펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

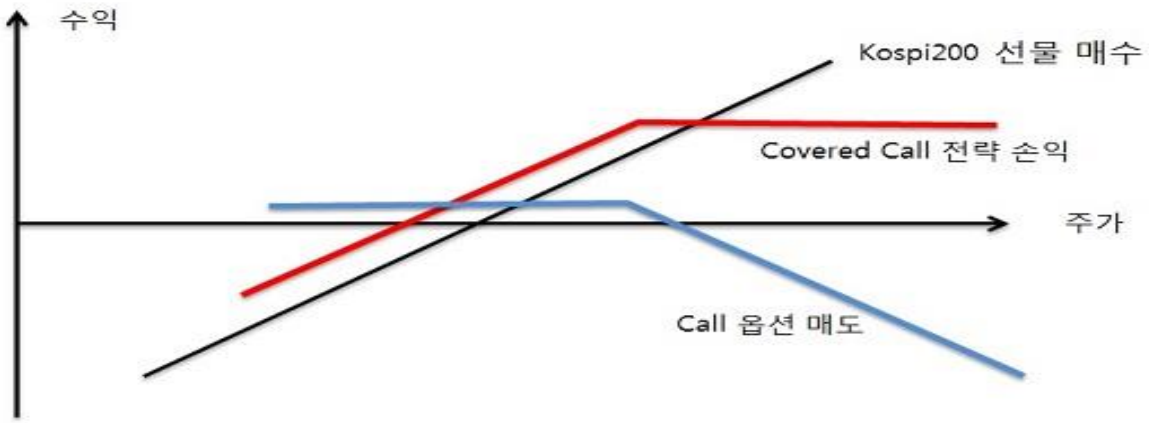
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	234	0	234	장내
누계	주가지수	선물	2,421	0	2,421	장내
신규	주가지수	옵션	3	156	-154	장내
누계	주가지수	옵션	2	782	-780	장내
신규	유가증권	선물	31	0	31	장내
누계	유가증권	선물	93	68	25	장내
합계			2,517	850	1,667	

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)	189

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

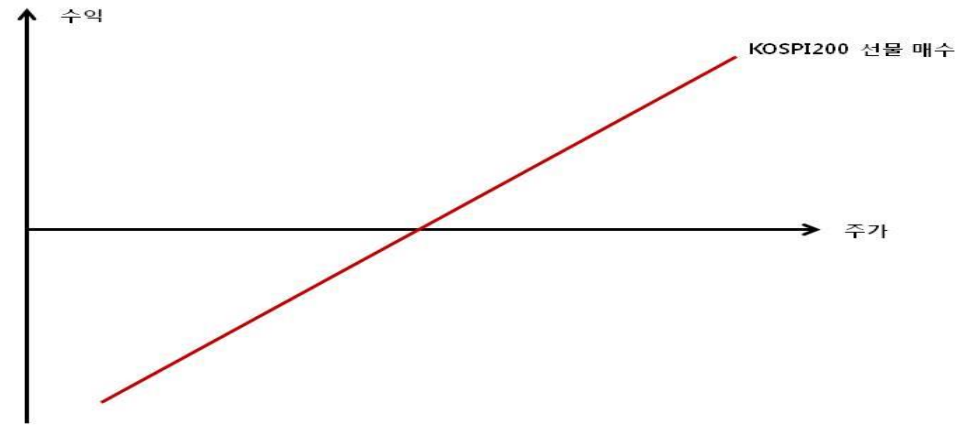
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	78	-78	장내
누계	주가지수	선물	22,340	0	22,340	장내
합계			22,340	0	22,340	

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 투자신탁은 KOSPI200지수 일간수익률 2배를 추종하는 레버리지 펀드로 KOSPI200 선물에 주로 투자하나, KOSPI200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 동 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	1,797

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,936

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

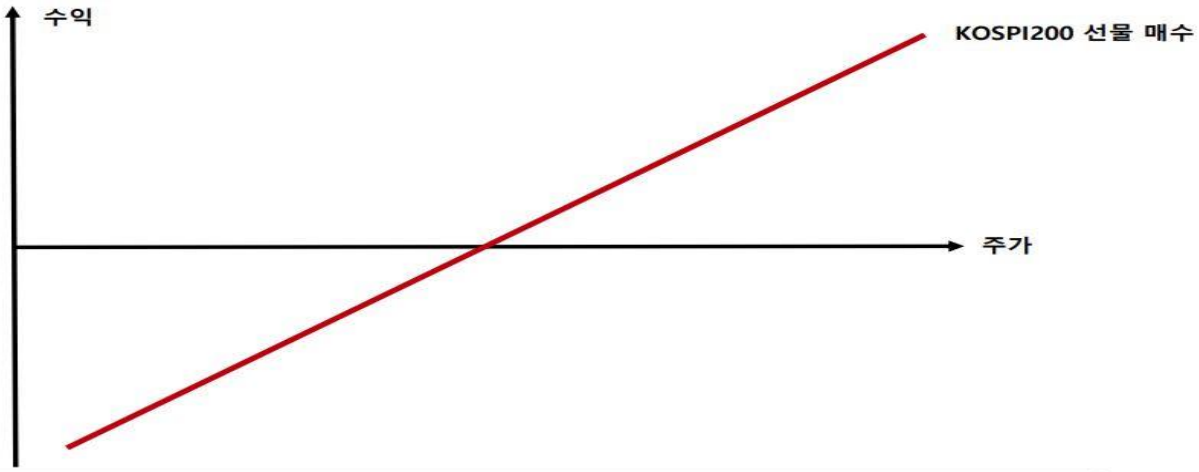
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	156	0	156	장내
누계	주가지수	선물	2,500	0	2,500	장내
신규	유가증권	선물	93	0	93	장내
누계	유가증권	선물	167	136	31	장내
합계			2,667	136	2,531	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



위 그림은 투자자의 이해를 돕기 위하여 KOSPI200지수를 기초자산으로 하는 선물 매수 그림은 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	201

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	207

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

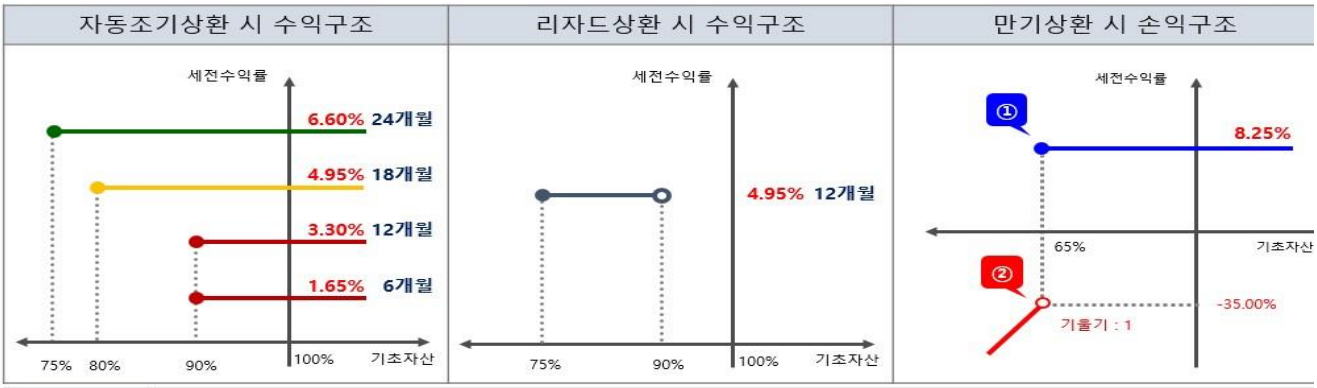
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,031		2,031	장외
합계			2,031		2,031	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기 상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상

리자드 상환 시

➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급

만기 상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

224

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-14호[ELS-파생형]

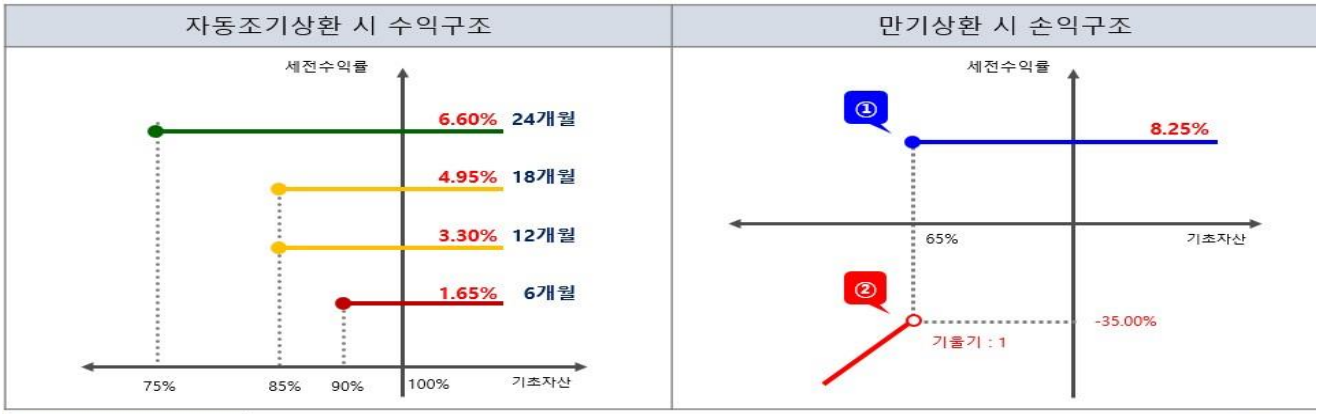
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X (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 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환 :
※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실
※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링
※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

100

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-27호[ELS-파생형]

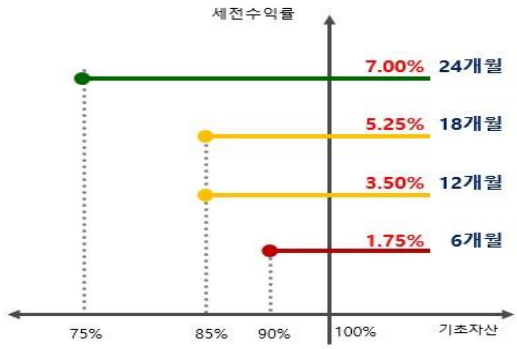
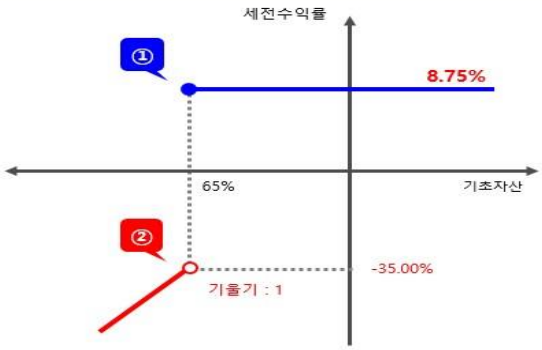
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,048		2,048	장외
합계			2,048		2,048	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

<table>
<tr><th>자동조기상환 시 수익구조</th><th>만기상환 시 손익구조</th></tr>
<tr>
<td> 
</td>
<td> 
</td>
</tr>
</table>

자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X (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 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

228

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

383

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

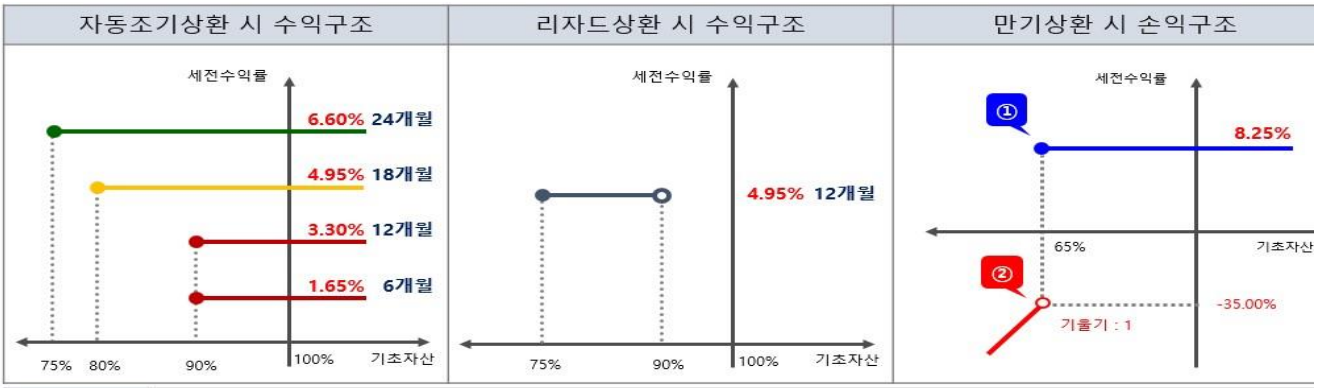
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



자동조기 상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상

리자드 상환 시

➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급

만기 상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

156

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)K-15호[ELS-파생형]

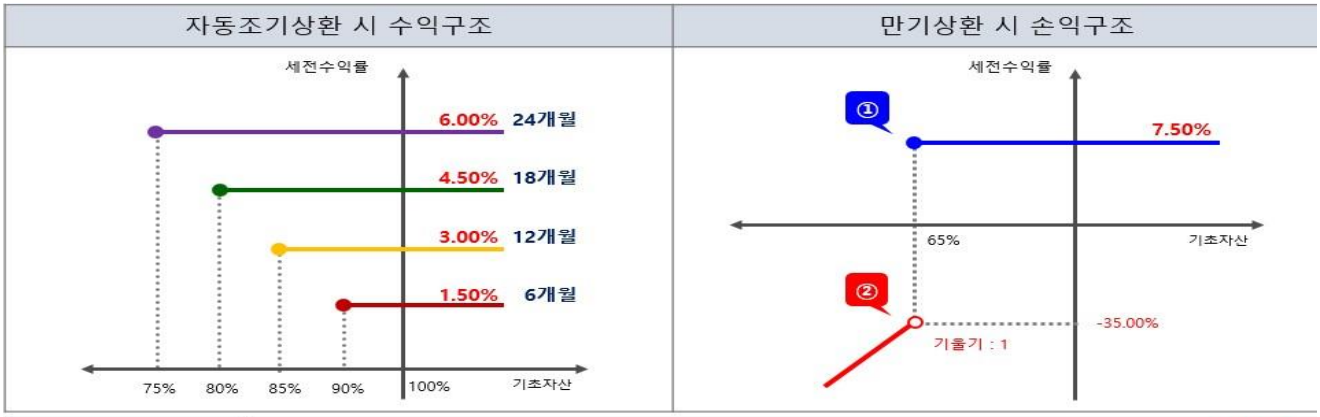
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.50% X (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 : 최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환 :
※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실
※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링
※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

38

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

66

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-30호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

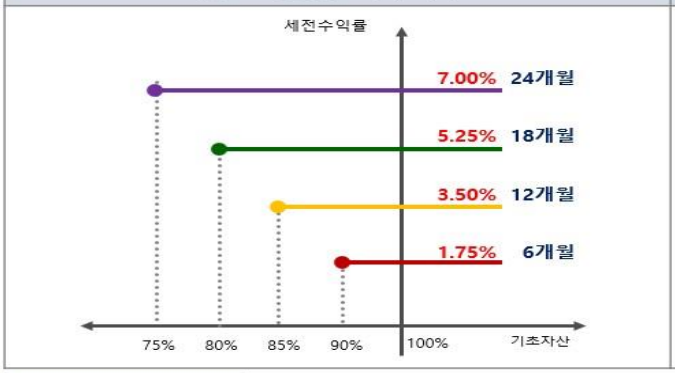
1. 계약금액

(단위: 백만원)

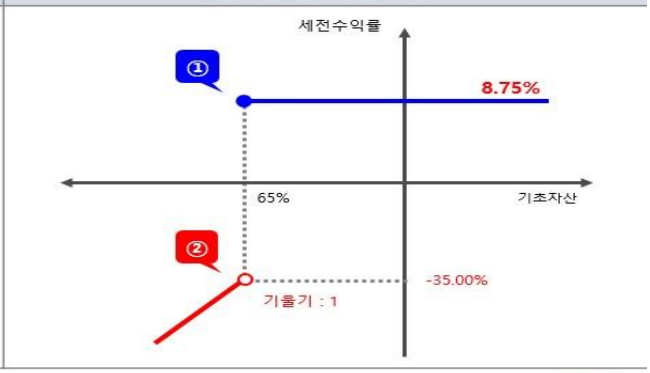
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,967		1,967	장외
합계			1,967		1,967	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조



만기상환 시 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
	6개월	90% 이상
	12개월	85% 이상
	18개월	80% 이상
	24개월	75% 이상
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

184

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

318

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

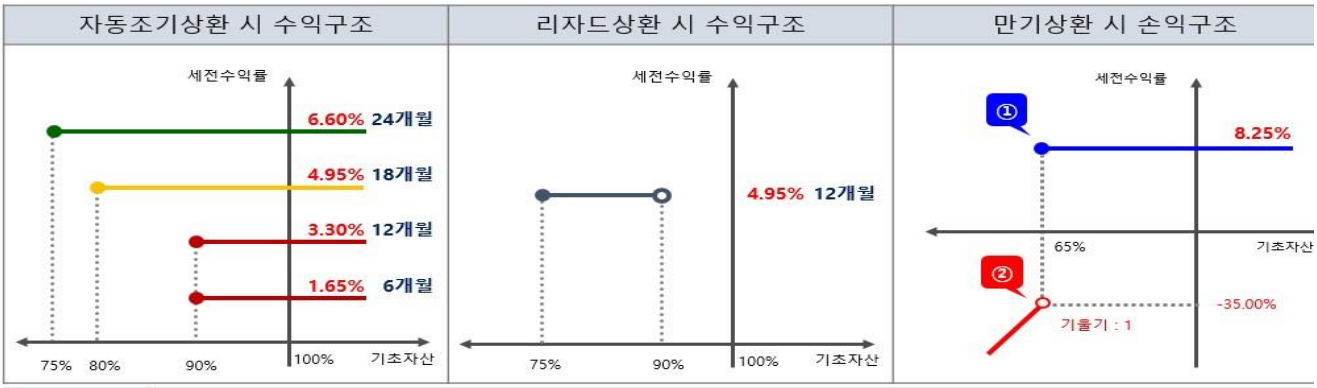
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,064		1,064	장외
합계			1,064		1,064	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기 상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.65% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	

6개월	12개월	18개월	24개월
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상

리자드 상환 시	➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.95% 수익 지급	
만기 상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

106

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-33호[ELS-파생형]

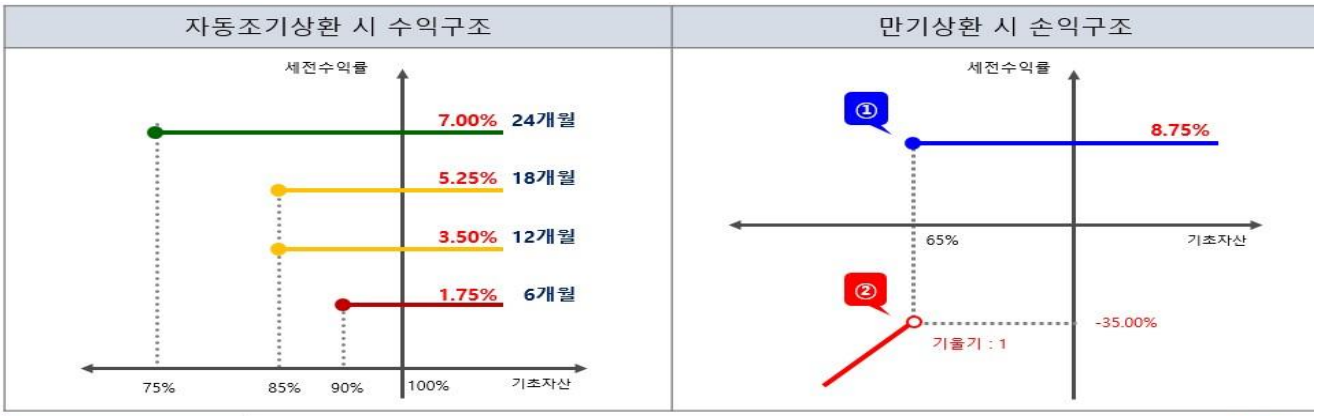
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	581		581	장외
합계			581		581	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X (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 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

94

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-37호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

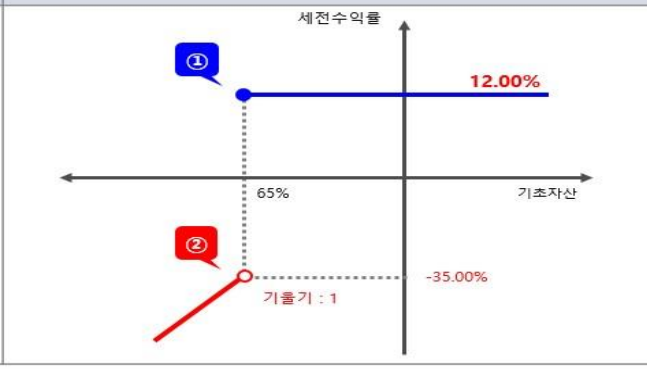
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,540		1,540	장외
합계			1,540		1,540	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조

만기상환 시 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.40% X (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

163

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

254

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

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

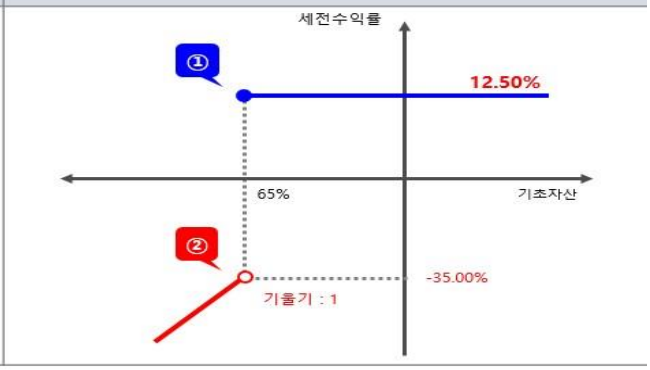
(단위: 백만원)

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

자동조기상환 시 수익구조

만기상환 시 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.50% X (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 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

95

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

147

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

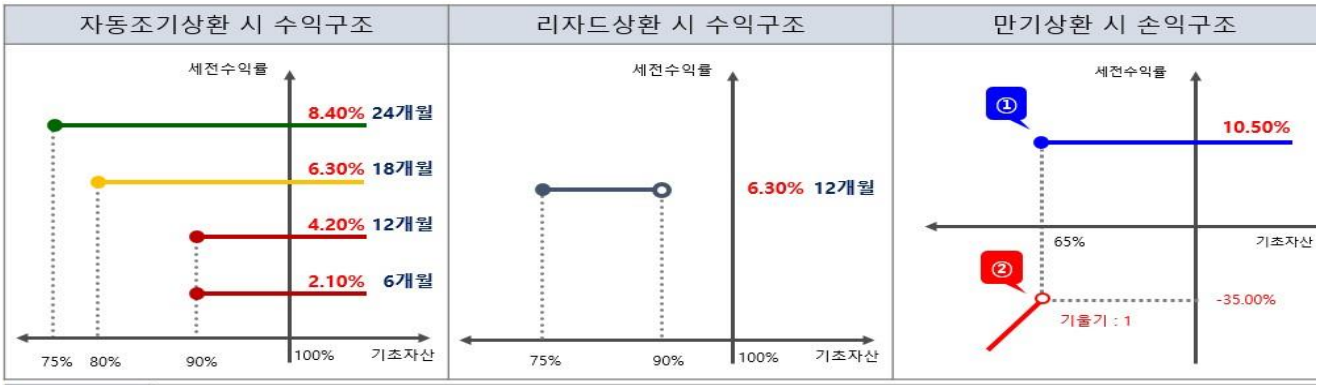
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



자동조기 상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.10% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

6개월	12개월	18개월	24개월
90% 이상	90% 이상	80% 이상	75% 이상

리자드 상환 시

➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 75% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연6.30% 수익 지급

만기 상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : BNK지수연계증권HS(KRW)N-40호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

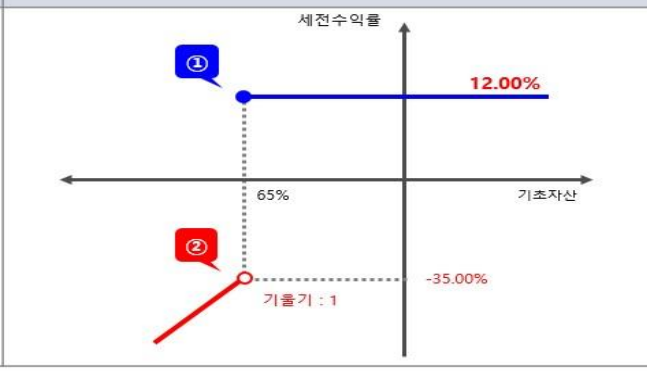
(단위: 백만원)

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

자동조기상환 시 수익구조

만기상환 시 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.40% X (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

97

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

165

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

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

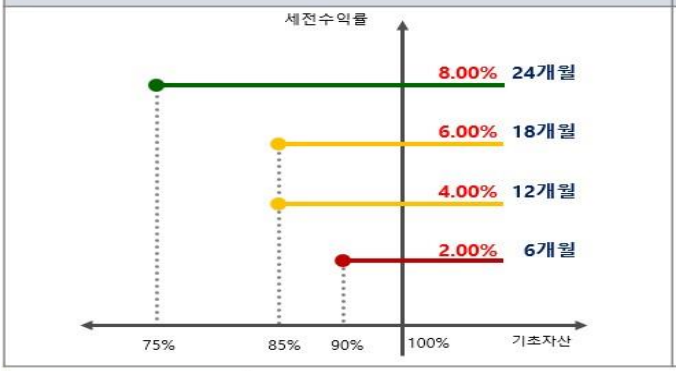
1. 계약금액

(단위: 백만원)

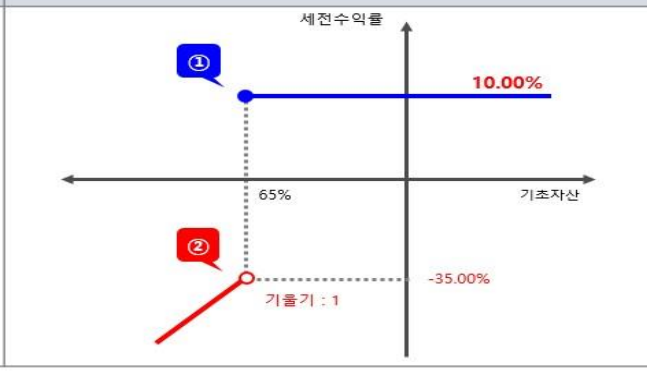
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,015		1,015	장외
합계			1,015		1,015	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조



만기상환 시 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

139

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

147

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

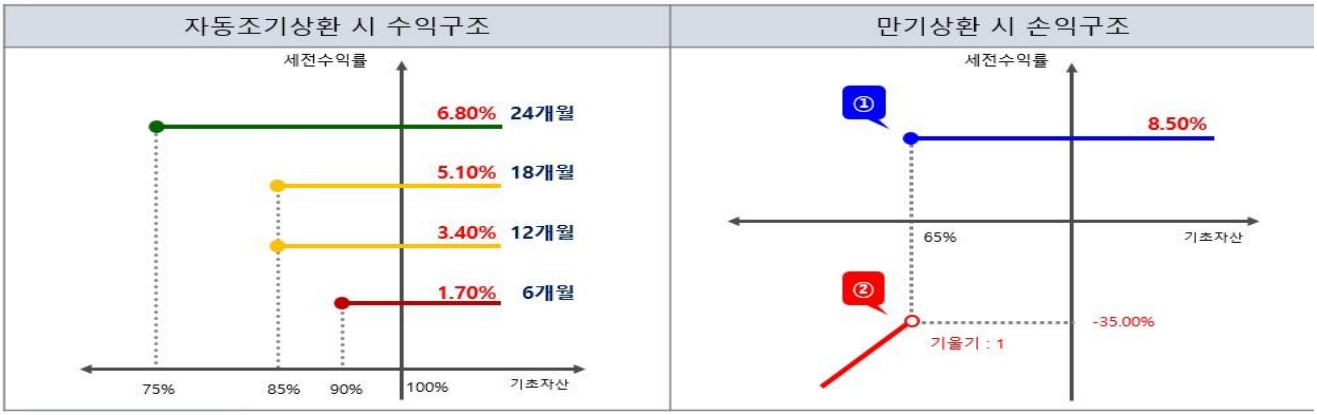
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.70% X (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

74

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

141

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

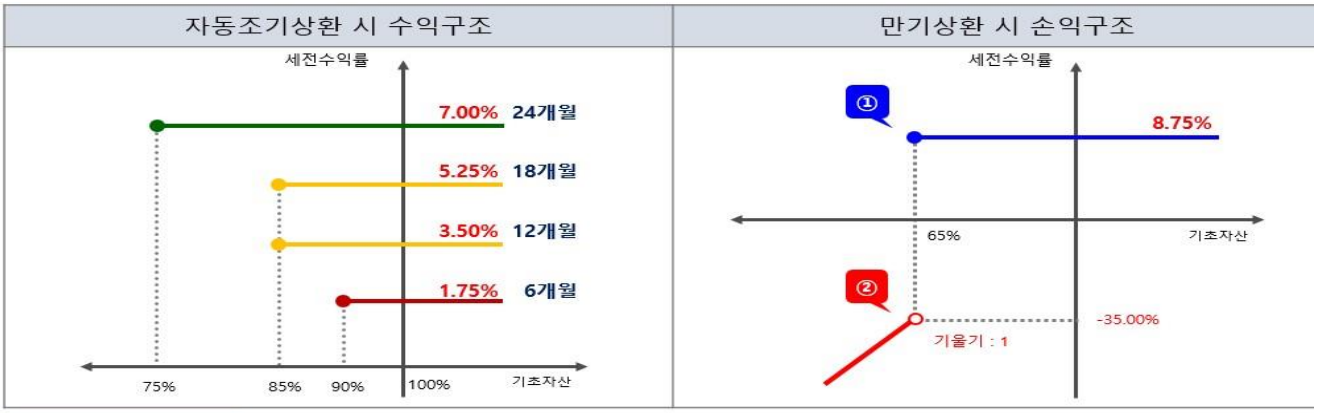
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,886		2,886	장외
합계			2,886		2,886	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.75% X (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 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환 :
※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실
※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링
※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

233

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

416

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

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

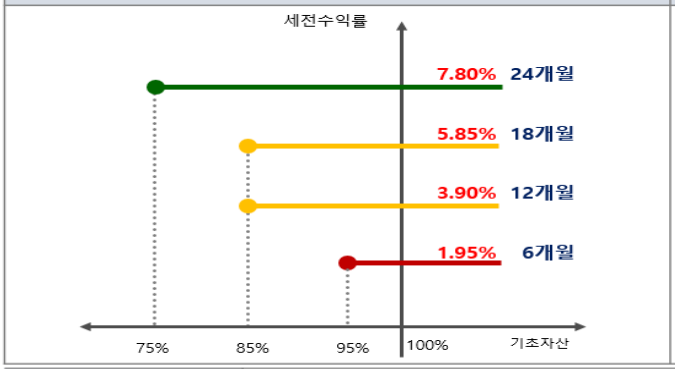
1. 계약금액

(단위: 백만원)

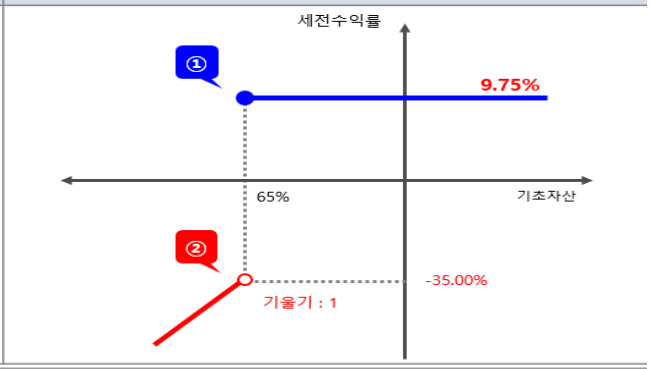
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,116		2,116	장외
합계			2,116		2,116	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조



만기상환 시 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 1.95% X (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

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

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

242

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

206

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

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

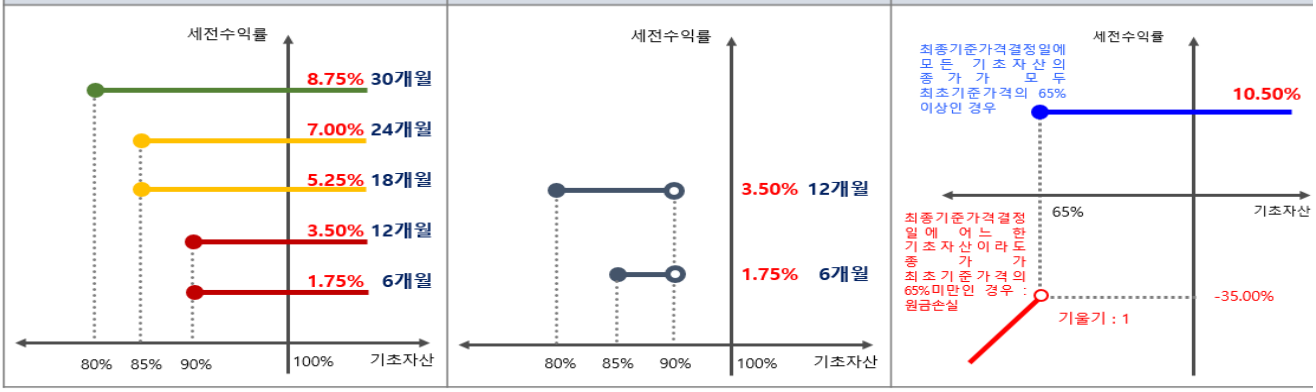
1. 계약금액

(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 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 수익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.50%** 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.50%** 수익 지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

135

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

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

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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

자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X (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 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우

② 손실상환 :
※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실
※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링
※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

107

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

89

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

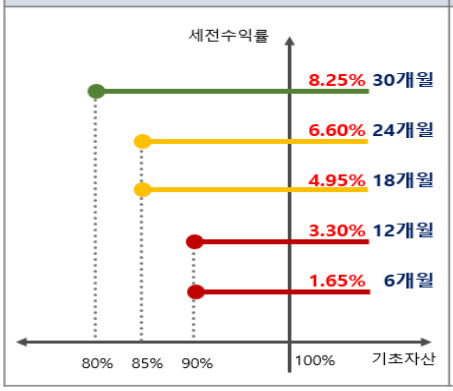
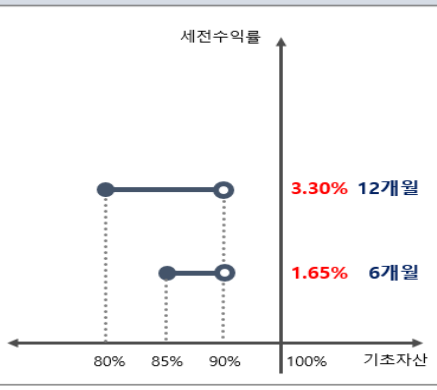
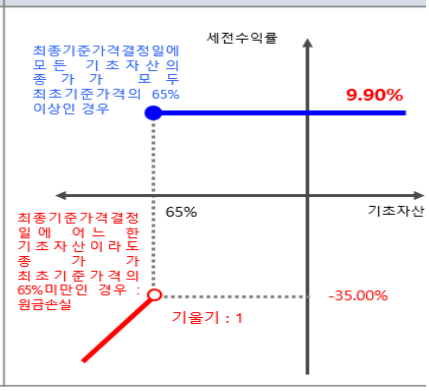
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 수익구조
		

자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.30%** 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 3.30%** 수익 지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

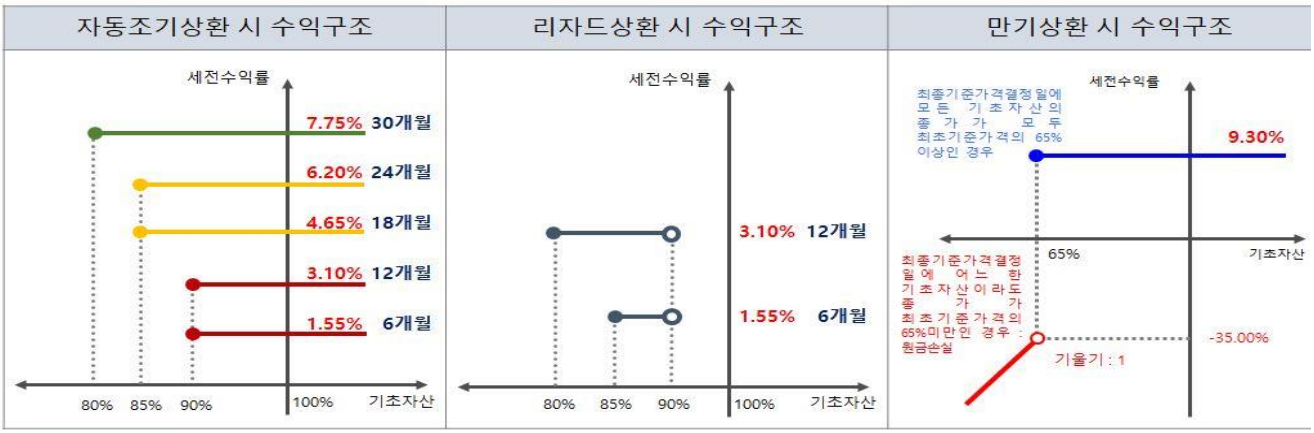
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	756		756	장외
합계			756		756	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

55

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

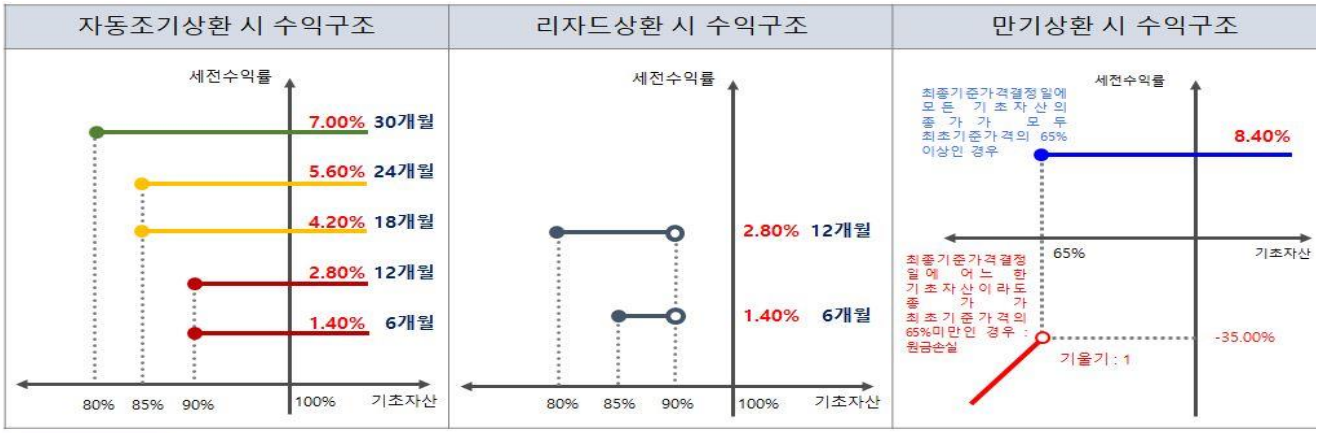
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 2.80% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

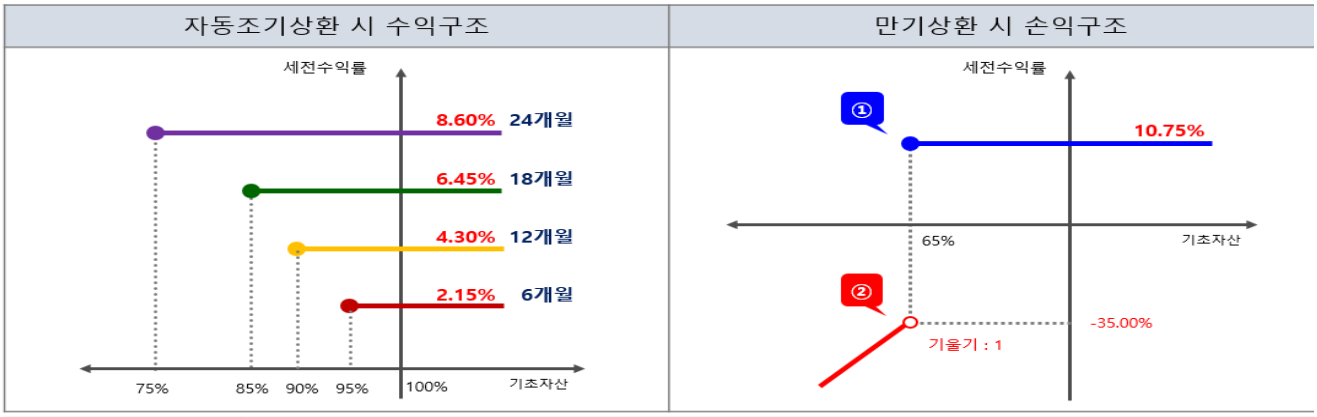
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



자동조기상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.15% X (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 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

38

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

66

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

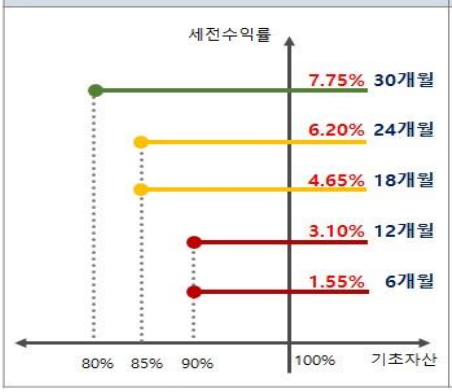
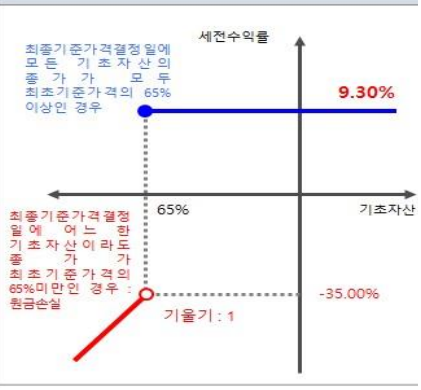
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 수익구조
		

자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 80%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.10% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

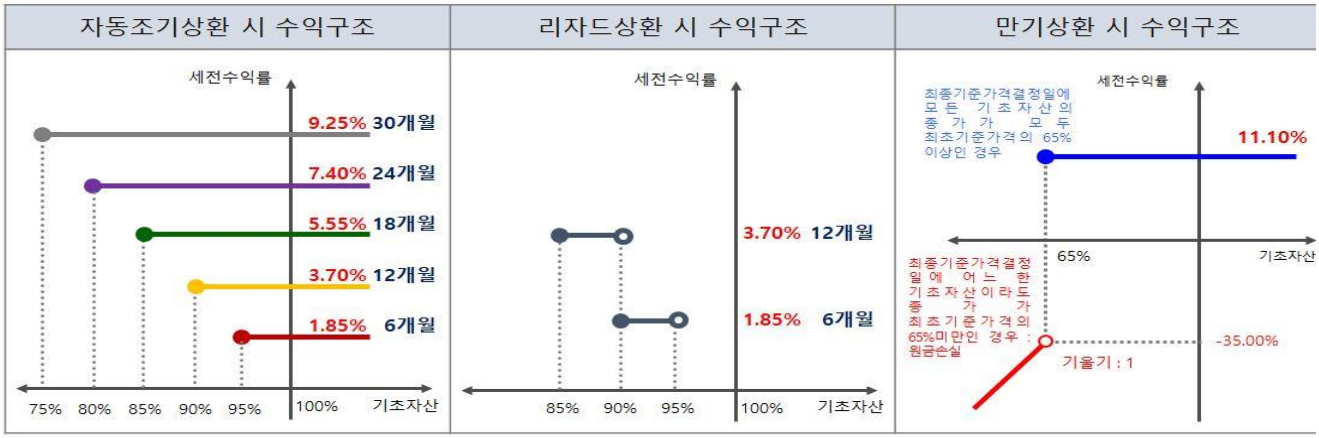
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.70% 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.70% 수익 지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

106

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

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

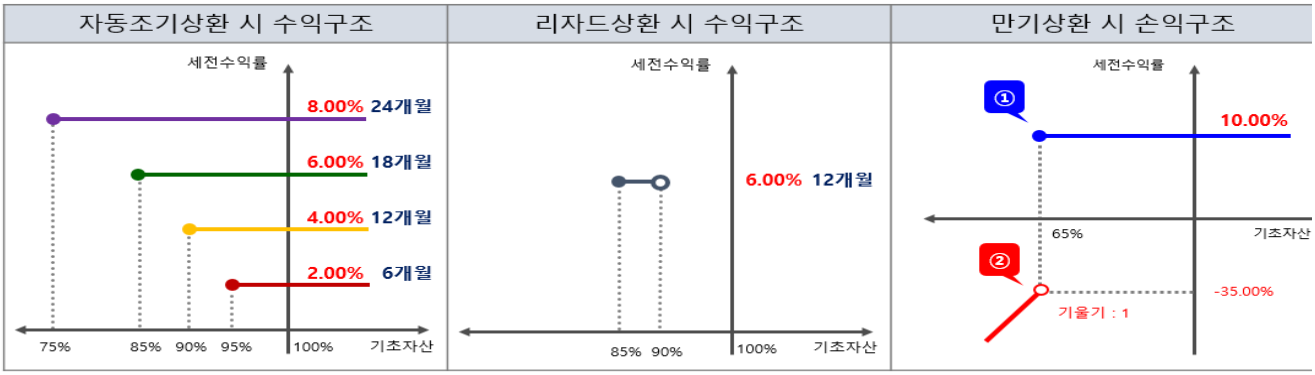
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



자동조기 상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
리자드 상환 시	➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급	
만기 상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

자동조기 상환 시	6개월	12개월	18개월	24개월
	95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

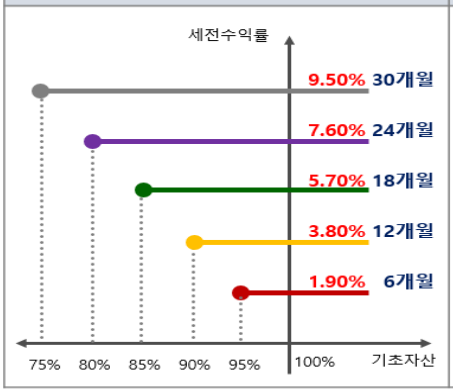
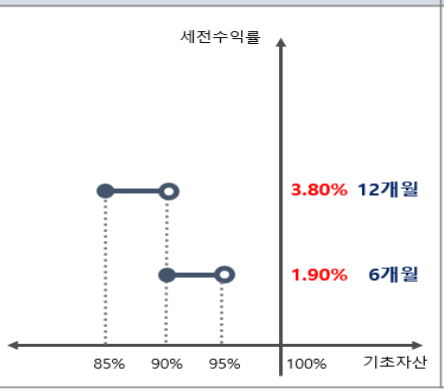
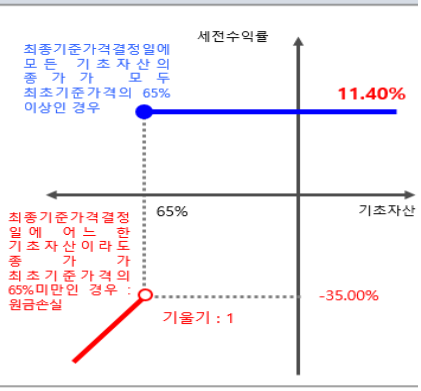
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 수익구조
		

자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.80% 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.80% 수익 지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

124

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

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

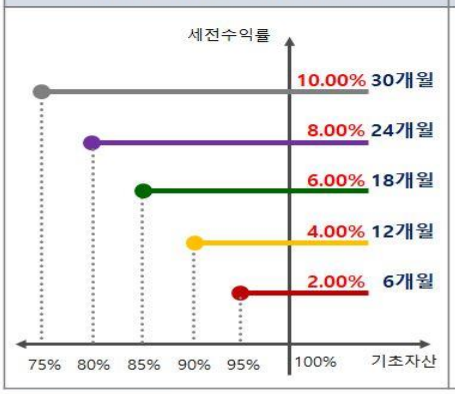
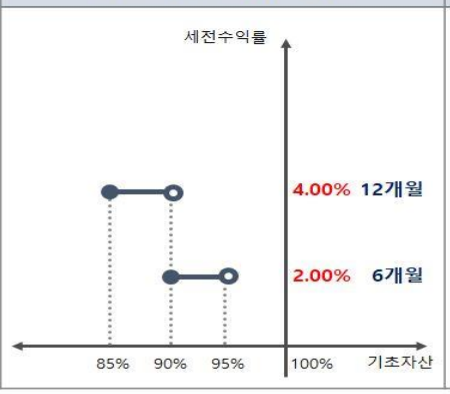
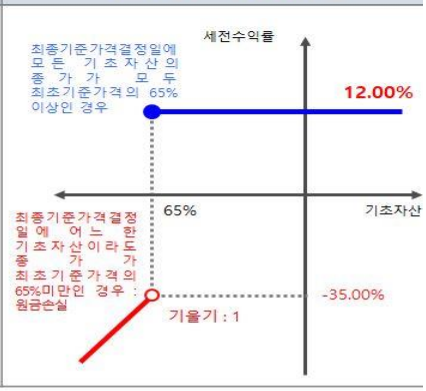
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 수익구조
		

자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.00% 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.00% 수익 지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

212

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11

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

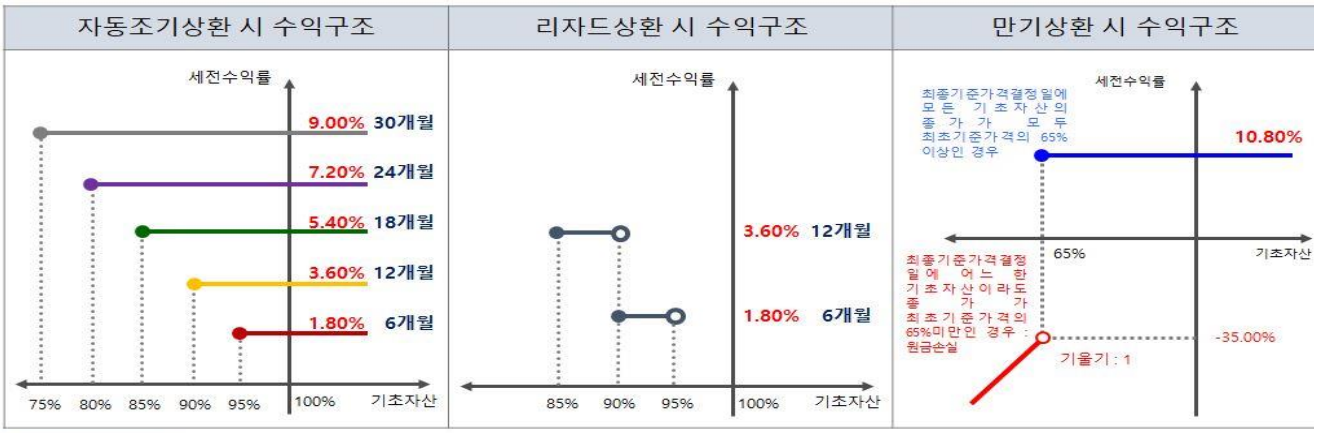
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.60% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.60% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

80

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

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

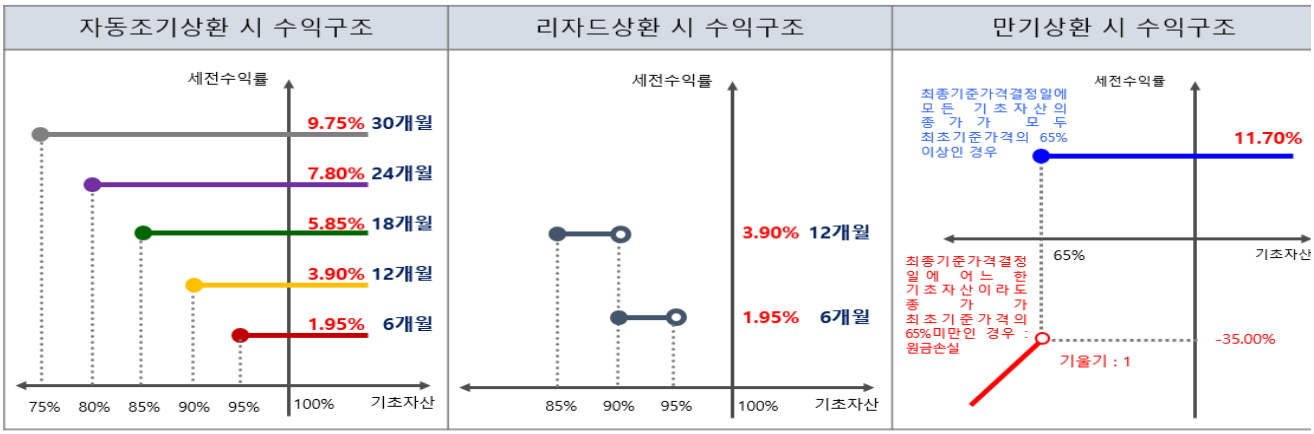
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

131

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

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

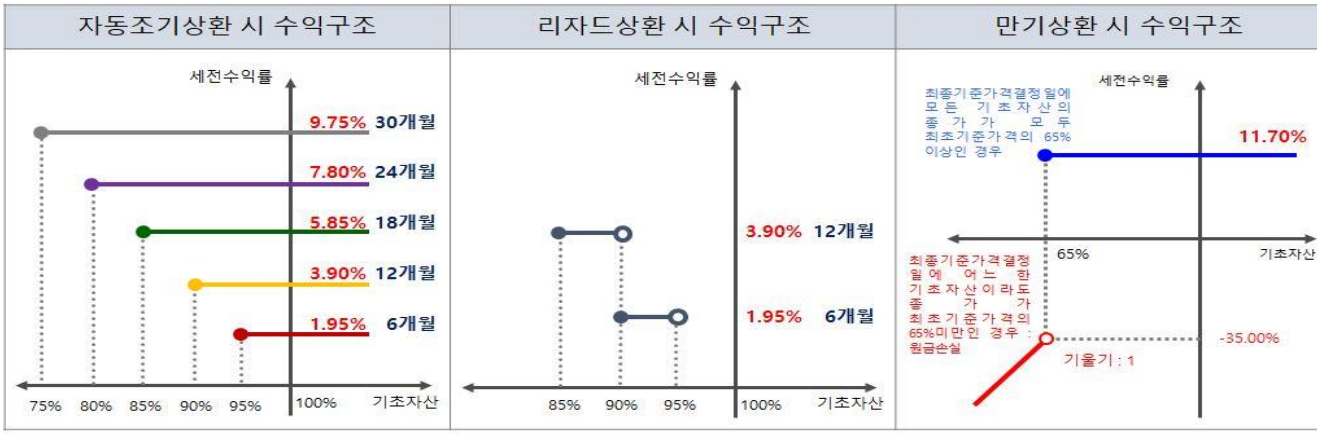
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익지 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익지
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

156

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

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

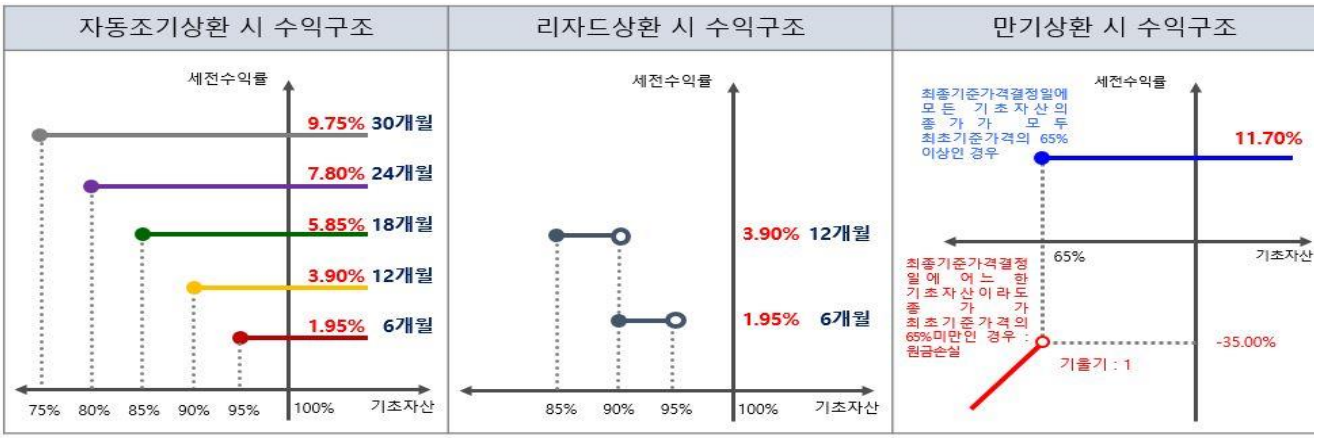
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 3.90% 수익 지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

264

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15

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

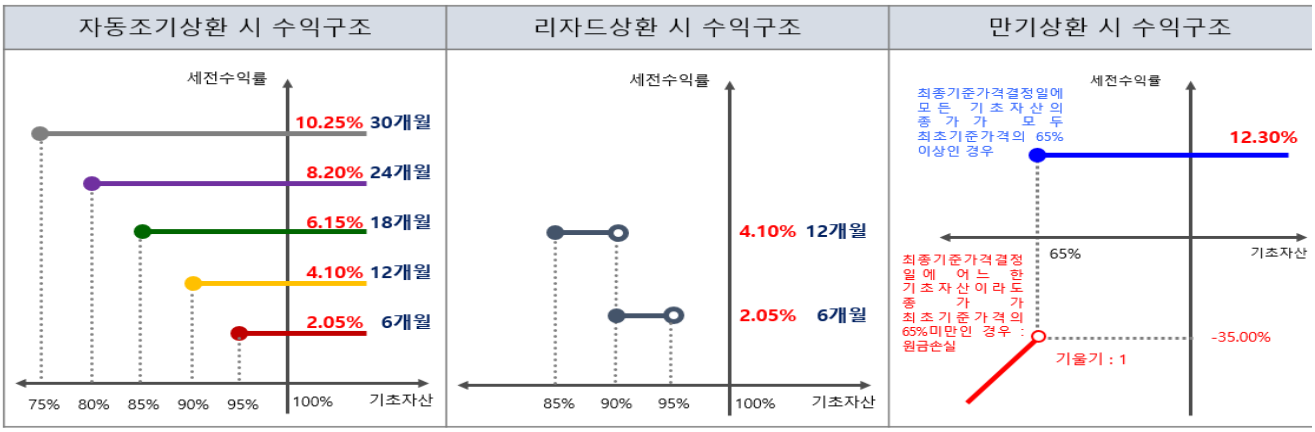
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **95%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 4.10%** 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 4.10%** 수익 지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

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

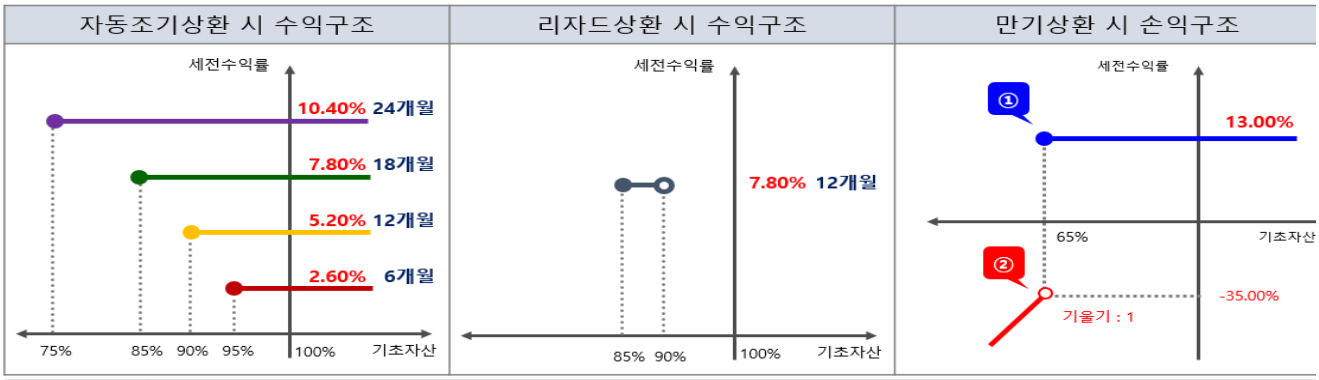
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



자동조기 상환 시

➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 **2.60%** X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산

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

리자드 상환 시

➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기준자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 7.80%** 수익 지급

만기 상환 시

① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 **65% 이상**인 경우
② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 **65%미만**인 경우 : 원금손실 ※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

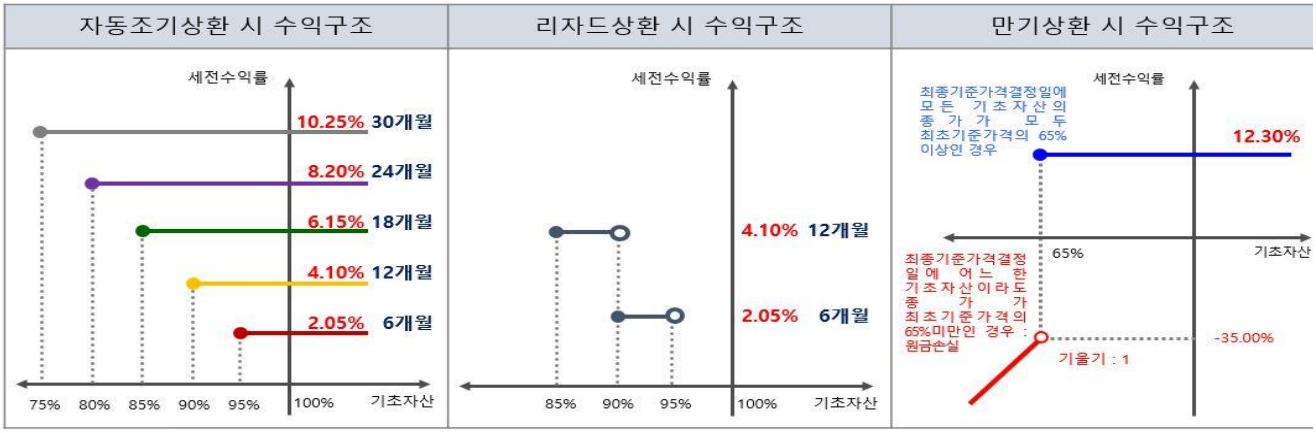
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **95%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 4.10%** 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 4.10%** 수익 지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

150

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

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

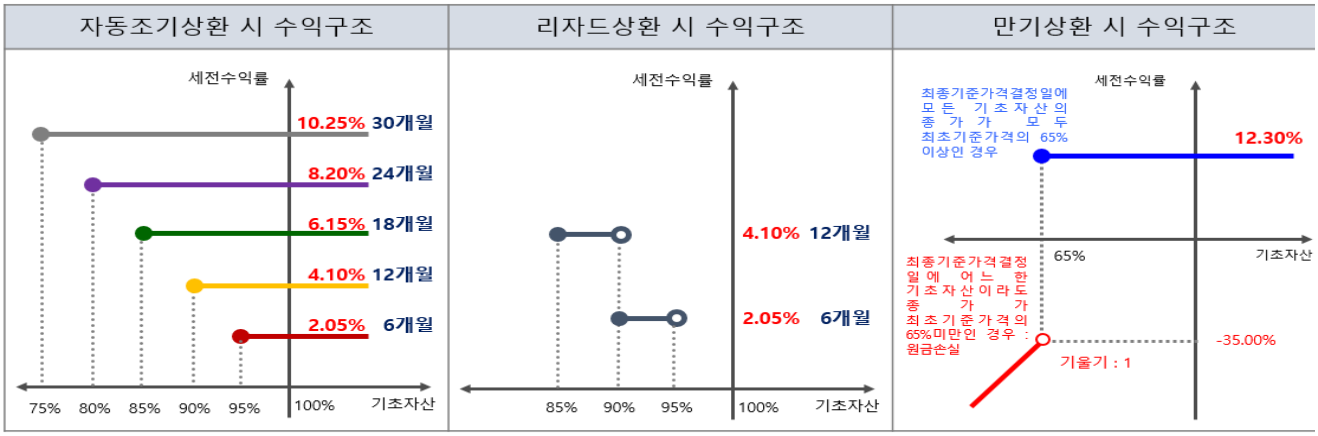
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **95%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 4.10%** 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 4.10%** 수익 지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

233

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

22

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

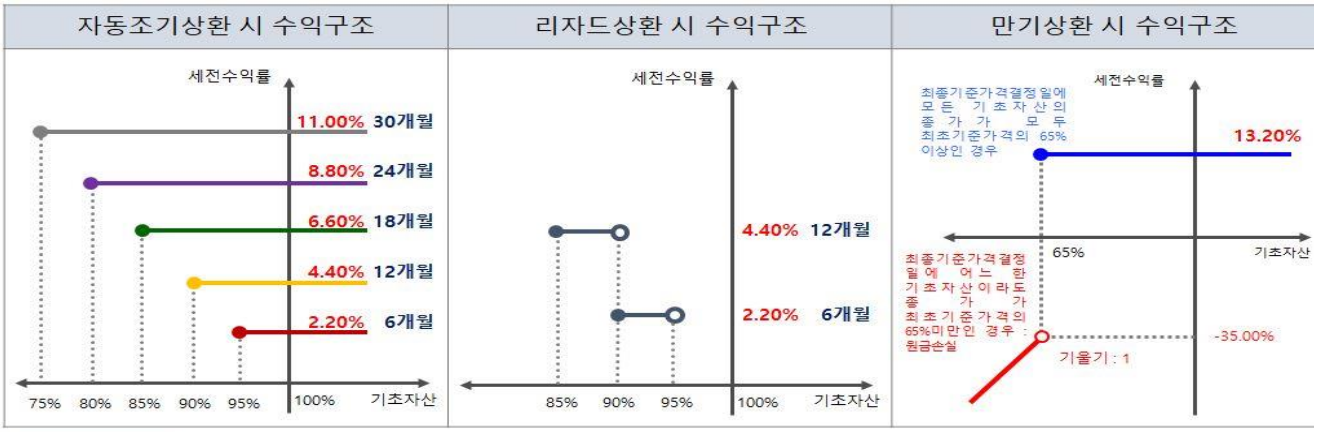
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.40% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기조자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

325

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

21

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

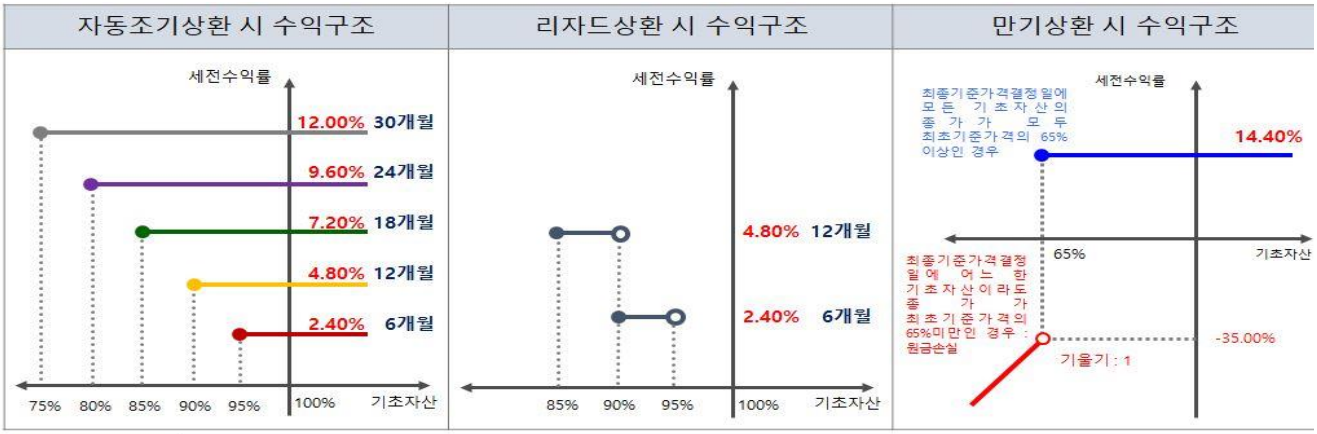
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.80% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

228

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

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

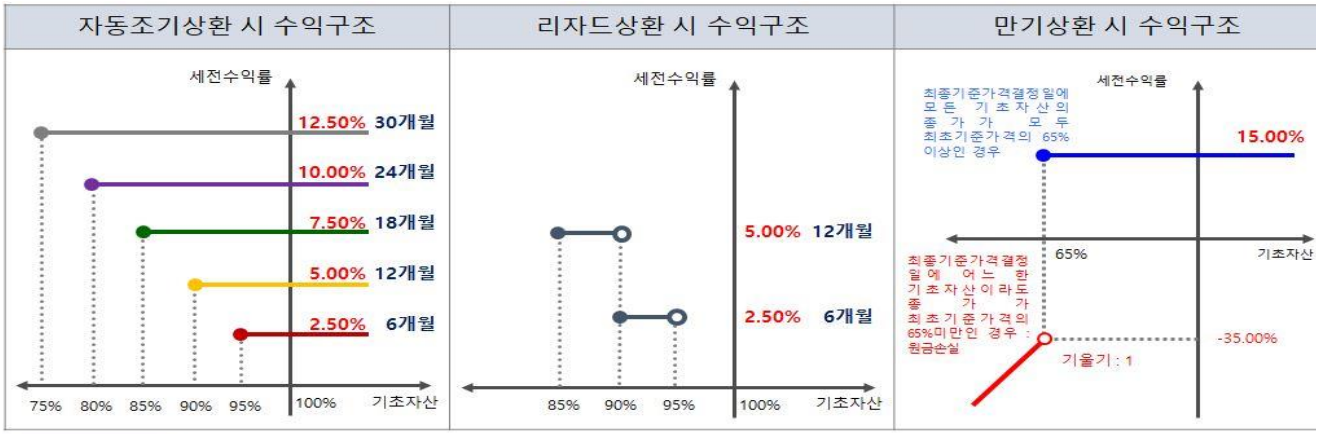
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-23호[ELS-파생형]

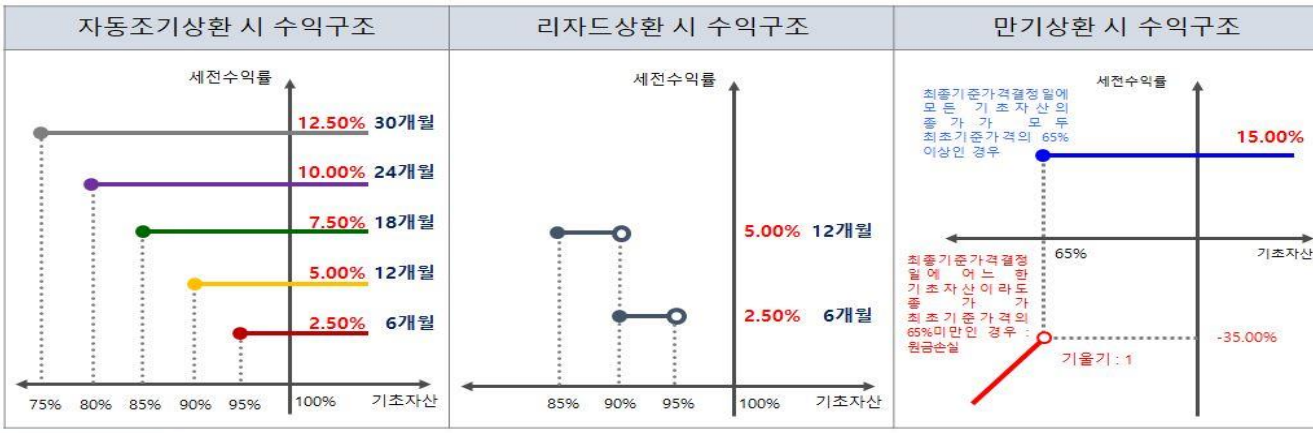
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-24호[ELS-파생형]

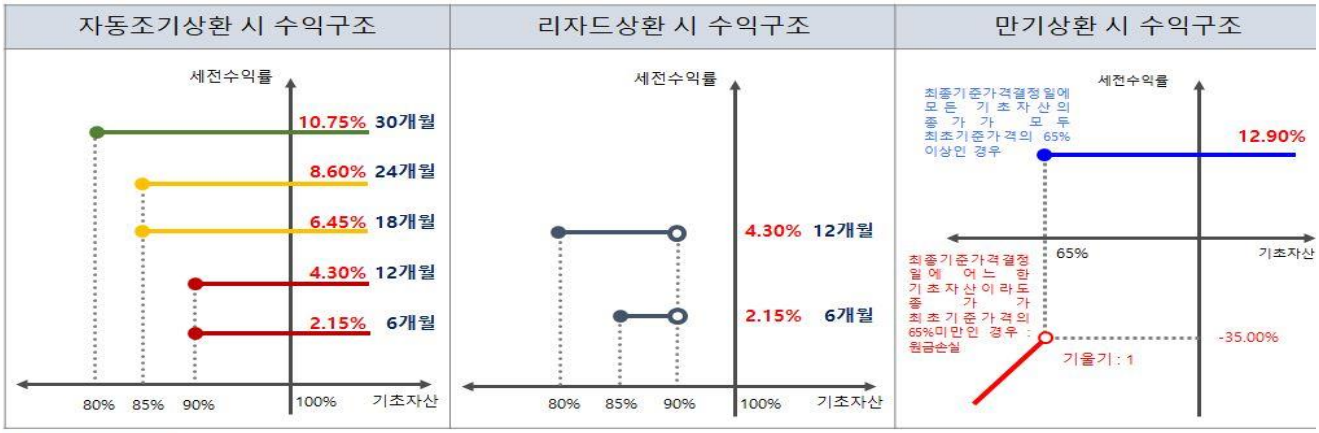
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.30% 수익지 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 4.30% 수익지
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

159

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

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

기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

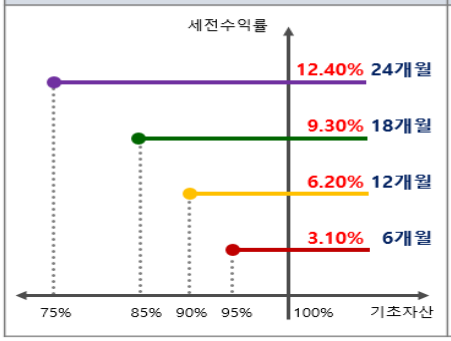
1. 계약금액

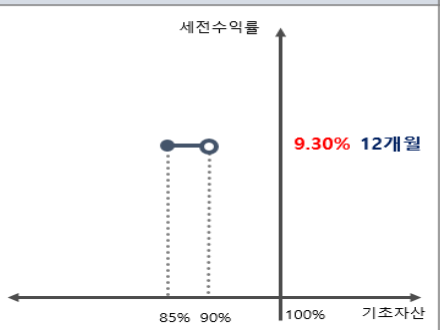
(단위: 백만원)

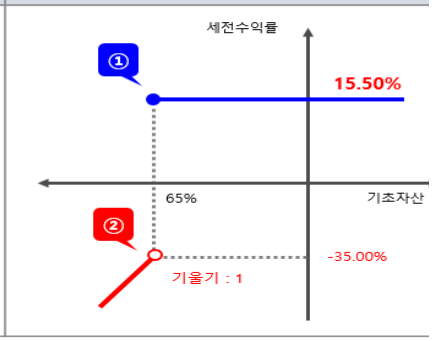
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	823		823	장외
합계			823		823	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

자동조기상환 시 수익구조	리자드상환 시 수익구조	만기상환 시 손익구조







자동조기 상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 3.10% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산	
	6개월	12개월 / 18개월 / 24개월
	95% 이상	90% 이상 / 85% 이상 / 75% 이상
리자드 상환 시	➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 9.30% 수익 지급	
만기 상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 종가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 종가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

77

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-25호[ELS-파생형]

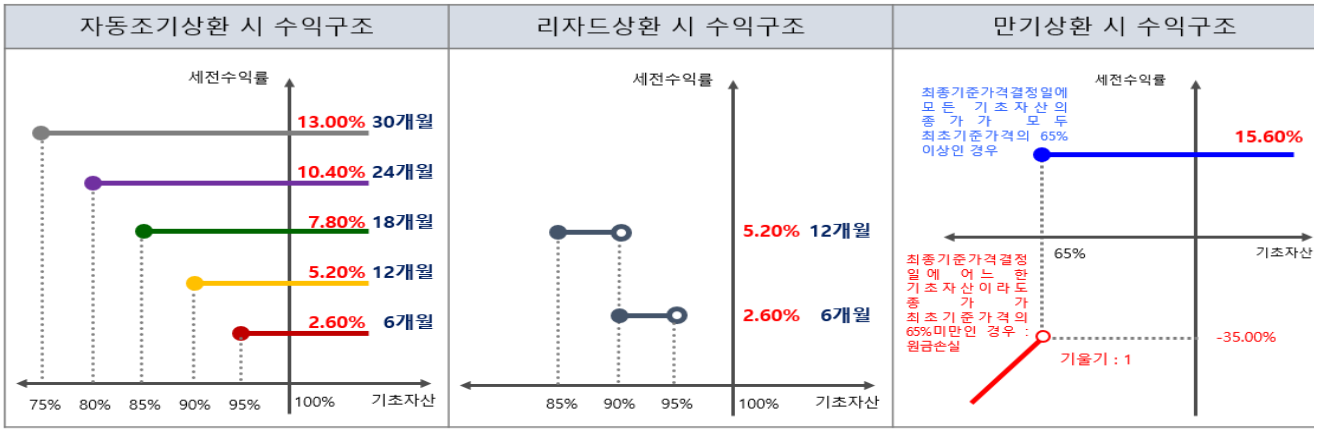
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	2,223		2,223	장외
합계			2,223		2,223	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **95%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 5.20%** 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 **90%미만**인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 **85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우** ⇒ **연 5.20%** 수익 지급
만기상환 시	※ **65%미만** 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ **최대 원금손실률: 100%**

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

189

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-26호[ELS-파생형]

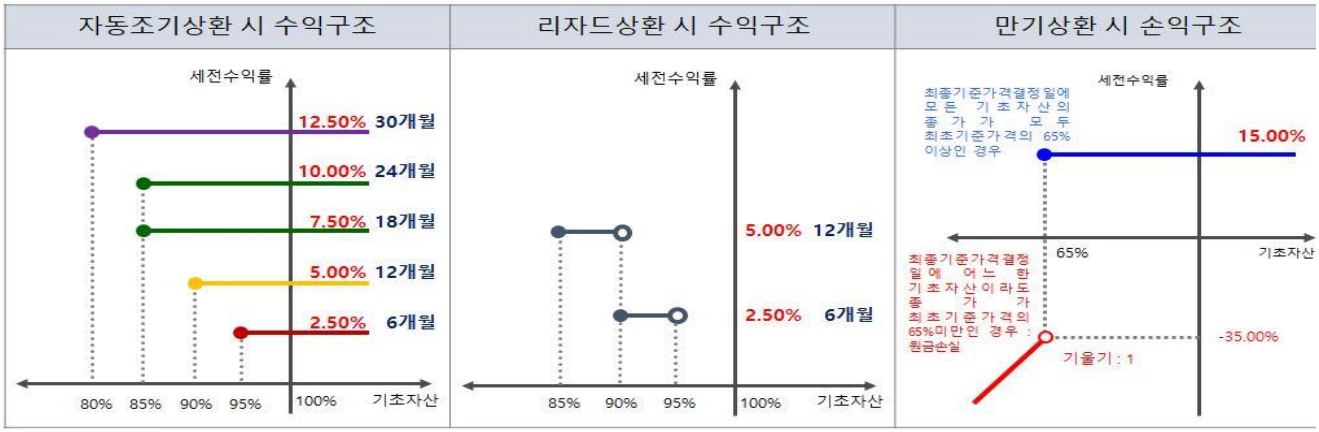
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.00% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기조자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

103

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-27호[ELS-파생형]

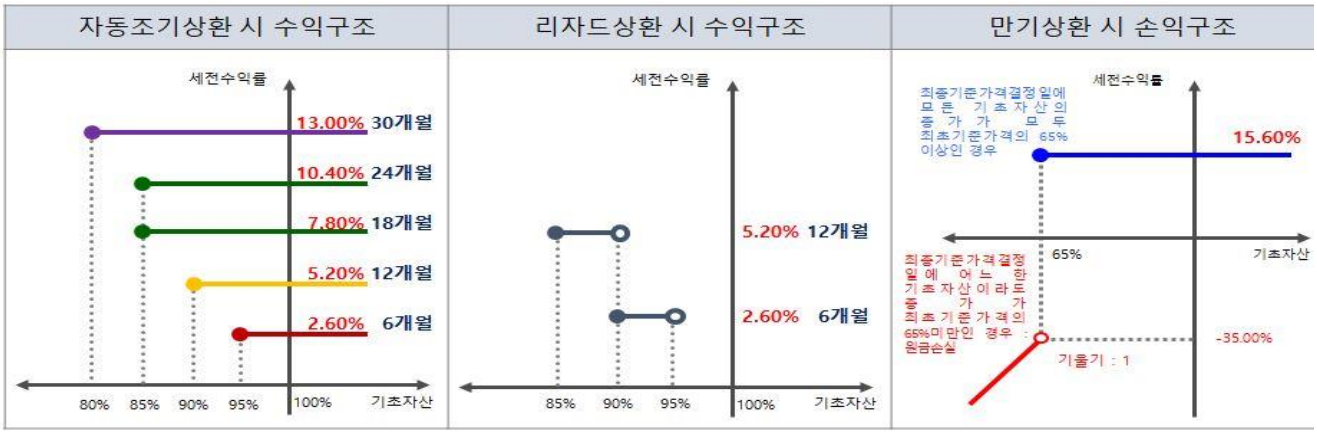
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.20% 수익 지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

79

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-28호[ELS-파생형]

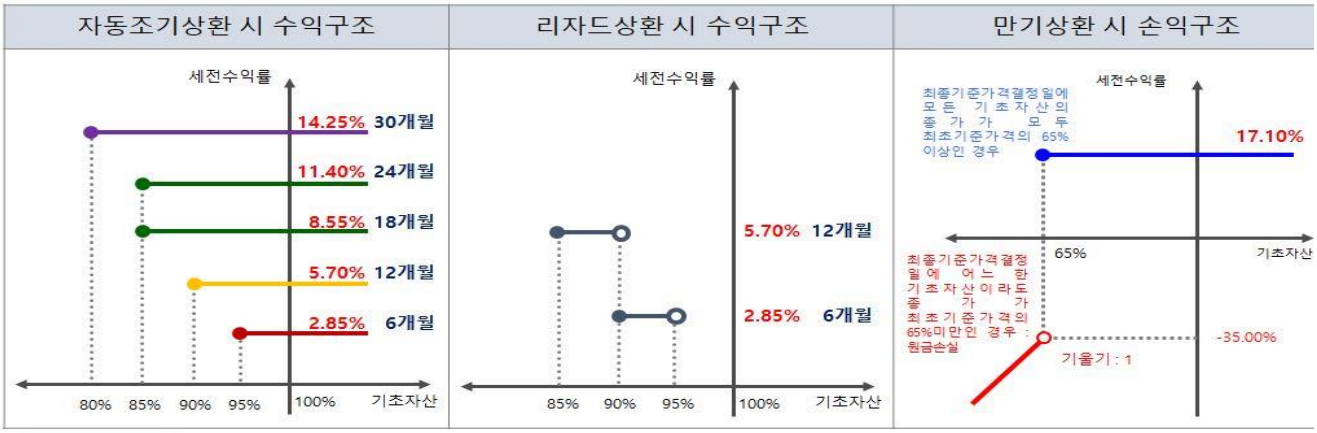
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.70% 수익지 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.70% 수익지
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

108

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-29호[ELS-파생형]

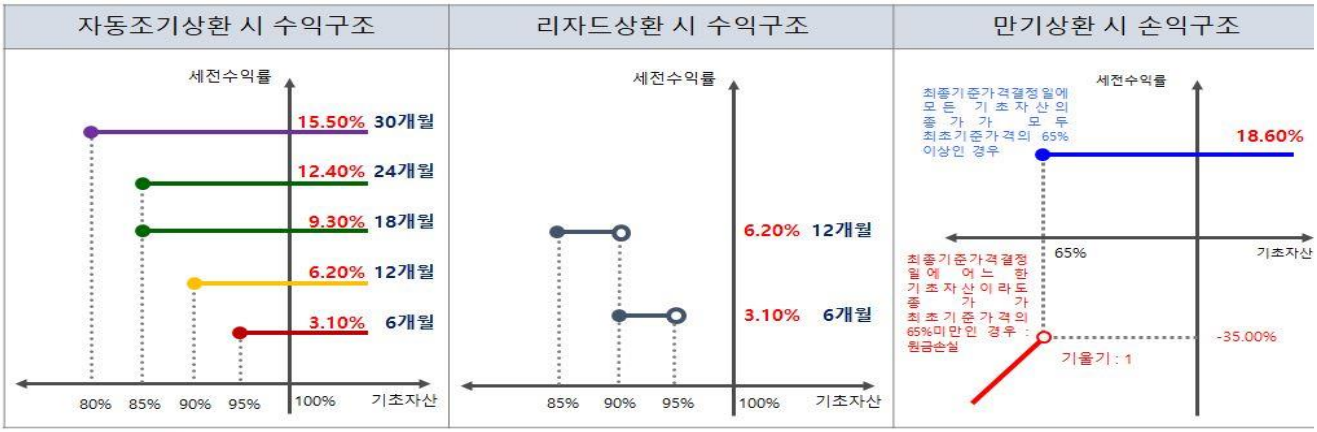
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.20% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85%미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.20% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

53

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

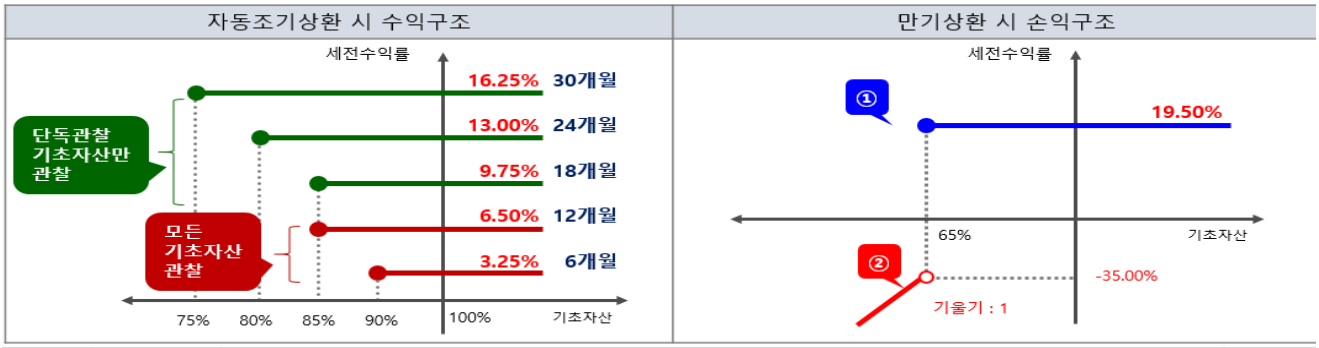
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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



	기간	상환조건	손익률(세
자동조기상환 시	6개월	• 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 90% 이상인 경우	3.25% 수
	12개월	• 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가가 모두 최초기준가격의 85% 이상인 경우 • 2차 자동조기상환평가일에 조기상환이 되지 않을 경우, 단독관찰기초자산 결정	6.50% 수
	18개월	• 3차 자동조기상환평가일에 **단독관찰기초자산**의 종가가 최초기준가격의 85% 이상인 경우 • 단독관찰기초자산 : 단독관찰결정일에 모든 기초자산 중 (중간평가가격/최초기준가격)의 비율이 가장 작은 기초자산	9.75% 수
	24개월	• 4차 자동조기상환평가일에 **단독관찰기초자산**의 종가가 최초기준가격의 80% 이상인 경우	13.00% 수
	30개월	• 5차 자동조기상환평가일에 **단독관찰기초자산**의 종가가 최초기준가격의 75% 이상인 경우	16.25% 수
만기상환 시	①수익상환	• 최종기준가격결정일에 **단독관찰기초자산**의 종가가 최초기준가격의 **65% 이상**인 경우	19.50% 수
	②손실상환	※ 최종기준가격결정일에 **단독관찰기초자산**의 종가가 최초기준가격의 **65%미만**인 경우 : 원금손실 ※ 단독관찰기초자산의 하락률 기준으로 원금손실 발생 ※ **최대 원금손실률: 100%**	-35% ~ -100% 수

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-31호[ELS-파생형]

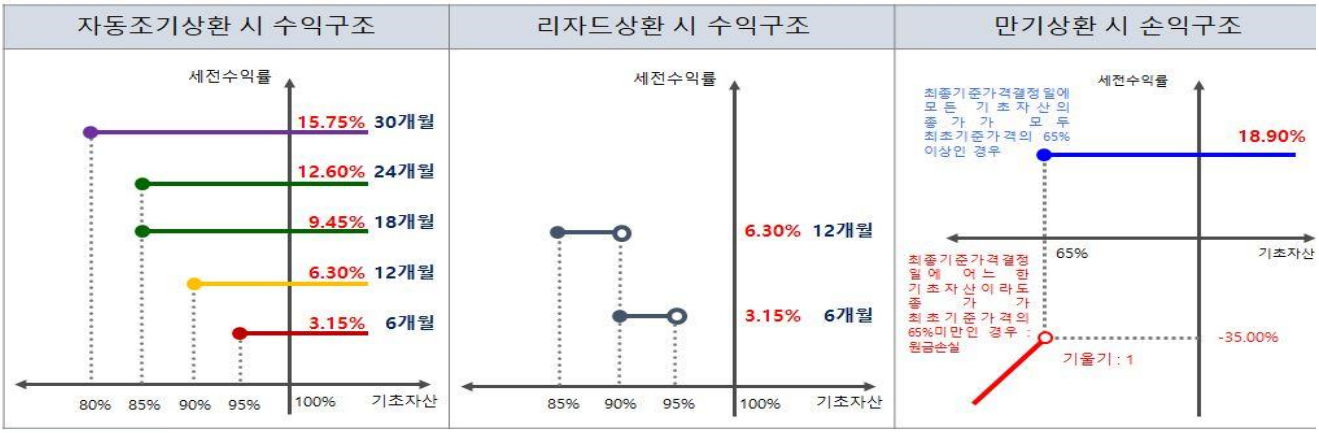
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

59

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-32호[ELS-파생형]

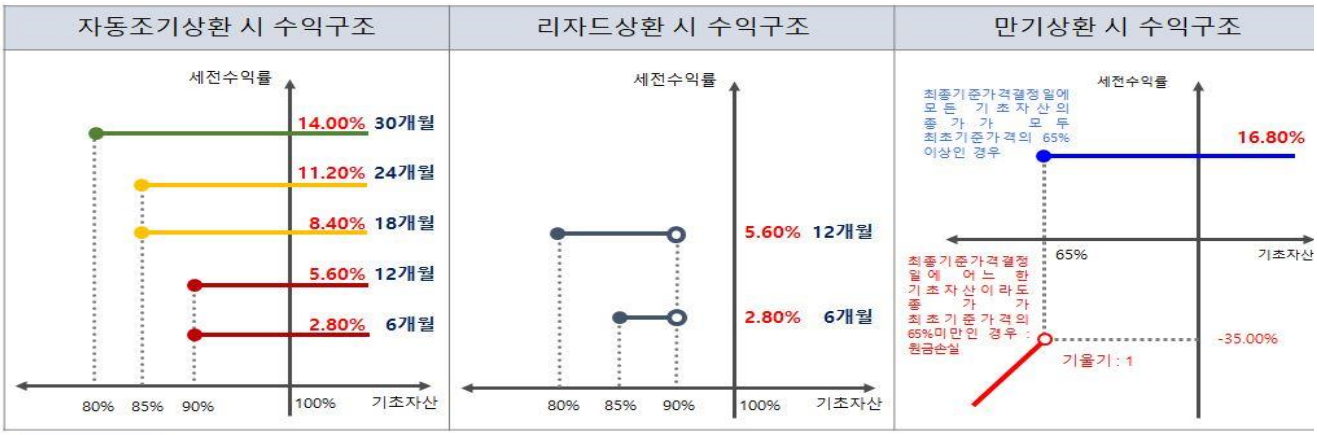
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.60% 수익지 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.60% 수익지
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

78

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-34호[ELS-파생형]

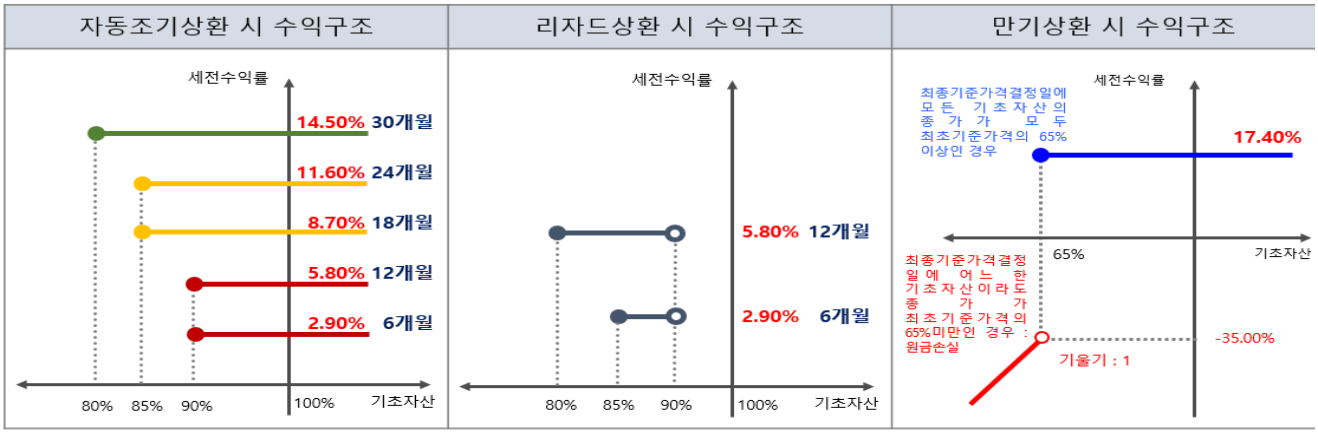
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.80% 수익 지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 80% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 5.80% 수익 지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-35호[ELS-파생형]

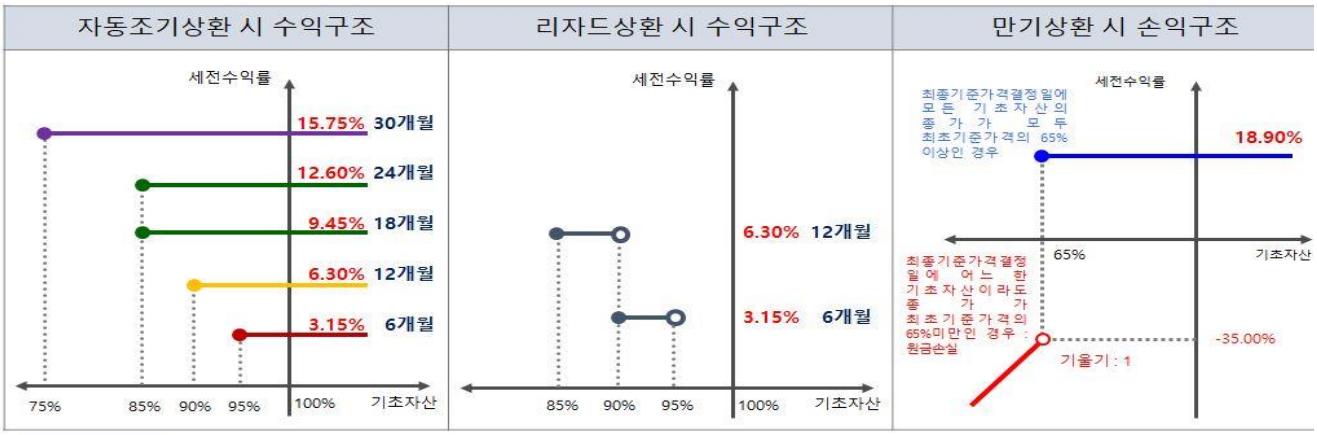
기준일 : 2023-03-27 공시일: 2023-03-28

1. 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	➢ 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 종가가 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	➢ 1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 95%미만인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 90% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익지급 ➢ 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 종가 중 어느 하나라도 최초기조자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 종가 중 어느 하나도 최초기조자산가격 대비 85% 미만 으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.30% 수익지급
만기상환 시	※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 종가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2