

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-07-12

공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	340	0	340	장내
누계	주가지수	선물	2,043	0	2,043	장내
신규	주가지수	옵션	0	509	-509	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,358	-1,358	장내
신규	유가증권	선물	232	289	-57	장내
누계	유가증권	선물	200	25	174	장내
합계			2,242	1,383	859	

## 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

151

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

117

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-07-12

공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	136	0	136	장내
누계	주가지수	선물	24,258	0	24,258	장내
합계			24,258	0	24,258	

## 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

1,943

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,887

# 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2023-07-12

공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	511	340	170	장내
누계	주가지수	선물	3,830	0	3,830	장내
신규	주가지수	옵션	0	683	-683	장내
누계	주가지수	옵션	0	1,702	-1,702	장내
신규	유가증권	선물	61	41	20	장내
누계	유가증권	선물	421	0	421	장내
합계			4,251	1,702	2,550	

## 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

294

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

265

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

기준일 : 2023-07-12

공시일:

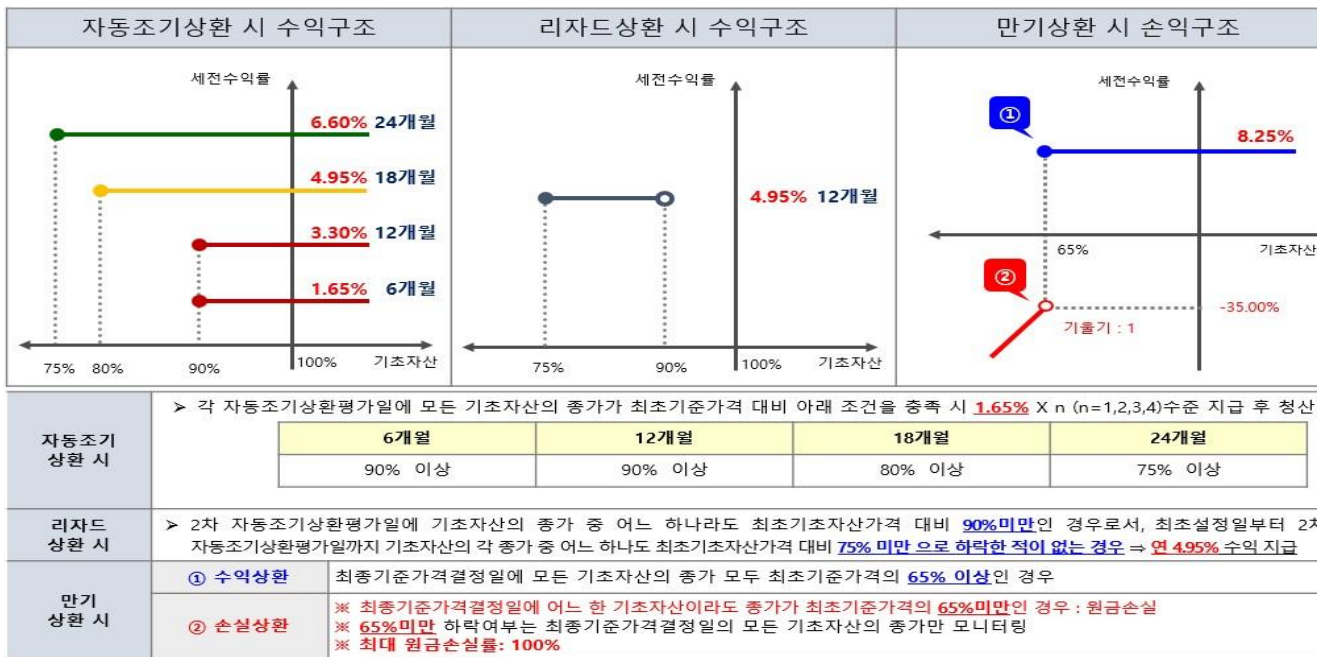
2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,680		1,680	장외
합계			1,680		1,680	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

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

기준일 : 2023-07-12

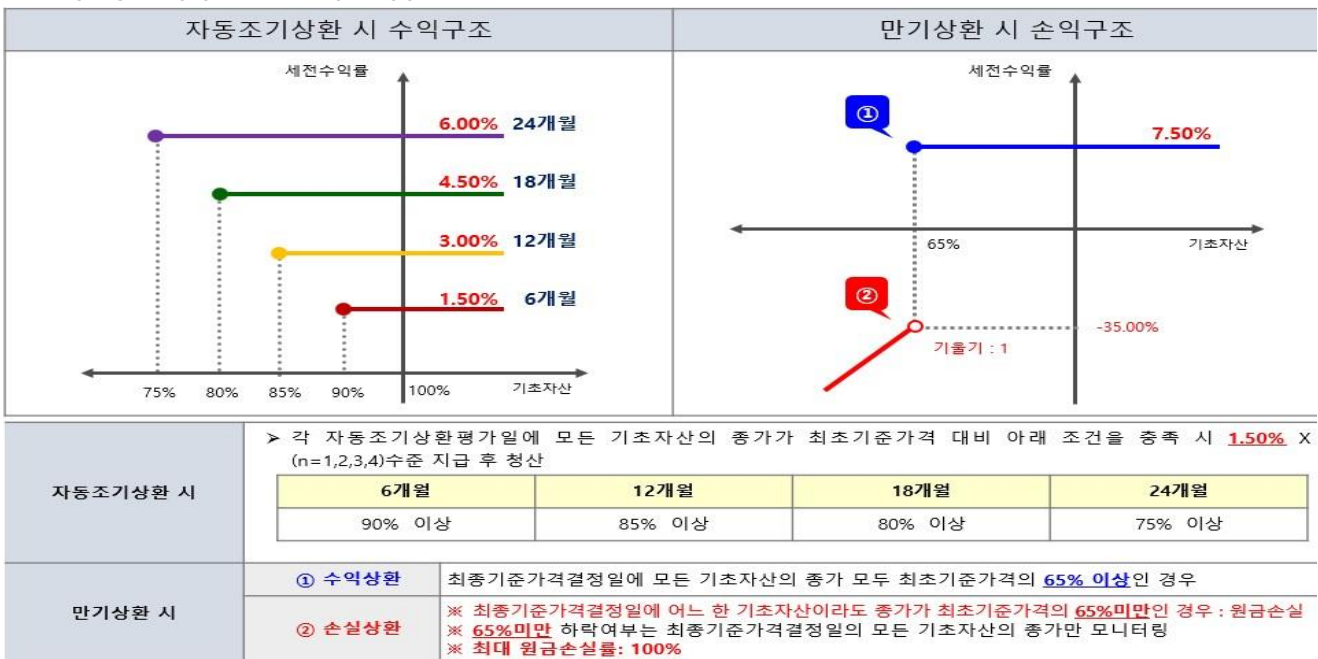
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	419		419	장외
합계			419		419	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

31

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

기준일 : 2023-07-12

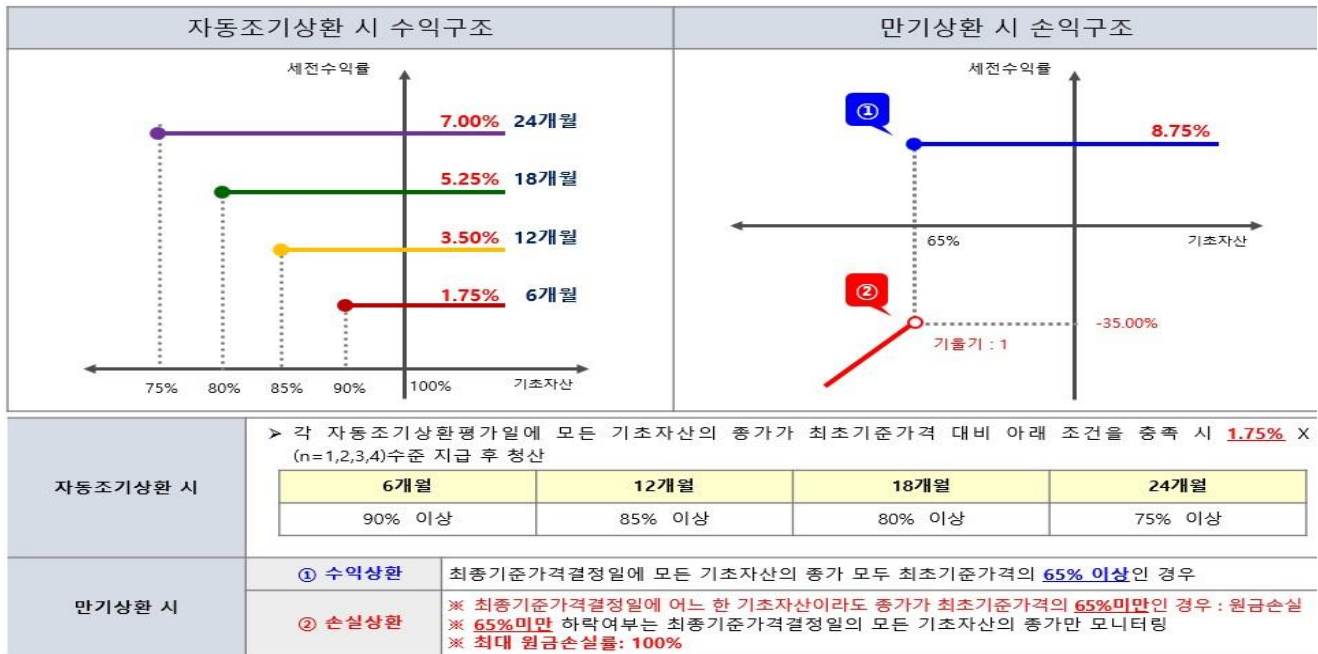
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

81

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

143

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

기준일 : 2023-07-12

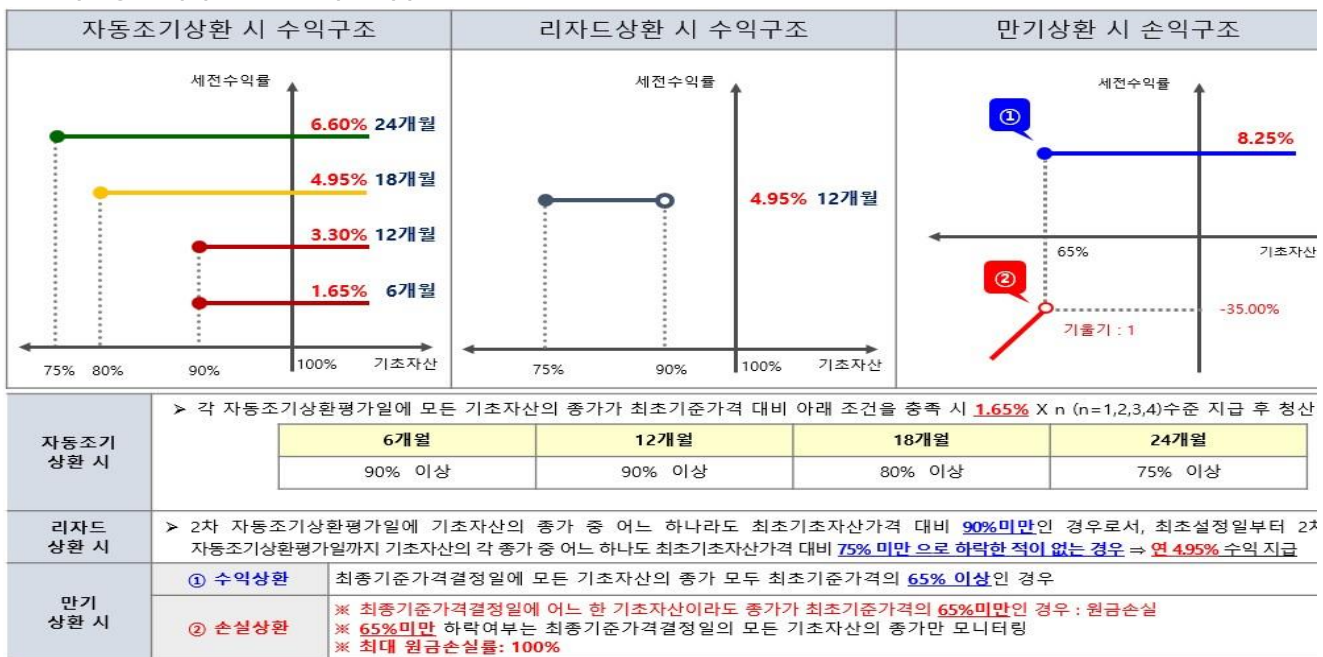
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

45

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

기준일 : 2023-07-12

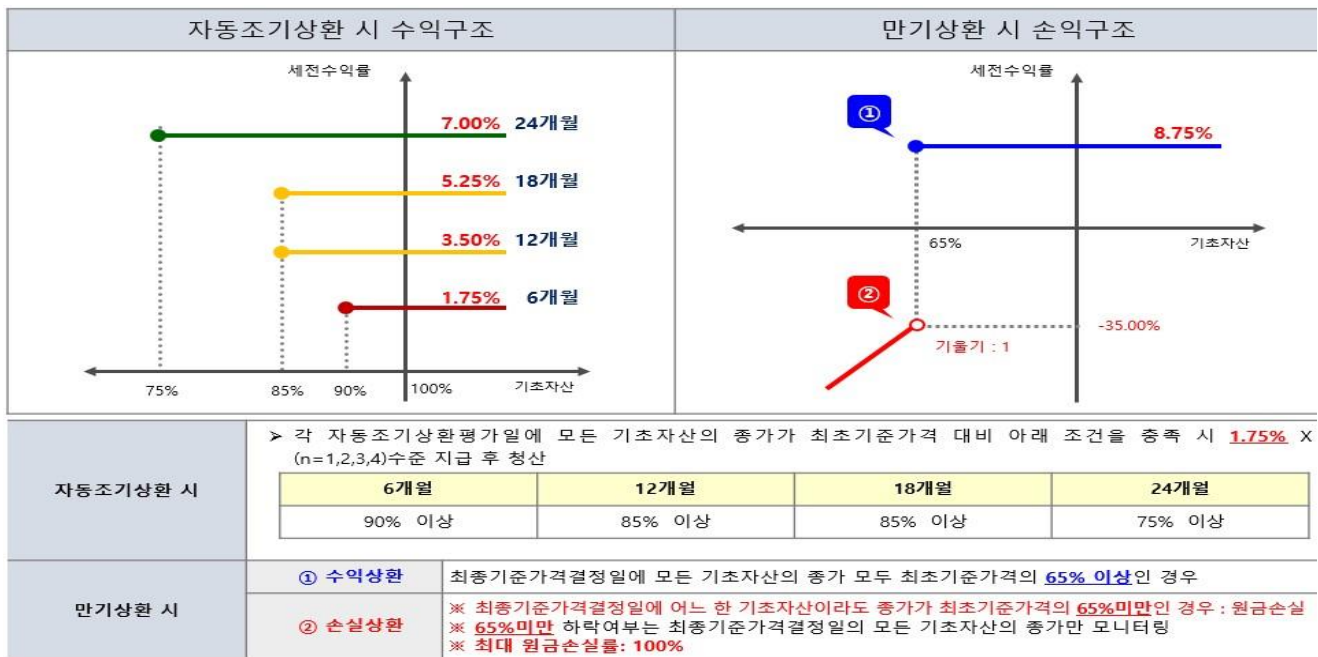
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

	<b>24</b>
--	-----------

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

	<b>46</b>
--	-----------

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

기준일 : 2023-07-12

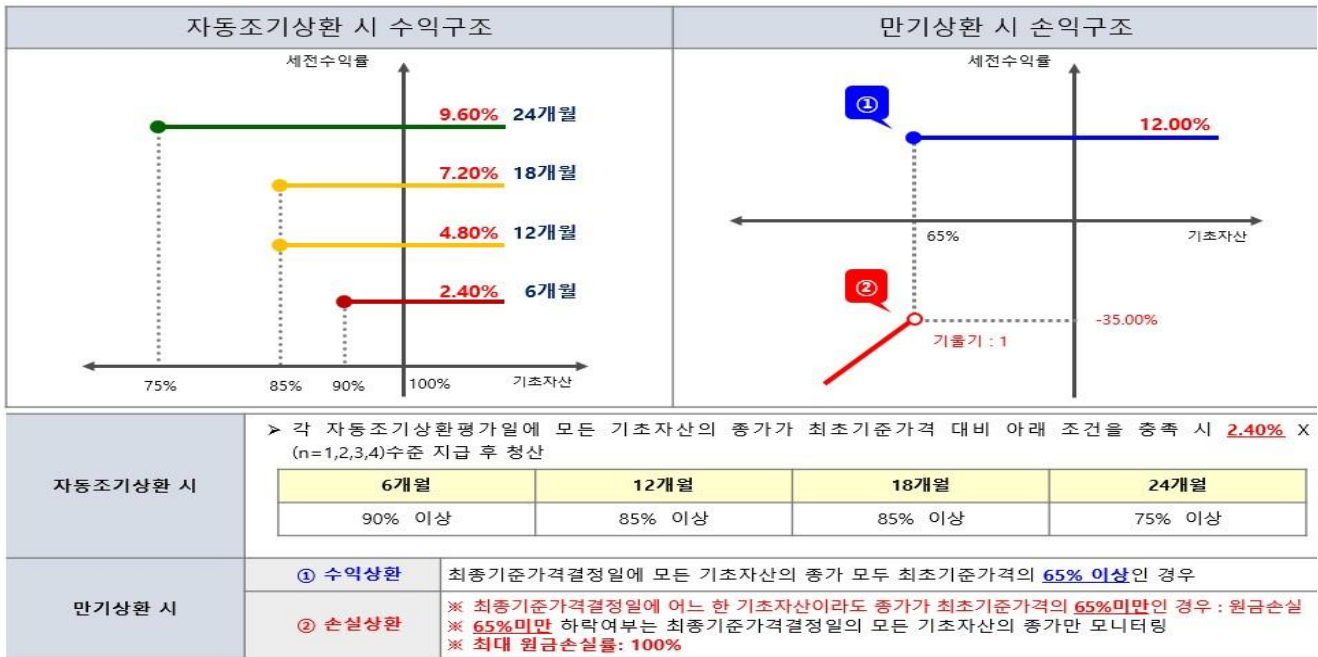
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

110

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

231

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

기준일 : 2023-07-12

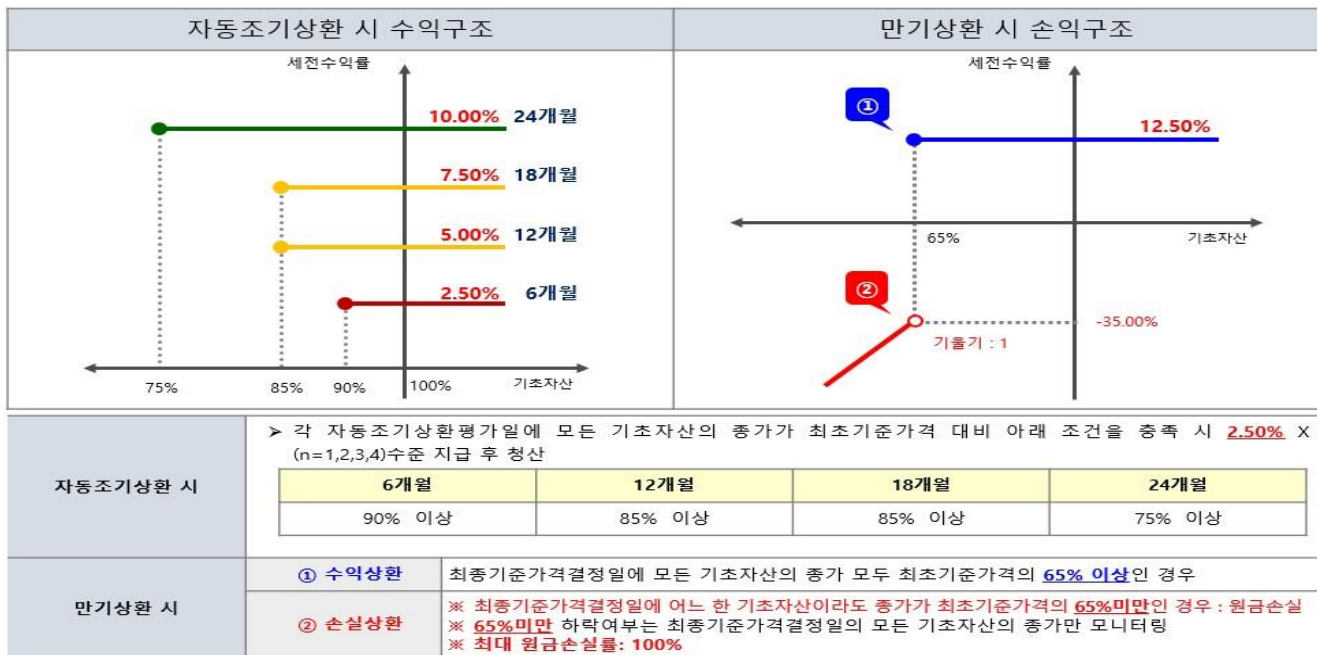
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	947		947	장외
합계			947		947	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

77

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

144

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

기준일 : 2023-07-12

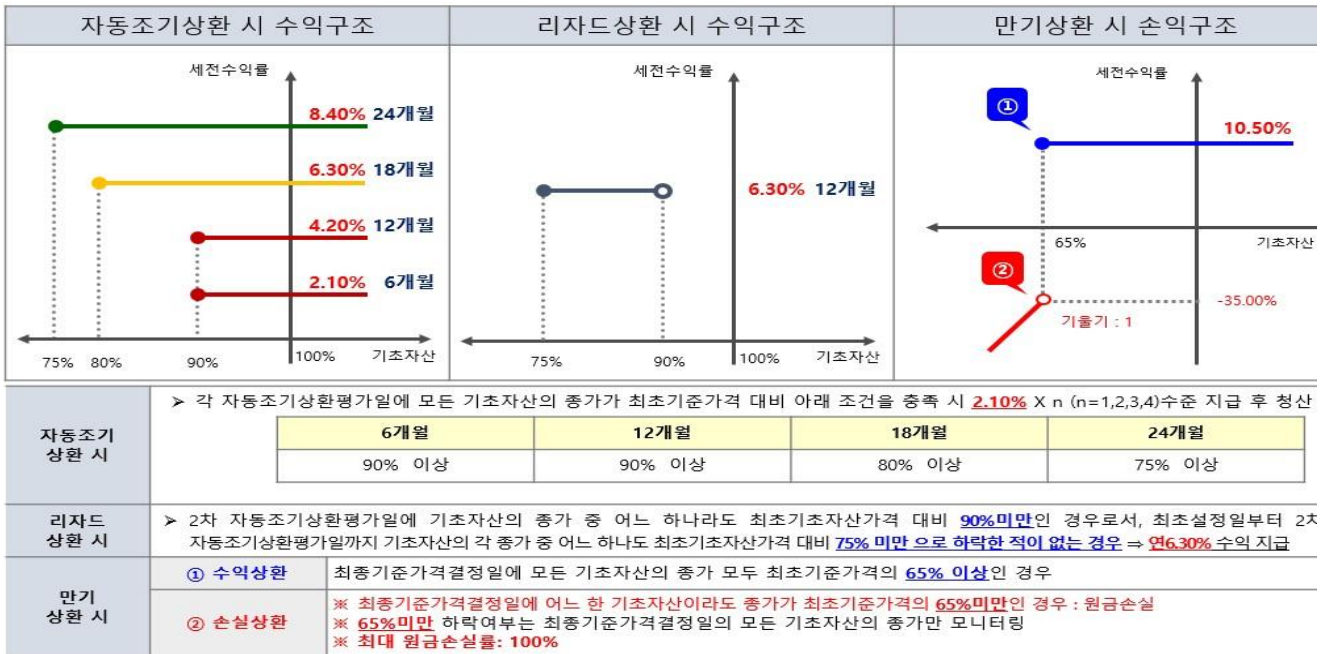
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	194		194	장외
합계			194		194	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

20

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2023-07-12

공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,017		1,017	장외
합계			1,017		1,017	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

102

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

174

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

기준일 : 2023-07-12

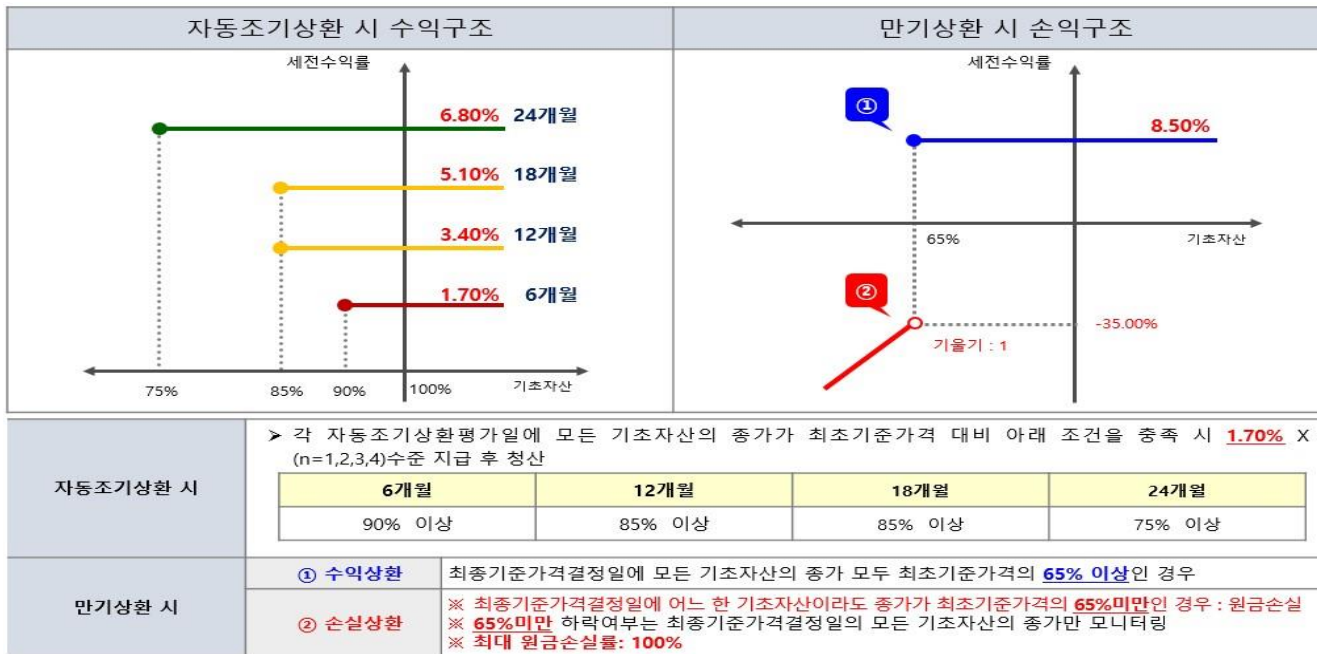
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	968		968	장외
합계			968		968	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

93

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

147

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

기준일 : 2023-07-12

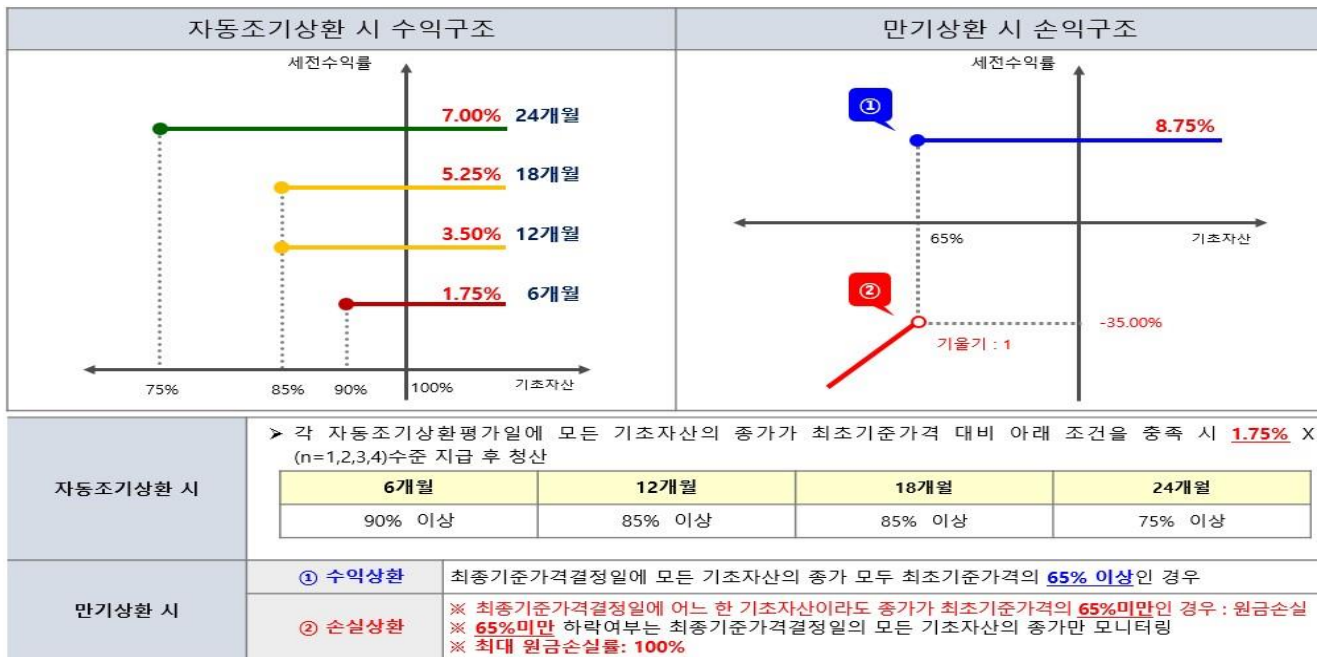
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

293

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

469

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

기준일 : 2023-07-12

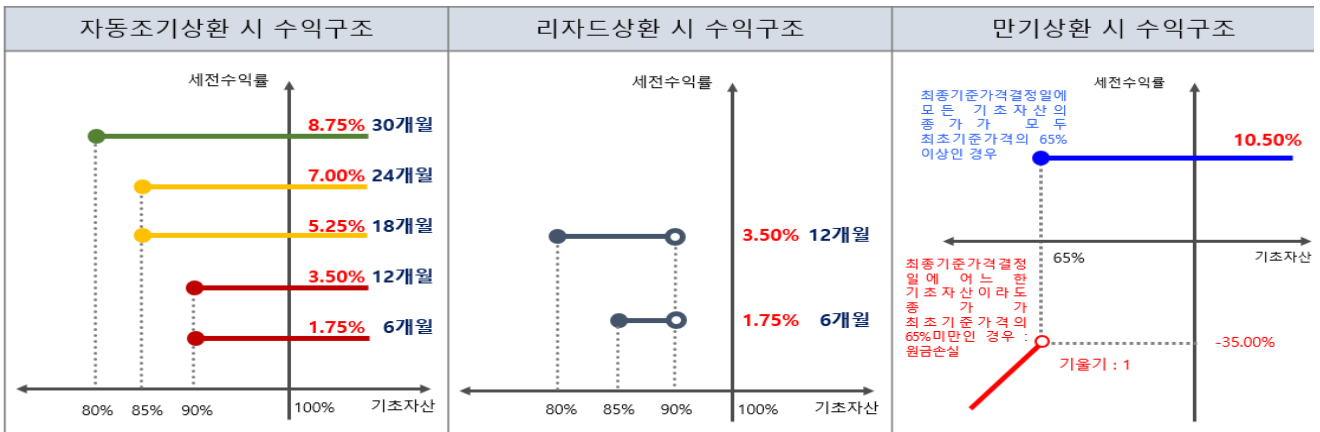
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

136

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3

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

기준일 : 2023-07-12

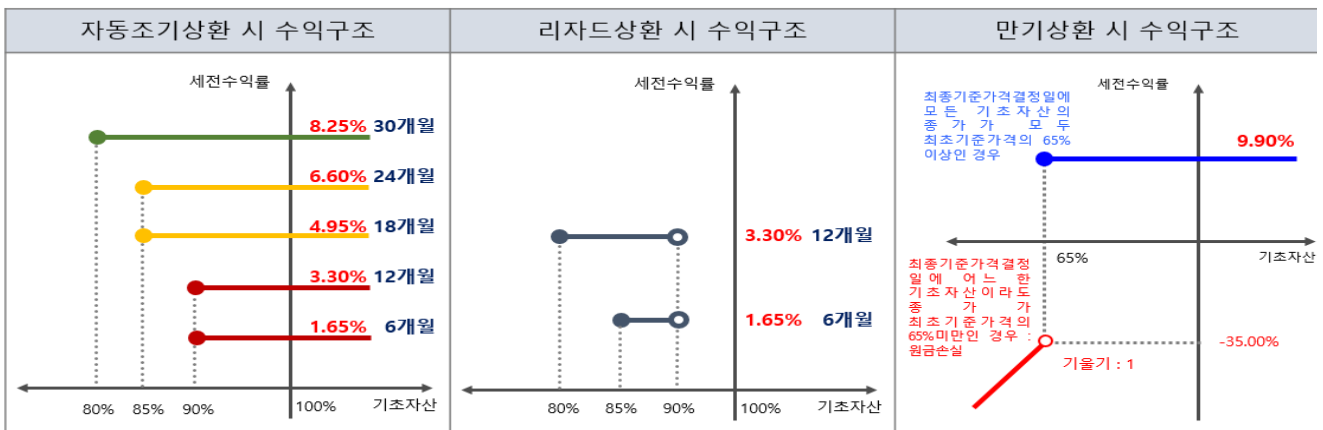
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	450		450	장외
합계			450		450	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

33

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1

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

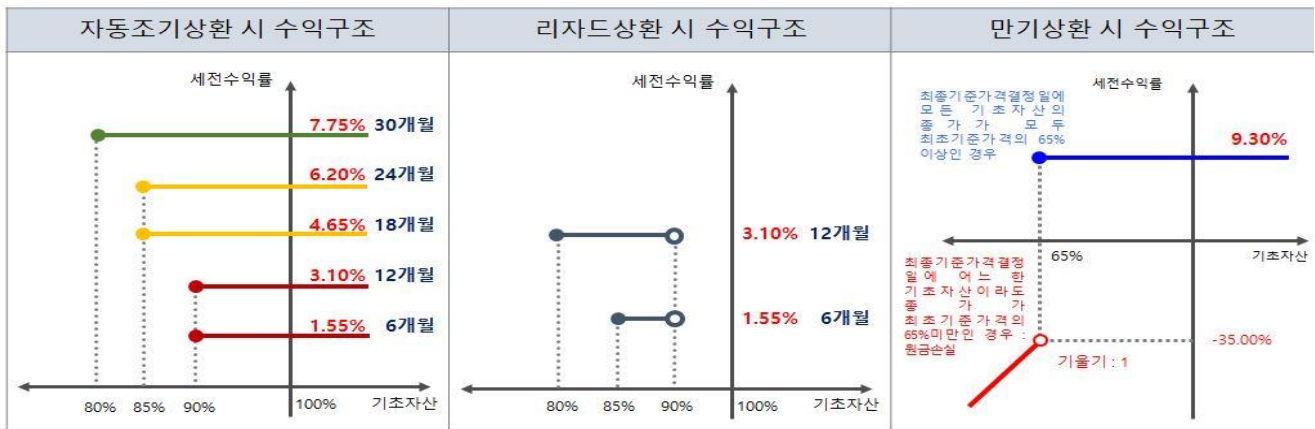
기준일 : 2023-07-12      공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.55%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.10%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.10%</b> 수익지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

54

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2023-07-12

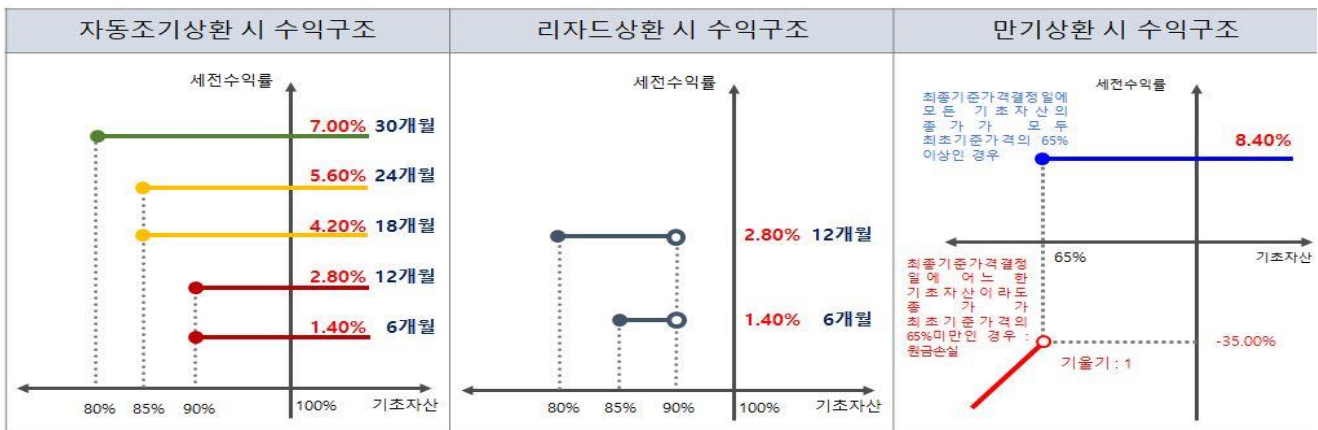
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.40%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 2.80%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기준가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기준가격 대비 <b>80%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 2.80%</b> 수익지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2023-07-12

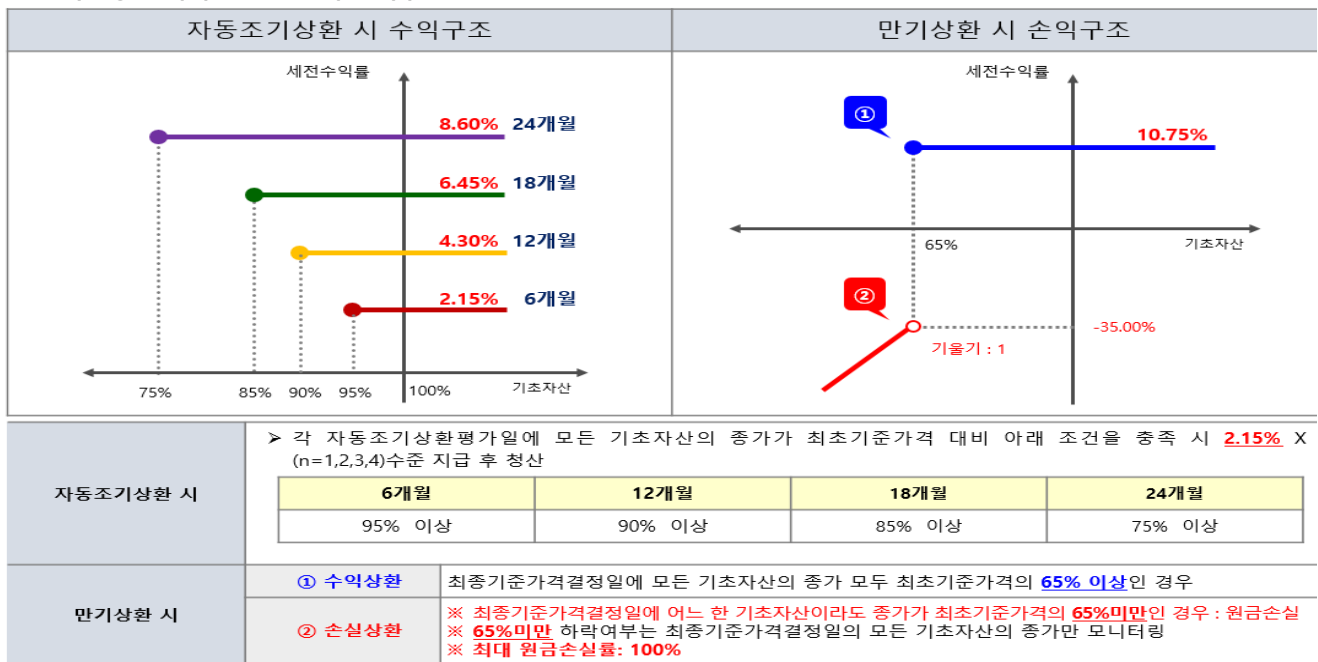
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

37

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

65

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

기준일 : 2023-07-12

공시일:

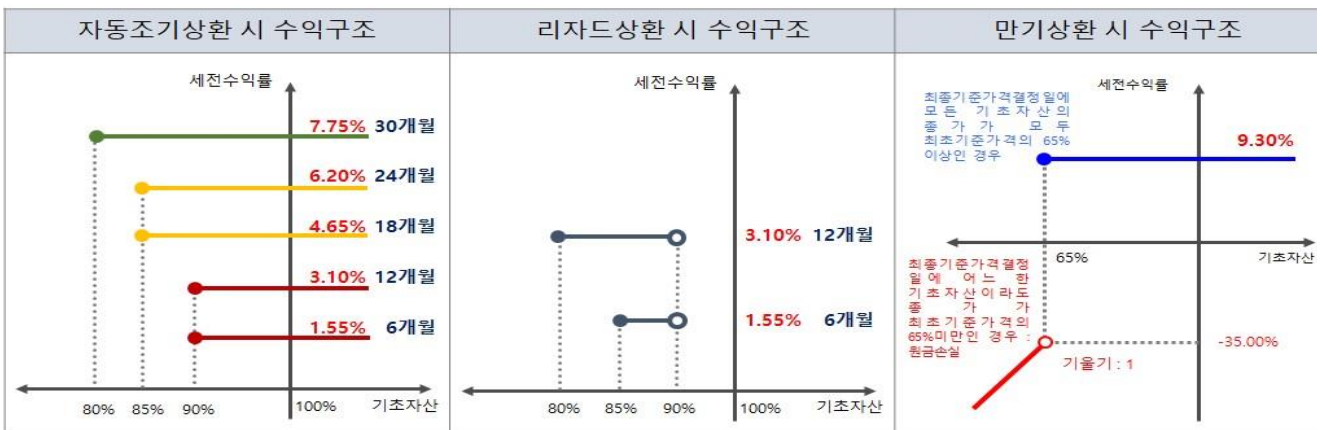
2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.55% X n</b> (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.10%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.10%</b> 수익지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

38

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

기준일 : 2023-07-12

공시일:

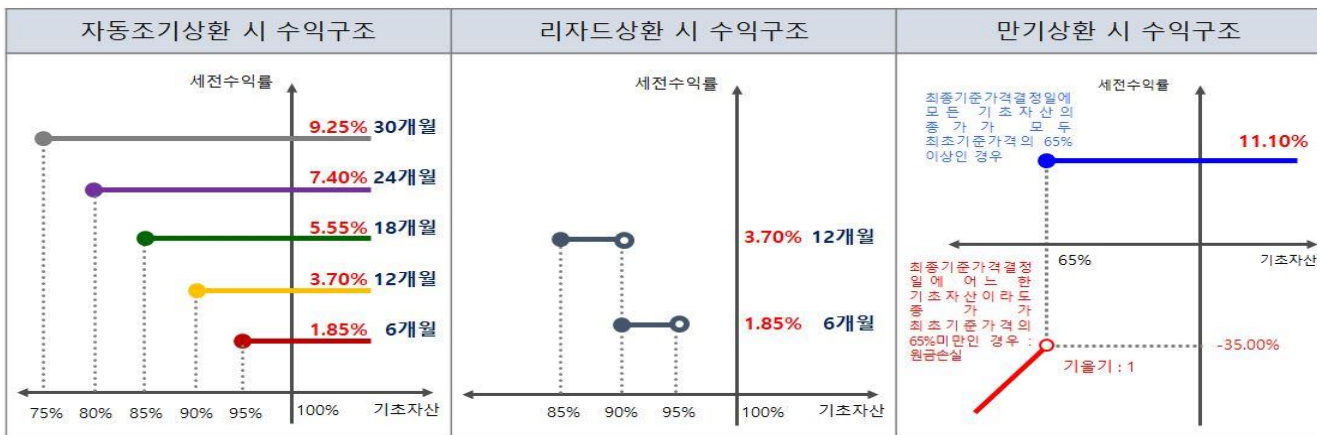
2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.85%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.70%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.70%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

147

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

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

기준일 : 2023-07-12

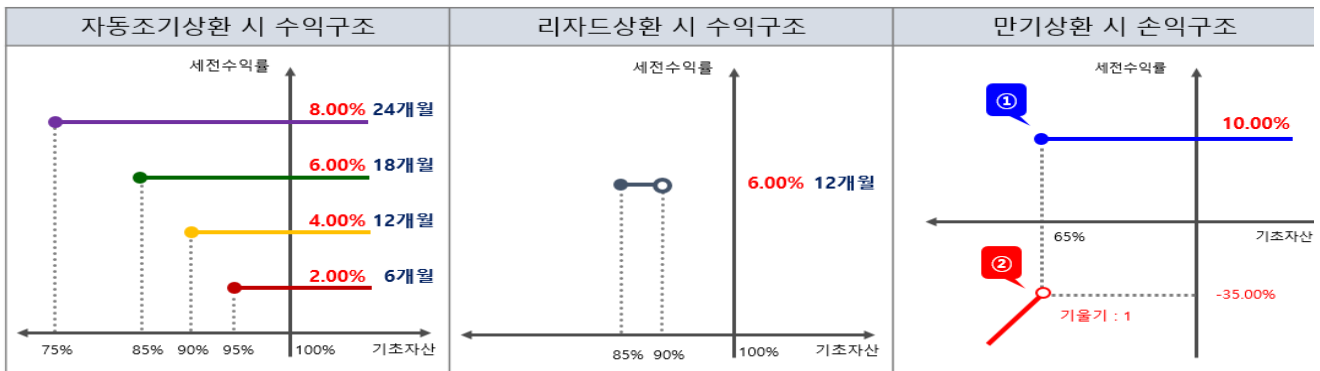
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 2.00% X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산			
	6개월	12개월	18개월	24개월
	95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상
리자드상환 시	> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 6.00% 수익 지급			
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우		
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

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

기준일 : 2023-07-12

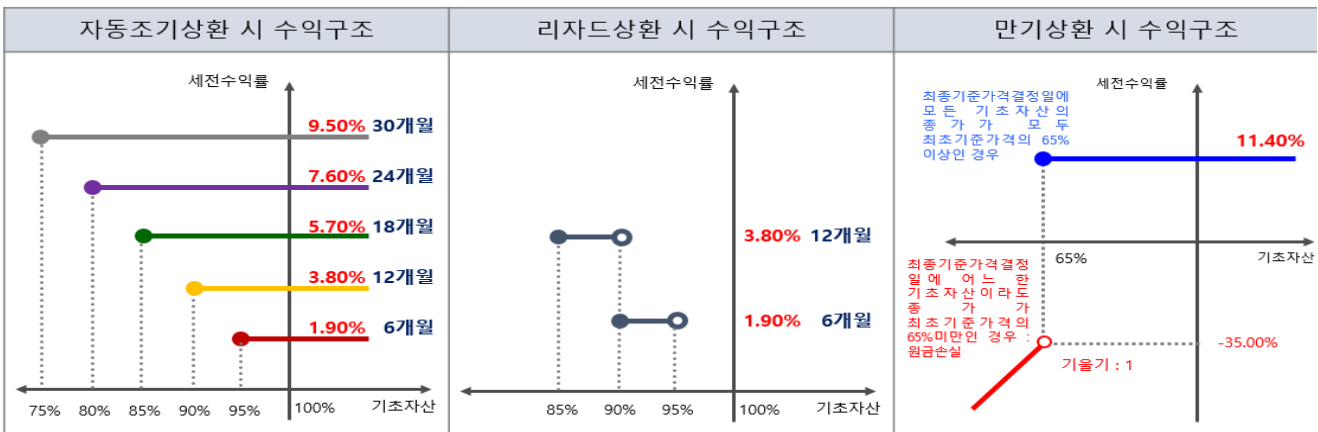
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.90%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.80%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 3.80%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

160

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3

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

기준일 : 2023-07-12

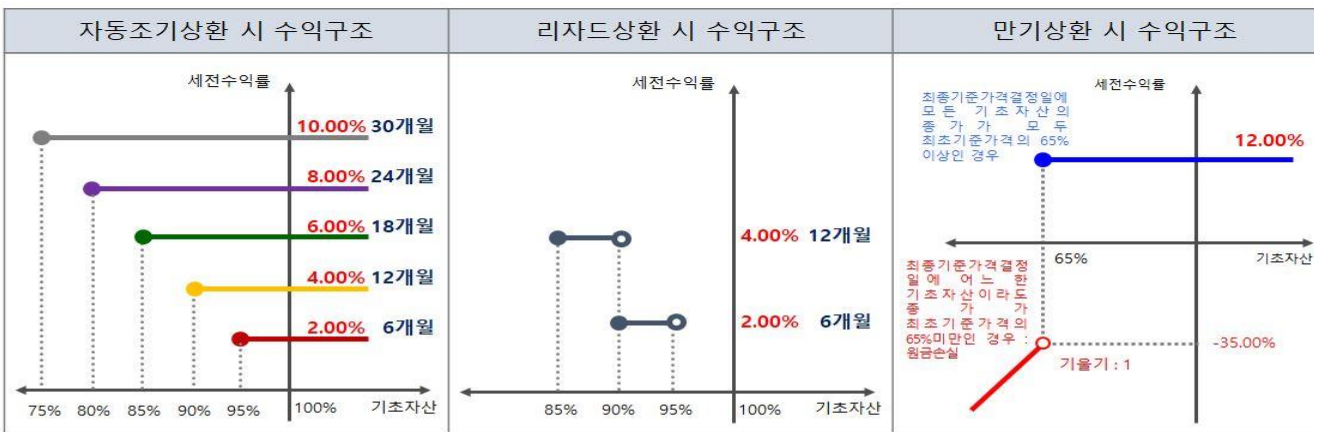
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> <math>2.00\% \times n</math> (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 4.00% 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 <math>\Rightarrow</math> 연 4.00% 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li><b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li><b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

288

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

10

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

기준일 : 2023-07-12

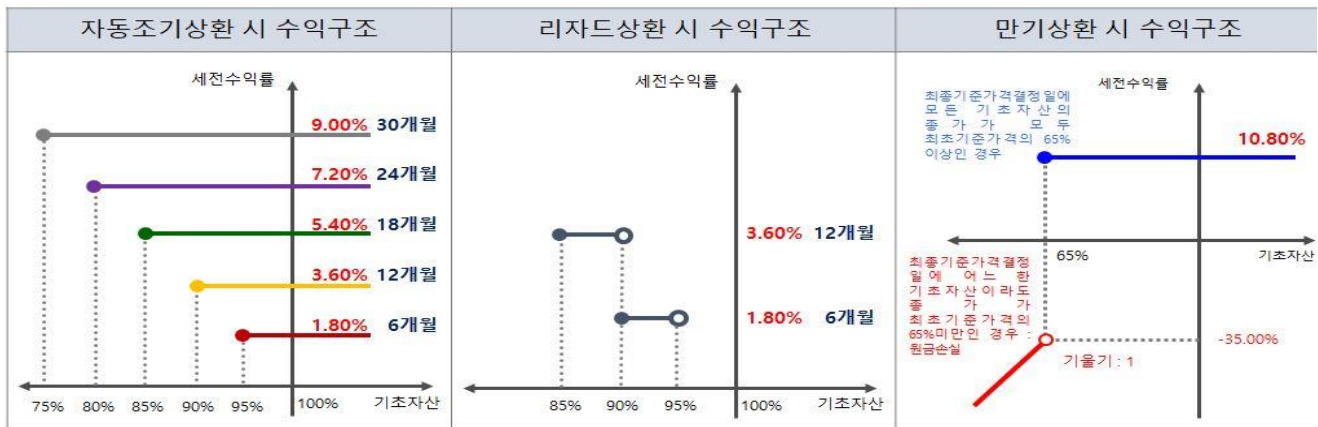
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>1.80% X n</b> (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.60%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 3.60%</b> 수익지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

98

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5

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

기준일 : 2023-07-12

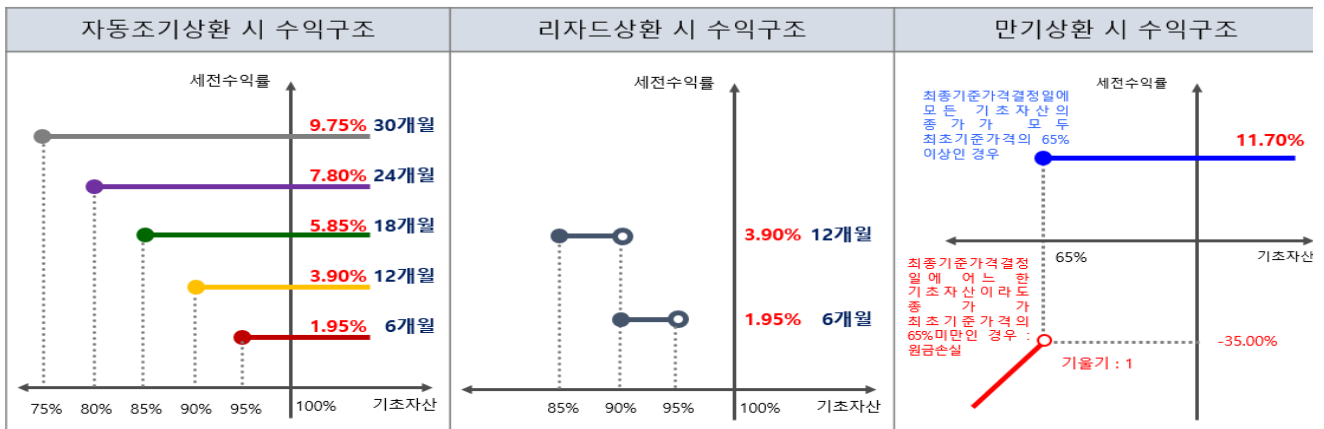
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

160

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8

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

기준일 : 2023-07-12

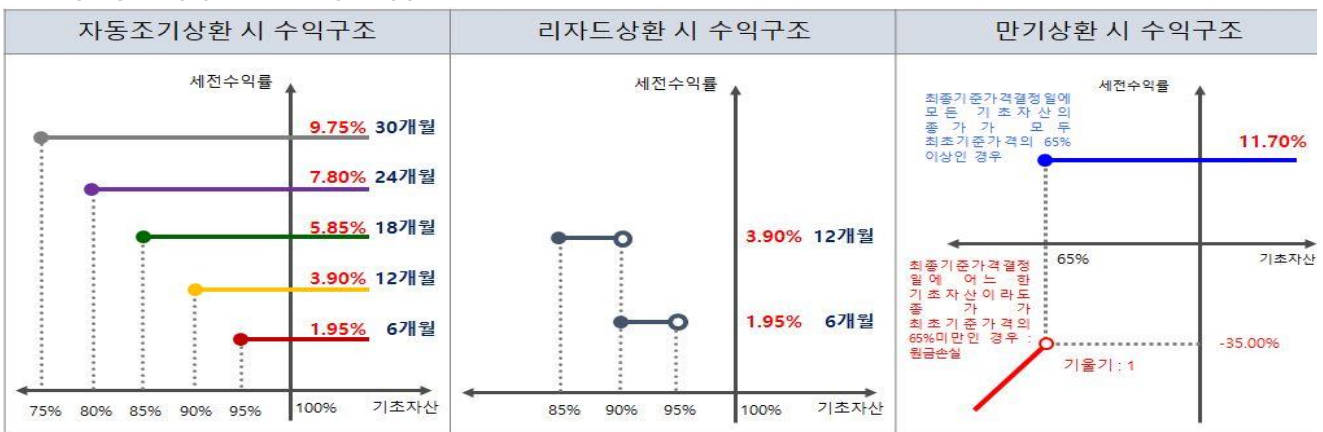
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

199

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

10

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

기준일 : 2023-07-12

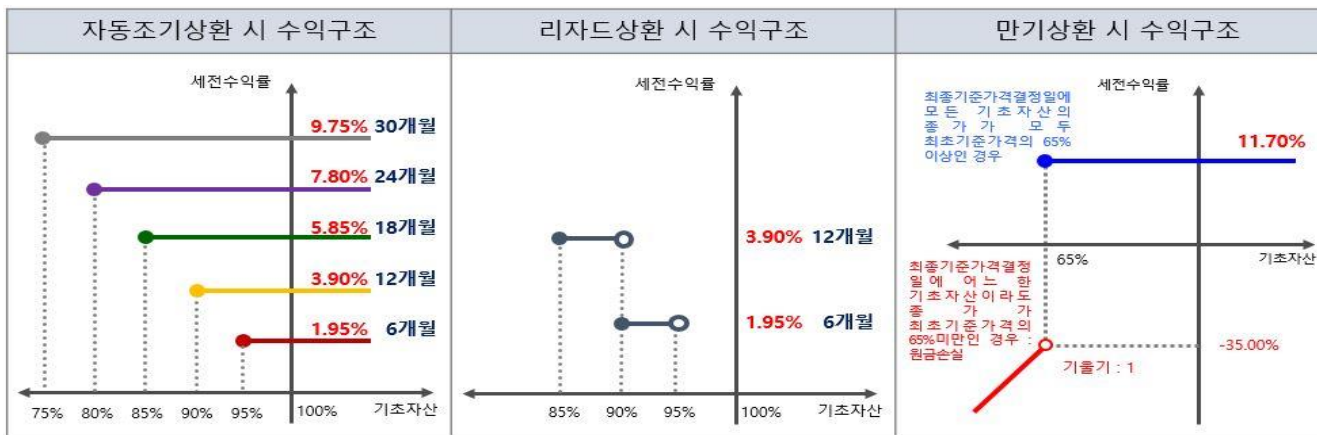
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

304

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15

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

기준일 : 2023-07-12

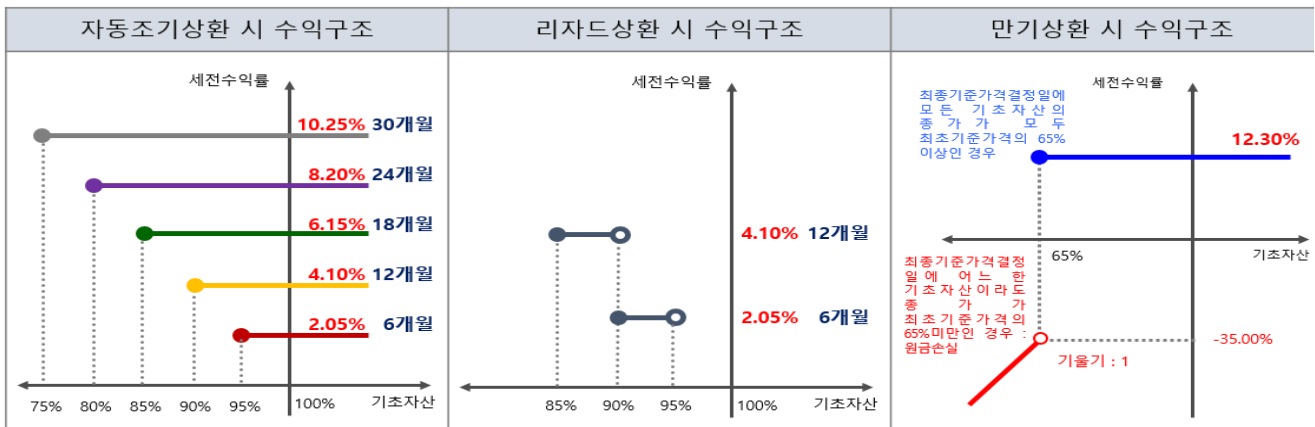
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

125

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

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

기준일 : 2023-07-12

공시일:

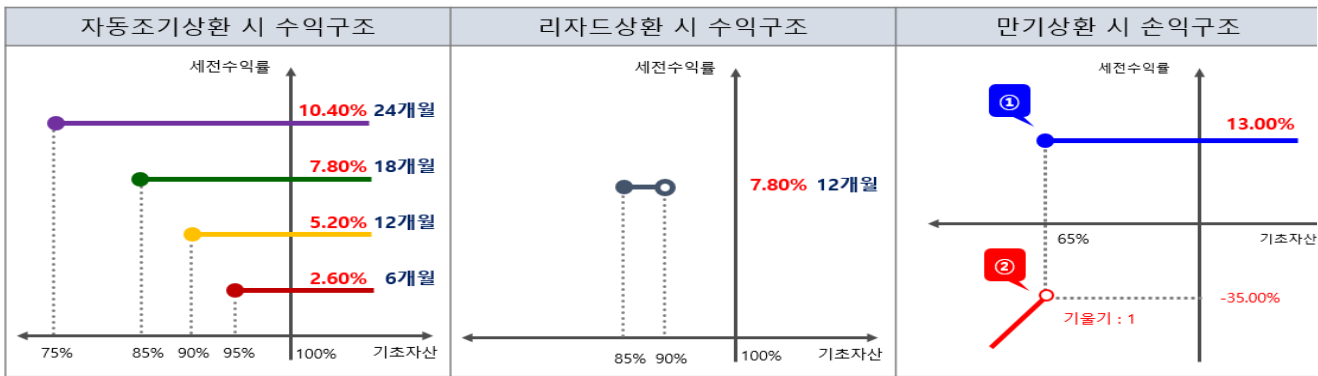
2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 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
리자드상환 시	> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 90%미만인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 → 연 7.80% 수익 지급			
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 65% 이상인 경우		
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 65%미만인 경우 : 원금손실 ※ 65%미만 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ 최대 원금손실률: 100%		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

15

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

기준일 : 2023-07-12

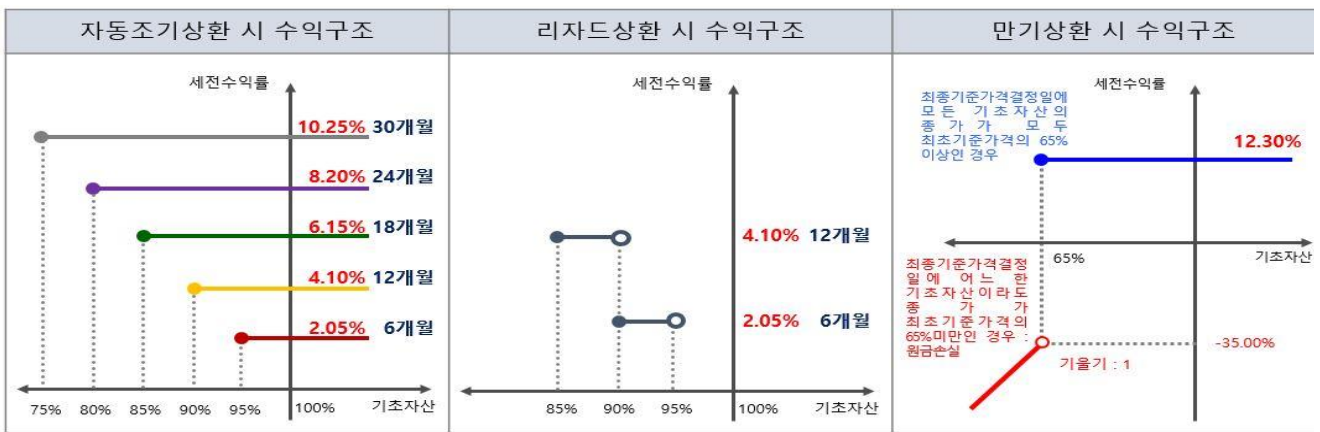
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

176

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9

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

기준일 : 2023-07-12

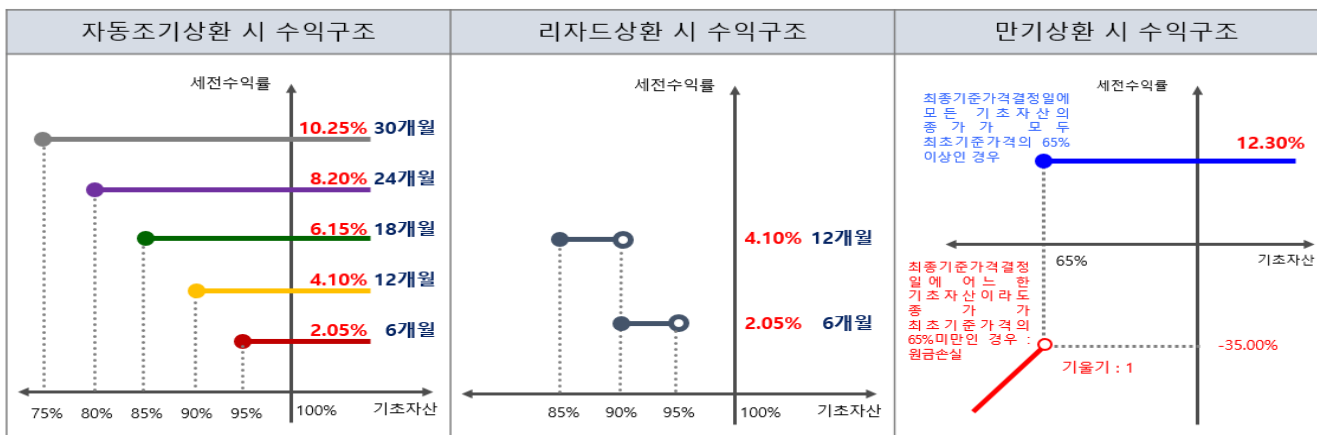
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



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

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

203

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

11

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

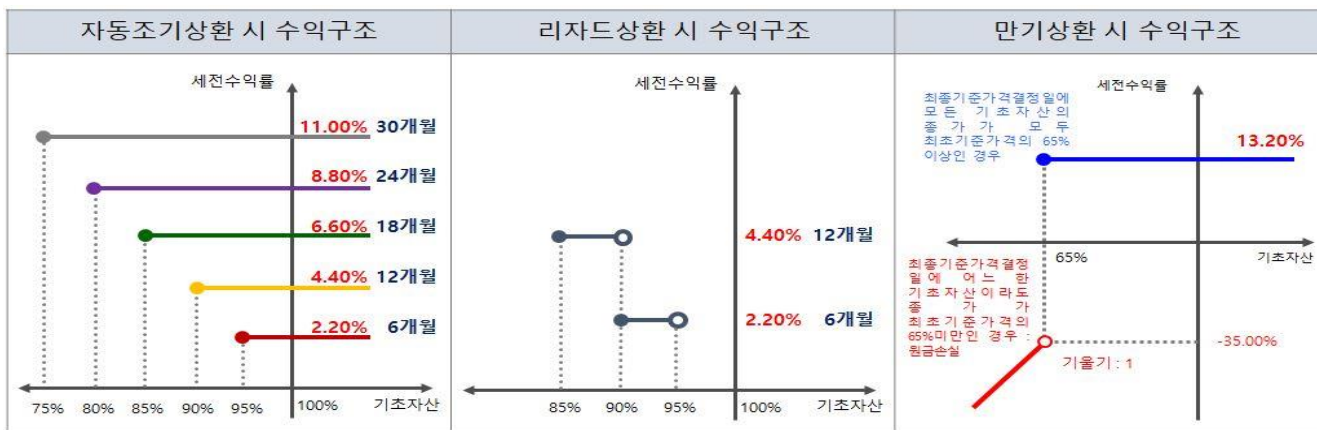
기준일 : 2023-07-12      공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.20%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.40%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 4.40%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

308

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

17

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

기준일 : 2023-07-12

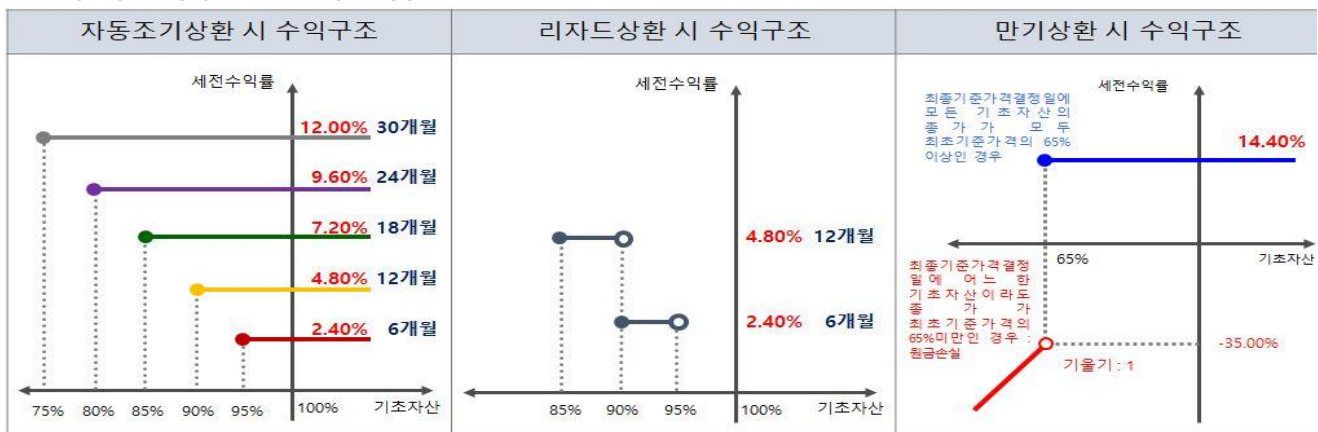
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80%, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.40%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.80%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 4.80%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

211

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

11

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

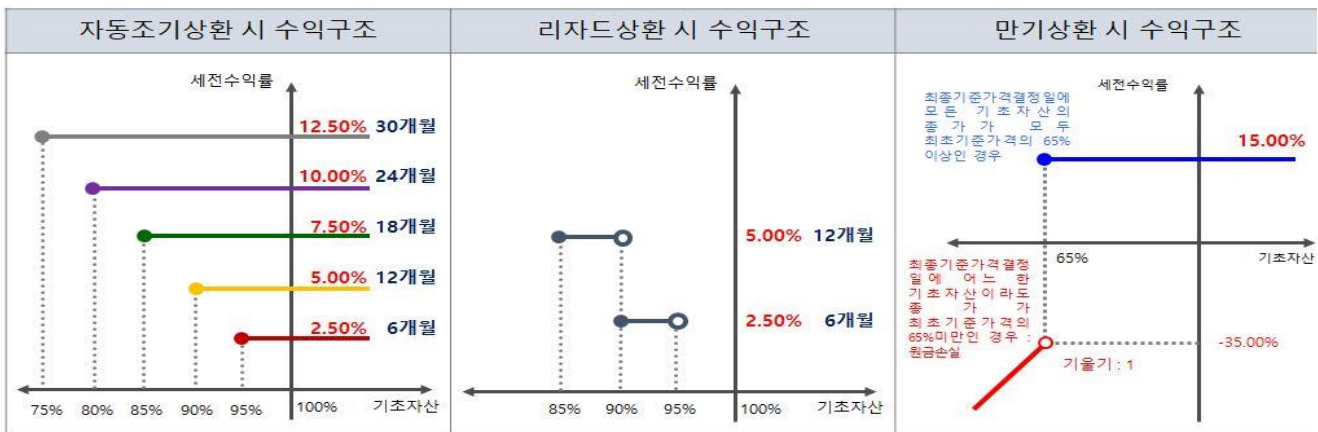
기준일 : 2023-07-12      공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.50% X n</b> (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 1 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 2 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.00%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

101

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-23호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-07-12

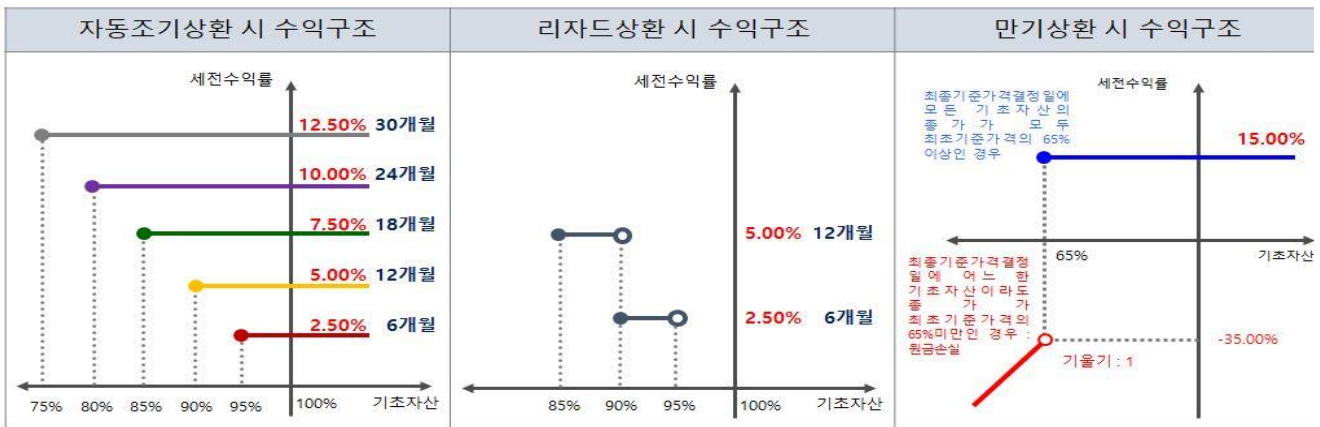
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 80, 30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.50%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 5.00%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.00%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

30

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

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

기준일 : 2023-07-12

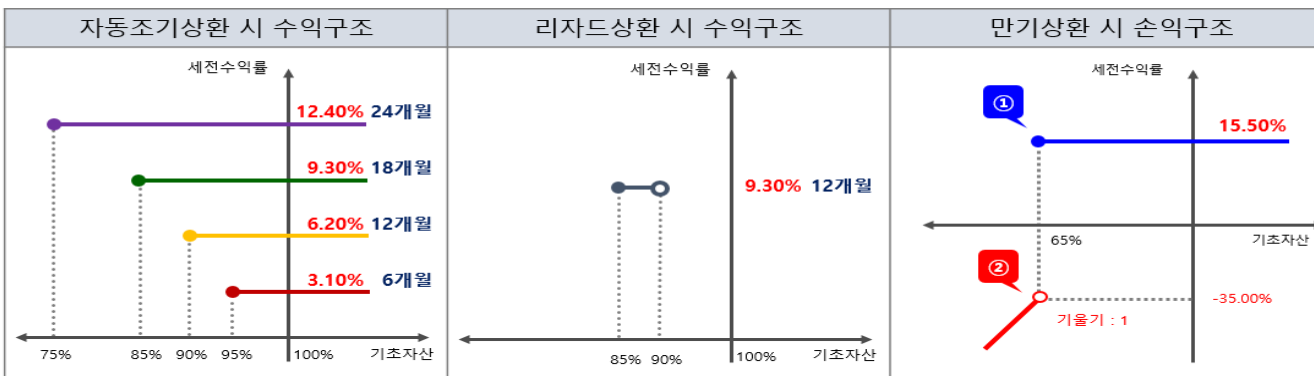
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	> 각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 최초기준가격 대비 아래 조건을 충족 시 <b>3.10%</b> X n (n=1,2,3,4)수준 지급 후 청산			
	<b>6개월</b>	<b>12개월</b>	<b>18개월</b>	<b>24개월</b>
	95% 이상	90% 이상	85% 이상	75% 이상
리자드상환 시	> 2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b> 인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만으로 하락한 적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 9.30%</b> 수익 지급			
만기상환 시	① 수익상환	최종기준가격결정일에 모든 기초자산의 증가 모두 최초기준가격의 <b>65% 이상</b> 인 경우		
	② 손실상환	※ 최종기준가격결정일에 어느 한 기초자산이라도 증가가 최초기준가격의 <b>65%미만</b> 인 경우 : 원금손실 ※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링 ※ <b>최대 원금손실률: 100%</b>		

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

80

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

65

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-32호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-07-12

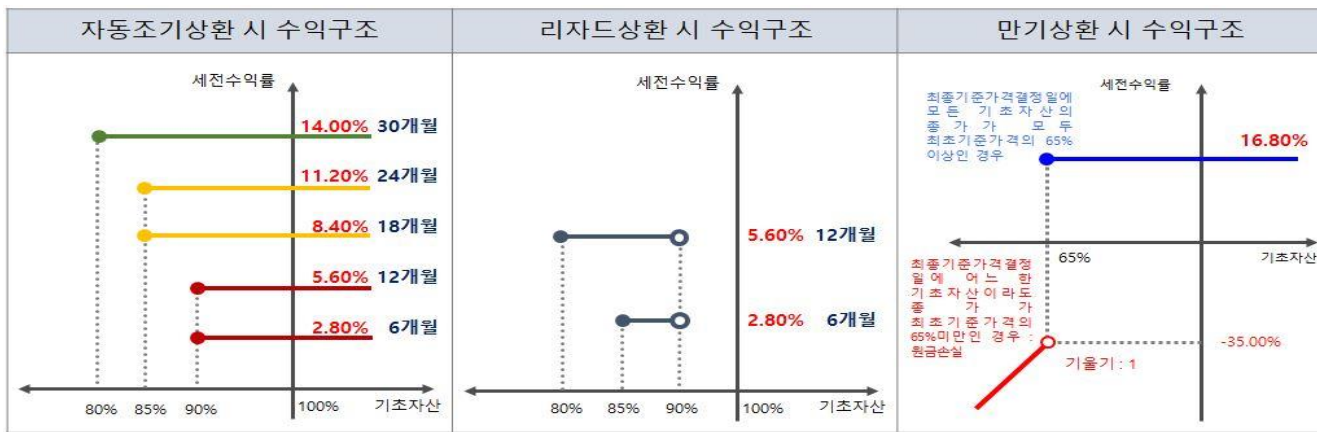
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85, 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.80%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만으로 하락한적이 없는 경우</b> ⇒ <b>연 5.60%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만인</b> 경우로서, 최초설정일부터 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 5.60%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

150

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-34호[ELS-파생형]

기준일 : 2023-07-12

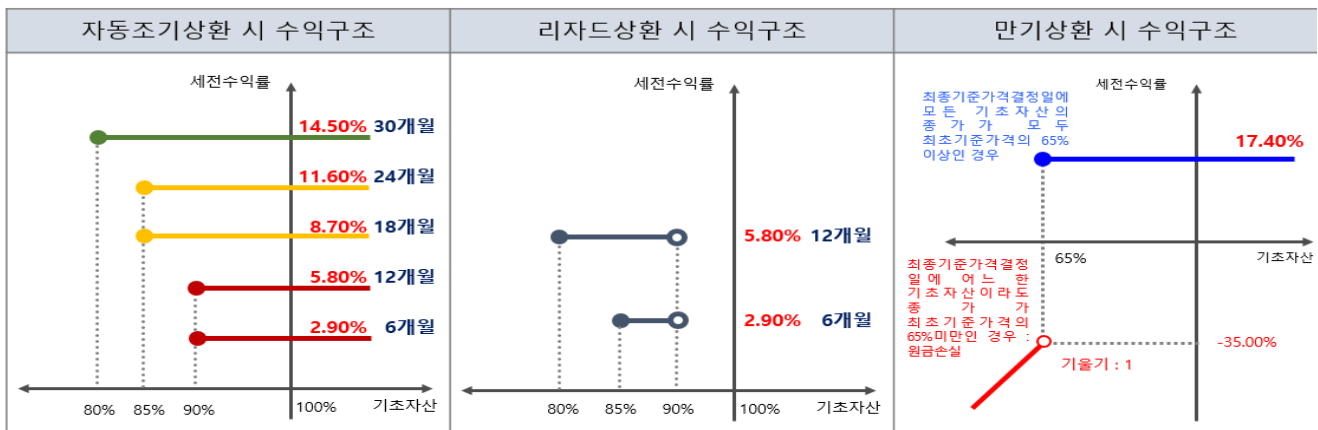
공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 90%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85% 30개월 80% 이상인 경우</b> ⇒ <b>2.90%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>5.80%</b> 수익 지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2: 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>80% 미만</b>으로 하락한 적이 없는 경우 ⇒ 연 <b>5.80%</b> 수익 지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

78

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

# 펀드명 : BNK더블리자드지수연계증권KSE-35호[ELS-파생형]

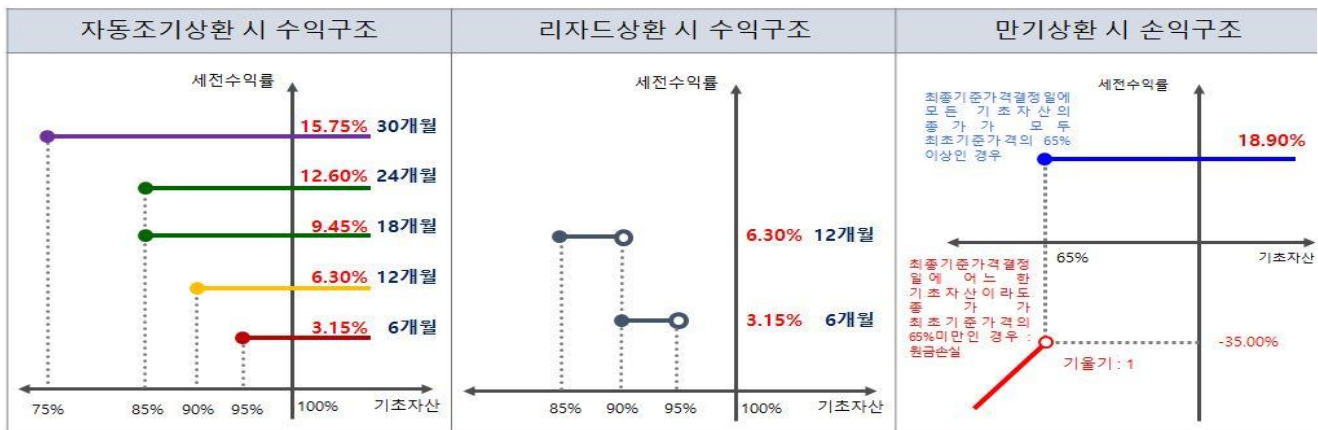
기준일 : 2023-07-12      공시일: 2023-07-13

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

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

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



자동조기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>각 자동조기상환평가일에 모든 기초자산의 증가가 모두 최초기준가격의 <b>6개월 95%, 12개월 90%, 18개월 85%, 24개월 85%</b> <b>30개월 75% 이상인 경우</b> ⇒ <b>3.15%</b> X n (n=1,2,3,4,5)수준 지급 후 청산</li> </ul>
리자드상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>1차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>95%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 1차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.30%</b> 수익지급</li> <li>2차 자동조기상환평가일에 기초자산의 증가 중 어느 하나라도 최초기초자산가격 대비 <b>90%미만</b>인 경우로서, 최초설정일부터 2차 자동조기상환평가일까지 기초자산의 각 증가 중 어느 하나도 최초기초자산가격 대비 <b>85%미만</b>으로 하락한적이 없는 경우 ⇒ <b>연 6.30%</b> 수익지급</li> </ul>
만기상환 시	<ul style="list-style-type: none"> <li>※ <b>65%미만</b> 하락여부는 최종기준가격결정일의 모든 기초자산의 증가만 모니터링</li> <li>※ <b>최대 원금손실률: 100%</b></li> </ul>

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2