

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

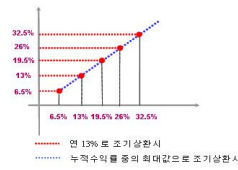
4) 기준지수: 2007년 4월 5일의 KOSPI200, NIKKEI225 증가

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 중도상환됨.
 액면금액 X (100% + MAX(연 13%, 누적수익률))
 (누적수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계, 특별수익률은 각 월별 누적수익률 중 최대값)

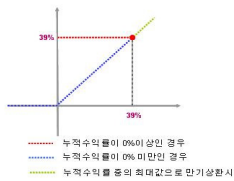
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 누적 수익률])

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
	5.33%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	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%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
-8%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

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 수익률의 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 (원금보장채주)

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 시나리오	8%	0.10	0.07	0.04	0.01	-0.01	-0.04	-0.07
	5.33%	0.10	0.07	0.04	0.02	-0.01	-0.04	-0.07
	2.67%	0.10	0.07	0.04	0.01	-0.02	-0.05	-0.08
	0%	0.09	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09
	-2.67%	0.07	0.04	0.01	-0.02	-0.04	-0.07	-0.10
	-5.33%	0.05	0.02	-0.01	-0.04	-0.06	-0.09	-0.12
	-8%	0.02	-0.00	-0.03	-0.06	-0.09	-0.12	-0.15

최대 손실 시나리오

위험액	-0.15
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.18
-----	------

4) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자전략 4호

1. 계약금액

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

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 (원금보장추주)

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.48
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모펀위귀생상품투자신탁 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 펀드청산 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 펀드 해지

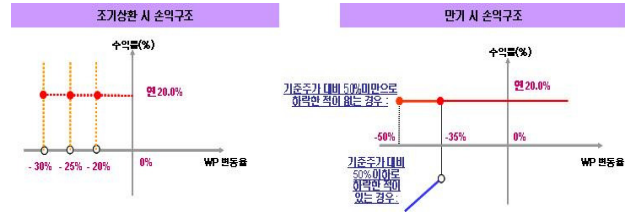
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 * 140%

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

: 할금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동 중(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR60376207AD 이력작성증권(ELS)243

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	13.96	12.77	11.58	10.40	9.21	8.03	6.84
	5.33%	10.75	9.56	8.37	7.19	6.00	4.81	3.63
	2.67%	7.28	6.09	4.91	3.72	2.53	1.35	0.16
	0%	3.56	2.37	1.19	0.00	-1.19	-2.37	-3.56
	-2.67%	-0.42	-1.60	-2.79	-3.98	-5.16	-6.35	-7.53
	-5.33%	-4.65	-5.83	-7.02	-8.21	-9.39	-10.58	-11.76
	-8%	-9.13	-10.32	-11.50	-12.69	-13.88	-15.06	-16.25

최대 손실 시나리오

위험액	-16.25
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	18.53
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자전략 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) 장외파생상품의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드청산 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(만기 상환일) 만을 15.8%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 각 중도상환일에 중도상환가격이 낮은 기초자산이 최초기준가격 보다 클 경우에는 보너스쿠폰을 지급하여 총 만을 31.6%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 만기 시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 청산

- 두 기초자산의 가격이 만비도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 만금 * 131.6%

- 두 기초자산의 가격(장중보합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 만금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345TTB9 만드증권(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	14.70	13.72	12.74	11.76	10.79	9.81	8.83
손익	5.33%	10.89	9.91	8.93	7.95	6.97	5.99	5.02
손익	2.67%	6.97	5.99	5.01	4.03	3.05	2.07	1.09
손익	0%	2.94	1.96	0.98	0.00	-0.98	-1.96	-2.94
손익	-2.67%	-1.20	-2.18	-3.16	-4.14	-5.12	-6.10	-7.08
손익	-5.33%	-5.46	-6.43	-7.41	-8.39	-9.37	-10.35	-11.33
손익	-8%	-9.62	-10.79	-11.77	-12.75	-13.73	-14.71	-15.69

최대 손실 시나리오

위험액	-15.69
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.77
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

구분	기래대상	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) 연기: 2010년 2월 22일

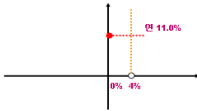
3) 만도침산 결정주기: 매 3개월

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

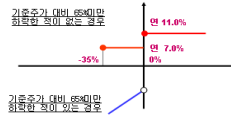
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이 상한 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 폐지
 - 두 기초자산의 가격이 만도트 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%초과 하락한 적이 있는 경우 : 원금 X (반기기준지수/최초기준지수)

6) 만도의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 만도증권(ELS) 2010-3974

손익 구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	441.82	419.14	396.46	373.77	351.09	328.41	305.73
	5.33%	316.00	293.32	270.63	247.95	225.27	202.59	179.90
	2.67%	191.41	168.73	146.04	123.36	100.68	78.00	55.31
	0%	68.05	45.36	22.68	0.00	-22.68	-45.36	-68.05
	-2.67%	-54.08	-76.76	-99.45	-122.13	-144.81	-167.49	-190.18
	-5.33%	-174.98	-197.66	-220.35	-243.03	-265.71	-288.39	-311.08
	-8%	-294.65	-317.33	-340.01	-362.70	-385.38	-408.06	-430.74

최대 손실 시나리오

위험액 -430.74

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 422.35

[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

연월 11.2%의 수익률로 중도상환이 됨.

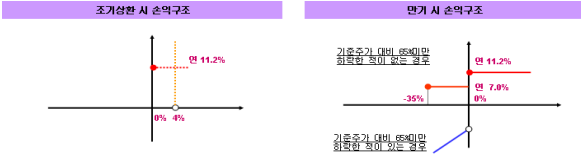
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 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)

KR60034SST27 최대 손실 (ELS) 2007-3984

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	42.59	40.42	38.24	36.07	33.90	31.73	29.56
5.33%	30.43	28.26	26.09	23.92	21.74	19.57	17.40
2.67%	18.41	16.24	14.06	11.89	9.72	7.55	5.38
0%	6.52	4.34	2.17	0.00	-2.17	-4.34	-6.52
-2.67%	-5.24	-7.42	-9.59	-11.76	-13.93	-16.10	-18.28
-5.33%	-16.67	-19.04	-21.21	-23.39	-25.56	-27.73	-29.90
-8%	-28.37	-30.54	-32.71	-34.88	-37.05	-39.23	-41.40

최대 손실 시나리오

위험액	-41.40
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	41.26
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

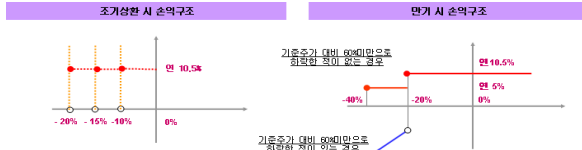
1. 계약금액

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 기건을 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. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR600172YT43 신영증권(ELS)552

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	541.63	499.57	457.50	415.44	373.38	331.32	289.25
5.33%	415.76	373.70	331.64	289.57	247.51	205.45	163.39
2.67%	277.28	235.22	193.16	151.09	109.03	66.97	24.91
0%	126.19	84.13	42.06	0.00	-42.06	-84.13	-126.19
-2.67%	-37.52	-79.58	-121.64	-163.71	-205.77	-247.83	-289.90
-5.33%	-213.84	-255.90	-297.96	-340.03	-382.09	-424.15	-466.22
-8%	-402.77	-444.84	-486.90	-528.96	-571.02	-613.09	-655.15

최대 손실 시나리오	
위험액	-655.15

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	654.02
-----	--------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

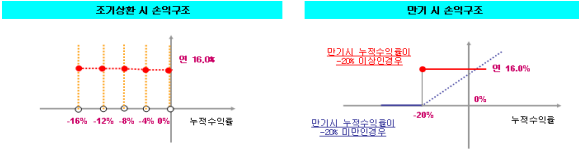
1. 계약금액

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 기건을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 초기 상환 설정일에 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, 만기시점까지 초기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 누적 수익률])
- 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007-504
수익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.18	0.08	-0.01	-0.11	-0.20	-0.30	-0.39
	5.33%	0.27	0.17	0.06	-0.02	-0.11	-0.21	-0.30
	2.67%	0.31	0.21	0.11	0.02	-0.08	-0.17	-0.27
	0%	0.29	0.19	0.10	0.00	-0.10	-0.19	-0.29
	-2.67%	0.21	0.11	0.02	-0.08	-0.17	-0.27	-0.36
	-5.33%	0.08	-0.02	-0.11	-0.21	-0.30	-0.40	-0.49
	-8%	-0.11	-0.20	-0.30	-0.39	-0.49	-0.58	-0.68

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.66

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

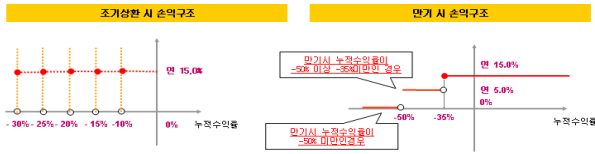
11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

						단위(백만원)	
구분	거래대상	거래종류	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) 만도점산 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 만도 해지
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%미만인 경우: 역면금액 지급 (원금보장추주)
- 6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상종형(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	2.38	1.96	1.54	1.12	0.70	0.27	-0.15
	5.33%	2.02	1.60	1.16	0.75	0.33	-0.09	-0.51
	2.67%	1.65	1.23	0.80	0.38	-0.04	-0.46	-0.88
	0%	1.26	0.84	0.42	0.00	-0.42	-0.84	-1.26
	-2.67%	0.87	0.45	0.03	-0.39	-0.81	-1.24	-1.66
	-5.33%	0.47	0.05	-0.37	-0.60	-1.22	-1.64	-2.06
	-8%	0.05	-0.37	-0.79	-1.21	-1.63	-2.05	-2.47

최대 손실 시나리오

위험액 -2.47

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1.89

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제10호

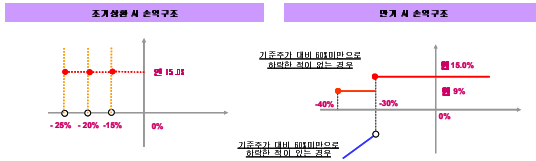
1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,623	0	1,623	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762L197 미래예상증권(ELS)219

손익구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	239.75	234.84	229.94	225.04	220.13	215.23	210.32
	5.33%	171.48	166.57	161.67	156.76	151.86	146.95	142.05
	2.67%	96.47	91.56	86.66	81.75	76.85	71.94	67.04
	0%	14.71	9.81	4.90	0.00	-4.90	-9.81	-14.71
	-2.67%	-73.78	-78.68	-83.59	-88.49	-93.40	-98.30	-103.21
	-5.33%	-169.01	-173.92	-178.82	-183.73	-188.63	-193.53	-198.44
	-8%	-270.98	-275.89	-280.79	-285.70	-290.60	-295.51	-300.41

최대 손실 시나리오

위험액	-300.41
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	317.98
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

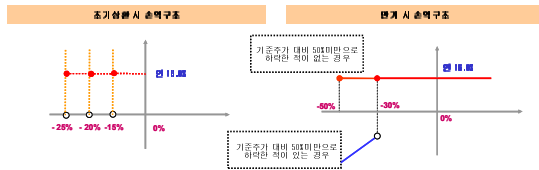
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 14일
- 3) 만드청산 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 기초자산기준으로 각각 최초기준가격의 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 만드청산이 됨.
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 132%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 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%	165.36	158.46	151.57	144.67	137.77	130.88	123.98
	5.33%	115.81	108.92	102.02	95.13	88.23	81.33	74.44
	2.67%	67.59	60.69	53.80	46.90	40.01	33.11	26.21
	0%	20.69	13.79	6.90	0.00	-6.90	-13.79	-20.69
	-2.67%	-24.89	-31.79	-38.69	-45.58	-52.48	-59.37	-66.27
	-5.33%	-69.15	-76.05	-82.95	-89.84	-96.74	-103.63	-110.53
	-8%	-112.09	-118.99	-125.89	-132.78	-139.68	-146.57	-153.47
	최대 손실 시나리오	위험액	-163.47					

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	162.27
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제13호

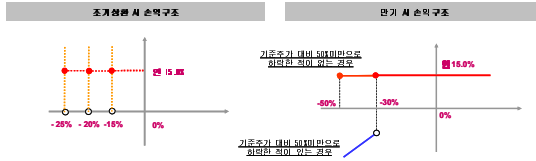
1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50	0	50	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 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 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
- 두 기초자산의 가격(중도포함)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))

KR603762B1B0 비례예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.12	4.83	4.55	4.27	3.99	3.71	3.43
	5.33%	3.82	3.54	3.26	2.98	2.70	2.42	2.14
	2.67%	2.40	2.12	1.84	1.56	1.27	0.99	0.71
	0%	0.84	0.56	0.28	0.00	-0.28	-0.56	-0.84
	-2.67%	-0.84	-1.13	-1.41	-1.69	-1.97	-2.25	-2.53
	-5.33%	-2.66	-2.95	-3.23	-3.51	-3.79	-4.07	-4.35
	-8%	-4.62	-4.90	-5.18	-5.46	-5.74	-6.02	-6.30

최대 손실 시나리오

위험액	-6.30
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	6.74
-----	------

[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자전략 15호

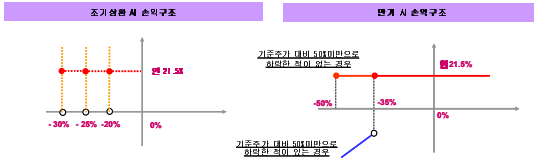
1. 계약금액

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

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. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345EV11 변동주변(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	212.82	187.66	162.51	137.35	112.19	87.03	61.87
시나리오	5.33%	166.64	141.49	116.33	91.17	66.01	40.85	15.70
	2.67%	120.86	95.70	70.55	45.39	20.23	-4.93	-30.09
	0%	75.47	50.32	25.16	0.00	-25.16	-50.32	-75.47
	-2.67%	30.48	5.32	-19.83	-44.99	-70.15	-95.31	-120.47
	-5.33%	-14.12	-39.27	-64.43	-89.59	-114.75	-139.91	-165.06
	-8%	-58.32	-83.48	-108.63	-133.79	-158.95	-184.11	-209.27

최대 손실 시나리오

위험액	-209.27
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	238.14
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 피생상품 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

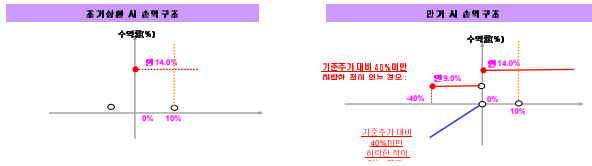
3) 만도침산 결정주기: 매3개월

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 한번이라도 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 한번도 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 배우증권(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	522.19	493.14	464.06	435.03	405.98	376.93	347.87
	5.33%	387.03	357.98	328.93	299.87	270.82	241.77	212.72
시나리오	2.67%	242.02	212.97	183.92	154.86	125.81	96.76	67.71
	0%	87.16	58.10	29.05	0.00	-29.05	-58.10	-87.16
	-2.67%	-77.96	-106.81	-135.66	-164.51	-193.37	-222.22	-251.07
	-5.33%	-252.13	-281.18	-310.23	-339.28	-368.33	-397.39	-426.44
	-8%	-436.55	-465.60	-494.65	-523.70	-552.75	-581.81	-610.86

최대 손실 시나리오

위험액	-610.86
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	598.82
-----	--------

[17]테리 조StepDown사모단위 퍼센트26호

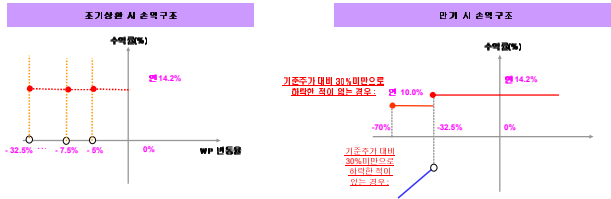
1. 계약금액

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

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 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기한을 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.
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 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 코무담신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	217.95	183.01	148.07	113.13	78.19	43.25	8.31
	5.33%	180.94	146.00	111.06	76.12	41.18	6.24	-28.70
	2.67%	143.23	108.29	73.35	38.41	3.47	-31.47	-66.41
	0%	104.82	69.88	34.94	0.00	-34.94	-69.88	-104.82
	-2.67%	65.71	30.77	-4.17	-39.11	-74.05	-108.99	-143.93
	-5.33%	25.90	-9.04	-43.99	-78.93	-113.87	-148.81	-183.75
	-8%	-14.62	-49.56	-84.50	-119.44	-154.38	-189.32	-224.26

최대 손실 시나리오	
위험액	-224.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	200.74
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

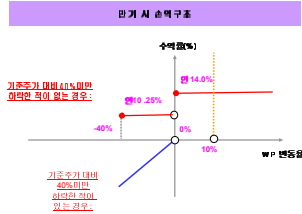
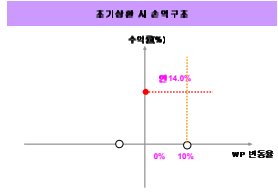
1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	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) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 15일 LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주의 증가
- 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 한번이라도 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 환비도 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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

구분	손익 구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	117.51	110.53	103.54	96.55	89.56	82.57	75.58
	5.33%	84.48	77.49	70.50	63.51	56.52	49.53	42.54
시나리오	2.67%	52.30	45.31	38.32	31.33	24.34	17.35	10.36
	0%	20.97	13.98	6.99	0.00	-6.99	-13.98	-20.97
	-2.67%	-9.51	-16.50	-23.49	-30.48	-37.47	-44.46	-51.45
	-5.33%	-39.13	-46.12	-53.11	-60.10	-67.09	-74.08	-81.07
	-8%	-67.91	-74.90	-81.89	-88.88	-95.87	-102.86	-109.85

최대 손실 시나리오	
위험액	75.58

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	110.81
-----	--------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가5호

1. 계약금액

구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(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) 펀드청산 결정일자: 매 6개월

4) 기준일자: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

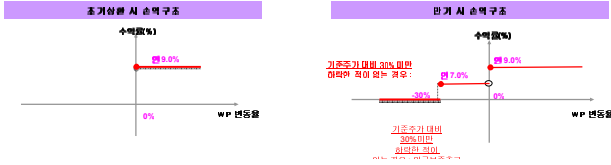
단, 평가시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락한적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 * 121%

- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한적이 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%	36.22	32.72	29.23	25.73	22.24	18.74	15.24
	5.33%	28.07	24.57	21.07	17.58	14.08	10.59	7.09
	2.67%	19.49	15.99	12.50	9.00	5.50	2.01	-1.49
	0%	10.49	6.99	3.50	0.00	-3.50	-6.99	-10.49
	-2.67%	1.06	-2.43	-5.93	-9.42	-12.92	-16.42	-19.91
	-5.33%	-8.78	-12.28	-15.78	-19.27	-22.77	-26.27	-29.76
-8%	-19.06	-22.55	-26.05	-29.54	-33.04	-36.54	-40.03	

최대 손실 시나리오

위험액	15.24
-----	-------

4. 파생상품의 최대 예상금액 (단위:백만원)

위험액	41.20
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼싱 6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 2월 21일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 종가

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.

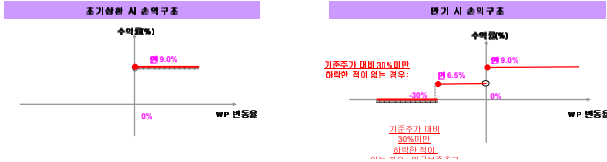
단, 평가시까지 조기상환조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 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 미래에셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	22.67	20.10	17.53	14.96	12.39	9.81	7.24
	5.33%	18.27	15.70	13.13	10.55	7.98	5.41	2.84
	2.67%	13.28	10.71	8.14	5.57	3.00	0.43	-2.15
	0%	7.71	5.14	2.57	0.00	-2.57	-5.14	-7.71
	-2.67%	1.56	-1.01	-3.56	-6.15	-8.72	-11.30	-13.87
	-5.33%	-5.17	-7.74	-10.32	-12.89	-15.46	-18.03	-20.60
	-8%	-12.49	-15.06	-17.64	-20.21	-22.78	-25.35	-27.92

최대 손실 시나리오

위험액	7.24
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.56
-----	-------

[2] 메리츠치주연계사모단위파생7호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(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) 만도형산결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

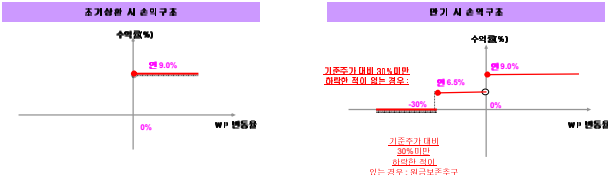
단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가격이 만도기준가격의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%

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

: 원금*100%

6) 만도의 수익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV22 미래예정종금(ELS)317

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	17.63	15.63	13.63	11.63	9.63	7.63	5.63
	5.33%	14.21	12.21	10.21	8.21	6.21	4.21	2.21
시나리오	2.67%	10.33	8.33	6.33	4.33	2.33	0.33	-1.67
	0%	6.00	4.00	2.00	0.00	-2.00	-4.00	-6.00
	-2.67%	1.22	-0.78	-2.78	-4.79	-6.79	-8.79	-10.79
	-5.33%	-4.02	-6.02	-8.02	-10.02	-12.02	-14.02	-16.02
	-8%	-9.72	-11.72	-13.72	-15.72	-17.72	-19.72	-21.72

최대 손실 시나리오

위험액	5.63
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.54
-----	-------

[23] 매리츠일종지수연계사모파생1호

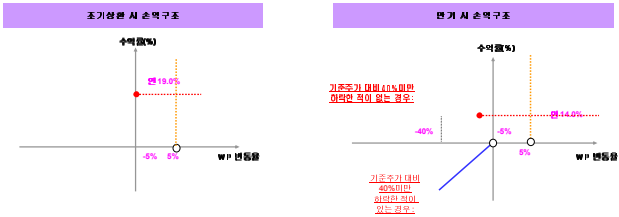
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수
- 만기: 2010년 08월 04일
- 관드첨산 결정주기: 매 3개월
- 기준지수: 2008년 8월 7일 NIKKEI225, HSCEI지수의 증가
- 발행 후 매 3개월마다 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 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 관드 후 만드 때까지
 - 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/초기 기준지수)
- 관드의 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%	131.09	121.43	111.78	102.13	92.48	82.83	73.18
	5.33%	97.55	87.89	78.24	68.59	58.94	49.29	39.64
	2.67%	63.50	53.85	44.20	34.55	24.90	15.25	5.59
	0%	28.95	19.30	9.65	0.00	-9.65	-19.30	-28.95
	-2.67%	-6.10	-15.75	-25.40	-35.05	-44.70	-54.35	-64.01
	-5.33%	-41.66	-51.31	-60.96	-70.61	-80.26	-89.91	-99.56
	-8%	-77.72	-87.37	-97.02	-106.67	-116.32	-125.97	-135.62

최대 손실 시나리오	
위험액	-135.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	131.93
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품SEPO-1호

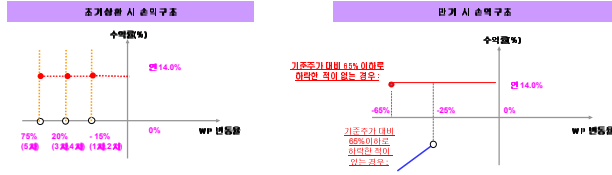
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(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 중도상환 가격 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 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 확정
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 48%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 142%
 - 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%	-1.36	-11.79	-12.23	-12.67	-13.10	-13.54	-13.97
	5.33%	-3.80	-4.24	-4.67	-5.11	-5.55	-5.98	-6.42
	2.67%	0.42	-0.02	-0.45	-0.89	-1.32	-1.76	-2.19
	0%	1.31	0.87	0.44	0.00	-0.44	-0.87	-1.31
	-2.67%	-1.14	-1.58	-2.01	-2.45	-2.88	-3.32	-3.75
	-5.33%	-6.92	-7.36	-7.79	-8.23	-8.66	-9.10	-9.54
	-8%	-16.04	-16.47	-16.91	-17.34	-17.78	-18.22	-18.65

최대 손실 시나리오

위험액 -18.65

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 14.25

[25] 테라즈 주가지수연계사모펀생상품 제 1호

1. 계약금액

구분	기래대상	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

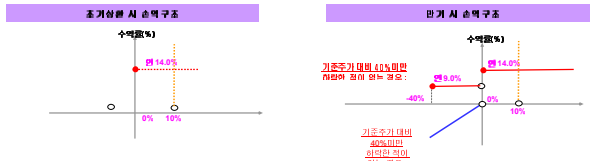
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

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 중도 상환

- 단, 만기까지 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 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	640.01	604.40	568.80	533.19	497.58	461.97	426.37
5.33%	474.36	438.75	403.14	367.54	331.93	296.32	260.71
2.67%	296.63	261.02	225.41	189.81	154.20	118.59	82.98
0%	106.82	71.21	35.61	0.00	-35.61	-71.21	-106.82
-2.67%	-95.06	-130.67	-166.27	-201.88	-237.49	-273.10	-308.70
-5.33%	-309.01	-344.62	-380.23	-415.84	-451.44	-487.05	-522.66
-8%	-535.05	-570.65	-606.26	-641.87	-677.48	-713.08	-748.69

최대 손실 시나리오

위험액 -748.69

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 733.94

[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1

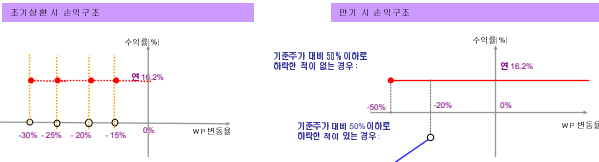
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(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 증가
- 5) 발행 후 매 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%	0.89	0.61	0.32	0.03	-0.26	-0.55	-0.83
	5.33%	1.35	1.06	0.78	0.49	0.20	-0.09	-0.38
	2.67%	1.34	1.05	0.77	0.48	0.19	-0.10	-0.39
	0%	0.86	0.58	0.29	0.00	-0.29	-0.58	-0.86
	-2.67%	-0.08	-0.37	-0.66	-0.95	-1.23	-1.52	-1.81
	-5.33%	-1.50	-1.78	-2.07	-2.36	-2.65	-2.93	-3.22
	-8%	-3.38	-3.66	-3.95	-4.24	-4.53	-4.81	-5.10

최대 손실 시나리오

위험액 -5.10

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 5.09

[29] 테라즈2Star파생 SEPO-2호

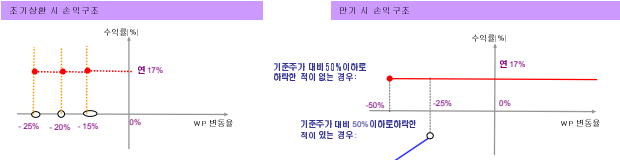
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	승모자산(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,096	0	1,096	상위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 만기: 2011년 09월 23일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2008년 09월 26일 삼성전자, POSCO의 증가
- 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)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) 변할17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 - 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 151.0%
 - 두 기초자산의 가액(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조



3. 손익구조인출(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%	7.15	5.30	3.45	1.59	-0.26	-2.12	-3.97
	5.33%	8.43	6.58	4.72	2.87	1.01	-0.84	-2.70
	2.67%	7.90	6.05	4.19	2.34	0.48	-1.37	-3.23
	0%	5.56	3.71	1.85	0.00	-1.85	-3.71	-5.56
	-2.67%	1.42	-0.43	-2.29	-4.14	-6.00	-7.85	-9.71
	-5.33%	-4.53	-6.38	-8.24	-10.09	-11.94	-13.80	-15.65
	-8%	-12.28	-14.14	-15.99	-17.84	-19.70	-21.55	-23.41
	최대 손실 시나리오							
위험액	-23.41							

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	23.98
-----	-------

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

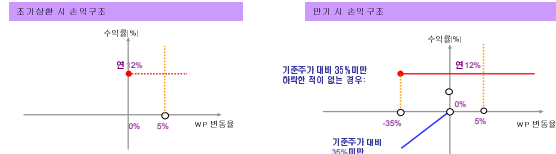
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

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 상환결정일에 최초기준가액 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포화하여 한변이라도 최초기준가액 대비 5%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (8차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격 이 환변도 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 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. 수익구조인 줄(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6583337V98 현대증권(ELS)2008-945

수익구조변동 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
-----	------

[34] 대리 조주가지 수연계 파생13

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

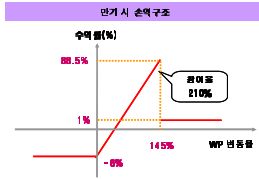
1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 1월 12일

3) 펀드청산 결정주기: 만기일 가일 1회

4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 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%
 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우
 : 원금 * 101%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동(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%	
기초자산 시나리오	8%	-34.17	-44.43	-54.70	-64.97	-75.24	-85.51	-95.77
	5.33%	-9.53	-19.79	-30.06	-40.33	-50.60	-60.86	-71.13
	2.67%	1.213	1.86	-8.40	-16.67	-28.94	-39.21	-49.48
	0%	30.80	20.54	10.27	0.00	-10.27	-20.54	-30.80
	-2.67%	46.49	36.22	25.96	15.69	5.42	-4.85	-15.12
	-5.33%	59.19	48.93	38.66	28.39	18.12	7.86	-2.41
	-8%	68.91	58.64	48.38	38.11	27.84	17.57	7.31

최대 손실 시나리오

위험액	7.31
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	64.33
-----	-------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

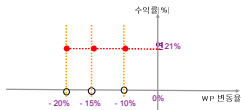
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

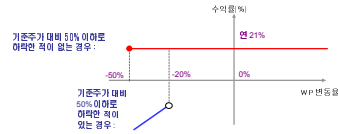
2. 만기시점의 손익구조

- 파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 만기: 2012년 02월 15일
- 중간평가일: 매6개월
- 기준지수: 2009년 02월 13일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 발행 후 6개월마다 중간평가를 시행하고, 기초자산(삼성전자 증가, SK텔레콤의 증가)의 평가일 증가가 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중간평가일), 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중간평가일), 80%이상인 경우(다섯번째 중간평가일) 인출 21.0%의 수익률로 종료 상황이 됨.
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 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 만기이상 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

초기상환 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%	7.24	5.79	4.35	2.90	1.45	0.01	-1.44
	5.33%	6.83	5.39	3.94	2.49	1.05	-0.40	-1.84
	2.67%	5.87	4.42	2.97	1.53	0.08	-1.36	-2.81
	0%	4.34	2.89	1.45	0.00	-1.45	-2.89	-4.34
	-2.67%	2.25	0.80	-0.64	-2.09	-3.53	-4.98	-6.43
	-5.33%	-0.40	-1.85	-3.29	-4.74	-6.18	-7.63	-9.08
	-8%	-3.61	-5.06	-6.50	-7.95	-9.39	-10.84	-12.29

최대 손실 시나리오

위험액	-12.29
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.17
-----	-------

[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	잔위

단위(백만원)

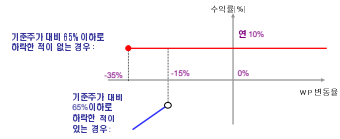
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 17일
- 3) 만기점산 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 0.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 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%	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 (다위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[80-2] 메리츠투자지수형계사모증권2호
 KR600594WVJ5 우리투자증권(ELS)1989

1. 계약금액

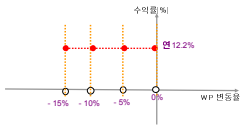
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

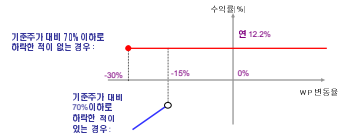
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산가중으로 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(장종포함)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
 KR600690MMV7 대우증권ELS2697

1. 계약금액

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

단위(백만원)

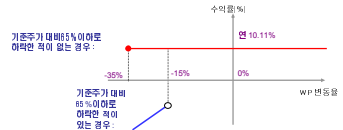
2. 연가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 14일
- 3) 펀드형산 결정주기: 매4개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월 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 수익구조



만기 시 수익구조



[80-4] 매리츠투자지수연계사모증권2.-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, 기준자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이

낮은 기준자산기준으로 각각 최초 기준가격의 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, 만기시 까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도침지

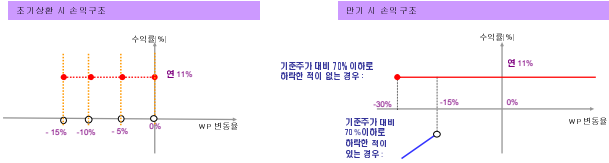
- 두 기준자산의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

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

: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조



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

1. 계약금액

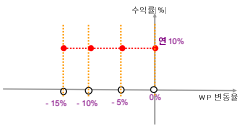
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액금(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

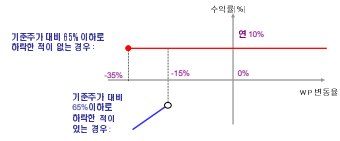
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 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 10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

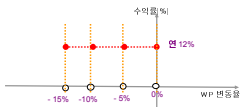
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

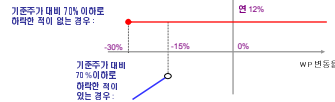
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 6월 12일
- 3) 펀드청산결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기 초자산의 가격 이 한번도 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기 초자산의 가격 (중중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기 준지수/최초기 준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-7] 메리츠투자지수연계사모증권2호
 KR6030617V67
 교보증권(ELS)Z27회

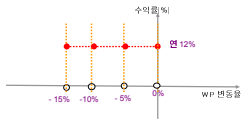
1. 계약금액

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 6월 10일
- 3) 권드청산 결정 주기 : 매3개월
- 4) 기 준지수 : 2008년 6월 10일 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) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환조건을 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 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-8] 메리츠투자지수형계사모증권2호
 KR6030617V83
 교보증권(ELS)269회

1. 계약금액

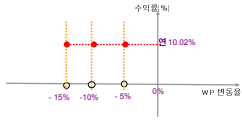
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 6월 18일
- 3) 권드청산 결정 주기: 매4개월
- 4) 기 준지수: 2008년 6월 18일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 만을 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기 초자산의 가격이 환반드 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 110.02%
 - 두 기 초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-9] 메리츠투자지수연계사모증권2호
 KR6030618V58
 교보증권(ELS)199회

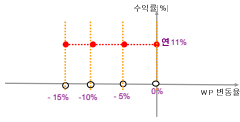
1. 계약금액

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) 장외파생상품과 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, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네 번째 중도상환일) 만을 11%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기 초자산의 가격이 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 111%
 - 두 기 초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] **메리츠투자자산수익계사로증권2호**

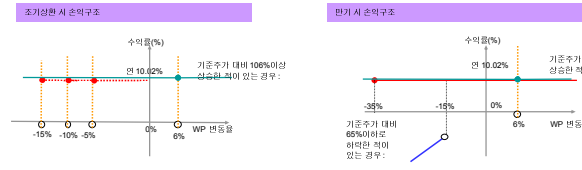
1. **계약금액**

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/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 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	-9.97	-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] 데리츠2Star사모증권투신LEHC-2

1. 계약금액

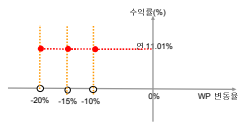
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	잔액

단위(백만원)

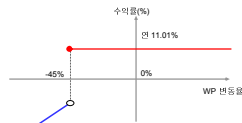
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 만기: 2012년 4월 12일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차지수의 증가
- 실행 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, 만기시까지 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%	1.02	0.73	0.45	0.16	-0.13	-0.41	-0.70	
	5.33%	1.08	0.80	0.51	0.23	-0.06	-0.35	-0.63	
	2.67%	1.03	0.74	0.46	0.17	-0.11	-0.40	-0.69	
	0%	0.86	0.57	0.29	0.00	-0.29	-0.57	-0.86	
	-2.67%	0.57	0.28	-0.00	-0.29	-0.58	-0.86	-1.15	
	-5.33%	0.16	-0.12	-0.41	-0.70	-0.98	-1.27	-1.56	
	-8%	-0.36	-0.65	-0.94	-1.22	-1.51	-1.79	-2.08	

최대 손실 시나리오

위험액 -2.08

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 9.05

[62] 테리츠2Star사모증권투자STWF-1

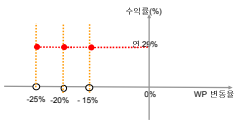
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	약수(1)	약도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771		잔액

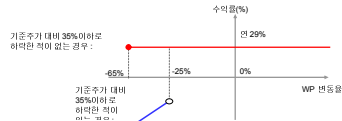
2. 만기시점의 손익구조

- 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 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.9%
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
 6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 표보통권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-2.38	-3.37	-4.37	-5.36	-6.36	-7.35	-8.34
	5.33%	-1.29	-2.28	-3.26	-4.27	-5.27	-6.26	-7.25
	2.67%	0.50	-0.50	-1.49	-2.49	-3.48	-4.47	-5.47
	0%	2.98	1.99	0.99	0.00	-0.98	-1.98	-2.98
	-2.67%	6.17	5.17	4.16	3.16	2.19	1.20	0.20
	-8%	14.63	13.63	12.64	11.65	10.65	9.66	8.66

최대 손실 시나리오

위험액	8.66
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	41.67
-----	-------

[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

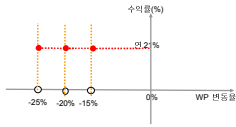
3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

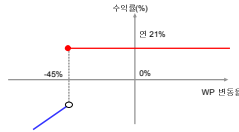
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보충주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 21%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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%	2.26	1.62	0.99	0.36	-0.28	-0.91	-1.54
시나리오	5.33%	2.40	1.77	1.13	0.50	-0.14	-0.77	-1.40
	2.67%	2.28	1.65	1.01	0.38	-0.25	-0.89	-1.52
	0%	1.90	1.27	0.63	0.00	-0.63	-1.27	-1.90
	-2.67%	1.26	0.63	-0.07	-0.64	-1.27	-1.91	-2.54
	-5.33%	0.36	-0.27	-0.91	-1.54	-2.18	-2.81	-3.44
	-8%	-0.80	-1.44	-2.07	-2.70	-3.34	-3.97	-4.60

최대 손실 시나리오

위험액	-4.60
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.04
-----	-------

[67] 테리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드칭산 결정주기: 매6개월

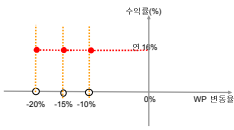
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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.

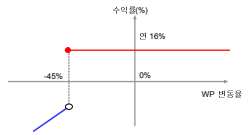
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 11.6%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.84	1.11	0.38	-0.35	-1.08	-1.81	-2.54
시나리오	5.33%	2.48	1.76	1.03	0.30	-0.43	-1.16	-1.89
	2.67%	2.60	1.87	1.14	0.41	-0.31	-1.04	-1.77
	0%	2.19	1.46	0.73	0.00	-0.73	-1.46	-2.19
	-2.67%	1.24	0.51	-0.22	-0.95	-1.67	-2.40	-3.13
	-5.33%	-0.24	-0.96	-1.69	-2.42	-3.15	-3.88	-4.61
	-8%	-2.24	-2.97	-3.70	-4.43	-5.16	-5.89	-6.62

최대 손실 시나리오

위험액	-6.62
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.60
-----	------

[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

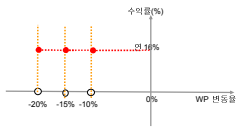
3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

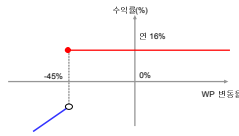
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 원금 + 11.6%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가액(중도포함)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 주권투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.33%	2.67%	0%	-2.67%	-5.33%	-8%	
	0.11	0.15	0.16	0.13	0.07	-0.01	-0.13	
	0.07	0.10	0.11	0.09	0.03	-0.06	-0.16	
	0.02	0.06	0.07	0.04	-0.01	-0.06	-0.22	
	-0.02	0.02	0.02	0.00	-0.06	-0.10	-0.26	
	-0.06	-0.03	-0.02	-0.04	-0.10	-0.19	-0.31	
	-0.11	-0.07	-0.06	-0.09	-0.14	-0.23	-0.35	
	-0.15	-0.11	-0.11	-0.13	-0.19	-0.28	-0.40	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.40
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.33
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(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) 만드청산 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.

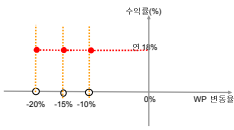
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우
: 원금 + 11.8%

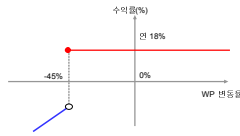
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
: 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동 (최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-2.65	-16.53	-20.20	-23.87	-27.54	-31.22	-34.89
시나리오	5.33%	-2.69	-6.37	-10.04	-13.71	-17.38	-21.06	-24.73
	2.67%	5.26	1.59	-2.06	-5.76	-9.43	-13.10	-16.77
	0%	11.02	7.35	3.67	0.00	-3.67	-7.35	-11.02
	-2.67%	14.57	10.90	7.23	3.55	-0.12	-3.79	-7.46
	-5.33%	15.92	12.25	8.58	4.91	1.23	-2.44	-6.11
	-8%	15.07	11.40	7.73	4.06	0.38	-3.29	-6.96

최대 손실 시나리오

위험액	-6.96
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.31
-----	-------

[68] 테리츠2Star사모증권SET-4호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

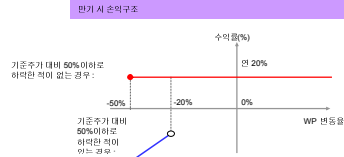
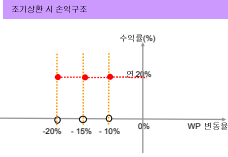
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

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 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 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

구분	손익 구조변동률 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.54	0.32	-0.91	-2.13	-3.35	-4.58	-5.80
시나리오	5.33%	2.65	1.43	0.20	-1.02	-2.24	-3.47	-4.69
	2.67%	3.36	2.14	0.91	-0.31	-1.53	-2.76	-3.98
	0%	3.67	2.45	1.22	0.00	-1.22	-2.45	-3.67
	-2.67%	3.58	2.36	1.13	-0.09	-1.31	-2.54	-3.76
	-5.33%	3.09	1.86	0.64	-0.58	-1.81	-3.03	-4.25
	-8%	2.20	0.97	-0.25	-1.41	-2.70	-3.92	-5.14

최대 손실 시나리오

위험액	-6.14
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.86
-----	-------

[76] 데리츠2Star사로 SEST-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드칭산 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.

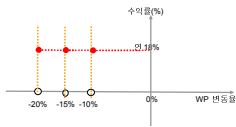
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

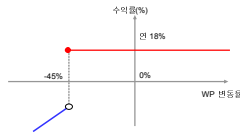
- 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-7.07	-9.09	-11.11	-13.13	-15.15	-17.17	-19.19
시나리오	5.33%	-1.48	-3.50	-5.52	-7.54	-9.56	-11.58	-13.60
	2.67%	2.89	0.87	-1.15	-3.17	-5.19	-7.21	-9.23
	0%	6.06	4.04	2.02	0.00	-2.02	-4.04	-6.06
	-2.67%	8.02	6.00	3.98	1.95	-0.07	-2.09	-4.11
	-5.33%	8.76	6.74	4.72	2.70	0.68	-1.34	-3.36
	-8%	8.29	6.27	4.25	2.23	0.21	-1.81	-3.83

최대 손실 시나리오

위험액	-3.83
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.38
-----	-------

[77] 테리츠2Star사로 SEST-3

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 29일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

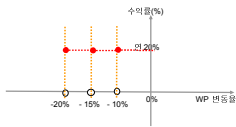
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

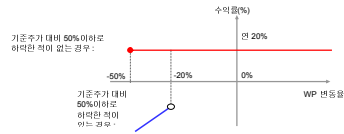
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



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 시나리오	8%	0.62	-0.27	-1.15	-2.04	-2.93	-3.81	-4.70	
	5.33%	1.85	0.96	0.07	-0.81	-1.70	-2.58	-3.47	
	2.67%	2.53	1.64	0.75	-0.13	-1.02	-1.90	-2.79	
	0%	2.66	1.77	0.89	0.00	-0.89	-1.77	-2.66	
	-2.67%	2.24	1.36	0.47	-0.42	-1.30	-2.19	-3.08	
최대 손실 시나리오	-5.33%	1.28	0.39	-0.50	-1.38	-2.27	-3.15	-4.04	
	-8%	-0.24	-1.12	-2.01	-2.90	-3.78	-4.67	-5.55	

최대 손실 시나리오

위험액	-6.66
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.91
-----	------

[78] 테리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

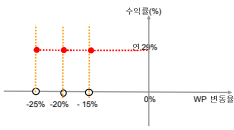
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융지주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기준자산기준으로 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.

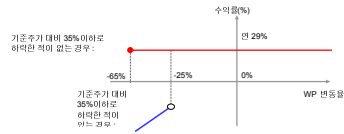
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
- 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12%
 - 두 기초자산의 가액(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6622313W42 표본증권(ELS)325

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				0	변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0		8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-2.07	-2.94	-3.80	-4.67	-5.53	-6.40	-7.26	
시나리오	5.33%	-1.12	-1.99	-2.85	-3.72	-4.58	-5.45	-6.32	
	2.67%	0.43	-0.43	-1.30	-2.16	-3.03	-3.89	-4.76	
	0%	2.60	1.73	0.87	0.00	-0.87	-1.73	-2.60	
	-2.67%	5.37	4.50	3.64	2.77	1.91	1.04	0.18	
	-5.33%	8.75	7.88	7.02	6.15	5.29	4.42	3.56	
	-8%	12.73	11.87	11.00	10.14	9.27	8.41	7.54	

최대 손실 시나리오

위험액	7.54
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	36.45
-----	-------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

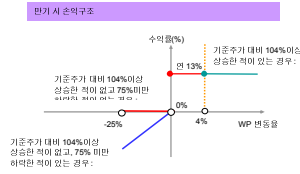
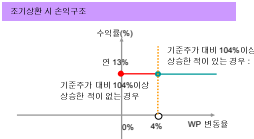
1. 계약금액

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 평가기간 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 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%이반으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.3%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%이반으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)
메리츠주가지수연계사모6호

구분	손익 구조변동률 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	8.33%	1.67%	25%	
기초자산	8%	8,792.06	8,118.55	7,445.05	6,771.54	6,098.04	5,424.53	4,751.02
	5.33%	6,544.50	5,871.00	5,197.49	4,523.99	3,850.48	3,176.97	2,503.47
	2.67%	4,287.32	3,613.82	2,940.31	2,266.81	1,593.30	919.79	246.29
시나리오	0%	2,020.52	1,347.01	673.51	0.00	-673.51	-1,347.01	-2,020.52
	-2.67%	-255.91	-929.42	-1,602.93	-2,276.43	-2,949.94	-3,623.44	-4,296.95
	-5.33%	-2,541.97	-3,215.48	-3,888.98	-4,562.49	-5,235.99	-5,909.50	-6,583.01
	-8%	-4,837.65	-5,511.16	-6,184.66	-6,858.17	-7,531.68	-8,205.18	-8,878.69

최대 손실 시나리오	
위험액	=6,878.69

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8,929.09
-----	----------

[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 매 3개월마다 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 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

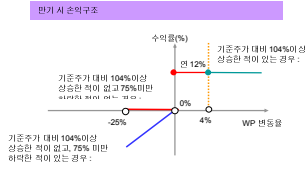
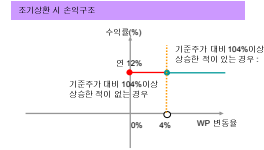
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우

: 원금 * 11.2%

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

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호

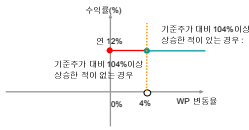
1. 계약금액

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

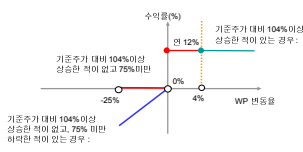
2. 만기시점의 수익구조

- 1) 정의피생상품의 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

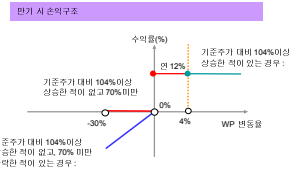
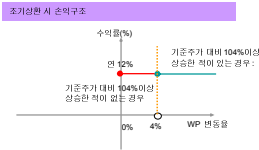
1. 계약금액

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 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 만드 해지
- 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 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/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	잔액

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

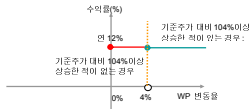
5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

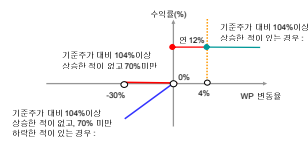
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 손익구조



KR600086767B7 국토님 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	잔액

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

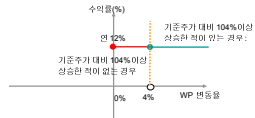
- 1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정점에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

단, 만기시 (12차 상황일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

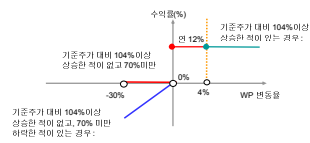
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600867CTB8 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

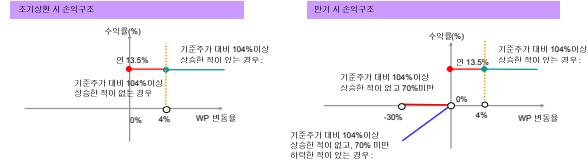
4) 기준지수: 2007년 12월 19일 KOSPI200지수의 증가

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

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

- 두 기초자산의 가격이 한비리드 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

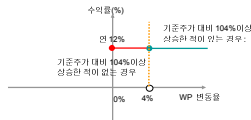
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000.0	0	5,000	차입

단위: (백만원)

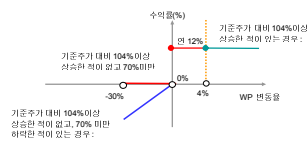
2. 만기시점의 손익구조

- 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 가격이 이 한번도 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

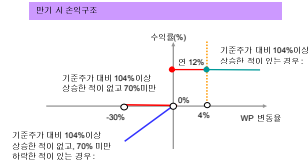
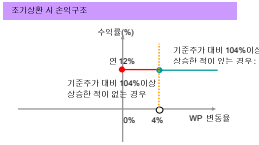
4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

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

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

- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함) 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

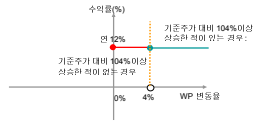
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

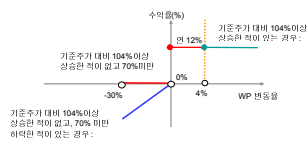
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일정에 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

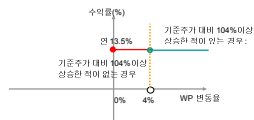
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

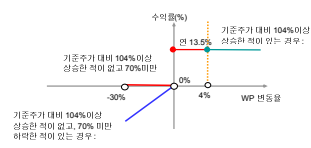
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 증도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 증도포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 증도 상환
 - 단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 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 (장종포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 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)

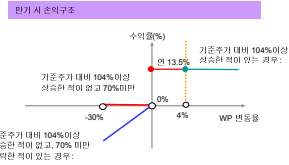
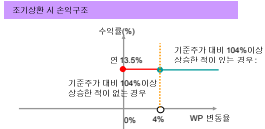
2. 만기시점의 손익구조

- 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

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

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))

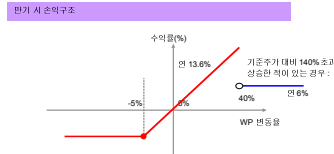
- 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우

: 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	8%	1.26	-0.21	-1.68	-3.15	-4.62	-6.09	-7.56
시나리오	5.33%	2.62	1.15	-0.32	-1.79	-3.26	-4.73	-6.20
	2.67%	3.67	2.20	0.73	-0.74	-2.21	-3.68	-5.15
	0%	4.41	2.94	1.47	0.00	-1.47	-2.94	-4.41
	-2.67%	4.84	3.37	1.90	0.43	-1.04	-2.51	-3.98
	-5.33%	4.96	3.49	2.02	0.55	-0.92	-2.39	-3.87
	-8%	4.77	3.30	1.83	0.36	-1.11	-2.58	-4.06

최대 손실 시나리오

위험액	-4.06
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.44
-----	------

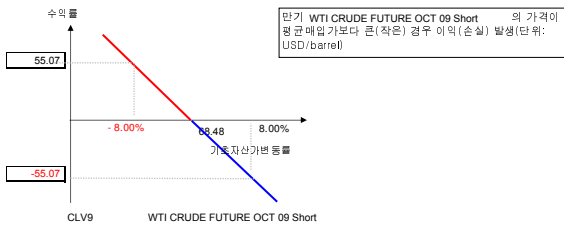
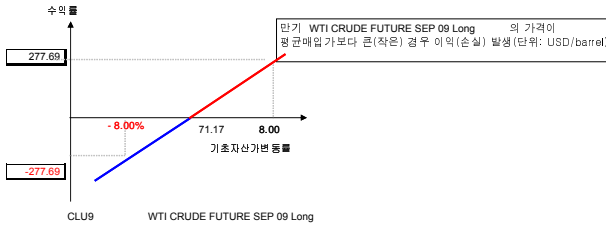
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	52	10	42	장내

단위:계약

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

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

구분	시나리오	손익
기초자산 시나리오	8%	222.62
	5.33%	148.32
	2.67%	74.30
	0%	0.00
	-2.67%	-74.30
	-5.33%	-148.32
	-8%	-222.62

최대손실 시나리오	
위험액	-222.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,348
-----	-------

[78] 데리 초주가지 수연계사모증권I(IE)

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. 연가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

2) 연가: 2010년 5월 28일

3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가액이

낮은 기초자산가액으로 각각 최초 기준가액의 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, 만기시 잔치 조가 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

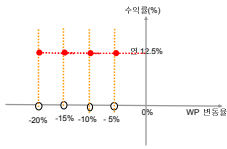
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 112.5%

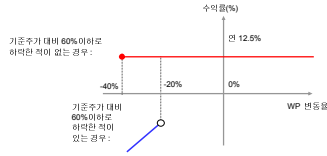
- 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6523310W80 대우증권ELS3005

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	0.21	0.21	0.21	0.21	0.21	0.21
	5.33%	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09
	2.67%	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	-0.00	-0.00
	-2.67%	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02
-5.33%	0.10	0.10	0.10	0.09	0.09	0.09	
-8%	0.21	0.21	0.21	0.21	0.21	0.21	

최대 손실 시나리오

위험액	0.21
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.20
-----	------

[79] 데리츠주가지 수연계사모증권! 61E

1. 계약금액

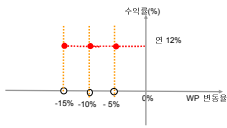
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	차입

단위: 백만원

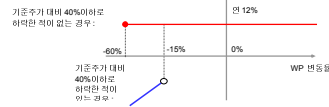
2. 연가시점의 손익구조

- 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 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%
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위: 백만원)
KR6503305W69 코모닝 신한증권(ELS)1039

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	-3.61	-5.29	-6.96	-8.67	-10.36	-12.04	-13.73
산	5.33%	2.46	0.78	-0.91	-2.60	-4.29	-5.97	-7.66
시나리오	2.67%	5.35	3.67	1.96	0.29	-1.40	-3.08	-4.77
	0%	8.06	6.36	4.69	3.00	1.36	-0.35	-2.06
	-2.67%	1.59	-0.09	-1.76	-3.47	-5.16	-6.85	-8.53
	-5.33%	-5.06	-6.74	-8.43	-10.12	-11.81	-13.49	-15.18
	-8%	-14.89	-16.57	-18.26	-19.95	-21.64	-23.32	-25.01

최대 손실 시나리오

위험액	-25.01
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	20.25
-----	-------

[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호

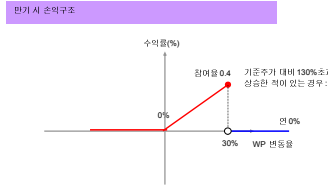
1. 계약금액

구분	기대대상	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))
 - : 원금 * 100%
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
 - : 원금 * 100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6673105W54 - 금융증권-채피플러스(ELS)91

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-1.51	-3.69	-5.86	-6.03	-10.21	-12.38	-14.55
손익	5.33%	1.53	-0.64	-2.81	-4.99	-7.16	-9.33	-11.51
손익	2.67%	4.21	2.04	-0.14	-2.31	-4.48	-6.66	-8.83
손익	0%	6.52	4.35	2.17	0.00	-2.17	-4.35	-6.52
손익	-2.67%	8.46	6.29	4.11	1.94	-0.23	-2.41	-4.58
손익	-5.33%	10.03	7.86	5.69	3.51	1.34	-0.83	-3.01
손익	-8%	11.24	9.06	6.89	4.72	2.54	0.37	-1.80

최대 손실 시나리오

위험액	-1.80
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.12
-----	-------

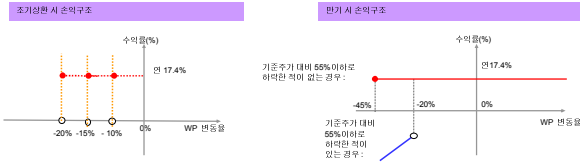
[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호

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 수익률을 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 : 평균 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

		변동성 시나리오						
구분		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초	8%	3.89	3.27	2.65	2.03	1.41	0.80	0.18
	5.33%	3.67	3.05	2.43	1.81	1.19	0.57	-0.05
산	2.67%	2.99	2.37	1.75	1.13	0.51	-0.11	-0.73
	0%	1.86	1.24	0.62	0.00	-0.62	-1.24	-1.86
시나리오	-2.67%	0.28	-0.34	-0.96	-1.58	-2.20	-2.82	-3.44
	-5.33%	-1.75	-2.37	-2.99	-3.61	-4.23	-4.85	-5.47
	-8%	-4.23	-4.85	-5.47	-6.09	-6.71	-7.33	-7.95

최대 손실 시나리오	
위험액	-7.95

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	10.32
-----	-------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

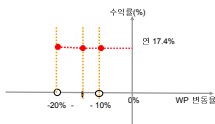
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

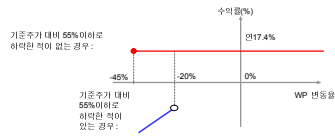
2. 만기시점의 손익구조

- 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 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반드 기준가액의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117.4%
- 두 기초자산의 가액 (중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조별 손 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	25.01	21.03	17.05	13.07	9.09	5.11	1.13
손실	5.33%	23.55	19.57	15.59	11.61	7.63	3.65	-0.33
손익	2.67%	19.19	15.21	11.23	7.25	3.27	-0.71	-4.69
시나리오	0%	11.94	7.96	3.98	0.00	-3.98	-7.96	-11.94
	-2.67%	1.80	-2.19	-6.17	-10.15	-14.13	-18.11	-22.09
	-5.33%	-11.25	-15.23	-19.21	-23.19	-27.17	-31.15	-35.13
	-8%	-27.18	-31.16	-35.15	-39.13	-43.11	-47.09	-51.07

최대 손실 시나리오

위험액	-51.07
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	66.32
-----	-------

[84] 데리츠2SIa사모증권SEPO-2호

1. 계약금액

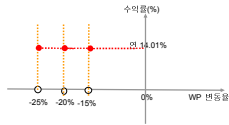
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: 백만원

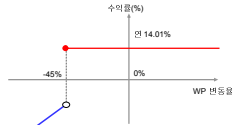
2. 만기시점의 손익구조

- 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
: 평균 * 114.01%
- 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 구조별 손(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)
KR6662305W64 - 한화스마트(ELS)132

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.24	0.12	0.00	-0.12	-0.23	-0.35	-0.47
	5.33%	0.42	0.30	0.18	0.06	-0.06	-0.18	-0.29
손익	2.67%	0.46	0.34	0.22	0.10	-0.02	-0.14	-0.26
	0%	0.36	0.24	0.12	0.00	-0.12	-0.24	-0.36
시나리오	-2.67%	0.12	-0.00	-0.12	-0.24	-0.36	-0.48	-0.59
	-5.33%	-0.26	-0.38	-0.50	-0.62	-0.73	-0.85	-0.97
	-8%	-0.78	-0.89	-1.01	-1.13	-1.25	-1.37	-1.49

최대 손실 시나리오	
위험액	-1.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	1.09
-----	------

[85] 테라츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

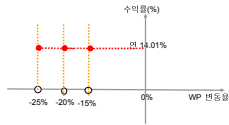
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

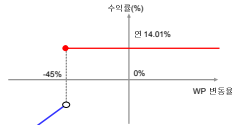
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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 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 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.66	0.44	0.01	-0.42	-0.65	-1.27	-1.70
손익	5.33%	1.50	1.08	0.65	0.22	-0.21	-0.63	-1.06
시나리오	2.67%	1.64	1.22	0.79	0.36	-0.07	-0.49	-0.92
	0%	1.26	0.85	0.43	0.00	-0.43	-0.85	-1.26
	-2.67%	0.42	-0.01	-0.43	-0.66	-1.29	-1.72	-2.14
	-5.33%	-0.94	-1.37	-1.80	-2.22	-2.65	-3.08	-3.51
	-8%	-2.80	-3.23	-3.66	-4.09	-4.51	-4.94	-5.37

최대 손실 시나리오

위험액	-5.37
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	3.95
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호

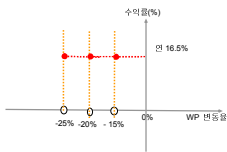
1. 계약금액

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

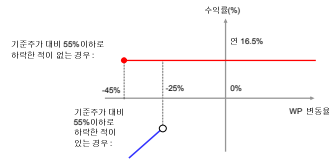
2. 만기시점의 손익구조

- 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 주가)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 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 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 환위스마트(ELS)127

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.03	-0.04	-0.06	-0.07	-0.08	-0.10	-0.11
	5.33%	0.03	0.02	0.01	-0.01	-0.02	-0.04	-0.05
시나리오	2.67%	0.06	0.04	0.03	0.01	0.00	-0.01	-0.03
	0%	0.04	0.03	0.01	0.00	-0.01	-0.03	-0.04
	-2.67%	-0.01	-0.03	-0.04	-0.05	-0.07	-0.08	-0.09
	-5.33%	-0.10	-0.12	-0.13	-0.14	-0.16	-0.17	-0.19
	-8%	-0.23	-0.25	-0.26	-0.27	-0.29	-0.30	-0.31

최대 손실 시나리오

위험액	-0.31
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.19
-----	------

[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(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

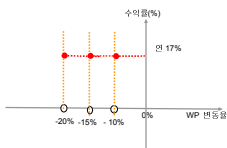
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

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

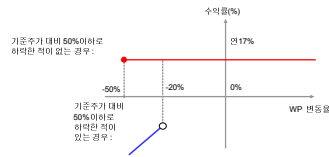
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117%
 - 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6562319W52 유인 투기증권 (ELS)2415

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	3.40	2.59	1.77	0.96	0.15	-0.66	-1.47
	5.33%	3.50	2.68	1.87	1.06	0.25	-0.56	-1.37
시나리오	2.67%	3.17	2.36	1.55	0.74	-0.07	-0.88	-1.69
	0%	2.43	1.62	0.81	0.00	-0.61	-1.62	-2.43
	-2.67%	1.28	0.46	-0.35	-1.16	-1.97	-2.78	-3.59
	-5.33%	-0.30	-1.11	-1.93	-2.74	-3.55	-4.36	-5.17
	-8%	-2.30	-3.11	-3.92	-4.74	-5.55	-6.36	-7.17

최대 손실 시나리오

위험액	-7.17
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7.76
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

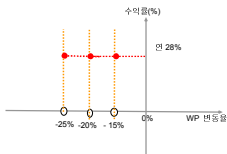
1. 계약금액

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

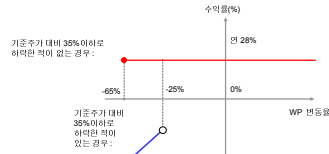
2. 만기시점의 손익구조

- 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 종가
- 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 환반도 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 128%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조의 리스크(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)
KR6622309W55 코분증권(ELS)344

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	41.71	31.13	20.56	9.99	-0.59	-11.16	-21.74
	5.33%	38.94	28.37	17.79	7.22	-3.36	-13.93	-24.50
	2.67%	35.61	25.04	14.46	3.89	-6.68	-17.26	-27.83
	0%	31.72	21.18	10.57	0.00	-10.87	-21.15	-31.72
	-2.67%	27.27	16.70	6.12	-4.45	-13.02	-25.80	-36.17
	-5.33%	22.26	11.69	1.11	-9.46	-20.04	-30.61	-41.18
	-8%	16.69	6.11	-4.46	-15.03	-25.61	-36.18	-46.76

최대 손실 시나리오

위험액	-46.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	41.02
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

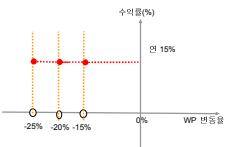
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	30.0	0	30.0	차입

단위:백만원

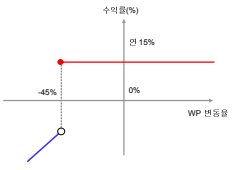
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 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 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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)
KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.28	0.23	0.18	0.13	0.08	0.03	-0.02
손익	5.33%	0.25	0.20	0.15	0.10	0.05	-0.00	-0.05
시나리오	2.67%	0.21	0.16	0.11	0.06	0.01	-0.04	-0.09
	0%	0.18	0.13	0.08	0.00	-0.05	-0.10	-0.15
	-2.67%	0.06	0.03	-0.02	-0.07	-0.12	-0.17	-0.22
	-5.33%	-0.01	-0.06	-0.11	-0.16	-0.21	-0.26	-0.31
	-8%	-0.11	-0.16	-0.21	-0.26	-0.31	-0.36	-0.41

최대 손실 시나리오

위험액	-0.41
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.52
-----	------

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

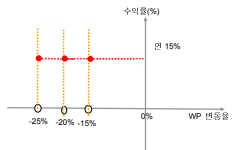
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위:백만원

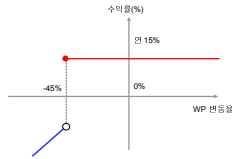
2. 만기시점의 손익구조

- 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) 만월 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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	21.19	17.36	13.54	9.71	5.89	2.06	-1.76
시나리오	5.33%	19.04	15.21	11.39	7.56	3.74	-0.09	-3.91
	2.67%	15.80	11.98	8.15	4.33	0.50	-3.33	-7.15
	0%	11.48	7.65	3.83	0.00	-3.83	-7.65	-11.48
	-2.67%	6.06	2.24	-1.59	-5.41	-9.24	-13.07	-16.89
	-5.33%	-0.44	-4.27	-8.09	-11.92	-15.74	-19.57	-23.39
	-8%	-6.03	-11.86	-15.68	-19.51	-23.33	-27.16	-30.98

최대 손실 시나리오

위험액	-30.98
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.19
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

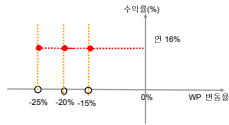
1. 계약금액

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

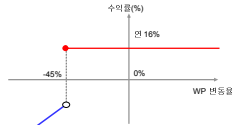
2. 만기시점의 손익구조

- 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 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 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 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.71	0.57	0.42	0.28	0.13	-0.01	-0.16
	5.33%	0.65	0.50	0.36	0.21	0.07	-0.08	-0.22
시나리오	2.67%	0.55	0.41	0.26	0.12	-0.02	-0.17	-0.31
	0%	0.43	0.29	0.14	0.00	-0.14	-0.29	-0.43
	-2.67%	0.29	0.14	-0.00	-0.15	-0.29	-0.44	-0.58
	-5.33%	0.11	-0.03	-0.18	-0.32	-0.47	-0.61	-0.76
	-8%	-0.09	-0.24	-0.38	-0.53	-0.67	-0.82	-0.96

최대 손실 시나리오

위험액	-0.96
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.13
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

1. 계약금액

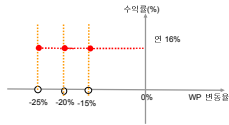
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	차입

단위: (백만원)

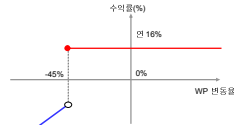
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 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
: 평균 * 110%
→ 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 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	12.74	10.15	7.56	4.97	2.38	-0.22	-2.81
	5.33%	11.58	8.99	6.40	3.80	1.21	-1.38	-3.97
시나리오	2.67%	9.92	7.33	4.74	2.15	-0.44	-3.03	-5.63
	0%	7.78	5.18	2.59	0.00	-2.09	-5.18	-7.78
	-2.67%	5.13	2.54	-0.05	-2.64	-5.23	-7.83	-10.42
	-5.33%	2.00	-0.59	-3.19	-5.78	-8.37	-10.96	-13.55
	-8%	-1.63	-4.22	-6.81	-9.41	-12.00	-14.59	-17.18

최대 손실 시나리오

위험액	-17.18
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.24
-----	-------

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

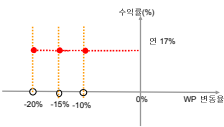
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

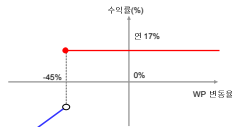
2. 평가시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 현대차 보통주
- 평가: 2012년 4월 27일
- 펀드청산 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 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 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, 평가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가액(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (평가기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



평가시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6552310W51 주위투자증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	14.95	10.93	6.90	2.87	-1.15	-5.18	-9.21
	5.33%	15.03	11.00	6.96	2.95	-1.08	-5.10	-9.13
시나리오	2.67%	14.07	10.05	6.02	1.99	-2.03	-6.06	-10.09
	0%	12.08	8.05	4.03	0.00	-4.03	-8.05	-12.08
최대 손실 시나리오	-2.67%	9.05	5.02	1.00	-3.03	-7.05	-11.08	-15.11
	-5.33%	4.99	0.96	-3.07	-7.09	-11.12	-15.15	-19.17
	-8%	-0.11	-4.14	-8.16	-12.19	-16.22	-20.24	-24.27

최대 손실 시나리오

위험액	-24.27
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.45
-----	-------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

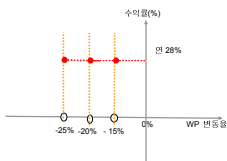
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위:백만원)

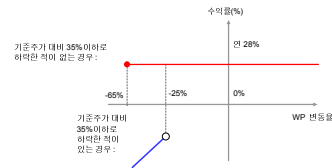
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주
- 2) 만기: 2012년 4월 27일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 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 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 끝드 해지
 - 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) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))
KR6622301W53 교보증권(ELS)336

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	25.41	19.54	13.67	7.80	1.93	-3.94	-9.81
시나리오	5.33%	23.34	17.47	11.61	5.74	-0.13	-6.00	-11.87
	2.67%	20.74	14.87	9.01	3.14	-2.73	-8.60	-14.47
	0%	17.81	11.74	5.87	0.00	-6.87	-11.74	-17.61
	-2.67%	13.94	6.07	2.20	-3.67	-9.94	-15.41	-21.28
	-5.33%	9.73	3.86	-2.01	-7.66	-13.75	-19.82	-25.49
	-8%	4.98	-0.89	-6.76	-12.62	-18.49	-24.56	-30.23

최대 손실 시나리오

위험액	-30.23
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	25.93
-----	-------

[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호

1. 계약금액

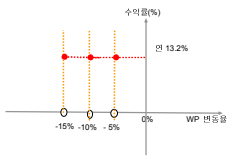
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위:백만원

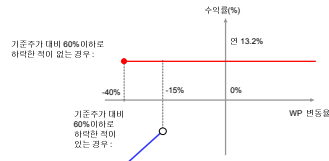
2. 만기시점의 손익구조

- 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 증가)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 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 113.2%
- 두 기초자산의 가액(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

손익 구조표 및 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.01	-0.02	-0.06	-0.09	-0.12	-0.15	-0.19
	5.33%	0.12	0.08	0.05	0.02	-0.01	-0.05	-0.08
	2.67%	0.15	0.11	0.08	0.05	0.01	-0.02	-0.05
	0%	0.08	0.07	0.03	0.00	-0.03	-0.07	-0.10
	-2.67%	-0.03	-0.06	-0.09	-0.12	-0.16	-0.19	-0.22
-5.33%	-0.23	-0.26	-0.29	-0.33	-0.36	-0.39	-0.43	
-8%	-0.51	-0.54	-0.57	-0.61	-0.64	-0.67	-0.70	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.70
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.15
-----	------

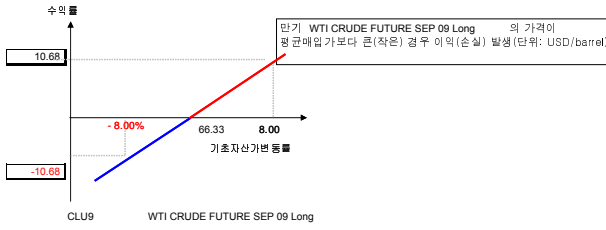
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	2	0	2	장내

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



3. 손익 구조별 중(최대 손실 가능금액) (단위:1,000 USD)

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	손실액
기초자산 시나리오	8%	10.68
	5.33%	7.12
	2.67%	3.56
	0%	0.00
	-2.67%	-3.56
최대 손실 시나리오	-5.33%	-7.12
	-8%	-10.68

최대 손실 시나리오	
위험액	-10.68

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	42
-----	----

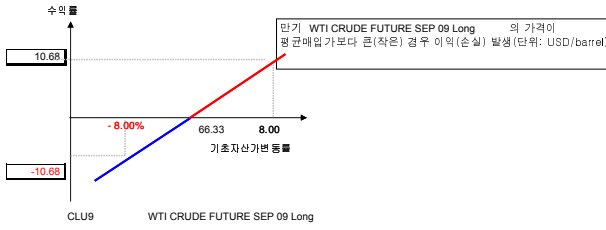
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

1. 계약 요약

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	2	0	2	장내

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



3. 손익 구조별 중(최대 손실 가능금액) (단위: 1,000 USD)

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	279.49
	5.33%	186.21
	2.67%	93.28
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-93.28
	-5.33%	-186.21
	-8%	-279.49

최대 손실 시나리오	
위험액	-279.49

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

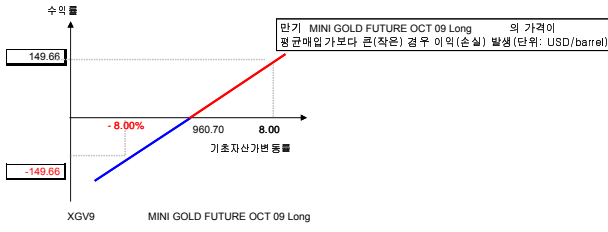
위험액	1.132
-----	-------

[96-2] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

단위: (계약)						
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	2	0	2	장내

2. 헷지시점의 손익 구조

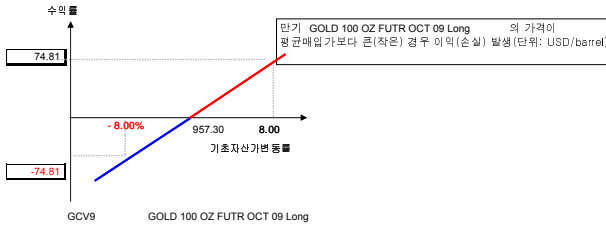


[96-3] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

단위: (계약)						
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	1	0	1	장내

2. 헷지시점의 손익 구조



[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

단위: (계약)						
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	2	0	2	장내

2. 연가시점의 손익 구조

