

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

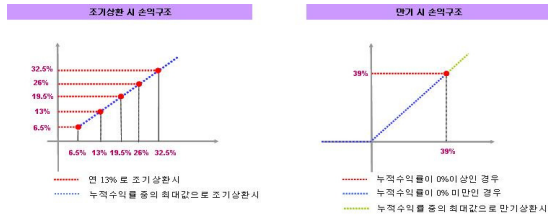
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.13	0.11	0.10	0.08	0.06	0.04	0.03
	5.33%	0.11	0.09	0.08	0.06	0.04	0.02	0.01
	2.67%	0.08	0.07	0.05	0.03	0.01	-0.01	-0.02
	0%	0.05	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.05
	-2.67%	0.01	-0.00	-0.02	-0.04	-0.06	-0.07	-0.09
	-5.33%	-0.03	-0.05	-0.06	-0.08	-0.10	-0.12	-0.13
-8%	-0.08	-0.10	-0.11	-0.13	-0.15	-0.17	-0.18	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.16
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.22
-----	------

[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 기건을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 우리금융지주 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -16%(2차 중도상환일), -22%(3차 중도상환일), -28%(4차 중도상환일), -34%(5차 중도상환일), -40%(만기상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(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%	0.13	0.11	0.10	0.08	0.06	0.04	0.03
	5.33%	0.10	0.09	0.07	0.05	0.03	0.02	-0.00
시나리오	2.67%	0.08	0.06	0.04	0.02	0.01	-0.01	-0.03
	0%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
	-2.67%	0.03	0.01	-0.01	-0.02	-0.04	-0.06	-0.08
	-5.33%	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06	-0.08	-0.10
	-8%	-0.01	-0.03	-0.05	-0.07	-0.08	-0.10	-0.12

최대 손실 시나리오

위험액	-0.12
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.26
-----	------

14) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

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) 만월 20.0%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

: 만월 * 140%

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

: 만월 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력작성증권(ELS)243

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-11.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	12.69	11.62	10.54	9.47	8.39	7.32	6.24
	5.33%	9.78	8.71	7.63	6.56	5.48	4.41	3.33
	2.67%	6.62	5.55	4.48	3.40	2.33	1.25	0.18
	0%	3.22	2.15	1.07	0.00	-1.07	-2.15	-3.22
	-2.67%	-0.42	-1.50	-2.57	-3.65	-4.72	-5.80	-6.87
	-5.33%	-4.32	-5.39	-6.46	-7.54	-8.61	-9.69	-10.76
	-8%	-8.45	-9.53	-10.60	-11.68	-12.75	-13.83	-14.90

최대 손실 시나리오

위험액	-14.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.65
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자전략 25호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600345TTB9 만드증권(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	13.23	12.38	11.53	10.68	9.84	8.99	8.14
	5.33%	9.73	8.88	8.03	7.19	6.34	5.49	4.64
	2.67%	6.17	5.32	4.47	3.63	2.78	1.93	1.08
	0%	2.54	1.70	0.85	0.00	-0.85	-1.70	-2.54
	-2.67%	-1.15	-1.99	-2.84	-3.69	-4.54	-5.38	-6.23
	-5.33%	-4.90	-5.75	-6.60	-7.44	-8.29	-9.14	-9.99
	-8%	-8.72	-9.57	-10.41	-11.26	-12.11	-12.96	-13.80

최대 손실 시나리오

위험액	-13.80
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.75
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 2월 22일

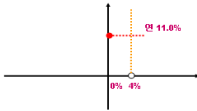
3) 만드첨산 결정주기: 매 3개월

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

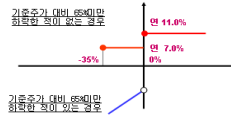
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 폐지
 - 두 기초자산의 가격이 원본투자 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의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

6) 만드의 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	8%	431.44	409.56	387.68	365.79	343.91	322.02	300.14
시나리오	5.33%	308.16	286.27	264.39	242.50	220.62	198.73	176.85
	2.67%	186.23	164.34	142.46	120.57	98.69	76.80	54.92
	0%	65.65	43.77	21.88	0.00	-21.88	-43.77	-65.65
	-2.67%	-53.56	-75.44	-97.33	-119.21	-141.10	-162.98	-184.87
	-5.33%	-171.41	-193.30	-215.18	-237.07	-258.95	-280.83	-302.72
	-8%	-287.91	-309.79	-331.67	-353.56	-375.44	-397.33	-419.21

최대 손실 시나리오

위험액	-419.21
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	413.81
-----	--------

[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. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 2월 22일

3) 만드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

연월 11.2%의 수익률로 중도 상환이 됨.

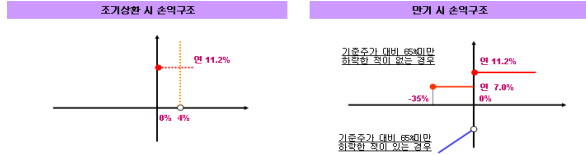
단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

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

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

: 원금 * (만기기준지수/초기기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 수익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345ST27 최대 손실 (ELS) 2007-3984

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	41.51	39.40	37.29	35.18	33.07	30.96	28.85
시나리오	5.33%	29.65	27.54	25.43	23.32	21.21	19.10	16.99
	2.67%	17.92	15.81	13.70	11.59	9.48	7.38	5.27
	0%	6.33	4.22	2.11	0.00	-2.11	-4.22	-6.33
	-2.67%	-5.13	-7.24	-9.35	-11.46	-13.57	-15.68	-17.79
	-5.33%	-16.47	-18.58	-20.69	-22.80	-24.91	-27.02	-29.12
	-8%	-27.67	-29.78	-31.89	-34.00	-36.11	-38.22	-40.33

최대 손실 시나리오

위험액	-40.33
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.76
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

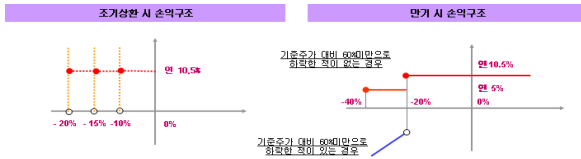
1. 계약금액

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 기한을 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 만드 확정
- 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) 만드의 수익구조



3. 손익구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR600172YT43 신영증권(ELS)552

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	552.41	510.20	467.96	425.77	383.56	341.35	299.14
시나리오	5.33%	423.71	381.50	339.29	297.08	254.87	212.66	170.44
	2.67%	281.79	239.58	197.37	155.16	112.94	70.73	28.52
	0%	126.63	84.42	42.21	0.00	-42.21	-84.42	-126.63
	-2.67%	-41.75	-83.96	-126.16	-168.39	-210.60	-252.81	-295.02
	-5.33%	-223.37	-265.58	-307.79	-350.00	-392.22	-434.43	-476.64
	-8%	-418.22	-460.43	-502.64	-544.85	-587.07	-629.28	-671.49

최대 손실 시나리오	
위험액	-671.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	666.09
-----	--------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

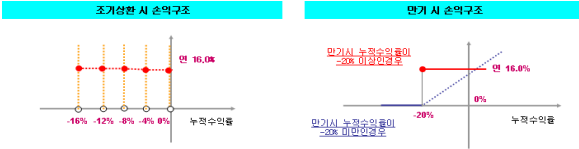
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 만기: 2010년 6월 3일
- 관점자산 결정 주기: 매 6개월
- 기준지수: 2007년 6월 5일의 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 초기 상환 일정일에 0%(1차 중도상환일), -4%(2차 중도상환일), -8%(3차 중도상환일), -12%(4차 중도상환일), -16%(5차 중도상환일), -20%(6차 중도상환일) 이상인 경우 16.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)
단, 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 손실(ELS)2007-504

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.07	0.93	0.80	0.66	0.52	0.38	0.24
	5.33%	0.86	0.72	0.56	0.45	0.31	0.17	0.03
	2.67%	0.64	0.50	0.37	0.23	0.09	-0.05	-0.19
	0%	0.42	0.28	0.14	0.00	-0.14	-0.28	-0.42
	-2.67%	0.18	0.04	-0.10	-0.23	-0.37	-0.51	-0.65
	-5.33%	-0.06	-0.20	-0.34	-0.48	-0.62	-0.75	-0.89
	-8%	-0.31	-0.45	-0.59	-0.73	-0.87	-1.00	-1.14

최대 손실 시나리오	
위험액	-1.14

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.24
-----	------

[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) 장의파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 8월 13일

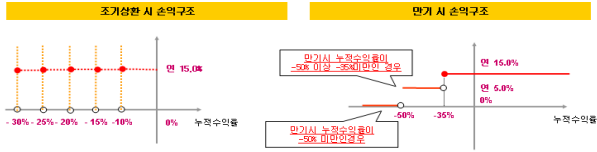
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만드 해지
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%미만인 경우: 역편금액 지급 (원금보장추주)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상종형(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	2.21	1.86	1.51	1.15	0.80	0.45	0.10
	5.33%	1.84	1.49	1.14	0.79	0.43	0.08	-0.27
	2.67%	1.46	1.10	0.75	0.40	0.05	-0.30	-0.65
	0%	1.06	0.70	0.35	0.00	-0.35	-0.70	-1.06
	-2.67%	0.64	0.29	-0.07	-0.42	-0.77	-1.12	-1.47
	-5.33%	0.20	-0.15	-0.50	-0.85	-1.20	-1.56	-1.91
	-8%	-0.25	-0.60	-0.95	-1.30	-1.65	-2.01	-2.36

최대 손실 시나리오

위험액 -2.36

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 3.62

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

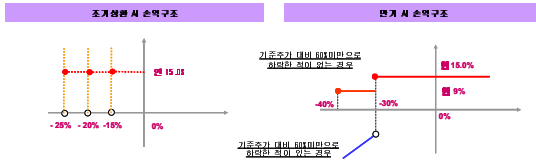
1. 계약금액

구분	기대자산	가액유형	여수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,623	0	1,623	차입

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762L197 미래예상점 (ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	261.35	256.81	252.26	247.75	243.22	238.68	234.15
	5.33%	184.64	180.11	175.56	171.04	166.51	161.98	157.45
	2.67%	102.06	97.53	92.99	88.46	83.93	79.39	74.86
	0%	13.60	9.07	4.53	0.00	-4.53	-9.07	-13.60
	-2.67%	-80.74	-85.27	-89.80	-94.34	-98.87	-103.40	-107.93
	-5.33%	-180.95	-185.49	-190.02	-194.55	-199.08	-203.62	-208.15
	-8%	-287.04	-291.58	-296.11	-300.64	-305.17	-309.71	-314.24

최대 손실 시나리오

위험액	-314.24
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	346.72
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제12호

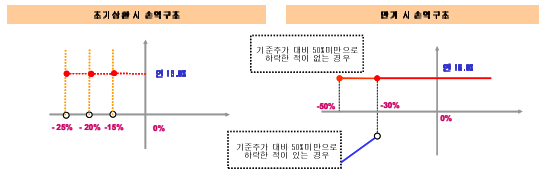
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 증가
- 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 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 132%
 - 두 기초자산의 가격(중중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 최(최대)손실가능금액(단위:백만원)
KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	159.01	152.75	146.50	140.24	133.98	127.72	121.47
	5.33%	110.47	104.22	97.96	91.70	85.44	79.19	72.93
	2.67%	63.73	57.47	51.21	44.95	38.70	32.44	26.18
	0%	18.77	12.52	6.26	0.00	-6.26	-12.52	-18.77
	-2.67%	-24.39	-30.65	-36.90	-43.16	-49.42	-55.68	-61.93
	-5.33%	-65.76	-72.02	-78.27	-84.53	-90.79	-97.05	-103.30
	-8%	-105.33	-111.59	-117.85	-124.11	-130.36	-136.62	-142.88

최대 손실 시나리오

위험액	-142.88
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	140.67
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

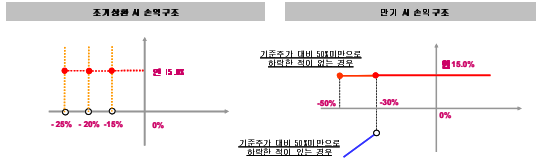
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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

KR603762BT80 미래예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.34	5.08	4.81	4.54	4.27	4.01	3.74
	5.33%	3.94	3.67	3.41	3.14	2.87	2.60	2.34
	2.67%	2.43	2.16	1.89	1.62	1.36	1.09	0.82
	0%	0.80	0.54	0.27	0.00	-0.27	-0.54	-0.80
	-2.67%	-0.93	-1.20	-1.47	-1.74	-2.00	-2.27	-2.54
	-5.33%	-2.78	-3.05	-3.31	-3.58	-3.85	-4.12	-4.38
	-8%	-4.74	-5.00	-5.27	-5.54	-5.81	-6.07	-6.34

최대 손실 시나리오

위험액	-6.34
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	6.52
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 피생상품투자신탁 15호

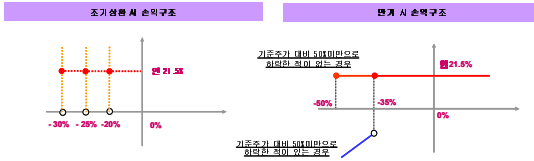
1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액금(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 기한을 설정하고, 기초자산(LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이 상한 경우(첫번째 중도상환일), 75%이 상한 경우(두번째 중도상환일), 70%이 상한 경우(세번째 중도상환일), 65%이 상한 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 변동증권(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	208.36	183.27	158.18	133.09	108.00	82.91	57.82
	5.33%	163.53	138.44	113.35	88.26	63.17	38.08	12.99
	2.67%	119.17	94.08	68.99	43.90	18.81	-6.28	-31.37
	0%	75.27	50.18	25.09	0.00	-25.09	-50.18	-75.27
	-2.67%	31.84	6.75	-18.34	-43.43	-68.52	-93.62	-118.71
	-5.33%	-11.13	-36.22	-61.31	-86.40	-111.49	-136.58	-161.68
	-8%	-53.64	-78.73	-103.82	-128.91	-154.00	-179.09	-204.18

최대 손실 시나리오

위험액 -204.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 196.43

[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

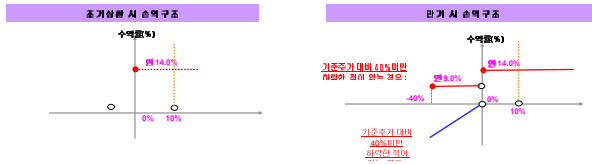
3) 만도점산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 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%	560.02	531.43	502.84	474.25	445.66	417.08	388.49
	5.33%	411.09	382.50	353.91	325.33	296.74	268.15	239.56
시나리오	2.67%	253.01	224.42	195.83	167.24	138.65	110.07	81.48
	0%	85.76	57.18	28.59	0.00	-29.99	-57.18	-85.76
	-2.67%	-90.84	-119.22	-147.61	-176.00	-204.39	-233.56	-262.16
	-5.33%	-276.19	-304.78	-333.37	-361.96	-390.54	-419.13	-447.72
	-8%	-470.91	-499.50	-528.08	-556.67	-585.26	-613.85	-642.44

최대 손실 시나리오

위험액	-642.44
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	622.28
-----	--------

[17]테리 조StepDown사모단 위 과정26호

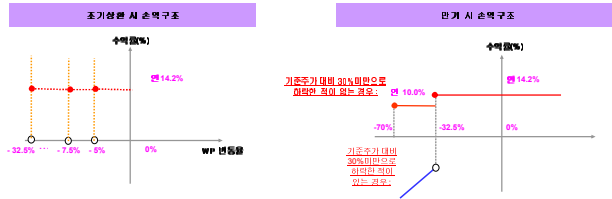
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR600867BTB0 코무담신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	214.13	180.63	147.13	113.63	80.14	46.64	13.14
	5.33%	176.76	143.26	109.76	76.27	42.77	9.27	-24.23
	2.67%	138.88	105.38	71.89	38.39	4.89	-26.61	-62.11
	0%	100.49	67.00	33.50	0.00	-33.50	-67.00	-100.49
	-2.67%	61.60	28.10	-5.40	-38.90	-72.40	-105.89	-139.39
	-5.33%	22.19	-11.31	-44.81	-78.31	-111.80	-145.30	-178.80
	-8%	-17.73	-51.23	-84.73	-118.22	-151.72	-185.22	-218.72

최대 손실 시나리오
위험액 -218.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 219.08

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

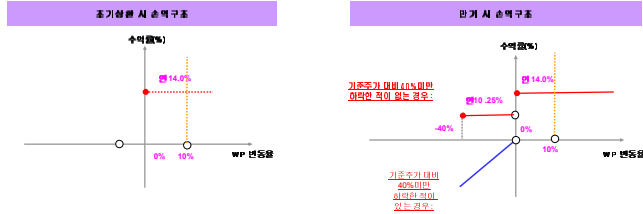
1. 계약금액

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



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS121회)

구분	수익구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	107.58	101.06	94.54	88.02	81.50	74.98	68.45
	5.33%	77.48	70.96	64.44	57.92	51.40	44.88	38.36
시나리오	2.67%	48.15	41.62	35.10	28.58	22.06	15.54	9.02
	0%	19.56	13.04	6.52	0.00	-6.52	-13.04	-19.56
	-2.67%	-8.26	-14.78	-21.30	-27.82	-34.34	-40.87	-47.39
	-5.33%	-35.32	-41.84	-48.36	-54.88	-61.41	-67.93	-74.45
	-8%	-81.83	-68.15	-74.67	-81.19	-87.71	-94.23	-100.75

최대 손실 시나리오	
위험액	68.45

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	103.41
-----	--------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가5호

1. 계약금액

단위(백만원)						
구분	기대대상	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) 평가: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산 결정일자: 매 6개월

4) 기준일자: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

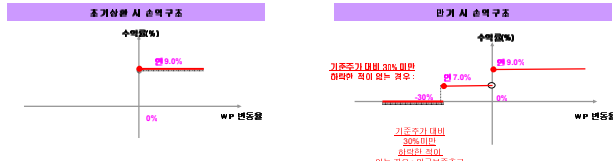
단, 평가시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한적이 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%	46.22	42.20	38.17	34.15	30.13	26.10	22.08
	5.33%	35.45	31.43	27.40	23.38	19.35	15.33	11.31
	2.67%	24.07	20.04	16.02	12.00	7.97	3.95	-0.08
	0%	12.07	8.05	4.02	0.00	-4.02	-8.05	-12.07
	-2.67%	-0.54	-4.56	-8.58	-12.61	-16.63	-20.65	-24.68
	-5.33%	-13.75	-17.78	-21.80	-25.83	-29.85	-33.87	-37.90
	-8%	-27.59	-31.61	-35.63	-39.66	-43.68	-47.70	-51.73

최대 손실 시나리오

위험액	22.08
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	53.04
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼싱 6호

1. 계약금액

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

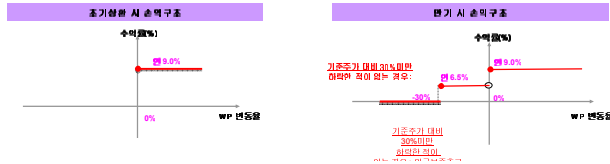
단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 미래에셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	77.92	74.84	71.75	68.67	65.58	62.50	59.41
	5.33%	52.17	49.09	46.00	42.92	39.83	36.75	33.67
	2.67%	29.28	26.20	23.11	20.03	16.95	13.86	10.78
	0%	9.25	6.17	3.08	0.00	-3.08	-6.17	-9.25
	-2.67%	-7.92	-11.00	-14.09	-17.17	-20.25	-23.34	-26.42
	-5.33%	-22.23	-25.31	-28.40	-31.48	-34.57	-37.65	-40.73
	-8%	-33.68	-36.76	-39.85	-42.93	-46.02	-49.10	-52.19

최대 손실 시나리오

위험액	59.41
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	44.03
-----	-------

[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) 만도청산 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 보 통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.

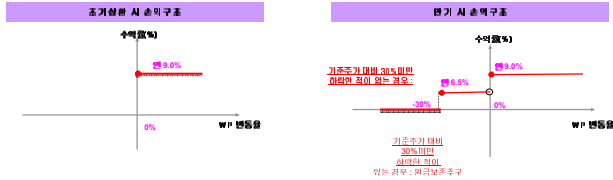
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가격이 만도기 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없고, 최초기 기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%

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

: 원금*100%

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래예정종결(ELS)317

손익 구조변동률 시나리오

구분		변동률 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초 자산	8%	60.61	56.21	55.61	53.41	51.01	48.61	46.21
	5.33%	40.56	36.16	35.76	33.36	30.96	28.56	26.16
시나리오	2.67%	22.78	20.38	17.98	15.58	13.18	10.78	8.38
	0%	7.20	4.80	2.40	0.00	-2.40	-4.80	-7.20
	-2.67%	-6.16	-8.56	-10.96	-13.36	-15.75	-18.15	-20.55
	-5.33%	-17.29	-19.69	-22.09	-24.49	-26.88	-29.28	-31.68
	-8%	-26.20	-28.59	-30.99	-33.39	-35.79	-38.19	-40.59

최대 손실 시나리오

위험액	46.21
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	34.25
-----	-------

[23] 메리츠증권지수연계사모파생1호

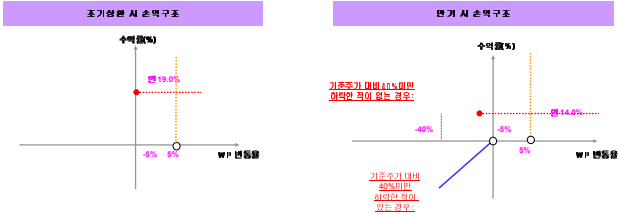
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	130.59	121.74	112.90	104.05	95.20	86.36	77.51
	5.33%	96.15	87.30	78.45	69.60	60.76	51.91	43.06
	2.67%	61.46	52.62	43.77	34.92	26.07	17.23	8.38
	0%	26.54	17.69	8.85	0.00	-8.85	-17.69	-26.54
	-2.67%	-8.62	-17.47	-26.31	-35.16	-44.01	-52.85	-61.70
	-5.33%	-44.02	-52.86	-61.71	-70.56	-79.41	-88.25	-97.10
	-8%	-79.65	-88.50	-97.35	-106.19	-115.04	-123.89	-132.74

최대 손실 시나리오	
위험액	-132.74

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	133.42
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품 SEPO-1호

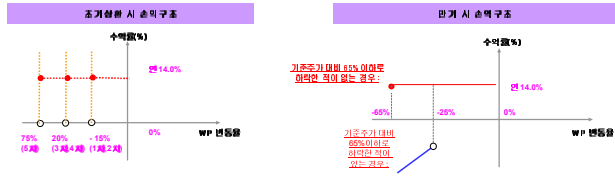
1. 계약금액

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

단위: 백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011년 08월 26일
- 3) 만드침산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세 번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 만일 14.0%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 침 후
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 48%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 보유종류(ELS)2723

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-20.76	-20.97	-21.18	-21.39	-21.60	-21.81	-22.02
	5.33%	-8.39	-8.60	-8.81	-9.02	-9.23	-9.43	-9.64
	2.67%	-1.26	-1.47	-1.68	-1.89	-2.10	-2.30	-2.51
	0%	0.63	0.42	0.21	0.00	-0.21	-0.42	-0.63
	-2.67%	-2.73	-2.94	-3.15	-3.36	-3.56	-3.77	-3.98
	-5.33%	-11.33	-11.54	-11.74	-11.95	-12.16	-12.37	-12.58
	-8%	-25.17	-25.38	-25.58	-25.79	-26.00	-26.21	-26.42

최대 손실 시나리오

위험액	-26.42
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	1.68
-----	------

[25] 테리츠 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

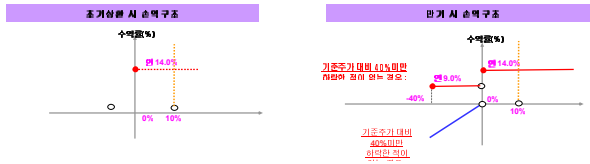
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

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 한번이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도상환

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600690BVR2 내부증권(ELS)2660

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	686.38	651.34	616.30	581.26	546.22	511.18	476.14
	5.33%	503.85	468.81	433.77	398.73	363.69	328.65	293.62
시나리오	2.67%	310.09	275.05	240.02	204.98	169.94	134.90	99.86
	0%	105.12	70.08	35.04	0.00	-35.04	-70.08	-105.12
	-2.67%	-111.09	-146.12	-181.16	-216.20	-251.24	-286.28	-321.32
	-5.33%	-338.51	-373.55	-408.59	-443.63	-478.67	-513.70	-548.74
	-8%	-577.16	-612.20	-647.24	-682.28	-717.31	-752.35	-787.39

최대 손실 시나리오

위험액 -787.39

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 762.68

[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

2) 만기: 2010년 09월 30일

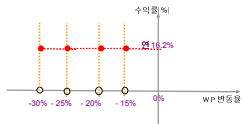
3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 삼성화재)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일), 70%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연달아 16.2%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 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

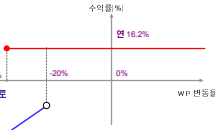
조기상환 시 수익구조



기준주가 대비 50%이상으로 하락한 적이 없는 경우:

기준주가 대비 50%이상으로 하락한 적이 있는 경우:

만기 시 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%	0.47	0.08	-0.31	-0.71	-1.10	-1.49	-1.88
	5.33%	1.48	1.09	0.70	0.31	-0.09	-0.48	-0.87
	2.67%	1.72	1.33	0.93	0.54	0.15	-0.24	-0.64
	0%	1.18	0.79	0.39	0.00	-0.39	-0.79	-1.18
	-2.67%	-0.14	-0.53	-0.93	-1.32	-1.71	-2.10	-2.50
	-5.33%	-2.24	-2.63	-3.02	-3.41	-3.81	-4.20	-4.59
	-8%	-5.11	-5.50	-5.89	-6.28	-6.68	-7.07	-7.46

최대손실 시나리오

위험액 -7.46

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 7.31

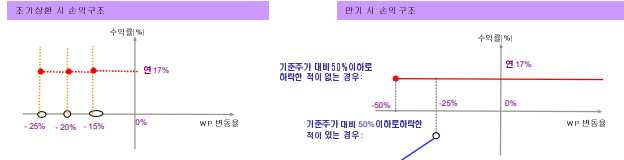
[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

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

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 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일)만큼 17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률 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



3. 손익구조인출(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6572345/91 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9.75	7.66	5.58	3.50	1.41	-0.67	-2.76
	5.33%	11.12	9.04	6.95	4.87	2.79	0.70	-1.38
	2.67%	9.96	7.87	5.79	3.71	1.62	-0.46	-2.55
	0%	6.25	4.17	2.08	0.00	-2.08	-4.17	-6.25
	-2.67%	0.00	-2.08	-4.16	-6.25	-8.33	-10.41	-12.50
	-5.33%	-6.78	-10.86	-12.95	-15.03	-17.11	-19.20	-21.28
	-8%	-20.11	-22.19	-24.27	-26.36	-28.44	-30.52	-32.61

최대 손실 시나리오	
위험액	-32.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	30.84
-----	-------

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 09월 20일

3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월마다 중도 상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기 상환결정일에 최초기준가액 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포함하여 한변이라도 최초기준가액 대비 5%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

단, 만기시(8차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격 이 환변도 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 100%보다 작은 경우

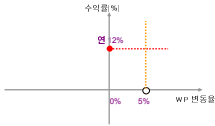
: 원금 * 124%

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

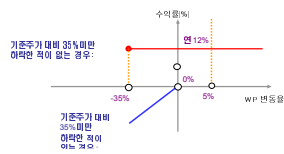
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

수익구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액 0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 0.00

[34] 대리 조주가지 수연계 파생 13

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 1월 12일

3) 펀드청산 결정주기: 만기일 가일 1회

4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가

5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최고 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우

- 만기 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우

: 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수 / 최초기준지수 - 1))

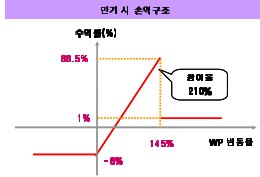
- 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우

: 원금 * 94%

기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최고 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우

: 원금 * 101%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-35.72	-45.85	-55.96	-66.11	-76.24	-86.37	-96.50
	5.33%	-10.71	-20.84	-30.97	-41.11	-51.24	-61.37	-71.50
	2.67%	11.32	1.19	-8.94	-19.07	-29.20	-39.33	-49.46
	0%	30.39	20.26	10.13	0.00	-10.13	-20.26	-30.39
	-2.67%	46.49	36.36	26.23	16.10	5.97	-4.16	-14.29
	-5.33%	59.63	49.50	39.37	29.24	19.11	8.98	-1.15
	-8%	69.80	59.67	49.54	39.41	29.28	19.14	9.01

최대 손실 시나리오

위험액 9.01

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 89.21

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

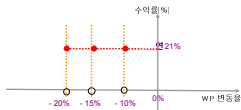
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

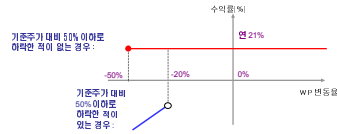
2. 만기시점의 손익구조

- 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, 두번째 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 만기일 증가 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 없는 경우
: 원금 * 163.0%
- 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 있는 경우 만기 평가일의 하락률이 큰 증폭을 기준으로
: 원금 * (만기 평가가격 / 최초기준가격)
- 만드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	10.54	9.09	7.65	6.20	4.76	3.31	1.87
	5.33%	8.95	7.51	6.06	4.62	3.17	1.73	0.28
	2.67%	6.89	5.44	4.00	2.55	1.11	-0.34	-1.78
	0%	4.34	2.89	1.45	0.00	-1.45	-2.89	-4.34
	-2.67%	1.30	-0.15	-1.59	-3.04	-4.48	-5.93	-7.37
	-5.33%	-2.22	-3.67	-5.11	-6.56	-8.00	-9.45	-10.89
	-8%	-6.23	-7.67	-9.12	-10.56	-12.01	-13.45	-14.90

최대 손실 시나리오

위험액	-14.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.59
-----	-------

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

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

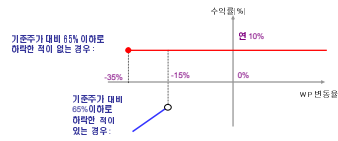
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 17일
- 3) 만기점산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100% 이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95% 이상인 경우(두번째 중도상환일), 90% 이상인 경우(세번째 중도상환일), 85% 이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 0.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
- 두 기초자산의 가격 (장종료함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드 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	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

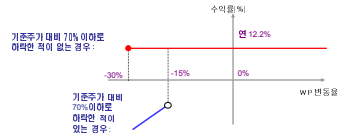
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교
 KR600690MM/M7 대우증권 ELS2697

1. 계약금액

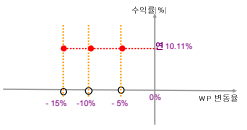
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

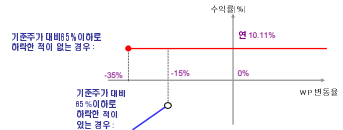
2. 연가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 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 만도 철회

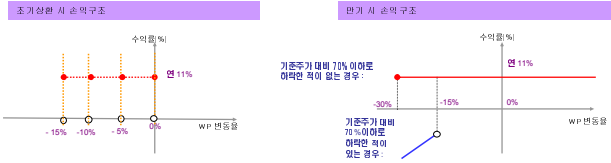
- 두 기준지수의 가격이 만도 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우

: 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 메리츠신한증권(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)

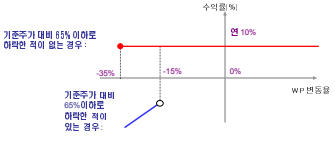
2. 연기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-6] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR600867AV62 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

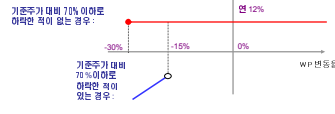
4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

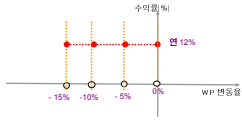
1. 계약금액

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

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기 : 2009년 6월 10일
- 3) 권드청산 결정 주기 : 매3개월
- 4) 기 준지수 : 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-8] 메리츠투자지수연계사모증권2호
 KR6030617V83
 교보증권(ELS)269회

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기 : 2009년 6월 18일

3) 권드청산 결정 주기 : 매4개월

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

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가액 의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일)

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

만들 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

- 두 기 초자산의 가액 이 환반드 기 준가액 의 65%이므로 하락한 척 이 없고, 최초기 준가액 의 85%보다 작은 경우

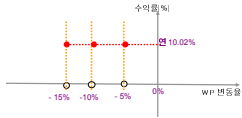
: 원금 * 110.02%

- 두 기 초자산의 가액 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가액 의 65%이므로 하락한 척 이 있는 경우

: 원금 * (만기 기 준지 수 /최 초기 준지 수)

6) 권 드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

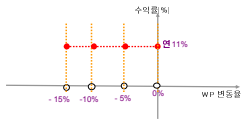
1. 계약금액

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

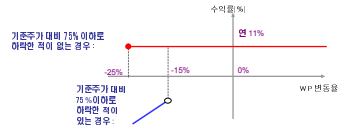
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기 : 2009년 5월 14일
- 3) 권드청산 결정 주기 : 매3개월
- 4) 기 준지수 : 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 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**

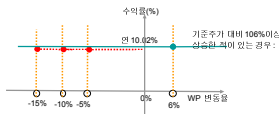
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7547.5	0	7,547.5	장외

단위(백만원)

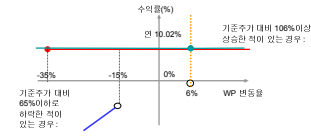
2. **연기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2011년 5월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기 준지수: 2000년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 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, 기초자산지수 기 준지수의 106% 이상으로 상승한 적이 있을 경우는 행사금지사건에 해당되며, 행사금지사건이 발행 후 18개월 이전에 일어나면 이후 드러하는 중간평가일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급. 18개월 이후에 발생하면 만기일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급
 단, 만기시 까지 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 20.04%
 - 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHC-2

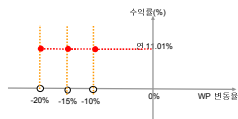
1. 계약금액

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

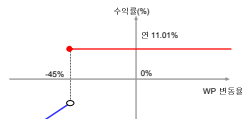
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 만기: 2012년 4월 12일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차지수의 증가
- 실행 후 매6개월마다 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%	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12	-0.16
	5.33%	0.16	0.12	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.08
	2.67%	0.18	0.14	0.10	0.06	0.02	-0.02	-0.06
	0%	0.12	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12
	-2.67%	-0.01	-0.05	-0.09	-0.13	-0.17	-0.21	-0.25
	-5.33%	-0.20	-0.24	-0.28	-0.32	-0.36	-0.40	-0.44
-8%	-0.47	-0.51	-0.55	-0.59	-0.63	-0.67	-0.71	

최대 손실 시나리오

위험액 -0.71

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.65

[62] 테리츠2Star사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

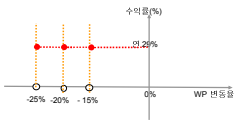
구분	거래대상	거래유형	약수(1)	약도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위:백만원

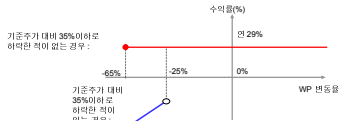
2. 만기시점의 손익구조

- 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 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.9%
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				0	변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	8.33%		16.67%	25%		
기초자산	8%	7.78	6.37	4.97	3.56	2.15	0.74	-0.67	
산	5.33%	9.79	8.38	6.97	5.56	4.15	2.75	1.34	
시나리오	2.67%	8.61	7.20	5.79	4.38	2.97	1.56	0.15	
오	0%	4.23	2.82	1.41	0.00	-1.41	-2.82	-4.23	
	-2.67%	-3.34	-4.75	-6.16	-7.57	-8.98	-10.39	-11.80	
	-5.33%	-14.11	-15.52	-16.93	-18.34	-19.75	-21.16	-22.56	
	-8%	-29.07	-29.48	-30.89	-32.29	-33.70	-35.11	-36.52	

최대 손실 시나리오

위험액	-36.52
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	39.25
-----	-------

[66] 테리츠2Star사모증권LEHC-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차

2) 만기: 2012년 4월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

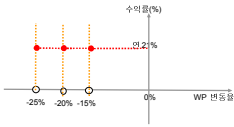
4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

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

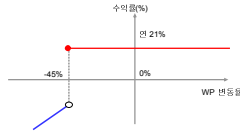
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55% 보다 이상인 경우
 : 원금 + 121%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

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 시나리오	8%	0.18	0.09	0.00	-0.09	-0.18	-0.27	-0.36
	5.33%	0.36	0.27	0.18	0.10	0.01	-0.08	-0.17
	2.67%	0.39	0.30	0.21	0.12	0.04	-0.05	-0.14
	0%	0.27	0.18	0.09	0.00	-0.09	-0.18	-0.27
손익 구조변동 시나리오	-2.67%	-0.01	-0.10	-0.19	-0.28	-0.37	-0.46	-0.55
	-5.33%	-0.45	-0.53	-0.62	-0.71	-0.80	-0.89	-0.98
	-8%	-1.03	-1.12	-1.21	-1.30	-1.39	-1.48	-1.57

최대 손실 시나리오

위험액	-1.57
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.45
-----	------

[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

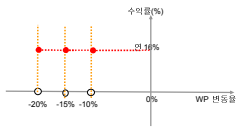
3) 만드칭산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

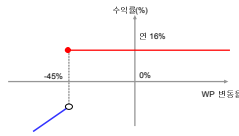
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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 시나리오	8%	5.99	4.90	3.80	2.71	1.62	0.53		-0.56
	5.33%	5.92	4.83	3.74	2.65	1.56	0.47		-0.63
	2.67%	5.02	3.93	2.84	1.75	0.65	-0.44		-1.53
	0%	3.28	2.18	1.09	0.00	-1.09	-2.18		-3.28
	-2.67%	0.69	-0.40	-1.49	-2.59	-3.68	-4.77		-5.86
최대 손실 시나리오	-5.33%	-2.74	-3.83	-4.92	-6.01	-7.10	-8.20		-9.29
	-8%	-7.00	-8.10	-9.19	-10.28	-11.37	-12.46		-13.55

최대 손실 시나리오

위험액	-13.55
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.85
-----	-------

[65] 테리츠2Star사모증권POKB-2호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

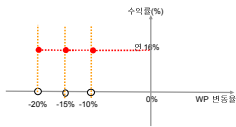
3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

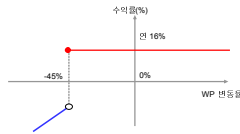
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.36	0.29	0.23	0.16	0.10	0.03	-0.03
	5.33%	0.35	0.29	0.22	0.16	0.09	0.03	-0.04
	2.67%	0.30	0.23	0.17	0.10	0.04	-0.03	-0.09
	0%	0.20	0.13	0.07	0.00	-0.07	-0.13	-0.20
	-2.67%	0.04	-0.02	-0.09	-0.15	-0.22	-0.28	-0.35
	-5.33%	-0.16	-0.23	-0.29	-0.36	-0.42	-0.49	-0.55
	-8%	-0.42	-0.48	-0.55	-0.61	-0.68	-0.74	-0.81

최대 손실 시나리오

위험액	-0.81
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.01
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(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

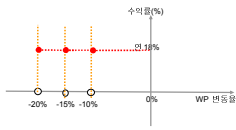
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

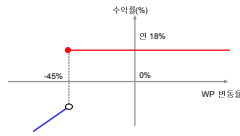
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 + 11.8%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오								
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%		
기초자산	8%	17.65	14.38	11.12	7.85	4.59	1.33	-1.94	
시나리오	5.33%	16.96	13.70	10.43	7.17	3.90	0.64	-2.63	
	2.67%	14.34	11.08	7.81	4.55	1.28	-1.96	-5.25	
	0%	9.79	6.53	3.26	0.00	-3.26	-6.53	-9.79	
	-2.67%	3.32	0.05	-3.21	-6.46	-9.74	-13.01	-16.27	
	-5.33%	-8.09	-8.35	-11.62	-14.88	-18.15	-21.41	-24.68	
	-8%	-15.42	-18.69	-21.95	-25.22	-28.48	-31.75	-35.01	

최대 손실 시나리오

위험액	-35.01
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	35.51
-----	-------

[68] 테리츠2Star사모증권SET-4호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

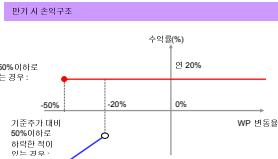
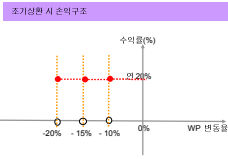
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

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

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	5.70	4.68	3.66	2.65	1.63	0.61	-0.41
시나리오	5.33%	5.94	4.92	3.90	2.88	1.87	0.85	-0.17
	2.67%	5.06	4.04	3.02	2.00	0.98	-0.03	-1.05
	0%	3.05	2.04	1.02	0.00	-1.02	-2.04	-3.05
	-2.67%	-0.07	-1.09	-2.10	-3.12	-4.14	-5.16	-6.18
	-5.33%	-4.31	-5.33	-6.35	-7.36	-8.38	-9.40	-10.42
	-8%	-9.67	-10.69	-11.71	-12.73	-13.74	-14.76	-15.78

최대 손실 시나리오

위험액	-15.78
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.03
-----	-------

[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.

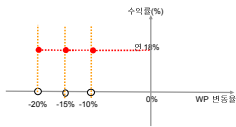
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

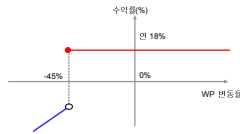
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	9.71	7.91	6.12	4.32	2.52	0.73	-1.07	
시나리오	5.33%	7.89	6.09	4.30	2.50	0.71	-1.09	
	2.67%	7.89	6.09	4.30	2.50	0.71	-1.09	
	0%	5.39	3.59	1.80	0.00	-1.80	-3.59	
	-2.67%	1.82	0.03	-1.77	-3.56	-5.36	-7.15	
	-5.33%	-2.80	-4.60	-6.39	-8.19	-9.98	-11.78	
	-8%	-6.48	-10.28	-12.08	-13.88	-15.67	-17.48	

최대 손실 시나리오

위험액	-19.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	19.54
-----	-------

[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

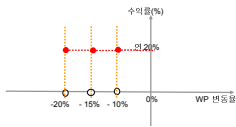
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

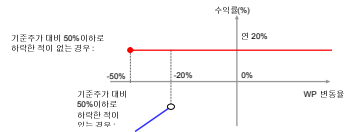
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오								
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%		
기초자산	8%	4.93	4.06	3.20	2.33	1.47	0.60	-0.26	
시나리오	5.33%	4.82	3.96	3.09	2.22	1.36	0.49	-0.37	
오	2.67%	4.04	3.18	2.31	1.45	0.58	-0.26	-1.15	
	0%	2.60	1.73	0.87	0.00	-0.67	-1.73	-2.60	
	-2.67%	0.48	-0.39	-1.25	-2.12	-2.98	-3.85	-4.71	
	-5.33%	-2.30	-3.17	-4.04	-4.90	-5.77	-6.63	-7.50	
	-8%	-5.76	-6.62	-7.49	-8.36	-9.22	-10.09	-10.95	

최대 손실 시나리오

위험액	-10.95
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.02
-----	-------

[78] 데리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

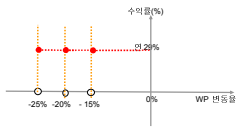
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

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.

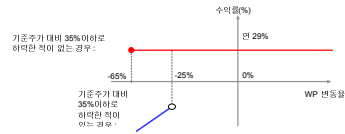
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 연도 확정
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12.9%
 - 두 기초자산의 가액(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	6.78	5.55	4.32	3.10	1.87	0.64	-0.59
시나리오	5.33%	8.52	7.30	6.07	4.84	3.62	2.39	1.16
	2.67%	7.49	6.27	5.04	3.81	2.58	1.36	0.13
	0%	3.68	2.45	1.23	0.00	-1.23	-2.45	-3.68
	-2.67%	-2.91	-4.14	-5.36	-6.59	-7.82	-9.05	-10.27
	-5.33%	-1.28	-1.51	-1.74	-1.96	-1.71	-1.42	-1.16
	-8%	-2.43	-2.66	-2.89	-2.89	-2.93	-3.07	-3.18

최대 손실 시나리오

위험액	-31.80
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	34.17
-----	-------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

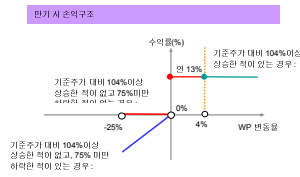
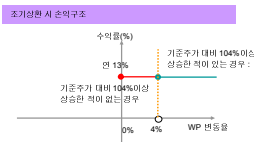
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
메리츠주가지수연계사모6호

구분	손익구조변동 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	8.33%	1.67%	25%	
기초자산	8%	9,263.47	8,594.08	7,924.69	7,255.30	6,585.91	5,916.52	5,247.13
시나리오	5.33%	6,828.14	6,158.75	5,489.36	4,819.97	4,150.58	3,481.18	2,811.79
	2.67%	4,409.71	3,740.32	3,070.92	2,401.53	1,732.14	1,062.75	393.36
	0%	2,008.17	1,338.78	669.39	0.00	-669.39	-1,338.78	-2,008.17
	-2.67%	-376.46	-1,045.85	-1,715.24	-2,384.63	-3,054.02	-3,723.42	-4,392.81
	-5.33%	-2,744.19	-3,413.59	-4,082.98	-4,752.37	-5,421.76	-6,091.15	-6,760.54
	-8%	-5,095.03	-5,764.42	-6,433.81	-7,103.20	-7,772.59	-8,441.98	-9,111.37

최대 손실 시나리오	
위험액	=9,111.37

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,049.29
-----	----------

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

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

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

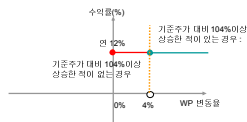
: 원금 * 11.2%

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

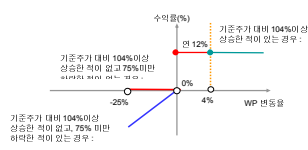
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환시 수익구조



만기시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호

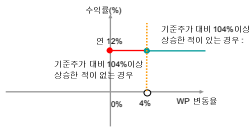
1. 계약금액

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

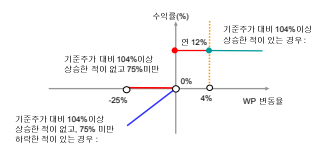
2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 16일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일일에 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 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (중도표현)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

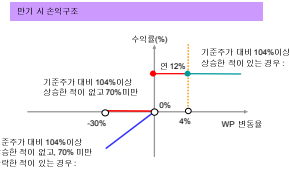
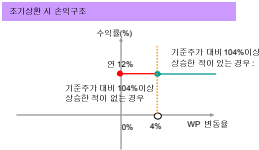
[79-4] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 수익구조

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



KR60008679TA3 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) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 10일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

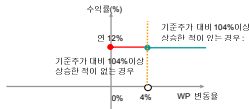
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

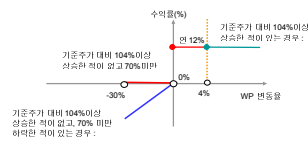
- 두 기초자산의 가격이 한 번도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

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) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 19일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가

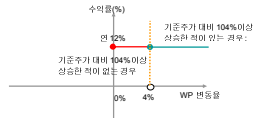
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

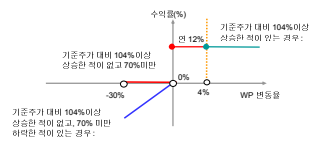
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6000867CTB8 굿모닝 신한증권(ELS)804

[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

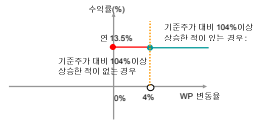
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위(백만원)

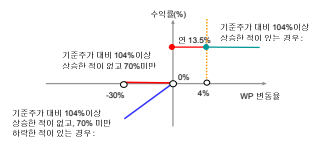
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 15일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 19일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한비아래도 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 한비도 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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR60008675TC7 곳도넛 신한증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

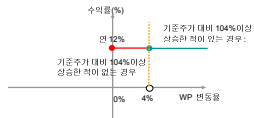
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000.0	0	5,000	차입

단위: (백만원)

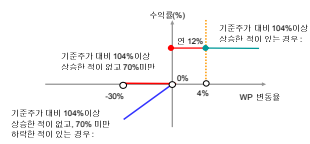
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 10월 15일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일 정일에 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 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 한나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TN2 우리투자증권 (ELS)1438

[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 08일

3) 만트청산 결제주기: 매3개월

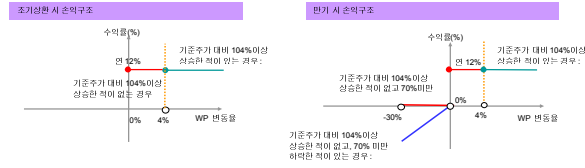
4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

6) 만트의 수익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

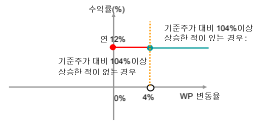
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

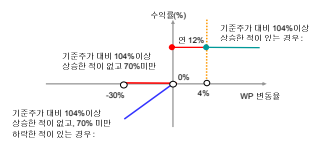
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기일을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일일 때 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	잔액

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 13일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

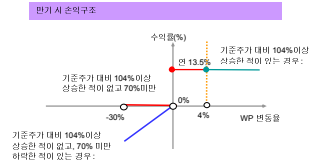
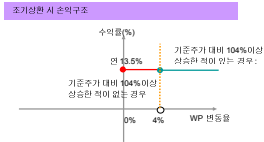
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월마다 증도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 증도포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 증도상환

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600594PTC8 우리투자증권 (ELS)1533

[79-12] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

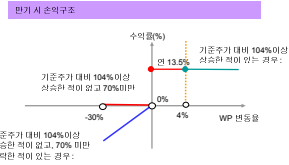
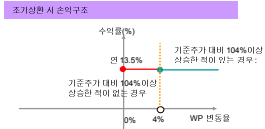
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600594TTC0 우리투자증권 (ELS)1535

[82] 데리 조주가지 수연계 사모증권5호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

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

기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우

- 만기평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우

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

- 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우

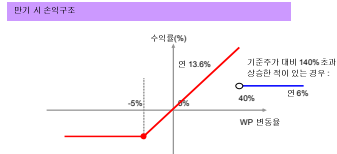
: 원금 * 95%

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

기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우

: 원금 * 108%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6523317W30 대우증권ELS2881

구분	손익 구조변동률 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.07	-0.38	-1.77	-3.19	-4.61	-6.03	-7.45
시나리오	5.33%	2.43	1.01	-0.41	-1.83	-3.25	-4.67	-6.09
	2.67%	3.50	2.08	0.66	-0.76	-2.18	-3.60	-5.02
	0%	4.26	2.84	1.42	0.00	-1.42	-2.84	-4.26
	-2.67%	4.72	3.30	1.88	0.46	-0.96	-2.38	-3.79
	-5.33%	4.89	3.47	2.05	0.63	-0.79	-2.21	-3.63
	-8%	4.75	3.33	1.91	0.49	-0.93	-2.35	-3.77

최대 손실 시나리오

위험액	-3.77
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.36
-----	------

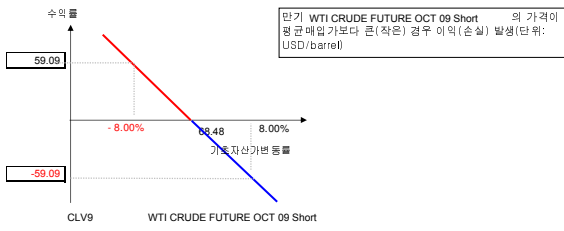
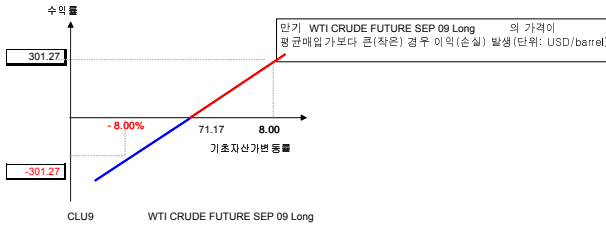
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위(계약)

2. 만기시점의 손익구조



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

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

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8%	242.18
	5.33%	161.35
	2.67%	80.83
	0%	0.00
	-2.67%	-80.83
	-5.33%	-161.35
-8%	-242.18	

최대 손실 시나리오	
위험액	-242.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,460
-----	-------

[78] 대리 조주가지 수연계사모증권I[E]

1. 계약금액

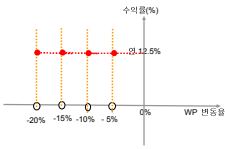
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1110.0	0	1,110.0	잔위

단위:백만원

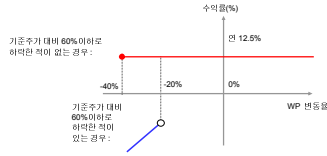
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 평가대상상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2010년 5월 28일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 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. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR6523310W80 (대우증권ELS3005)

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.15	-0.15	-0.15	-0.15	-0.15	-0.15	-0.15
	5.33%	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07
	2.67%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.02	-0.02	-0.02
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	-2.67%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	-5.33%	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08
	-8%	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17

최대 손실 시나리오

위험액	-0.17
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.04
-----	------

[79] 데리 초주가지 수연계사모증권!61E

1. 계약금액

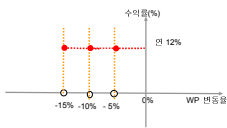
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위:백만원

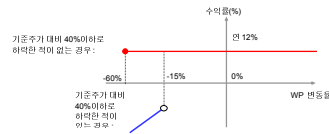
2. 연가시점의 손익구조

- 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 90%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 85%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 12%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표인 및(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%	
기초지	8%	-5.96	-7.55	-9.14	-10.73	-12.32	-13.91	-15.50
	5.33%	2.36	0.77	-0.83	-2.42	-4.01	-5.60	-7.19
산	2.67%	5.93	4.34	2.75	1.16	-0.43	-2.02	-3.61
	0%	4.27	3.18	1.59	0.00	-1.59	-3.18	-4.77
시나리오	-2.67%	-1.12	-2.72	-4.31	-5.90	-7.49	-9.08	-10.67
	-5.33%	-11.76	-13.35	-14.94	-16.53	-18.12	-19.71	-21.30
	-8%	-27.13	-28.72	-30.31	-31.90	-33.49	-35.08	-36.67

최대 손실 시나리오

위험액	-36.67
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	26.92
-----	-------

[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호

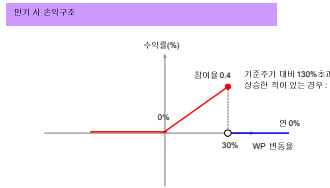
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 펀드청산 결정주기: 만기일 당일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 5월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기일까지 수가가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 130% 미만일 경우
 - : 원금 * (100% + 40% * (만기기준지수/최초기준지수 - 1))
 - : 원금 * 100%
 - 만기일까지 수가가 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%	1.41	-0.75	-2.91	-5.06	-7.22	-9.38	-11.53
손익	2.67%	4.12	1.96	-0.19	-2.35	-4.50	-6.66	-8.82
시나리오	0%	6.47	4.31	2.16	0.00	-2.16	-4.31	-6.47
	-2.67%	6.45	6.29	4.14	1.98	-0.17	-2.33	-4.49
	-5.33%	10.07	7.91	5.75	3.60	1.44	-0.72	-2.87
	-8%	11.32	9.16	7.00	4.65	2.69	0.53	-1.62

최대 손실 시나리오

위험액	-1.62
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.20
-----	-------

[82] 데리츠2Star사모증권SE-ST-8호

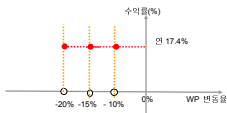
1. 계약금액

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

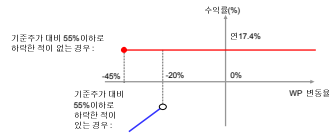
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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%	5.10	4.48	3.86	3.24	2.62	2.00	1.37
	5.33%	4.70	4.08	3.46	2.84	2.21	1.59	0.97
	2.67%	3.62	3.00	2.38	1.76	1.14	0.51	-0.11
0%	1.86	1.24	0.62	0.00	-0.62	-1.24	-1.86	
-2.67%	-0.97	-1.19	-1.41	-1.63	-1.86	-2.08	-2.30	
-5.33%	-3.66	-4.31	-4.93	-5.55	-6.17	-6.79	-7.41	
-8%	-7.48	-8.10	-8.72	-9.34	-9.96	-10.58	-11.20	

최대 손실 시나리오

위험액	-11.20
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.64
-----	------

[83] 데리츠2Star사모증권SET-5호

1. 계약금액

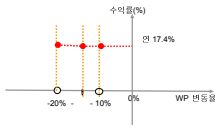
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

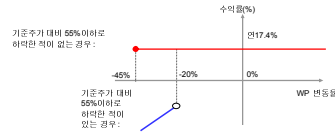
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	32.77	28.78	24.79	20.80	16.81	12.82	8.83
손실	5.33%	30.19	26.20	22.21	18.22	14.23	10.24	6.25
시나리오	2.67%	23.26	19.27	15.28	11.29	7.30	3.31	-0.68
	0%	11.97	7.98	3.99	0.00	-3.99	-7.98	-11.97
	-2.67%	-3.87	-7.86	-11.85	-15.84	-19.84	-23.83	-27.82
	-5.33%	-23.68	-27.67	-31.66	-35.65	-39.64	-43.63	-47.62
	-8%	-48.03	-52.02	-56.01	-60.00	-63.99	-67.98	-71.97

최대 손실 시나리오

위험액	-71.97
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	61.97
-----	-------

[84] 테라츠2SIa사모증권SEPO-2호

1. 계약금액

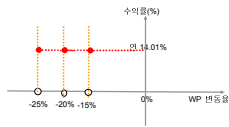
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	차입

단위: (백만원)

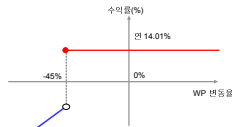
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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
: 원금 * 114.01%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.33	0.16	-0.01	-0.18	-0.34	-0.51	-0.68
	5.33%	0.64	0.47	0.30	0.13	-0.03	-0.20	-0.37
시나리오	2.67%	0.70	0.53	0.36	0.19	0.02	-0.14	-0.31
	0%	0.60	0.34	0.17	0.00	-0.17	-0.34	-0.51
	-2.67%	0.06	-0.11	-0.26	-0.41	-0.61	-0.78	-0.95
	-5.33%	-0.64	-0.81	-0.97	-1.14	-1.31	-1.48	-1.65
	-8%	-1.59	-1.75	-1.92	-2.09	-2.26	-2.43	-2.60

최대 손실 시나리오

위험액	-2.60
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	3.54
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

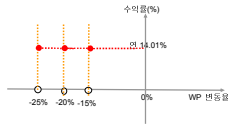
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위: (백만원)

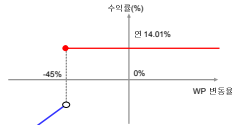
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.19	0.58	-0.03	-0.63	-1.24	-1.85	-2.46
	5.33%	2.31	1.70	1.09	0.49	-0.12	-0.73	-1.34
시나리오	2.67%	2.52	1.91	1.31	0.70	0.09	-0.52	-1.13
	0%	1.82	1.22	0.61	0.00	-0.61	-1.22	-1.82
	-2.67%	0.22	-0.39	-1.00	-1.61	-2.22	-2.82	-3.43
	-5.33%	-2.30	-2.91	-3.52	-4.12	-4.73	-5.34	-5.95
	-8%	-5.73	-6.34	-6.94	-7.55	-8.16	-8.77	-9.37

최대 손실 시나리오

위험액	-9.37
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	12.79
-----	-------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호

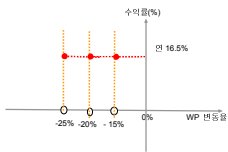
1. 계약금액

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

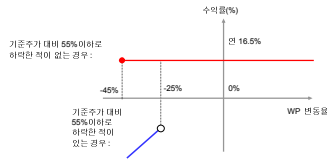
2. 만기시점의 손익구조

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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.03	-0.05	-0.07	-0.08	-0.10	-0.12	-0.14
	5.33%	0.05	0.03	0.01	-0.01	-0.02	-0.04	-0.06
시나리오	2.67%	0.08	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.01	-0.03
	0%	0.05	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.05
	-2.67%	-0.02	-0.04	-0.05	-0.07	-0.09	-0.11	-0.13
	-5.33%	-0.14	-0.16	-0.17	-0.19	-0.21	-0.23	-0.25
	-8%	-0.31	-0.33	-0.35	-0.36	-0.38	-0.40	-0.42

최대 손실 시나리오

위험액	-0.42
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.19
-----	------

[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호

1. 계약금액

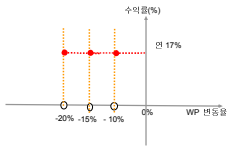
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	341.7	0	341.7	잔위

단위(백만원)

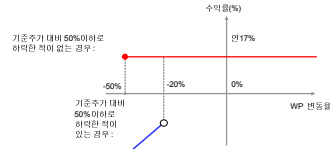
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 10일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 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 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117%
 - 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6562319W52 유인 투기증권 (ELS)2415

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.92	4.09	3.26	2.43	1.60	0.77	-0.06
손실	5.33%	4.69	3.86	3.03	2.20	1.37	0.54	-0.29
시나리오	2.67%	3.88	3.05	2.22	1.39	0.56	-0.27	-1.10
	0%	2.49	1.66	0.83	0.00	-0.83	-1.66	-2.49
	-2.67%	0.52	-0.31	-1.14	-1.97	-2.80	-3.63	-4.46
	-5.33%	-2.04	-2.87	-3.70	-4.53	-5.36	-6.19	-7.02
	-8%	-5.18	-6.01	-6.84	-7.67	-8.50	-9.33	-10.16

최대 손실 시나리오

위험액	-10.16
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.09
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

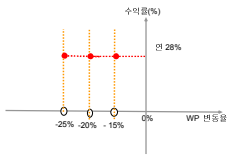
1. 계약금액

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

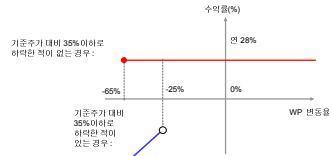
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산의 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 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	51.97	40.26	28.55	16.83	5.12	-6.60	-18.31
	5.33%	46.71	35.00	23.29	11.57	-0.14	-11.86	-23.57
	2.67%	41.10	29.39	17.68	5.96	-5.75	-17.47	-29.18
	0%	35.14	23.43	11.71	0.00	-11.71	-23.43	-35.14
	-2.67%	28.83	17.12	5.40	-6.31	-18.03	-29.14	-41.46
	-5.33%	22.17	10.45	-1.26	-12.97	-24.69	-36.40	-48.12
	-8%	15.15	3.44	-8.27	-19.99	-31.70	-43.42	-55.13

최대 손실 시나리오

위험액	-55.13
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	53.58
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

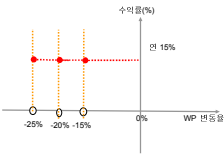
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	30.0	0	30.0	차입

단위:백만원

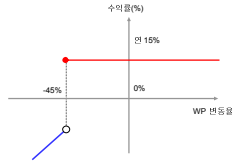
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO
- 2) 만기: 2012년 5월 11일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 13일 LG전자 보통주, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, POSCO 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 초과상환 요건을 충족하지 못한 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

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6662311W58 한화스마트(ELS)117

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.40	0.32	0.25	0.18	0.10	0.03	-0.05
	5.33%	0.37	0.30	0.22	0.15	0.08	0.00	-0.07
시나리오	2.67%	0.31	0.24	0.16	0.09	0.02	-0.06	-0.13
	0%	0.22	0.16	0.07	0.00	-0.07	-0.15	-0.22
	-2.67%	0.10	0.03	-0.05	-0.12	-0.20	-0.27	-0.34
	-5.33%	-0.05	-0.13	-0.20	-0.28	-0.35	-0.42	-0.50
	-8%	-0.24	-0.31	-0.39	-0.46	-0.53	-0.61	-0.68

최대 손실 시나리오

위험액	-0.68
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.68
-----	------

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

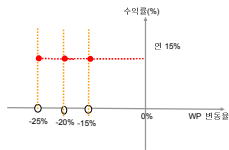
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위:백만원

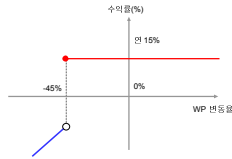
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	30.23	24.62	19.01	13.40	7.79	2.18	-3.43
시나리오	5.33%	28.16	22.55	16.94	11.33	5.72	0.11	-5.50
	2.67%	23.69	18.08	12.47	6.86	1.25	-4.36	-9.97
	0%	16.83	11.22	5.61	0.00	-6.61	-11.22	-16.83
	-2.67%	7.57	1.96	-3.65	-9.98	-14.67	-20.45	-26.09
	-5.33%	-4.09	-9.70	-15.31	-20.99	-26.53	-32.14	-37.75
	-8%	-16.14	-23.75	-29.36	-34.97	-40.58	-46.19	-51.81

최대 손실 시나리오

위험액	-51.81
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	51.89
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

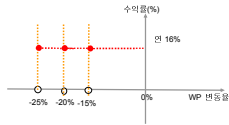
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	차입

단위:백만원

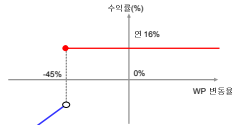
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.66	0.69	0.52	0.35	0.18	0.01	-0.16
손실	5.33%	0.79	0.62	0.44	0.27	0.10	-0.07	-0.24
시나리오	2.67%	0.67	0.50	0.33	0.16	-0.01	-0.18	-0.36
	0%	0.51	0.34	0.17	0.00	-0.17	-0.34	-0.51
	-2.67%	0.31	0.14	-0.03	-0.20	-0.37	-0.54	-0.71
	-5.33%	0.07	-0.10	-0.27	-0.44	-0.61	-0.78	-0.95
	-8%	-0.21	-0.38	-0.55	-0.72	-0.89	-1.06	-1.23

최대 손실 시나리오

위험액	-1.23
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.24
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

1. 계약금액

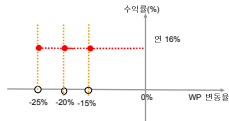
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	차입

단위:백만원

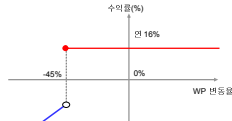
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	15.43	12.37	9.30	6.24	3.18	0.12	-2.94
손익	5.33%	14.08	11.02	7.96	4.90	1.84	-1.22	-4.29
시나리오	2.67%	12.00	8.94	5.88	2.82	-0.24	-3.31	-6.37
	0%	9.18	6.12	3.06	0.00	-3.06	-6.12	-9.18
	-2.67%	6.63	2.57	-0.49	-3.65	-6.61	-9.68	-12.74
	-5.33%	1.34	-1.72	-4.78	-7.84	-10.90	-13.96	-17.03
	-8%	-3.68	-6.74	-9.81	-12.87	-15.93	-18.99	-22.05

최대 손실 시나리오

위험액	-22.05
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.22
-----	-------

[93] 데리츠281r사모증권LEHC-3

1. 계약금액

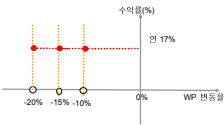
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

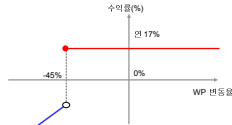
2. 연가시점의 손익구조

- 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 기초자산가액으로 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, 연가시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권리 행사
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우
 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (연가 기준지수/최초 기준지수)
- 연도의 수익구조

조기상환 시 손익구조



연가시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	7.80	5.92	4.04	2.16	0.28	-1.60	-3.49
시나리오	5.33%	7.92	6.04	4.15	2.27	0.39	-1.49	-3.37
	2.67%	7.20	5.32	3.43	1.55	-0.33	-2.21	-4.09
	0%	5.64	3.76	1.88	0.00	-1.88	-3.76	-5.64
	-2.67%	3.26	1.38	-0.51	-2.39	-4.27	-6.15	-8.03
	-5.33%	0.04	-1.84	-3.73	-5.61	-7.49	-9.37	-11.25
	-8%	-4.02	-5.90	-7.78	-9.66	-11.54	-13.42	-15.31

최대 손실 시나리오

위험액	-15.31
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.17
-----	-------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

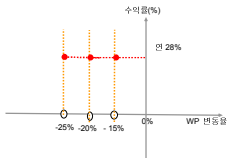
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위:백만원

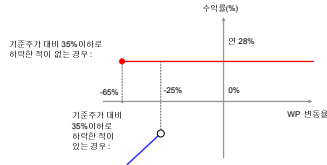
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	36.01	28.61	21.22	13.83	6.44	-0.95	-8.34
시나리오	5.33%	32.26	24.87	17.47	10.08	2.69	-4.70	-12.09
	2.67%	27.65	20.26	12.86	5.47	-1.92	-9.31	-16.70
	0%	22.18	14.78	7.39	0.00	-7.39	-14.78	-22.18
	-2.67%	15.84	8.45	1.06	-6.33	-13.73	-21.12	-28.51
	-5.33%	8.65	1.25	-6.14	-13.65	-20.92	-28.31	-35.71
	-8%	0.59	-6.80	-14.20	-21.59	-28.98	-36.57	-43.76

최대 손실 시나리오

위험액	-43.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	58.89
-----	-------

[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호

1. 계약금액

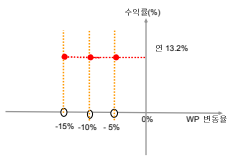
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위:백만원

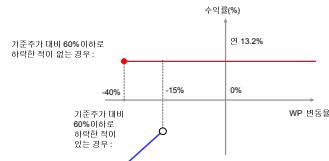
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.14	-0.14	-0.14	-0.15	-0.15	-0.15	-0.15
	5.33%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05
시나리오	2.67%	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
	-5.33%	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12
	-8%	-0.24	-0.25	-0.25	-0.25	-0.25	-0.25	-0.25

최대 손실 시나리오

위험액	-0.25
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.02
-----	------

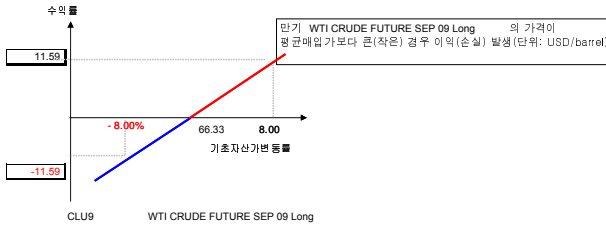
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	11.59
	5.33%	7.72
	2.67%	3.87
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.87
	-5.33%	-7.72
	-8%	-11.59

최대손실 시나리오	
위험액	-11.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46
-----	----

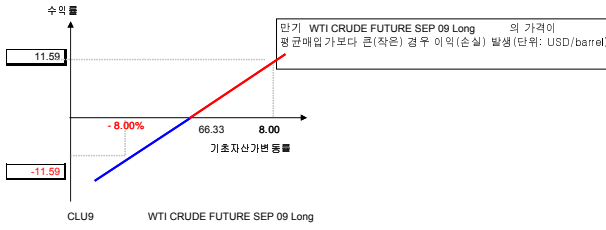
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



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

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	43.22
	5.33%	28.80
	2.67%	14.43
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-14.43
	-5.33%	-28.80
	-8%	-43.22

최대 손실 시나리오	
위험액	-43.22

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.5
-----	------

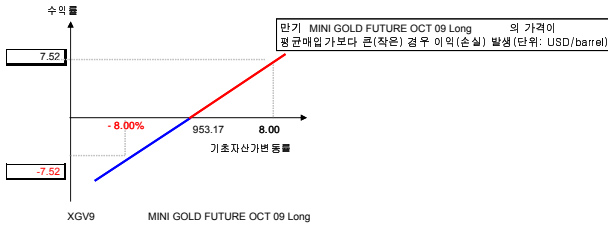
[96-2] 헤지 초 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조

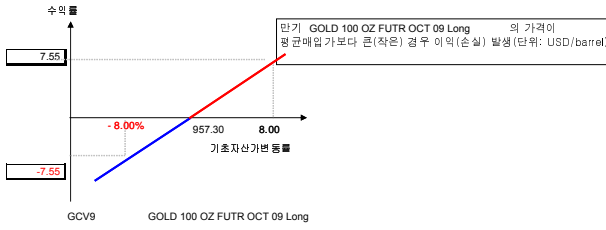


[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조

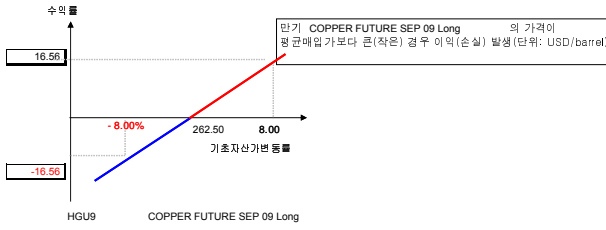


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

단위: (계약)						
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조

