

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-07-07

공시일: 2026-07-08

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 3,677  | 1,838  | 1,838     | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 15,013 | 0      | 15,013    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 15,495 | 15,495 | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 19,561 | 301    | 19,260    | 장내 |
| 합계 |      |      | 34,574 | 301    | 34,273    |    |

## 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 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

1,223

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

8,023

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-07-07

공시일: 2026-07-08

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0      | 1,409 | -1,409    | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 67,406 | 184   | 67,223    | 장내 |
| 합계 |      |      | 67,406 | 184   | 67,223    |    |

## 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

5,474

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

15,080

# 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2026-07-07

공시일: 2026-07-08

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 1,226  | 1,226 | 0         | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 3,677  | 0     | 3,677     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 9,464  | 9,464 | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 10,436 | 0     | 10,436    | 장내 |
| 합계 |      |      | 14,113 | 0     | 14,113    |    |

## 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

676

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,297