

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-02-13

공시일: 2026-02-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,851	2,851	0	장내
누계	주가지수	선물	7,942	0	7,942	장내
신규	유가증권	선물	906	181	725	장내
누계	유가증권	선물	8,853	435	8,418	장내
합계			16,795	435	16,360	

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

635

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,398

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-02-13

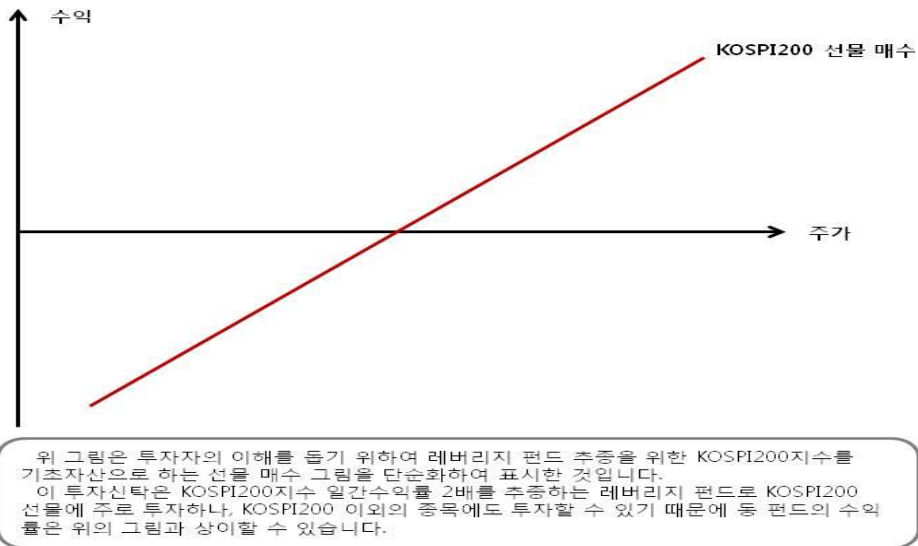
공시일: 2026-02-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	652	0	652	장내
누계	주가지수	선물	41,218	0	41,218	장내
합계			41,218	0	41,218	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,295

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,972

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-02-13

공시일: 2026-02-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,851	2,851	0	장내
누계	주가지수	선물	4,684	0	4,684	장내
신규	유가증권	선물	544	181	362	장내
누계	유가증권	선물	9,162	0	9,162	장내
합계			13,846	0	13,846	

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

705

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,748