

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-04-15

공시일: 2026-04-16

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	10,083	4,583	5,500	장내
누계	주가지수	선물	8,708	0	8,708	장내
신규	유가증권	선물	633	844	-211	장내
누계	유가증권	선물	11,224	368	10,857	장내
합계			19,932	368	19,564	

## 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

703

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,727

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-04-15

공시일:

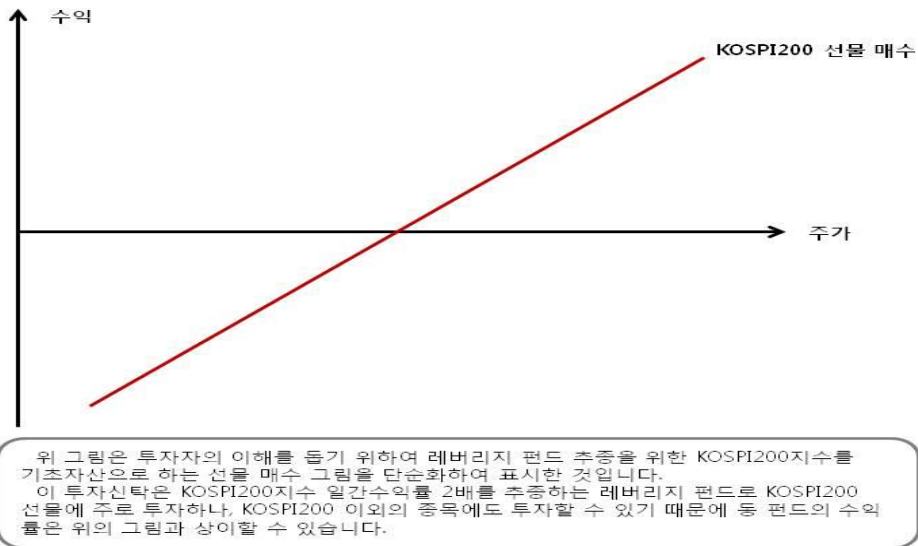
2026-04-16

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	458	0	458	장내
누계	주가지수	선물	47,022	0	47,022	장내
합계			47,022	0	47,022	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,795

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

8,242

## 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-04-15

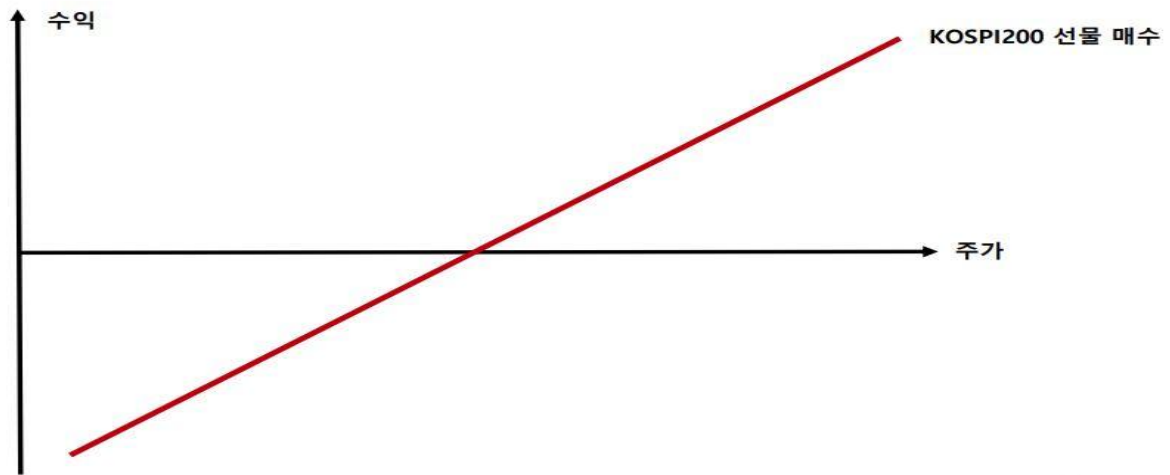
공시일: 2026-04-16

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	917	917	0	장내
누계	주가지수	선물	5,958	0	5,958	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,901	0	6,901	장내
합계			12,859	0	12,859	

### 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

483

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,945