 단독관찰기초자산 : 단독관찰결정일에 모든 기초자산 중 (중간평가가격/최초기준가격)의 비율이 가장 작은 기초자산 | 9.75% 수준 | |
| | 24개월 | 4차 자동조기상환평가일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 80% 이상인 경우 | 13.00% 수준 | |
| | 30개월 | 5차 자동조기상환평가일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 75% 이상인 경우 | 16.25% 수준 | |
| 만기 상환 시 | ①수익상환 | 최종기준가격결정일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 65% 이상인 경우 | 19.50% 수준 | |
| | ②손실상환 | ※ 최종기준가격결정일에 단독관찰기초자산의 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 단독관찰기초자산의 하락률 기준으로 원금손실 발생 ※ 최대 원금손실률: 100% | -35% ~ -100% 수준 | |

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

7

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-31호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

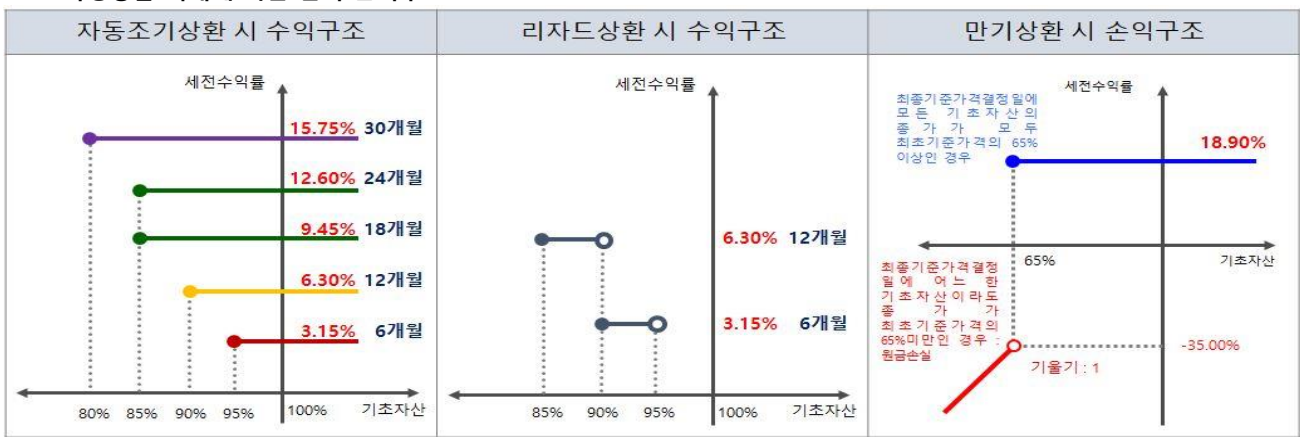
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 743 | | 743 | 장외 |
| 합계 | | | 743 | | 743 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우 ⇒ 3.15% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이없는 경우 ⇒ 연 6.30% 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

45

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

59

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-32호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 973 | | 973 | 장외 |
| 합계 | | | 973 | | 973 | |

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 ⇒ 2.80% 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 하나라도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.60% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 80%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.60% 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

78

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

121

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-33호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 698 | | 698 | 장외 |
| 합계 | | | 698 | | 698 | |

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 ⇒ 2.75% 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.50% 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 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 5.50% 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

62

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

69

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-34호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일: 2022-06-09

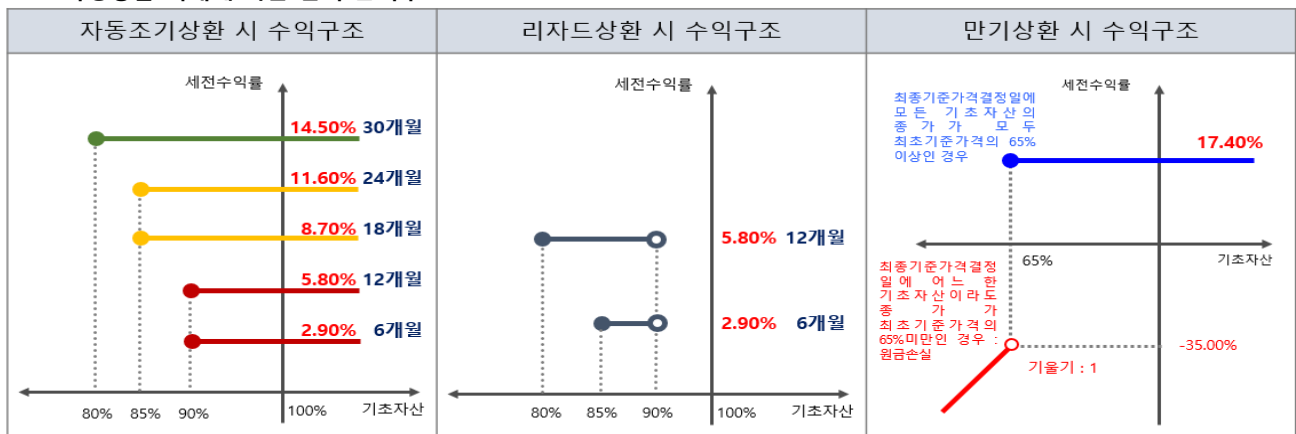
2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 992 | | 992 | 장외 |
| 합계 | | | 992 | | 992 | |

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 ⇒ 2.90% 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 5.80% 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 5.80% 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

77

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

102

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-35호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 326 | | 326 | 장외 |
| 합계 | | | 326 | | 326 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 3.15% 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 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 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

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

30

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-36호[ELS-파생형]

기준일 : 2022-06-08

공시일:

2022-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 908 | | 908 | 장외 |
| 합계 | | | 908 | | 908 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



| | |
|----------|--|
| 자동조기상환 시 | <ul style="list-style-type: none"> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최저기준가격의 6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 75% 이상인 경우 ⇒ 3.40% 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 최저기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.80% 수익 지급 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최저기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최저기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.80% 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

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

78