

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 콜리켓 시모단위 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

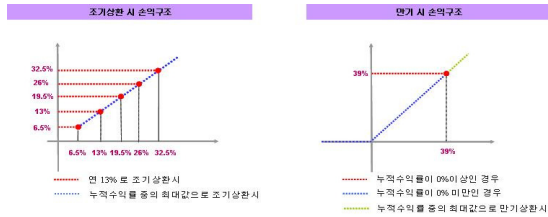
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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 관할하는 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 누적수익률])

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.14	0.14	0.14	0.13	0.13	0.13	0.13
	5.33%	0.09	0.08	0.08	0.08	0.08	0.08	0.08
	2.67%	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	-0.03	-0.03	-0.03
	-2.67%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
최대 손실 시나리오	-8.33%	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06
	-8%	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.02
-----	------

[3] 테라즈 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: 역면금액 지급 (원금보장추구)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.15	0.12	0.09	0.06	0.03	-0.00	-0.03
	5.33%	0.13	0.10	0.07	0.04	0.01	-0.02	-0.05
시나리오	2.67%	0.11	0.08	0.05	0.02	-0.01	-0.04	-0.07
	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	-0.05	-0.08	-0.11
	-5.33%	0.04	0.01	-0.02	-0.05	-0.08	-0.11	-0.13
	-8%	0.02	-0.01	-0.04	-0.07	-0.10	-0.13	-0.16

최대 손실 시나리오

위험액	-0.16
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.27
-----	------

4) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

3) 만드청산 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 만드 해지
 만기 평가일의 누적 수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 18.0%의 수익률로 상환
 만기 평가일의 누적 수익률이 -50%미만인 경우: 역편금액 지급 (원금보장추구)

6) 만드의 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 시나리오	8%	0.02	0.01	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.01
	5.33%	0.02	0.01	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.01
	2.67%	0.02	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	0%	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01
	-2.67%	0.01	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.02
-5.33%	0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.01	-0.02	-0.02	
-8%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.02	-0.02	-0.03	-0.03	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모단위파생상품투자전략 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만드청산 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) 만을 20.0%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

: 원금 * 140%

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

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력익성증권(ELS)243

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	12.20	11.07	9.94	8.81	7.68	6.55	5.42
	5.33%	9.57	8.44	7.32	6.19	5.06	3.93	2.80
	2.67%	6.64	5.51	4.38	3.25	2.12	0.99	-0.14
	0%	3.39	2.26	1.13	0.00	-1.13	-2.26	-3.39
	-2.67%	-0.18	-1.31	-2.43	-3.56	-4.69	-5.82	-6.95
	-5.33%	-4.05	-5.18	-6.31	-7.44	-8.57	-9.70	-10.83
	-8%	-8.25	-9.38	-10.50	-11.63	-12.76	-13.89	-15.02

최대 손실 시나리오

위험액	-16.02
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.33
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모단위파생상품투자전략 25호

1. 계약금액

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

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

- 두 기초자산의 가격이 만기도 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 최대주변(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	13.87	12.96	12.06	11.15	10.24	9.34	8.43
손익	5.33%	10.24	9.34	8.43	7.52	6.62	5.71	4.81
손익	2.67%	6.52	5.62	4.71	3.81	2.90	2.00	1.09
손익	0%	2.72	1.81	0.91	0.00	-0.91	-1.81	-2.72
손익	-2.67%	-1.18	-2.09	-2.99	-3.90	-4.80	-5.71	-6.62
손익	-5.33%	-5.17	-6.08	-6.98	-7.89	-8.79	-9.70	-10.60
손익	-8%	-9.25	-10.16	-11.06	-11.97	-12.87	-13.78	-14.68

최대 손실 시나리오

위험액	-14.68
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.63
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

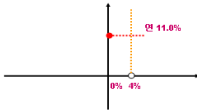
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,471	0	7,471	창의

단위(백만원)

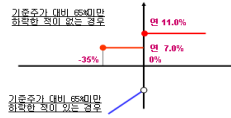
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225
- 2) 연기: 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%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 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 원본투자 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%
- 두 기초자산의 가격(상중표준) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%초과 하락한 적이 있는 경우 : 원금 X (반기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 변동증권(ELS) 2007-397세

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	5.33%	314.18	291.31	268.44	245.56	222.69	199.82	176.94
시나리오	2.67%	190.70	167.83	144.95	122.08	99.20	76.33	53.46
	0%	68.62	45.75	22.87	0.00	-22.87	-45.75	-68.62
	-2.67%	-52.05	-74.92	-97.80	-120.67	-143.55	-166.42	-189.29
	-5.33%	-171.32	-194.19	-217.06	-239.94	-262.81	-285.68	-308.56
	-8%	-289.17	-312.05	-334.92	-357.80	-380.67	-403.54	-426.42

최대 손실 시나리오

위험액 -426.42

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 416.22

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

연말 11.2%의 수익률로 중도 상환이 됨.

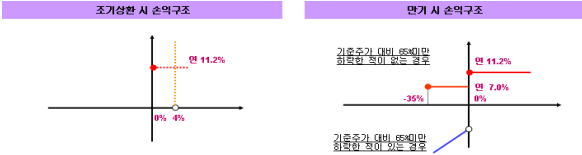
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR60034SST27 최대 손실 (ELS): 2007-3984

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	42.44	40.29	38.13	35.97	33.81	31.66	29.50
시나리오	5.33%	30.28	28.12	25.97	23.81	21.65	19.49	17.34
	2.67%	18.29	16.13	13.98	11.82	9.66	7.50	5.35
	0%	6.47	4.32	2.16	0.00	-2.16	-4.32	-6.47
	-2.67%	-5.17	-7.33	-9.49	-11.65	-13.81	-15.96	-18.12
	-5.33%	-16.65	-18.81	-20.97	-23.12	-25.28	-27.44	-29.60
	-8%	-27.95	-30.11	-32.27	-34.43	-36.59	-38.74	-40.90

최대 손실 시나리오

위험액	-40.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	40.32
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

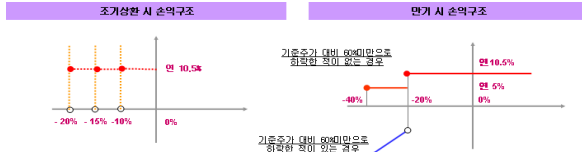
1. 계약금액

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 펀드폐지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 115%
- 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600172YT43 신영증권(ELS)552

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	524.69	483.21	441.74	400.26	358.78	317.31	275.83
5.33%	406.26	364.78	323.31	281.83	240.35	198.88	157.40
2.67%	272.84	231.36	189.89	148.41	106.93	65.46	23.98
0%	124.43	82.95	41.48	0.00	-41.48	-82.95	-124.43
-2.67%	-38.97	-80.44	-121.92	-163.40	-204.88	-246.35	-287.83
-5.33%	-217.36	-258.83	-300.31	-341.79	-383.26	-424.74	-466.22
-8%	-410.73	-452.21	-493.69	-535.16	-576.64	-618.12	-659.60

최대 손실 시나리오	
위험액	-659.60

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	651.33
-----	--------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

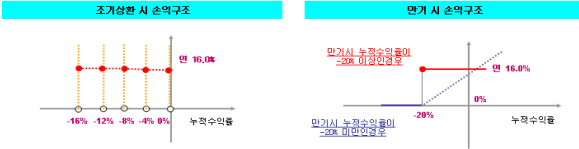
1. 계약금액

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
 - 관점산 결정주기: 매 6개월
 - 기준지수: 2007년 6월 5일의 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주의 증가
 - 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 초기 상환 설정일에 0%(1차 중도상환일), -4%(2차 중도상환일), -8%(3차 중도상환일), -12%(4차 중도상환일), -16%(5차 중도상환일), -20%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 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%, 36개월간 최고 누적 수익률])
- 펀드의 수익구조



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

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.82	0.68	0.54	0.40	0.27	0.13	-0.01
	5.33%	0.70	0.56	0.42	0.29	0.15	0.01	-0.13
	2.67%	0.57	0.43	0.29	0.15	0.01	-0.13	-0.26
	0%	0.41	0.28	0.14	0.00	-0.14	-0.28	-0.41
	-2.67%	0.25	0.11	-0.03	-0.17	-0.31	-0.44	-0.58
	-5.33%	0.06	-0.07	-0.21	-0.35	-0.49	-0.63	-0.76
	-8%	-0.13	-0.27	-0.41	-0.55	-0.69	-0.83	-0.96

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.96

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.76
-----	------

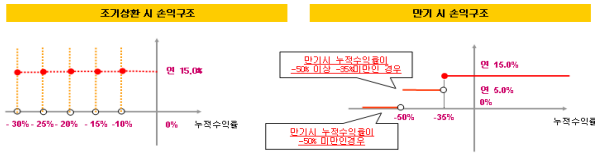
11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 8월 13일
- 3) 만드청산 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, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만드 해지
만기 평가일의 누적수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환
만기 평가일의 누적수익률이 -50%미만인 경우: 역면금액 지급 (원금보장추구)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762C780 비례예상종형(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	2.22	1.78	1.35	0.92	0.48	0.05	-0.39
	5.33%	1.95	1.52	1.08	0.65	0.21	-0.22	-0.65
	2.67%	1.64	1.21	0.78	0.34	-0.09	-0.52	-0.96
	0%	1.30	0.87	0.43	0.00	-0.43	-0.87	-1.30
	-2.67%	0.92	0.49	0.05	-0.38	-0.81	-1.25	-1.68
	-5.33%	0.50	0.07	-0.36	-0.60	-1.23	-1.66	-2.10
	-8%	0.05	-0.39	-0.82	-1.25	-1.69	-2.12	-2.55

최대 손실 시나리오

위험액 -2.55

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 4.11

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

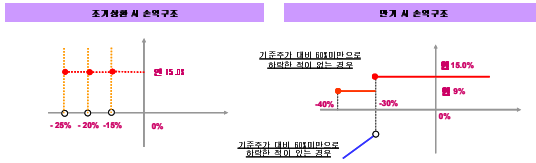
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2009년 9월 18일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 9월 19일의 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 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, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 118%
- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762L197 미래예상증권(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	255.78	251.15	246.52	241.88	237.25	232.62	227.99
	5.33%	180.60	175.97	171.34	166.71	162.08	157.44	152.81
	2.67%	99.98	95.34	90.71	86.08	81.45	76.82	72.18
	0%	13.90	9.26	4.63	0.00	-4.63	-9.26	-13.90
	-2.67%	-77.64	-82.27	-86.90	-91.53	-96.17	-100.80	-105.43
	-5.33%	-174.62	-179.26	-183.89	-188.52	-193.15	-197.78	-202.41
	-8%	-277.06	-281.69	-286.33	-290.96	-295.59	-300.22	-304.85

최대 손실 시나리오

위험액	-304.85
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	323.37
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제12호

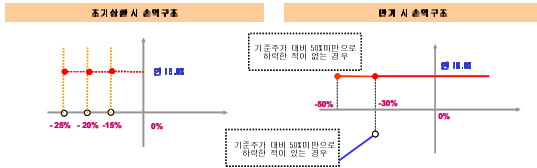
1. 계약금액

구분	기대대상	거래유형	액수(1)	비율(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) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(현대모비스, 삼성중공업 보통주)의 중도상환가격이 낮은 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 펀드 청산
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 132%
- 두 기초자산의 가격(중중포환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	167.24	160.31	153.38	146.45	139.52	132.59	125.66
	5.33%	116.74	109.81	102.88	95.95	89.02	82.09	75.15
	2.67%	67.92	60.99	54.06	47.13	40.20	33.27	26.34
	0%	20.79	13.86	6.93	0.00	-6.93	-13.86	-20.79
	-2.67%	-24.65	-31.58	-38.51	-45.45	-52.38	-59.31	-66.24
	-5.33%	-68.41	-75.34	-82.28	-89.21	-96.14	-103.07	-110.00
	-8%	-110.49	-117.42	-124.35	-131.28	-138.21	-145.14	-152.08

최대 손실 시나리오

위험액	-152.08
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	172.12
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

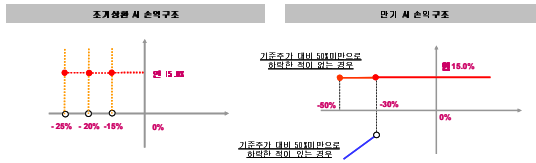
1. 계약금액

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 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 한번호 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
 - 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762B1B0 미래예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.16	4.88	4.60	4.32	4.04	3.75	3.47
	5.33%	3.85	3.57	3.29	3.00	2.72	2.44	2.16
	2.67%	2.41	2.13	1.85	1.56	1.28	1.00	0.72
	0%	0.85	0.56	0.28	0.00	-0.28	-0.56	-0.85
	-2.67%	-0.84	-1.12	-1.41	-1.69	-1.97	-2.25	-2.53
	-5.33%	-2.65	-2.94	-3.22	-3.50	-3.78	-4.06	-4.35
	-8%	-4.59	-4.87	-5.15	-5.44	-5.72	-6.00	-6.28

최대 손실 시나리오

위험액	-6.28
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.39
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

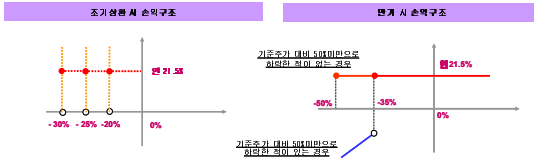
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010년 01월 07일
- 3) 만드첨산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이 상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이 상인 경우(두번째 중도상환일), 70%이 상인 경우(세번째 중도상환일), 65%이 상인 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(중도포함)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 최대 손위(ELS)2008=647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	206.43	181.93	157.44	132.94	108.44	83.94	59.44
	5.33%	161.67	137.17	112.67	88.17	63.67	39.18	14.68
	2.67%	117.36	92.86	68.36	43.86	19.36	-5.14	-29.63
	0%	73.50	49.00	24.50	0.00	-24.50	-49.00	-73.50
	-2.67%	30.09	5.59	-18.91	-43.41	-67.91	-92.41	-116.91
	-5.33%	-12.87	-37.37	-61.87	-86.37	-110.87	-135.37	-159.86
	-8%	-55.38	-79.88	-104.38	-128.88	-153.37	-177.87	-202.37

최대 손실 시나리오

위험액	-202.37
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	228.72
-----	--------

[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

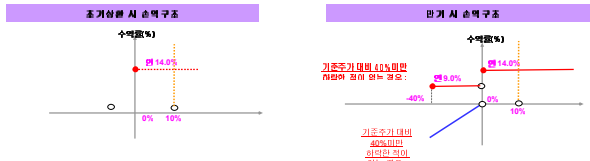
3) 만도청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	576.71	547.96	519.25	490.52	461.79	433.06	404.33
	5.33%	420.92	392.19	363.46	334.73	306.00	277.27	248.54
시나리오	2.67%	257.42	228.68	199.95	171.22	142.49	113.76	85.03
	0%	86.19	57.46	28.73	0.00	-28.73	-57.46	-86.19
	-2.67%	-92.75	-121.48	-150.21	-178.94	-207.67	-236.40	-265.13
	-5.33%	-279.41	-308.14	-336.87	-365.60	-394.33	-423.06	-451.79
	-8%	-473.78	-502.51	-531.24	-559.97	-588.70	-617.43	-646.16

최대 손실 시나리오

위험액	-646.16
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	614.94
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위파생26호

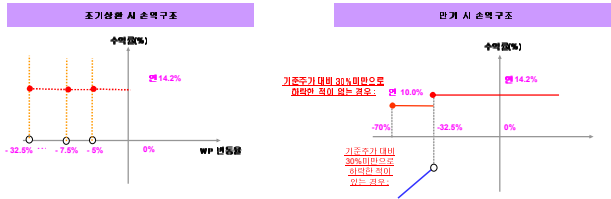
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순보지선(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) 만드침산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 14일의 CJ 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기건을 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. 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) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600867BTB0 코루브신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	215.08	182.10	149.13	116.16	83.18	50.21	17.23
	5.33%	176.65	143.67	110.70	77.72	44.75	11.77	-21.20
	2.67%	137.93	104.95	71.96	39.00	6.03	-26.95	-59.92
	0%	98.92	65.95	32.97	0.00	-32.97	-65.95	-98.92
	-2.67%	59.64	26.66	-6.31	-39.29	-72.26	-105.24	-138.21
	-5.33%	20.06	-12.91	-45.89	-78.66	-111.84	-144.81	-177.79
	-8%	-19.80	-52.77	-85.75	-118.72	-151.70	-184.67	-217.65

최대 손실 시나리오
위험액 -217.65

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 189.74

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

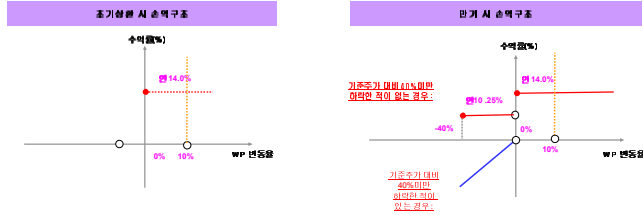
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

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



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	110.64	103.71	96.77	89.84	82.90	75.97	69.03
시나리오	5.33%	80.05	73.11	66.18	59.24	52.31	45.37	38.44
	2.67%	50.10	43.17	36.23	29.30	22.36	15.43	8.49
	0%	20.81	13.87	6.94	0.00	-6.94	-13.87	-20.81
	-2.67%	-7.84	-14.77	-21.71	-28.64	-35.58	-42.51	-49.45
	-5.33%	-35.83	-42.77	-49.70	-56.64	-63.57	-70.51	-77.44
	-8%	-63.17	-70.11	-77.04	-83.98	-90.91	-97.85	-104.78

최대 손실 시나리오

위험액	69.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	103.37
-----	--------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가5호

1. 계약금액

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

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

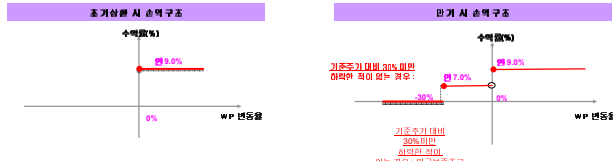
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가액의 70%이만 하락할 적 이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우 : 원금 * 121%

- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 70%이만 하락할 적 이 있는 경우

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	48.20	44.18	40.16	36.15	32.13	28.12	24.10
	5.33%	36.52	32.50	28.48	24.47	20.45	16.44	12.42
	2.67%	24.47	20.45	16.44	12.42	8.40	4.39	0.37
	0%	12.05	8.03	4.02	0.00	-4.02	-8.03	-12.05
	-2.67%	-0.74	-4.76	-8.77	-12.79	-16.81	-20.82	-24.84
	-5.33%	-13.90	-17.92	-21.93	-25.95	-29.96	-33.98	-38.00
-8%	-27.43	-31.44	-35.46	-39.48	-43.49	-47.51	-51.53	

최대 손실 시나리오

위험액	24.10
-----	-------

4. 파생상품의 최대 예상금액 (단위:백만원)

위험액	51.48
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단원 퍼센트 6호

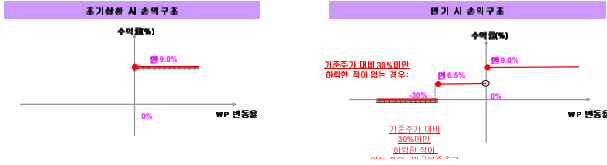
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
 - 2) 평가: 2011년 2월 21일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
 - 4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가
 - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.
- 단, 평가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환비도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 * 119.5%
 - 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우 : 원금*100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR603762OV23 미래에셋증권(ELS)306

구분	손익 구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	73.46	70.45	67.45	64.45	61.45	58.44	55.44
	5.33%	49.49	46.49	43.49	40.49	37.48	34.48	31.48
	2.67%	28.01	25.01	22.01	19.00	16.00	13.00	10.00
	0%	9.01	6.00	3.00	0.00	-3.00	-6.00	-9.01
	-2.67%	-7.52	-10.52	-13.52	-16.52	-19.53	-22.53	-25.53
	-5.33%	-21.56	-24.56	-27.57	-30.57	-33.57	-36.57	-39.58
	-8%	-33.13	-36.13	-39.13	-42.13	-45.14	-48.14	-51.14

최대 손실 시나리오	
위험액	55.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	47.54
-----	-------

[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) 만도청산결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

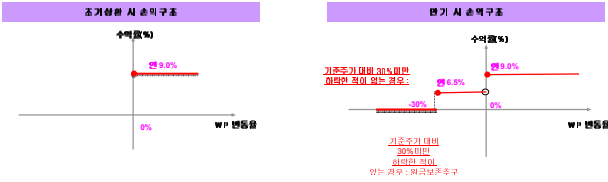
단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가격이 만도기간의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%

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

: 원금*100%

6) 만도의 수익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래예정종결(ELS)317

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	57.13	54.80	52.46	50.13	47.79	45.46	43.12
	5.33%	38.49	36.16	33.82	31.49	29.15	26.82	24.48
	2.67%	21.79	19.45	17.12	14.78	12.45	10.11	7.78
	0%	7.01	4.67	2.34	0.00	-2.34	-4.67	-7.01
	-2.67%	-5.85	-8.18	-10.52	-12.85	-15.19	-17.52	-19.86
	-5.33%	-16.77	-19.11	-21.44	-23.78	-26.11	-28.45	-30.78
	-8%	-25.77	-28.10	-30.44	-32.77	-35.11	-37.44	-39.78

최대손실 시나리오

위험액	43.12
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	36.98
-----	-------

[23] 메리츠증권주연계사모과정1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	1,474	0	1,474	천원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI주

2) 평가: 2010년 08월 04일

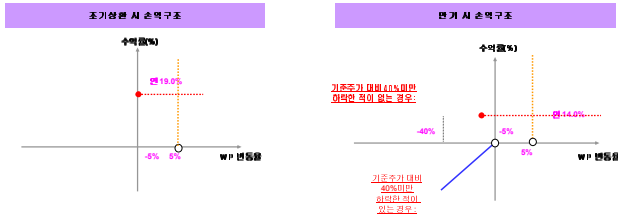
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

4) 기준지수: 2008년 8월 7일 NIKKEI225, HSCEI주 수의 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상환 포함하여 한번이라도 최초기준가격의 95% 이상이거나 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 19%의 수익률로 중도상환

- 단, 평가시 까지 초기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 * 138%
- 두 기초자산의 가격(상환 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (평가 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR600594WV82 우리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	133.80	123.74	113.68	103.61	93.55	83.49	73.43
	5.33%	99.97	89.91	79.85	69.79	59.72	49.66	39.60
	2.67%	65.44	55.37	45.31	35.25	25.19	15.12	5.06
	0%	30.19	20.12	10.06	0.00	-10.06	-20.12	-30.19
	-2.67%	-5.77	-15.84	-25.90	-35.96	-46.02	-56.08	-66.15
	-5.33%	-42.44	-52.51	-62.57	-72.63	-82.69	-92.75	-102.82
	-8%	-79.83	-89.89	-99.95	-110.01	-120.07	-130.14	-140.20
	최대 손실 시나리오							
위험액	-140.20							

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	137.29
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품SEPO-1호

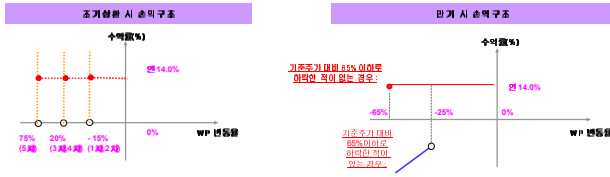
1. 계약금액

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: 2011 년 08월 26일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격 의85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세 번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 14.0%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의48%이므로 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%	-20.21	-20.70	-21.19	-21.68	-22.17	-22.66	-23.15
	5.33%	-7.45	-7.94	-8.42	-8.91	-9.40	-9.89	-10.38
	2.67%	-0.22	-0.71	-1.20	-1.69	-2.18	-2.67	-3.15
	0%	1.47	0.98	0.49	0.00	-0.49	-0.98	-1.47
	-2.67%	-2.39	-2.88	-3.36	-3.85	-4.34	-4.83	-5.32
	-5.33%	-11.78	-12.27	-12.76	-13.25	-13.74	-14.23	-14.72
	-8%	-26.72	-27.21	-27.70	-28.19	-28.68	-29.16	-29.65

최대 손실 시나리오

위험액	-29.65
-----	--------

4. 파생 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	21.30
-----	-------

[25] 테라즈 주가지수연계사모펀생상품 제 1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

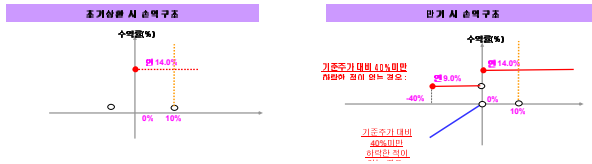
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(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%	
기초자산 시나리오	8%	706.84	671.63	636.41	601.20	565.99	530.77	495.56
	5.33%	515.90	480.68	445.47	410.26	375.04	339.63	304.62
	2.67%	315.50	280.28	245.07	209.86	174.64	139.43	104.22
	0%	105.64	70.43	35.21	0.00	-35.21	-70.43	-105.64
	-2.67%	-113.68	-148.89	-184.10	-219.32	-254.53	-289.74	-324.95
	-5.33%	-342.45	-377.66	-412.88	-448.09	-483.30	-518.52	-553.73
	-8%	-580.68	-615.89	-651.11	-686.32	-721.53	-756.75	-791.96

최대 손실 시나리오

위험액 -791.96

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 753.70

[26] 데리츠2Star사모파생SE SF-1

1. 계약금액

구분	기래대상	가액유형	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, 만기시점까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드매지
- 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(최대손실가능금액(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%	1.26	0.91	0.57	0.22	-0.13	-0.48	-0.83
	5.33%	1.77	1.42	1.07	0.72	0.37	0.03	-0.32
	2.67%	1.69	1.34	1.00	0.65	0.30	-0.05	-0.39
	0%	1.04	0.70	0.35	0.00	-0.35	-0.70	-1.04
	-2.67%	-0.18	-0.53	-0.88	-1.23	-1.57	-1.92	-2.27
	-5.33%	-1.98	-2.33	-2.68	-3.03	-3.38	-3.72	-4.07
	-8%	-4.36	-4.71	-5.06	-5.41	-5.76	-6.10	-6.45

최대 손실 시나리오

위험액 -6.45

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 6.74

[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

2) 만기: 2011년 09월 23일

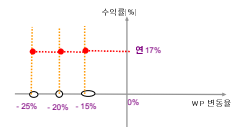
3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

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

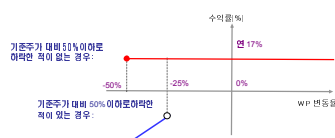
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일)만큼 17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 151.0%
 - 두 기초자산의 가액(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6572345/91 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	11.63	9.27	6.92	4.56	2.21	-0.15	-2.50
	5.33%	12.70	10.34	7.99	5.63	3.28	0.92	-1.43
	2.67%	11.17	8.82	6.46	4.11	1.75	-0.60	-2.96
	0%	7.07	4.71	2.36	0.00	-2.36	-4.71	-7.07
	-2.67%	0.37	-1.99	-4.34	-6.70	-9.05	-11.41	-13.76
	-5.33%	-6.91	-11.27	-13.62	-15.98	-18.34	-20.69	-23.05
	-8%	-20.79	-23.14	-25.50	-27.85	-30.21	-32.56	-34.92

최대 손실 시나리오

위험액 -34.92

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 37.86

[29] 테리 조주가지 수익계 과생4호

1. 계약금액

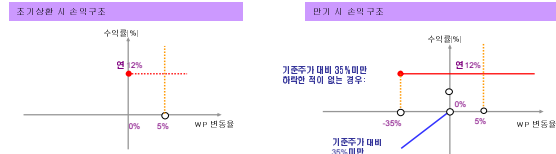
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

- 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
 - 만기: 2010년 09월 20일
 - 펀드청산 결정주기: 매3개월
 - 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가
 - 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준가액 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포화하여 한변이라도 최초기준가액 대비 5%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
- 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 최대증권(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	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생13

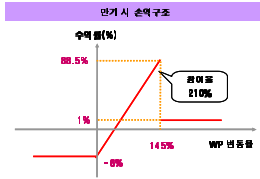
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 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%
- 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%	-34.60	-44.41	-54.21	-64.02	-73.82	-83.63	-93.43
	5.33%	-10.46	-20.26	-30.07	-39.87	-49.67	-59.48	-69.28
	2.67%	10.88	1.08	-8.73	-16.53	-28.34	-38.14	-47.94
	0%	29.41	19.61	9.80	0.00	-9.80	-19.61	-29.41
	-2.67%	45.14	35.33	25.53	15.72	5.92	-3.89	-13.69
	-5.33%	58.05	48.25	38.44	28.64	18.84	9.03	-0.77
	-8%	68.16	58.36	48.55	38.75	28.94	19.14	9.33

최대 손실 시나리오

위험액	9.33
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	83.14
-----	-------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

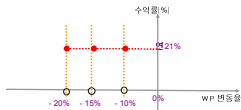
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

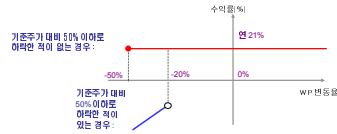
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	10.22	8.72	7.22	5.72	4.21	2.71	1.21
	5.33%	8.92	7.42	5.92	4.41	2.91	1.41	-0.09
	2.67%	7.01	5.51	4.01	2.51	1.01	-0.49	-2.00
	0%	4.50	3.00	1.50	0.00	-1.50	-3.00	-4.50
	-2.67%	1.39	-0.11	-1.61	-3.11	-4.62	-6.12	-7.62
	-5.33%	-2.33	-3.83	-5.33	-6.83	-8.33	-9.84	-11.34
	-8%	-6.65	-8.15	-9.66	-11.16	-12.66	-14.16	-15.66

최대 손실 시나리오

위험액	-15.66
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	17.18
-----	-------

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

1. 계약금액

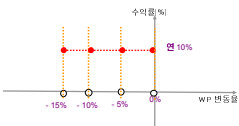
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

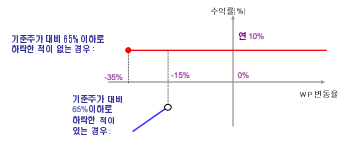
2. 만기시점의 손익구조

- 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 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 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 가액이 환반도 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 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)

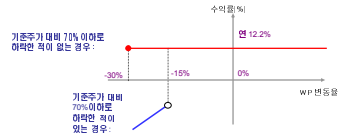
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12.2%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112.2%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교
 KR600690MM/M7 당우증권 ELS2697

1. 계약금액

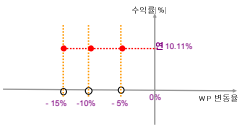
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

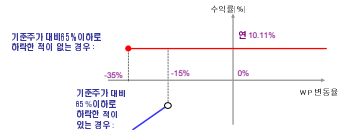
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 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 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

낮은 기준지수기준으로 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

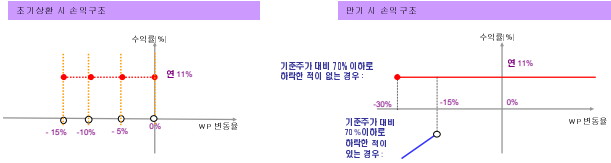
- 두 기준지수의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

- 두 기준지수의 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 메리츠신안증권(ELS)931

1. 계약금액

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

단위(백만원)

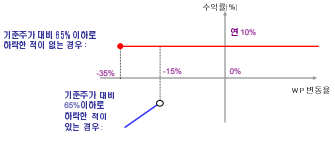
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 연기시 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 * (반기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



반기 시 손익구조



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

1. 계약금액

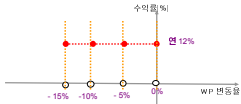
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

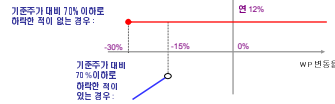
2. 연기시점의 손익구조

- 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 기준가격의 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 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기 초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기 준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

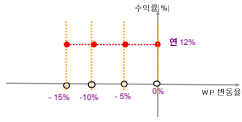
1. 계약금액

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-8] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR6030617V83
 교보증권(ELS)269회

1. 계약금액

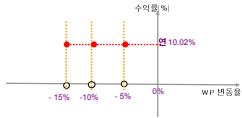
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	차입

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기 : 2009년 6월 18일
- 3) 권드청산 결정 주기 : 매4개월
- 4) 기 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)만큼 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 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 + (만기기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

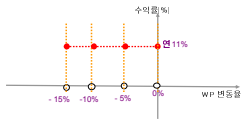
1. 계약금액

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

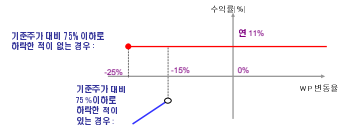
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] **메리츠주가지수연계사로증권2호**

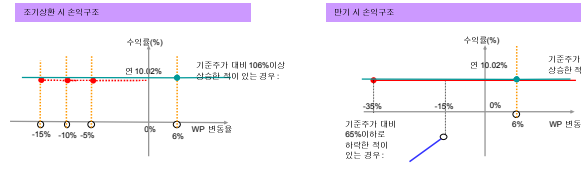
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 연가시점의 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 주당 투자증권 (ELS)2457

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

최대 손실 시나리오	
위험액	-18.06

4. 발행상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.08
-----	-------

[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHG-2

1. 계약금액

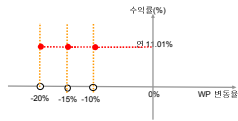
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	잔액

단위(백만원)

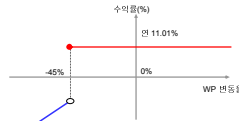
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 만기: 2012년 4월 12일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차 지수의 증가
- 실행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차, 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 11.01%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 * 111.01%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 * (만기 기준지수/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			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.13	0.86	0.59	0.31	0.04	-0.23	-0.51
	5.33%	1.18	0.90	0.63	0.36	0.09	-0.19	-0.46
	2.67%	1.07	0.80	0.53	0.25	-0.02	-0.29	-0.57
	0%	0.82	0.55	0.27	0.00	-0.27	-0.55	-0.82
	-2.67%	0.42	0.14	-0.13	-0.40	-0.68	-0.95	-1.22
	-5.33%	-0.14	-0.41	-0.69	-0.96	-1.23	-1.51	-1.78
	-8%	-0.84	-1.12	-1.39	-1.66	-1.94	-2.21	-2.48

최대 손실 시나리오

위험액 -2.48

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 1.78

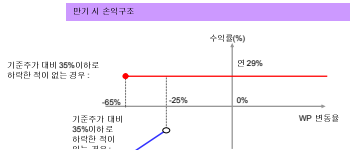
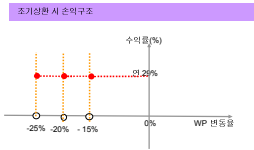
[62] 테리츠2Star사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 만드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융저주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.5%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
 6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

구분	손익구조변동 시나리오					변동성 시나리오				
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%			
기초자산	9.79	8.58	7.38	6.17	4.96	3.76	2.55			
시나리오	10.28	9.05	7.84	6.63	5.43	4.22	3.01			
	8.20	6.99	5.78	4.58	3.37	2.16	0.96			
	3.62	2.41	1.21	0.00	-1.21	-2.41	-3.62			
	-3.48	-4.68	-5.88	-7.08	-8.28	-9.48	-10.68			
	-13.09	-14.30	-15.50	-16.71	-17.92	-19.13	-20.33			
	-25.23	-26.43	-27.64	-28.85	-30.05	-31.26	-32.47			

최대 손실 시나리오	
위험액	-32.47

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.42
-----	-------

[66] 테리츠2Star사모증권LEHC-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차

2) 만기: 2012년 4월 12일

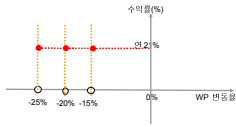
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

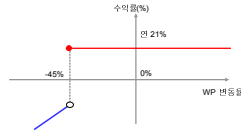
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보중주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 21%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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(장중포화)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%	2.50	1.90	1.30	0.69	0.09	-0.52	-1.12
	5.33%	2.61	2.00	1.40	0.79	0.19	-0.42	-1.02
시나리오	2.67%	2.38	1.77	1.17	0.56	-0.04	-0.65	-1.25
	0%	1.81	1.21	0.60	0.00	-0.60	-1.21	-1.81
오	-2.67%	0.92	0.31	-0.29	-0.90	-1.50	-2.10	-2.71
	-5.33%	-0.31	-0.91	-1.52	-2.12	-2.73	-3.33	-3.94
	-8%	-1.87	-2.47	-3.06	-3.66	-4.29	-4.89	-5.50

최대 손실 시나리오

위험액	-6.60
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	3.93
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

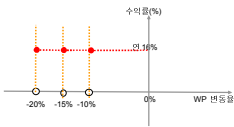
3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

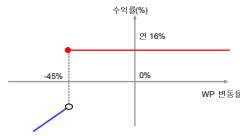
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오								
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%		
기초자산	8%	5.82	4.85	3.89	2.92	1.96	1.00	0.03	
시나리오	5.33%	5.65	4.69	3.72	2.76	1.79	0.83	-0.13	
	2.67%	4.67	3.71	2.75	1.78	0.82	-0.15	-1.11	
	0%	2.89	1.93	0.96	0.00	-0.96	-1.93	-2.89	
	-2.67%	0.30	-0.66	-1.63	-2.59	-3.55	-4.52	-5.48	
	-5.33%	-3.10	-4.06	-5.02	-5.99	-6.95	-7.91	-8.88	
	-8%	-7.30	-8.26	-9.23	-10.19	-11.16	-12.12	-13.08	

최대 손실 시나리오

위험액	-13.08
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.44
-----	-------

[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

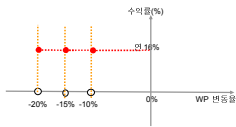
3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

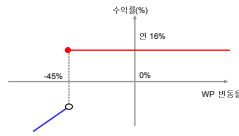
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
 KR6552340W48 주권투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.35	0.29	0.23	0.17	0.12	0.06	0.00
	5.33%	0.34	0.28	0.22	0.16	0.11	0.05	-0.01
	2.67%	0.28	0.22	0.16	0.11	0.05	-0.01	-0.07
	0%	0.17	0.12	0.06	0.00	-0.06	-0.12	-0.17
	-2.67%	0.02	-0.04	-0.10	-0.15	-0.21	-0.27	-0.33
	-5.33%	-0.16	-0.24	-0.30	-0.36	-0.42	-0.47	-0.53
	-8%	-0.44	-0.49	-0.55	-0.61	-0.67	-0.72	-0.78

최대 손실 시나리오

위험액	-0.78
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.86
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	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.

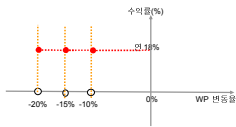
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

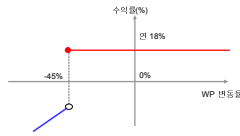
- 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	21.15	17.28	13.41	9.54	5.67	1.80	-2.07
시나리오	5.33%	20.22	16.35	12.48	6.61	4.74	0.87	-3.00
	2.67%	17.04	13.17	9.30	5.43	1.56	-2.31	-6.18
	0%	11.61	7.74	3.87	0.00	-3.67	-7.74	-11.61
	-2.67%	3.94	0.07	-3.80	-7.67	-11.54	-15.41	-19.28
	-5.33%	-8.99	-9.86	-13.73	-17.60	-21.47	-25.34	-29.21
	-8%	-18.15	-22.02	-25.89	-29.76	-33.63	-37.50	-41.37

최대 손실 시나리오

위험액	-41.37
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.98
-----	-------

[68] 테라츠2Star사모증권SET-4호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

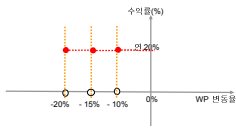
4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

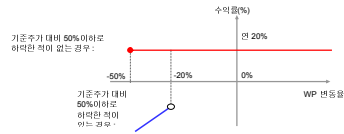
단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

초기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6622303W44 표보증권(ELS)322

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오								
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%		
기초자산	8%	5.44	4.36	3.27	2.19	1.11	0.03	-1.05	
시나리오	5.33%	6.12	5.04	3.95	2.87	1.79	0.71	-0.37	
	2.67%	5.39	4.31	3.22	2.14	1.06	-0.02	-1.10	
	0%	3.24	2.16	1.08	0.00	-1.08	-2.16	-3.24	
	-2.67%	-0.31	-1.39	-2.47	-3.55	-4.64	-5.72	-6.80	
	-5.33%	-5.28	-6.36	-7.44	-8.52	-9.60	-10.68	-11.76	
	-8%	-11.65	-12.74	-13.82	-14.90	-15.98	-17.06	-18.14	

최대 손실 시나리오

위험액	-18.14
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	19.17
-----	-------

[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

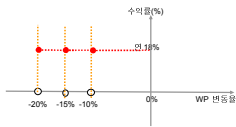
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

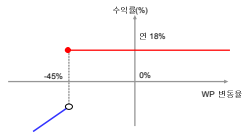
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 * 118%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환시 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%	11.64	9.51	7.38	5.25	3.12	0.99	-1.14	
시나리오	5.33%	11.12	8.99	6.86	4.74	2.61	0.48	-1.65	
	2.67%	9.37	7.24	5.11	2.99	0.86	-1.27	-3.40	
	0%	6.39	4.26	2.13	0.00	-2.13	-4.26	-6.39	
	-2.67%	2.17	0.04	-2.09	-4.22	-6.35	-8.48	-10.61	
	-5.33%	-3.29	-5.42	-7.55	-9.68	-11.81	-13.94	-16.07	
	-8%	-9.99	-12.11	-14.24	-16.37	-18.50	-20.63	-22.76	

최대 손실 시나리오

위험액	-22.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.00
-----	-------

[77] 테리츠2Star사로 SEST-3

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 29일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

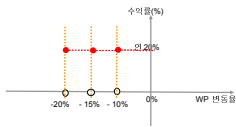
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

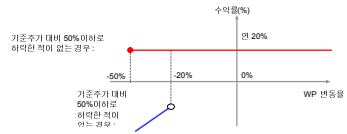
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

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	8%	7.15	6.30	5.46	4.61	3.76	2.92	2.07
시나리오	5.33%	6.18	5.33	4.49	3.64	2.80	1.95	1.10
	2.67%	4.64	3.80	2.95	2.11	1.26	0.41	-0.43
	0%	2.54	1.69	0.85	0.00	-0.85	-1.69	-2.54
	-2.67%	-0.14	-0.98	-1.83	-2.67	-3.52	-4.37	-5.21
	-5.33%	-3.38	-4.23	-5.07	-5.92	-6.76	-7.61	-8.46
	-8%	-7.19	-8.04	-8.88	-9.73	-10.58	-11.42	-12.27

최대 손실 시나리오

위험액	-12.27
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.02
-----	-------

[78] 테리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

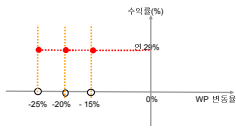
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

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

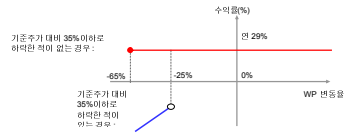
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 확정
- 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12.9%
 - 두 기초자산의 가액(중종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622313W42 표본증권(ELS)325

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	8.52	7.47	6.42	5.37	4.32	3.27	2.22
시나리오	5.33%	8.93	7.88	6.83	5.78	4.72	3.67	2.62
	2.67%	7.14	6.09	5.04	3.98	2.93	1.88	0.83
	0%	3.15	2.10	1.05	0.00	-1.05	-2.10	-3.15
	-2.67%	-3.03	-4.08	-5.13	-6.18	-7.23	-8.28	-9.33
	-5.33%	-1.40	-12.45	-13.50	-14.55	-15.60	-16.65	-17.70
	-8%	-21.96	-23.01	-24.06	-25.11	-26.16	-27.22	-28.27

최대 손실 시나리오

위험액	-28.27
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	27.36
-----	-------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

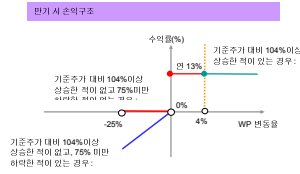
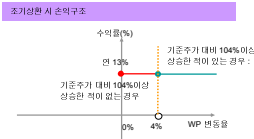
단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13%의 수익률로 중도상환

- 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.3%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모6호

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	9,213.30	8,532.98	7,852.65	7,172.33	6,492.01	5,811.69	5,131.36
	5.33%	6,813.67	6,133.35	5,453.02	4,772.70	4,092.38	3,412.05	2,731.73
	2.67%	4,422.89	3,742.57	3,062.24	2,381.92	1,701.60	1,021.28	340.95
시나리오	0%	2,040.97	1,360.65	680.32	0.00	-660.32	-1,360.65	-2,040.97
	-2.67%	-332.10	-1,012.42	-1,692.74	-2,373.07	-3,053.39	-3,733.71	-4,414.04
	-5.33%	-2,696.31	-3,376.63	-4,056.96	-4,737.28	-5,417.60	-6,097.92	-6,778.25
	-8%	-5,051.66	-5,731.99	-6,412.31	-7,092.63	-7,772.96	-8,453.28	-9,133.60

최대 손실 시나리오

위험액	-9,133.60
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,005.98
-----	----------

[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 KOSPI200지수

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

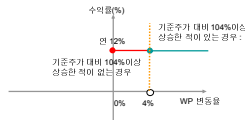
: 원금 * 11.2%

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

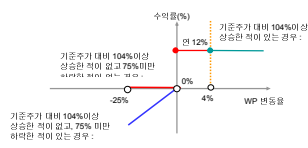
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호

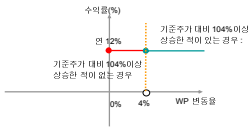
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	비율(1)	배도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	원위	

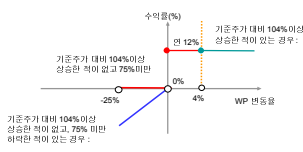
2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 16일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 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 (중중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[79-4] 메리츠주가지수연계사모6호

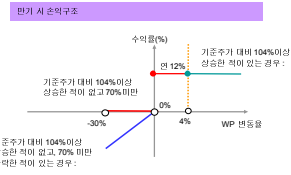
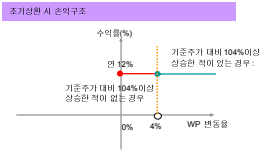
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

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



KR6008679TA3 굿모닝 신한증권(ELS)786

[79-5] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 10일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

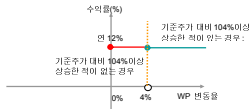
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

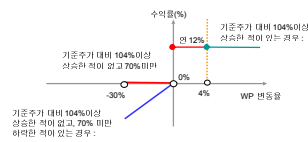
- 두 기초자산의 가격이 한 번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600086761B7 국토부 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 19일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가

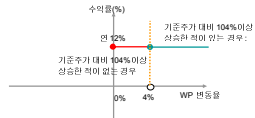
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정점에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

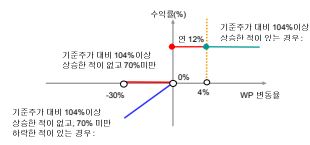
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6000867CTB8 굿모닝 신한증권(ELS)804

[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 15일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

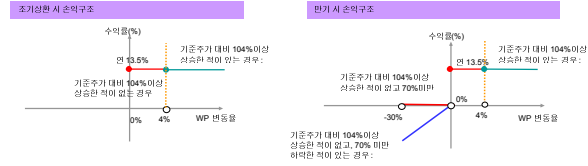
4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가

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

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

- 두 기초자산의 가격이 한 번도 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

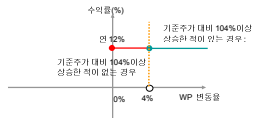
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

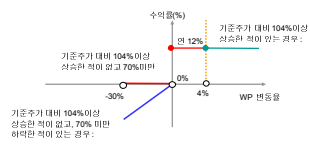
2. 만기시점의 손익구조

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

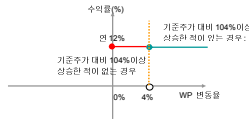
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위: (백만원)

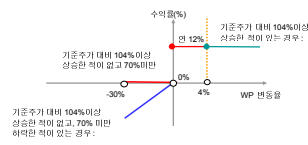
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 11월 08일
 - 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
 - 4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
 - 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기상환일정일에 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 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

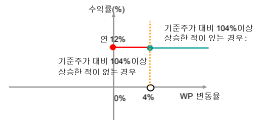
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

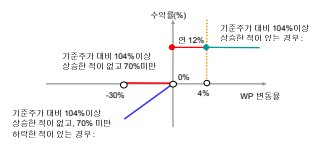
2. 만기시점의 손익구조

- 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) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 13일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

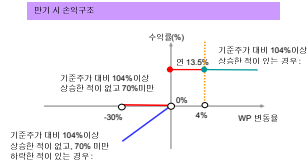
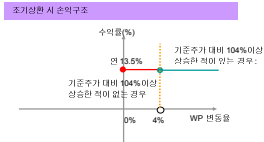
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

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

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



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)

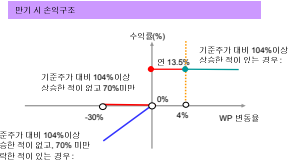
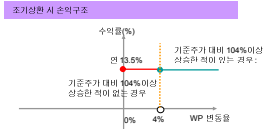
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매3개월마다 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: 만기일 전날 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기일 전날까지 장중지수를 포함하여 최초

기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우

- 만기일 전날 지수기 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우

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

- 만기일 전날 지수기 최초기준가격 미만일 경우

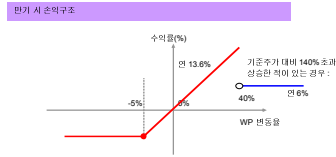
: 원금 * 95%

기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기일 전날까지 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%	1.33	-0.02	-1.37	-2.72	-4.07	-5.42	-6.77
시나리오	5.33%	2.51	1.16	-0.19	-1.53	-2.88	-4.23	-5.58
	2.67%	3.42	2.07	0.72	-0.63	-1.98	-3.33	-4.68
	0%	4.05	2.70	1.35	0.00	-1.35	-2.70	-4.05
	-2.67%	4.40	3.05	1.70	0.35	-1.00	-2.35	-3.70
	-5.33%	4.47	3.12	1.77	0.42	-0.93	-2.28	-3.63
	-8%	4.26	2.91	1.56	0.21	-1.14	-2.49	-3.84

최대 손실 시나리오

위험액	-3.64
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.75
-----	------

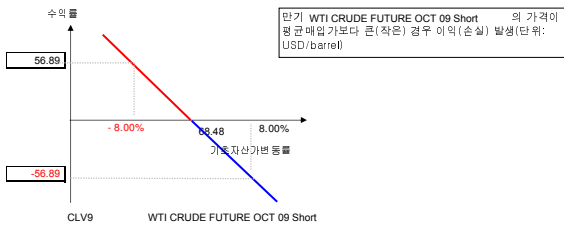
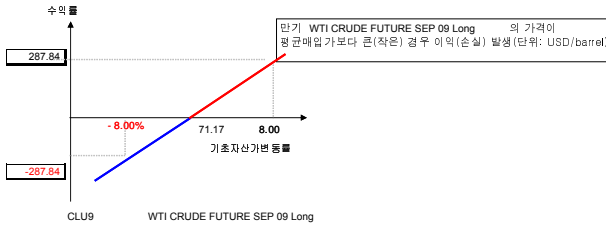
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

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. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위: 1,000 USD)

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

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8%	230.94
	5.33%	153.87
	2.67%	77.08
	0%	0.00
	-2.67%	-77.08
	-5.33%	-153.87
-8%	-230.94	

최대손실 시나리오	
위험액	-230.94

4. 특정상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,397
-----	-------

[78] 데리 조주가지 수연계사모증권I[E]

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 평가대상상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

2) 만기: 2010년 5월 28일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

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

5) 발행 후 매3개월마다 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, 만기시까지 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

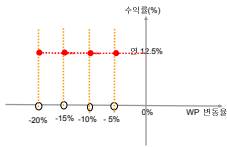
: 원금 * 112.5%

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

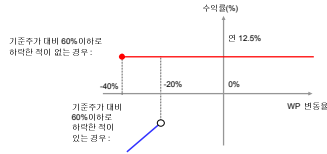
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6523310W80 대우증권ELS3005

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초 자산 시나리오	8%	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36
	5.33%	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17
	2.67%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
	0%	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
손익 구조	-2.67%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
	-5.33%	-0.16	-0.16	-0.16	-0.16	-0.16	-0.16	-0.16
	-8%	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36	-0.36

최대 손실 시나리오

위험액	-0.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.08
-----	------

[79] 데리 초주가지 수연계사모증권! 61E

1. 계약금액

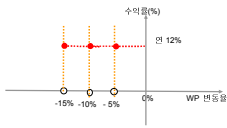
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위: (백만원)

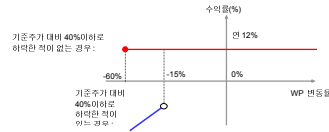
2. 연가시점의 손익구조

- 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 기초자산가(기준)로 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, 연가시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (연가 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환시 손익구조



연가시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6503305W69 코모닝 신한동권(ELS)1039

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-3.24	-4.60	-6.36	-7.92	-9.48	-11.05	-12.61
	5.33%	3.91	2.35	0.79	-0.77	-2.33	-3.89	-5.45
시나리오	2.67%	6.55	4.99	3.43	1.87	0.31	-1.25	-2.81
	0%	4.68	3.12	1.56	0.00	-1.56	-3.12	-4.68
	-2.67%	-1.70	-3.26	-4.82	-6.38	-7.94	-9.51	-11.07
	-5.33%	-12.60	-14.16	-15.72	-17.28	-18.84	-20.40	-21.96
	-8%	-28.00	-29.56	-31.12	-32.69	-34.25	-35.81	-37.37

최대 손실 시나리오

위험액	-37.37
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	32.04
-----	-------

[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호

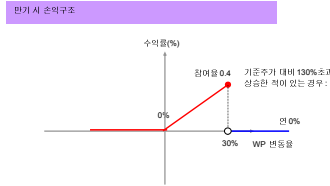
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 만기일 당일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 5월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기일 당일까지 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	5.33%	1.33	-0.76	-2.85	-4.94	-7.04	-9.13	-11.22
손익	2.67%	3.98	1.88	-0.21	-2.30	-4.39	-6.48	-8.57
시나리오	0%	6.27	4.18	2.09	0.00	-2.09	-4.18	-6.27
	-2.67%	8.22	6.13	4.04	1.95	-0.14	-2.23	-4.32
	-5.33%	9.83	7.73	5.64	3.55	1.46	-0.83	-2.72
	-8%	11.08	8.99	6.90	4.81	2.72	0.62	-1.47

최대 손실 시나리오

위험액	-1.47
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.89
-----	-------

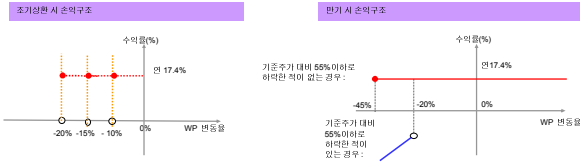
[82] 데리츠2Star사모증권SE-ST-8호

1. 계약금액

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

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 중도상환가액이 낮은 기초자산(기준)으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)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)

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	5.79	5.09	4.40	3.70	3.00	2.30	1.60
	5.33%	5.26	4.56	3.87	3.17	2.47	1.77	1.08
	2.67%	4.03	3.33	2.63	1.94	1.24	0.54	-0.16
손익	0%	2.08	1.40	0.70	0.00	-0.70	-1.40	-2.08
시나리오	-2.67%	-0.55	-1.24	-1.94	-2.64	-3.34	-4.04	-4.73
	-5.33%	-3.89	-4.59	-5.29	-5.98	-6.68	-7.38	-8.08
	-8%	-7.94	-8.63	-9.33	-10.03	-10.73	-11.43	-12.12

최대 손실 시나리오

위험액	-12.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	11.74
-----	-------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

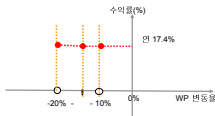
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

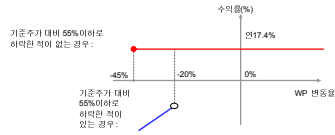
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기시 수익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))
KR652233W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	37.22	32.73	28.25	23.76	19.28	14.80	10.31
	5.33%	33.82	29.33	24.85	20.36	15.88	11.39	6.91
	2.67%	25.90	21.41	16.93	12.44	7.96	3.47	-1.01
0%	13.45	8.97	4.48	0.00	-4.48	-8.97	-13.45	
-2.67%	-9.51	-7.99	-12.46	-16.96	-21.45	-25.93	-30.42	
-5.33%	-24.99	-29.48	-33.96	-38.45	-42.93	-47.42	-51.90	
-8%	-61.00	-65.48	-69.97	-74.45	-78.93	-83.42	-77.90	

최대 손실 시나리오

위험액	-77.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	75.46
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

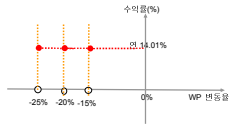
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	차입

단위: (백만원)

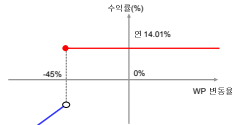
2. 만기시점의 손익구조

- 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 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 114.01%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6662305W64 - 한화스마트(ELS)132

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.33	0.18	0.04	-0.11	-0.26	-0.41	-0.56
손익	5.33%	0.63	0.49	0.34	0.19	0.04	-0.11	-0.25
시나리오	2.67%	0.67	0.52	0.36	0.23	0.08	-0.07	-0.22
	0%	0.44	0.30	0.15	0.00	-0.15	-0.30	-0.44
	-2.67%	-0.05	-0.20	-0.34	-0.49	-0.64	-0.79	-0.94
	-5.33%	-0.80	-0.95	-1.10	-1.25	-1.40	-1.54	-1.69
	-8%	-1.83	-1.97	-2.12	-2.27	-2.42	-2.57	-2.71

최대 손실 시나리오

위험액	-2.71
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.54
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

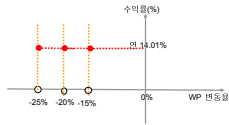
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

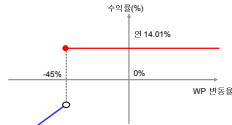
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR6662305W64 권위스마트(ELS)132

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.20	0.67	0.13	-0.40	-0.94	-1.47	-2.01
	5.33%	2.29	1.76	1.22	0.69	0.15	-0.38	-0.92
시나리오	2.67%	2.42	1.89	1.36	0.82	0.29	-0.25	-0.78
	0%	1.60	1.07	0.53	0.00	-0.53	-1.07	-1.60
	-2.67%	-0.11	-0.71	-1.24	-1.78	-2.31	-2.85	-3.38
	-5.33%	-2.90	-3.44	-3.97	-4.51	-5.04	-5.58	-6.11
	-8%	-6.59	-7.13	-7.66	-8.20	-8.73	-9.26	-9.80

최대 손실 시나리오	
위험액	-9.80

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.55
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호

1. 계약금액

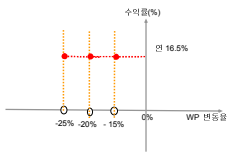
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

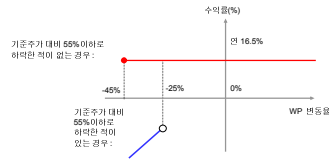
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	8%	0.01	-0.01	-0.02	-0.04	-0.05	-0.07	-0.09
	5.33%	0.07	0.05	0.04	0.02	0.00	-0.01	-0.03
시나리오	2.67%	0.08	0.06	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.01
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.03	-0.05
	-2.67%	-0.03	-0.05	-0.06	-0.08	-0.09	-0.11	-0.13
	-5.33%	-0.16	-0.17	-0.19	-0.20	-0.22	-0.23	-0.25
	-8%	-0.33	-0.34	-0.36	-0.37	-0.39	-0.41	-0.42

최대 손실 시나리오

위험액	-0.42
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.63
-----	------

[87] 데리츠2SIa사모증권SEKT-이 호

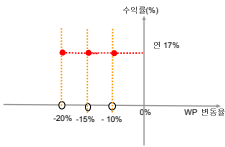
1. 계약금액

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

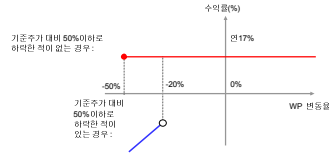
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 10일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조의 범위(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%	4.69	3.92	3.16	2.39	1.63	0.86	0.09
손실	5.33%	4.47	3.70	2.94	2.17	1.41	0.64	-0.13
시나리오	2.67%	3.67	2.91	2.14	1.37	0.61	-0.16	-0.92
	0%	2.30	1.53	0.77	0.00	-0.77	-1.53	-2.30
	-2.67%	0.35	-0.42	-1.19	-1.95	-2.72	-3.48	-4.25
	-5.33%	-2.18	-2.95	-3.71	-4.48	-5.24	-6.01	-6.78
	-8%	-5.29	-6.05	-6.82	-7.58	-8.35	-9.12	-9.88

최대 손실 시나리오

위험액	-9.88
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.42
-----	------

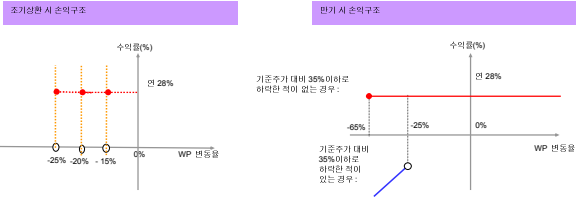
[88] 데리츠2Star사로증권SCDM-1호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 15일 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주의 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 : 원금 * 128%
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백 만원)

KR6622309W55 코브증권(ELS)344

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	45.69	35.13	24.56	14.02	3.46	-7.10	-17.65
	5.33%	41.53	30.97	20.42	9.86	-0.70	-11.26	-21.81
산	2.67%	36.86	26.30	15.74	5.19	-5.37	-15.93	-26.49
	0%	31.67	21.12	10.56	0.00	-10.56	-21.12	-31.67
시나리오	-2.67%	25.97	15.42	4.86	-5.70	-16.26	-26.81	-37.51
	-5.33%	19.76	9.20	-1.35	-11.91	-22.47	-33.03	-43.58
	-8%	13.04	2.48	-8.06	-16.64	-29.19	-39.75	-50.31

최대 손실 시나리오

위험액	-50.31
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	49.39
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

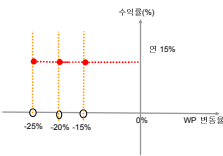
1. 계약금액

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

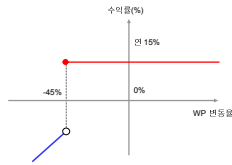
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO
- 2) 만기: 2012년 5월 11일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 13일 LG전자 보통주, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, POSCO 주가)의 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
: 평균 * 115%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.39	0.31	0.24	0.17	0.10	0.03	-0.04
손익	5.33%	0.36	0.29	0.22	0.15	0.08	0.01	-0.07
시나리오	2.67%	0.31	0.23	0.16	0.09	0.02	-0.05	-0.12
	0%	0.21	0.14	0.07	0.00	-0.07	-0.14	-0.21
	-2.67%	0.09	0.02	-0.05	-0.12	-0.20	-0.27	-0.34
	-5.33%	-0.07	-0.14	-0.21	-0.29	-0.36	-0.43	-0.50
	-8%	-0.27	-0.34	-0.41	-0.48	-0.55	-0.62	-0.70

최대 손실 시나리오

위험액	-0.70
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.56
-----	------

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

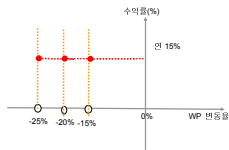
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위: (백만원)

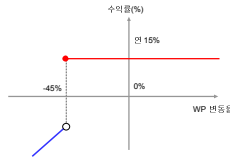
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO
- 2) 만기: 2012년 5월 11일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 13일 LG전자 보통주, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, POSCO 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 만할 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 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%	29.32	23.89	18.46	13.02	7.59	2.16	-3.28
손익	5.33%	27.59	22.16	16.73	11.30	5.86	0.43	-5.00
손익	2.67%	23.25	17.82	12.39	6.95	1.52	-3.91	-9.34
손익	0%	16.30	10.87	5.43	0.00	-6.43	-10.87	-16.30
손익	-2.67%	6.73	1.30	-4.14	-9.57	-15.00	-20.43	-25.87
손익	-5.33%	-9.45	-10.89	-16.32	-21.75	-27.18	-32.61	-38.05
손익	-8%	-20.25	-25.68	-31.11	-36.54	-41.98	-47.41	-52.84

최대 손실 시나리오

위험액	-52.84
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	42.90
-----	-------

[91] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

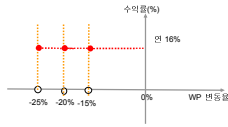
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	잔위

단위:백만원

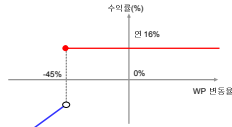
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 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 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.75	0.60	0.44	0.29	0.14	-0.02	-0.17
손익	5.33%	0.70	0.54	0.39	0.24	0.08	-0.07	-0.22
시나리오	2.67%	0.60	0.45	0.29	0.14	-0.01	-0.17	-0.32
	0%	0.46	0.31	0.15	0.00	-0.15	-0.31	-0.46
	-2.67%	0.28	0.12	-0.03	-0.18	-0.33	-0.49	-0.64
	-5.33%	0.05	-0.10	-0.25	-0.41	-0.56	-0.71	-0.87
	-8%	-0.21	-0.37	-0.52	-0.67	-0.83	-0.98	-1.13

최대 손실 시나리오

위험액	-1.13
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.95
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

1. 계약금액

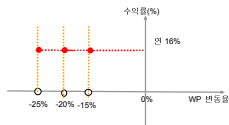
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

단위:백만원

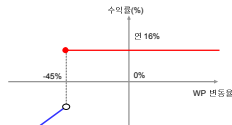
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%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 * 116%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 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%	13.44	10.70	7.96	5.21	2.47	-0.28	-3.02
	5.33%	12.46	9.72	6.96	4.23	1.49	-1.26	-4.00
시나리오	2.67%	10.73	7.96	5.24	2.49	-0.25	-2.99	-5.74
	0%	8.23	5.49	2.74	0.00	-2.74	-5.49	-8.23
	-2.67%	4.93	2.24	-0.51	-3.25	-6.00	-8.74	-11.48
	-5.33%	0.97	-1.77	-4.52	-7.26	-10.00	-12.75	-15.49
	-8%	-3.79	-6.54	-9.28	-12.03	-14.77	-17.51	-20.26

최대 손실 시나리오

위험액	-20.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.00
-----	-------

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

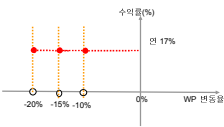
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

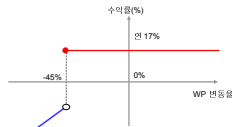
2. 연가시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 현대차 보통주
- 연가: 2012년 4월 27일
- 연도청산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2009년 4월 30일 LG전자 보통주, 현대차 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 현대차 보통주 주가)의 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, 연가시점의 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 월드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우
 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (연가기준지수/최초기준지수)
- 연도의 수익구조

조기상환 시 손익구조



연가시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	14.38	10.88	7.37	3.87	0.37	-3.14	-6.64
손실	5.33%	14.25	10.75	7.25	3.74	0.24	-3.26	-6.77
시나리오	2.67%	12.96	9.46	5.96	2.45	-1.05	-4.55	-8.06
	0%	10.51	7.01	3.50	0.00	-3.50	-7.01	-10.51
	-2.67%	6.89	3.39	-0.12	-3.62	-7.12	-10.63	-14.13
	-5.33%	2.11	-1.40	-4.90	-8.40	-11.91	-15.41	-18.91
	-8%	-3.84	-7.34	-10.85	-14.35	-17.85	-21.36	-24.86

최대 손실 시나리오

위험액	-24.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.30
-----	-------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

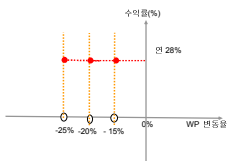
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위(백만원)

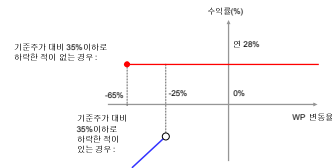
2. 만기시점의 손익구조

- 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 만드 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) 만드 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	5.33%	27.19	20.82	14.46	8.09	1.72	-4.65	-11.02
시나리오	2.67%	23.65	17.28	10.91	4.54	-1.82	-8.19	-14.56
	0%	19.11	12.74	6.37	0.00	-6.37	-12.74	-19.11
	-2.67%	13.56	7.19	0.82	-5.94	-11.91	-18.28	-24.65
	-5.33%	7.02	0.65	-5.72	-12.09	-18.46	-24.82	-31.19
	-8%	-0.53	-6.89	-13.26	-19.63	-26.00	-32.37	-38.74

최대 손실 시나리오

위험액	-38.74
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	45.39
-----	-------

[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호

1. 계약금액

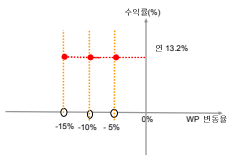
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위: (백만원)

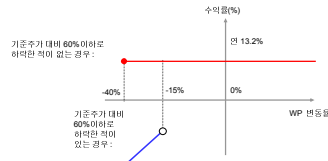
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.25	-0.25	-0.25	-0.24	-0.24	-0.24	-0.24
	5.33%	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10
	2.67%	-0.02	-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	0.00
	-2.67%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.04	-0.04
-5.33%	-0.16	-0.16	-0.16	-0.16	-0.16	-0.16	-0.15	
-8%	-0.33	-0.33	-0.33	-0.33	-0.33	-0.33	-0.33	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.33
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

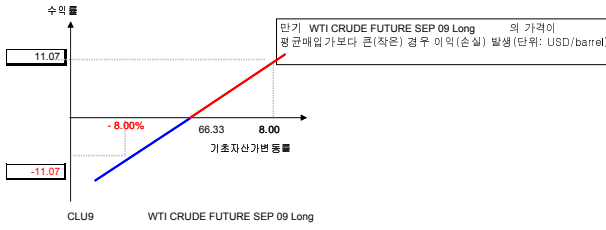
위험액	0.11
-----	------

[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

2. 연기시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	
기초자산	8%	11.07
	5.33%	7.38
	2.67%	3.69
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.69
	-5.33%	-7.38
	-8%	-11.07

최대손실 시나리오	
위험액	-11.07

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.4
-----	-----

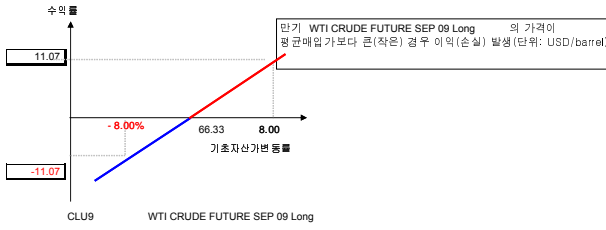
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

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 손익구조



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

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 Long

구분	시나리오	손실액
기초자산	8%	280.48
	5.33%	186.87
	2.67%	93.61
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-93.61
	-5.33%	-186.87
	-8%	-280.48

최대 손실 시나리오	
위험액	-280.48

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

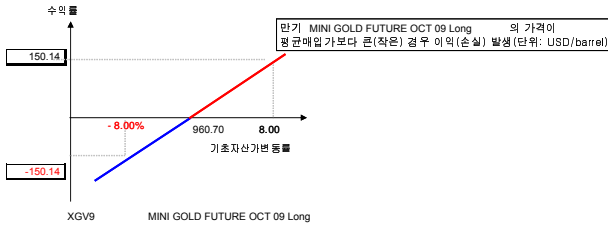
위험액	1.136
-----	-------

[96-2] 헤지 초 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. 헷지시점의 손익 구조



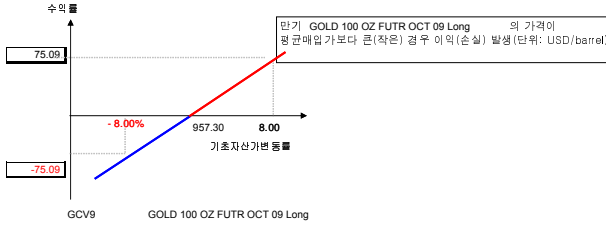
[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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

