

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

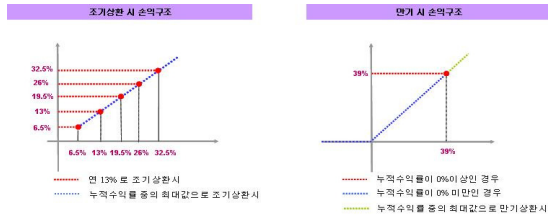
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.06 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

| | | | | | | | 단위(백만원) | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|---------|--|
| 구분 | 기래대상 | 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 만 15.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률에 단순합계)

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 0.19 | 0.18 | 0.16 | 0.14 | 0.12 | 0.11 | 0.09 |
| | 5.33% | 0.14 | 0.13 | 0.11 | 0.09 | 0.07 | 0.06 | 0.04 |
| 시나리오 | 2.67% | 0.10 | 0.08 | 0.06 | 0.04 | 0.03 | 0.01 | -0.01 |
| | 0% | 0.05 | 0.03 | 0.02 | 0.00 | -0.02 | -0.03 | -0.05 |
| | -2.67% | 0.01 | -0.01 | -0.02 | -0.04 | -0.06 | -0.08 | -0.09 |
| | -5.33% | -0.03 | -0.04 | -0.06 | -0.08 | -0.10 | -0.11 | -0.13 |
| | -8% | -0.06 | -0.08 | -0.10 | -0.11 | -0.13 | -0.15 | -0.16 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.16 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.41 |
|-----|------|

4) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자전략 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.02 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[5]에리츠 StepDown 사모단위파생상품투자신탁 24호

1. 계약금액

| | | 단위(백만원) | | | | |
|----|------|---------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 611 | 0 | 611 | 잔액 |

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

: 할금 * 140%

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

: 할금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KRB0376207AD 이력정보증권(ELS)243

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 9.27 | 8.51 | 7.75 | 6.98 | 6.22 | 5.46 | 4.69 |
| | 5.33% | 7.22 | 6.46 | 5.69 | 4.93 | 4.17 | 3.40 | 2.64 |
| | 2.67% | 4.89 | 4.13 | 3.37 | 2.60 | 1.84 | 1.08 | 0.31 |
| | 0% | 2.29 | 1.53 | 0.76 | 0.00 | -0.76 | -1.53 | -2.29 |
| | -2.67% | -0.59 | -1.35 | -2.11 | -2.88 | -3.64 | -4.40 | -5.17 |
| | -5.33% | -3.74 | -4.50 | -5.27 | -6.03 | -6.79 | -7.56 | -8.32 |
| | -8% | -7.17 | -7.93 | -8.69 | -9.46 | -10.22 | -10.98 | -11.75 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -11.75 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 11.60 |
|-----|-------|

[6]에리츠 StepDown 사모펀위 과정상용투자신탁 25호

1. 계약금액

| 구분 | | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순투자액(1-2) | 비고 |
|----|------|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | | 305 | -2745 | 3,050 | 상위 |

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 투신증권업 보통주, SK에너지 보통주

2) 평가: 2009년 11월 12일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(투신증권업 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(평가상환일) 연율 15.8%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345TTB9 펀드 운용(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 14.07 | 13.28 | 12.43 | 11.61 | 10.79 | 9.97 | 9.15 |
| 손익 | 5.33% | 10.19 | 9.37 | 8.55 | 7.73 | 6.91 | 6.09 | 5.27 |
| 손익 | 2.67% | 6.32 | 5.50 | 4.68 | 3.86 | 3.04 | 2.22 | 1.40 |
| 손익 | 0% | 2.46 | 1.64 | 0.82 | 0.00 | -0.82 | -1.64 | -2.46 |
| 손익 | -2.67% | -1.39 | -2.21 | -3.03 | -3.85 | -4.68 | -5.50 | -6.32 |
| 손익 | -5.33% | -5.24 | -6.06 | -6.88 | -7.70 | -8.52 | -9.34 | -10.16 |
| 손익 | -8% | -9.08 | -9.90 | -10.72 | -11.54 | -12.36 | -13.18 | -14.00 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -14.00 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 13.04 |
|-----|-------|

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

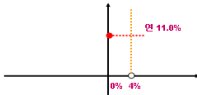
| 구분 | 기래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 7,471 | 0 | 7,471 | 잔의 |

단위(백만원)

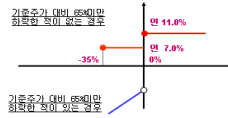
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 비파생상품(ELS) 2007-397세

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 459.63 | 437.39 | 415.14 | 392.89 | 370.65 | 348.40 | 326.16 |
| 손익 | 5.33% | 326.84 | 304.59 | 282.35 | 260.10 | 237.86 | 215.61 | 193.37 |
| 손익 | 2.67% | 195.87 | 173.63 | 151.38 | 129.14 | 106.89 | 84.65 | 62.40 |
| 손익 | 0% | 66.74 | 44.49 | 22.25 | 0.00 | -22.25 | -44.49 | -66.74 |
| 손익 | -2.67% | -60.57 | -82.82 | -105.06 | -127.31 | -149.56 | -171.80 | -194.05 |
| 손익 | -5.33% | -186.06 | -208.30 | -230.55 | -252.79 | -275.04 | -297.28 | -319.53 |
| 손익 | -8% | -309.71 | -331.96 | -354.20 | -376.45 | -398.69 | -420.94 | -443.19 |

최대 손실 시나리오

위험액 -443.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 438.22

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

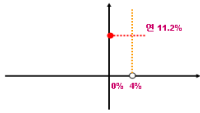
- 두 기초자산의 가격이 만드 기준가격의 65%초과 하락한적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 121%

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

: 원금 * (만기기준지수/초기기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345ST27 최대 손실 (ELS): 2007-3984

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|-----------|--------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 44.41 | 42.26 | 40.11 | 37.95 | 35.80 | 33.65 | 31.50 |
| | 5.33% | 31.57 | 29.42 | 27.26 | 25.11 | 22.96 | 20.81 | 18.66 |
| | 2.67% | 18.91 | 16.76 | 14.61 | 12.46 | 10.31 | 8.16 | 6.01 |
| | 0% | 6.45 | 4.30 | 2.15 | 0.00 | -2.15 | -4.30 | -6.45 |
| | -2.67% | -5.82 | -7.97 | -10.12 | -12.27 | -14.42 | -16.57 | -18.72 |
| | -5.33% | -17.89 | -20.05 | -22.20 | -24.35 | -26.50 | -28.65 | -30.80 |
| | -8% | -29.78 | -31.93 | -34.08 | -36.24 | -38.39 | -40.54 | -42.69 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -42.69 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 42.38 |
|-----|-------|

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

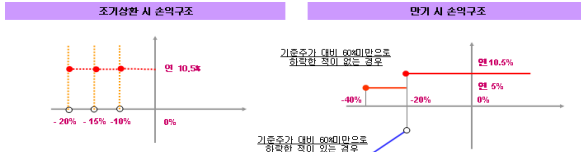
1. 계약금액

| 구분 | 기래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,658 | 0 | 5,658 | 잔위 |

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 04월 19일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 4월 20일 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(3번째, 4번째 중도상환일), 80%이상인 경우(5번째 중도상환일, 만기상환일) 연율 10.5%의 수익률로 중도상환이 됨.
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 확정
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 115%
- 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR600172YT43 신영증권(ELS)552

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 458.07 | 423.11 | 388.14 | 353.18 | 318.22 | 283.26 | 248.30 |
| 시나리오 | 5.33% | 358.49 | 323.53 | 288.57 | 253.61 | 218.65 | 183.69 | 148.72 |
| | 2.67% | 240.76 | 205.80 | 170.84 | 135.88 | 100.92 | 65.96 | 31.00 |
| | 0% | 104.88 | 69.92 | 34.96 | 0.00 | -34.96 | -69.92 | -104.88 |
| | -2.67% | -49.15 | -84.11 | -119.07 | -154.03 | -188.99 | -223.96 | -258.92 |
| | -5.33% | -221.34 | -256.30 | -291.26 | -326.22 | -361.18 | -396.14 | -431.10 |
| | -8% | -411.67 | -446.64 | -481.60 | -516.56 | -551.52 | -586.48 | -621.44 |
| | 최대 손실 시나리오 | 위험액 | -621.44 | | | | | |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 602.12 |
|-----|--------|

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

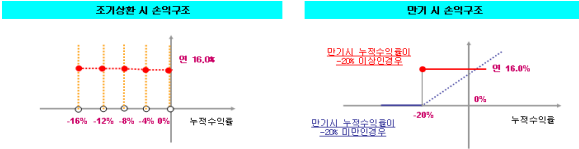
1. 계약금액

| 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

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



3. 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 | 8% | 2.00 | 1.98 | 1.95 | 1.93 | 1.90 | 1.88 | 1.86 |
| 시나리오 | 5.33% | 1.28 | 1.25 | 1.23 | 1.20 | 1.18 | 1.16 | 1.13 |
| | 2.67% | 0.63 | 0.61 | 0.59 | 0.56 | 0.54 | 0.51 | 0.49 |
| | 0% | 0.07 | 0.05 | 0.02 | 0.00 | -0.02 | -0.05 | -0.07 |
| | -2.67% | -0.41 | -0.43 | -0.46 | -0.48 | -0.51 | -0.53 | -0.55 |
| | -5.33% | -0.81 | -0.84 | -0.86 | -0.88 | -0.91 | -0.93 | -0.95 |
| | -8% | -1.13 | -1.16 | -1.18 | -1.20 | -1.23 | -1.25 | -1.28 |

| | |
|------------|-------|
| 최대 손실 시나리오 | |
| 위험액 | -1.28 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

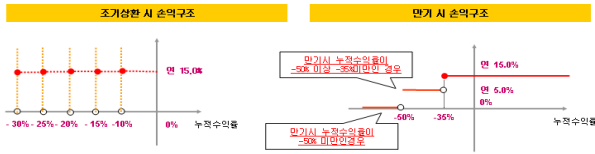
[11] 메리츠 글러벳 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762C780

비례예상종형(ELS)191

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 1.72 | 1.25 | 0.77 | 0.29 | -0.18 | -0.66 | -1.14 |
| | 5.33% | 1.71 | 1.23 | 0.75 | 0.28 | -0.20 | -0.68 | -1.15 |
| | 2.67% | 1.61 | 1.13 | 0.65 | 0.18 | -0.30 | -0.78 | -1.25 |
| | 0% | 1.43 | 0.95 | 0.48 | 0.00 | -0.48 | -0.95 | -1.43 |
| | -2.67% | 1.17 | 0.70 | 0.22 | -0.26 | -0.73 | -1.21 | -1.69 |
| | -5.33% | 0.84 | 0.36 | -0.12 | -0.59 | -1.07 | -1.55 | -2.02 |
| | -8% | 0.42 | -0.05 | -0.53 | -1.01 | -1.48 | -1.96 | -2.44 |

최대 손실 시나리오

위험액 -2.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 2.88

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

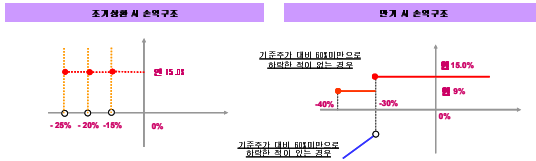
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762L197 미래예상증권(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 214.38 | 210.65 | 206.92 | 203.19 | 199.46 | 195.73 | 191.99 |
| 시나리오 | 5.33% | 158.56 | 154.83 | 151.10 | 147.37 | 143.64 | 139.91 | 136.18 |
| | 2.67% | 90.83 | 87.10 | 83.37 | 79.64 | 75.91 | 72.18 | 68.45 |
| | 0% | 11.19 | 7.46 | 3.73 | 0.00 | -3.73 | -7.46 | -11.19 |
| | -2.67% | -80.36 | -84.09 | -87.82 | -91.55 | -95.28 | -99.01 | -102.74 |
| | -5.33% | -183.82 | -187.55 | -191.28 | -195.01 | -198.74 | -202.47 | -206.20 |
| | -8% | -299.20 | -302.93 | -306.66 | -310.39 | -314.12 | -317.85 | -321.58 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -321.68 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 337.33 |
|-----|--------|

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

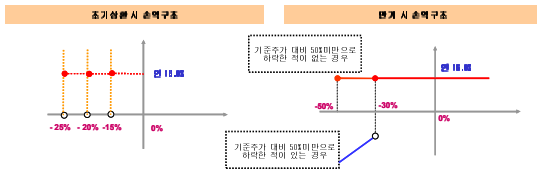
1. 계약금액

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조범용 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 130.18 | 125.72 | 121.26 | 116.80 | 112.34 | 107.88 | 103.41 |
| | 5.33% | 89.13 | 84.67 | 80.21 | 75.75 | 71.29 | 66.82 | 62.36 |
| | 2.67% | 50.20 | 45.74 | 41.28 | 36.81 | 32.35 | 27.89 | 23.43 |
| | 0% | 13.38 | 8.92 | 4.46 | 0.00 | -4.46 | -8.92 | -13.38 |
| | -2.67% | -21.31 | -25.77 | -30.23 | -34.69 | -39.16 | -43.62 | -48.08 |
| 손익 | -5.33% | -53.89 | -58.35 | -62.81 | -67.27 | -71.73 | -76.19 | -80.65 |
| | -8% | -84.34 | -88.80 | -93.26 | -97.73 | -102.19 | -106.65 | -111.11 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -111.11 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 117.64 |
|-----|--------|

[14] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제13호

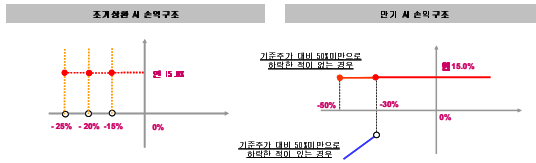
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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

KR603762BT80 비례예상증권(ELS)240

손익 구조범위 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 5.75 | 5.48 | 5.21 | 4.94 | 4.66 | 4.39 | 4.12 |
| | 5.33% | 4.22 | 3.94 | 3.67 | 3.40 | 3.13 | 2.85 | 2.58 |
| | 2.67% | 2.57 | 2.30 | 2.03 | 1.75 | 1.48 | 1.21 | 0.93 |
| | 0% | 0.82 | 0.55 | 0.27 | 0.00 | -0.27 | -0.55 | -0.82 |
| | -2.67% | -1.04 | -1.31 | -1.59 | -1.86 | -2.13 | -2.40 | -2.68 |
| | -5.33% | -3.01 | -3.28 | -3.55 | -3.83 | -4.10 | -4.37 | -4.64 |
| | -8% | -5.08 | -5.35 | -5.63 | -5.90 | -6.17 | -6.44 | -6.72 |

최대 손실 시나리오

위험액 -6.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 7.04

[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

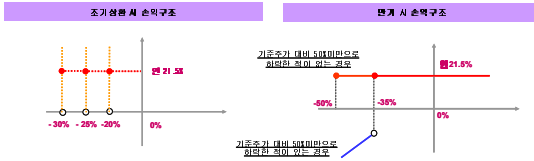
1. 계약금액

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

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(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345EV11 펀드 운용(ELS/2008-647)

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 211.54 | 186.91 | 162.28 | 137.64 | 113.01 | 88.38 | 63.74 |
| | 5.33% | 165.94 | 141.31 | 116.68 | 92.04 | 67.41 | 42.78 | 18.14 |
| | 2.67% | 120.06 | 95.43 | 70.80 | 46.16 | 21.53 | -3.10 | -27.74 |
| | 0% | 73.90 | 49.27 | 24.63 | 0.00 | -24.63 | -49.27 | -73.90 |
| | -2.67% | 27.45 | 2.82 | -21.81 | -46.45 | -71.08 | -95.71 | -120.35 |
| | -5.33% | -19.27 | -43.91 | -68.54 | -93.17 | -117.81 | -142.44 | -167.07 |
| | -8% | -66.28 | -90.92 | -115.55 | -140.18 | -164.82 | -189.45 | -214.09 |

최대 손실 시나리오
위험액 -214.09

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 224.74

[16] 메리츠 주가지수연계 괴생상률 제 1호

1. 계약금액

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

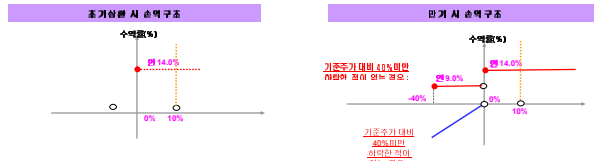
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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

- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 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) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 배후증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 447.13 | 427.95 | 406.77 | 389.59 | 370.41 | 351.23 | 332.05 |
| | 5.33% | 328.85 | 309.67 | 290.49 | 271.31 | 252.14 | 232.96 | 213.78 |
| 시나리오 | 2.67% | 198.99 | 179.81 | 160.63 | 141.45 | 122.27 | 103.09 | 83.91 |
| | 0% | 57.54 | 38.36 | 19.18 | 0.00 | -19.18 | -38.36 | -57.54 |
| | -2.67% | -95.90 | -114.80 | -133.66 | -153.04 | -172.22 | -191.40 | -210.58 |
| | -5.33% | -260.12 | -279.30 | -298.48 | -317.66 | -336.84 | -356.02 | -375.20 |
| | -8% | -436.34 | -455.52 | -474.70 | -493.88 | -513.06 | -532.24 | -551.41 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -551.41 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 551.79 |
|-----|--------|

[17]테리 조StepDown사모단위 편성26호

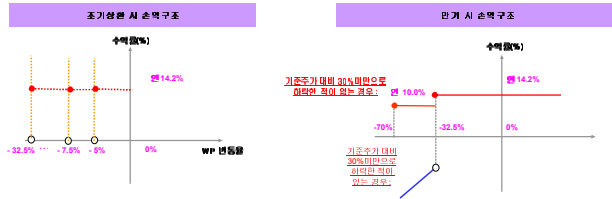
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: CJ 보통주
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 14일의 CJ 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(CJ 보통주)의 최초기준가격의 95%(1차중도상환일), 92.5%(2차중도상환일), 90.0%(3차중도상환일), 87.5%(4차중도상환일), 85%(5차중도상환일), 82.5%(6차중도상환일), 80%(7차중도상환일), 77.5%(8차중도상환일), 75%(9차중도상환일), 72.5%(10차중도상환일), 70.0%(11차중도상환일), 67.5%(만기상환일) 이산된 경우 만이율 14.2%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 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 코무담신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 220.90 | 187.11 | 153.32 | 119.53 | 85.75 | 51.96 | 18.17 |
| 시나리오 | 5.33% | 181.52 | 147.73 | 113.95 | 80.16 | 46.37 | 12.58 | -21.21 |
| | 2.67% | 141.68 | 107.89 | 74.10 | 40.31 | 6.52 | -27.26 | -61.05 |
| | 0% | 101.36 | 67.58 | 33.79 | 0.00 | -33.79 | -67.58 | -101.36 |
| | -2.67% | 60.58 | 26.80 | -6.99 | -40.78 | -74.57 | -108.36 | -142.15 |
| | -5.33% | 19.33 | -14.45 | -48.24 | -82.03 | -115.82 | -149.61 | -183.40 |
| | -8% | -22.38 | -56.17 | -89.96 | -123.75 | -157.54 | -191.33 | -225.11 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -225.11 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 210.51 |
|-----|--------|

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

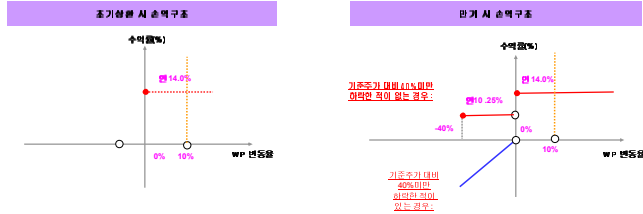
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

| 구분 | 손익 구조변동 시나리오 | | | | | | | |
|------|--------------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 102.61 | 96.75 | 90.90 | 85.04 | 79.18 | 73.33 | 67.47 | |
| 손익 | 73.62 | 67.76 | 61.91 | 56.05 | 50.19 | 44.34 | 38.48 | |
| 손익 | 45.27 | 39.42 | 33.56 | 27.70 | 21.85 | 15.99 | 10.14 | |
| 손익 | 17.57 | 11.71 | 5.86 | 0.00 | -5.86 | -11.71 | -17.57 | |
| 손익 | -9.49 | -15.35 | -21.21 | -27.06 | -32.92 | -38.77 | -44.63 | |
| 손익 | -35.91 | -41.77 | -47.62 | -53.48 | -59.33 | -65.19 | -71.05 | |
| 손익 | -61.69 | -67.54 | -73.40 | -79.25 | -85.11 | -90.97 | -96.82 | |

| 최대 손실 시나리오 | |
|------------|-------|
| 위험액 | 67.47 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 96.51 |
|-----|-------|

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가5호

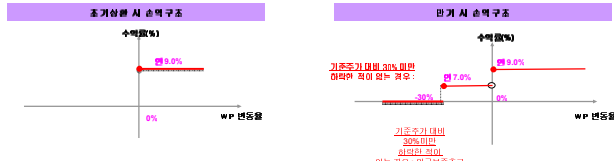
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,461 | 0 | 1,461 | 창의 |

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2011년 1월 24일
 - 3) 만도침산 결정주기: 매 6개월
 - 4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가
 - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가액의 100% 이상인 경우 연이율 9%로 중도상환함.
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 원도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 만도침산 기준가액의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우 : 원금 * 121%
 - 두 기초자산의 가격(장중도침산)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 70%이만 하락한 적이 있는 경우 : 원금*100%
 6) 만도의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762RV14 미래예상증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 32.35 | 29.15 | 25.96 | 22.76 | 19.57 | 16.38 | 13.18 |
| | 5.33% | 25.55 | 22.35 | 19.16 | 15.97 | 12.77 | 9.58 | 6.38 |
| | 2.67% | 17.96 | 14.77 | 11.57 | 8.38 | 5.18 | 1.99 | -1.21 |
| | 0% | 9.58 | 6.39 | 3.19 | 0.00 | -3.19 | -6.39 | -9.58 |
| | -2.67% | 0.42 | -2.78 | -5.97 | -9.17 | -12.38 | -15.55 | -18.75 |
| | -5.33% | -9.54 | -12.73 | -15.93 | -19.12 | -22.31 | -25.51 | -28.70 |
| | -8% | -20.28 | -23.47 | -26.67 | -29.86 | -33.06 | -36.25 | -39.45 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 13.18 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 38.33 |
|-----|-------|

[20]테리 조지 수연계 사모단원 피싱 6호

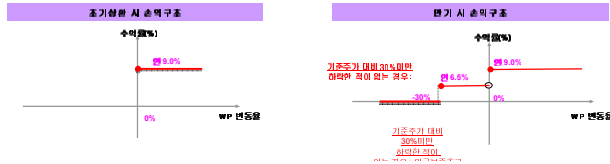
1. 계약금액

| 단위(백만원) | | | | | | |
|---------|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,080 | 0 | 1,080 | 장외 |

2. 평가시점의 손익구조

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

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762OV23 미래에셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 23.33 | 20.93 | 18.53 | 16.13 | 13.73 | 11.33 | 8.93 |
| | 5.33% | 18.48 | 16.09 | 13.69 | 11.29 | 8.89 | 6.49 | 4.09 |
| | 2.67% | 13.11 | 10.71 | 8.31 | 5.91 | 3.51 | 1.11 | -1.28 |
| | 0% | 7.20 | 4.80 | 2.40 | 0.00 | -2.40 | -4.80 | -7.20 |
| | -2.67% | 0.75 | -1.65 | -4.05 | -6.45 | -8.84 | -11.24 | -13.64 |
| | -5.33% | -6.23 | -8.63 | -11.03 | -13.43 | -15.82 | -18.22 | -20.62 |
| | -8% | -13.74 | -16.14 | -18.54 | -20.94 | -23.34 | -25.74 | -28.14 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 6.93 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 28.11 |
|-----|-------|

[2] 메리츠치주연계사모단위파생7호

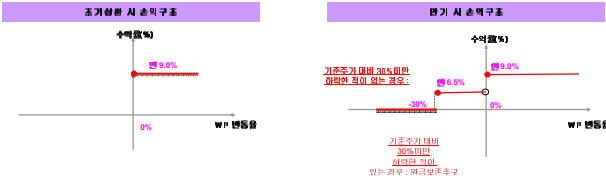
1. 계약금액

| | | | | | | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 840 | 0 | 840 | 장외 |

단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2011년 2월 21일
 - 3) 만도상환 결정주기: 매 6개월
 - 4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가
 - 5) 발행 후 매 6개월 마다 만도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(LG 보 통주, SK HOLDINGS 보 통주)의 만도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 만도상환기액의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 만도상환함.
- 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지
- 두 기초자산의 가액이 만도상환기액의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기 준가액 보다 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(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래예상종결(ELS)317

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | | 변동률 시나리오 | | | | | | |
|------------|--------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% |
| 기초 자산 시나리오 | 8% | 16.14 | 16.28 | 14.41 | 12.55 | 10.68 | 8.81 | 6.95 |
| | 5.33% | 14.38 | 12.51 | 10.65 | 8.78 | 6.91 | 5.05 | 3.18 |
| | 2.67% | 10.19 | 8.33 | 6.46 | 4.60 | 2.73 | 0.87 | -1.00 |
| | 0% | 5.60 | 3.73 | 1.87 | 0.00 | -1.87 | -3.73 | -5.60 |
| | -2.67% | 0.58 | -1.28 | -3.15 | -5.01 | -6.88 | -8.74 | -10.61 |
| | -5.33% | -4.85 | -6.71 | -8.58 | -10.44 | -12.31 | -14.17 | -16.04 |
| | -8% | -10.69 | -12.56 | -14.42 | -16.29 | -18.15 | -20.02 | -21.88 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 6.95 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 21.86 |
|-----|-------|

[23] 메리츠증권지수연계사모파생1호

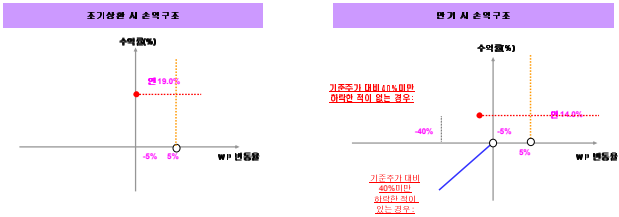
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

손익 구조인 톱 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 130.56 | 121.46 | 112.35 | 103.25 | 94.14 | 85.03 | 75.93 |
| | 5.33% | 97.16 | 88.05 | 78.95 | 69.84 | 60.73 | 51.63 | 42.52 |
| | 2.67% | 62.74 | 53.64 | 44.53 | 35.43 | 26.32 | 17.21 | 8.11 |
| | 0% | 27.32 | 18.21 | 9.11 | 0.00 | -9.11 | -18.21 | -27.32 |
| | -2.67% | -9.12 | -18.22 | -27.33 | -36.44 | -45.54 | -54.65 | -63.75 |
| | -5.33% | -46.56 | -55.67 | -64.78 | -73.88 | -82.99 | -92.10 | -101.20 |
| | -8% | -85.02 | -94.13 | -103.23 | -112.34 | -121.45 | -130.55 | -139.66 |

| | |
|------------|---------|
| 최대 손실 시나리오 | |
| 위험액 | -139.66 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 133.62 |
|-----|--------|

[24] 메리츠2Star 파생 상품 SEPO-1호

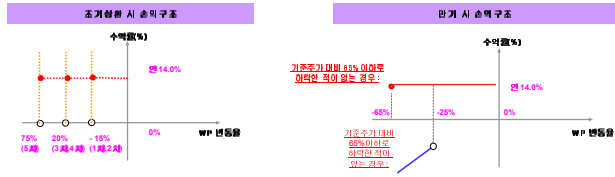
1. 계약금액

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

단위: 백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011년 08월 26일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세 번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 14.0%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 후지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 48%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 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/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6522907WR2 보유종류(ELS)2723

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 |
| | 5.33% | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 |
| | 2.67% | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 |
| | 0% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 | -0.11 |
| | -5.33% | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 | -0.44 |
| | -8% | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 | -0.99 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.99 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[25] 테리츠 주가지수연계사모펀생상품 제 1호

1. 계약금액

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

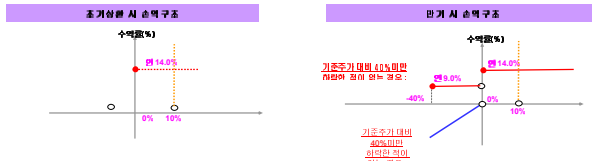
단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600690BVR2 대우증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 548.02 | 524.51 | 501.00 | 477.50 | 453.99 | 430.48 | 406.98 |
| | 5.33% | 403.05 | 379.55 | 356.04 | 332.53 | 309.03 | 285.52 | 262.01 |
| 시나리오 | 2.67% | 243.89 | 220.38 | 196.87 | 173.37 | 149.86 | 126.35 | 102.85 |
| | 0% | 70.52 | 47.01 | 23.51 | 0.00 | -23.51 | -47.01 | -70.52 |
| | -2.67% | -117.05 | -140.55 | -164.06 | -187.57 | -211.08 | -234.58 | -258.09 |
| | -5.33% | -318.82 | -342.33 | -365.83 | -389.34 | -412.85 | -436.35 | -459.86 |
| | -8% | -534.79 | -558.30 | -581.80 | -605.31 | -628.82 | -652.33 | -675.83 |
| | 최대 손실 시나리오 | | | | | | | |

위험액 -675.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 676.29

[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

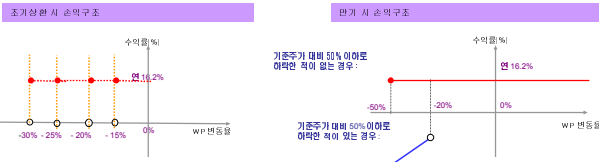
2) 만기: 2010년 09월 30일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(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% | -0.39 | -0.40 | -0.41 | -0.43 | -0.44 | -0.45 | -0.47 |
| | 5.33% | -0.13 | -0.14 | -0.15 | -0.17 | -0.18 | -0.19 | -0.21 |
| | 2.67% | 0.01 | 0.00 | -0.01 | -0.02 | -0.04 | -0.05 | -0.06 |
| | 0% | 0.04 | 0.03 | 0.01 | 0.00 | -0.01 | -0.03 | -0.04 |
| | -2.67% | -0.05 | -0.07 | -0.06 | -0.09 | -0.11 | -0.12 | -0.13 |
| | -5.33% | -0.26 | -0.28 | -0.29 | -0.30 | -0.32 | -0.33 | -0.34 |
| | -8% | -0.59 | -0.61 | -0.62 | -0.63 | -0.64 | -0.66 | -0.67 |

최대 손실 시나리오

위험액 -0.67

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 2.36

[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

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

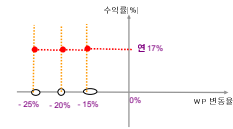
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

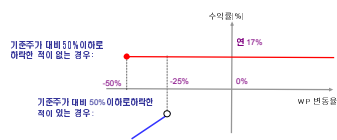
- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011년 09월 23일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 09월 26일 삼성전자, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일)만큼 17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우
 : 원금 * 151.0%
 - 두 기초자산의 가액(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6572345/91 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 1.85 | 0.87 | -0.10 | -1.08 | -2.05 | -3.03 | -4.01 |
| | 5.33% | 3.64 | 2.67 | 1.69 | 0.72 | -0.26 | -1.24 | -2.21 |
| | 2.67% | 4.00 | 3.03 | 2.05 | 1.07 | 0.10 | -0.88 | -1.85 |
| | 0% | 2.93 | 1.95 | 0.98 | 0.00 | -0.98 | -1.95 | -2.93 |
| | -2.67% | 0.42 | -0.56 | -1.53 | -2.51 | -3.48 | -4.46 | -5.44 |
| | -5.33% | -3.52 | -4.50 | -5.47 | -6.45 | -7.43 | -8.40 | -9.38 |
| | -8% | -8.90 | -9.87 | -10.85 | -11.83 | -12.80 | -13.78 | -14.76 |

최대 손실 시나리오

위험액 -14.76

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 8.07

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

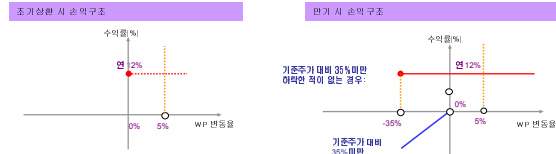
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 372 | 0 | 372 | 잔위 |

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 상환 결정일에 최초 기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포화하여 한변이라도 최초 기준가격 대비 5%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (8차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격 이 환변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 124%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수 / 최초 기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조인출(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[34] 대리 조주가지 수연계 파생13

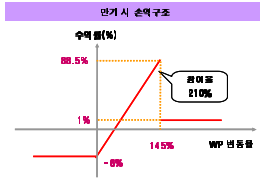
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 펀드자산 결정주기: 만기일 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우
: 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수 / 최초기준지수 - 1))
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
: 원금 * 94%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동 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 | 8% | -56.46 | -62.64 | -68.82 | -74.99 | -81.17 | -87.35 | -93.52 |
| 손익 | 5.33% | -29.55 | -35.72 | -41.90 | -48.07 | -54.25 | -60.43 | -66.60 |
| 손익 | 2.67% | -4.55 | -10.72 | -16.90 | -23.08 | -29.25 | -35.43 | -41.61 |
| 손익 | 0% | 18.53 | 12.35 | 6.18 | 0.00 | -6.18 | -12.35 | -18.53 |
| 손익 | -2.67% | 39.69 | 33.51 | 27.33 | 21.16 | 14.98 | 8.80 | 2.63 |
| 손익 | -5.33% | 58.92 | 52.75 | 46.57 | 40.39 | 34.22 | 28.04 | 21.87 |
| 손익 | -8% | 76.24 | 70.06 | 63.89 | 57.71 | 51.53 | 45.36 | 39.18 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 39.18 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 68.80 |
|-----|-------|

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

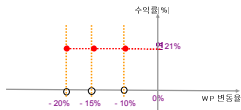
| | | | | | | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 238 | 0 | 238 | 잔위 |

단위(백만원)

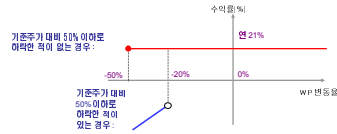
2. 만기시점의 손익구조

- 파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 만기: 2012년 02월 15일
- 증가평가일: 매6개월
- 기준지수: 2009년 02월 13일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 발행 후 6개월마다 증가평가를 시행하고, 기초자산(삼성전자 증가, SK텔레콤의 증가)의 평가일 증가가 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 증가평가일), 85%이상인 경우(세번째, 네번째 증가평가일), 80%이상인 경우(다섯번째 증가평가일) 인출 21.0%의 수익률로 종료 상황이 됨.
단, 만기시 까지 초기 상황 조건을 충족하지 못한 경우 아래와 같이 만기 상당금액을 산출함
- 두 기초자산의 만기일 증가가 모두 최초 기준가격의 80%이상인 경우
: 원금 * 163.0%
- 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 만기일 증가 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 없는 경우
: 원금 * 163.0%
- 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 있는 경우 만기 평가일의 하락률이 큰 증폭을 기준으로
: 원금 * (만기 평가가격 / 최초기준가격)
- 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% | |
| 기초 자산 시나리오 | 8% | 5.20 | 3.92 | 2.65 | 1.37 | 0.10 | -1.17 | -2.45 |
| | 5.33% | 5.33 | 4.06 | 2.79 | 1.51 | 0.24 | -1.03 | -2.31 |
| | 2.67% | 4.88 | 3.60 | 2.33 | 1.06 | -0.22 | -1.49 | -2.76 |
| | 0% | 3.82 | 2.55 | 1.27 | 0.00 | -1.27 | -2.55 | -3.82 |
| | -2.67% | 2.17 | 0.89 | -0.38 | -1.65 | -2.93 | -4.20 | -5.47 |
| | -5.33% | -0.08 | -1.36 | -2.63 | -3.91 | -5.18 | -6.45 | -7.73 |
| | -8% | -2.93 | -4.21 | -5.48 | -6.75 | -8.03 | -9.30 | -10.58 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -10.58 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 13.06 |
|-----|-------|

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

1. 계약금액

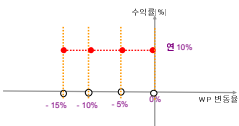
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,000 | 0 | 5,000 | 잔위 |

단위(백만원)

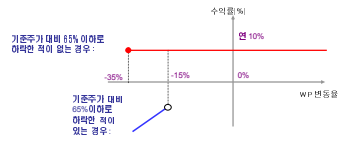
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동/최대손실가능금액 (다위:백만원)

메리츠주가지수연계사모증권2호

손익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[80-2] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR600594WVJ5 우리투자증권(ELS)1989

1. 계약금액

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

단위(백만원)

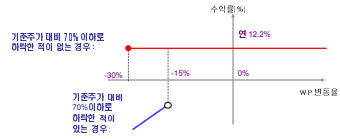
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 6월 12일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 6월 12일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산가중으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12.2%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 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
 KR600690MM/M7 대우증권 ELS2697

1. 계약금액

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

단위(백만원)

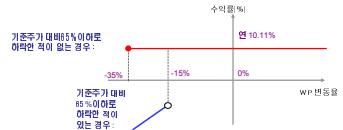
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 14일
- 3) 펀드형산 결정주기: 매4개월
- 4) 기 존지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수 의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가액 의 95% 이상인 경우(첫 번째 중도상환일) 90% 이상인 경우(두 번째 중도상환일), 85% 이상인 경우(세 번째 중도상환일) 만월 10.11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기 초자산의 가액 이 원본도 기 준가액 의 85%이 만으로 하락한 적 이 없고, 최초 기 준 가액 의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 110.11%
 - 두 기 초자산의 가액 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가액 의 65%이 만으로 하락한 적 이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 존지수/최초기 존지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

연율11%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

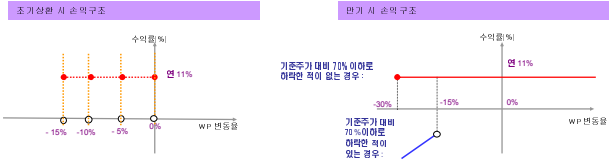
- 두 기준지수의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

- 두 기준지수의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우

: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조



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

1. 계약금액

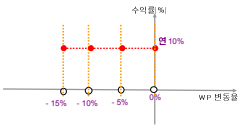
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액금(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,000 | 0 | 5,000 | 잔위 |

단위(백만원)

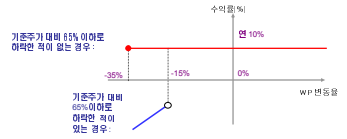
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 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%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 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

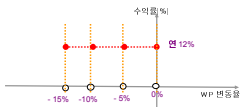
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

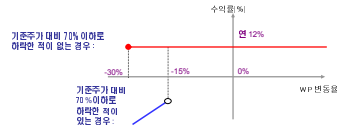
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고,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

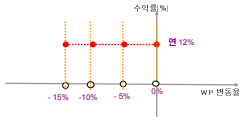
1. 계약금액

| 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) 연율 12%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 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

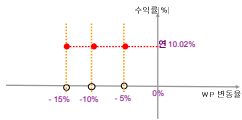
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,000 | 0 | 5,000 | 잔액 |

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) 만을 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 * (만기 기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

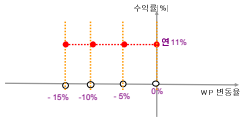
1. 계약금액

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

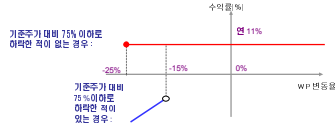
2. 평가시점의 손익구조

- 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 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] **메리츠주가지수연계사로증권2호**

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

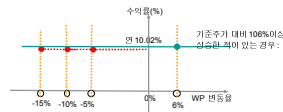
2) 만기: 2011년 5월 27일

3) 만드침산 결정주기: 매 4개월

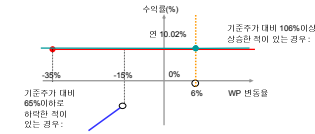
4) 기준지수: 2000년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가

- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 95% 이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90% 이상인 경우(두번째 중도상환일), 85% 이상인 경우(세번째 중도상환일), 80% 이상인 경우(네번째 중도상환일) 변할 10.02%의 수익률로 중도 상환이 됨.
- 단, 기초자산지수 기준지수의 106% 이상으로 상승한 적이 있을 경우는 행사금지사건에 해당되며, 행사금지사건이 발행 후 18개월 이전에 일어나면 이후 드러하는 중간평가일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급. 18개월 이후에 발생하면 만기일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급
- 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 20.04%
 - 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHC-2

1. 계약금액

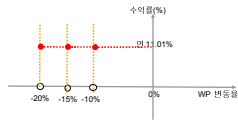
| | | | | | | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 924.4 | 0 | 924 | 잔액 |

단위(백만원)

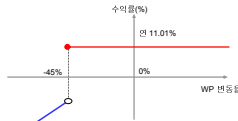
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 만기: 2012년 4월 12일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차 지수의 증가
- 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차, 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80% 이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 11.01%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 * 111.01%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포화) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액 -0.12

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.54

[62] 데리츠2Star사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

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

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

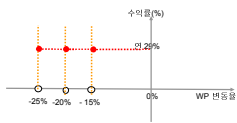
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

- 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.9%

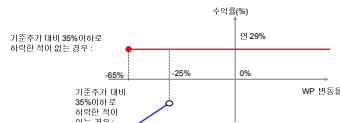
- 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 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 시나리오 | 8% | -0.93 | -1.59 | -2.25 | -2.91 | -3.58 | -4.24 | -4.90 |
| | 5.33% | -2.08 | -2.74 | -3.41 | -4.07 | -4.73 | -5.39 | -6.06 |
| | 2.67% | -1.11 | -1.77 | -2.43 | -3.10 | -3.76 | -4.42 | -5.08 |
| | 0% | 1.99 | 1.33 | 0.66 | 0.00 | -0.66 | -1.33 | -1.99 |
| | -2.67% | 7.21 | 6.55 | 5.89 | 5.22 | 4.56 | 3.90 | 3.23 |
| | -5.33% | 14.56 | 13.90 | 13.23 | 12.57 | 11.91 | 11.24 | 10.58 |
| | -8% | 24.03 | 23.37 | 22.71 | 22.04 | 21.38 | 20.72 | 20.06 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 20.06 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 35.48 |
|-----|-------|

[66] 테리츠2Star사모증권LEHC-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차

2) 만기: 2012년 4월 12일

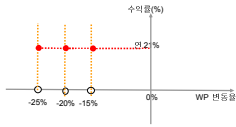
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

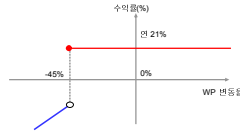
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보충주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 21%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------------|----------|---------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 0.01 | -0.02 | -0.05 | -0.09 | -0.12 | -0.15 | -0.19 |
| | 5.33% | 0.07 | 0.04 | 0.00 | -0.03 | -0.06 | -0.10 | -0.13 |
| | 2.67% | 0.10 | 0.06 | 0.03 | -0.00 | -0.03 | -0.07 | -0.10 |
| | 0% | 0.10 | 0.07 | 0.03 | 0.00 | -0.03 | -0.07 | -0.10 |
| | -2.67% | 0.07 | 0.04 | 0.01 | -0.03 | -0.06 | -0.09 | -0.13 |
| 최대 손실 시나리오 | -5.33% | 0.02 | -0.01 | -0.05 | -0.08 | -0.11 | -0.15 | -0.18 |
| | -8% | -0.06 | -0.09 | -0.13 | -0.16 | -0.19 | -0.23 | -0.26 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.26 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 1.20 |
|-----|------|

[67] 테리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

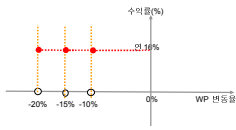
3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

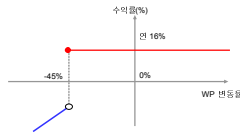
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 65%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

초기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 2.17 | 1.61 | 1.06 | 0.50 | -0.05 | -0.61 | -1.16 |
| 시나리오 | 5.33% | 2.32 | 1.76 | 1.21 | 0.65 | 0.10 | -0.45 | -1.01 |
| | 2.67% | 2.15 | 1.60 | 1.04 | 0.49 | -0.07 | -0.62 | -1.18 |
| | 0% | 1.66 | 1.11 | 0.55 | 0.00 | -0.55 | -1.11 | -1.66 |
| | -2.67% | 0.86 | 0.30 | -0.25 | -0.81 | -1.36 | -1.91 | -2.47 |
| | -5.33% | -0.27 | -0.82 | -1.38 | -1.93 | -2.48 | -3.04 | -3.59 |
| | -8% | -1.71 | -2.27 | -2.82 | -3.37 | -3.93 | -4.48 | -5.04 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -6.04 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 3.83 |
|-----|------|

[65] 테리츠2Star사모증권POKB-2호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

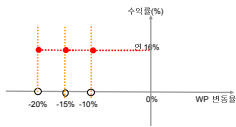
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

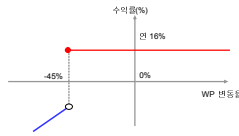
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------------|----------|---------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 0.13 | 0.10 | 0.06 | 0.03 | -0.00 | -0.04 | -0.07 |
| | 5.33% | 0.14 | 0.11 | 0.07 | 0.04 | 0.01 | -0.03 | -0.06 |
| | 2.67% | 0.13 | 0.10 | 0.06 | 0.03 | -0.00 | -0.04 | -0.07 |
| | 0% | 0.10 | 0.07 | 0.03 | 0.00 | -0.03 | -0.07 | -0.10 |
| | -2.67% | 0.05 | 0.02 | -0.02 | -0.05 | -0.08 | -0.11 | -0.15 |
| 최대 손실 시나리오 | -8.33% | -0.02 | -0.05 | -0.08 | -0.12 | -0.15 | -0.18 | -0.21 |
| | -8% | -0.10 | -0.14 | -0.17 | -0.20 | -0.23 | -0.27 | -0.30 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.90 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.23 |
|-----|------|

[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.

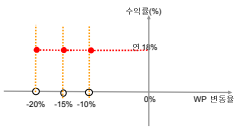
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

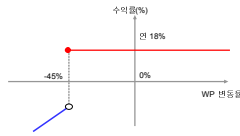
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
: 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | -19.50 | -22.57 | -25.63 | -28.70 | -31.77 | -34.83 | -37.90 |
| 시나리오 | 5.33% | -8.37 | -11.44 | -14.50 | -17.57 | -20.64 | -23.70 | -26.77 |
| | 2.67% | 1.20 | -1.87 | -4.94 | -8.00 | -11.07 | -14.14 | -17.20 |
| | 0% | 9.20 | 6.13 | 3.07 | 0.00 | -3.07 | -6.13 | -9.20 |
| | -2.67% | 15.64 | 12.57 | 9.51 | 6.44 | 3.37 | 0.31 | -2.76 |
| | -5.33% | 20.51 | 17.45 | 14.38 | 11.31 | 8.25 | 5.18 | 2.12 |
| | -8% | 23.83 | 20.76 | 17.69 | 14.63 | 11.56 | 8.49 | 5.43 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 5.43 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 48.27 |
|-----|-------|

[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

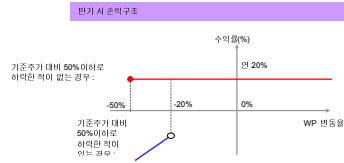
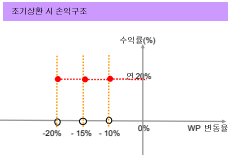
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | 손익 구조변동률 시나리오 | | | | 변동성 시나리오 | | | |
|------|---------------|---------|--------|-------|----------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | -3.12 | -4.00 | -4.88 | -5.76 | -6.64 | -7.53 | -8.41 |
| 시나리오 | 5.33% | -0.89 | -1.77 | -2.65 | -3.54 | -4.42 | -5.30 | -6.18 |
| | 2.67% | 1.03 | 0.15 | -0.73 | -1.61 | -2.50 | -3.38 | -4.26 |
| | 0% | 2.64 | 1.76 | 0.88 | 0.00 | -0.88 | -1.76 | -2.64 |
| | -2.67% | 3.95 | 3.07 | 2.19 | 1.31 | 0.43 | -0.45 | -1.34 |
| | -5.33% | 4.95 | 4.07 | 3.19 | 2.31 | 1.43 | 0.55 | -0.34 |
| | -8% | 5.64 | 4.76 | 3.88 | 3.00 | 2.12 | 1.24 | 0.36 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.36 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 12.52 |
|-----|-------|

[76] 테리츠2Star사로 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) 만드정산 결정주기: 매6개월

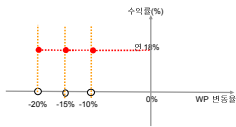
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

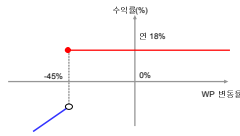
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 11.8%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동 (최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | -10.73 | -12.41 | -14.10 | -15.79 | -17.47 | -19.16 | -20.85 |
| 시나리오 | 5.33% | -4.60 | -6.29 | -7.96 | -9.66 | -11.35 | -13.04 | -14.73 |
| | 2.67% | 0.66 | -1.03 | -2.72 | -4.40 | -6.09 | -7.78 | -9.46 |
| | 0% | 5.06 | 3.37 | 1.69 | 0.00 | -1.69 | -3.37 | -5.06 |
| | -2.67% | 8.60 | 6.92 | 5.23 | 3.54 | 1.86 | 0.17 | -1.52 |
| | -5.33% | 11.29 | 9.60 | 7.97 | 6.22 | 4.54 | 2.85 | 1.16 |
| | -8% | 13.11 | 11.42 | 9.73 | 8.05 | 6.36 | 4.67 | 2.99 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 2.99 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 26.55 |
|-----|-------|

[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

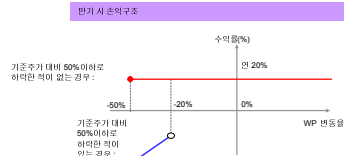
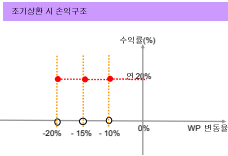
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

손익구조변동률 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | 0 | 변동성 시나리오 | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|----------|-------|-------|--|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 8.33% | | 16.67% | 25% | | |
| 기초자산 | 8% | -2.79 | -3.54 | -4.29 | -5.04 | -5.79 | -6.55 | -7.30 | |
| 시나리오 | 5.33% | -0.61 | -1.36 | -2.12 | -2.87 | -3.62 | -4.37 | -5.13 | |
| | 2.67% | 1.07 | 0.32 | -0.44 | -1.19 | -1.94 | -2.69 | -3.45 | |
| | 0% | 2.26 | 1.50 | 0.75 | 0.00 | -0.75 | -1.50 | -2.26 | |
| | -2.67% | 2.95 | 2.20 | 1.45 | 0.70 | -0.06 | -0.81 | -1.56 | |
| | -5.33% | 3.16 | 2.41 | 1.65 | 0.90 | 0.15 | -0.60 | -1.36 | |
| | -8% | 2.87 | 2.12 | 1.36 | 0.61 | -0.14 | -0.89 | -1.65 | |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -1.65 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 4.17 |
|-----|------|

[78] 데리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

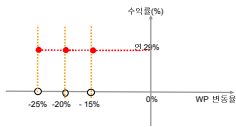
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

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

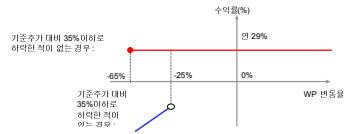
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가액이 합변도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12.9%
 - 두 기초자산의 가액(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 연도의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 표본증권(ELS)325

수익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | 변동성 시나리오 | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|----------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | -0.81 | -1.38 | -1.96 | -2.54 | -3.11 | -3.69 | -4.27 |
| 시나리오 | 5.33% | -1.81 | -2.39 | -2.96 | -3.54 | -4.12 | -4.70 | -5.27 |
| | 2.67% | -0.97 | -1.54 | -2.12 | -2.70 | -3.27 | -3.85 | -4.43 |
| | 0% | 1.73 | 1.15 | 0.58 | 0.00 | -0.58 | -1.15 | -1.73 |
| | -2.67% | 6.28 | 5.70 | 5.12 | 4.55 | 3.97 | 3.39 | 2.82 |
| | -5.33% | 12.67 | 12.10 | 11.52 | 10.94 | 10.37 | 9.79 | 9.21 |
| | -8% | 20.92 | 20.34 | 19.77 | 19.19 | 18.61 | 18.04 | 17.46 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 17.46 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 30.88 |
|-----|-------|

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

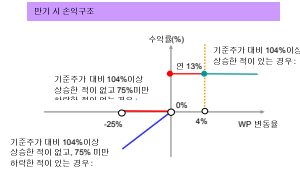
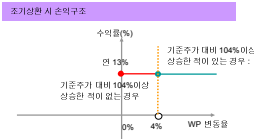
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

메리츠주가지수연계사모6호

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 8,867.49 | 8,246.01 | 7,624.53 | 7,003.05 | 6,381.57 | 5,760.09 | 5,138.61 |
| | 5.33% | 6,552.71 | 5,931.23 | 5,309.75 | 4,688.27 | 4,066.79 | 3,445.31 | 2,823.83 |
| | 2.67% | 4,218.36 | 3,596.88 | 2,975.40 | 2,353.92 | 1,732.44 | 1,110.96 | 489.48 |
| 시나리오 | 0% | 1,864.44 | 1,242.96 | 621.48 | 0.00 | -621.48 | -1,242.96 | -1,864.44 |
| | -2.67% | -909.04 | -1,130.52 | -1,752.00 | -2,373.48 | -2,994.96 | -3,616.44 | -4,237.92 |
| | -5.33% | -2,902.09 | -3,523.57 | -4,145.05 | -4,766.53 | -5,388.01 | -6,009.49 | -6,630.97 |
| | -8% | -5,314.70 | -5,936.18 | -6,557.66 | -7,179.14 | -7,800.62 | -8,422.10 | -9,043.58 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-----------|
| 위험액 | -9,043.58 |
|-----|-----------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|----------|
| 위험액 | 8,988.08 |
|-----|----------|

[79-2] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 8일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 8일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

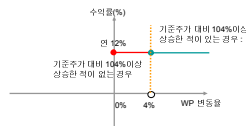
: 원금 * 11.2%

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

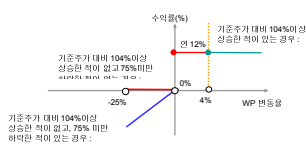
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환시 수익구조



만기시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호

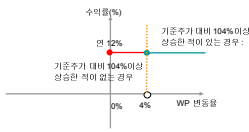
1. 계약금액

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

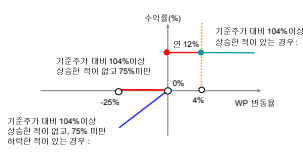
2. 만기시점의 수익구조

- 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 |

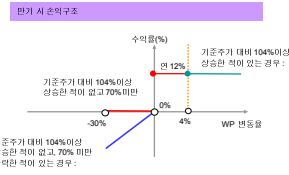
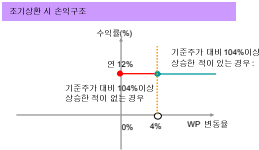
단위(백만원)

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 신한증권(ELS)786

[79-5] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

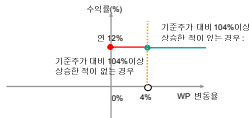
5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

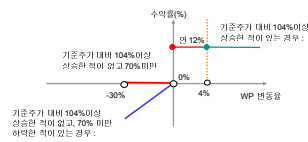
- 두 기초자산의 가격이 한 번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 손익구조



KR600086767B7 국토부 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 19일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가

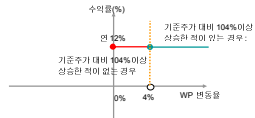
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정점에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

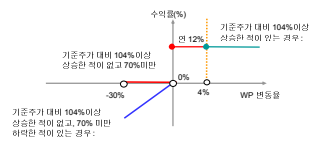
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6000867CTB8 굿모닝 신한증권(ELS)804

[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 15일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

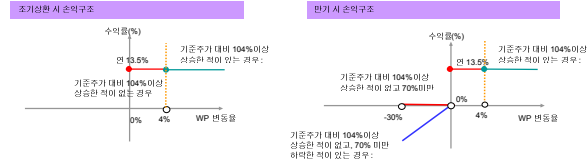
4) 기준지수: 2007년 12월 19일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR60008675TC7 굿모닝 신한증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

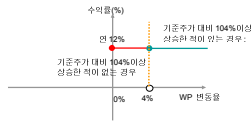
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,000.0 | 0 | 5,000 | 차입 |

단위: (백만원)

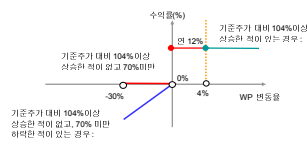
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TN2 우리투자증권 (ELS)1438

[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 08일

3) 만트청산 결제주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

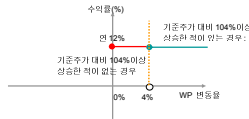
5) 발행 후 매3개월마다 증도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기상환결제일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 증도포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 증도상환

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

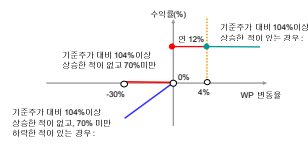
- 두 기초자산의 가격 이 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (증도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만트의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

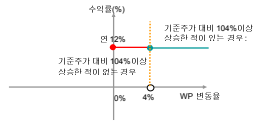
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5000.0 | 0 | 5,000 | 차입 |

단위(백만원)

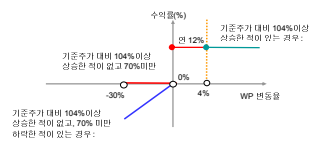
2. 만기시점의 손익구조

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

2) 만기: 2010년 12월 13일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

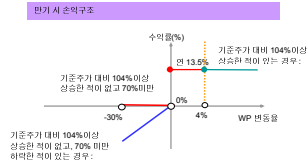
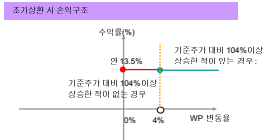
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

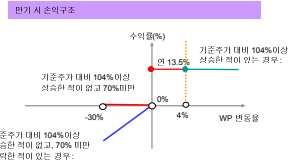
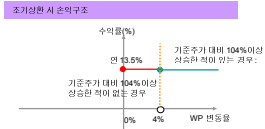
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600594TTC0 우리투자증권 (ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

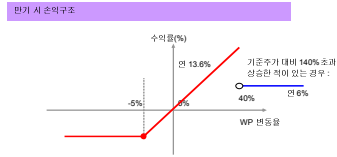
1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우
 : 원금 * (95% + 100% * (만기기준지수/최초기준지수 - 1))
 - 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
 : 원금 * 95%
- 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우
 : 원금 * 100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6523317W30 대우증권ELS2881

| 구분 | 손익 구조변동률 시나리오 | | | | 변동성 시나리오 | | | |
|------|---------------|---------|--------|-------|----------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | -1.90 | -2.28 | -2.66 | -3.04 | -3.42 | -3.79 | -4.17 |
| 시나리오 | 5.33% | -0.82 | -1.20 | -1.57 | -1.96 | -2.33 | -2.71 | -3.09 |
| | 2.67% | 0.20 | -0.18 | -0.56 | -0.94 | -1.32 | -1.70 | -2.08 |
| | 0% | 1.14 | 0.76 | 0.38 | 0.00 | -0.38 | -0.76 | -1.14 |
| | -2.67% | 2.01 | 1.63 | 1.25 | 0.87 | 0.49 | 0.11 | -0.27 |
| | -5.33% | 2.81 | 2.43 | 2.05 | 1.67 | 1.29 | 0.91 | 0.53 |
| | -8% | 3.53 | 3.16 | 2.78 | 2.40 | 2.02 | 1.64 | 1.26 |

| 최대 손실 시나리오 | |
|------------|------|
| 위험액 | 1.26 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 4.79 |
|-----|------|

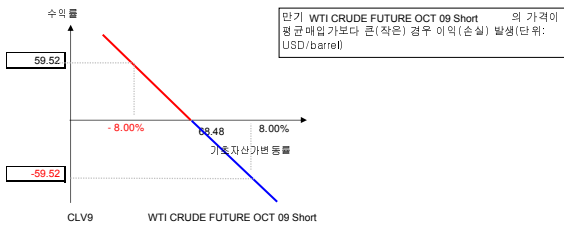
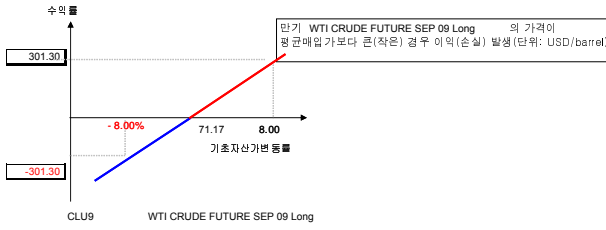
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위(계약)

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위: 1,000 USD)

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

| 구분 | 시나리오 | 손익 |
|--------------|--------|---------|
| 기초자산 시나리오 | 8% | 241.78 |
| | 5.33% | 161.08 |
| | 2.67% | 80.69 |
| | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -80.69 |
| 최대손실 | -5.33% | -161.08 |
| | -8% | -241.78 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|---------|
| 위험액 | -241.78 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 1,462 |
|-----|-------|

[78] **대리 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

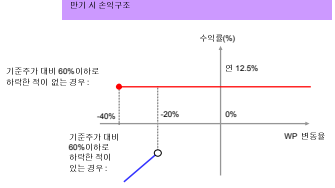
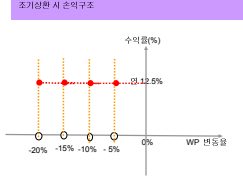
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 112.5%

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

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6523310W80 대우증권ELS3005

수익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|------------|----------|---------|--------|------|-------|--------|------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% |
| 기초 자산 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 | 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 |
|-----|------|

[79] 데리 초주가지 수연계사모증권! 61E

1. 계약금액

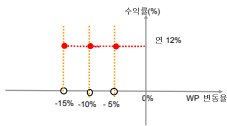
| | | | | | | |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3842.0 | 0 | 3,842.0 | 잔위 |

단위: (백만원)

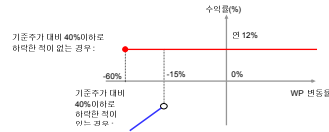
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조별 손익 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------------------|----------|---------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초지 | 8% | -2.44 | -2.72 | -3.01 | -3.29 | -3.58 | -3.86 | -4.15 |
| 산 시 나 리 오 | 5.33% | -0.40 | -0.68 | -0.97 | -1.25 | -1.54 | -1.82 | -2.11 |
| | 2.67% | 0.70 | 0.42 | 0.13 | -0.15 | -0.44 | -0.73 | -1.01 |
| | 0% | 0.86 | 0.57 | 0.29 | 0.00 | -0.29 | -0.57 | -0.86 |
| | -2.67% | 0.07 | -0.22 | -0.50 | -0.79 | -1.07 | -1.36 | -1.65 |
| | -5.33% | -1.66 | -1.95 | -2.23 | -2.52 | -2.80 | -3.09 | -3.38 |
| | -8% | -4.33 | -4.62 | -4.90 | -5.19 | -5.48 | -5.76 | -6.05 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -6.05 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 4.31 |
|-----|------|

[80] 대리주가지지수연계사모증권10호

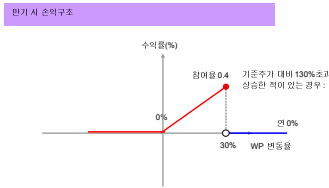
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 펀드청산 결정주기: 만기일 당일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 5월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(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% * (만기기준지수/최초기준지수 - 1)}
 - : 원금 * 100%
 - 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
 - : 원금 * 100%
- 6) 펀드의 손익구조



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 | 8% | -4.69 | -6.49 | -8.29 | -10.10 | -11.90 | -13.70 | -15.51 |
| | 5.33% | -1.00 | -2.80 | -4.61 | -6.41 | -8.21 | -10.01 | -11.82 |
| 시나리오 | 2.67% | 2.37 | 0.56 | -1.24 | -3.04 | -4.85 | -6.65 | -8.45 |
| | 0% | 5.41 | 3.61 | 1.80 | 0.00 | -1.80 | -3.61 | -5.41 |
| | -2.67% | 6.13 | 6.33 | 4.52 | 2.72 | 0.92 | -0.89 | -2.69 |
| | -5.33% | 10.53 | 8.72 | 6.92 | 5.12 | 3.31 | 1.51 | -0.29 |
| | -8% | 12.60 | 10.80 | 8.99 | 7.19 | 5.39 | 3.58 | 1.78 |

| 최대 손실 시나리오 | |
|------------|------|
| 위험액 | 1.78 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 15.31 |
|-----|-------|

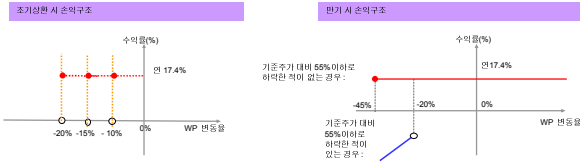
[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호

1. 계약금액

| | | | | | | 단위(백만원) | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|---------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 | |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 275.9 | 0 | 275.9 | | 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 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85% 이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80% 이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 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% | 2.79 | 2.21 | 1.62 | 1.04 | 0.45 | -0.13 | -0.72 |
| | 5.33% | 2.86 | 2.27 | 1.69 | 1.10 | 0.52 | -0.07 | -0.65 |
| 손익 | 2.67% | 2.51 | 1.93 | 1.34 | 0.76 | 0.17 | -0.41 | -1.00 |
| | 0% | 1.25 | 1.17 | 0.98 | 0.00 | -0.58 | -1.17 | -1.75 |
| 시나리오 | -2.67% | 0.59 | 0.00 | -0.58 | -1.17 | -1.75 | -2.34 | -2.92 |
| | -5.33% | -0.99 | -1.57 | -2.16 | -2.74 | -3.33 | -3.91 | -4.50 |
| | -8% | -2.98 | -3.56 | -4.15 | -4.73 | -5.32 | -5.90 | -6.49 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -6.49 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 7.47 |
|-----|------|

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

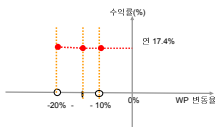
| 구분 | 기대대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1772.6 | 0 | 1,772.6 | 잔위 |

단위(백만원)

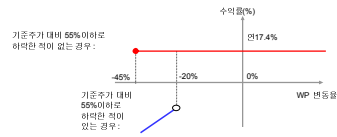
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기시 수익구조



3. 손익 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% | 17.94 | 14.18 | 10.42 | 6.67 | 2.91 | -0.85 | -4.60 |
| | 5.33% | 18.35 | 14.60 | 10.84 | 7.08 | 3.33 | -0.43 | -4.19 |
| 시나리오 | 2.67% | 16.13 | 12.37 | 8.62 | 4.86 | 1.10 | -2.65 | -6.41 |
| | 0% | 11.27 | 7.51 | 3.76 | 0.00 | -3.76 | -7.51 | -11.27 |
| | -2.67% | 3.77 | 0.02 | -3.74 | -7.50 | -11.25 | -15.01 | -18.77 |
| | -5.33% | -6.36 | -10.12 | -13.87 | -17.63 | -21.39 | -25.14 | -28.90 |
| | -8% | -9.13 | -22.89 | -26.64 | -30.40 | -34.16 | -37.91 | -41.67 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -41.67 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 47.98 |
|-----|-------|

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

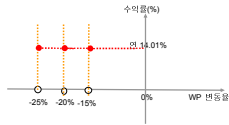
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 390.1 | 0 | 390.1 | 잔위 |

단위: (백만원)

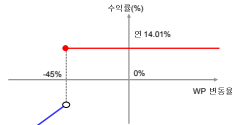
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 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% | -0.05 | -0.11 | -0.16 | -0.22 | -0.27 | -0.33 | -0.38 |
| | 5.33% | 0.09 | 0.04 | -0.02 | -0.07 | -0.13 | -0.18 | -0.24 |
| 시나리오 | 2.67% | 0.17 | 0.11 | 0.06 | 0.00 | -0.05 | -0.11 | -0.16 |
| | 0% | 0.17 | 0.11 | 0.06 | 0.00 | -0.06 | -0.11 | -0.17 |
| -2.67% | 0.09 | 0.03 | -0.02 | -0.06 | -0.13 | -0.19 | -0.24 | -0.29 |
| | -5.33% | -0.06 | -0.12 | -0.17 | -0.23 | -0.28 | -0.34 | -0.39 |
| -8% | -0.29 | -0.35 | -0.40 | -0.46 | -0.51 | -0.57 | -0.62 | |

| 최대 손실 시나리오 | |
|------------|-------|
| 위험액 | -0.62 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.94 |
|-----|------|

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

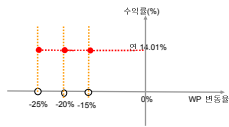
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1408.7 | 0 | 1,408.7 | 잔위 |

단위: (백만원)

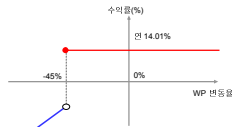
2. 만기시점의 손익구조

- 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/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조표본 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | -0.19 | -0.39 | -0.59 | -0.79 | -0.99 | -1.18 | -1.38 |
| 손익 | 5.33% | 0.34 | 0.14 | -0.05 | -0.25 | -0.45 | -0.65 | -0.85 |
| 시나리오 | 2.67% | 0.61 | 0.41 | 0.21 | 0.01 | -0.19 | -0.39 | -0.59 |
| | 0% | 0.60 | 0.40 | 0.20 | 0.00 | -0.20 | -0.40 | -0.60 |
| | -2.67% | 0.32 | 0.12 | -0.06 | -0.26 | -0.46 | -0.66 | -0.86 |
| | -5.33% | -0.23 | -0.43 | -0.63 | -0.83 | -1.03 | -1.23 | -1.43 |
| | -8% | -1.05 | -1.25 | -1.45 | -1.65 | -1.85 | -2.05 | -2.25 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -2.25 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 3.38 |
|-----|------|

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-1호

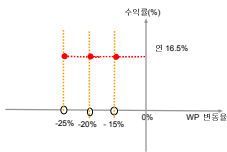
1. 계약금액

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

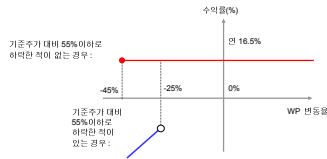
2. 만기시점의 손익구조

- 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 가치 조가 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 환펀드 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 116.5%
→ 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.08 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.30 |
|-----|------|

[87] 데리츠2SIa사모증권SEKT-이 호

1. 계약금액

| | | | | | | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(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

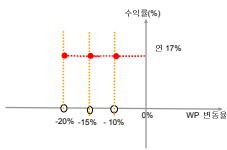
5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기까지 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%

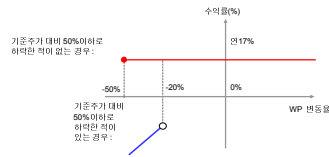
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR6562319W52 유인 투기증권 (ELS)2415

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | 변동률 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 3.50 | 2.79 | 2.06 | 1.36 | 0.65 | -0.06 | -0.78 |
| | 5.33% | 3.37 | 2.65 | 1.94 | 1.23 | 0.51 | -0.20 | -0.91 |
| 시나리오 | 2.67% | 2.91 | 2.20 | 1.48 | 0.77 | 0.06 | -0.66 | -1.37 |
| | 0% | 2.14 | 1.43 | 0.71 | 0.00 | -0.21 | -0.83 | -2.14 |
| | -2.67% | 1.05 | 0.34 | -0.37 | -1.08 | -1.80 | -2.51 | -3.23 |
| | -5.33% | -0.35 | -1.06 | -1.78 | -2.49 | -3.20 | -3.92 | -4.63 |
| | -8% | -2.07 | -2.78 | -3.49 | -4.21 | -4.92 | -5.63 | -6.35 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -6.35 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 9.01 |
|-----|------|

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

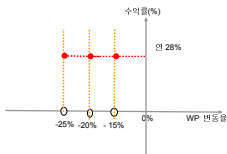
1. 계약금액

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

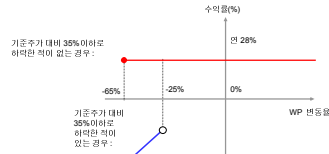
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 47.40 | 35.90 | 24.40 | 12.90 | 1.40 | -10.11 | -21.61 |
| | 5.33% | 43.61 | 32.11 | 20.61 | 9.11 | -2.40 | -13.90 | -25.40 |
| | 2.67% | 39.31 | 27.81 | 16.31 | 4.81 | -6.70 | -18.20 | -29.70 |
| | 0% | 34.51 | 23.00 | 11.90 | 0.00 | -11.60 | -23.00 | -34.00 |
| | -2.67% | 29.19 | 17.69 | 6.19 | -5.31 | -16.81 | -28.32 | -39.62 |
| | -5.33% | 23.37 | 11.87 | 0.37 | -11.13 | -22.63 | -34.14 | -45.64 |
| | -8% | 17.05 | 5.54 | -5.96 | -17.46 | -28.96 | -40.46 | -51.97 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -51.97 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 50.92 |
|-----|-------|

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

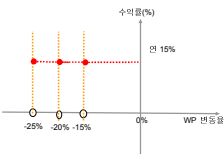
1. 계약금액

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

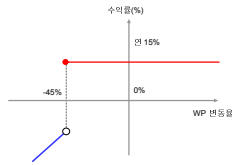
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백 만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

| | | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|-----------|--------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|
| 구분 | | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 0.18 | 0.15 | 0.12 | 0.09 | 0.06 | 0.02 | -0.01 |
| | 5.33% | 0.17 | 0.13 | 0.10 | 0.07 | 0.04 | 0.01 | -0.03 |
| | 2.67% | 0.14 | 0.11 | 0.07 | 0.04 | 0.01 | -0.02 | -0.06 |
| | 0% | 0.10 | 0.06 | 0.03 | 0.00 | -0.03 | -0.06 | -0.10 |
| 손익 구조 | -2.67% | 0.04 | 0.01 | -0.02 | -0.05 | -0.08 | -0.12 | -0.15 |
| | -5.33% | -0.02 | -0.05 | -0.08 | -0.12 | -0.15 | -0.18 | -0.21 |
| | -8% | -0.09 | -0.13 | -0.16 | -0.19 | -0.22 | -0.26 | -0.29 |
| | -10% | -0.16 | -0.20 | -0.24 | -0.28 | -0.32 | -0.36 | -0.39 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.29 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.39 |
|-----|------|

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

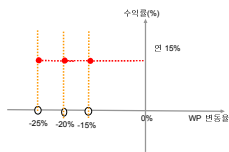
| | | | | | | |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2280.8 | 0 | 2,280.8 | 상위 |

단위:백만원

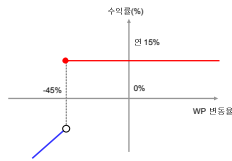
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 14.00 | 11.56 | 9.11 | 6.67 | 4.22 | 1.78 | -0.66 |
| 시나리오 | 5.33% | 12.65 | 10.21 | 7.76 | 5.32 | 2.87 | 0.43 | -2.01 |
| | 2.67% | 10.43 | 7.99 | 5.54 | 3.10 | 0.65 | -1.79 | -4.24 |
| | 0% | 7.33 | 4.89 | 2.44 | 0.00 | -2.44 | -4.89 | -7.33 |
| | -2.67% | 3.37 | 0.92 | -1.52 | -3.97 | -6.41 | -8.86 | -11.30 |
| | -5.33% | -1.48 | -3.92 | -6.37 | -8.81 | -11.25 | -13.70 | -16.14 |
| | -8% | -7.19 | -9.64 | -12.08 | -14.52 | -16.97 | -19.41 | -21.86 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -21.86 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 29.57 |
|-----|-------|

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호 [EL]

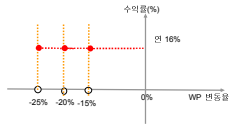
1. 계약금액

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

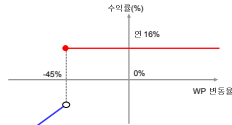
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 10%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 110%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조범위 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 0.44 | 0.35 | 0.27 | 0.18 | 0.09 | 0.00 | -0.08 |
| | 5.33% | 0.40 | 0.32 | 0.23 | 0.14 | 0.05 | -0.03 | -0.12 |
| | 2.67% | 0.34 | 0.26 | 0.17 | 0.08 | -0.01 | -0.09 | -0.18 |
| 시나리오 | 0% | 0.26 | 0.17 | 0.09 | 0.00 | -0.09 | -0.17 | -0.26 |
| | -2.67% | 0.16 | 0.07 | -0.02 | -0.10 | -0.19 | -0.28 | -0.36 |
| | -5.33% | 0.03 | -0.05 | -0.14 | -0.23 | -0.32 | -0.40 | -0.49 |
| | -8% | -0.12 | -0.20 | -0.29 | -0.38 | -0.46 | -0.55 | -0.64 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.64 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.58 |
|-----|------|

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

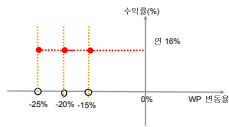
1. 계약금액

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

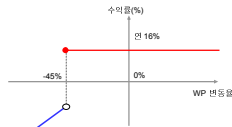
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 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 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|-------|-------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 7.88 | 6.32 | 4.76 | 3.20 | 1.64 | 0.08 | -1.47 |
| 손익 | 5.33% | 7.20 | 5.65 | 4.09 | 2.53 | 0.97 | -0.59 | -2.15 |
| 시나리오 | 2.67% | 6.14 | 4.58 | 3.02 | 1.46 | -0.10 | -1.66 | -3.22 |
| | 0% | 4.68 | 3.12 | 1.56 | 0.00 | -1.58 | -3.15 | -4.68 |
| | -2.67% | 2.82 | 1.26 | -0.29 | -1.85 | -3.41 | -4.97 | -6.53 |
| | -5.33% | 0.56 | -0.98 | -2.54 | -4.10 | -5.68 | -7.22 | -8.78 |
| | -8% | -2.06 | -3.62 | -5.18 | -6.74 | -8.30 | -9.86 | -11.42 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -11.42 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 10.30 |
|-----|-------|

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

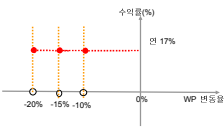
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2000.0 | 0 | 2,000.0 | 상위 |

단위: (백만원)

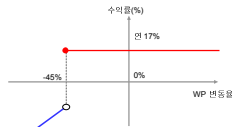
2. 연가시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 현대차 보통주
- 연가: 2012년 4월 27일
- 연도청산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2009년 4월 30일 LG전자 보통주, 현대차 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 현대차 보통주 주가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85% 이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권리 행사
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 55% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (연가 기준지수/최초 기준지수)
- 연도 청산 수익구조

조기상환 시 손익구조



연가시 손익구조



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

| 손익 구조변동 시나리오 | | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|--------------|--------|----------|-------|---------|--------|-------|-------|--------|
| | | 구분 | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 2.96 | 2.52 | 2.08 | 1.64 | 1.21 | 0.77 | 0.33 |
| | 5.33% | 2.51 | 2.07 | 1.63 | 1.19 | 0.75 | 0.32 | -0.12 |
| | 2.67% | 1.96 | 1.52 | 1.08 | 0.64 | 0.21 | -0.23 | -0.67 |
| | 0% | 1.32 | 0.88 | 0.44 | 0.00 | -0.44 | -0.88 | -1.32 |
| | -2.67% | 0.56 | 0.14 | -0.30 | -0.74 | -1.18 | -1.62 | -2.06 |
| -5.33% | -0.26 | -0.70 | -1.14 | -1.58 | -2.02 | -2.46 | -2.90 | |
| -8% | -1.20 | -1.64 | -2.07 | -2.51 | -2.95 | -3.39 | -3.83 | |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -3.83 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 7.23 |
|-----|------|

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

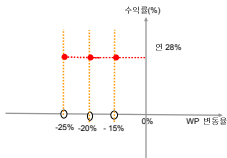
| | | | | | | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 833.3 | 0 | 833.3 | 상위 |

단위:백만원

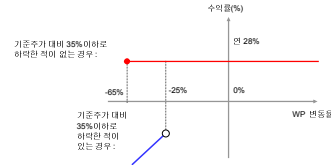
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대차 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2012년 4월 27일
- 3) 만드칭산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 30일 현대차 보통주, 삼성중공업 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(현대차 보통주, 삼성중공업 보통주 주가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 만을 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우
 : 원금 * 128%
 - 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 45.28 | 34.39 | 23.49 | 12.60 | 1.71 | -9.18 | -20.07 |
| 시나리오 | 5.33% | 42.00 | 31.11 | 20.22 | 9.33 | -1.57 | -12.46 | -23.35 |
| | 2.67% | 37.80 | 26.91 | 16.02 | 5.13 | -5.77 | -16.66 | -27.55 |
| | 0% | 32.68 | 21.78 | 10.89 | 0.00 | -10.89 | -21.78 | -32.68 |
| | -2.67% | 26.63 | 15.73 | 4.84 | -6.09 | -16.94 | -27.84 | -38.73 |
| | -5.33% | 19.65 | 8.76 | -2.13 | -13.05 | -23.92 | -34.81 | -45.71 |
| | -8% | 11.75 | 0.86 | -10.03 | -20.93 | -31.82 | -42.71 | -53.60 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -53.60 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 37.08 |
|-----|-------|

[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호

1. 계약금액

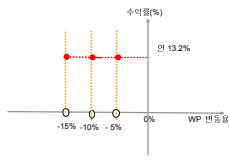
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1810.3 | 0 | 1,810.3 | 잔위 |

단위:백만원

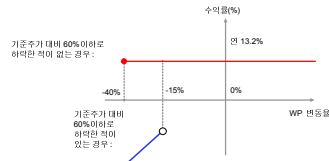
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% |
| 기초자산 | 8% | 0.03 | 0.03 | 0.03 | 0.03 | 0.03 | 0.03 |
| 시나리오 | 5.33% | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 |
| | 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% | -0.01 | -0.01 | -0.01 | -0.01 | -0.01 | -0.01 |
| | -8% | -0.02 | -0.02 | -0.02 | -0.02 | -0.02 | -0.02 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.02 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 2.21 |
|-----|------|

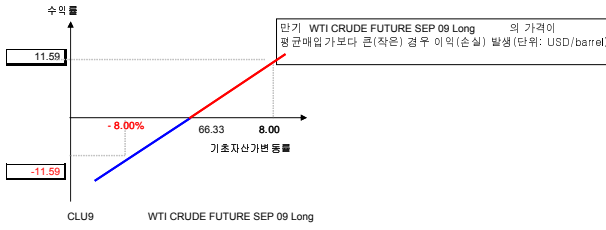
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 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 |
|-----|----|

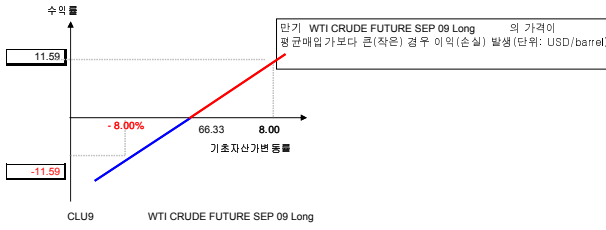
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

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 | |
|------|--------|--------|
| 기초자산 | 8% | 44.15 |
| | 5.33% | 29.42 |
| | 2.67% | 14.74 |
| 시나리오 | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -14.74 |
| | -5.33% | -29.42 |
| | -8% | -44.15 |

| 최대 손실 시나리오 | |
|------------|--------|
| 위험액 | -44.15 |

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

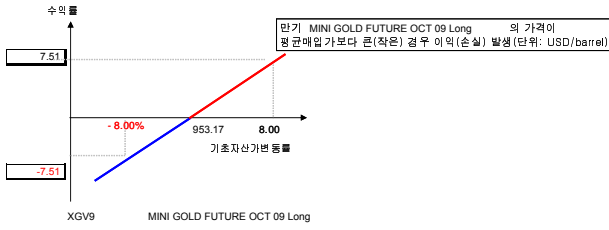
| | |
|-----|-----|
| 위험액 | 179 |
|-----|-----|

[96-2] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



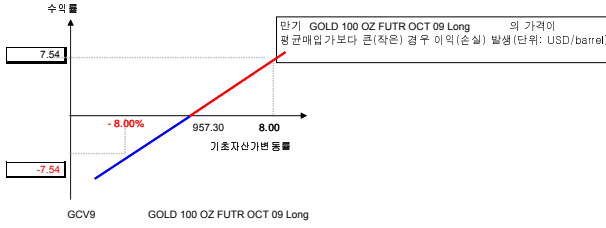
[96-3] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조

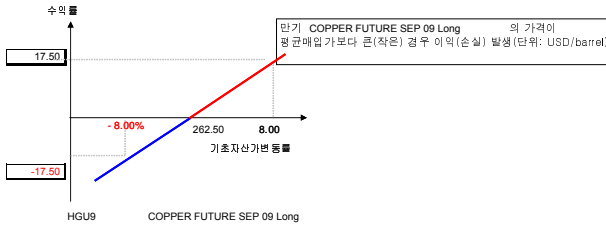


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 헷지시점의 손익 구조

