

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-08-02

공시일: 2024-08-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	548	183	365	장내
누계	주가지수	선물	2,100	0	2,100	장내
신규	유가증권	선물	17	9	8	장내
누계	유가증권	선물	1,337	143	1,194	장내
합계			3,437	143	3,294	

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

169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

240

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-08-02

공시일:

2024-08-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,096	18	1,077	장내
누계	주가지수	선물	23,225	0	23,225	장내
합계			23,225	0	23,225	

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

1,866

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,915

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2024-08-02

공시일:

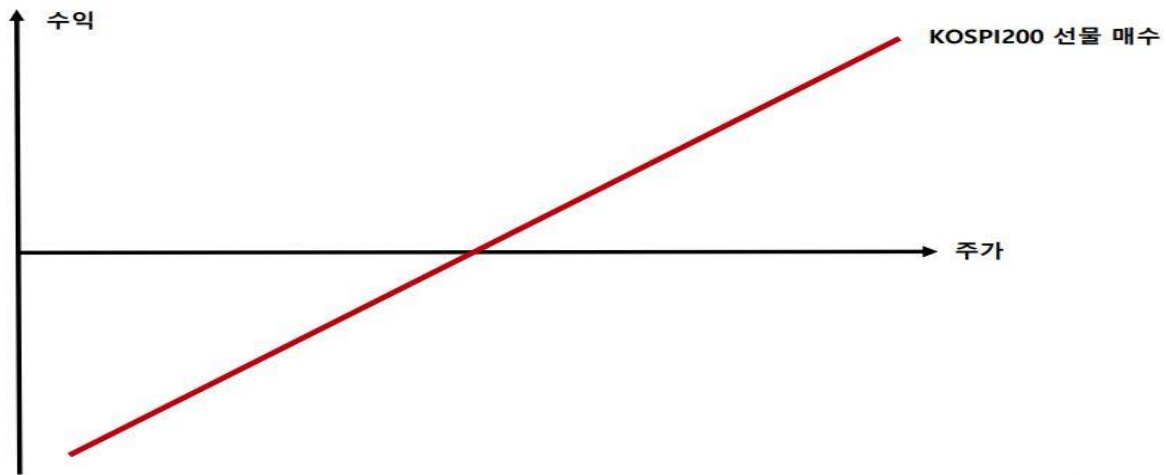
2024-08-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	365	274	91	장내
누계	주가지수	선물	548	0	548	장내
신규	유가증권	선물	431	346	85	장내
누계	유가증권	선물	2,751	529	2,222	장내
합계			3,299	529	2,769	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



위 그림은 투자자의 이해를 돕기 위하여 KOSPI200지수를 기초자산으로 하는 선물 매수 그림은 단순화하여 표시한 것입니다.
이 투자전략은 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

188

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

287