

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-05-04

공시일: 2026-05-06

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,312	787	525	장내
누계	주가지수	선물	7,872	0	7,872	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,298	363	13,934	장내
합계			22,170	363	21,807	

## 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

849

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,256

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-05-04

공시일:

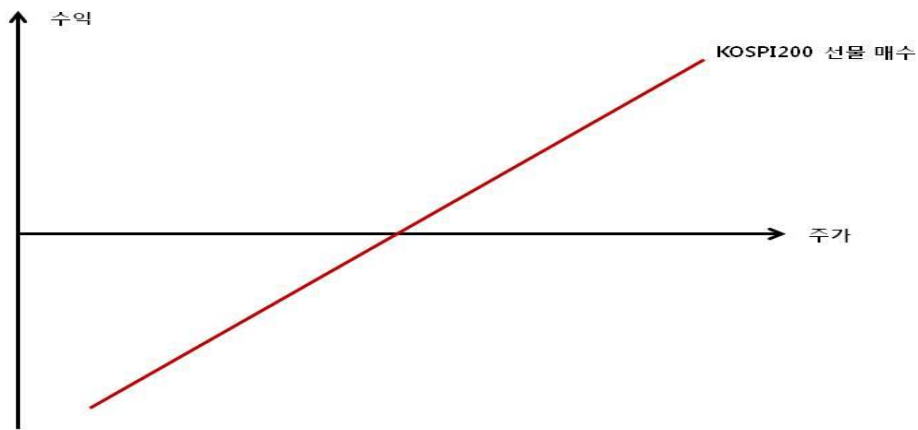
2026-05-06

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,572	0	2,572	장내
누계	주가지수	선물	54,740	0	54,740	장내
합계			54,740	0	54,740	

## 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 둘 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

4,383

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

9,359

# 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-05-04

공시일: 2026-05-06

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	262	262	0	장내
누계	주가지수	선물	6,298	0	6,298	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,133	0	9,133	장내
합계			15,431	0	15,431	

## 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

618

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,552