

펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-06-05

공시일: 2026-06-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	7,782	14,916	-7,134	장내
누계	주가지수	선물	13,294	0	13,294	장내
신규	유가증권	선물	1,157	828	329	장내
누계	유가증권	선물	17,281	320	16,961	장내
합계			30,575	320	30,255	

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

1,076

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,108

펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-06-05

공시일:

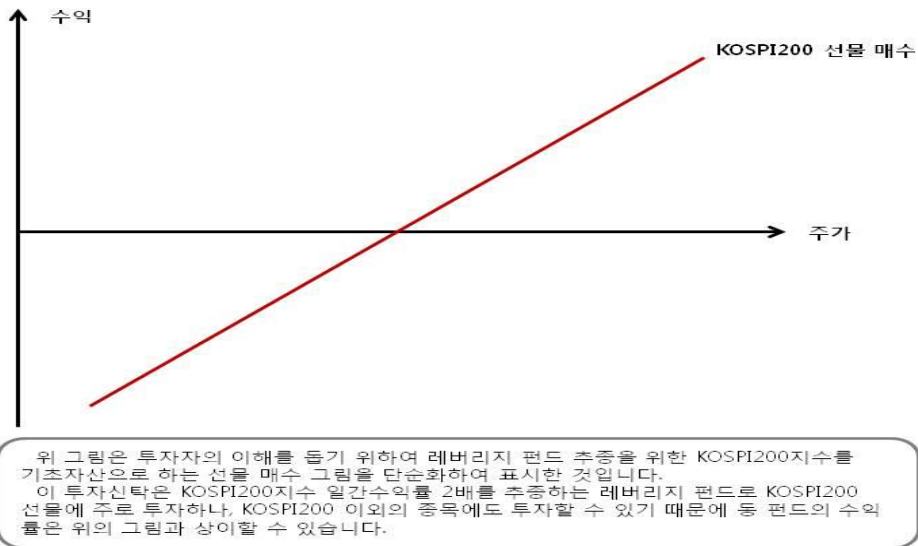
2026-06-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	65	2,270	-2,205	장내
누계	주가지수	선물	76,978	0	76,978	장내
합계			76,978	0	76,978	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,164

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

14,526

펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 :

2026-06-05

공시일:

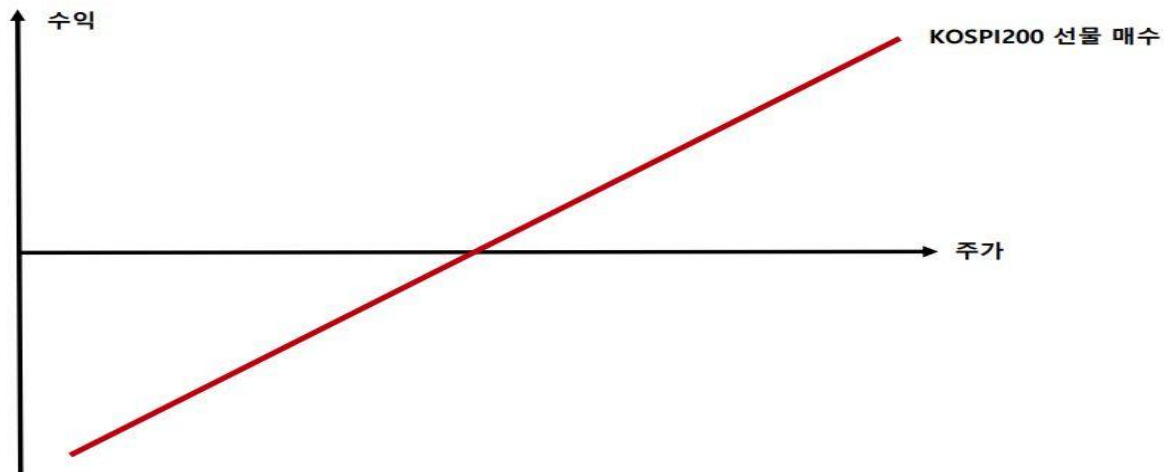
2026-06-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	6,485	5,837	649	장내
누계	주가지수	선물	20,104	0	20,104	장내
신규	유가증권	선물	1,656	1,656	0	장내
누계	유가증권	선물	11,666	0	11,666	장내
합계			31,770	0	31,770	

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

1,616

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

7,130