

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-03-26

공시일: 2026-03-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	6,471	11,729	-5,258	장내
누계	주가지수	선물	10,313	0	10,313	장내
신규	유가증권	선물	1,666	360	1,305	장내
누계	유가증권	선물	8,909	354	8,555	장내
합계			19,222	354	18,869	

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

826

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,170

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-03-26

공시일:

2026-03-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	849	-849	장내
누계	주가지수	선물	44,691	121	44,570	장내
합계			44,691	121	44,570	

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

3,571

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7,230

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-03-26

공시일: 2026-03-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	607	202	404	장내
누계	주가지수	선물	9,504	0	9,504	장내
신규	유가증권	선물	180	360	-180	장내
누계	유가증권	선물	6,026	0	6,026	장내
합계			15,530	0	15,530	

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

762

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,070