

# 펀드명 : BNK K200인덱스증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-03-10

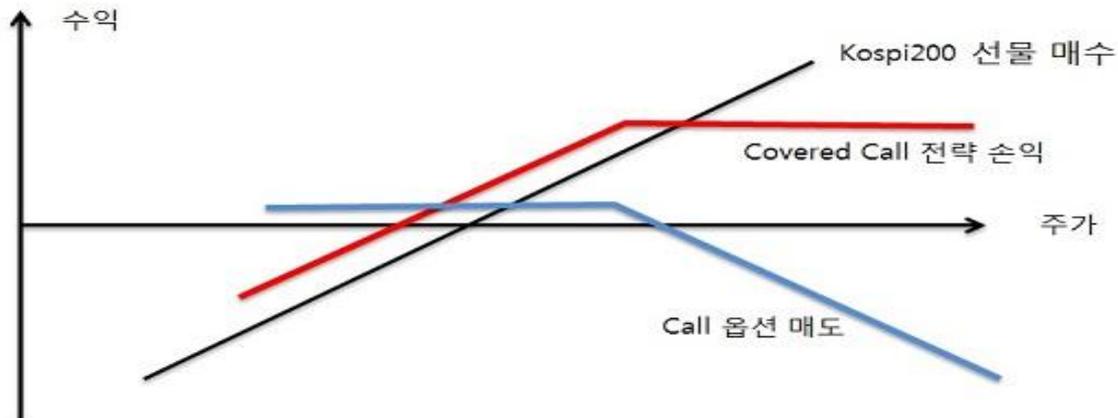
공시일: 2025-03-11

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,694	1,779	-85	장내
누계	주가지수	선물	2,033	0	2,033	장내
신규	유가증권	선물	40	18	21	장내
누계	유가증권	선물	1,024	0	1,024	장내
합계			3,057	0	3,057	

## 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

163

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

267

# 펀드명 : BNKK200지수2배레버리지증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-03-10

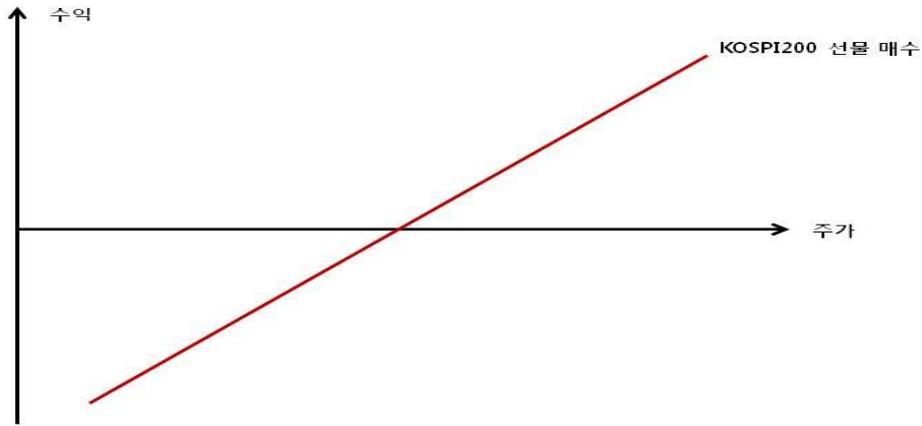
공시일: 2025-03-11

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	5,421	5,505	-85	장내
누계	주가지수	선물	24,732	0	24,732	장내
합계			24,732	0	24,732	

## 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 펀드로 KOSPI200 선물에 주로 투자하나, KOSPI200 이외의 종목에도 투자할 수 있기 때문에 등 펀드의 수익률은 위의 그림과 상이할 수 있습니다.

(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,981

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,410

# 펀드명 : BNK K200인덱스알파증권(주식-파생형)

기준일 : 2025-03-10

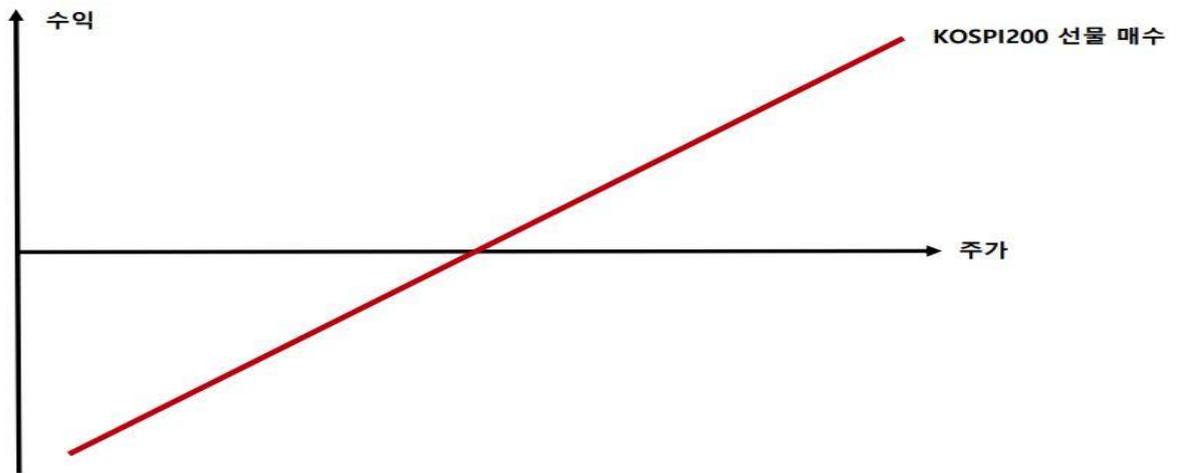
공시일: 2025-03-11

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	254	254	0	장내
누계	주가지수	선물	254	0	254	장내
신규	유가증권	선물	91	43	49	장내
누계	유가증권	선물	1,432	79	1,353	장내
합계			1,686	79	1,607	

## 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

44

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

186