

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-12-26

공시일: 2025-12-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 590 | 1,180 | -590 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 5,901 | 0 | 5,901 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 117 | 585 | -468 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,483 | 429 | 3,054 | 장내 |
| 합계 | | | 9,384 | 429 | 8,955 | |

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 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

472

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,066

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-12-26

공시일: 2025-12-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 148 | 826 | -679 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 30,832 | 148 | 30,684 | 장내 |
| 합계 | | | 30,832 | 148 | 30,684 | |

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 펀드 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

2,454

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,264

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-12-26

공시일: 2025-12-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 738 | 738 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 6,048 | 0 | 6,048 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 117 | 1,053 | -936 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,419 | 0 | 7,419 | 장내 |
| 합계 | | | 13,468 | 0 | 13,468 | |

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

568

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,358