

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1] 데리츠 블리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액트(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,925	0	5,925	장외

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

3) 만드정산결정주기: 매 6개월

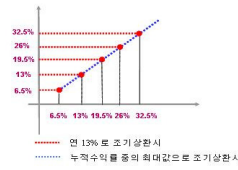
4) 기준지수: 2007년 4월 5일의 KOSPI200, NIKKEI225 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 초기 상환 설정일에 0% 이상인 경우 다음 금액으로 중도상환함.
 액면금액 X (100% + MAX [단: 13%, 특별수익률])
 (누적수익률은 기초자산의 액면 단위 관할되는 수익률의 단순합계, 특별수익률은 각 월별 누적수익률 중 최대값)

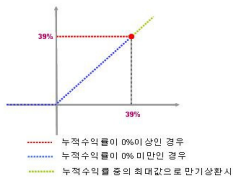
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 누적수익률])

6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR800680AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	0.02	-0.01	-0.04	-0.07	-0.10	-0.13	-0.16
	5.33%	0.10	0.07	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09
	2.67%	0.12	0.09	0.06	0.03	-0.00	-0.04	-0.07
	0%	0.09	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09
	-2.67%	0.02	-0.01	-0.05	-0.08	-0.11	-0.14	-0.17
	-5.33%	-0.11	-0.14	-0.17	-0.20	-0.23	-0.27	-0.30
	-8%	-0.29	-0.32	-0.35	-0.38	-0.41	-0.44	-0.47

최대손실 시나리오

위험액	-0.47
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.17
-----	------

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,000	0	1,000	잔액

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 7월 31일 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 우리금융지주 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -16%(2차 중도상환일), -22%(3차 중도상환일), -28%(4차 중도상환일), -34%(5차 중도상환일), -40%(만기상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률에 단순합계)

단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만드 해지
 만기 평가일의 누적수익률이 -50%이상 -40% 미만인 경우: 18.0%의 수익률로 상환
 만기 평가일의 누적수익률이 -50%미만인 경우: 액면금액 지급 (원금보장투주)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.11	0.08	0.05	0.02	-0.02	-0.05	-0.08
	5.33%	0.11	0.08	0.05	0.01	-0.02	-0.05	-0.08
시나리오	2.67%	0.11	0.07	0.04	0.01	-0.02	-0.06	-0.09
	0%	0.10	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.10
	-2.67%	0.08	0.05	0.02	-0.01	-0.04	-0.08	-0.11
	-5.33%	0.07	0.04	0.01	-0.03	-0.06	-0.09	-0.12
	-8%	0.05	0.02	-0.01	-0.04	-0.08	-0.11	-0.14

최대 손실 시나리오

위험액	-0.14
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.18
-----	------

4) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

단위(백만원)						
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,420	0	1,420	잔위

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 8월 31일 한국전력 보통주, KT&G 보통주

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(한국전력 보통주, KT&G 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 기초자산의 누적 수익률이 초기 상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(만기상환일) 이상인 경우 만 17.0%로 중도상환됨. (누적 수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

단, 만기시까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 권드 해지
 만기 평가일의 누적 수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 18.0%의 수익률로 상환
 만기 평가일의 누적 수익률이 -50%미만인 경우: 역편금액 지급 (원금보장추구)

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6037627198

미래예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.06	0.04	0.02	-0.01	-0.03	-0.05	-0.08
	5.33%	0.07	0.05	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.07
시나리오	2.67%	0.07	0.05	0.03	0.00	-0.02	-0.04	-0.07
	0%	0.07	0.05	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.07
시나리오	-2.67%	0.06	0.04	0.01	-0.01	-0.03	-0.06	-0.08
	-5.33%	0.05	0.02	-0.00	-0.02	-0.05	-0.07	-0.09
	-8%	0.03	0.00	-0.02	-0.04	-0.07	-0.09	-0.11

최대 손실 시나리오

위험액	-0.11
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모단위파생상품투자전략 24호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	611	0	611	장외

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

1) 만기시점의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만드형산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 10월 26일의 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이상인 경우(2번째 중도상환일), 70%이상인 경우(3번째 중도상환일), 65%이상인 경우(만기 상환일) 만일 20.0%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 만기 시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 * 140%

- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우

: 할금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력(상장종목(ELS)243

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	16.16	14.34	12.52	10.70	8.89	7.07	5.25
	5.33%	12.81	11.00	9.18	7.36	5.54	3.72	1.91
	2.67%	9.25	7.43	5.61	3.79	1.97	0.16	-1.66
	0%	5.45	3.64	1.82	0.00	-1.82	-3.64	-5.45
	-2.67%	1.44	-0.38	-2.20	-4.02	-5.83	-7.65	-9.47
	-5.33%	-2.80	-4.62	-6.44	-8.26	-10.07	-11.89	-13.71
	-8%	-7.27	-9.08	-10.90	-12.72	-14.54	-16.36	-18.17

최대 손실 시나리오

위험액	-16.17
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	20.39
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모단위과생상물투자신탁 25호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	305	-2745	3,050	장외

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외과생상물의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 평가: 2009년 11월 12일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 11월 14일의 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(투산중공업 보통주, SK에너지 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(평가상환일) 만큼 15.8%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 각 중도상환일에 중도상환가격이 낮은 기초자산이 최초기준가격 보다 클 경우에는 보너스쿠폰을 지급하여 총 연율 31.6%의 수익률로중도상환이 됨.

단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 만기도 기준가격의 50%이므로 하락한적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 131.6%

- 두 기초자산의 가격(장중모함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 리스크(최대 손실가능금액)(단위:백만원)

KR600345TTB9 변동주형(ELS)2007-609

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	20.24	18.38	16.52	14.65	12.79	10.93	9.07
손익	5.33%	15.50	13.64	11.78	9.92	8.06	6.20	4.34
손익	2.67%	10.62	8.76	6.90	5.04	3.18	1.32	-0.54
손익	0%	5.58	3.72	1.86	0.00	-1.86	-3.72	-5.58
손익	-2.67%	0.39	-1.47	-3.33	-5.19	-7.05	-8.91	-10.77
손익	-5.33%	-4.96	-6.82	-8.68	-10.54	-12.40	-14.26	-16.12
손익	-8%	-10.45	-12.31	-14.17	-16.03	-17.89	-19.75	-21.61

최대 손실 시나리오

위험액	-21.61
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	21.50
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

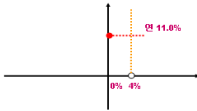
구분	기대자산	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,471	0	7,471	잔의

단위(백만원)

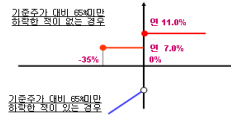
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225
- 2) 만기: 2010년 2월 22일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 2월 22일의 KOSPI200, NIKKEI225 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이 상한 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확인 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환본도 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%
- 두 기초자산의 가격(청종표합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%초과 하락한 적이 있는 경우 : 원금 X (반기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR600345RT28 비터 증권(ELS) 2007-397세

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	508.31	476.07	443.84	411.60	379.36	347.13	314.89
시나리오	5.33%	368.97	336.73	304.50	272.26	240.03	207.79	175.55
	2.67%	231.77	199.53	167.30	135.06	102.83	70.59	38.35
	0%	96.71	64.47	32.24	0.00	-32.24	-64.47	-96.71
	-2.67%	-36.22	-68.46	-100.69	-132.92	-165.16	-197.39	-229.63
	-5.33%	-167.00	-199.24	-231.47	-263.71	-295.94	-328.18	-360.42
	-8%	-295.65	-327.88	-360.12	-392.35	-424.59	-456.83	-489.06

최대 손실 시나리오	
위험액	-489.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	478.94
-----	--------

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

구분		거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS		726	0	726	잔액

단위(백만원)

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

4) 기준지수: 2007년 2월 22일의 KOSPI200, NIKKEI225 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 104%이상 상승한적이 있는 경우

연말 11.2%의 수익률로 중도 상환이 됨.

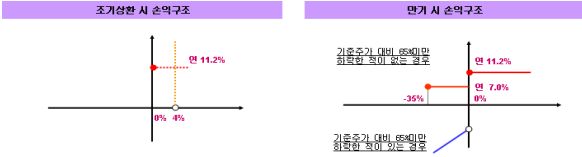
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환비드 기준가격의 65%초과 하락한적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 121%

- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%초과 하락한 적이 있는 경우

: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345ST27 최대 손실(ELS): 2017-3984

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	49.24	46.14	43.04	39.94	36.83	33.73	30.63	
시나리오	35.71	32.60	29.50	26.40	23.30	20.20	17.09	
	2.67%	22.39	19.29	16.19	13.09	9.99	6.88	
	0%	9.31	6.20	3.10	0.00	-3.10	-6.20	
	-2.67%	-3.56	-6.66	-9.76	-12.87	-15.97	-19.07	
	-5.33%	-16.20	-19.30	-22.40	-25.51	-28.61	-31.71	
	-8%	-28.62	-31.72	-34.82	-37.92	-41.03	-44.13	

최대 손실 시나리오

위험액	-47.23
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	47.03
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

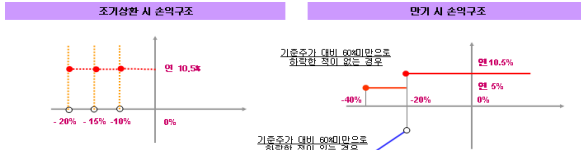
1. 계약금액

구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,658	0	5,658	창의

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 04월 19일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 4월 20일 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(3번째, 4번째 중도상환일), 80%이상인 경우(5번째 중도상환일, 만기상환일) 연율 10.5%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드침
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 115%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익구조표 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600172YT43 신영증권(ELS)552

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	488.53	442.23	395.94	349.64	303.34	257.05	210.75
시나리오	5.33%	385.00	338.70	292.41	246.11	199.82	153.52	107.22
	2.67%	268.45	222.15	175.86	129.56	83.27	36.97	-9.32
	0%	138.89	92.59	46.30	0.00	-46.30	-92.59	-138.89
	-2.67%	-37.0	-49.99	-96.29	-142.58	-188.88	-235.17	-281.47
	-5.33%	-159.29	-205.59	-251.89	-298.18	-344.48	-390.77	-437.07
	-8%	-327.91	-374.21	-420.50	-466.80	-513.09	-559.39	-605.68

최대 손실 시나리오
위험액 -605.68

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 705.38

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

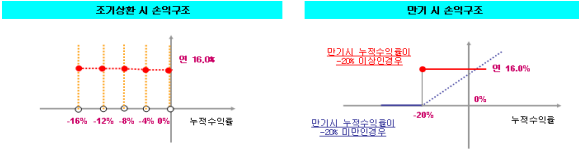
1. 계약금액

구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,934	0	5,934	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 만기: 2010년 6월 3일
- 관점자산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2007년 6월 5일의 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 초기 상환 일정일에 0%(1차 중도상환일), -4%(2차 중도상환일), -8%(3차 중도상환일), -12%(4차 중도상환일), -16%(5차 중도상환일), -20%(6차 중도상환일) 이상인 경우 16.0%로 중도상환됨.
(누적수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)
단, 만기시 까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 누적 수익률])
- 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007=504

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.85	1.64	1.44	1.23	1.02	0.81	0.61
	5.33%	1.49	1.28	1.07	0.86	0.66	0.45	0.24
	2.67%	1.08	0.87	0.66	0.45	0.25	0.04	-0.17
	0%	0.62	0.41	0.21	0.00	-0.21	-0.41	-0.62
	-2.67%	0.12	-0.08	-0.29	-0.50	-0.71	-0.91	-1.12
	-5.33%	-0.42	-0.63	-0.83	-1.04	-1.25	-1.46	-1.66
	-8%	-1.01	-1.21	-1.42	-1.63	-1.83	-2.04	-2.25

최대 손실 시나리오	
위험액	-2.25

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

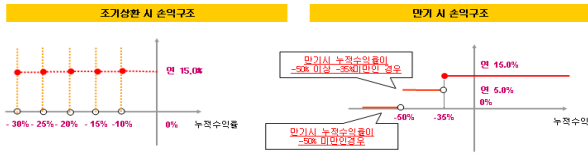
[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자전략 5호

1. 계약금액

						단위(백만원)	
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고	
누계	유가증권	ELS	1,907	0	1,907		잔위

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 8월 13일
- 3) 만드점산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 8월 13일의 국민은행 보통주, 한국전력 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(국민은행, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환됨.
(누적 수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만드 해지
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%미만인 경우: 역편금액 지급 (원금보장추주)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상증권(ELS)191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산 시나리오	8%	2.76	2.00	1.25	0.49	-0.27	-1.03	-1.79
	5.33%	2.71	1.95	1.20	0.44	-0.32	-1.08	-1.84
	2.67%	2.55	1.79	1.03	0.28	-0.48	-1.24	-2.00
	0%	2.28	1.52	0.76	0.00	-0.76	-1.52	-2.28
	-2.67%	1.89	1.13	0.37	-0.39	-1.15	-1.90	-2.66
	-5.33%	1.39	0.63	-0.13	-0.69	-1.65	-2.41	-3.16
	-8%	0.77	0.01	-0.74	-1.50	-2.26	-3.02	-3.78

최대 손실 시나리오

위험액 -3.78

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 4.88

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

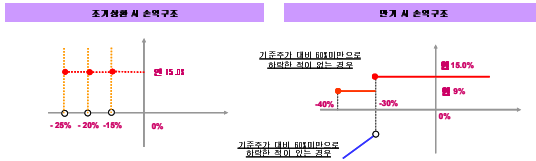
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,623	0	1,623	창의

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2009년 9월 18일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 9월 19일의 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(만기 상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 118%
- 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762L197 미래예상증권(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	125.33	119.72	114.11	108.51	102.90	97.29	91.69
시나리오	5.33%	98.18	92.57	86.96	81.36	75.75	70.14	64.54
	2.67%	62.01	56.40	50.80	45.19	39.58	33.97	28.37
	0%	16.82	11.21	5.61	0.00	-5.61	-11.21	-16.82
	-2.67%	-37.39	-42.99	-48.60	-54.21	-59.81	-65.42	-71.03
	-5.33%	-100.61	-106.22	-111.83	-117.43	-123.04	-128.65	-134.25
	-8%	-172.86	-178.47	-184.07	-189.68	-195.29	-200.89	-206.50
	최대 손실 시나리오	위험액	-206.50					

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	233.75
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제12호

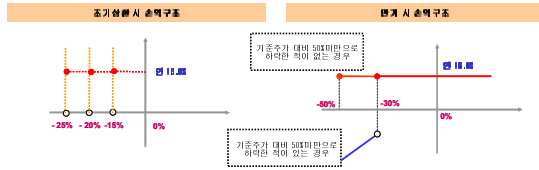
1. 계약금액

구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,347	0	1,347	잔액

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장의괴생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(현대모비스, 삼성중공업 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(만기상환일) 연율 16.0%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률로 중도상환이 됨.
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 132%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR603762HTA9

미래에셋증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	148.29	138.88	129.47	120.06	110.65	101.24	91.83
	5.33%	107.78	98.37	88.96	79.55	70.14	60.73	51.32
	2.67%	67.76	58.35	48.94	39.53	30.12	20.71	11.30
	0%	28.23	18.82	9.41	0.00	-9.41	-18.82	-28.23
	-2.67%	-10.81	-20.22	-29.63	-39.04	-48.45	-57.86	-67.27
	-5.33%	-49.37	-58.78	-68.19	-77.60	-87.01	-96.42	-105.83
	-8%	-87.44	-96.85	-106.26	-115.67	-125.08	-134.49	-143.90

최대 손실 시나리오

위험액 -143.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 157.00

[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

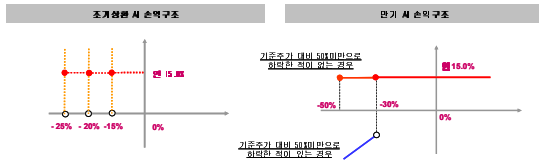
1. 계약금액

구분	기대대상	거래유형	여수(1)	배분(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50	0	50	창의

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 파생상품의 기초자산: LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 30일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 2일의 LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(LG필립스LCD, LG화학 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(만기 상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률로 중도 상환이 됨.
 - 두 기초자산의 가격이 한번호 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762B7B0 미래에셋증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.40	5.02	4.64	4.26	3.88	3.49	3.11
	5.33%	4.05	3.67	3.29	2.90	2.52	2.14	1.76
	2.67%	2.63	2.25	1.87	1.48	1.10	0.72	0.34
	0%	1.15	0.76	0.38	0.00	-0.38	-0.76	-1.15
	-2.67%	-0.40	-0.78	-1.17	-1.55	-1.93	-2.31	-2.70
	-5.33%	-2.02	-2.40	-2.78	-3.16	-3.55	-3.93	-4.31
	-8%	-3.70	-4.08	-4.46	-4.84	-5.23	-5.61	-5.99

최대 손실 시나리오

위험액	-5.99
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.76
-----	------

[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

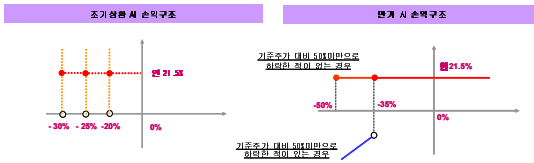
1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,020	0	2,020	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG디스플레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010년 01월 07일
- 3) 만드첨산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG디스플레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(LG디스플레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이상인 경우(두번째 중도상환일), 70%이상인 경우(세번째 중도상환일), 65%이상인 경우(만기 상환일) 연월 21.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우 : 원금 * 143%
- 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345EV11 최대 손위(ELS)/2008=647

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	206.80	174.13	141.47	108.81	76.14	43.48	10.82
	5.33%	171.10	138.44	105.76	73.11	40.45	7.79	-24.87
	2.67%	134.83	102.17	69.51	36.84	4.18	-26.48	-61.14
	0%	97.99	65.33	32.66	0.00	-32.66	-65.33	-97.99
	-2.67%	60.57	27.90	-4.76	-37.42	-70.08	-102.75	-135.41
	-5.33%	22.57	-10.09	-42.75	-75.42	-108.08	-140.74	-173.41
	-8%	-16.00	-48.66	-81.33	-113.99	-146.65	-179.31	-211.98

최대 손실 시나리오	
위험액	-211.98

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	195.54
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 괴상상물 제 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6,752	0	6,752	잔위

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

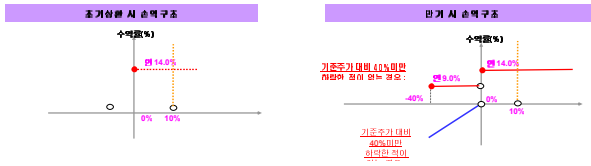
3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한반이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도상환

- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지
- 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격 보다 작은 경우 : 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	595.77	563.05	530.34	497.62	464.91	432.19	399.47
	5.33%	436.09	403.37	370.66	337.94	305.23	272.51	239.79
시나리오	2.67%	270.21	237.50	204.78	172.07	139.35	106.64	73.92
	0%	96.15	63.43	30.72	0.00	-32.02	-64.53	-98.15
	-2.67%	-90.11	-112.83	-145.55	-178.26	-210.98	-243.69	-276.41
	-5.33%	-264.57	-297.28	-330.00	-362.71	-395.43	-428.15	-460.86
	-8%	-455.22	-487.93	-520.65	-553.36	-586.08	-618.79	-651.51

최대 손실 시나리오

위험액	-651.51
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	645.27
-----	--------

[17]테리 조StepDown사모단위 편성26호

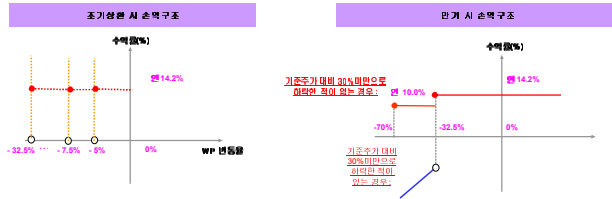
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,606	0	1,606	창의

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: CJ 보통주
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 14일의 CJ 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(CJ 보통주)의 최초기준가격의 95%(1차중도상환일), 92.5%(2차중도상환일), 90.0%(3차중도상환일), 87.5%(4차중도상환일), 85%(5차중도상환일), 82.5%(6차중도상환일), 80%(7차중도상환일), 77.5%(8차중도상환일), 75%(9차중도상환일), 72.5%(10차중도상환일), 70.0%(11차중도상환일), 67.5%(만기상환일) 이상인 경우 만이율 14.2%의 수익률로 중도상환이 됨. 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 30%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 67.5%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 30%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867BTB0 코무상신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	226.06	187.55	149.04	110.53	72.01	33.50	-5.01
	5.33%	189.67	151.15	112.64	74.13	35.62	-2.90	-41.41
	2.67%	152.82	114.31	75.80	37.29	-1.23	-39.74	-78.25
	0%	115.54	77.03	38.51	0.00	-38.51	-77.03	-115.54
	-2.67%	77.81	39.30	0.78	-37.73	-76.24	-114.76	-153.27
	-5.33%	39.63	1.12	-37.39	-75.91	-114.42	-152.93	-191.44
	-8%	1.01	-37.50	-76.01	-114.52	-153.04	-191.55	-230.06

최대 손실 시나리오

위험액 -230.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 224.70

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생1호

1. 계약금액

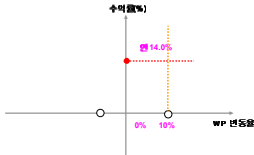
구분	기대자산	가액유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	잔위

단위(백만원)

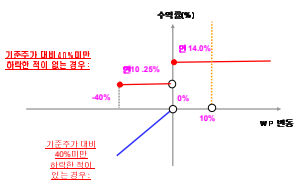
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주
- 2) 만기: 2010년 1월 15일
- 3) 펀드청산결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 15일 LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상종포함하여 환번이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도상환
 단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환번도 기준가격의 60%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 120.5%
 - 두 기초자산의 가격(상종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (만기기준지수/초기기준지수)
 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	별동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	135.92	125.48	115.04	104.60	94.16	83.71	73.27
손익	5.33%	100.28	89.84	79.40	68.96	58.52	48.07	37.63
시나리오	2.67%	65.42	54.98	44.53	34.09	23.65	13.21	2.77
	0%	31.33	20.88	10.44	0.00	-10.44	-20.88	-31.33
	-2.67%	-1.99	-12.43	-22.88	-33.32	-43.76	-54.20	-64.64
	-5.33%	-34.54	-44.98	-55.42	-65.86	-76.30	-86.75	-97.19
	-8%	-66.31	-76.75	-87.19	-97.63	-108.07	-118.52	-128.96

최대 손실 시나리오

위험액	73.27
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	126.07
-----	--------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가5호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,461	0	1,461	잔위

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가액의 100% 이상인 경우 연이율 9%로 중도상환함.

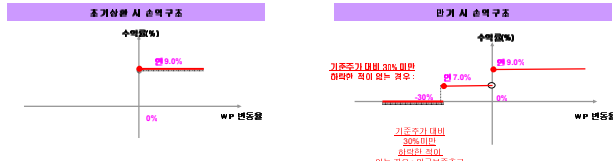
단, 평가시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환비도 기준가액의 70%이만 하락할적 이 없고, 최초기 준가액 보다 작은 경우 : 원금 * 121%

- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 70%이만 하락한 적이 있는 경우

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래에셋증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	42.89	38.40	33.90	29.40	24.91	20.41	15.92
	5.33%	33.62	29.13	24.63	20.13	15.64	11.14	6.65
	2.67%	23.82	19.32	14.83	10.33	5.84	1.34	-3.15
	0%	13.49	8.99	4.50	0.00	-4.50	-8.99	-13.49
	-2.67%	2.62	-1.87	-6.37	-10.87	-15.38	-19.88	-24.35
	-5.33%	-8.77	-13.27	-17.77	-22.26	-26.76	-31.25	-35.75
	-8%	-20.70	-25.20	-29.70	-34.19	-38.69	-43.18	-47.68

최대 손실 시나리오

위험액	15.92
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	44.80
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단원 피싱 6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,080	0	1,080	잔위

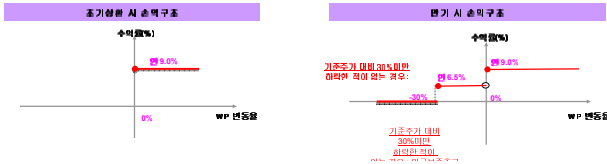
단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2011년 2월 21일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.

- 단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환비도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 * 119.5%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우 : 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 미래셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	41.23	38.55	35.87	33.19	30.51	27.82	25.14
	5.33%	30.29	27.61	24.93	22.25	19.56	16.88	14.20
	2.67%	19.23	16.55	13.86	11.18	8.50	5.82	3.14
	0%	8.04	5.36	2.68	0.00	-2.68	-5.36	-8.04
손익구조변동	-2.67%	-3.26	-5.94	-8.62	-11.30	-13.99	-16.67	-19.35
	-5.33%	-14.69	-17.37	-20.05	-22.73	-25.41	-28.09	-30.77
	-8%	-26.23	-28.91	-31.59	-34.28	-36.96	-39.64	-42.32

최대 손실 시나리오

위험액	25.14
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	44.36
-----	-------

[2] 메리츠치주연계사모단위파생7호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	840	0	840	장외

단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만드형산결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 종료상환기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보 통주)의 종료상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 종료상환함.

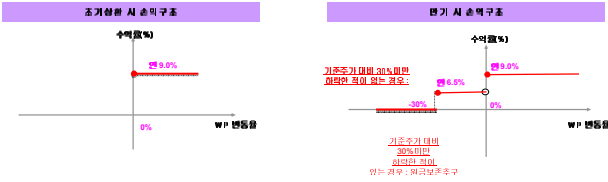
단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

- 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%

- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만 하락한 적이 있는 경우

: 원금*100%

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래예정종결(ELS)317

손익구조변동 시나리오

구분		별동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	32.07	29.98	27.90	25.81	23.73	21.64	19.56
	5.33%	23.56	21.47	19.39	17.30	15.22	13.13	11.05
	2.67%	14.95	12.87	10.78	8.70	6.61	4.53	2.44
	0%	6.26	4.17	2.09	0.00	-2.09	-4.17	-6.26
	-2.67%	-2.54	-4.62	-6.71	-8.79	-10.88	-12.96	-15.05
	-5.33%	-11.42	-13.51	-15.59	-17.68	-19.76	-21.85	-23.93
	-8%	-20.40	-22.49	-24.57	-26.66	-28.74	-30.83	-32.91

최대 손실 시나리오

위험액	19.56
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	34.51
-----	-------

[22] 대리 손주가지수연계과제제2호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,725	0	1,725	창의

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

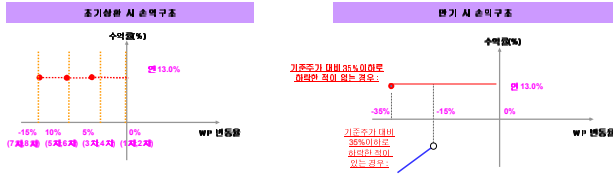
1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 08월 06일

3) 만드침산 결정주기: 매 3개월

4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 95%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 90%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일), 85%이상인 경우(일곱번째, 여덟번째 중도상환일)인 경우 13.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 선택
- 두 기초자산의 가격이 환반드 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 12.8%
 - 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR600333DV81 차니IF증권(ELS)8.08

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	-296.32	-296.35	-296.39	-296.42	-296.45	-296.48	-296.51
	5.33%	-131.47	-131.50	-131.54	-131.57	-131.60	-131.63	-131.66
	2.67%	-32.67	-32.70	-32.73	-32.76	-32.79	-32.83	-32.86
	0%	0.10	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.10
	-2.67%	-33.19	-33.22	-33.25	-33.28	-33.31	-33.34	-33.38
	-5.33%	-132.51	-132.54	-132.57	-132.61	-132.64	-132.67	-132.70
	-8%	-297.68	-297.91	-297.94	-297.97	-298.01	-298.04	-298.07

최대 손실 시나리오

위험액	-296.07
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	9.78
-----	------

[23] 매리츠증권 중저수익계사모파생1호

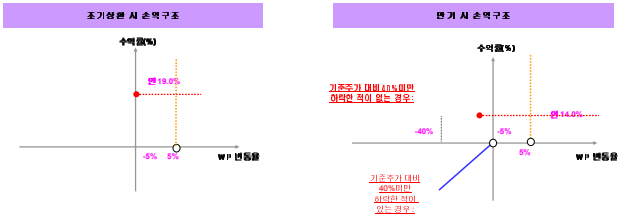
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,474	0	1,474	창의

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수
- 만기: 2010년 08월 04일
- 린드럼산 결정주기: 매 3개월
- 기준지수: 2008년 8월 7일 NIKKEI225, HSCEI지수의 증가
- 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상중 포함하여 한번이라도 최초기준가격의 95% 이상이거나 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 19%의 수익률로 중도상환
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 린드럼
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 * 138%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 린드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	134.41	122.98	111.55	100.13	88.70	77.27	65.84
	5.33%	101.96	90.53	79.10	67.67	56.25	44.82	33.39
	2.67%	68.59	57.16	45.73	34.30	22.87	11.44	0.01
	0%	34.29	22.86	11.43	0.00	-11.43	-22.86	-34.29
	-2.67%	-0.94	-12.37	-23.80	-35.22	-46.65	-58.08	-69.51
	-5.33%	-37.09	-48.52	-59.94	-71.37	-82.80	-94.23	-105.66
	-8%	-74.16	-85.59	-97.02	-108.45	-119.88	-131.30	-142.73

최대 손실 시나리오	
위험액	-142.73

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	136.81
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품 SEPO-1호

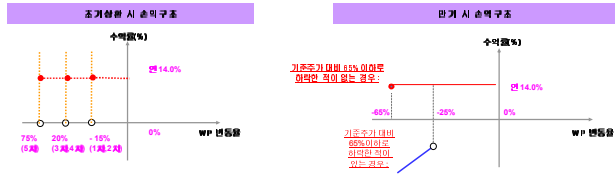
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,381	0	2,381	잔위

단위: 백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011년 08월 26일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세 번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 14.0%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 후 처리
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 48%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 14.2%
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 45%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR652307WR2 보유증권(ELS)2723

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-3.55	-4.50	-5.45	-6.40	-7.35	-8.30	-9.25
	5.33%	1.28	0.33	-0.62	-1.57	-2.52	-3.47	-4.42
	2.67%	3.42	2.47	1.52	0.56	-0.39	-1.34	-2.29
	0%	2.85	1.90	0.95	0.00	-0.95	-1.90	-2.85
	-2.67%	-0.41	-1.36	-2.31	-3.26	-4.21	-5.17	-6.12
	-5.33%	-6.37	-7.32	-8.27	-9.22	-10.18	-11.13	-12.08
	-8%	-15.03	-15.98	-16.93	-17.88	-18.84	-19.79	-20.74

최대 손실 시나리오

위험액	-20.74
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	11.35
-----	-------

[25] 테라즈 주가지수연계사모펀생상품 제 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	830	0	830	창의

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

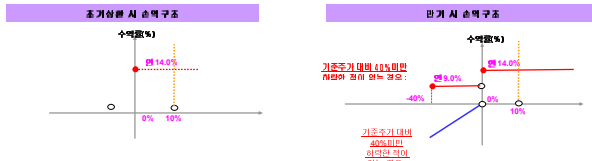
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한반이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도상환

- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격 보다 작은 경우 : 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600690BVR2 대우증권(ELS)2660

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	730.19	690.10	650.00	609.90	569.80	529.71	489.61
5.33%	534.48	494.39	454.29	414.19	374.09	334.00	293.90
2.67%	331.18	291.09	250.99	210.89	170.79	130.70	90.60
0%	120.29	80.19	40.10	0.00	-40.10	-80.19	-120.29
-2.67%	-98.19	-138.29	-178.39	-218.48	-258.58	-298.68	-338.77
-5.33%	-324.26	-364.36	-404.46	-444.56	-484.65	-524.75	-564.85
-8%	-557.93	-598.03	-638.12	-678.22	-718.32	-758.42	-798.51

최대 손실 시나리오

위험액 -798.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 790.66

[26] 데리츠2Star사모파생SE SF-1

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	여수(1)	여도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	501	0	501	상위

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

2) 만기: 2010년 09월 30일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 종가

- 5) 발행 후 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 삼성화재)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일), 70%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연달아 16.2%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우: 원금 * 132.4%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6612302/A7 - 매신증권(ELS)713

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.12	4.29	3.46	2.64	1.81	0.98	0.16
	5.33%	5.04	4.21	3.38	2.56	1.73	0.91	0.08
	2.67%	4.16	3.33	2.51	1.68	0.85	0.03	-0.80
	0%	2.48	1.65	0.83	0.00	-0.83	-1.65	-2.48
	-2.67%	-0.00	-0.83	-1.65	-2.48	-3.31	-4.13	-4.96
	-5.33%	-3.28	-4.11	-4.93	-5.76	-6.59	-7.41	-8.24
	-8%	-7.36	-8.19	-9.02	-9.84	-10.67	-11.49	-12.32

최대 손실 시나리오

위험액 -12.32

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 12.26

[29] 테라즈2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,096	0	1,096	상위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

2) 만기: 2011년 09월 23일

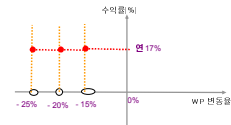
3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 09월 26일 삼성전자, POSCO의 증가

- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 변율17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 151.0%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6572345/91 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9.02	7.38	5.74	4.10	2.47	0.83	-0.81
	5.33%	9.07	7.43	5.79	4.15	2.51	0.88	-0.76
	2.67%	7.70	6.06	4.42	2.78	1.15	-0.49	-2.13
	0%	4.92	3.28	1.64	0.00	-1.64	-3.28	-4.92
	-2.67%	0.71	-0.92	-2.56	-4.20	-5.84	-7.48	-9.12
	-5.33%	-4.90	-6.54	-8.18	-9.82	-11.46	-13.09	-14.73
	-8%	-11.93	-13.57	-15.21	-16.85	-18.49	-20.13	-21.77

최대 손실 시나리오

위험액 -21.77

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 21.27

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

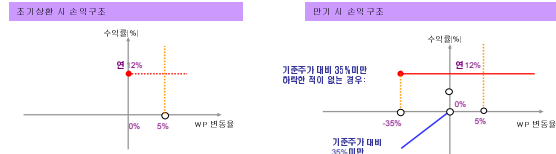
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

- 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 만기: 2010년 09월 20일
 - 펀드청산 결정 주기: 매3개월
 - 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가
 - 발행 후 매 3개월마다 중도 상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기 상환 결정일에 최초 기준가액 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포화하여 한변이라도 최초 기준가액 대비 5%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시(8차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격 이 환변도 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가액의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 124%
 - 두 기초자산의 가격(장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

수익구조변동률 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생 13

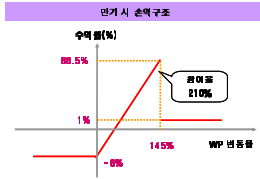
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	707	0	707	차입

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 펀드자산 결정주기: 만기일 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우
: 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수/최초기준지수 - 1))
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
: 원금 * 94%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (단위:백만원))
KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산 시나리오	8%	-22.89	-29.29	-35.66	-42.08	-48.48	-54.88	-61.27
	5.33%	-7.46	-13.85	-20.25	-26.65	-33.05	-39.44	-45.84
	2.67%	6.57	0.17	-6.22	-12.62	-19.02	-25.42	-31.81
	0%	19.19	12.79	6.40	0.00	-6.40	-12.79	-19.19
	-2.67%	30.41	24.01	17.61	11.21	4.82	-1.58	-7.98
	-5.33%	40.21	33.82	27.42	21.02	14.62	8.23	1.83
	-8%	48.61	42.22	35.82	29.42	23.03	16.63	10.23

최대 손실 시나리오

위험액	10.23
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	58.80
-----	-------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

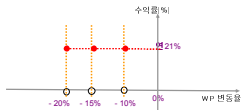
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

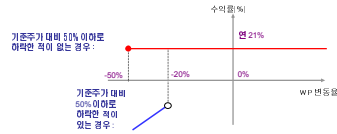
2. 만기시점의 손익구조

- 파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 만기: 2012년 02월 15일
- 증권평가일: 매6개월
- 기준지수: 2009년 02월 13일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 발행 후 6개월마다 증권평가를 시행하고, 기초자산(삼성전자 증가, SK텔레콤의 증가)의 평가일 증가가 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 증권평가일), 85%이상인 경우(세번째, 네번째 증권평가일), 80%이상인 경우(다섯번째 증권평가일) 안을 21.0%의 수익률로 종료 상황이 됨.
단, 만기시 까지 조기 상환 효력을 충족하지 못한 경우 아래와 같이 만기 상환금액을 산출함
- 두 기초자산의 만기일 증가가 모두 최초 기준가격의 80%이상인 경우
: 원금 * 163.0%
- 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 만기일 증가 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 없는 경우
: 원금 * 163.0%
- 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 있는 경우 만기 평가일의 하락률이 큰 증폭을 기준으로
: 원금 * (만기 평가가격 / 최초기준가격)
- 만기의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (단위: 백만원))
KR6562326W20 유인투기증권(ELS)2315

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	6.34	5.15	3.97	2.78	1.60	0.42	-0.77
	5.33%	6.27	5.08	3.90	2.71	1.53	0.34	-0.84
	2.67%	5.34	4.15	2.97	1.78	0.60	-0.58	-1.77
	0%	3.55	2.37	1.18	0.00	-1.18	-2.37	-3.55
	-2.67%	0.91	-0.27	-1.46	-2.64	-3.83	-5.01	-6.20
	-5.33%	-2.59	-3.77	-4.95	-6.14	-7.32	-8.51	-9.69
	-8%	-6.94	-8.12	-9.31	-10.49	-11.68	-12.86	-14.05

최대 손실 시나리오

위험액	-14.05
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	10.96
-----	-------

[49] 데리츠2Star사모파생상품G-12호

1. 계약금액

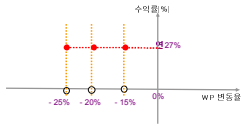
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,130	0	1,130	잔위

단위(백만원)

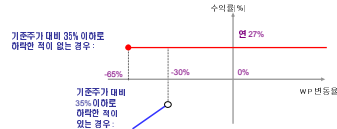
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 파생상품의 기초자산 : POSCO보통주, KB금융보통주
- 2) 만기: 2011년 02월 11일
- 3) 중간평가일: 매6개월
- 4) 최초 기준가격: 2009년 02월 13일 POSCO 보통주, KB금융 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중간평가를 시행하고, 기초자산(POSCO보통주, KB금융보통주)의 당일 증가가 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(둘째 중도상환일), 75% 이상인 경우(세번째 중도상환일) 연율 27.0%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 더 증가 같은 방식으로 수익률 산출
 - 두 기초자산의 만기일 증가가 모두 최초 기준가격의 70%이상인 경우
 : 원금 * 154.0%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 35%미만으로 결정된 적이 없고, 만기시 증가가 하나라도 최초 기준가격의 70%미만인 경우
 : 원금 * 154.0%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 35%미만으로 결정된 적이 있고, 만기시 증가가 하나라도 70%미만인 경우 더욱더 크게 하락한 기초자산을 기준으로
 : 원금 * (만기일 증가/최초기준가격)
- 6) 만일의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액(단위:백만원))
KR6502319W24 코모닝 신한동원(ELS)1009

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[80-1] 메리츠주가지수연계사모증권2호
KR600594DVL1 우리투자증권(ELS)2136

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	단위(백만원) 잔위

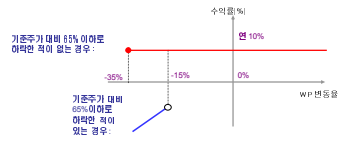
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 17일
- 3) 만도침산 결정 주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 0.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만도의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동/최대손실가능금액(다위:백만원)

메리츠주가지수연계사모증권2호

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-124.46	-124.50	-124.53	-124.57	-124.61	-124.64	-124.68
	5.33%	-54.20	-54.24	-54.27	-54.31	-54.34	-54.38	-54.41
	2.67%	-12.68	-12.71	-12.75	-12.78	-12.82	-12.85	-12.89
	0%	0.11	0.07	0.04	0.00	-0.04	-0.07	-0.11
	-2.67%	-15.85	-15.89	-15.92	-15.96	-15.99	-16.03	-16.06
	-5.33%	-60.55	-60.58	-60.62	-60.65	-60.69	-60.73	-60.76
	-8%	-133.99	-134.02	-134.06	-134.09	-134.13	-134.16	-134.20

최대 손실 시나리오

위험액	-134.20
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(다위:백만원)

위험액	25.69
-----	-------

[80-2] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR600594WVJ5 우리투자증권(ELS)1989

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

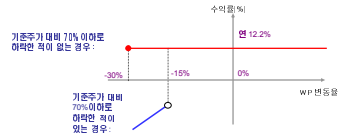
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 6월 12일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 6월 12일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12.2%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2.2%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교
 KR600690MM/M7 당주증권ELS2697

1. 계약금액

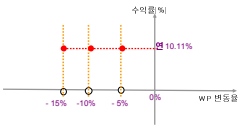
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

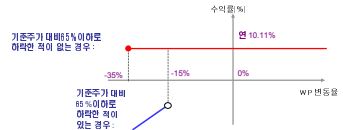
2. 연가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 14일
- 3) 펀드형산 결정주기: 매4개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기준지수(기준)로 각각 최초 기준가격의 95% 이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90% 이상인 경우(두번째 중도상환일), 85% 이상인 경우(세번째 중도상환일) 만월 10.11%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 → 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 85% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 110.11%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-4] 매리츠주가지수연계사모증권2.-4
 KR6008678V51 롯데당 신안증권(ELS)890

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	단위(백만원) 잔액

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 : KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이

낮은기초자산기준으로 각각 최초기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일)

95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일)

연율11%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 만도침지

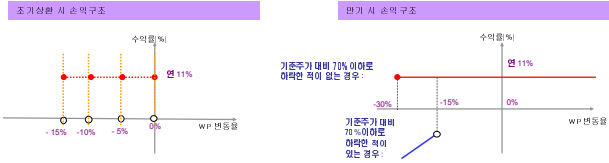
- 두 기초자산의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만도의 수익구조



[80-5] 메리츠투자지수형계사로종업2호
 KR6008679V84 메리츠신안증권(ELS)931

1. 계약금액

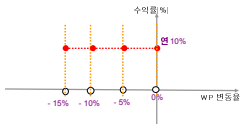
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위: (백만원)

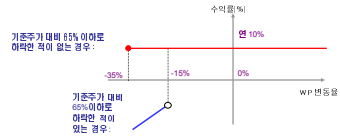
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료합) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수 / 최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-6] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR600867AV62 메리츠신한증권(ELS)899

1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 6월 12일

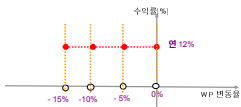
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

4) 기 준지 수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

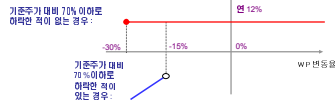
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-7] 메리츠투자지수연계서로증권2호
 KR6030617V67
 교환증권(ELS)Z27회

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기 : 2009년 6월 10일

3) 권드청산 결정 주기 : 매3개월

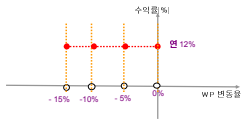
4) 기 준지 수 : 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가액 의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네 번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도 상환이 됨.

- 만기 시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
- 두 기 초자산의 가액 이 환반드 기 준가액 의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가액 의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
- 두 기 초자산의 가액 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가액 의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기 준지 수/최 초기 준지 수)

6) 권 드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-8] 메리츠투자지수연계사모증권2호
 KR6030617V83
 교보증권(ELS)269회

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	차입

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기 : 2009년 6월 18일

3) 권드청산 결정 주기 : 매4개월

4) 기 준 지 수 : 2008년 6월 18일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기 초 자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초 자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일)

90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일)

만들 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 행지

- 두 기 초 자산의 가격이 환반드 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우

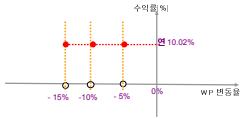
: 원금 * 110.02%

- 두 기 초 자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준 가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우

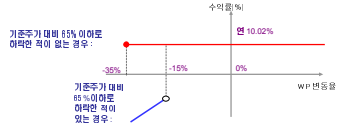
: 원금 * (만기 기 준 지 수 /최 초 기 준 지 수)

6) 권 드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-9] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR6030618V58
 교보증권(ELS)199회

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	단위(백만원) 잔액

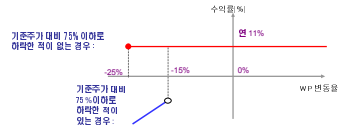
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기 : 2009년 5월 14일
- 3) 권드청산 결정 주기 : 매3개월
- 4) 기 준지수 : 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 만을 11%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 111%
 - 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] **메리츠투자자산수익계사로증권2호**

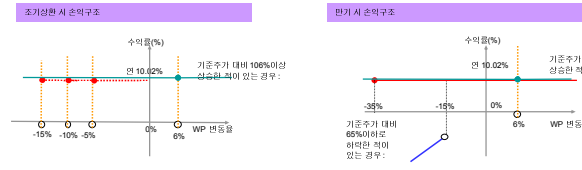
1. **계약금액**

구분	거래대상	거래유형	약수(1)	약도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7547.5	0	7,547.5	장외

단위:백만원

2. **연기시점의 손익구조**

- 1) 장외피생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2011년 5월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2000년 5월 29일KOSPI 200 지수의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일), 80%이상인 경우(네번째 중도상환일) 변할 10.02%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 기초자산의 수가 기준지수의 106%이상으로 상승한 적이 있을 경우는 행사정지사건에 해당되며, 행사정지사건이 발행 후 18개월 이전에 일어나면 이후 도래하는 중도상환일에는 연 10.02%의 중도상환금액을 지급. 18개월 이후에 발생하면 만기일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 하지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 20.04%
- 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. **손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))**

KR6553309W60 유가 증권(ELS)2457

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	16.70	13.79	10.87	7.95	5.04	2.12	-0.80
	5.33%	14.20	11.29	8.37	5.45	2.54	-0.38	-3.30
	2.67%	11.55	8.64	5.72	2.80	-0.11	-3.03	-5.95
	0%	8.75	5.83	2.92	0.00	-2.92	-5.83	-8.75
	-2.67%	5.80	2.86	-0.04	-2.95	-5.87	-8.79	-11.70
	-5.33%	2.89	-0.22	-3.14	-6.06	-8.97	-11.89	-14.81
	-8%	-0.56	-3.48	-6.40	-9.31	-12.23	-15.15	-18.06

최대 손실 시나리오	
위험액	-18.06

4. **파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	20.08
-----	-------

[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHG-2

1. 계약금액

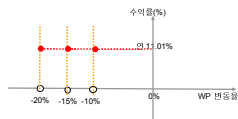
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	잔액

단위(백만원)

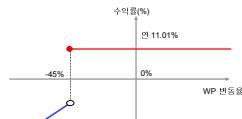
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 만기: 2012년 4월 12일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차지수의 증가
- 발행 후 매6개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차, 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 11.01%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 원금 * 111.01%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오	변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0		8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.96	1.37	0.77	0.16	-0.41	-1.01	-1.60	
	5.33%	2.23	1.63	1.04	0.44	-0.15	-0.74	-1.34	
	2.67%	2.17	1.57	0.98	0.38	-0.21	-0.80	-1.40	
	0%	1.78	1.19	0.59	0.00	-0.59	-1.19	-1.78	
	-2.67%	1.07	0.48	-0.11	-0.71	-1.30	-1.90	-2.49	
	-5.33%	0.04	-0.55	-1.15	-1.74	-2.34	-2.93	-3.52	
	-8%	-1.32	-1.91	-2.50	-3.10	-3.69	-4.29	-4.88	

최대 손실 시나리오

위험액 -4.88

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 4.18

[62] 테리츠2Star사모증권투자STWF-1

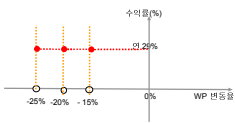
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순투자금(1-2)	단위(백만원)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771		잔액

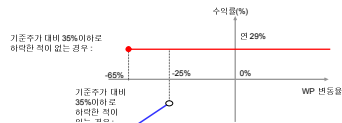
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 만드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융저주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.9%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
 6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 | 구분증권(ELS)325

손익구조변동 시나리오

구분	손익구조변동 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	17.43	15.00	12.57	10.14	7.71	5.28	2.85
손익	5.33%	18.25	15.82	13.39	10.96	8.53	6.11	3.68
시나리오	2.67%	14.87	12.44	10.01	7.58	5.16	2.73	0.30
	0%	7.29	4.86	2.43	0.00	-2.43	-4.86	-7.29
	-2.67%	-4.50	-6.93	-9.36	-11.79	-14.22	-16.65	-19.07
	-5.33%	-20.49	-22.92	-25.35	-27.78	-30.21	-32.64	-35.07
	-8%	-40.69	-43.12	-45.55	-47.98	-50.41	-52.83	-55.26

최대 손실 시나리오

위험액	-55.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	57.40
-----	-------

[65] 테리츠2Star사모증권HKKB-1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	704.6	0	705	최의

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, 현대중공업

2) 만기: 2011년 4월 08일

3) 만드청산 결정주기: 매 4개월

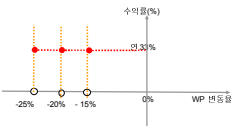
4) 기준지수: 2009년 4월 9일 KB금융, 현대중공업의 증가

5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, 현대중공업 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 33%의 수익률로 중도 상환이 됨.

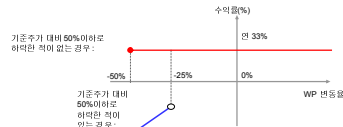
- 단, 만기시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 133%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6572353W40 한국투자증권(ELS)1215

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
시나리오	5.33%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	2.67%	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	-5.33%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	-8%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04

최대 손실 시나리오

위험액	-0.04
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[66] 테리츠2Star사모증권LEHC-1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2045.8	0	2,046	최의

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차

2) 만기: 2012년 4월 12일

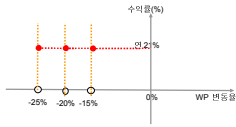
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

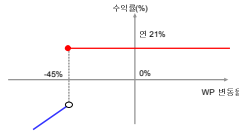
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보충주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 21%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 + 121%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)
 6) 권드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.34	3.03	1.71	0.40	-0.91	-2.23	-3.54
	5.33%	4.93	3.61	2.30	0.98	-0.33	-1.65	-2.96
시나리오	2.67%	4.60	3.48	2.17	0.85	-0.46	-1.78	-3.09
	0%	3.94	2.63	1.31	0.00	-1.31	-2.63	-3.94
오	-2.67%	2.38	1.06	-0.25	-1.57	-2.88	-4.20	-5.51
	-5.33%	0.09	-1.22	-2.54	-3.85	-5.17	-6.48	-7.80
	-8%	-2.91	-4.23	-5.54	-6.86	-8.17	-9.49	-10.80

최대 손실 시나리오

위험액	-10.80
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.25
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	837.0	0	837	최의

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

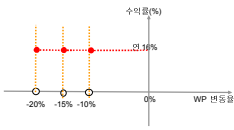
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

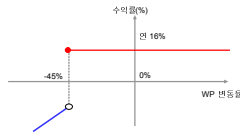
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 11.6%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오									
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%			
기초자산	8%	4.62	3.71	2.80	1.88	0.97	0.06	-0.85		
시나리오	5.33%	4.58	3.66	2.75	1.84	0.92	0.01	-0.90		
	2.67%	3.95	3.03	2.12	1.21	0.30	-0.62	-1.53		
	0%	2.74	1.83	0.91	0.00	-0.91	-1.83	-2.74		
	-2.67%	0.95	0.04	-0.88	-1.79	-2.70	-3.61	-4.53		
	-5.33%	-1.42	-2.33	-3.24	-4.16	-5.07	-5.98	-6.90		
	-8%	-4.37	-5.28	-6.19	-7.11	-8.02	-8.93	-9.84		

최대 손실 시나리오

위험액	-9.84
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.33
-----	------

[65] 테리츠2Star사모증권POKB-2호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50	최의

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

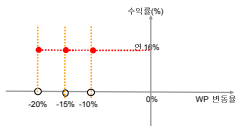
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

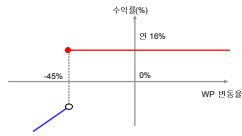
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 원금 + 11.6%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.28	0.22	0.17	0.11	0.06	0.00	-0.05
	5.33%	0.27	0.22	0.16	0.11	0.06	0.00	-0.05
	2.67%	0.24	0.18	0.13	0.07	0.02	-0.04	-0.09
	0%	0.16	0.11	0.05	0.00	-0.05	-0.11	-0.16
	-2.67%	0.06	0.00	-0.05	-0.11	-0.16	-0.22	-0.27
최대 손실 시나리오	-5.33%	-0.08	-0.14	-0.19	-0.25	-0.30	-0.36	-0.41
	-8%	-0.26	-0.32	-0.37	-0.42	-0.48	-0.53	-0.59

최대 손실 시나리오

위험액	-0.69
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.56
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	최대

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.

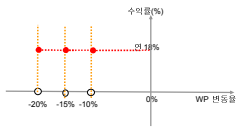
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우
: 원금 * 118%

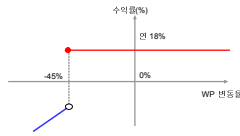
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동 (최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	29.42	25.73	22.04	18.35	14.66	10.97	7.28
시나리오	5.33%	24.94	21.25	17.56	13.87	10.18	6.49	2.80
	2.67%	18.82	15.13	11.44	7.75	4.06	0.37	-3.32
	0%	11.07	7.38	3.69	0.00	-3.69	-7.38	-11.07
	-2.67%	1.68	-2.01	-5.70	-9.39	-13.07	-16.76	-20.45
	-5.33%	-9.34	-13.03	-16.71	-20.40	-24.09	-27.78	-31.47
	-8%	-21.99	-25.68	-29.37	-33.06	-36.75	-40.44	-44.12

최대 손실 시나리오

위험액	-44.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	48.98
-----	-------

[68] 테리츠2Star사모증권SET-4호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	500.0	0	500	최대

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

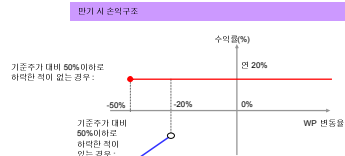
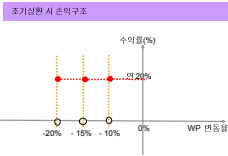
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

손익 구조변동률 시나리오		변동성 시나리오														
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	구분	8%	5.33%	2.67%	0%	-2.67%	-5.33%	-8%
기초자산 시나리오	10.22	8.86	7.50	6.13	4.77	3.41	2.05									
	9.33	7.96	6.60	5.24	3.88	2.51	1.15									
	7.28	5.92	4.56	3.19	1.83	0.47	-0.89									
	4.09	2.72	1.36	0.00	-1.36	-2.72	-4.09									
	-0.25	-1.62	-2.98	-4.34	-5.70	-7.07	-8.43									
	-5.74	-7.11	-8.47	-9.83	-11.19	-12.56	-13.92									
	-12.38	-13.74	-15.10	-16.47	-17.83	-19.19	-20.55									

최대 손실 시나리오	
위험액	-20.55

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.89
-----	-------

[76] 데리츠2Star사로 SEST-2

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	최대

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

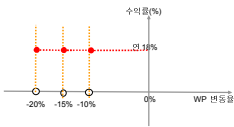
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.

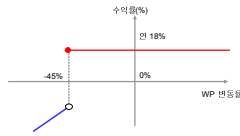
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 11.8%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	1.6,18	14,15	12,12	10,10	8,07	6,04	4,01	
시나리오	5,33%	13,72	11,69	9,66	7,63	5,60	3,57	
	2,67%	10,35	8,32	6,29	4,26	2,23	0,20	
	0%	6,09	4,06	2,03	0,00	-2,03	-4,06	
	-2,67%	0,93	-1,10	-3,13	-5,16	-7,19	-9,22	
	-5,33%	-5,14	-7,17	-9,19	-11,22	-13,25	-15,28	
	-8%	-1,21,0	-14,13	-16,16	-18,18	-20,21	-22,24	

최대 손실 시나리오

위험액	-24,27
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	26,94
-----	-------

[77] 테리츠2Star사로 SEST-3

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241.4	0	241	최의

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 29일

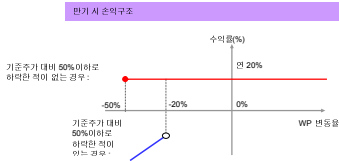
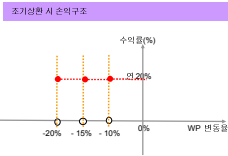
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	8.00	7.12	6.23	5.34	4.46	3.57	2.69
시나리오	5.33%	6.84	5.96	5.07	4.18	3.30	2.41	1.53
	2.67%	5.06	4.17	3.29	2.40	1.52	0.63	-0.26
	0%	2.66	1.77	0.89	0.00	-0.89	-1.77	-2.66
	-2.67%	-0.37	-1.25	-2.14	-3.02	-3.91	-4.80	-5.68
	-5.33%	-4.01	-4.90	-5.78	-6.67	-7.55	-8.44	-9.33
	-8%	-6.28	-9.16	-10.05	-10.93	-11.82	-12.71	-13.59

최대 손실 시나리오

위험액	-13.59
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	12.16
-----	-------

[78] 테리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	최대

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

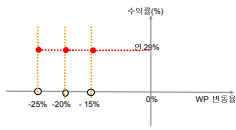
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융지주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.

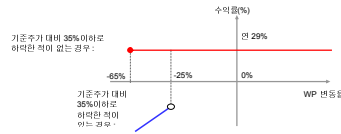
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가액이 합반도 기준가액의 50%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12.9%
 - 두 기초자산의 가액(중중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%이상으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	15.17	13.06	10.94	8.83	7.43	4.60	2.48
시나리오	5.33%	15.89	13.77	11.66	9.54	7.43	5.32	3.20
	2.67%	12.95	10.83	8.72	6.60	4.49	2.37	0.26
	0%	6.34	4.23	2.11	0.00	-2.11	-4.23	-6.34
	-2.67%	-3.92	-6.03	-8.15	-10.26	-12.38	-14.49	-16.61
	-5.33%	-17.84	-19.96	-22.07	-24.19	-26.30	-28.41	-30.53
	-8%	-35.42	-37.54	-39.65	-41.77	-43.88	-46.00	-48.11

최대 손실 시나리오

위험액	-48.11
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	49.97
-----	-------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

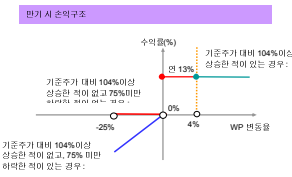
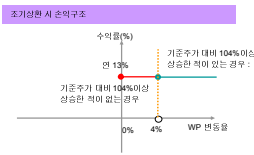
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	최위

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13%의 수익률로 중도상환
 - 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우: 원금 * 11.3%
 - 두 기초자산의 가격(정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모6호

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	9,280.82	8,508.10	7,735.38	6,962.66	6,189.94	5,417.22	4,644.50
시나리오	5.33%	6,957.52	6,184.80	5,412.08	4,639.36	3,866.64	3,093.92	2,321.20
	2.67%	4,636.63	3,863.92	3,091.20	2,318.48	1,545.76	773.04	0.32
	0%	2,318.16	1,545.44	772.72	0.00	-772.72	-1,545.44	-2,318.16
	-2.67%	2.09	-770.63	-1,543.35	-2,316.07	-3,088.79	-3,861.50	-4,634.22
	-5.33%	-2,311.56	-3,064.28	-3,857.00	-4,629.72	-5,402.44	-6,175.16	-6,947.88
	-8%	-4,622.81	-5,395.53	-6,168.25	-6,940.97	-7,713.69	-8,466.41	-9,259.12

최대 손실 시나리오

위험액	-9,259.12
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,106.68
-----	----------

[79-2] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000		최위

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 8일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 8일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

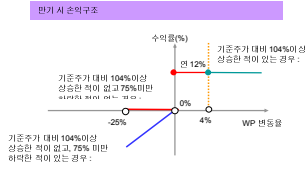
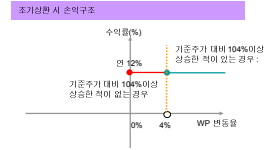
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우

: 원금 * 11.2%

- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호

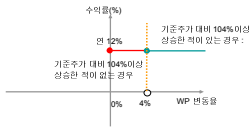
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	원	최위

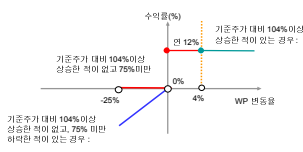
2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 16일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
 - 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[79-4] 메리츠주가지수연계사모6호

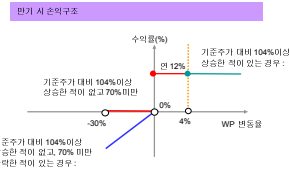
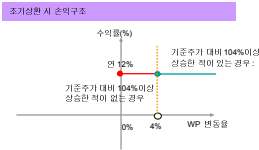
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	배도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	최의

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 10월 19일
 - 3) 만드청산 결정주기: 매3개월
 - 4) 기준지수: 2007년 10월 15일 KOSPI200지수의 증가
 - 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중표현하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



KR6008679TA3 굿모닝 신환증권(ELS)786

[79-5] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 10일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

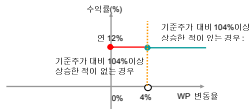
5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

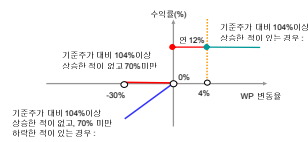
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 손익구조



KR600086767B7 국토부 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위: (백만원)

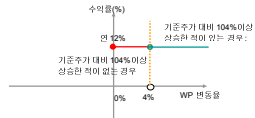
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

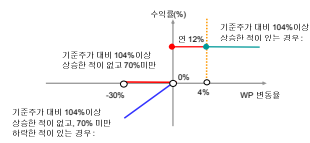
단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6000867CTB8 굿모닝 신한증권(ELS)804

[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 15일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

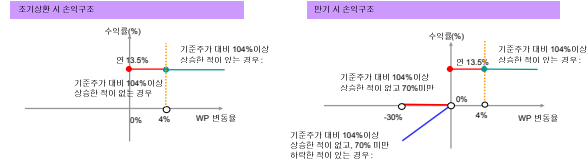
4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기일을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한반이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환

단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 113.5%
- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR60008675TC7 굿모닝 신한증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

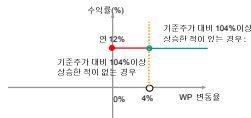
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
통화	유가종목	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

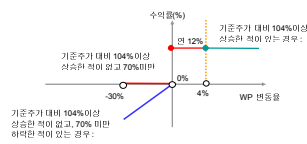
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 10월 15일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 월기기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
 - 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 한반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 한나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 08일

3) 만트청산 결제주기: 매3개월

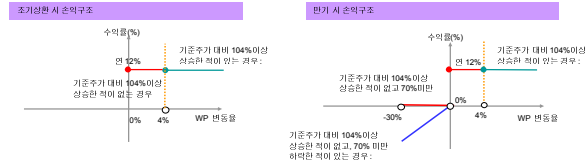
4) 기준지수: 2007년 11월 08일KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매3개월마다 증도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기상환결제일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 증도포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 증도상환

단, 만기시(12차상환일)까지 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 만트해지

- 두 기초자산의 가격 이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (증도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만트의 수익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

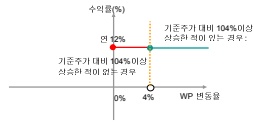
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

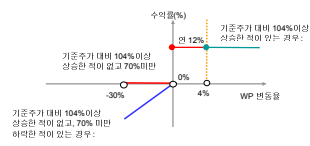
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중요합하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
 - 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중요합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 13일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

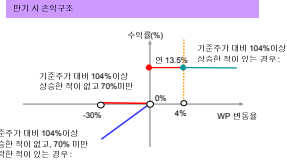
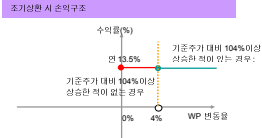
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환

단, 만기시(12차 상환일)까지 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지

- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 113.5%
- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	잔액

단위: (백만원)

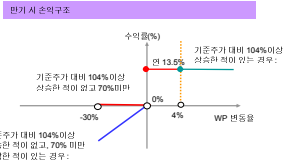
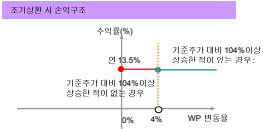
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환

단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 113.5%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[80] 데리 조주가지 수연계 사모7호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	300.0	0	300	천원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200

2) 만기: 2011년 4월 5일

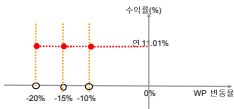
3) 만드청산 결제주기: 매4개월

4) 기준지수: 2009년 4월 3일 KOSPI 200의 증가

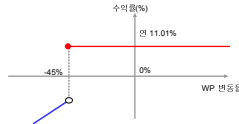
5) 발행 후 매 4개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(장번계 중도상환일) 85%이상인 경우(두번계 중도상환일), 80%이상인 경우(세번계 중도상환일) 연율 11.01%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 * 111.01%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
 6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실가능금액)(단위:백만원)

KR6563321W49 무리투자증권(ELS)2392

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
	-8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[82] 대리 조주가지 수연계사모증권5호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	591.3	0	591	최위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초

기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우

- 만기평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우

: 원금 * (95% + 100% * (만기기준지수/최초기준지수 - 1))

- 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우

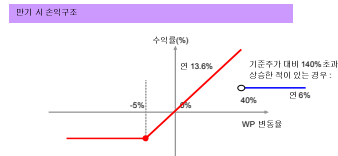
: 원금 * 95%

기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초

기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우

: 원금 * 108%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6523317W30 대우증권ELS2881

구분	손익 구조변동률 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	3.90	3.20	2.50	1.80	1.10	0.40	-0.30	
시나리오	2.67	2.12	1.42	0.71	0.01	-0.69	-1.39	
	2.10	1.40	0.70	0.00	-0.70	-1.40	-2.10	
	1.27	0.57	-0.13	-0.83	-1.53	-2.23	-2.93	
	0.33	-0.37	-1.07	-1.77	-2.47	-3.17	-3.87	
	-0.73	-1.43	-2.13	-2.83	-3.53	-4.23	-4.93	

최대 손실 시나리오

위험액	-4.93
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.58
-----	------

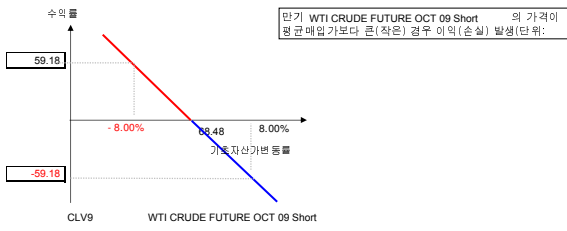
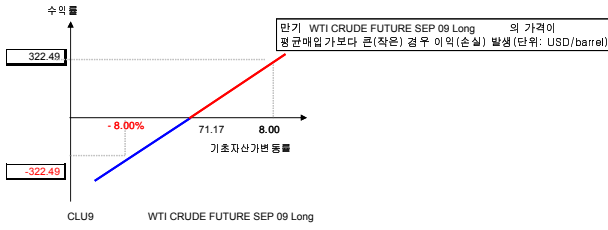
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	56	10	46	장내

단위:계약

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 Long
CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Short

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8%	263.31
	5.33%	175.43
	2.67%	87.88
	0%	0.00
	-2.67%	-87.88
	-5.33%	-175.43
	-8%	-263.31

최대손실 시나리오	
위험액	-263.31

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,546
-----	-------

[78] 데리 조주까지 수연계사모증권161E

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1110.0	0	1,110.0	잔위

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

2) 만기: 2010년 5월 28일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2009년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가

5) 발행 후 매3개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가격이

낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일)

90%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 85%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일)

연율 12.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

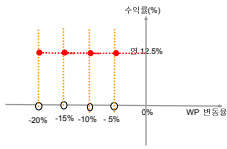
: 원금 * 112.5%

- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우

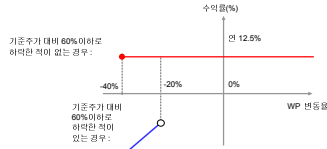
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6523310W80 대우증권ELS3005

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-1.66	-1.72	-1.79	-1.85	-1.91	-1.98	-2.04
	5.33%	-0.49	-0.56	-0.62	-0.68	-0.75	-0.81	-0.87
시나리오	2.67%	0.12	0.06	-0.00	-0.07	-0.13	-0.19	-0.26
	0%	0.18	0.13	0.06	0.00	-0.06	-0.13	-0.19
-2.67%	-0.29	-0.36	-0.42	-0.48	-0.55	-0.61	-0.67	
	-5.33%	-1.33	-1.39	-1.45	-1.52	-1.58	-1.64	-1.71
-8%	-2.91	-2.97	-3.04	-3.10	-3.16	-3.23	-3.29	

최대 손실 시나리오

위험액	-3.29
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.89
-----	------

[79] 데리츠주가지 수연계사모증권! 61E

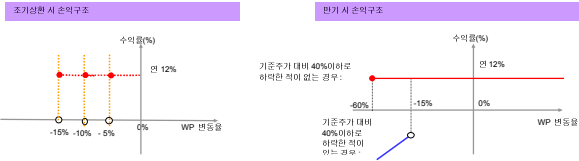
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	차입

단위: (백만원)

2. 연가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 연가: 2010년 5월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 90%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 85%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 12%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR6503305W89 코모닝 신한동원권(ELS)1039

손익 구조표인 톱 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	13.45	9.76	6.06	2.39	-1.30	-4.99	-8.67
산	5.33%	17.85	14.16	10.46	6.79	3.10	-0.59	-4.27
시나리오	2.67%	17.05	13.37	9.66	5.99	2.31	-1.38	-5.07
	0%	16.06	7.37	3.69	0.00	-3.69	-7.37	-11.06
	-2.67%	-0.13	-3.82	-7.56	-11.75	-14.88	-18.56	-22.25
	-5.33%	-16.51	-20.20	-23.89	-27.58	-31.26	-34.95	-38.64
	-8%	-38.10	-41.78	-45.47	-49.16	-52.85	-56.53	-60.22

최대 손실 시나리오

위험액	-60.22
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	59.00
-----	-------

[80] 대리 조주가지 수연계 사모증권 10호

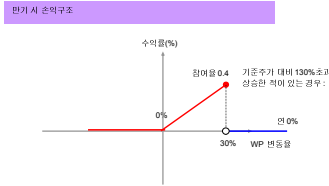
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2300.0	0	2,300.0	상위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 만기 평가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 5월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 130% 미만일 경우
 - : 원금 * (100% + 40% * (만기 기준지수/최초기준지수 - 1))
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
 - : 원금 * 100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6673105W54 - 금융증권-채피플러스(ELS)91

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-1.47	-2.90	-4.33	-5.76	-7.18	-8.61	-10.04
시나리오	5.33%	0.64	-0.79	-2.22	-3.65	-5.08	-6.51	-7.93
	2.67%	2.55	1.13	-0.30	-1.73	-3.16	-4.59	-6.02
0%	4.29	2.86	1.43	0.00	-1.43	-2.86	-4.29	
-2.67%	5.83	4.40	2.97	1.54	0.12	-1.31	-2.74	
-5.33%	7.19	5.76	4.33	2.90	1.47	0.04	-1.38	
-8%	8.36	6.93	5.50	4.07	2.64	1.21	-0.21	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.21
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.37
-----	-------

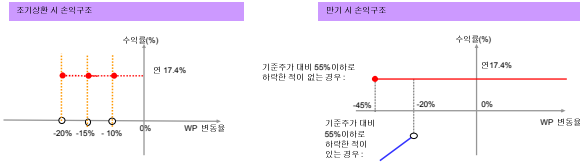
[82] 데리츠2Star사모증권SE-ST-8호

1. 계약금액

							단위(백만원)
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고	
누계	유가증권	ELS	275.9	0	275.9	차입	

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	6.00	5.16	4.32	3.48	2.64	1.80	0.96
손실리	5.33%	5.57	4.73	3.89	3.05	2.21	1.37	0.53
오	2.67%	4.41	3.57	2.73	1.89	1.05	0.21	-0.63
	0%	2.52	1.68	0.84	0.00	-0.84	-1.68	-2.52
	-2.67%	-0.10	-0.94	-1.78	-2.62	-3.46	-4.30	-5.14
	-5.33%	-3.46	-4.30	-5.14	-5.98	-6.82	-7.66	-8.50
	-8%	-7.65	-8.39	-9.23	-10.07	-10.91	-11.75	-12.59

최대 손실 시나리오

위험액	-12.59
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.03
-----	-------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

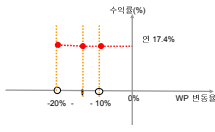
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

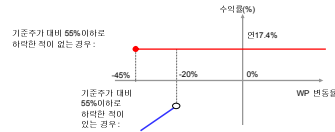
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 주가의 중도상환가액이 낮은 기초자산) 기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률을 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117.4%
- 두 기초자산의 가액 (장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기시 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)
KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	38.53	33.13	27.73	22.34	16.94	11.54	6.14
손실리	5.33%	35.79	30.39	25.00	19.60	14.20	8.80	3.40
오	2.67%	28.35	22.95	17.55	12.15	6.75	1.35	-4.05
0%	16.20	10.80	5.40	0.00	-5.40	-10.80	-16.20	
-2.67%	-0.66	-6.00	-11.46	-16.66	-22.28	-27.65	-33.05	
-5.33%	-2.22	-27.62	-33.02	-38.42	-43.82	-49.22	-54.62	
-8%	-48.49	-53.89	-59.29	-64.69	-70.09	-75.49	-80.88	

최대 손실 시나리오

위험액	-80.88
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	90.17
-----	-------

[84] 데리츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

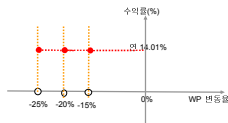
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: (백만원)

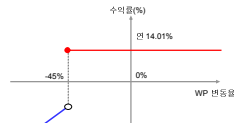
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2011년 5월 31일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 6월 1일 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 14.01%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 114.01%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))
KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	0.57	0.46	0.36	0.25	0.15	0.04	-0.06
5.33%	0.63	0.53	0.42	0.32	0.21	0.11	0.00
2.67%	0.55	0.44	0.34	0.23	0.13	0.02	-0.08
0%	0.32	0.21	0.11	0.00	-0.11	-0.21	-0.32
-2.67%	-0.06	-0.11	-0.21	-0.32	-0.49	-0.59	-0.70
-5.33%	-0.59	-0.70	-0.80	-0.91	-1.01	-1.12	-1.22
-8%	-1.27	-1.37	-1.48	-1.58	-1.69	-1.80	-1.90

최대 손실 시나리오

위험액	-1.90
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.87
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

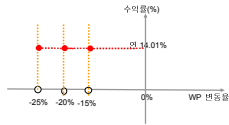
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위: (백만원)

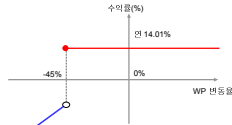
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2011년 5월 31일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 6월 1일 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 14.01%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 114.01%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	2.05	1.67	1.29	0.91	0.53	0.15	-0.23
산	5.33%	2.28	1.90	1.52	1.14	0.76	0.38	0.00
시나리오	2.67%	1.98	1.60	1.22	0.84	0.46	0.08	-0.30
	0%	1.14	0.76	0.38	0.00	-0.38	-0.76	-1.14
	-2.67%	-0.23	-0.61	-0.99	-1.37	-1.75	-2.13	-2.51
	-5.33%	-2.14	-2.52	-2.90	-3.28	-3.66	-4.04	-4.42
	-8%	-4.58	-4.96	-5.34	-5.72	-6.10	-6.48	-6.86

최대 손실 시나리오

위험액	-6.86
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	6.74
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호

1. 계약금액

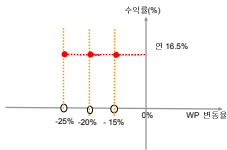
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

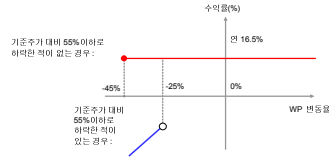
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, LG전자 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 22일 삼성전자 보통주, LG전자 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, LG전자 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일) 연율 16.5%의 수익률을 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 환펀드 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 116.5%
→ 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))
KR6662321W56 환외스파드(ELS)127

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.21	0.91	0.62	0.32	0.03	-0.27	-0.56
산	5.33%	1.51	1.21	0.92	0.62	0.33	0.03	-0.26
시나리오	2.67%	1.40	1.11	0.81	0.52	0.22	-0.07	-0.37
	0%	0.89	0.59	0.30	0.00	-0.30	-0.59	-0.89
	-2.67%	-0.04	-0.33	-0.63	-0.92	-1.22	-1.51	-1.81
	-5.33%	-1.37	-1.67	-1.96	-2.26	-2.55	-2.85	-3.14
	-8%	-3.11	-3.41	-3.70	-4.00	-4.29	-4.59	-4.88

최대 손실 시나리오

위험액	-4.88
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	4.33
-----	------

[87] 데리츠2SIa사모증권SEKT-이 호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	341.7	0	341.7	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

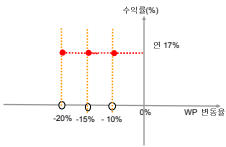
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.

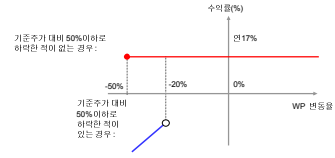
- 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117%
 - 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)
KR6562319W52 유린 투기증권 (ELS)2415

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	6.35	5.30	4.25	3.20	2.15	1.10	0.04
손익	5.33%	5.81	4.75	3.70	2.65	1.60	0.55	-0.50
시나리오	2.67%	4.74	3.69	2.64	1.59	0.53	-0.52	-1.57
	0%	3.15	2.10	1.05	0.00	-1.05	-2.10	-3.15
	-2.67%	1.05	-0.00	-1.05	-2.10	-3.15	-4.21	-5.26
	-5.33%	-1.57	-2.62	-3.68	-4.73	-5.78	-6.83	-7.88
	-8%	-4.71	-5.77	-6.82	-7.87	-8.92	-9.97	-11.02

최대 손실 시나리오

위험액	-11.02
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	11.15
-----	-------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

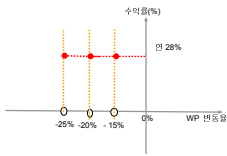
1. 계약금액

단위(백만원)						
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	462.0	0	462.0	잔위

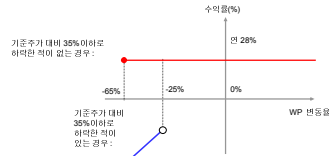
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 15일 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주의 총가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반드 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 128%
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR6622309W55 코분증권(ELS)344

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초지	46.70	35.59	24.48	13.37	2.26	-8.85	-19.96
산	42.63	31.52	20.41	9.30	-1.81	-12.92	-24.03
시나리오	38.17	27.06	15.95	4.84	-6.27	-17.38	-28.49
0%	33.33	22.22	11.11	0.00	-11.11	-22.22	-33.33
-2.67%	28.10	16.99	5.88	-5.23	-16.34	-27.45	-38.56
-5.33%	22.49	11.38	0.27	-10.84	-21.95	-33.06	-44.17
-8%	16.49	5.38	-5.73	-16.84	-27.95	-39.06	-50.18

최대 손실 시나리오

위험액	-50.18
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	42.60
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	단위(백만원)			
			액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	30.0	0	30.0	잔위

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO

2) 만기: 2012년 5월 11일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2009년 5월 13일 LG전자 보통주, POSCO의 증가

5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, POSCO 주가)의 중도상환가액이

낮은 기초자산가액으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일)

80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일)

연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가액이 기준가액의 55%이상인 경우

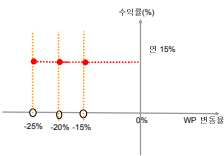
: 원금 * 115%

- 두 기초자산의 가액 중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만인 경우

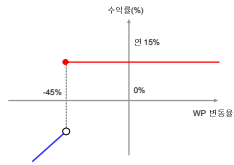
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.29	0.23	0.17	0.11	0.05	-0.01	-0.07
	5.33%	0.27	0.21	0.15	0.10	0.04	-0.02	-0.08
	2.67%	0.24	0.18	0.12	0.06	-0.00	-0.06	-0.12
	0%	0.18	0.12	0.06	0.00	-0.06	-0.12	-0.18
	-2.67%	0.10	0.04	-0.02	-0.06	-0.14	-0.20	-0.26
	-5.33%	-0.01	-0.07	-0.13	-0.19	-0.25	-0.30	-0.36
	-8%	-0.13	-0.19	-0.25	-0.31	-0.37	-0.43	-0.49

최대 손실 시나리오

위험액	-0.49
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.43
-----	------

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

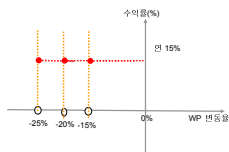
구분	거래대상	거래유형	약수(1)	약도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위:백만원

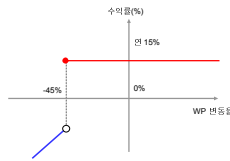
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO
- 2) 만기: 2012년 5월 11일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 13일 LG전자 보통주, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, POSCO 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 만할 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 원금 * 115%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))
KR6652311W58 권위스펀드(ELS)117

손익 구조변동 시나리오		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	21.83	17.31	12.80	8.29	3.77	-0.74	-5.25
	5.33%	20.79	16.27	11.76	7.25	2.73	-1.78	-6.29
	2.67%	18.03	13.51	9.00	4.49	-0.03	-4.54	-9.05
	0%	13.54	9.03	4.51	0.00	-4.51	-9.03	-13.54
	-2.67%	7.33	2.82	-1.70	-6.21	-10.72	-15.24	-19.75
-5.33%	-0.80	-5.11	-9.63	-14.14	-18.65	-23.17	-27.68	
-8%	-10.26	-14.77	-19.28	-23.80	-28.31	-32.82	-37.34	

최대 손실 시나리오

위험액	-37.34
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	33.00
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호 [EL]

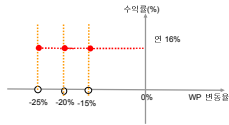
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	천원

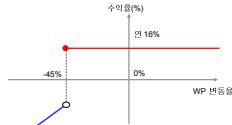
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 평균 * 118%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.70	1.39	1.08	0.78	0.47	0.17	-0.14
	5.33%	1.47	1.17	0.86	0.55	0.25	-0.06	-0.36
시나리오	2.67%	1.21	0.91	0.60	0.30	-0.01	-0.32	-0.62
	0%	0.92	0.61	0.31	0.00	-0.31	-0.61	-0.92
	-2.67%	0.59	0.28	-0.02	-0.33	-0.64	-0.94	-1.25
	-5.33%	0.22	-0.08	-0.39	-0.70	-1.00	-1.31	-1.62
	-8%	-0.18	-0.49	-0.79	-1.10	-1.41	-1.71	-2.02

최대 손실 시나리오

위험액	-2.02
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.27
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

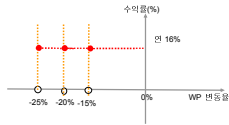
1. 계약금액

단위:백만원						
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

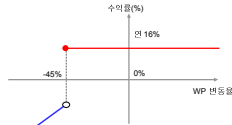
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째), 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 10%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 110%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)
KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	30.39	24.90	19.42	13.93	8.45	2.96	-2.52
손리	5.33%	26.38	20.90	15.41	9.93	4.44	-1.04	-6.53
오	2.67%	21.74	16.25	10.77	5.28	-0.20	-5.69	-11.17
0%	16.45	10.97	5.48	0.00	-3.98	-10.97	-16.45	
-2.67%	10.53	5.05	-0.44	-5.92	-11.40	-16.89	-22.37	
-5.33%	3.98	-1.51	-6.99	-12.48	-17.96	-23.45	-28.93	
-8%	-3.22	-8.70	-14.19	-19.67	-25.16	-30.64	-36.13	

최대 손실 시나리오

위험액	-36.13
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	40.69
-----	-------

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

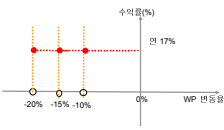
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

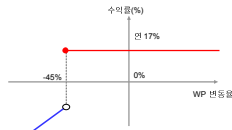
2. 연기사실의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 현대차 보통주
- 연기: 2012년 4월 27일
- 연도청산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2009년 4월 30일 LG전자 보통주, 현대차 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 현대차 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 연기사실의 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 월드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우
 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (연기사실지수/최초기준지수)
- 연도청산의 수익구조

초기상환 시 손익구조



연기사실 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	28.67	22.83	16.99	11.16	5.32	-0.52	-6.36
시나리오	5.33%	26.37	20.53	14.69	8.86	3.02	-2.82	-8.66
	2.67%	22.65	16.81	10.97	5.14	-0.70	-6.54	-12.38
	0%	17.51	11.68	5.84	0.00	-6.84	-11.68	-17.51
	-2.67%	10.96	5.12	-0.72	-6.55	-12.39	-18.23	-24.07
	-5.33%	2.99	-2.85	-8.69	-14.53	-20.36	-26.20	-32.04
	-8%	-6.40	-12.24	-18.08	-23.92	-29.75	-35.59	-41.43

최대 손실 시나리오

위험액	-41.43
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	45.51
-----	-------

[94] 데리츠281사모증권HCSV-1

1. 계약금액

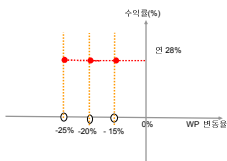
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위(백만원)

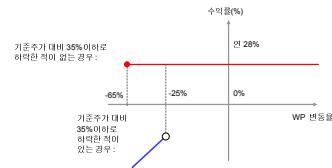
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주
- 2) 만기: 2012년 4월 27일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2000년 4월 30일 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(현대차 보통주, 삼성증권업 보통주 주가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 만을 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권리 행사
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우
 : 원금 * 128%
 - 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드리의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))
KR6622301W55 교보증권(ELS)336

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	46.30	36.86	27.42	17.97	8.53	-0.92	-10.36
시나리오	5.33%	41.05	31.61	22.17	12.72	3.28	-6.17	-15.61
	2.67%	35.06	25.62	16.17	6.73	-2.71	-12.16	-21.60
	0%	28.33	18.89	9.44	0.00	-9.44	-18.89	-28.33
	-2.67%	20.86	11.42	1.97	-7.47	-16.92	-26.36	-35.80
	-5.33%	12.65	3.21	-6.24	-15.66	-25.13	-34.57	-44.01
	-8%	3.70	-5.74	-15.19	-24.63	-34.08	-43.52	-52.97

최대 손실 시나리오

위험액	-52.97
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	50.27
-----	-------

[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호

1. 계약금액

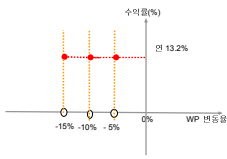
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위:백만원

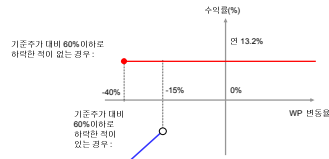
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 14일 삼성전자 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주 주가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산가액으로 각각 최초 기준가액의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 연율 13.2%의 수익률을 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환펀드 기준가액의 60%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우 : 평균 * 113.2%
 - 두 기초자산의 가액(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 60%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))
KR6621307W59 표본증권(ELS)341

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.83	-0.95	-1.06	-1.21	-1.33	-1.46	-1.59
	5.33%	0.04	-0.09	-0.22	-0.35	-0.47	-0.60	-0.73
시나리오	2.67%	0.44	0.31	0.18	0.06	-0.07	-0.20	-0.32
	0%	0.36	0.25	0.13	0.00	-0.13	-0.25	-0.36
	-2.67%	-0.14	-0.26	-0.39	-0.52	-0.64	-0.77	-0.90
	-5.33%	-1.11	-1.24	-1.37	-1.49	-1.62	-1.75	-1.87
	-8%	-2.55	-2.68	-2.80	-2.93	-3.06	-3.18	-3.31

최대 손실 시나리오

위험액	-3.31
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.07
-----	------