

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

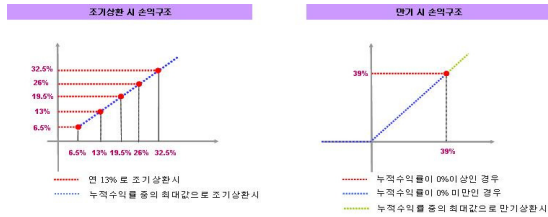
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 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%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
	5.33%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	2.67%	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	-5.33%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
-8%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.08
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

14) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자전략 4호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

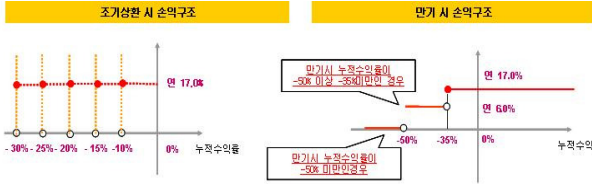
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.04
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자전략 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) 장기파생상품의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

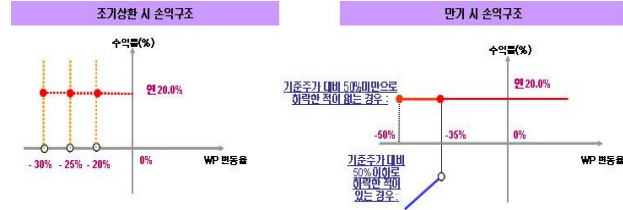
- 두 기초자산의 가격이 한방도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 원금 \* 140%

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

: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KRB0376207AD 이력작성종결(ELS)243

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9.71	8.86	8.01	7.16	6.31	5.46	4.62
	5.33%	7.60	6.75	5.90	5.05	4.20	3.36	2.51
	2.67%	5.21	4.36	3.51	2.67	1.82	0.97	0.12
	0%	2.55	1.70	0.85	0.00	-0.85	-1.70	-2.55
	-2.67%	-0.40	-1.25	-2.10	-2.95	-3.79	-4.64	-5.49
	-5.33%	-3.62	-4.47	-5.32	-6.17	-7.02	-7.87	-8.72
	-8%	-7.13	-7.98	-8.83	-9.67	-10.52	-11.37	-12.22

최대 손실 시나리오

위험액	-12.22
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	11.56
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자전략 25호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 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) 만큼 15.8%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600345TTB9 최대주주(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	13.75	12.93	12.10	11.28	10.45	9.63	8.81
손익	5.33%	10.00	9.18	8.35	7.53	6.71	5.88	5.06
손익	2.67%	6.24	5.42	4.60	3.77	2.95	2.12	1.30
손익	0%	2.47	1.65	0.82	0.00	-0.82	-1.65	-2.47
손익	-2.67%	-1.31	-2.14	-2.96	-3.78	-4.61	-5.43	-6.26
손익	-5.33%	-5.11	-5.93	-6.75	-7.58	-8.40	-9.23	-10.05
손익	-8%	-8.91	-9.74	-10.56	-11.39	-12.21	-13.03	-13.86

최대 손실 시나리오

위험액	-13.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.76
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 2월 22일

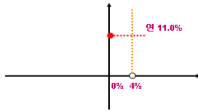
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

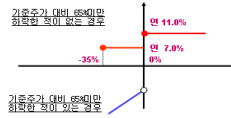
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 증도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 증도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이 상환 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 증도 상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 원본투자 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%  
 -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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 변동주권(ELS): 2007-3974

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	426.12	405.32	384.51	363.71	342.90	322.10	301.29
5.33%	303.64	282.84	262.03	241.23	220.42	199.62	178.81
2.67%	182.41	161.60	140.80	119.99	99.19	78.38	57.58
0%	62.42	41.61	20.81	0.00	-20.81	-41.61	-62.42
-2.67%	-56.33	-77.13	-97.94	-118.74	-139.55	-160.35	-181.16
-5.33%	-173.63	-194.63	-215.44	-236.24	-257.05	-277.85	-298.66
-8%	-290.08	-310.89	-331.69	-352.50	-373.30	-394.11	-414.91

최대 손실 시나리오

위험액	-414.91
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	408.34
-----	--------

**[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 수익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 2월 22일

3) 만드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

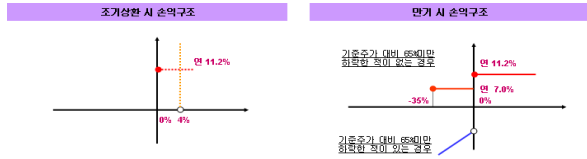
단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해제

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

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

: 원금 \* (만기기준지수/초기기준지수)

6) 만드의 수익구조



**3. 수익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR600345ST27 최대 손실 (ELS): 2007-3984

**수익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	41.01	39.02	37.03	35.04	33.05	31.06	29.07
시나리오	5.33%	29.20	27.21	25.22	23.23	21.24	19.25	17.26
	2.67%	17.52	15.53	13.54	11.55	9.56	7.57	5.58
	0%	5.97	3.98	1.99	0.00	-1.99	-3.98	-5.97
	-2.67%	-5.45	-7.44	-9.43	-11.42	-13.41	-15.40	-17.39
	-5.33%	-16.73	-18.72	-20.71	-22.70	-24.69	-26.68	-28.67
	-8%	-27.69	-29.68	-31.67	-33.66	-35.65	-37.64	-39.63

**최대 손실 시나리오**

위험액	-39.63
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	39.38
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

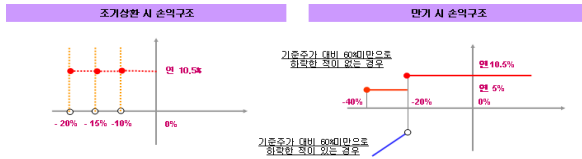
1. 계약금액

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(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600172YT43 신영증권(ELS)552

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	496.59	460.28	423.96	387.67	351.37	315.06	278.76
시나리오	5.33%	383.28	346.97	310.67	274.36	238.06	201.75	165.45
	2.67%	254.05	217.75	181.44	145.14	108.83	72.53	36.22
	0%	108.92	72.61	36.31	0.00	-36.31	-72.61	-108.92
	-2.67%	-52.14	-88.44	-124.75	-161.05	-197.36	-233.66	-269.97
	-5.33%	-229.10	-265.41	-301.71	-338.02	-374.32	-410.63	-446.93
	-8%	-421.98	-458.28	-494.59	-530.89	-567.20	-603.50	-639.81

최대 손실 시나리오

위험액	-639.81
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	610.66
-----	--------



[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

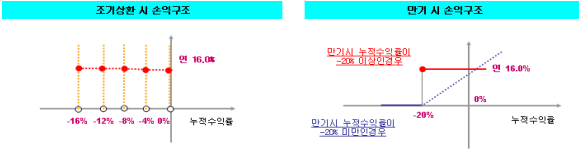
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 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%	0.59	0.45	0.31	0.17	0.03	-0.10	-0.24
	5.33%	0.58	0.45	0.31	0.17	0.03	-0.11	-0.25
	2.67%	0.53	0.39	0.25	0.11	-0.03	-0.17	-0.30
	0%	0.42	0.28	0.14	0.00	-0.14	-0.28	-0.42
	-2.67%	0.25	0.11	-0.03	-0.17	-0.30	-0.44	-0.58
	-5.33%	0.03	-0.11	-0.25	-0.38	-0.52	-0.66	-0.80
	-8%	-0.24	-0.38	-0.52	-0.66	-0.80	-0.93	-1.07

최대 손실 시나리오	
위험액	-1.07

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	6.06
-----	------

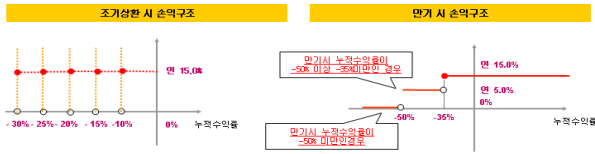
[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762C780 비례예상종형(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.62	1.19	0.75	0.31	-0.12	-0.56	-1.00
	5.33%	1.59	1.15	0.72	0.28	-0.16	-0.59	-1.03
	2.67%	1.48	1.05	0.61	0.18	-0.26	-0.70	-1.13
	0%	1.31	0.87	0.44	0.00	-0.44	-0.87	-1.31
	-2.67%	1.06	0.63	0.19	-0.25	-0.68	-1.12	-1.56
	-5.33%	0.74	0.31	-0.13	-0.57	-1.00	-1.44	-1.88
	-8%	0.35	-0.08	-0.52	-0.96	-1.39	-1.83	-2.27

최대 손실 시나리오

위험액 -2.27

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 2.14

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

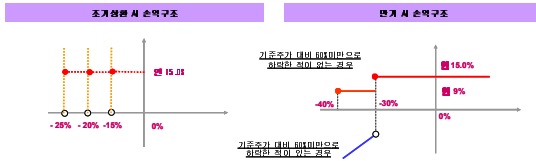
1. 계약금액

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

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, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 \* 118%  
- 두 기초자산의 가격(중중포함)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 시나리오	8%	227.56	223.75	219.94	216.13	212.32	208.51	204.70
	5.33%	165.29	161.48	157.67	153.86	150.05	146.24	142.43
	2.67%	93.25	89.44	85.63	81.82	78.01	74.20	70.39
	0%	11.43	7.62	3.81	0.00	-3.81	-7.62	-11.43
	-2.67%	-80.16	-83.97	-87.78	-91.59	-95.40	-99.21	-103.02
	-5.33%	-181.53	-185.34	-189.15	-192.96	-196.77	-200.58	-204.39
	-8%	-292.67	-296.48	-300.29	-304.10	-307.91	-311.72	-315.53

최대 손실 시나리오

위험액 -315.53

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 385.52

[13] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제12호

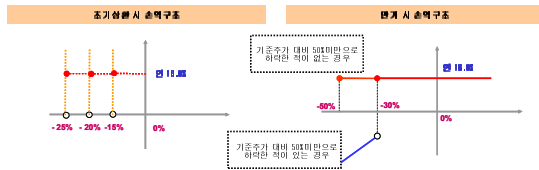
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 최(최대)손실가능금액(단위:백만원)

KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	130.23	125.64	121.05	116.46	111.86	107.27	102.68
	5.33%	89.37	84.78	80.19	75.60	71.01	66.41	61.82
	2.67%	50.56	45.96	41.37	36.78	32.19	27.59	23.00
	0%	13.78	9.18	4.59	0.00	-4.59	-9.18	-13.78
	-2.67%	-20.96	-25.55	-30.15	-34.74	-39.33	-43.92	-48.52
	-5.33%	-53.66	-58.25	-62.84	-67.44	-72.03	-76.62	-81.21
	-8%	-84.32	-88.91	-93.50	-98.10	-102.69	-107.28	-111.87

최대 손실 시나리오

위험액	-111.87
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	124.42
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

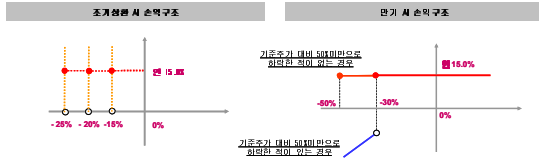
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 30일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 2일의 LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(LG필립스LCD, LG화학 보통주)의 중도상환가격이 넣은 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(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762B7B0 미래예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.48	5.21	4.94	4.67	4.40	4.13	3.86
	5.33%	4.06	3.78	3.51	3.24	2.97	2.70	2.43
	2.67%	2.50	2.23	1.96	1.69	1.41	1.14	0.87
	0%	0.81	0.54	0.27	0.00	-0.27	-0.54	-0.81
	-2.67%	-1.00	-1.27	-1.54	-1.81	-2.09	-2.36	-2.63
	-5.33%	-2.95	-3.22	-3.49	-3.76	-4.03	-4.30	-4.57
	-8%	-5.02	-5.29	-5.56	-5.83	-6.10	-6.37	-6.65

최대 손실 시나리오

위험액 -6.65

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 6.65

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

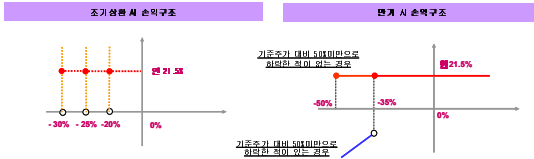
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345EV11 최대 손위(ELS)2008=647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	206.91	183.28	159.65	136.02	112.39	88.76	65.13
	5.33%	161.46	137.84	114.21	90.58	66.95	43.32	19.89
	2.67%	116.12	92.49	68.87	45.24	21.81	-2.02	-25.65
	0%	70.89	47.26	23.63	0.00	-23.63	-47.26	-70.89
	-2.67%	25.76	2.13	-21.50	-45.13	-68.76	-92.39	-116.02
	-5.33%	-19.27	-42.90	-66.53	-90.16	-113.79	-137.42	-161.05
	-8%	-64.19	-87.82	-111.45	-135.08	-158.71	-182.34	-205.97

최대 손실 시나리오  
위험액 -205.97

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 182.27

[16] 메리츠 주가지수연계 피생상품 제 1호

1. 계약금액

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

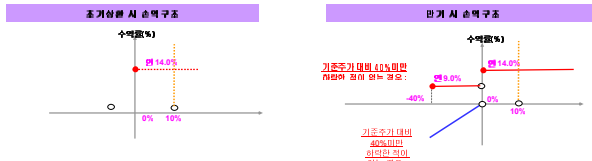
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수
- 2) 만기: 2010년 7월29일
- 3) 만도침산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도상환

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 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%
8%	531.50	509.32	487.15	464.97	442.80	420.63	398.45
5.33%	385.58	363.41	341.23	319.06	296.88	274.71	252.53
2.67%	230.59	208.41	186.24	164.07	141.89	119.72	97.54
0%	66.62	44.35	22.17	0.00	-22.17	-44.35	-66.62
-2.67%	-106.82	-129.19	-151.56	-173.94	-196.31	-217.49	-239.66
-5.33%	-288.83	-311.00	-333.18	-355.35	-377.53	-399.70	-421.88
-8%	-480.12	-502.29	-524.47	-546.64	-568.81	-590.99	-613.16

최대 손실 시나리오

위험액	-613.16
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	615.02
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위특성26호

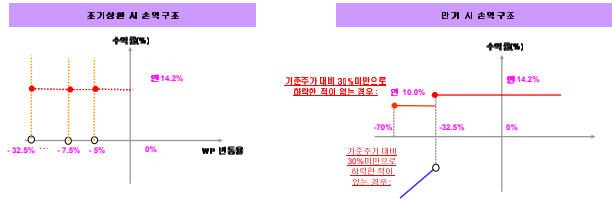
1. 계약금액

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600867BTB0 코무보신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	215.81	184.08	152.35	120.62	88.88	57.15	25.42
	5.33%	175.76	144.03	112.30	80.56	48.83	17.10	-14.63
	2.67%	135.55	103.82	72.09	40.36	8.63	-23.10	-54.84
	0%	95.19	63.46	31.73	0.00	-31.73	-63.46	-95.19
	-2.67%	54.68	22.95	-8.76	-40.51	-72.25	-103.98	-135.71
	-5.33%	14.01	-17.72	-49.45	-81.18	-112.91	-144.64	-176.38
	-8%	-26.81	-58.54	-90.27	-122.00	-153.73	-185.47	-217.20

최대 손실 시나리오

위험액 -217.20

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 216.60



[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

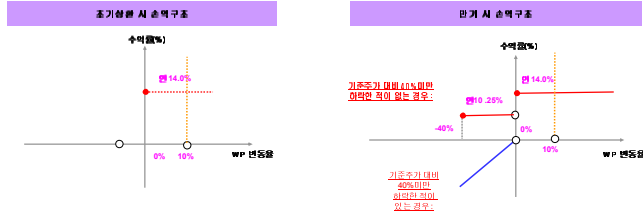
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

구분	손익 구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	100.34	94.33	88.32	82.31	76.30	70.29	64.28	
파생상품	72.36	66.35	60.34	54.33	48.32	42.31	36.30	
손익	44.93	38.92	32.91	26.90	20.89	14.88	8.87	
손익률	18.03	12.02	6.01	0.00	-6.01	-12.02	-18.03	
변동성	-8.33	-14.34	-20.35	-26.36	-32.37	-38.38	-44.39	
최대 손실	-34.15	-40.16	-46.17	-52.18	-58.19	-64.20	-70.21	
최소 손실	-59.44	-65.45	-71.46	-77.47	-83.48	-89.48	-95.49	

최대 손실 시나리오	
위험액	64.28

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	93.64
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서5호

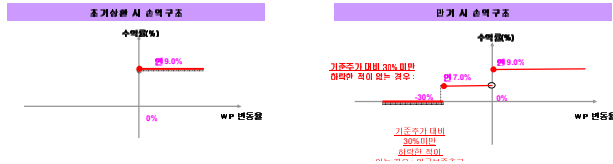
1. 계약금액

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

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 평가: 2011년 1월 24일
- 3) 펀드청산 결정일자: 매 6개월
- 4) 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, 평가시점에 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%	44.30	40.68	37.06	33.44	29.82	26.19	22.57
	5.33%	33.85	30.23	26.61	22.99	19.37	15.75	12.13
	2.67%	22.71	19.09	15.47	11.85	8.23	4.61	0.98
	0%	10.86	7.24	3.62	0.00	-3.62	-7.24	-10.86
	-2.67%	-1.89	-5.31	-8.93	-12.55	-16.17	-19.79	-23.41
	-5.33%	-14.93	-18.56	-22.18	-25.80	-29.42	-33.04	-36.66
-8%	-28.89	-32.51	-36.13	-39.75	-43.37	-46.99	-50.61	

최대 손실 시나리오

위험액	22.57
-----	-------

4. 파생상품의 최대 예상금액 (단위:백만원)

위험액	47.71
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼싱 6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 2월 21일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

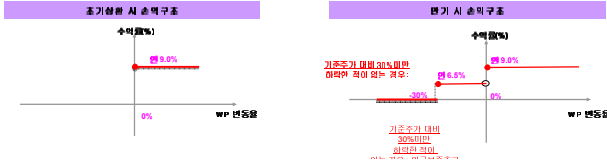
단, 평가시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금\*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 비례셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	89.72	86.84	83.97	81.09	78.22	75.34	72.47
	5.33%	58.91	56.03	53.16	50.28	47.41	44.53	41.66
	2.67%	31.88	29.00	26.13	23.25	20.38	17.50	14.63
	0%	8.63	5.75	2.88	0.00	-2.88	-5.75	-8.63
	-2.67%	-10.84	-13.72	-16.59	-19.47	-22.34	-25.22	-28.09
	-5.33%	-26.53	-29.41	-32.28	-35.16	-38.03	-40.91	-43.78
	-8%	-38.44	-41.31	-44.19	-47.06	-49.94	-52.81	-55.69

최대 손실 시나리오

위험액	72.47
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	35.71
-----	-------

[2] 메리츠주 수연계 사모단위파생7호

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) 만도형산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 종도상환 기 간을 설정하고,기 초자산(LG 보 통주, SK HOLDINGS 보 통주)의 종도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가액의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 종도상환함.

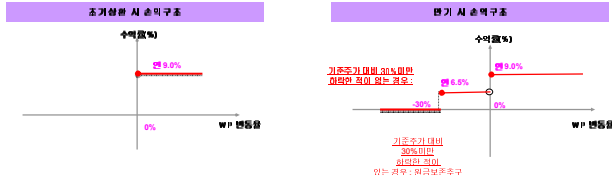
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가액이 만도도 기준가액의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기 준가액보다 작은 경우: 원금 \* 119.5%

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

: 원금\*100%

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래예정종결(ELS)317

손익 구조변동률 시나리오

구분		변동률 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초 자산	8%	69.78	67.55	65.31	63.07	60.84	58.60	56.37
	5.33%	45.82	43.58	41.34	39.11	36.87	34.64	32.40
시나리오	2.67%	24.79	22.56	20.32	18.08	15.85	13.61	11.38
	0%	6.71	4.47	2.24	0.00	-2.24	-4.47	-6.71
	-2.67%	-8.43	-10.67	-12.91	-15.14	-17.38	-19.61	-21.85
	-5.33%	-20.64	-22.87	-25.11	-27.34	-29.58	-31.82	-34.05
	-8%	-29.90	-32.13	-34.37	-36.60	-38.84	-41.08	-43.31

최대 손실 시나리오

위험액	56.37
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	27.77
-----	-------

[23] 메리츠증권 증권계사모과정1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 평가대상상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 평가: 2010년 08월 04일

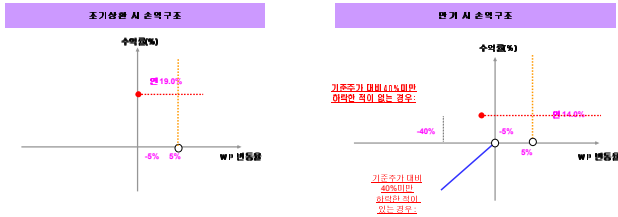
3) 펀드청산결정주기: 매 3개월

4) 기준지수: 2008년 8월 7일 NIKKEI225, HSCEI 지수의 증가

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

- 단, 평가시 까지 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한방도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 \* 138%
- 두 기초자산의 가격(상환포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (평가기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	135.67	126.36	117.05	107.74	98.42	89.11	79.80
	5.33%	100.23	90.92	81.61	72.29	62.98	53.67	44.36
	2.67%	64.32	55.01	45.69	36.38	27.07	17.76	8.45
	0%	27.94	18.62	9.31	0.00	-9.31	-18.62	-27.94
	-2.67%	-8.92	-18.23	-27.54	-36.85	-46.16	-55.48	-64.79
	-5.33%	-46.24	-55.55	-64.86	-74.18	-83.49	-92.80	-102.11
	-8%	-84.04	-93.35	-102.66	-111.97	-121.28	-130.59	-139.91

최대 손실 시나리오

위험액	-139.91
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	138.54
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품SEPO-1호

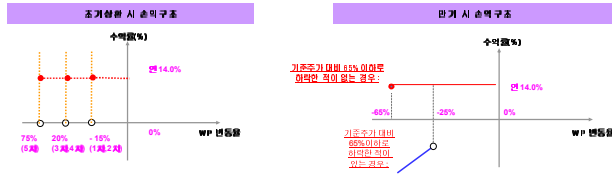
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산:삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011 년 08월 26일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도 상환 기 간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격 의85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세 번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 14.0%의 수익률로 중도 상환이 됨. 단, 만기시 까지 조기 상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 확정
  - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의48%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준 가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 14.2%
  - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 45%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백 만원))

KR6522907WR2 보유증권(ELS)2723

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-6.36	-6.38	-6.39	-6.41	-6.42	-6.44	-6.46
	5.33%	-2.80	-2.82	-2.83	-2.85	-2.87	-2.88	-2.90
	2.67%	-0.67	-0.68	-0.70	-0.71	-0.73	-0.75	-0.76
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.03	-0.05
	-2.67%	-0.66	-0.68	-0.69	-0.71	-0.72	-0.74	-0.75
	-5.33%	-2.79	-2.80	-2.82	-2.84	-2.85	-2.87	-2.88
	-8%	-6.34	-6.35	-6.37	-6.39	-6.40	-6.42	-6.43

최대 손실 시나리오

위험액 -6.43

4. 파생 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액 0.34

[25] 테라즈 주가지수연계사모펀생상품 제 1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

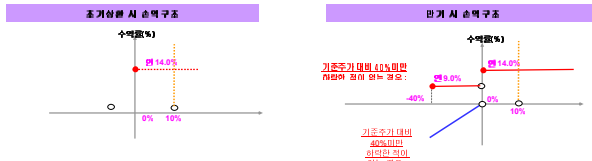
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	651.42	624.24	597.07	569.89	542.71	515.53	488.36
	5.33%	472.58	445.40	418.23	391.05	363.87	336.69	309.51
	2.67%	282.62	255.44	228.26	201.08	173.91	146.73	119.55
	0%	81.53	54.36	27.18	0.00	-27.18	-54.36	-81.53
	-2.67%	-130.67	-157.85	-185.03	-212.21	-239.38	-266.56	-293.74
	-5.33%	-354.00	-381.18	-408.35	-435.53	-462.71	-489.89	-517.07
	-8%	-588.45	-615.63	-642.80	-669.98	-697.16	-724.34	-751.51

최대 손실 시나리오

위험액 -751.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 753.79

[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

2) 만기: 2010년 09월 30일

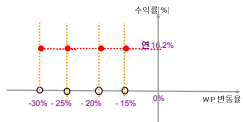
3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

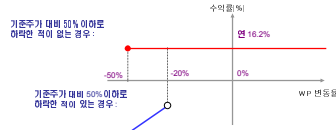
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 삼성화재)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일), 70%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연달아 16.2%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시점까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익특성 추이대로 처리
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6612302/A7 - 매신증권(ELS)713

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.49	-0.50	-0.52	-0.54	-0.56	-0.58	-0.60
	5.33%	-0.12	-0.14	-0.16	-0.18	-0.19	-0.21	-0.23
	2.67%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.01	-0.03	-0.05
	0%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
	-2.67%	-0.13	-0.15	-0.17	-0.19	-0.21	-0.23	-0.24
	-5.33%	-0.51	-0.52	-0.54	-0.56	-0.58	-0.60	-0.62
	-8%	-1.06	-1.08	-1.10	-1.12	-1.14	-1.16	-1.17

최대손실 시나리오

위험액 -1.17

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 1.25



[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

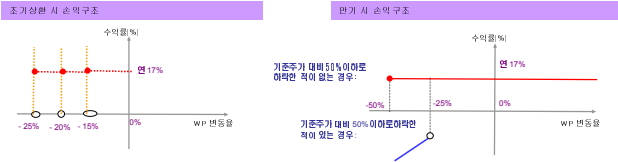
2) 만기: 2011년 09월 23일

3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

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

- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.  
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 151.0%  
 - 두 기초자산의 가액(장중보합)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조인출(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6572345/91 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	3.17	1.77	0.37	-1.03	-2.43	-3.83	-5.23
	5.33%	5.81	4.41	3.01	1.61	0.21	-1.19	-2.59
	2.67%	6.15	4.75	3.35	1.95	0.55	-0.85	-2.25
	0%	4.20	2.80	1.40	0.00	-1.40	-2.80	-4.20
	-2.67%	-0.04	-1.44	-2.84	-4.24	-5.64	-7.04	-8.44
	-5.33%	-6.58	-7.98	-9.38	-10.78	-12.18	-13.58	-14.98
	-8%	-15.40	-16.80	-18.20	-19.60	-21.00	-22.41	-23.81

최대 손실 시나리오

위험액 -23.81

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액 32.93

**[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호**

**1. 계약금액**

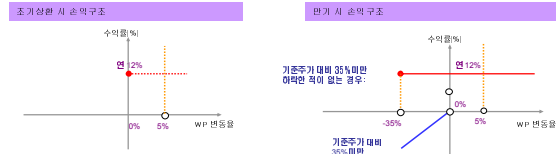
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

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
-----	------

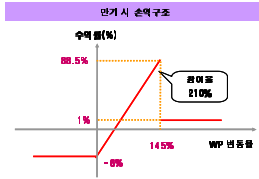
**[34] 대리 조주가지 수연계 파생13**

**1. 계약금액**

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

**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 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우  
: 원금 \* ( 94% + 210% \* ( 만기기준지수/최초기준지수 - 1 ) )
  - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우  
: 원금 \* 94%
- 6) 펀드의 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-48.22	-56.50	-64.76	-73.06	-81.35	-89.63	-97.91
	5.33%	-21.33	-29.61	-37.90	-46.18	-54.46	-62.74	-71.02
	2.67%	3.02	-5.26	-13.54	-21.82	-30.10	-38.38	-46.66
	0%	24.84	16.56	8.28	0.00	-8.28	-16.56	-24.84
	-2.67%	44.13	35.85	27.57	19.29	11.01	2.73	-5.55
	-5.33%	60.89	52.61	44.33	36.04	27.76	19.48	11.20
	-8%	75.11	66.83	58.55	50.27	41.99	33.71	25.42

최대 손실 시나리오

위험액	25.42
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	89.53
-----	-------

**[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호**

**1. 계약금액**

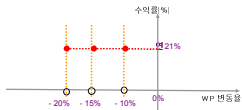
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

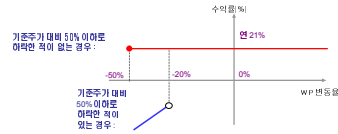
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9.55	8.11	6.66	5.22	3.77	2.33	0.89
	5.33%	8.39	6.95	5.50	4.06	2.61	1.17	-0.28
	2.67%	6.65	5.21	3.76	2.32	0.87	-0.57	-2.02
	0%	4.33	2.89	1.44	0.00	-1.44	-2.89	-4.33
	-2.67%	1.44	-0.00	-1.45	-2.89	-4.34	-5.78	-7.23
	-5.33%	-2.03	-3.48	-4.92	-6.36	-7.81	-9.25	-10.70
	-8%	-6.08	-7.52	-8.97	-10.41	-11.86	-13.30	-14.75

최대 손실 시나리오

위험액 -14.75

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액 17.15

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

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

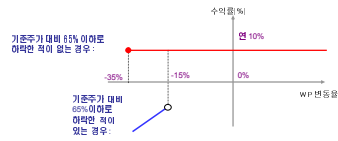
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 17일
- 3) 만도침산 결정 주기: 매3개월
- 4) 기 존지 수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 0.0%의 수익률로 중도상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 만도 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가액의 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) 만도의 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

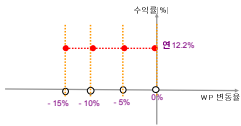
**1. 계약금액**

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

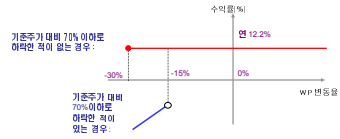
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교**  
 KR600690MMV7 대우증권ELS2697

1. 계약금액

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

단위(백만원)

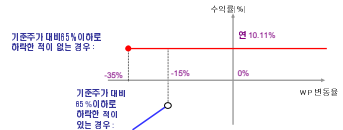
2. 연가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 14일
- 3) 펀드형산 결정주기: 매4개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기준지수(기준)로 각각 최초 기준가격의 95% 이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90% 이상인 경우(두번째 중도상환일), 85% 이상인 경우(세번째 중도상환일) 만월 10.11%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 → 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 85% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우  
 : 원금 \* 110.11%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



**[80-4] 매리츠투자지수연계사모증권2.-4**  
 KR6008678V51 롯데당 신안증권(ELS)890

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

연율11%의 수익률로 중도상환이 됨.

단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 만도침지

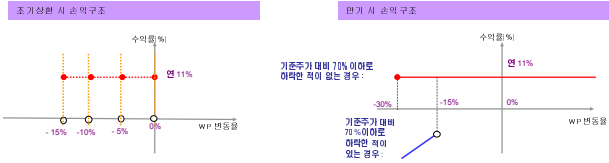
- 두 기준자산의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 \* 111%

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

: 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조





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

1. 계약금액

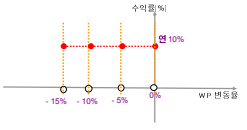
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

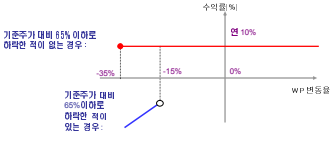
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 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 (장종료합) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수 / 최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**[80-6] 메리츠투자지수형계사로증권2호**  
 KR600867AV62 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

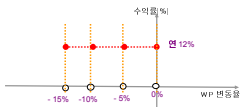
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

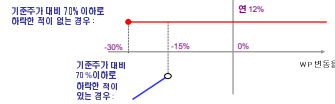
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

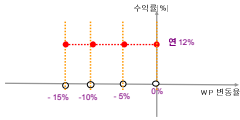
**1. 계약금액**

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

**2. 평가시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**1. 계약금액**

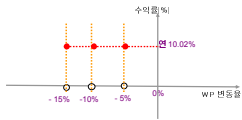
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위(백만원)

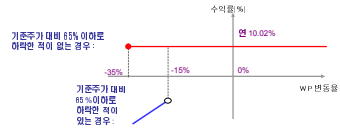
**2. 평가시점의 손익구조**

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

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**1. 계약금액**

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

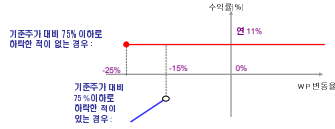
**2. 평가시점의 손익구조**

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

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



[60-10] **메리츠주가지수연계사로증권2호**

1. **계약금액**

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

단위(백만원)

2. **연기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

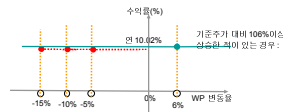
2) 만기: 2011년 5월 27일

3) 만드침산 결정주기: 매 4개월

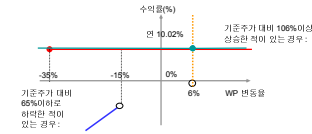
4) 기준지수: 2000년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가

- 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 한반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 20.04%
  - 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHC-2

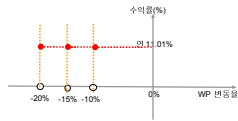
1. 계약금액

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

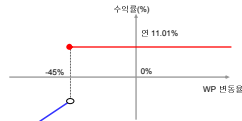
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 만기: 2012년 4월 12일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차지수의 증가
- 실행 후 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 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 \* 111.01%  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.00	-0.03	-0.05	-0.07	-0.09	-0.12	-0.14
	5.33%	0.06	0.03	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.08
	2.67%	0.08	0.06	0.04	0.01	-0.01	-0.03	-0.05
	0%	0.07	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.07
	-2.67%	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.07	-0.10	-0.12
	-5.33%	-0.08	-0.10	-0.12	-0.14	-0.16	-0.19	-0.21
-8%	-0.20	-0.23	-0.25	-0.27	-0.29	-0.31	-0.34	

최대 손실 시나리오

위험액 -0.34

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.47

[62] 테리츠2Star사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

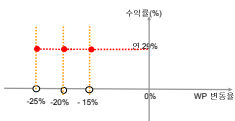
구분	거래대상	거래유형	약수(1)	약도(2)	순투자금(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위(백만원)

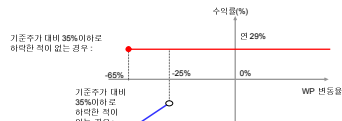
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 만드청산 결제주기: 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 한편도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 12.5%  
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	7.52	6.46	5.41	4.35	3.30	2.24	1.19
손익	5.33%	8.01	6.95	5.90	4.84	3.79	2.73	1.68
손익	2.67%	6.56	5.50	4.45	3.39	2.34	1.28	0.23
손익	0%	3.16	2.11	1.05	0.00	-1.05	-2.11	-3.16
손익	-2.67%	-2.17	-3.23	-4.28	-5.34	-6.39	-7.45	-8.50
손익	-5.33%	-9.45	-10.51	-11.56	-12.62	-13.67	-14.73	-15.78
손익	-8%	-18.68	-19.73	-20.79	-21.84	-22.89	-23.95	-25.00

최대 손실 시나리오

위험액	-25.00
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	17.18
-----	-------



[66] 테리츠2Star사모증권LEHC-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차

2) 만기: 2012년 4월 12일

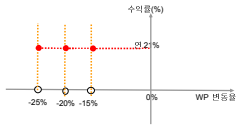
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

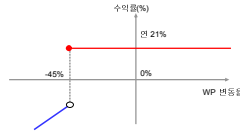
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보충주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 21%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))  
 KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.01	-0.06	-0.11	-0.16	-0.21	-0.26	-0.30
	5.33%	0.13	0.08	0.03	-0.02	-0.07	-0.12	-0.17
	2.67%	0.18	0.13	0.08	0.03	-0.02	-0.07	-0.12
손익 구조변동 시나리오	0%	0.15	0.10	0.05	0.00	-0.05	-0.10	-0.15
	-2.67%	0.03	-0.02	-0.07	-0.12	-0.16	-0.21	-0.26
	-5.33%	-0.17	-0.22	-0.27	-0.31	-0.36	-0.41	-0.46
	-8%	-0.45	-0.50	-0.55	-0.60	-0.65	-0.70	-0.75

최대 손실 시나리오

위험액	-0.75
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.04
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

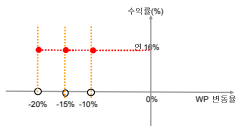
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

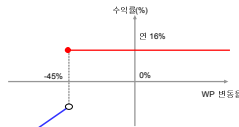
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 + 11.6%  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

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%	3.20	2.60	2.00	1.40	0.80	0.19	-0.41
시나리오	5.33%	3.40	2.80	2.20	1.59	0.99	0.39	-0.21
	2.67%	2.93	2.33	1.73	1.13	0.53	-0.07	-0.68
	0%	1.80	1.20	0.60	0.00	-0.60	-1.20	-1.80
	-2.67%	0.01	-0.59	-1.19	-1.79	-2.39	-2.99	-3.60
	-5.33%	-2.44	-3.04	-3.64	-4.25	-4.85	-5.45	-6.05
	-8%	-5.56	-6.16	-6.76	-7.36	-7.96	-8.56	-9.17

최대 손실 시나리오

위험액	-9.17
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.09
-----	------

[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) 장의피생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

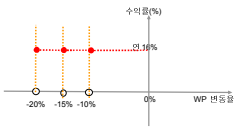
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

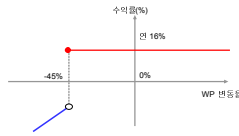
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 + 11.6%  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 주권투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.19	0.16	0.12	0.08	0.05	0.01	-0.02
	5.33%	0.20	0.17	0.13	0.10	0.06	0.02	-0.01
	2.67%	0.18	0.14	0.10	0.07	0.03	-0.00	-0.04
	0%	0.11	0.07	0.04	0.00	-0.04	-0.07	-0.11
	-2.67%	0.00	-0.04	-0.07	-0.11	-0.14	-0.18	-0.21
	-5.33%	-0.15	-0.18	-0.22	-0.25	-0.29	-0.33	-0.36
	-8%	-0.33	-0.37	-0.40	-0.44	-0.48	-0.51	-0.55

최대 손실 시나리오

위험액	-0.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.54
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

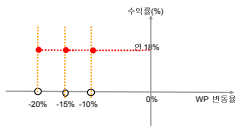
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

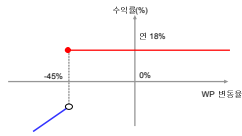
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	13.27	9.51	5.75	1.99	-1.77	-5.53	-9.29
시나리오	5.33%	14.96	11.20	7.44	3.68	-0.08	-3.84	-7.60
	2.67%	14.30	10.54	6.78	3.02	-0.75	-4.51	-8.27
	0%	11.28	7.52	3.76	0.00	-3.76	-7.52	-11.28
	-2.67%	5.92	2.15	-1.61	-5.37	-9.13	-12.89	-16.65
	-5.33%	-1.80	-5.56	-9.33	-13.09	-16.85	-20.61	-24.37
	-8%	-11.87	-15.64	-19.40	-23.16	-26.92	-30.68	-34.44

최대 손실 시나리오

위험액	-34.44
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.19
-----	-------

**[68] 테리츠2Star사모증권SET-4호**

**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

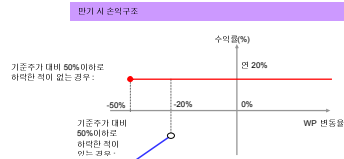
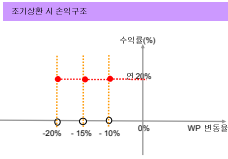
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

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

6) 원도의 수익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

구분	손익 구조변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	4.46	3.37	2.29	1.20	0.11	-0.97	-2.06
	5.33%	5.22	4.14	3.05	1.96	0.88	-0.21	-1.29
	2.67%	4.62	3.74	2.65	1.56	0.48	-0.61	-1.69
	0%	3.26	2.17	1.09	0.00	-1.09	-2.17	-3.26
	-2.67%	0.53	-0.55	-1.64	-2.73	-3.81	-4.90	-5.98
	-5.33%	-3.36	-4.44	-5.53	-6.62	-7.70	-8.79	-9.87
	-8%	-6.41	-9.50	-10.58	-11.67	-12.76	-13.84	-14.93

**최대 손실 시나리오**

위험액	-14.93
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	16.20
-----	-------

[76] 데리츠2Star사로 SEST-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드칭산 결정주기: 매6개월

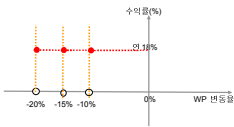
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

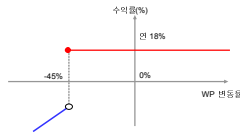
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 + 11.8%  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동 (최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	7.30	5.23	3.16	1.09	-0.97	-3.04	-5.11
시나리오	5.33%	8.23	6.16	4.09	2.02	-0.05	-2.11	-4.18
	2.67%	7.67	5.60	3.73	1.66	-0.41	-2.48	-4.55
	0%	6.21	4.14	2.07	0.00	-2.07	-4.14	-6.21
	-2.67%	3.25	1.19	-0.86	-2.95	-5.02	-7.09	-9.16
	-5.33%	-0.99	-3.06	-5.13	-7.20	-9.27	-11.34	-13.41
	-8%	-6.53	-8.60	-10.67	-12.74	-14.81	-16.88	-18.95

최대 손실 시나리오

위험액	-16.95
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.05
-----	-------

[77] 테리츠2Star사로 SEST-3

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 29일

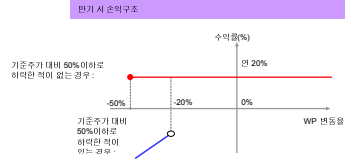
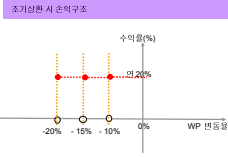
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

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

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.26	3.37	2.48	1.58	0.69	-0.20	-1.10
시나리오	5.33%	4.42	3.53	2.63	1.74	0.85	-0.05	-0.94
	2.67%	3.89	3.00	2.11	1.21	0.32	-0.57	-1.47
	0%	2.68	1.79	0.89	0.00	-0.69	-1.79	-2.68
	-2.67%	0.78	-0.11	-1.00	-1.90	-2.79	-3.68	-4.58
	-5.33%	-1.80	-2.69	-3.59	-4.48	-5.37	-6.27	-7.16
	-8%	-5.06	-5.96	-6.85	-7.74	-8.64	-9.53	-10.43

최대 손실 시나리오

위험액	-10.43
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.98
-----	------

[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

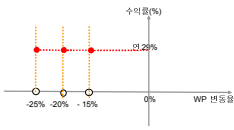
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

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

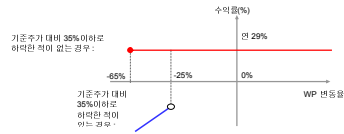
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12%
  - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	6.54	5.62	4.71	3.79	2.87	1.95	1.03
시나리오	5.33%	6.97	6.05	5.14	4.22	3.30	2.38	1.46
	2.67%	5.71	4.79	3.87	2.95	2.04	1.12	0.20
	0%	2.75	1.84	0.92	0.00	-0.92	-1.84	-2.75
	-2.67%	-1.89	-2.81	-3.73	-4.65	-5.56	-6.48	-7.40
	-5.33%	-8.23	-9.15	-10.07	-10.98	-11.90	-12.82	-13.74
	-8%	-16.26	-17.18	-18.10	-19.01	-19.93	-20.85	-21.77

최대 손실 시나리오

위험액	-21.77
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.95
-----	-------



[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

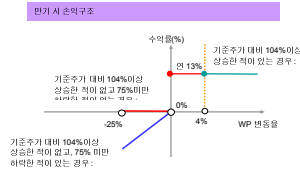
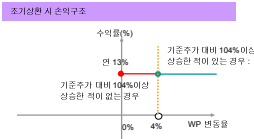
1. 계약금액

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



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모6호

손익구조변동률 시나리오

구분	변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	9,363.20	8,727.84	8,092.49	7,457.13	6,821.77	6,186.42	5,551.06
시나리오	5.33%	6,865.75	6,230.39	5,595.04	4,959.68	4,324.32	3,688.97	3,053.61
	2.67%	4,380.04	3,744.68	3,109.33	2,473.97	1,838.61	1,203.26	567.90
	0%	1,906.07	1,270.71	635.36	0.00	-635.36	-1,270.71	-1,906.07
	-2.67%	-556.16	-1,191.52	-1,826.67	-2,462.23	-3,097.59	-3,732.94	-4,368.30
	-5.33%	-3,006.65	-3,642.01	-4,277.36	-4,912.72	-5,548.07	-6,183.43	-6,818.79
	-8%	-5,445.40	-6,080.76	-6,716.11	-7,351.47	-7,986.82	-8,622.18	-9,257.53

최대 손실 시나리오

위험액	-9,257.53
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,260.72
-----	----------

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

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

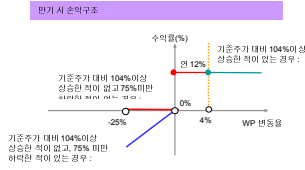
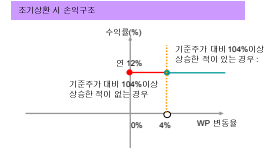
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우

: 원금 \* 11.2%

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

: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6030613TB2      교보증권(ELS)82

**[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호**

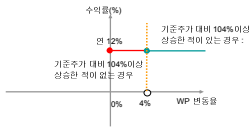
**1. 계약금액**

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

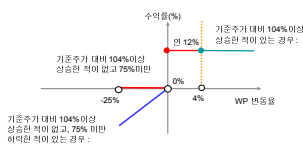
**2. 만기시점의 수익구조**

- 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

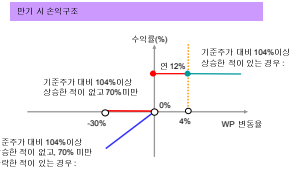
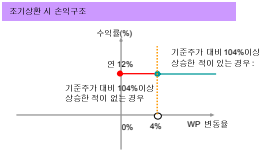
단위(백만원)

**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	잔액

단위: (백만원)

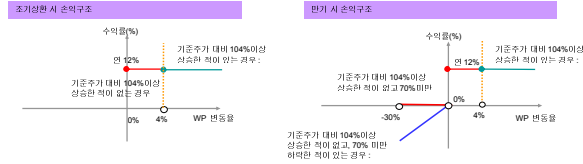
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 10일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

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

**6) 펀드의 수익구조**



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

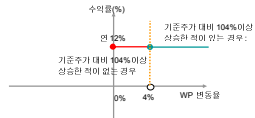
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정점에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

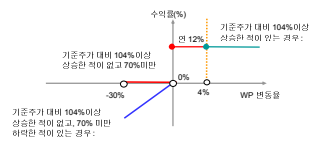
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
: 원금 \* 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6000867CTB8      굿모닝 신한증권(ELS)804

**[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

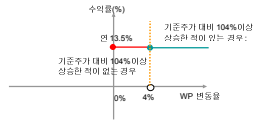
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위(백만원)

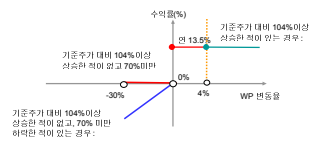
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 15일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 19일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기일을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한반이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환
  - 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
    - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
      - : 원금 \* 113.5%
    - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
      - : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR60008675TC7      굿모닝 신한증권(ELS)809

**[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

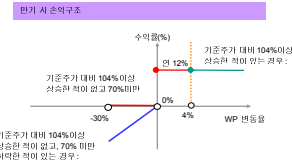
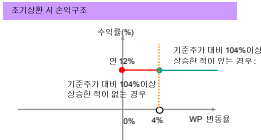
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
통화	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

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 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 월기기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
- 두 기초자산의 가격이 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
    - : 원금 \* 11.2%
  - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 한나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
    - : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438



**[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 08일

3) 만트청산 결정주기: 매3개월

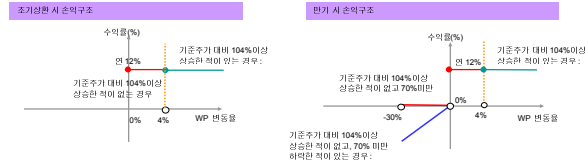
4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

6) 만트의 수익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

**[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

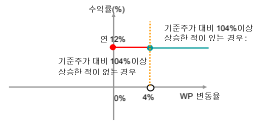
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

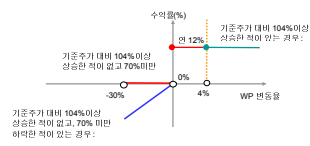
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 13일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

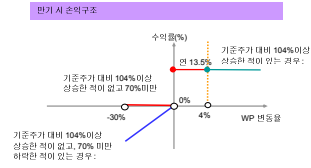
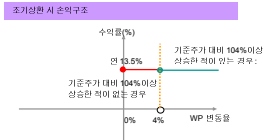
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매3개월마다 증도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 증도포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 증도상환

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

- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
: 원금 \* 113.5%
- 두 기초자산의 가격(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)

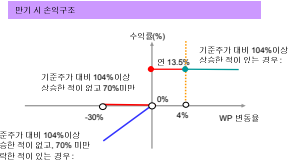
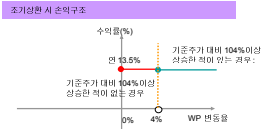
**2. 만기시점의 손익구조**

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

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

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

**6) 펀드의 수익구조**



KR600594TTC0 우리투자증권 (ELS)1535

**[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호**

**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

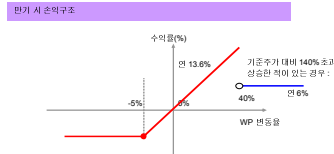
1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우  
 - 만기평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우  
   : 원금 \* ( 95% + 100% \* ( 만기기준지수/최초기준지수 - 1 ) )  
 - 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우  
   : 원금 \* 95%
- 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우  
   : 원금 \* 108%
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액)(단위:백만원)**

KR6523317W30 대우증권ELS2881

구분	손익 구조변동률 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.82	-1.72	-2.62	-3.52	-4.42	-5.32	-6.22
시나리오	5.33%	0.54	-0.35	-1.25	-2.15	-3.05	-3.95	-4.85
	2.67%	1.72	0.82	-0.06	-0.96	-1.86	-2.76	-3.66
	0%	2.70	1.80	0.90	0.00	-0.90	-1.80	-2.70
	-2.67%	3.49	2.59	1.69	0.79	-0.11	-1.01	-1.91
	-5.33%	4.09	3.19	2.29	1.39	0.49	-0.41	-1.31
	-8%	4.51	3.61	2.71	1.81	0.91	0.01	-0.89

최대 손실 시나리오

위험액	-0.89
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	6.47
-----	------

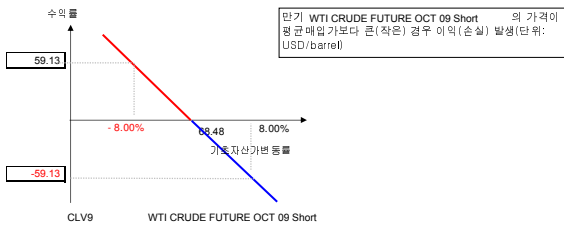
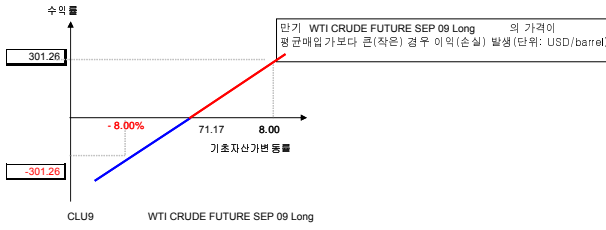
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

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

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8%	242.12
	5.33%	161.32
	2.67%	80.81
	0%	0.00
	-2.67%	-80.81
	-5.33%	-161.32
	-8%	-242.12

최대손실 시나리오	
위험액	-242.12

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,460
-----	-------

[78] 데리 조주가지 수연계사모증권I6IE

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

2) 연가: 2010년 5월 28일

3) 펀드청산 결정주기: 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, 만기시 잔치 조가 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

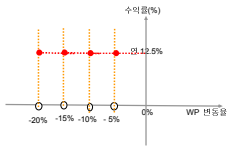
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우

: 원금 \* 112.5%

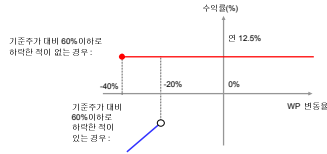
- 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우

: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

조가상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6523310W80 대우증권ELS3005

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	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	0.00
-8%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01

최대 손실 시나리오

위험액	0.01
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

**[79] 데리츠주가지 수연계사모증권!61E**

**1. 계약금액**

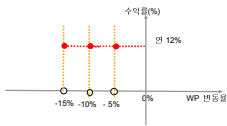
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위:백만원

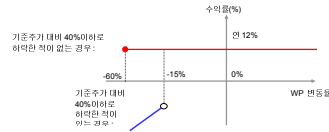
**2. 연가시점의 손익구조**

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**  
KR6503305W69 코모닝 신한동원권(ELS)1039

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-5.20	-5.59	-5.96	-6.37	-6.76	-7.14	-7.53
	5.33%	-0.61	-1.00	-1.39	-1.78	-2.17	-2.56	-2.95
시나리오	2.67%	1.51	1.12	0.73	0.34	-0.05	-0.44	-0.83
	0%	1.17	0.78	0.39	0.00	-0.39	-0.78	-1.17
	-2.67%	-1.84	-2.03	-2.42	-2.80	-3.19	-3.58	-3.97
	-5.33%	-6.90	-7.29	-7.68	-8.07	-8.46	-8.85	-9.24
	-8%	-14.64	-15.02	-15.41	-15.80	-16.19	-16.58	-16.97

**최대 손실 시나리오**

위험액	-16.97
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	9.83
-----	------



**[80] 대리주주가지수연계사모증권10호**

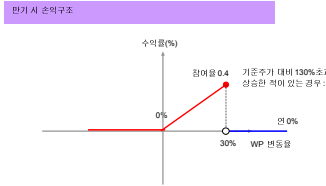
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기 : 2010년 5월 07일
- 3) 펀드형산 결정주기 : 만기일 가일 1회
- 4) 기준지수 : 2009년 5월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
  - 만기평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 130% 미만일 경우
    - : 원금 \* {100% + 40% \* 1 만기기준지수/최초기준지수 - 1}
    - : 원금 \* 100%
  - 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
    - : 원금 \* 100%
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))**

KR6673105W54 - 금융증권-채피플러스(ELS)91

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	5.33%	0.15	-1.87	-3.90	-5.92	-7.94	-9.96	-11.98
손익	2.67%	3.29	1.26	-0.76	-2.78	-4.80	-6.82	-8.85
시나리오	0%	6.07	4.04	2.02	0.00	-2.02	-4.04	-6.07
	-2.67%	8.49	6.47	4.44	2.42	0.40	-1.62	-3.64
	-5.33%	10.55	8.53	6.51	4.49	2.46	0.44	-1.58
	-8%	12.26	10.23	8.21	6.19	4.17	2.15	0.12

**최대 손실 시나리오**

위험액	0.12
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	15.13
-----	-------

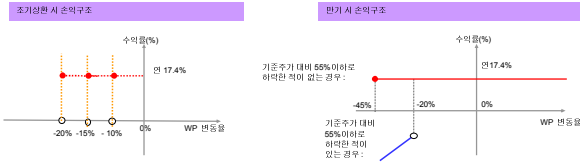
**[82] 데리츠2Star사모증권SE-ST-8호**

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 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(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	5.07	4.39	3.71	3.03	2.35	1.67	0.99
손실	5.33%	4.73	4.05	3.37	2.69	2.01	1.33	0.65
시나리오	2.67%	3.72	3.04	2.36	1.68	1.00	0.32	-0.36
	0%	2.04	1.36	0.68	0.00	-0.68	-1.36	-2.04
	-2.67%	-0.31	-0.99	-1.67	-2.35	-3.03	-3.71	-4.39
	-5.33%	-3.32	-4.00	-4.68	-5.36	-6.04	-6.72	-7.40
	-8%	-7.01	-7.69	-8.37	-9.05	-9.73	-10.41	-11.09

**최대 손실 시나리오**

위험액	-11.09
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	11.00
-----	-------

**[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호**

**1. 계약금액**

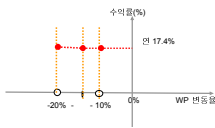
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위:백만원

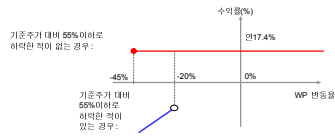
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 주가의 중도상환가액이 낮은 기초자산) 기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률을 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의55%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 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익 구조별 손(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**  
KR652233W57 (대우증권(ELS)2976)

**손익 구조별 손 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	32.55	28.18	23.81	19.44	15.08	10.71	6.34
손	5.33%	30.37	26.00	21.63	17.26	12.89	8.52	4.15
시나리오	2.67%	23.89	19.52	15.15	10.78	6.41	2.04	-2.33
	0%	13.11	8.74	4.37	0.00	-4.37	-8.74	-13.11
	-2.67%	-1.97	-6.34	-10.71	-15.08	-19.45	-23.82	-28.19
	-5.33%	-21.35	-25.72	-30.09	-34.46	-38.83	-43.20	-47.57
	-8%	-45.03	-49.40	-53.77	-58.14	-62.51	-66.88	-71.25

최대 손실 시나리오

위험액	-71.25
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	70.68
-----	-------

[84] 데리츠2SIa사모증권SEPO-2호

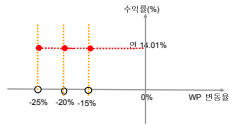
1. 계약금액

단위: (백만원)						
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

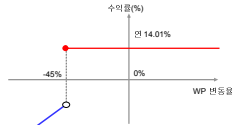
2. 만기시점의 손익구조

- 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 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백 만원))  
KR6662305W64 - 한화스마트(ELS)132

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.04	-0.10	-0.16	-0.22	-0.28	-0.34	-0.39
	5.33%	0.18	0.13	0.07	0.01	-0.05	-0.11	-0.16
시나리오	2.67%	0.26	0.20	0.14	0.08	0.02	-0.03	-0.09
	0%	0.17	0.12	0.06	0.00	-0.06	-0.12	-0.17
	-2.67%	-0.06	-0.12	-0.18	-0.24	-0.30	-0.35	-0.41
	-5.33%	-0.46	-0.52	-0.57	-0.63	-0.69	-0.75	-0.81
	-8%	-1.01	-1.07	-1.12	-1.18	-1.24	-1.30	-1.36

최대 손실 시나리오

위험액	-1.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백 만원)

위험액	1.80
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

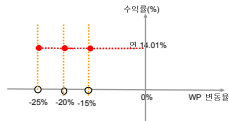
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

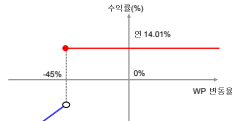
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.16	-0.37	-0.56	-0.79	-1.00	-1.21	-1.42
손익	5.33%	0.66	0.45	0.24	0.03	-0.18	-0.39	-0.60
시나리오	2.67%	0.93	0.72	0.51	0.30	0.09	-0.12	-0.33
	0%	0.63	0.42	0.21	0.00	-0.21	-0.42	-0.63
	-2.67%	-0.23	-0.44	-0.65	-0.86	-1.07	-1.28	-1.49
	-5.33%	-1.65	-1.86	-2.07	-2.28	-2.49	-2.70	-2.91
	-8%	-3.64	-3.85	-4.06	-4.27	-4.48	-4.69	-4.90

최대 손실 시나리오

위험액	-4.90
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.50
-----	------

**[86] 데리츠2Star사로증권SELE-1호**

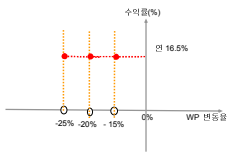
**1. 계약금액**

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

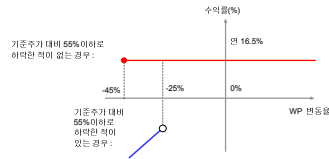
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, LG전자 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 22일 삼성전자 보통주, LG전자 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, LG전자 보통주 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 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
→ 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 \* 116.5%  
→ 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조표 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6662321W56 환위스마트(ELS)127

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	-0.09	-0.09	-0.09	-0.10	-0.10	-0.10	-0.11
	5.33%	-0.02	-0.03	-0.03	-0.03	-0.04	-0.04	-0.04
	2.67%	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.01
	0%	0.01	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.01	-0.01
	-2.67%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.03	-0.03	-0.04
	-5.33%	-0.07	-0.08	-0.08	-0.08	-0.09	-0.09	-0.09
	-8%	-0.16	-0.17	-0.17	-0.17	-0.18	-0.18	-0.18

최대 손실 시나리오

위험액	-0.18
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.23
-----	------

**[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. 평가시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

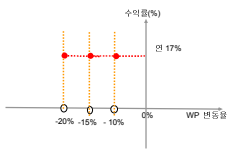
5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 \* 117%

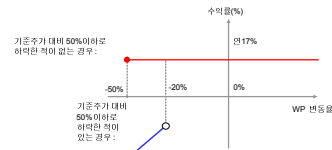
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 수익구조**



**만기 시 수익구조**



**3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)**

KR6562319W52 유가증권 (ELS)2415

**손익 구조표인 톱 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	5.94	5.03	4.11	3.20	2.29	1.38	0.47
손익	5.33%	5.41	4.50	3.59	2.67	1.76	0.85	-0.06
손익	2.67%	4.34	3.43	2.52	1.61	0.69	-0.22	-1.13
손익	0%	2.76	1.82	0.91	0.00	-0.91	-1.82	-2.76
손익	-2.67%	0.59	-0.32	-1.23	-2.15	-3.06	-3.97	-4.88
손익	-5.33%	-2.09	-3.01	-3.92	-4.83	-5.74	-6.65	-7.56
손익	-8%	-5.32	-6.23	-7.14	-8.05	-8.96	-9.88	-10.79

**최대 손실 시나리오**

위험액	-10.79
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	10.21
-----	-------

**[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호**

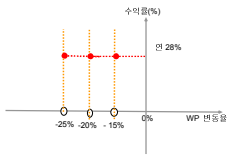
**1. 계약금액**

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

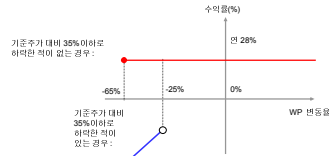
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	5.33%	47.40	35.48	23.55	11.63	-0.29	-12.21	-24.13
손익	2.67%	41.80	29.88	17.95	6.03	-5.89	-17.81	-29.73
시나리오	0%	35.77	23.84	11.92	0.00	-11.92	-23.84	-35.77
	-2.67%	29.30	17.38	5.46	-5.46	-13.39	-30.31	-42.23
	-5.33%	22.40	10.48	-1.44	-13.36	-25.28	-37.20	-49.13
	-8%	15.08	3.16	-8.77	-20.69	-32.61	-44.63	-56.45

**최대 손실 시나리오**

위험액	-56.45
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	58.93
-----	-------



[89] 데리츠2Star사로 증권POLE-2호

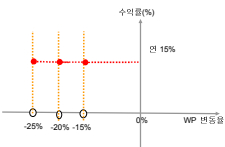
1. 계약금액

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

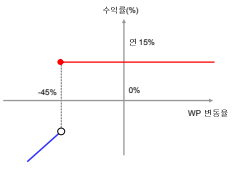
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.25	0.20	0.16	0.11	0.07	0.02	-0.02
손익	5.33%	0.24	0.19	0.15	0.10	0.06	0.01	-0.03
시나리오	2.67%	0.20	0.15	0.11	0.06	0.02	-0.03	-0.07
	0%	0.13	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.09	-0.13
	-2.67%	0.04	-0.00	-0.05	-0.09	-0.14	-0.18	-0.22
	-5.33%	-0.07	-0.12	-0.16	-0.21	-0.25	-0.30	-0.34
	-8%	-0.22	-0.26	-0.31	-0.35	-0.40	-0.44	-0.49

최대 손실 시나리오

위험액	-0.49
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.78
-----	------

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

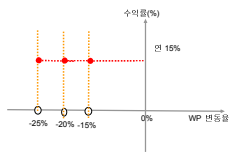
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위:백만원

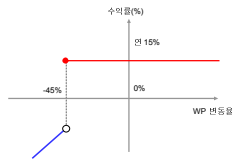
2. 평가시점의 손익구조

- 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) 만일 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



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6652311W58 권위스펀드(ELS)117

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	18.66	15.26	11.86	6.46	9.06	1.66	-1.74
손익	5.33%	17.88	14.48	11.08	7.68	4.28	0.88	-2.52
시나리오	2.67%	15.06	11.66	8.26	4.86	1.46	-1.94	-5.34
	0%	10.20	6.80	3.40	0.00	-3.40	-6.80	-10.20
	-2.67%	3.30	-0.10	-3.50	-6.90	-10.30	-13.70	-17.10
	-5.33%	-5.84	-9.04	-12.44	-15.84	-19.24	-22.64	-26.04
	-8%	-16.82	-20.02	-23.42	-26.82	-30.22	-33.62	-37.02

최대 손실 시나리오

위험액	-37.02
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	59.08
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

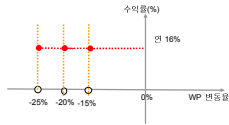
1. 계약금액

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

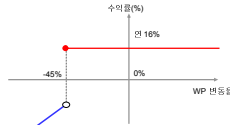
2. 만기시점의 손익구조

- 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 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산의 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우  
: 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 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.63	0.50	0.37	0.25	0.12	-0.01	-0.14
	5.33%	0.59	0.46	0.33	0.21	0.08	-0.05	-0.18
시나리오	2.67%	0.51	0.38	0.25	0.12	-0.00	-0.13	-0.26
	0%	0.38	0.26	0.13	0.00	-0.13	-0.26	-0.39
	-2.67%	0.22	0.09	-0.04	-0.16	-0.29	-0.42	-0.55
	-5.33%	0.01	-0.11	-0.24	-0.37	-0.50	-0.63	-0.75
	-8%	-0.23	-0.36	-0.49	-0.62	-0.75	-0.87	-1.00

최대 손실 시나리오

위험액	-1.00
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.94
-----	------

**[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]**

**1. 계약금액**

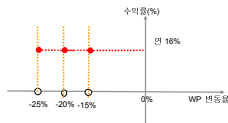
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

단위:백만원

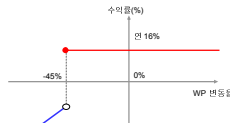
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 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 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우  
 : 평균 \* 118%  
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우  
 : 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 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%	11.27	6.98	6.69	4.40	2.11	-0.18	-2.47
	5.33%	10.55	8.25	5.96	3.67	1.38	-0.91	-3.20
시나리오	2.67%	9.08	6.79	4.50	2.21	-0.09	-2.38	-4.67
	0%	6.87	4.58	2.29	0.00	-2.29	-4.58	-6.87
	-2.67%	3.93	1.64	-0.65	-2.94	-5.24	-7.53	-9.82
	-5.33%	0.25	-2.04	-4.34	-6.63	-8.92	-11.21	-13.50
	-8%	-4.17	-6.47	-8.76	-11.05	-13.34	-15.63	-17.92

**최대 손실 시나리오**

위험액	-17.92
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	16.78
-----	-------

[93] 데리츠2SIr사모증권LEHC-3

1. 계약금액

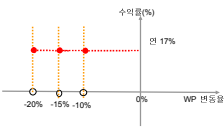
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

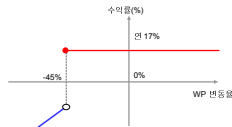
2. 평가시점의 손익구조

- 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 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 \* 117%  
 - 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (평가기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



평가시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	5.64	4.39	3.14	1.90	0.65	-0.60	-1.85
시나리오	5.33%	5.65	4.40	3.15	1.90	0.65	-0.59	-1.84
	2.67%	5.01	3.77	2.52	1.27	0.02	-1.23	-2.47
	0%	3.74	2.50	1.25	0.00	-1.25	-2.50	-3.74
	-2.67%	1.84	0.59	-0.66	-1.91	-3.16	-4.40	-5.65
	-5.33%	-0.71	-1.96	-3.21	-4.46	-5.70	-6.95	-8.20
	-8%	-3.89	-5.14	-6.39	-7.64	-8.89	-10.13	-11.38

최대 손실 시나리오

위험액	-11.38
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	12.36
-----	-------

**[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1**

**1. 계약금액**

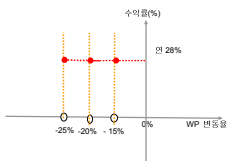
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위:백만원

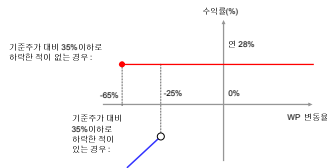
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	5.33%	43.13	33.11	23.09	13.07	3.06	-6.96	-16.98
시나리오	2.67%	37.03	27.01	17.00	6.98	-3.04	-13.06	-23.08
0%	30.05	20.04	10.02	0.00	-10.02	-20.04	-30.05	
-2.67%	22.20	12.18	2.16	-7.98	-17.88	-27.89	-37.91	
-5.33%	13.46	3.44	-6.56	-16.60	-26.61	-36.63	-46.65	
-8%	3.84	-6.18	-16.20	-26.21	-36.23	-46.25	-56.27	

최대 손실 시나리오

위험액	-56.27
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	63.18
-----	-------

**[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호**

**1. 계약금액**

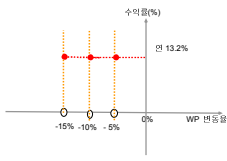
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위:백만원

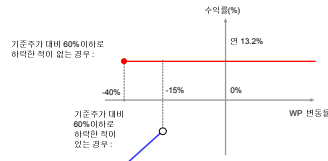
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

**손익 구조표별 시나리오**

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

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.06
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

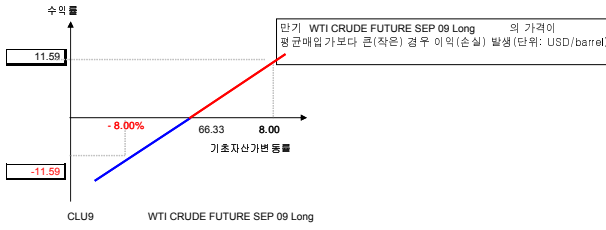
위험액	0.08
-----	------

[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유\_파생형]모

1. 계약금액

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

2. 연기시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

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

최대손실 시나리오	
위험액	-11.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46
-----	----



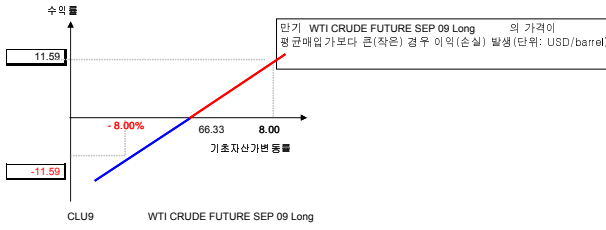
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



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

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 Long

구분	시나리오	손실액
기초자산	8%	44.10
	5.33%	29.38
	2.67%	14.72
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-14.72
	-5.33%	-29.38
	-8%	-44.10

최대 손실 시나리오	
위험액	-44.10

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

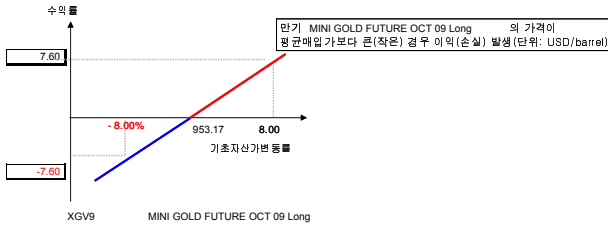
위험액	179
-----	-----

[96-2] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 헷지시점의 손익 구조

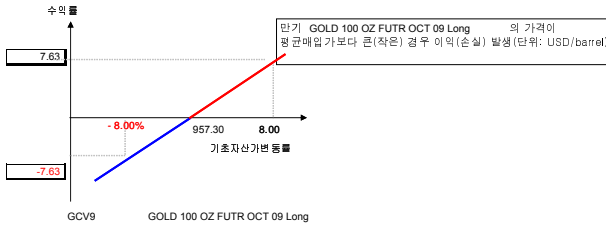


[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조

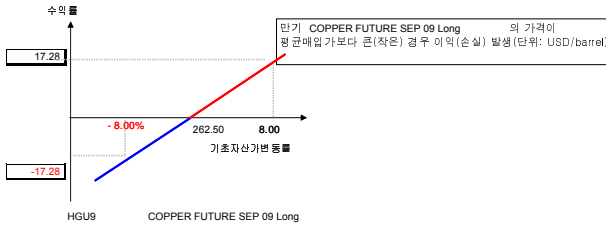


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조

