

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 콜리켓 시모단위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

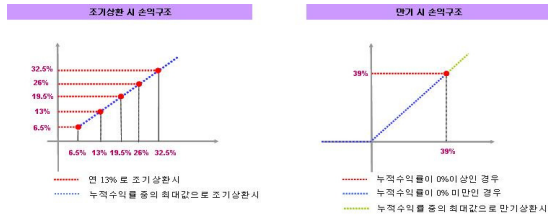
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가액이 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 관할하는 수익률의 단순합계, 특별수익률은 각 월별 누적수익률 중 최대값)

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.05	-0.07	-0.09	-0.10	-0.12	-0.14	-0.15
	5.33%	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06	-0.08	-0.10
	2.67%	0.04	0.02	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.03	-0.05
	-2.67%	0.04	0.02	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06
	-5.33%	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06	-0.08	-0.10
	-8%	-0.05	-0.07	-0.09	-0.10	-0.12	-0.14	-0.15

최대 손실 시나리오

위험액	-0.15
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.20
-----	------

[3] 테라즈 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 우리금융지주 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -16%(2차 중도상환일), -22%(3차 중도상환일), -28%(4차 중도상환일), -34%(5차 중도상환일), -40%(만기상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 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 시나리오	8%	0.07	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.03
	5.33%	0.07	0.05	0.03	0.02	-0.00	-0.02	-0.04
	2.67%	0.06	0.04	0.03	0.01	-0.01	-0.03	-0.04
	0%	0.05	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.05
	-2.67%	0.04	0.02	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.07
	-8.33%	0.03	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06	-0.08
	-8%	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06	-0.08	-0.10

최대 손실 시나리오

위험액	-0.10
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.19
-----	------

14) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

구분		거래대상	거래유형	액수(1)	액수(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 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 기초자산의 누적 수익률이 초기 상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(만기상환일) 이상인 경우 만 17.0%로 중도상환됨. (누적 수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.07
-----	-------

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) 만드형산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

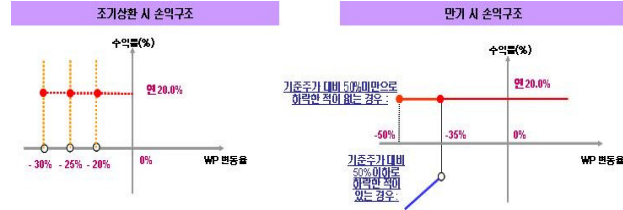
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 원금 \* 140%

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

: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력(상장일:LS1243)

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	10.42	9.54	8.66	7.78	6.90	6.02	5.14
	5.33%	8.09	7.21	6.33	5.45	4.57	3.69	2.81
	2.67%	5.50	4.62	3.74	2.86	1.98	1.10	0.22
	0%	2.64	1.76	0.88	0.00	-0.88	-1.76	-2.64
	-2.67%	-0.48	-1.36	-2.24	-3.12	-4.00	-4.88	-5.76
	-5.33%	-3.86	-4.74	-5.62	-6.50	-7.38	-8.26	-9.14
	-8%	-7.50	-8.38	-9.26	-10.14	-11.02	-11.90	-12.78

최대 손실 시나리오

위험액	-12.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	12.22
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모펀위 과정상용투자신탁 25호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순투자액(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	305	-2745	3,050	상위 (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 최초 기준가격 보다 클 경우에는 보너스쿠폰을 지급하여 총 만을 31.6%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

- 두 기초자산의 가격 (장중보합) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 만금 \* (만기 기준지수 / 최초 기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600345TTB9 최대손실(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	13.23	12.46	11.69	10.91	10.14	9.37	8.60
손익	5.33%	9.64	8.87	8.10	7.33	6.56	5.78	5.01
손익	2.67%	6.01	5.23	4.46	3.69	2.92	2.15	1.37
손익	0%	2.32	1.54	0.77	0.00	-0.77	-1.54	-2.32
손익	-2.67%	-1.43	-2.20	-2.97	-3.74	-4.51	-5.29	-6.06
손익	-5.33%	-5.22	-5.99	-6.76	-7.53	-8.31	-9.08	-9.85
손익	-8%	-9.06	-9.84	-10.61	-11.38	-12.15	-12.92	-13.70

최대 손실 시나리오

위험액	-13.70
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.32
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

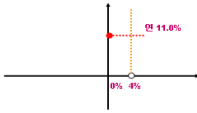
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,471	0	7,471	잔의

단위(백만원)

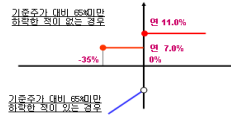
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 변동증권(ELS) 2007-3974

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	433.52	412.22	390.93	369.63	348.34	327.04	305.75
	5.33%	309.11	287.62	266.53	245.23	223.94	202.64	181.35
	2.67%	185.90	164.61	143.31	122.02	100.73	79.43	58.14
	0%	63.88	42.59	21.29	0.00	-21.29	-42.59	-63.88
	-2.67%	-56.95	-78.24	-99.53	-120.83	-142.12	-163.42	-184.71
	-5.33%	-176.58	-197.88	-219.17	-240.47	-261.76	-283.05	-304.35
	-8%	-295.03	-316.32	-337.62	-358.91	-380.21	-401.50	-422.79

최대 손실 시나리오

위험액 -422.79

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 416.50

**[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 연가시점의 수익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

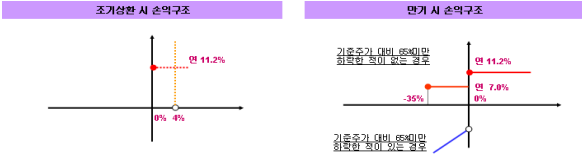
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 104%이상 상승한적이 있는 경우 연월 11.2%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환비도 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 \* (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



**3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR60034SST27 최대 손실 (ELS): 2007-3984

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	41.94	39.89	37.85	35.81	33.76	31.72	29.68
시나리오	5.33%	29.86	27.82	25.78	23.73	21.69	19.65	17.61
	2.67%	17.93	15.88	13.84	11.80	9.76	7.71	5.67
	0%	6.13	4.09	2.04	0.00	-2.04	-4.09	-6.13
	-2.67%	-5.53	-7.57	-9.62	-11.66	-13.70	-15.75	-17.79
	-5.33%	-17.06	-19.10	-21.14	-23.18	-25.23	-27.27	-29.31
	-8%	-28.44	-30.48	-32.53	-34.57	-36.61	-38.66	-40.70

<b>최대 손실 시나리오</b>	
<b>위험액</b>	-40.70

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

<b>위험액</b>	39.62
------------	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

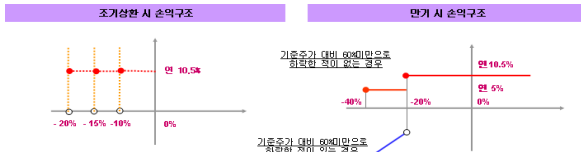
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 04월 19일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 4월 20일 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(3번째, 4번째 중도상환일), 80%이상인 경우(5번째 중도상환일, 만기상환일) 연율 10.5%의 수익률로 중도상환이 됨.  
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 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%	495.14	456.74	418.33	379.93	341.53	303.12	264.72
시나리오	5.33%	385.09	346.69	308.29	269.88	231.48	193.08	154.67
	2.67%	258.45	220.05	181.64	143.24	104.84	66.43	28.03
	0%	115.21	76.81	38.40	0.00	-38.40	-76.81	-115.21
	-2.67%	-44.63	-83.03	-121.43	-159.84	-198.24	-236.64	-275.05
	-5.33%	-221.06	-259.46	-297.86	-336.27	-374.67	-413.07	-451.48
	-8%	-414.08	-452.48	-490.89	-529.29	-567.70	-606.10	-644.50

최대 손실 시나리오	
위험액	-644.50

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	662.58
-----	--------



[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

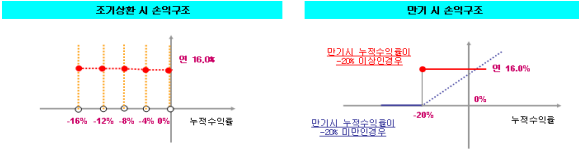
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007=504

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.82	0.66	0.50	0.34	0.18	0.02	-0.15
	5.33%	0.76	0.59	0.43	0.27	0.11	-0.05	-0.21
	2.67%	0.64	0.48	0.32	0.16	-0.00	-0.16	-0.33
	0%	0.48	0.32	0.16	0.00	-0.16	-0.32	-0.48
	-2.67%	0.28	0.12	-0.04	-0.20	-0.37	-0.53	-0.69
	-5.33%	0.03	-0.13	-0.29	-0.46	-0.62	-0.78	-0.94
	-8%	-0.27	-0.43	-0.59	-0.75	-0.91	-1.08	-1.24

최대 손실 시나리오	
위험액	-1.24

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	3.25
-----	------

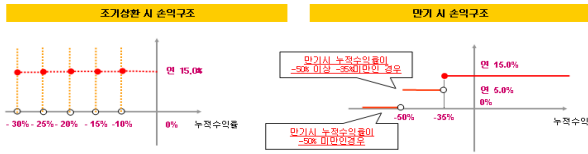
[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)  
KR603762C780 비례예상종형(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.97	1.54	1.11	0.68	0.25	-0.18	-0.61
	5.33%	1.80	1.37	0.94	0.51	0.08	-0.36	-0.79
	2.67%	1.57	1.14	0.71	0.28	-0.15	-0.58	-1.01
	0%	1.29	0.86	0.43	0.00	-0.43	-0.86	-1.29
	-2.67%	0.96	0.53	0.10	-0.33	-0.76	-1.19	-1.62
	-5.33%	0.57	0.14	-0.29	-0.72	-1.15	-1.58	-2.01
	-8%	0.13	-0.30	-0.73	-1.16	-1.59	-2.02	-2.46

최대 손실 시나리오

위험액	-2.46
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.60
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

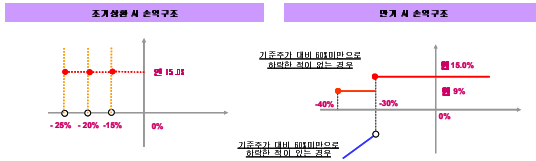
1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	여수(1)	배분(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,623	0	1,623	창의

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR603762L197 미래예상점(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	215.36	210.95	206.54	202.13	197.71	193.30	188.89
시나리오	5.33%	158.52	154.11	149.70	145.28	140.87	136.46	132.05
	2.67%	91.14	86.73	82.32	77.91	73.50	69.08	64.67
	0%	13.24	8.82	4.41	0.00	-4.41	-8.82	-13.24
	-2.67%	-75.20	-79.62	-84.03	-88.44	-92.85	-97.26	-101.68
	-5.33%	-174.18	-178.59	-183.00	-187.41	-191.83	-196.24	-200.65
	-8%	-283.68	-288.10	-292.51	-296.92	-301.33	-305.74	-310.16

최대 손실 시나리오

위험액	-310.16
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	322.06
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

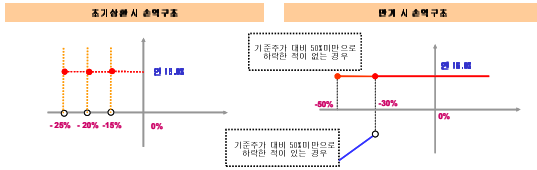
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR603762HTA9

미래예상증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	148.65	143.10	137.55	132.00	126.46	120.91	115.36
	5.33%	102.46	96.91	91.36	85.82	80.27	74.72	69.18
	2.67%	58.46	52.91	47.36	41.82	36.27	30.72	25.17
	0%	16.64	11.09	5.55	0.00	-5.55	-11.09	-16.64
	-2.67%	-22.99	-28.54	-34.08	-39.63	-45.18	-50.72	-56.27
	-5.33%	-60.43	-65.98	-71.53	-77.07	-82.62	-88.17	-93.71
	-8%	-95.69	-101.24	-106.78	-112.33	-117.88	-123.42	-128.97

최대 손실 시나리오

위험액	-128.97
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	125.17
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제13호

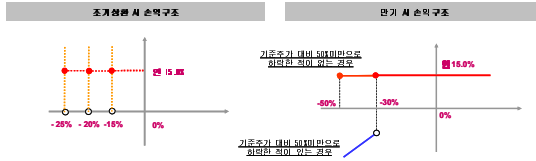
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762BT80 미래예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.21	4.94	4.67	4.41	4.14	3.88	3.61
	5.33%	3.87	3.61	3.34	3.08	2.81	2.55	2.28
	2.67%	2.40	2.14	1.87	1.61	1.34	1.08	0.81
	0%	0.80	0.53	0.27	0.00	-0.27	-0.53	-0.80
	-2.67%	-0.95	-1.21	-1.48	-1.75	-2.01	-2.28	-2.54
	-5.33%	-2.83	-3.10	-3.37	-3.63	-3.90	-4.16	-4.43
	-8%	-4.86	-5.12	-5.39	-5.65	-5.92	-6.18	-6.45

최대 손실 시나리오

위험액 -6.45

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 6.20

[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자전략 15호

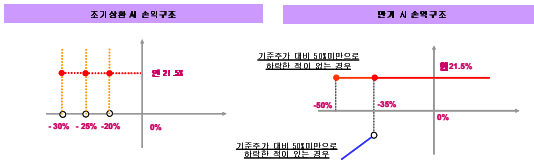
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345EV11 변동주변(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	213.35	187.96	162.56	137.19	111.80	86.42	61.03
	5.33%	167.45	142.06	116.67	91.29	65.90	40.51	15.13
	2.67%	121.72	96.33	70.94	45.56	20.17	-5.22	-30.60
	0%	76.16	50.77	25.39	0.00	-25.39	-50.77	-76.16
	-2.67%	30.78	5.39	-20.00	-45.38	-70.77	-96.16	-121.54
	-5.33%	-14.43	-39.82	-65.21	-90.59	-115.98	-141.37	-166.76
	-8%	-59.47	-84.86	-110.25	-135.63	-161.02	-186.41	-211.79

최대 손실 시나리오  
위험액 -211.79

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 211.03

[16] 메리츠 주가지수연계 괴생상률 제 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

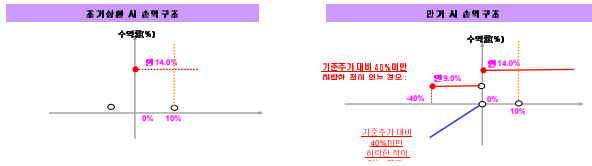
3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	535.32	510.84	486.36	461.88	437.41	412.93	388.45
	5.33%	390.80	366.32	341.84	317.36	292.89	268.41	243.93
시나리오	2.67%	236.83	212.36	187.88	163.40	138.93	114.45	89.97
	0%	73.43	48.95	24.48	0.00	-24.48	-48.95	-73.43
	-2.67%	-99.41	-123.89	-148.37	-172.84	-197.32	-221.80	-246.28
	-5.33%	-281.70	-306.18	-330.65	-355.13	-379.61	-404.08	-428.56
	-8%	-473.43	-497.90	-522.38	-546.86	-571.33	-595.81	-620.29

최대 손실 시나리오

위험액	-620.29
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	606.98
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위파생26호

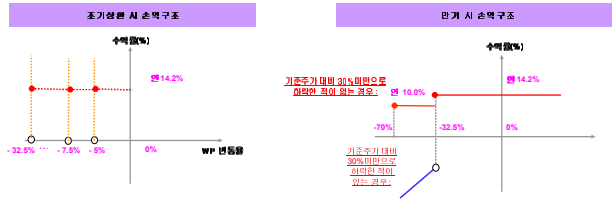
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600867BTB0 쿠모상신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	210.66	177.64	144.62	111.59	78.57	45.55	12.53
시나리오	5.33%	174.44	141.42	108.40	75.38	42.35	9.33	-23.69
	2.67%	137.24	104.22	71.20	38.18	5.16	-27.86	-60.89
	0%	99.06	66.04	33.02	0.00	-33.02	-66.04	-99.06
	-2.67%	59.91	26.89	-6.14	-39.16	-72.18	-105.20	-138.22
	-5.33%	19.77	-13.25	-46.27	-79.29	-112.31	-145.33	-178.35
	-8%	-21.34	-54.36	-87.38	-120.40	-153.43	-186.45	-219.47

최대 손실 시나리오

위험액 -219.47

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 269.14



[18]테리츠 TOUCH사모단위파생1호

1. 계약금액

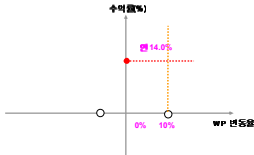
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	잔위

단위(백만원)

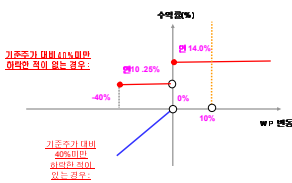
2. 만기시점의 수익구조

- 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/시초기준지수)  
 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	106.90	100.65	94.40	88.15	81.89	75.64	69.39	
파생	76.78	70.53	64.28	58.02	51.77	45.52	39.27	
시나리오	2.67%	47.40	41.15	34.89	28.64	22.39	16.14	
	0%	18.76	12.50	6.25	0.00	-6.25	-12.50	
	-2.67%	-9.14	-15.40	-21.65	-27.90	-34.15	-40.40	
	-8.33%	-36.30	-42.55	-48.81	-55.06	-61.31	-67.56	
	-8%	-62.72	-68.97	-75.23	-81.48	-87.73	-93.98	

최대 손실 시나리오

위험액	69.39
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	100.44
-----	--------

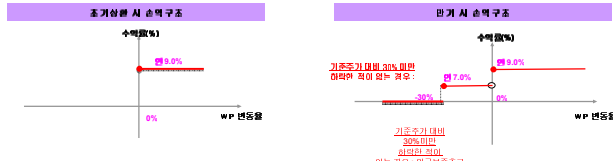
[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가5호

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) 만기: 2011년 1월 24일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
  - 4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가
  - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가격의 100% 이상인 경우 연이율 9%로 중도상환함.
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 \* 121%
  - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우 : 원금\*100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	44.50	40.61	37.11	33.42	29.73	26.04	22.35
	5.33%	34.08	30.38	26.69	23.00	19.31	15.62	11.92
	2.67%	22.93	19.24	15.55	11.86	8.17	4.48	0.78
	0%	11.08	7.38	3.69	0.00	-3.69	-7.38	-11.08
	-2.67%	-1.50	-5.19	-8.89	-12.58	-16.27	-19.96	-23.65
	-5.33%	-14.80	-18.49	-22.18	-25.87	-29.57	-33.26	-36.95
	-8%	-28.61	-32.51	-36.20	-39.89	-43.58	-47.27	-50.96

최대 손실 시나리오

위험액	22.35
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	52.20
-----	-------

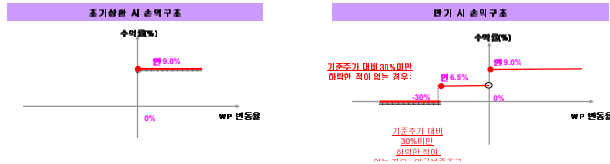
[20]테리 조지 수연계 사모단원 피싱6호

1. 계약금액

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

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
  - 2) 평가: 2011년 2월 21일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
  - 4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가
  - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)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 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 \* 119.5%
  - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우 : 원금\*100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))  
KR603762OV23 미래셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오		변동성 시나리오						
구분		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	89.36	86.50	83.64	80.77	77.91	75.05	72.19
	5.33%	58.76	55.90	53.04	50.18	47.32	44.45	41.59
	2.67%	31.84	29.98	26.12	23.25	20.39	17.53	14.67
	0%	8.59	5.72	2.86	0.00	-2.86	-5.72	-8.59
	-2.67%	-11.00	-13.86	-16.72	-19.58	-22.44	-25.31	-28.17
	-5.33%	-26.91	-29.77	-32.63	-35.49	-38.35	-41.22	-44.08
	-8%	-39.14	-42.01	-44.87	-47.73	-50.59	-53.45	-56.32

최대 손실 시나리오	
위험액	72.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	54.58
-----	-------

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

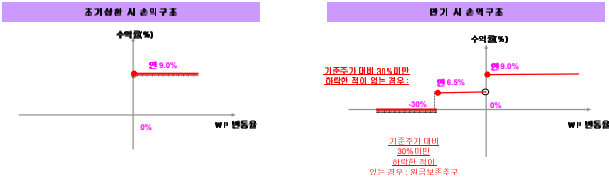
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가격이 만도 기 준가격 의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기 준가격 보다 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 시나리오	8%	69.50	67.28	65.05	62.82	60.60	58.37	56.15
	5.33%	45.71	43.48	41.25	39.03	36.80	34.58	32.35
	2.67%	24.76	22.54	20.31	18.09	15.86	13.63	11.41
	0%	6.68	4.45	2.23	0.00	-2.23	-4.45	-6.68
	-2.67%	-6.55	-10.78	-13.00	-15.23	-17.46	-19.68	-21.91
	-5.33%	-20.93	-23.15	-25.38	-27.60	-29.83	-32.06	-34.28
	-8%	-30.45	-32.67	-34.90	-37.12	-39.35	-41.58	-43.80

최대 손실 시나리오

위험액	56.15
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	42.45
-----	-------

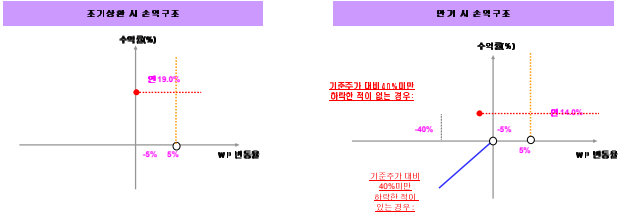
[23] 메리츠증권지수연계사모파생1호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수
- 만기: 2010년 08월 04일
- 관드첨산 결정주기: 매 3개월
- 기준지수: 2008년 8월 7일 NIKKEI225, HSCEI지수의 증가
- 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상승포함하여 한방이라도 최초기준가격의 95% 이상이거나 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 19%의 수익률로 중도상환  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 관드첨  
 - 두 기초자산의 가격이 한방도 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 구조인 톱 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	137.46	128.28	119.10	109.91	100.73	91.55	82.36
	5.33%	101.06	91.88	82.70	73.52	64.33	55.15	45.97
	2.67%	64.43	55.24	46.06	36.88	27.70	18.51	9.33
	0%	27.55	18.37	9.18	0.00	-9.18	-18.37	-27.55
	-2.67%	-9.57	-18.75	-27.94	-37.12	-46.30	-55.48	-64.67
	-5.33%	-46.93	-56.11	-65.30	-74.48	-83.66	-92.84	-102.03
	-8%	-84.53	-93.71	-102.90	-112.08	-121.26	-130.44	-139.63

최대 손실 시나리오

위험액 -139.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액 134.82

[24] 메리츠2Star 파생 상품 SEPO-1호

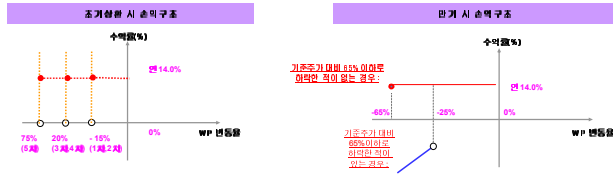
1. 계약금액

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) 만드첨산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 14.0%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 확정
  - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 48%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 14.0%
  - 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)

KR652307VR2 보유증권(ELS)2723

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-7.15	-7.17	-7.18	-7.20	-7.21	-7.23	-7.24
	5.33%	-3.15	-3.17	-3.18	-3.20	-3.21	-3.23	-3.24
	2.67%	-0.75	-0.77	-0.78	-0.80	-0.81	-0.83	-0.84
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.03	-0.05
	-2.67%	-0.76	-0.77	-0.79	-0.80	-0.82	-0.83	-0.85
	-5.33%	-3.16	-3.17	-3.19	-3.20	-3.22	-3.23	-3.25
	-8%	-7.16	-7.17	-7.19	-7.20	-7.22	-7.23	-7.25

최대 손실 시나리오

위험액 -7.25

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액 6.19

[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

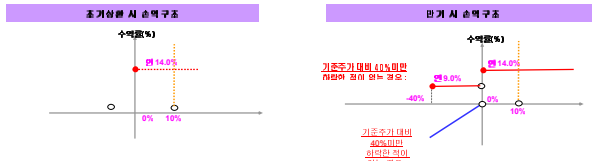
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600690BVR2 대우증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	656.10	626.10	596.10	566.10	536.10	506.10	476.10
시나리오	5.33%	478.97	448.97	418.97	388.97	358.97	328.97	298.97
	2.67%	290.27	260.27	230.27	200.27	170.27	140.27	110.27
	0%	90.00	60.00	30.00	0.00	-30.00	-60.00	-90.00
	-2.67%	-121.84	-151.84	-181.84	-211.84	-241.84	-271.84	-301.84
	-5.33%	-345.26	-375.26	-405.26	-435.26	-465.26	-495.26	-525.26
	-8%	-580.25	-610.25	-640.25	-670.25	-700.25	-730.25	-760.25

최대 손실 시나리오

위험액 -760.25

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 743.94

**[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재
- 2) 만기: 2010년 09월 30일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 삼성화재)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일), 70%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연달아 16.2%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드매각
  - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우: 원금 \* 132.4%
  - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우: 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6612302/A7 - 매신증권(ELS)713

**손익구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.34	-0.44	-0.55	-0.66	-0.77	-0.88	-0.99
시나리오	5.33%	0.27	0.16	0.05	-0.06	-0.17	-0.28	-0.39
	2.67%	0.49	0.38	0.27	0.16	0.05	-0.06	-0.17
	0%	0.33	0.22	0.11	0.00	-0.11	-0.22	-0.33
	-2.67%	-0.22	-0.33	-0.43	-0.54	-0.65	-0.76	-0.87
	-5.33%	-1.14	-1.25	-1.36	-1.47	-1.58	-1.69	-1.80
	-8%	-2.45	-2.56	-2.67	-2.78	-2.89	-2.99	-3.10
	최대 손실 시나리오	<b>위험액 -3.10</b>						

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

<b>위험액</b>	<b>2.32</b>
------------	-------------



[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

2) 만기: 2011년 09월 23일

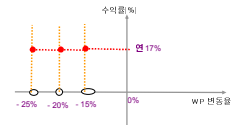
3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

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

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

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR657234591 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	4.72	3.46	2.20	0.95	-0.31	-1.57	-2.82
	5.33%	6.54	5.28	4.03	2.77	1.52	0.26	-1.00
	2.67%	6.22	4.97	3.71	2.46	1.20	-0.06	-1.31
	0%	3.77	2.51	1.26	0.00	-1.26	-2.51	-3.77
	-2.67%	-0.83	-2.08	-3.34	-4.60	-5.85	-7.11	-8.37
	-5.33%	-7.56	-8.82	-10.08	-11.33	-12.59	-13.85	-15.10
	-8%	-16.44	-17.70	-18.95	-20.21	-21.47	-22.72	-23.98

최대 손실 시나리오

위험액	-23.98
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.38
-----	-------

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

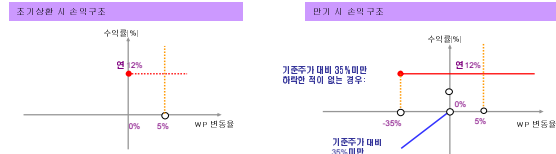
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조인 줄(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6583337V98 현대증권(ELS)2008-945

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액 0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 0.00

**[34] 대리 조주가지 수익계 파생 13**

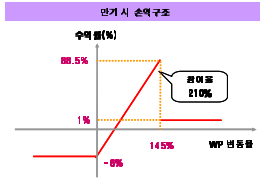
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 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 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
  - 만기 평가시 초기 기준가격 이상이고 최초 기준가격의 145% 미만일 경우  
: 원금 \* ( 94% + 210% \* ( 만기 기준지수 / 최초 기준지수 - 1 ) )
  - 만기 평가시 초기 기준가격 미만일 경우  
: 원금 \* 94%
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조변동(최대 손실 가능 금액(단위:백만원))**

KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산 시나리오	8%	-45.56	-54.24	-62.92	-71.60	-80.28	-88.95	-97.63
	5.33%	-19.07	-27.75	-36.43	-45.11	-53.78	-62.46	-71.14
	2.67%	4.80	-3.88	-12.56	-21.24	-29.92	-38.60	-47.28
	0%	26.04	17.36	8.68	0.00	-8.68	-17.36	-26.04
	-2.67%	44.65	35.97	27.29	18.61	9.94	1.26	-7.42
	-5.33%	60.64	51.96	43.28	34.60	25.92	17.25	8.57
	-8%	74.00	65.32	56.64	47.96	39.29	30.61	21.93

최대 손실 시나리오

위험액 21.93

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액 88.65

**[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호**

**1. 계약금액**

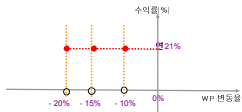
구분	기래자산	가액유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

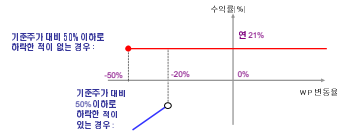
**2. 만기시점의 손익구조**

- 파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 만기: 2012년 02월 15일
- 증가평가일: 매6개월
- 기준지수: 2009년 02월 13일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 발행 후 6개월마다 증가평가를 시행하고, 기초자산(삼성전자 증가, SK텔레콤의 증가)의 평가일 증가가 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 증가평가일), 85%이상인 경우(세번째, 네번째 증가평가일), 80%이상인 경우(다섯번째 증가평가일) 인출 21.0%의 수익률로 종료 상황이 됨.  
단, 만기시 까지 초기 상황 충족하지 못한 경우 아래와 같이 만기 상당금액을 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 증가가 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	9.10	7.74	6.38	5.03	3.67	2.32	0.96
시나리오	5.33%	7.95	6.60	5.24	3.89	2.53	1.18
	2.67%	6.28	4.92	3.57	2.21	0.86	-0.50
	0%	4.07	2.71	1.36	0.00	-1.36	-2.71
	-2.67%	1.32	-0.04	-1.39	-2.75	-4.10	-5.46
	-5.33%	-1.96	-3.32	-4.68	-6.03	-7.39	-8.74
	-8%	-5.78	-7.14	-8.49	-9.85	-11.20	-12.56

**최대 손실 시나리오**

위험액	-13.91
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	13.09
-----	-------

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

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

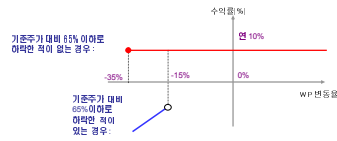
**2. 연가시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 연가: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 결정 일자: 매3개월
- 4) 기 존지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 0.0%의 수익률로 중도상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 110.0%  
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**3. 손익구조변동/최대 손실 가능 금액 (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

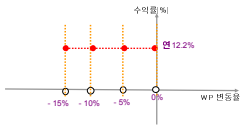
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액금(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

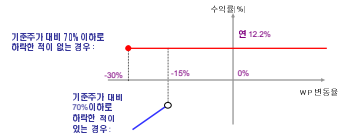
2. 만기시점의 손익구조

- 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/최초 기준지수)
- 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)

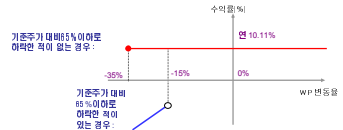
**2. 연가시점의 손익구조**

- 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 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

낮은 기준지수기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일)

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

연율11%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도침지

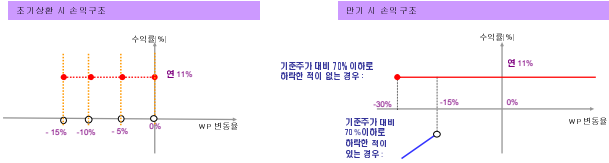
- 두 기준지수의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우

: 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

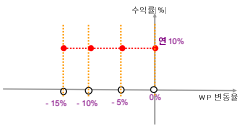
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

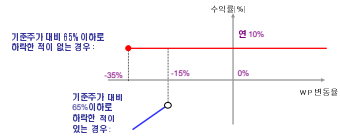
2. 연기시점의 손익구조

- 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, 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) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**1. 계약금액**

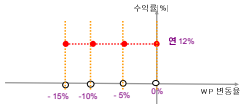
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

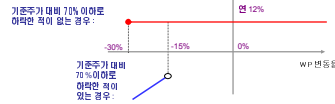
**2. 연기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**1. 계약금액**

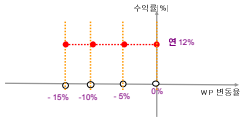
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	차입

단위(백만원)

**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, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네 번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 두 기 초자산의 가격이 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 112%  
 - 두 기 초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**1. 계약금액**

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

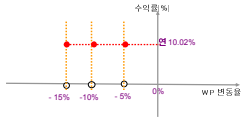
: 원금 \* 110.02%

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

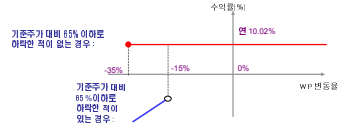
: 원금 \* (만기 기 준지 수 /최 초기 준지 수)

6) 권 드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

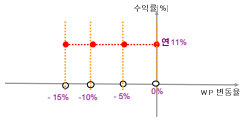
**1. 계약금액**

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

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

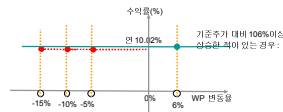
2) 만기: 2011년 5월 27일

3) 만드침산 결정주기: 매 4개월

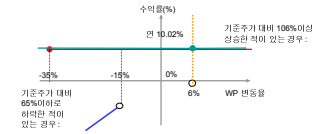
4) 기준지수: 2000년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가

- 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 기준지수의 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 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 20.04%
  - 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHG-2

1. 계약금액

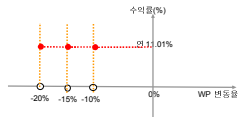
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	잔액

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 만기: 2012년 4월 12일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차 지수의 증가
- 실행 후 6개월 마다 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 중도상환이 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							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.13	0.11	0.08	0.06	0.04	0.01	-0.01
	5.33%	0.14	0.11	0.09	0.06	0.04	0.01	-0.01
	2.67%	0.12	0.09	0.07	0.04	0.02	-0.01	-0.03
	0%	0.07	0.05	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.07
	-2.67%	0.01	-0.02	-0.04	-0.07	-0.09	-0.11	-0.14
	-5.33%	-0.08	-0.11	-0.13	-0.16	-0.18	-0.20	-0.23
	-8%	-0.19	-0.22	-0.24	-0.27	-0.29	-0.32	-0.34
	최대 손실 시나리오	위험액 -0.34						

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.69
-----	------

[62] 테리츠2Star사모증권투자STWF-1

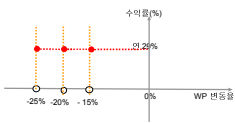
1. 계약금액

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

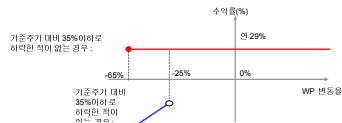
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오					변동성 시나리오				
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%			
기초자산 시나리오	8%	1.61	0.52	-0.58	-1.68	-2.77	-3.87	-4.97		
	5.33%	4.64	3.54	2.45	1.35	0.25	-0.84	-1.94		
	2.67%	5.20	4.10	3.00	1.91	0.81	-0.29	-1.38		
	0%	3.29	2.19	1.10	0.00	-1.10	-2.19	-3.29		
	-2.67%	-1.06	-2.16	-3.26	-4.37	-5.47	-6.57	-7.66		
-5.33%	-7.93	-9.02	-10.12	-11.21	-12.31	-13.41	-14.50			
-8%	-17.23	-18.33	-19.43	-20.52	-21.62	-22.72	-23.81			

최대 손실 시나리오

위험액	-23.81
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	60.14
-----	-------



[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

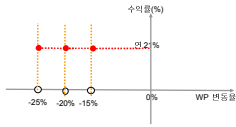
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

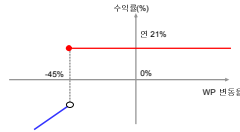
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보충주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80% 이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 21%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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(장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)  
 6) 권드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.29	0.24	0.19	0.13	0.08	0.03	-0.03
	5.33%	0.30	0.25	0.19	0.14	0.09	0.03	-0.02
시나리오	2.67%	0.26	0.20	0.15	0.10	0.04	-0.01	-0.07
	0%	0.16	0.11	0.05	0.00	-0.05	-0.11	-0.16
시나리오	-2.67%	0.02	-0.04	-0.09	-0.15	-0.20	-0.25	-0.31
	-5.33%	-0.16	-0.24	-0.29	-0.34	-0.40	-0.45	-0.50
	-8%	-0.43	-0.48	-0.54	-0.59	-0.64	-0.70	-0.75

최대 손실 시나리오

위험액	-0.75
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.53
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

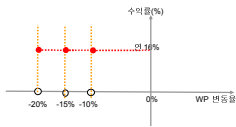
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

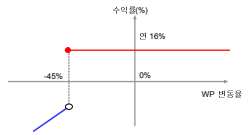
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 + 11.6%  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오								
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%		
기초자산	8%	2.70	2.05	1.40	0.75	0.10	-0.55	-1.20	
시나리오	5.33%	3.15	2.50	1.85	1.20	0.55	-0.10	-0.75	
	2.67%	2.90	2.25	1.60	0.95	0.30	-0.35	-1.00	
	0%	1.95	1.30	0.65	0.00	-0.65	-1.30	-1.95	
	-2.67%	0.31	-0.35	-1.00	-1.65	-2.30	-2.95	-3.60	
	-5.33%	-2.04	-2.69	-3.34	-3.99	-4.65	-5.30	-5.95	
	-8%	-5.09	-5.74	-6.39	-7.04	-7.69	-8.34	-8.99	

최대 손실 시나리오

위험액	-8.99
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.37
-----	------

[65] 테리츠2Star사모증권POKB-2호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

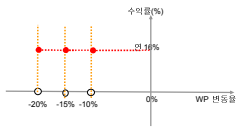
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

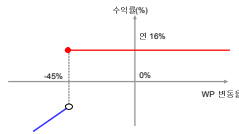
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 + 11.6%  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 주권투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.33%	2.67%	0%	-2.67%	-5.33%	-8%	
변동성 시나리오	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
손익	0.16	0.12	0.08	0.04	0.01	-0.03	-0.07	
손익	0.19	0.15	0.11	0.07	0.03	-0.01	-0.05	
손익	0.17	0.13	0.10	0.06	0.02	-0.02	-0.06	
손익	0.12	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12	
손익	0.02	-0.02	-0.06	-0.10	-0.14	-0.18	-0.22	
손익	-0.12	-0.16	-0.20	-0.24	-0.28	-0.32	-0.36	
손익	-0.30	-0.34	-0.38	-0.42	-0.46	-0.50	-0.54	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.54
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.26
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드칭산 결정주기: 매6개월

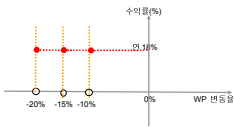
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

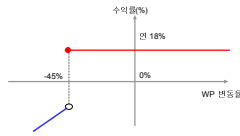
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 + 11.8%  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	10.94	7.94	4.95	1.95	-1.05	-4.05	-7.04
시나리오	5.33%	12.67	9.67	6.67	3.68	0.68	-2.32	-5.31
	2.67%	12.02	9.02	6.02	3.03	0.03	-2.97	-5.96
	0%	8.99	5.99	3.00	0.00	-3.00	-5.99	-8.99
	-2.67%	3.59	0.59	-2.41	-5.41	-6.40	-11.40	-14.40
	-5.33%	-4.20	-7.19	-10.19	-13.19	-16.19	-19.18	-22.18
	-8%	-14.36	-17.36	-20.35	-23.35	-26.35	-29.35	-32.34

최대 손실 시나리오

위험액	-32.34
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	33.50
-----	-------

**[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

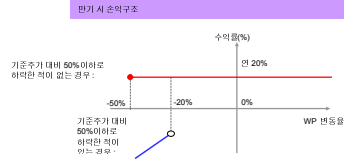
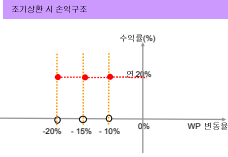
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

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

6) 원도의 수익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

구분	손익 구조변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.33%	2.67%	0%	-2.67%	-5.33%	-8%	
변동성 시나리오	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
최대 손실	3.88	4.70	4.39	2.94	0.35	-3.37	-6.24	
최대 손실	2.90	3.72	3.41	1.96	-0.63	-4.35	-9.22	
최대 손실	1.92	2.74	2.43	0.98	-1.61	-3.33	-8.20	
최대 손실	0.94	1.76	1.45	0.00	-2.59	-6.31	-11.18	
최대 손실	-0.04	0.78	0.47	-0.98	-3.57	-7.29	-12.16	
최대 손실	-1.02	-0.20	-0.51	-1.96	-4.55	-8.27	-13.14	
최대 손실	-2.00	-1.18	-1.49	-2.94	-5.53	-9.25	-14.12	

**최대 손실 시나리오**

위험액	-14.12
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	15.53
-----	-------

[76] 데리츠2Star사로 SEST-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드칭산 결정주기: 매6개월

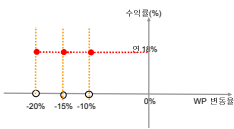
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

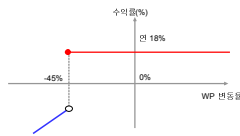
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 + 11.8%  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	6.02	4.37	2.72	1.07	-0.58	-2.23	-3.87
시나리오	5.33%	6.97	5.32	3.67	2.02	0.37	-1.27	-2.92
	2.67%	6.61	4.96	3.31	1.67	0.02	-1.63	-3.28
	0%	4.95	3.30	1.65	0.00	-1.65	-3.30	-4.95
	-2.67%	1.97	0.32	-1.32	-2.97	-4.62	-6.27	-7.92
	-5.33%	-2.31	-3.96	-5.61	-7.26	-8.90	-10.55	-12.20
	-8%	-7.90	-9.55	-11.20	-12.85	-14.49	-16.14	-17.79

최대 손실 시나리오

위험액	-17.79
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	18.43
-----	-------

[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

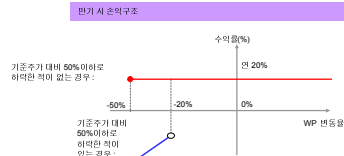
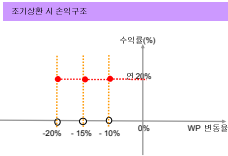
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오								
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%		
기초자산	8%	4.67	3.88	3.10	2.31	1.53	0.75	-0.04	
사니리오	5.33%	4.46	3.68	2.89	2.11	1.33	0.54	-0.24	
오	2.67%	3.69	2.91	2.12	1.34	0.56	-0.23	-1.01	
	0%	2.35	1.57	0.78	0.00	-0.78	-1.57	-2.35	
	-2.67%	0.44	-0.34	-1.12	-1.91	-2.69	-3.47	-4.26	
	-5.33%	-2.03	-2.81	-3.60	-4.38	-5.17	-5.95	-6.73	
	-8%	-5.07	-5.86	-6.64	-7.42	-8.21	-8.99	-9.78	

최대 손실 시나리오

위험액	-9.78
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	11.47
-----	-------

[78] 테리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

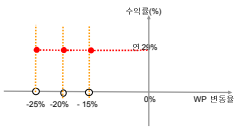
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융지주, SK텔레콤 보 통주)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.

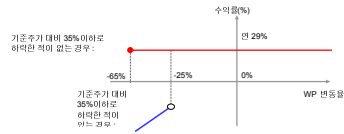
- 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
- 두 기초자산의 가액이 합반도 기준가액의 50%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12%
  - 두 기초자산의 가액(중종 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%이상으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622313W42 표본증권(ELS)325

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.41	0.45	-0.50	-1.46	-2.41	-3.37	-4.32
시나리오	5.33%	4.04	3.08	2.13	1.17	0.22	-0.73	-1.69
	2.67%	4.53	3.57	2.62	1.66	0.71	-0.25	-1.20
	0%	2.86	1.91	0.95	0.00	-0.95	-1.91	-2.86
	-2.67%	-0.94	-1.90	-2.85	-3.81	-4.76	-5.72	-6.67
	-5.33%	-6.90	-7.85	-8.81	-9.76	-10.72	-11.67	-12.63
	-8%	-15.00	-15.96	-16.91	-17.87	-18.82	-19.78	-20.73

최대 손실 시나리오

위험액	-20.73
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	52.35
-----	-------



[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

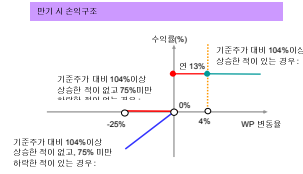
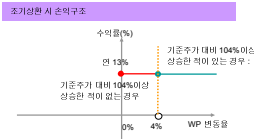
단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

메리츠주가지수연계사모6호

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	9,383.42	8,738.05	8,092.67	7,447.30	6,801.93	6,156.55	5,511.18
시나리오	5.33%	6,885.57	6,240.20	5,594.82	4,949.45	4,304.07	3,658.70	3,013.33
	2.67%	4,403.14	3,757.76	3,112.39	2,467.01	1,821.64	1,176.27	530.89
	0%	1,936.12	1,290.75	645.37	0.00	-645.37	-1,290.75	-1,936.12
	-2.67%	-915.48	-1,160.85	-1,806.22	-2,451.60	-3,096.97	-3,742.34	-4,387.72
	-5.33%	-2,951.65	-3,597.02	-4,242.40	-4,887.77	-5,533.15	-6,178.52	-6,823.89
	-8%	-5,372.41	-6,017.78	-6,663.16	-7,308.53	-7,953.90	-8,599.28	-9,244.65

최대 손실 시나리오

위험액	-9,244.65
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,138.57
-----	----------

**[79-2] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 수익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 8일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 8일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 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

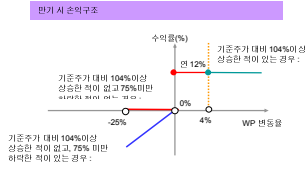
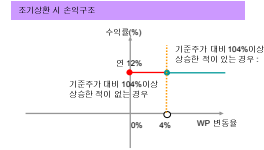
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우

: 원금 \* 11.2%

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

: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6030613TB2      교보증권(ELS)82

**[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호**

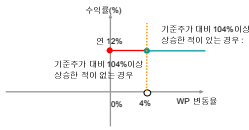
**1. 계약금액**

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

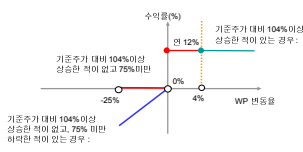
**2. 만기시점의 수익구조**

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

**조기상환 시 수익구조**



**만기 시 수익구조**



KR603061ATB9      교보증권(ELS)87

**[79-4] 메리츠주가지수연계사모6호**

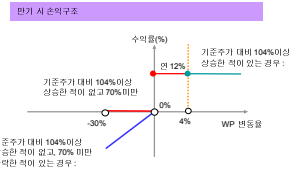
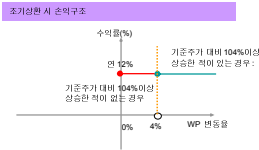
**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 수익구조**

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



KR6008679TA3      굿모닝 신환증권(ELS)786

**[79-5] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 10일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

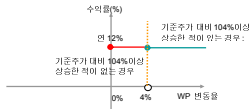
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

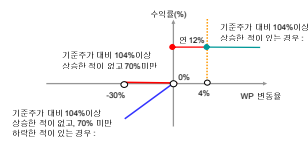
- 두 기초자산의 가격이 한 번도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
: 원금 \* 112%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우  
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600086767B7 국토부 신한증권(ELS)797

**[79-6] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

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

단위: (백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 19일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가

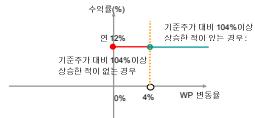
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정점에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

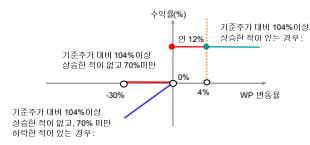
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
: 원금 \* 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600867CTB8      굿모닝 신한증권(ELS)804

**[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 15일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

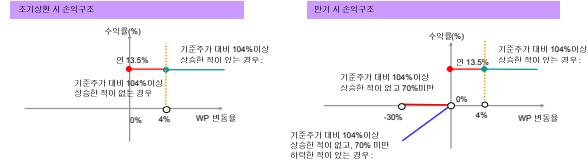
4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가

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



KR60008675TC7    굿모닝 신한증권(ELS)809

**[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

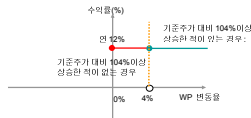
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
통화	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

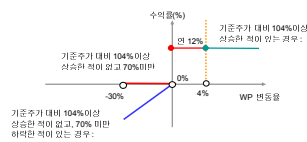
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438



**[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 08일

3) 만트청산 결정주기: 매3개월

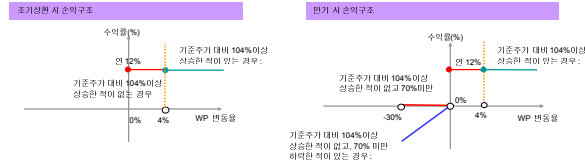
4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

6) 만트의 수익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

**[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

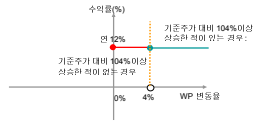
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000.0	0	5,000	차입

단위: (백만원)

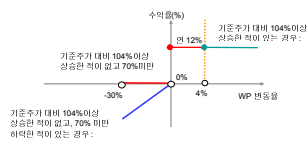
**2. 만기시점의 손익구조**

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

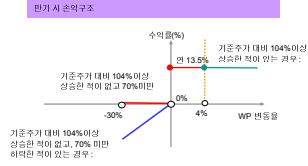
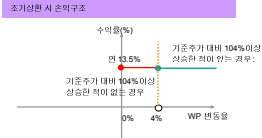
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

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 증도 상환

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

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

6) 펀드의 수익구조



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)

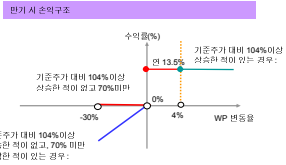
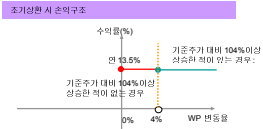
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 조기상환일점에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환

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

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

**6) 펀드의 수익구조**



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

**[82] 대리 조주가지 수연계사모증권5호**

**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

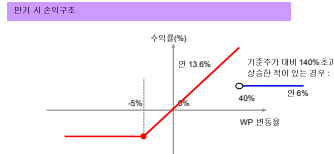
1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 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(KOSPI200지수)의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우  
 : 원금 \* 100%
- 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%	-0.43	-1.44	-2.45	-3.46	-4.47	-5.48	-6.49
시나리오	5.33%	0.94	-0.07	-1.06	-2.09	-3.10	-4.11	-5.12
	2.67%	2.09	1.08	0.07	-0.94	-1.95	-2.96	-3.97
	0%	3.03	2.02	1.01	0.00	-1.01	-2.02	-3.03
	-2.67%	3.76	2.75	1.73	0.72	-0.29	-1.30	-2.31
	-5.33%	4.27	3.26	2.25	1.23	0.22	-0.79	-1.80
	-8%	4.56	3.55	2.54	1.53	0.52	-0.49	-1.50

**최대 손실 시나리오**

위험액	-1.60
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	6.66
-----	------

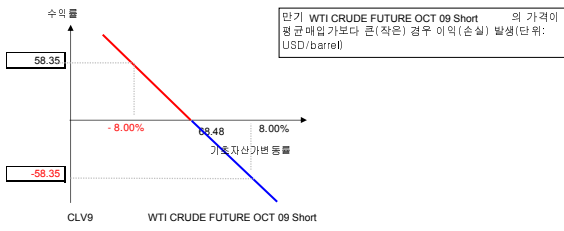
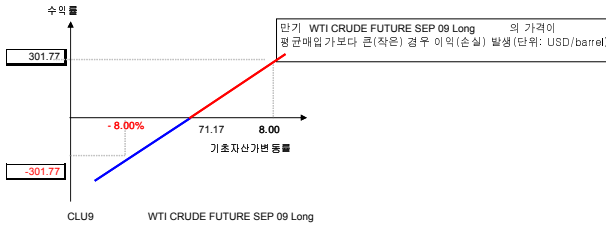
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위(계약)

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위: 1,000 USD)

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

구분	시나리오	손익
기초자산 시나리오	8%	243.42
	5.33%	162.18
	2.67%	81.24
	0%	0.00
	-2.67%	-81.24
	-5.33%	-162.18
	-8%	-243.42

최대손실 시나리오	
위험액	-243.42

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,459
-----	-------

**[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	차입

단위(백만원)

**2. 평가시점의 손익구조**

1) 평가대상상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

2) 만기: 2010년 5월 28일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

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

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

낮은 기초자산가액으로 각각 최초 기준가액의 95%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일)

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

연율 12.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

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

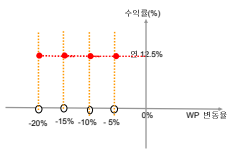
: 원금 \* 112.5%

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

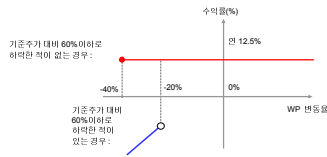
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



기준주가 대비 60%이하로 하락한 적이 없는 경우:

기준주가 대비 60%이하로 하락한 적이 있는 경우:

**3. 손익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6523310W80 대우증권ELS3005

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초 자산 시나리오	8%	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02
	5.33%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	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%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	
-8%	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	

최대 손실 시나리오

위험액	0.02
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

[79] 데리츠주가지 수연계사모증권!61E

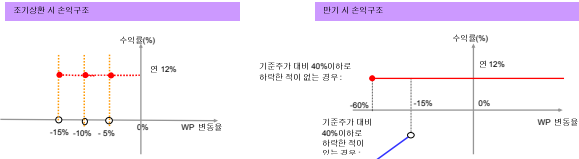
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 연가시점의 손익구조

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



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6503305W69 코모닝 신한증권(ELS)1039

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-5.74	-6.61	-7.46	-8.33	-9.22	-10.09	-10.96
	5.33%	0.09	-0.78	-1.65	-2.52	-3.39	-4.26	-5.13
산	2.67%	2.87	2.00	1.14	0.27	-0.60	-1.47	-2.34
	0%	2.61	1.74	0.87	0.00	-0.87	-1.74	-2.61
시나리오	-2.67%	-0.71	-1.58	-2.45	-3.32	-4.19	-5.05	-5.92
	-5.33%	-7.07	-7.94	-8.81	-9.68	-10.55	-11.42	-12.29
	-8%	-16.49	-17.36	-18.23	-19.10	-19.97	-20.84	-21.71

최대 손실 시나리오

위험액	-21.71
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	19.76
-----	-------



**[80] 대리 조주가지 수연계 사모증권 10호**

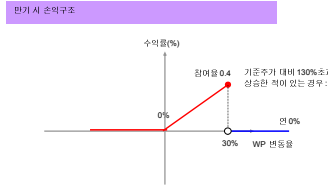
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 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% \* 1 만기 기준지수/최초기준지수 - 1}
    - : 원금 \* 100%
  - 만기일까지 수가가 최초기준가격 미만일 경우
    - : 원금 \* 100%
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익구조변동률(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%	0.42	-1.64	-3.69	-5.74	-7.79	-9.84	-11.90
손익	2.67%	3.47	1.41	-0.64	-2.69	-4.74	-6.79	-8.85
시나리오	0%	6.16	4.10	2.05	0.00	-2.05	-4.10	-6.16
	-2.67%	6.49	6.43	4.38	2.33	0.28	-1.77	-3.83
	-5.33%	10.46	8.40	6.35	4.30	2.25	0.19	-1.86
	-8%	12.07	10.01	7.96	5.91	3.86	1.80	-0.25

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.25
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	14.95
-----	-------

**[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호**

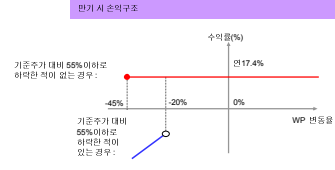
**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산( 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산의 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



**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%	4.28	3.68	3.07	2.47	1.87	1.27	0.67
	5.33%	4.14	3.54	2.94	2.34	1.74	1.14	0.54
시나리오	2.67%	3.32	2.72	2.12	1.51	0.91	0.31	-0.29
	0%	1.80	1.20	0.60	0.00	-0.60	-1.20	-1.80
	-2.67%	-0.40	-1.00	-1.60	-2.20	-2.81	-3.41	-4.01
	-5.33%	-3.30	-3.90	-4.50	-5.10	-5.70	-6.30	-6.90
	-8%	-6.88	-7.48	-8.08	-8.69	-9.29	-9.89	-10.49

**최대 손실 시나리오**

위험액	-10.49
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	10.94
-----	-------

**[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호**

**1. 계약금액**

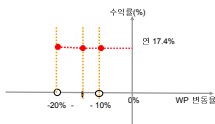
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

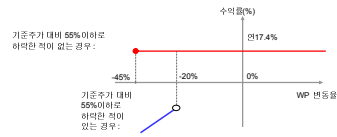
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**  
KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

**손익 구조표본 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	27.48	23.62	19.76	15.90	12.04	8.18	4.32
	5.33%	26.61	22.75	18.89	15.03	11.17	7.32	3.46
	2.67%	21.31	17.45	13.59	9.73	5.87	2.02	-1.84
0%	11.58	7.72	3.86	0.00	-3.86	-7.72	-11.58	-15.44
-2.67%	-2.99	-6.45	-10.31	-14.17	-18.03	-21.89	-25.75	-29.61
-5.33%	-21.19	-25.05	-28.91	-32.77	-36.63	-40.49	-44.35	-48.21
-8%	-44.23	-48.09	-51.95	-55.81	-59.67	-63.53	-67.38	-71.24

**최대 손실 시나리오**

위험액	-67.38
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	70.28
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

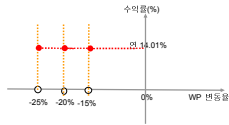
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: (백만원)

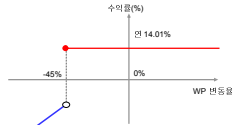
2. 만기시점의 손익구조

- 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/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.15	-0.21	-0.27	-0.33	-0.40	-0.46	-0.52
손익	5.33%	0.13	0.07	0.01	-0.05	-0.11	-0.18	-0.24
시나리오	2.67%	0.25	0.18	0.12	0.06	-0.00	-0.06	-0.13
	0%	-0.08	-0.12	-0.06	-0.00	-0.06	-0.12	-0.18
	-2.67%	-0.04	-0.11	-0.17	-0.23	-0.29	-0.35	-0.42
	-5.33%	-0.44	-0.51	-0.57	-0.63	-0.69	-0.75	-0.82
	-8%	-1.01	-1.08	-1.14	-1.20	-1.26	-1.32	-1.39

최대 손실 시나리오	
위험액	-1.39

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	2.69
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

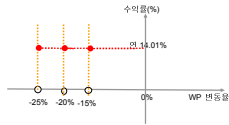
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위: (백만원)

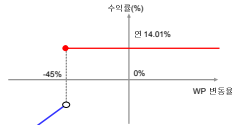
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.53	-0.76	-0.96	-1.20	-1.43	-1.65	-1.87
손익	5.33%	0.48	0.26	0.04	-0.19	-0.41	-0.63	-0.86
시나리오	2.67%	0.89	0.66	0.44	0.21	-0.01	-0.23	-0.46
	0%	0.67	0.45	0.22	0.00	-0.22	-0.45	-0.67
	-2.67%	-0.16	-0.39	-0.61	-0.83	-1.05	-1.28	-1.50
	-5.33%	-1.60	-1.83	-2.05	-2.27	-2.50	-2.72	-2.95
	-8%	-3.66	-3.89	-4.11	-4.34	-4.56	-4.78	-5.01

최대 손실 시나리오

위험액	-5.01
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	9.73
-----	------

**[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호**

**1. 계약금액**

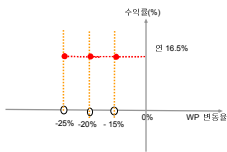
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

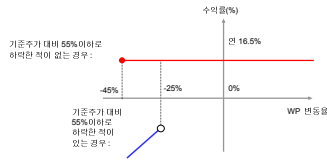
**2. 만기시점의 손익구조**

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

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	8%	-0.01	-0.02	-0.03	-0.03	-0.04	-0.05	-0.05
	5.33%	0.02	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.01	-0.02
시나리오	2.67%	0.03	0.03	0.02	0.01	0.01	0.00	-0.01
	0%	0.02	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.01	-0.02
	-2.67%	-0.02	-0.02	-0.03	-0.04	-0.04	-0.05	-0.06
	-5.33%	-0.06	-0.09	-0.09	-0.10	-0.11	-0.11	-0.12
	-8%	-0.17	-0.17	-0.16	-0.19	-0.19	-0.20	-0.20

최대 손실 시나리오

위험액	-0.20
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	0.08
-----	------

**[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

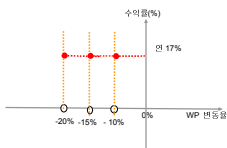
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

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

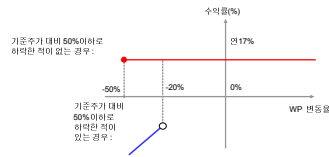
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 \* 117%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 수익구조**



**만기 시 수익구조**



**3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6562319W52 유가증권 (ELS)2415

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	4.46	3.70	2.94	2.18	1.43	0.67	-0.09
손익	5.33%	4.30	3.54	2.78	2.02	1.26	0.50	-0.26
시나리오	2.67%	3.57	2.81	2.05	1.29	0.54	-0.22	-0.98
	0%	2.28	1.52	0.76	0.00	-0.76	-1.52	-2.28
	-2.67%	0.42	-0.34	-1.10	-1.86	-2.62	-3.38	-4.14
	-5.33%	-2.01	-2.77	-3.53	-4.29	-5.05	-5.81	-6.57
	-8%	-5.00	-5.76	-6.52	-7.28	-8.04	-8.80	-9.56

**최대 손실 시나리오**

위험액	-9.56
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	7.43
-----	------

**[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호**

**1. 계약금액**

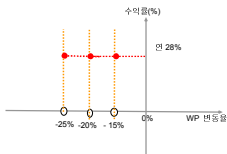
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	462.0	0	462.0	잔위

단위: (백만원)

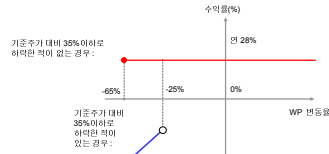
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	50.00	36.61	27.22	15.82	4.43	-6.96	-18.35
	5.33%	45.17	33.78	22.39	10.99	-0.40	-11.79	-23.18
	2.67%	39.90	28.50	17.11	5.72	-5.67	-17.06	-28.46
	0%	34.18	22.78	11.39	0.00	-11.89	-22.78	-34.18
	-2.67%	28.01	16.62	5.23	-5.17	-17.56	-28.95	-40.34
	-5.33%	21.40	10.01	-1.38	-12.78	-24.17	-35.56	-46.95
	-8%	14.34	2.95	-8.44	-19.83	-31.22	-42.62	-54.01

**최대 손실 시나리오**

위험액	-54.01
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)**

위험액	53.18
-----	-------



[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

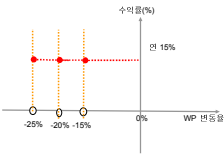
1. 계약금액

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

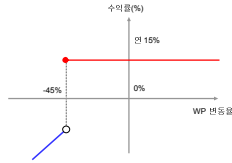
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.27	0.22	0.16	0.11	0.06	0.01	-0.04
	5.33%	0.26	0.21	0.15	0.10	0.05	0.00	-0.05
시나리오	2.67%	0.22	0.17	0.12	0.07	0.01	-0.04	-0.09
	0%	0.16	0.10	0.05	0.00	-0.05	-0.10	-0.15
	-2.67%	0.06	0.01	-0.04	-0.09	-0.14	-0.20	-0.25
	-5.33%	-0.06	-0.11	-0.17	-0.22	-0.27	-0.32	-0.37
	-8%	-0.21	-0.26	-0.32	-0.37	-0.42	-0.47	-0.52

최대 손실 시나리오

위험액	-0.52
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.43
-----	------

**[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호**

**1. 계약금액**

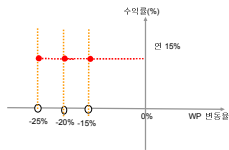
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위: (백만원)

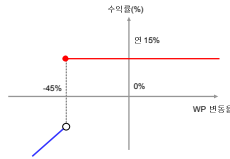
**2. 평가시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))**  
KR6652311W58 권위스마트(ELS)117

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	20.31	16.40	12.49	6.57	4.66	0.75	-3.17
	5.33%	19.61	15.69	11.78	7.87	3.96	0.04	-3.87
	2.67%	16.75	12.84	8.92	5.01	1.10	-2.81	-6.73
	0%	11.74	7.83	3.91	0.00	-3.91	-7.83	-11.74
	-2.67%	4.57	0.66	-3.25	-7.17	-11.08	-14.99	-18.90
-5.33%	-4.75	-8.66	-12.57	-16.48	-20.40	-24.31	-28.22	
-8%	-16.22	-20.13	-24.04	-27.96	-31.87	-35.78	-39.69	

**최대 손실 시나리오**

위험액	-39.69
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	33.02
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

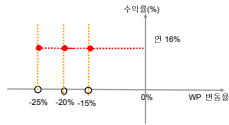
1. 계약금액

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

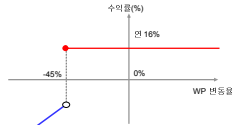
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우  
: 원금 \* 118%  
- 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%	0.71	0.57	0.44	0.30	0.17	0.04	-0.10
	5.33%	0.64	0.51	0.37	0.24	0.11	-0.03	-0.16
시나리오	2.67%	0.54	0.41	0.27	0.14	0.00	-0.13	-0.26
	0%	0.40	0.27	0.13	0.00	-0.13	-0.27	-0.40
	-2.67%	0.23	0.09	-0.04	-0.16	-0.31	-0.44	-0.56
	-5.33%	0.01	-0.12	-0.26	-0.39	-0.52	-0.66	-0.79
	-8%	-0.24	-0.37	-0.51	-0.64	-0.77	-0.91	-1.04

최대 손실 시나리오

위험액	-1.04
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.25
-----	------

**[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]**

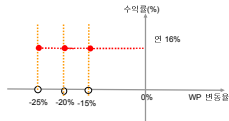
**1. 계약금액**

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

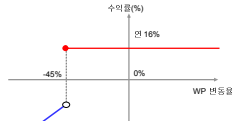
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우  
: 원금 \* 118%  
→ 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%	12.63	10.23	7.84	5.44	3.05	0.65	-1.74
손익	5.33%	11.48	9.09	6.69	4.30	1.90	-0.49	-2.89
시나리오	2.67%	9.67	7.27	4.86	2.46	0.09	-2.31	-4.70
	0%	7.16	4.75	2.35	0.00	-2.29	-4.79	-7.18
	-2.67%	4.03	1.64	-0.76	-3.15	-5.55	-7.94	-10.34
	-5.33%	0.22	-2.18	-4.57	-6.97	-9.38	-11.76	-14.15
	-8%	-4.27	-6.67	-9.06	-11.46	-13.85	-16.25	-18.64

**최대 손실 시나리오**

위험액	-18.64
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	22.43
-----	-------

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

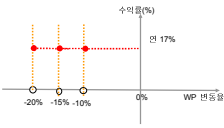
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

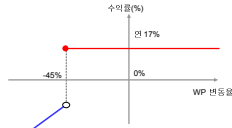
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



평가시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.26	3.01	1.76	0.52	-0.73	-1.98	-3.22
자산	5.33%	4.95	3.70	2.45	1.21	-0.04	-1.29	-2.53
시나리오	2.67%	4.77	3.53	2.28	1.03	-0.21	-1.46	-2.71
	0%	3.74	2.49	1.25	0.00	-1.26	-2.49	-3.74
	-2.67%	1.85	0.60	-0.65	-1.89	-3.14	-4.39	-5.63
	-5.33%	-0.90	-2.15	-3.40	-4.64	-5.89	-7.14	-8.38
	-8%	-4.52	-5.76	-7.01	-8.26	-9.50	-10.75	-12.00

최대 손실 시나리오

위험액	-12.00
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.85
-----	-------

**[94] 데리츠281a사모증권HCSV-1**

**1. 계약금액**

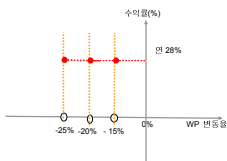
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위:백만원

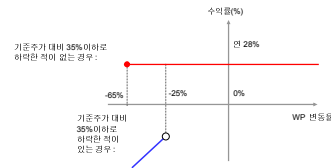
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	37.57	29.28	20.99	12.70	4.42	-3.87	-12.16
	5.33%	34.53	26.25	17.96	9.67	1.38	-6.91	-15.19
	2.67%	30.30	22.01	13.72	5.44	-2.85	-11.14	-19.43
	0%	24.86	16.58	8.29	0.00	-6.29	-16.58	-24.86
	-2.67%	18.23	9.94	1.65	-6.64	-14.92	-23.21	-31.50
-5.33%	10.39	2.10	-6.19	-14.46	-22.76	-31.05	-39.34	
-8%	1.35	-6.94	-15.23	-23.51	-31.80	-40.09	-48.38	

최대 손실 시나리오

위험액	-48.38
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	50.97
-----	-------

**[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호**

**1. 계약금액**

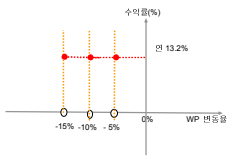
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위:백만원

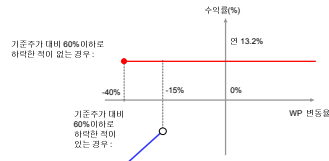
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 수익구조**



**만기 시 수익구조**



**3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)**

KR6621307W59 표본증권(ELS)341

**손익 구조표 및 시나리오**

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

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.06
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

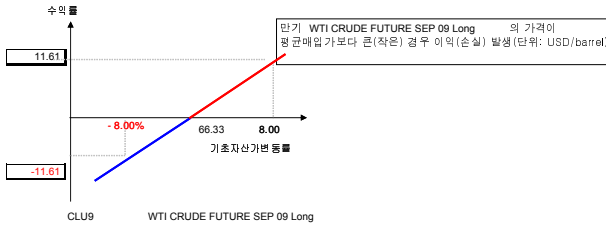
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유\_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



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

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	11.61
	5.33%	7.73
	2.67%	3.87
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.87
	-5.33%	-7.73
	-8%	-11.61

최대 손실 시나리오	
위험액	-11.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46
-----	----



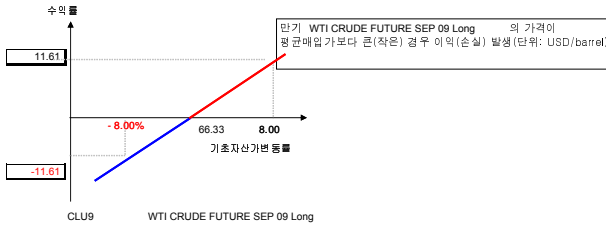
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

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	손실액
기초자산	8%	43.08
	5.33%	28.70
	2.67%	14.38
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-14.38
	-5.33%	-28.70
	-8%	-43.08

최대 손실 시나리오	
위험액	-43.08

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

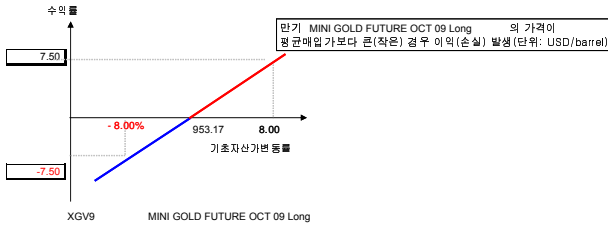
위험액	17.5
-----	------

[96-2] 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. 헷지시점의 손익 구조



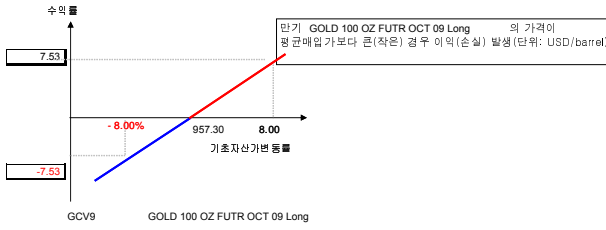
[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



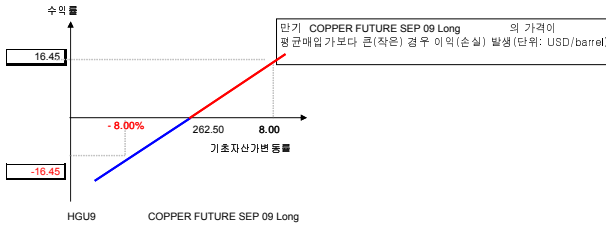
[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조

