

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-04-06

공시일: 2026-04-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 812    | 406   | 406       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 6,901  | 0     | 6,901     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 919    | 1,304 | -385      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,347  | 339   | 9,008     | 장내 |
| 합계 |      |      | 16,247 | 339   | 15,909    |    |

## 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

552

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,963

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-04-06

공시일:

2026-04-07

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 447    | 0     | 447       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 44,489 | 0     | 44,489    | 장내 |
| 합계 |      |      | 44,489 | 0     | 44,489    |    |

## 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

3,561

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7,622

## 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-04-06

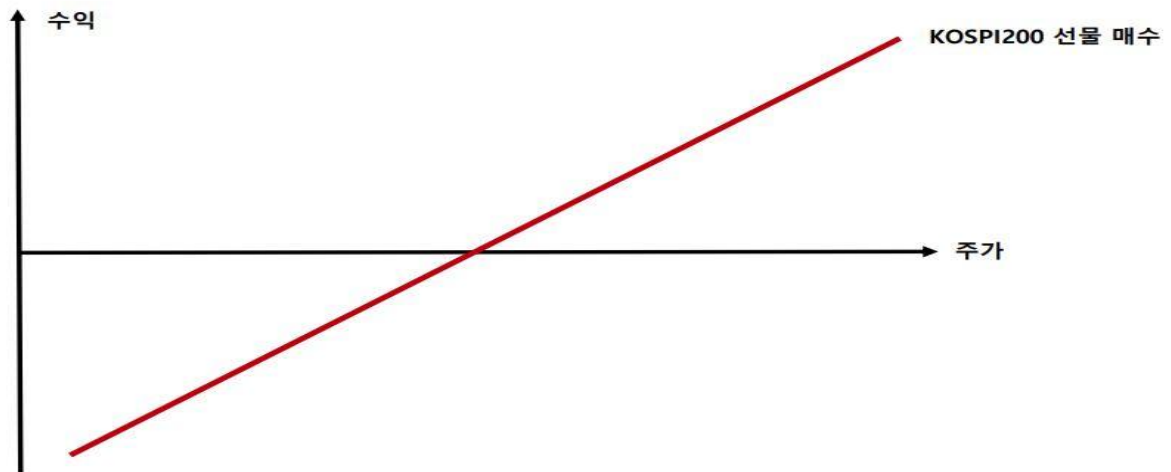
공시일: 2026-04-07

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 406    | 203   | 203       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 5,886  | 0     | 5,886     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 2,440  | 2,440 | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,468  | 0     | 5,468     | 장내 |
| 합계 |      |      | 11,354 | 0     | 11,354    |    |

### 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

471

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,484