

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

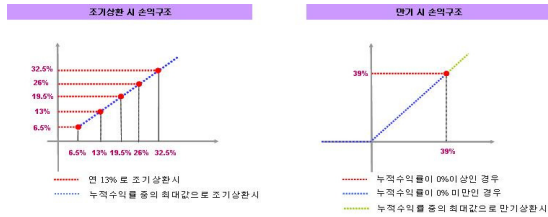
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.12
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.41
-----	------

14) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

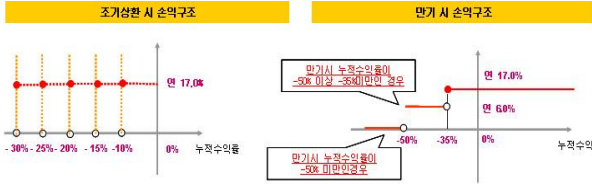
3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(한국전력 보통주, KT&G 보통주)의 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 시나리오	8%	0.01	0.01	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.00
	5.33%	0.01	0.01	0.00	0.00	0.00	-0.00	-0.00
	2.67%	0.01	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	0%	0.01	0.00	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	-2.67%	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01
-5.33%	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	
-8%	-0.00	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.02	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.02
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모펀위괴생상품투자신탁 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

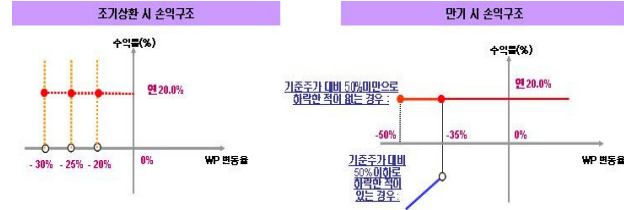
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 \* 140%

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

: 할금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력작성증권(ELS)243

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	11.72	10.83	9.94	9.05	8.15	7.26	6.37
	5.33%	8.97	8.07	7.18	6.29	5.40	4.51	3.61
	2.67%	5.95	5.06	4.17	3.27	2.38	1.49	0.60
	0%	2.68	1.78	0.89	0.00	-0.89	-1.78	-2.68
	-2.67%	-0.86	-1.75	-2.64	-3.53	-4.42	-5.32	-6.21
	-5.33%	-4.65	-5.54	-6.43	-7.32	-8.22	-9.11	-10.00
	-8%	-8.70	-9.59	-10.48	-11.37	-12.27	-13.16	-14.05

최대 손실 시나리오

위험액	-14.05
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.71
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모펀위 과정상물투자신탁 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) 상위파생상품의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345TTB9 최대주주(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	14.72	13.99	13.26	12.54	11.81	11.08	10.35
손익	5.33%	10.47	9.74	9.01	8.28	7.55	6.82	6.10
손익	2.67%	6.29	5.56	4.83	4.10	3.37	2.65	1.92
손익	0%	2.18	1.46	0.73	0.00	-0.73	-1.46	-2.18
손익	-2.67%	-1.84	-2.57	-3.30	-4.03	-4.75	-5.48	-6.21
손익	-5.33%	-5.79	-6.52	-7.25	-7.98	-8.70	-9.43	-10.16
손익	-8%	-9.66	-10.39	-11.12	-11.85	-12.58	-13.31	-14.03

최대 손실 시나리오

위험액 -14.03

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 16.66

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연기: 2010년 2월 22일

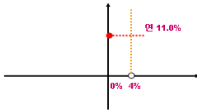
3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

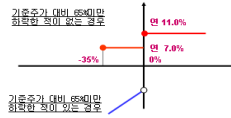
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이 상한 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확인 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 원본투자 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%  
 -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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 변동증권(ELS) 2007-397세

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	439.79	418.60	397.41	376.22	355.03	333.84	312.65
손익	5.33%	313.07	291.88	270.69	249.50	228.31	207.13	185.94
손익	2.67%	187.67	166.48	145.29	124.10	102.91	81.72	60.53
손익	0%	63.57	42.38	21.19	0.00	-21.19	-42.38	-63.57
손익	-2.67%	-59.22	-80.41	-101.60	-122.79	-143.98	-165.17	-186.36
손익	-5.33%	-180.70	-201.89	-223.08	-244.27	-265.46	-286.65	-307.84
손익	-8%	-300.88	-322.07	-343.26	-364.45	-385.64	-406.82	-428.01

최대 손실 시나리오

위험액	-428.01
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	416.23
-----	--------

**[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 연가시점의 수익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

연월 11.2%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

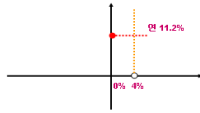
- 두 기초자산의 가격이 환비도 기준가격의 65%이하 하락한적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 \* 121%

- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이하 하락한적이 있는 경우

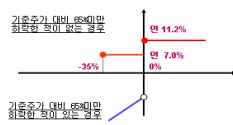
: 원금 \* (연가기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 수익구조**



**연가 시 수익구조**



**3. 수익구조의 범위(최대 손실가능금액)(단위:백만원)**

KR600345ST27 환비 운반 (ELS) 2007-398회

**수익구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	42.59	40.57	38.55	36.53	34.50	32.48	30.46
시나리오	5.33%	30.26	28.24	26.22	24.19	22.17	20.15	18.12
	2.67%	18.09	16.06	14.04	12.02	10.00	7.97	5.95
	0%	6.07	4.05	2.02	0.00	-2.02	-4.05	-6.07
	-2.67%	-5.79	-7.82	-9.84	-11.86	-13.88	-15.91	-17.93
	-5.33%	-17.50	-19.52	-21.54	-23.57	-25.59	-27.61	-29.63
	-8%	-29.04	-31.07	-33.09	-35.11	-37.14	-39.16	-41.18

**최대 손실 시나리오**

위험액	-41.18
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	40.14
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

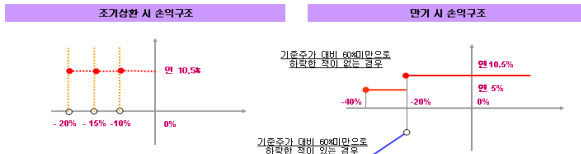
1. 계약금액

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

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		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	523.40	489.38	455.37	421.35	387.33	353.31	319.30
	5.33%	401.07	367.05	333.03	299.02	265.00	230.98	196.96
	2.67%	260.62	226.60	192.58	158.57	124.55	90.53	56.51
	0%	102.05	68.03	34.02	0.00	-34.02	-68.03	-102.05
	-2.67%	-74.63	-108.65	-142.67	-176.68	-210.70	-244.72	-278.73
	-5.33%	-269.43	-303.45	-337.46	-371.48	-405.50	-439.52	-473.53
	-8%	-482.35	-516.36	-550.38	-584.40	-618.42	-652.43	-686.45

최대 손실 시나리오	
위험액	-686.45

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	725.22
-----	--------



[10] 메리츠 글리벳 단위파생상품투자신탁 3호

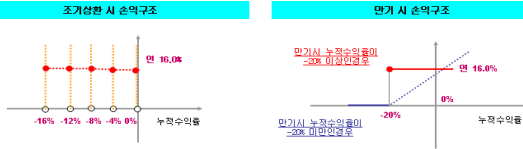
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS/2007=504)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.10	1.03	0.96	0.89	0.82	0.75	0.68
	5.33%	0.77	0.70	0.63	0.56	0.49	0.42	0.35
	2.67%	0.47	0.40	0.34	0.27	0.20	0.13	0.06
	0%	0.21	0.14	0.07	0.00	-0.07	-0.14	-0.21
	-2.67%	-0.03	-0.10	-0.17	-0.24	-0.31	-0.37	-0.44
	-5.33%	-0.23	-0.30	-0.37	-0.44	-0.51	-0.58	-0.65
	-8%	-0.41	-0.48	-0.55	-0.62	-0.69	-0.76	-0.83

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	5.28
-----	------

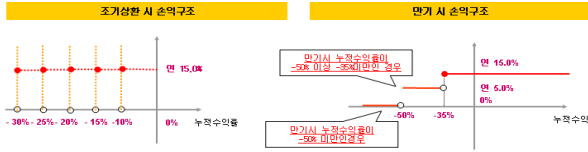
111] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762C780 비례예상종형(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.33	0.98	0.63	0.28	-0.07	-0.42	-0.78
	5.33%	1.30	0.95	0.60	0.24	-0.11	-0.46	-0.81
	2.67%	1.21	0.85	0.50	0.15	-0.20	-0.55	-0.90
	0%	1.05	0.70	0.35	0.00	-0.35	-0.70	-1.05
	-2.67%	0.84	0.49	0.14	-0.21	-0.56	-0.91	-1.27
	-5.33%	0.57	0.22	-0.13	-0.48	-0.83	-1.19	-1.54
	-8%	0.24	-0.11	-0.46	-0.82	-1.17	-1.52	-1.87

최대 손실 시나리오

위험액	-1.87
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.30
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

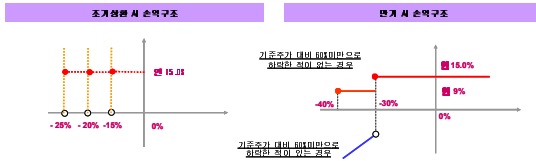
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762L197 미래예상점(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	251.67	248.12	244.57	241.02	237.48	233.93	230.38
손익	5.33%	181.02	177.47	173.92	170.38	166.83	163.28	159.73
손익	2.67%	100.68	97.13	93.58	90.04	86.49	82.94	79.39
손익	0%	10.64	7.09	3.55	0.00	-3.55	-7.09	-10.64
손익	-2.67%	-89.09	-92.64	-96.18	-99.73	-103.28	-106.82	-110.37
손익	-5.33%	-198.51	-202.06	-205.61	-209.15	-212.70	-216.25	-219.80
손익	-8%	-317.63	-321.18	-324.73	-328.27	-331.82	-335.37	-338.92

최대 손실 시나리오

위험액	-338.92
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	366.15
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제12호

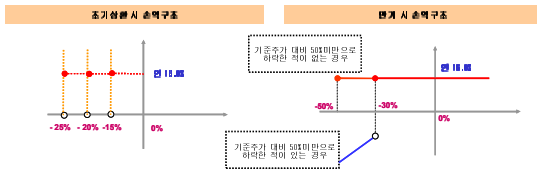
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



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

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	129.49	125.43	121.36	117.29	113.23	109.16	105.09
시나리오	5.33%	88.07	84.01	79.94	75.88	71.81	67.74	63.68
	2.67%	48.98	44.91	40.84	36.78	32.71	28.65	24.58
	0%	12.20	8.13	4.07	0.00	-4.07	-8.13	-12.20
	-2.67%	-22.26	-26.33	-30.39	-34.46	-38.52	-42.59	-46.66
	-5.33%	-54.40	-58.46	-62.53	-66.59	-70.66	-74.73	-78.79
	-8%	-84.21	-88.28	-92.35	-96.41	-100.48	-104.54	-108.61

최대 손실 시나리오

위험액	-108.61
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	115.20
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

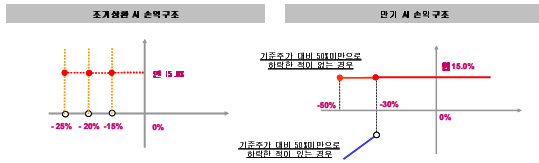
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 30일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 2일의 LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(LG필립스LCD, LG화학 보통주)의 중도상환가격이 낮은 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 수익률로 중도 상환이 됨.  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 \* 130%  
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762BT80 미래예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.42	5.16	4.90	4.64	4.38	4.13	3.87
	5.33%	4.01	3.75	3.49	3.24	2.98	2.72	2.46
	2.67%	2.46	2.21	1.95	1.69	1.43	1.17	0.91
	0%	0.78	0.52	0.26	0.00	-0.26	-0.52	-0.78
	-2.67%	-1.05	-1.31	-1.57	-1.83	-2.09	-2.35	-2.60
	-5.33%	-3.02	-3.28	-3.54	-3.80	-4.06	-4.31	-4.57
	-8%	-5.13	-5.39	-5.65	-5.90	-6.16	-6.42	-6.68

최대 손실 시나리오

위험액 -6.68

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 6.46

[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

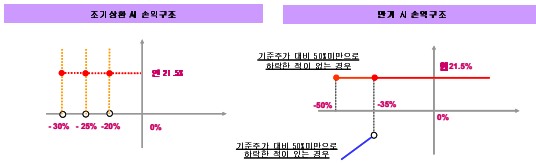
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품의 기초자산: LG더 스톱레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010 년 01월 07일
- 3) 만드첨산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG더 스톱레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(LG더 스톱레이 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 최대 손실(ELS)/2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	220.25	196.42	172.56	148.75	124.92	101.09	77.26
	5.33%	170.66	146.83	122.99	99.16	75.33	51.50	27.67
	2.67%	121.07	97.24	73.41	49.58	25.75	1.92	-21.92
	0%	71.49	47.66	23.83	0.00	-23.83	-47.66	-71.49
	-2.67%	21.92	-1.91	-25.74	-49.57	-73.40	-97.24	-121.07
	-5.33%	-27.64	-51.48	-75.31	-99.14	-122.97	-146.80	-170.63
	-8%	-77.21	-101.04	-124.87	-148.70	-172.53	-196.36	-220.19

최대 손실 시나리오

위험액	-220.19
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	239.51
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 괴상상물 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

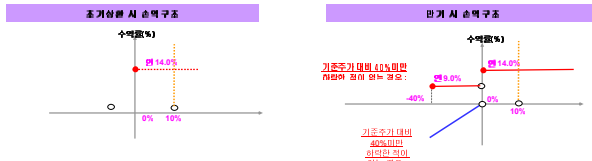
3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 보유종류(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	538.53	519.63	500.72	481.81	462.91	444.00	425.09
	5.33%	385.36	366.45	347.54	328.64	309.73	290.82	271.92
시나리오	2.67%	224.75	205.85	186.94	168.03	149.13	130.22	111.31
	0%	56.72	37.81	18.91	0.00	-18.91	-37.81	-56.72
	-2.67%	-118.74	-137.65	-156.55	-175.46	-194.37	-213.28	-232.18
	-5.33%	-301.63	-320.54	-339.44	-358.35	-377.26	-396.16	-415.07
	-8%	-491.95	-510.85	-529.76	-548.67	-567.57	-586.48	-605.39

최대 손실 시나리오

위험액	-605.39
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	578.39
-----	--------

[17]테리 조StepDown사모단위 편성26호

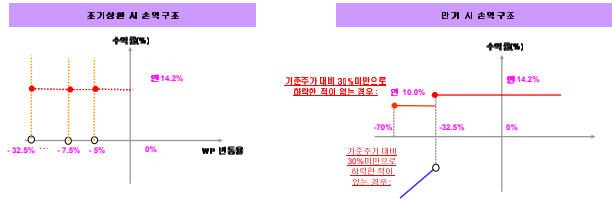
1. 계약금액

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 기간을 설정하고, 기초자산(CJ 보통주)의 최초기준가격의 95%(1차중도상환일), 92.5%(2차중도상환일), 90.0%(3차중도상환일), 87.5%(4차중도상환일), 85%(5차중도상환일), 82.5%(6차중도상환일), 80%(7차중도상환일), 77.5%(8차중도상환일), 75%(9차중도상환일), 72.5%(10차중도상환일), 70.0%(11차중도상환일), 67.5%(만기상환일) 이상인 경우 만이율 14.2%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 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 시나리오	8%	215.38	184.26	153.15	122.03	90.92	59.80	28.69
	5.33%	175.01	143.89	112.76	81.66	50.55	19.43	-11.69
	2.67%	134.33	103.21	72.10	40.98	9.87	-21.25	-52.36
	0%	93.35	62.23	31.12	0.00	-31.12	-62.23	-93.35
	-2.67%	52.06	20.94	-10.17	-41.29	-72.40	-103.52	-134.63
	-5.33%	10.47	-20.65	-51.76	-82.68	-113.99	-145.11	-176.22
	-8%	-31.43	-62.54	-93.66	-124.77	-155.89	-187.00	-218.12

최대 손실 시나리오  
위험액 -218.12

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 217.69



[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

1. 계약금액

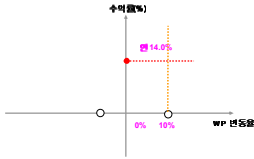
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	잔위

단위(백만원)

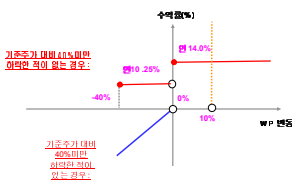
2. 만기시점의 수익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	99.31	93.77	88.23	82.69	77.14	71.60	66.06	
손익	5.33%	2.67%	0%	-2.67%	-5.33%	-8.00%	-10.67%	
손익	43.63	38.09	32.55	27.01	21.47	15.92	10.38	
손익	16.63	11.08	5.54	0.00	-5.54	-11.08	-16.63	
손익	-9.83	-15.37	-20.91	-26.45	-32.00	-37.54	-43.08	
손익	-35.73	-41.27	-46.81	-52.36	-57.90	-63.44	-68.98	
손익	-61.06	-66.60	-72.14	-77.69	-83.23	-88.78	-94.33	

최대 손실 시나리오

위험액	66.06
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	92.02
-----	-------

[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	잔위

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

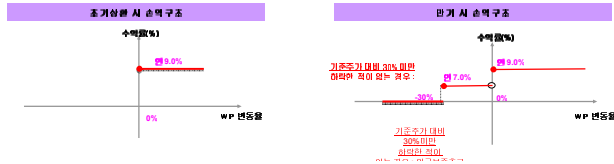
단, 평가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금\*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산 시나리오	8%	44.73	41.39	38.04	34.70	31.35	28.01	24.66
	5.33%	33.89	30.54	27.20	23.85	20.50	17.16	13.81
	2.67%	22.32	18.98	15.63	12.28	8.94	5.59	2.25
	0%	10.04	6.69	3.35	0.00	-3.35	-6.69	-10.04
	-2.67%	-2.97	-6.31	-9.66	-13.00	-16.35	-19.69	-23.04
	-5.33%	-16.69	-20.04	-23.38	-26.73	-30.07	-33.42	-36.76
-8%	-31.14	-34.48	-37.83	-41.17	-44.52	-47.86	-51.21	

최대 손실 시나리오

위험액	24.66
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	50.93
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단원 피싱 6호

1. 계약금액

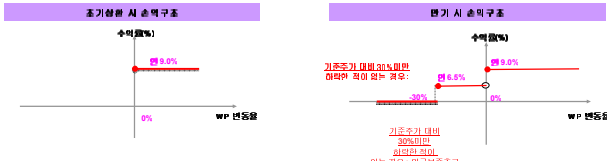
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,080	0	1,080	잔위

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

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

단, 평가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 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%	32.28	29.50	26.72	23.94	21.16	18.38	15.59
	5.33%	24.90	22.12	19.33	16.55	13.77	10.99	8.21
	2.67%	16.92	14.14	11.36	8.57	5.79	3.01	0.23
	0%	8.34	5.56	2.78	0.00	-2.78	-5.56	-8.34
	-2.67%	-0.83	-3.61	-6.39	-9.17	-11.95	-14.73	-17.51
	-5.33%	-10.60	-13.38	-16.16	-18.94	-21.72	-24.50	-27.28
	-8%	-20.96	-23.74	-26.52	-29.30	-32.08	-34.86	-37.64

최대 손실 시나리오

위험액	15.59
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	37.91
-----	-------

[2] 메리츠치주연계사모단위파생7호

1. 계약금액

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

단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 21일 KOSPI200의 증가

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

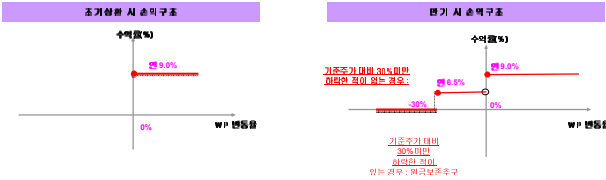
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가격이 만도 기 준가격의 70%미만 하락한 적이 없고, 최초기 준가격보다 작은 경우: 원금 \* 119.5%

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

: 원금\*100%

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래예정종금(ELS)317

손익 구조변동률 시나리오

구분		변동률 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산	8%	25.11	22.94	20.78	18.62	16.45	14.29	12.13
	5.33%	19.36	17.20	15.04	12.88	10.71	8.55	6.39
시나리오	2.67%	13.16	11.00	8.83	6.67	4.51	2.34	0.18
	0%	6.49	4.33	2.16	0.00	-2.16	-4.33	-6.49
	-2.67%	-0.64	-2.81	-4.97	-7.13	-9.30	-11.46	-13.62
	-5.33%	-8.24	-10.40	-12.57	-14.73	-16.89	-19.06	-21.22
	-8%	-16.30	-18.46	-20.63	-22.79	-24.95	-27.12	-29.28

최대 손실 시나리오

위험액	12.13
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.48
-----	-------

[23] 메리츠증권지수연계사모파생1호

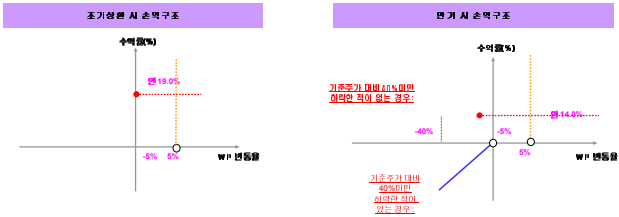
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수
- 만기: 2010년 08월 04일
- 관드첨산 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 상승포함하여 한방이라도 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 관드첨  
 - 두 기초자산의 가격이 한방도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 \* 138%  
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/초기 기준지수)
- 관드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 무리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	137.89	128.18	118.47	108.76	99.05	89.34	79.63
	5.33%	102.39	92.68	82.97	73.26	63.55	53.84	44.13
	2.67%	66.13	56.42	46.71	37.00	27.29	17.58	7.87
	0%	29.13	19.42	9.71	0.00	-9.71	-19.42	-29.13
	-2.67%	-8.62	-18.33	-28.04	-37.75	-47.46	-57.17	-66.88
	-5.33%	-47.12	-56.83	-66.54	-76.25	-85.96	-95.67	-105.38
	-8%	-86.37	-96.08	-105.79	-115.50	-125.21	-134.92	-144.63

최대 손실 시나리오	
위험액	-144.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	144.60
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품 SEPO-1호

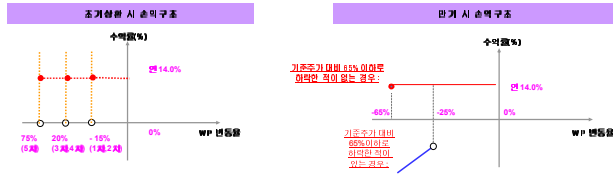
1. 계약금액

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 중도 상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세 번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 만일 14.0%의 수익률로 중도 상환이 될 단, 만기시 까지 조기 상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 확정
  - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 48%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우
    - : 원금 \* 142%
  - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 45%미만으로 하락한 적이 있는 경우
    - : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR652307WR2 보유종류(ELS)2723

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37
	5.33%	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17
	2.67%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
	-5.33%	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17
	-8%	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37	-0.37

최대 손실 시나리오

위험액	-0.37
-----	-------

4. 파생 상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

[25] 테라즈 주가지수연계사모펀생상품 제 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

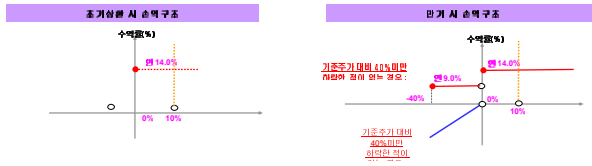
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 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 시나리오	8%	660.05	636.87	613.70	590.53	567.35	544.18	521.01
	5.33%	472.31	449.14	425.96	402.79	379.62	356.44	333.27
	2.67%	275.47	252.29	229.12	205.95	182.77	159.60	136.43
	0%	69.52	46.35	23.17	0.00	-23.17	-46.35	-69.52
	-2.67%	-145.53	-168.70	-191.88	-215.05	-238.22	-261.40	-284.57
	-5.33%	-369.69	-392.86	-416.03	-439.21	-462.38	-485.55	-508.73
	-8%	-602.95	-626.12	-649.29	-672.47	-695.64	-718.81	-741.99

최대 손실 시나리오

위험액 -741.99

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 708.89

**[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1**

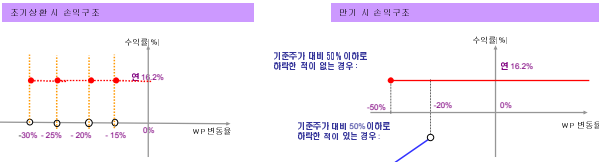
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재
- 2) 만기: 2010년 09월 30일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 삼성화재)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일), 70%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연달아 16.2%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시점까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 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%	-0.46	-0.49	-0.52	-0.55	-0.58	-0.61	-0.64
	5.33%	-0.08	-0.11	-0.14	-0.17	-0.20	-0.23	-0.26
	2.67%	0.10	0.07	0.04	0.01	-0.02	-0.05	-0.08
	0%	0.09	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09
	-2.67%	-0.12	-0.15	-0.18	-0.21	-0.24	-0.27	-0.30
	-5.33%	-0.53	-0.56	-0.59	-0.62	-0.65	-0.68	-0.71
	-8%	-1.13	-1.16	-1.19	-1.22	-1.25	-1.28	-1.31

**최대손실 시나리오**

위험액 -1.31

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액 0.94



[29] 테라즈2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

2) 만기: 2011년 09월 23일

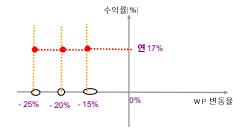
3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

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

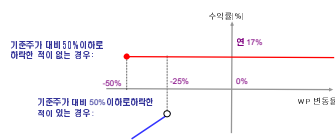
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 변율17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.  
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 151.0%  
 - 두 기초자산의 가액(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%	1.69	0.34	-1.01	-2.36	-3.71	-5.06	-6.42
	5.33%	4.84	3.49	2.14	0.79	-0.56	-1.91	-3.26
	2.67%	5.63	4.28	2.93	1.57	0.22	-1.13	-2.48
	0%	4.05	2.70	1.35	0.00	-1.35	-2.70	-4.05
	-2.67%	0.11	-1.24	-2.59	-3.94	-5.29	-6.64	-7.99
	-5.33%	-6.19	-7.54	-8.89	-10.24	-11.59	-12.94	-14.29
	-8%	-14.85	-16.20	-17.55	-18.90	-20.25	-21.60	-22.95

최대 손실 시나리오

위험액 -22.95

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 32.36

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 09월 20일

3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

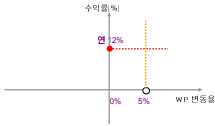
: 원금 \* 124%

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

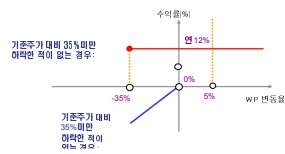
: 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조인 중(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액 0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 0.00

**[34] 대리 조주가지 수익계 파생13**

**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 1월 12일

3) 펀드청산 결정주기: 만기일 가일 1회

4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가

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

- 만기평가일 수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우

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

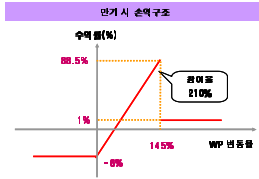
- 만기평가일 수가 최초기준가격 미만일 경우

: 원금 \* 94%

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

: 원금 \* 101%

6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조변동(최대 손실 가능 금액 (단위:백만원))**

KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-61.75	-69.29	-76.83	-84.38	-91.92	-99.46	-107.01
	5.33%	-31.09	-38.63	-46.16	-53.72	-61.26	-68.81	-76.35
	2.67%	-2.96	-10.51	-18.05	-25.59	-33.14	-40.68	-48.22
	0%	22.63	15.09	7.54	0.00	-7.54	-15.09	-22.63
	-2.67%	45.69	38.15	30.60	23.06	15.52	7.98	0.43
	-5.33%	66.22	58.68	51.13	43.59	36.05	28.50	20.96
	-8%	84.22	76.67	69.13	61.59	54.04	46.50	38.96

최대 손실 시나리오

위험액 38.96

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액 99.02

**[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호**

**1. 계약금액**

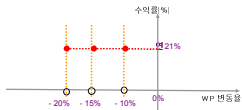
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

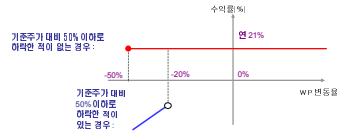
**2. 만기시점의 손익구조**

- 파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 만기: 2012년 02월 15일
- 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 한번이상 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%	
기초자산 시나리오	8%	9.51	8.07	6.63	5.19	3.76	2.32	0.88
	5.33%	8.38	6.94	5.50	4.06	2.63	1.19	-0.25
	2.67%	6.64	5.21	3.77	2.33	0.90	-0.54	-1.98
	0%	4.31	2.87	1.44	0.00	-1.44	-2.87	-4.31
	-2.67%	1.38	-0.06	-1.50	-2.93	-4.37	-5.81	-7.25
	-5.33%	-2.16	-3.59	-5.03	-6.47	-7.91	-9.34	-10.78
	-8%	-6.29	-7.73	-9.17	-10.61	-12.04	-13.48	-14.92

최대 손실 시나리오

위험액	-14.92
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	13.90
-----	-------

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

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

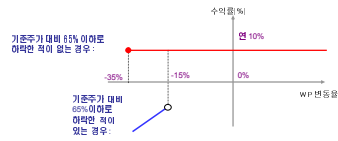
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**3. 손익구조변동/최대 손실 가능 금액 (다위:백만원)**

메리츠주가지수연계사모증권2호

**손익구조변동 시나리오**

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

**최대 손실 시나리오**

위험액	0.00
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

**[80-2] 메리츠투자지수형계사모증권2호**  
 KR600594WVJ5 우리투자증권(ELS)1989

**1. 계약금액**

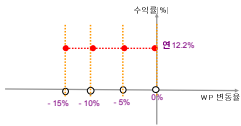
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위(백만원)

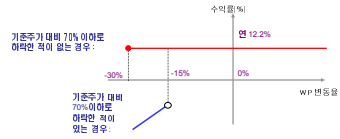
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교**  
 KR600690MM/M7 당우증권ELS2697

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

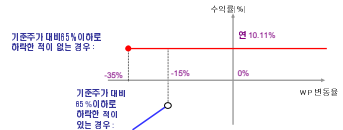
**2. 연기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 14일
- 3) 펀드형산 결정주기: 매4개월
- 4) 기 존지 수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도 상환 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지 수의 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 한반도 기 준가액 의 85% 미만으로 하락한 적 이 없고, 최초 기 준 가액 의 85%보다 작은 경우  
 : 원금 \* 110.11%  
 - 두 기 초자산의 가액 (장종 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가액 의 65%미만으로 하락한 적 이 있는 경우  
 : 원금 \* (만기 기 존지 수/최 초기 존지 수)
- 6) 펀 드의 수익구 조

**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 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이

낮은기초자산기준으로 각각 최초기준가격의 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 수익확정 후 만도침지

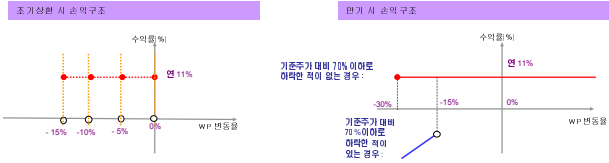
- 두 기초자산의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 \* 111%

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

: 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조





**[80-5] 메리츠투자지수형계사로종업2호**  
 KR6008679V84 롯데당 신안증권(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

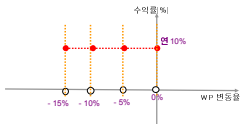
3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가

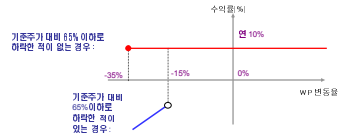
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 110.0%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



**[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

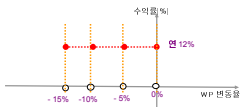
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

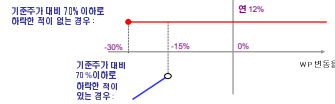
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한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

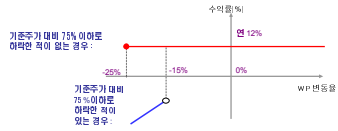
**2. 평가시점의 손익구조**

- 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, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네 번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 두 기 초자산의 가격이 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 112%  
 - 두 기 초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권 드의 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 준지 수 : 2008년 6월 18일 KOSPI200지수의 증가

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

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

만들 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

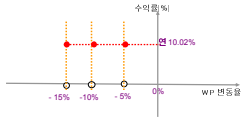
: 원금 \* 110.02%

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

: 원금 \* (만기 기 준지 수/최 초기 준지 수)

6) 권 드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



기초자산 대비 85%이여도 하락한 척 이 없는 경우 :

-35%

-15%

0%

연 10.02%

WP 변동률

기초자산 대비 65%이여도 하락한 척 이 있는 경우 :

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

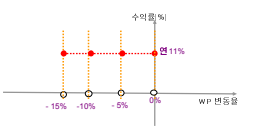
**1. 계약금액**

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

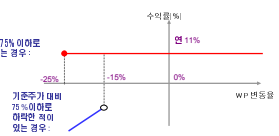
**2. 평가시점의 손익구조**

- 1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기 : 2009년 5월 14일
- 3) 권드청산 결정 주기 : 매3개월
- 4) 기 준지수 : 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네 번째 중도상환일) 만을 11%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 두 기 초자산의 가격이 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 111%  
 - 두 기 초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



[60-10] **메리츠주가지수연계사로증권2호**

1. **계약금액**

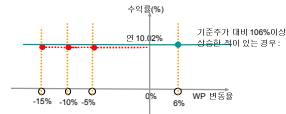
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7547.5	0	7,547.5	장외

단위(백만원)

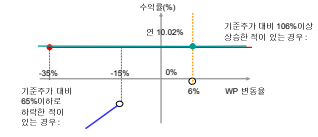
2. **연기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2011년 5월 27일
- 3) 만드청산 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 도래하는 중간평가일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급. 18개월 이후에 발생하면 만기일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급  
 단, 만기시 까지 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우  
   : 원금 \* 20.04%  
 - 두 기초자산의 가격(장중 포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우  
   : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHG-2

1. 계약금액

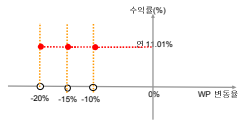
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	잔액

단위(백만원)

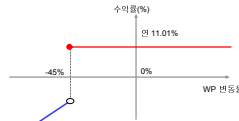
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.05	-0.05	-0.05
	5.33%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.01
	2.67%	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	-5.33%	-0.07	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06
	-8%	-0.13	-0.13	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12

최대 손실 시나리오

위험액	-0.12
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.16
-----	------

[62] 테리츠2Star사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

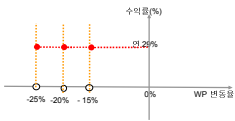
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순투자금(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위(백만원)

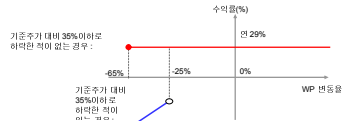
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 만드청산 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(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6622313W42 교보증권(ELS)325

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.03	0.32	-0.38	-1.09	-1.80	-2.50	-3.21
손익	5.33%	3.04	2.33	1.62	0.92	0.21	-0.50	-1.20
시나리오	2.67%	3.40	2.69	1.99	1.28	0.57	-0.13	-0.84
	0%	2.12	1.41	0.71	0.00	-0.71	-1.41	-2.12
	-2.67%	-0.80	-1.51	-2.21	-2.92	-3.63	-4.33	-5.04
	-5.33%	-3.36	-4.07	-4.78	-5.48	-6.19	-6.90	-7.60
	-8%	-1.57	-1.27	-1.98	-3.69	-4.39	-5.10	-5.81

최대 손실 시나리오

위험액	-15.81
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.88
-----	------



[66] 테리츠2Star사모증권LEHC-1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차

2) 만기: 2012년 4월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

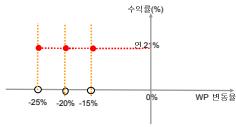
4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

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

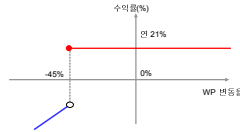
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55% 보다 이상인 경우  
 : 원금 + 121%  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.13	-0.13	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12	-0.12
시나리오	5.33%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.03	-0.03
	2.67%	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.01	0.01	0.01
	0%	-0.01	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.01
	-2.67%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.04	-0.04
	-5.33%	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14	-0.13	-0.13
	-8%	-0.28	-0.28	-0.28	-0.27	-0.27	-0.27	-0.27

최대 손실 시나리오

위험액	-0.27
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.36
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

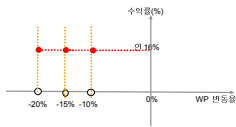
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

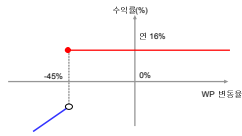
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 + 11.6%  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	2.52	1.99	1.47	0.95	0.43	-0.10	-0.62
시나리오	5.33%	2.87	2.35	1.83	1.30	0.78	0.26	-0.26
	2.67%	2.55	2.03	1.51	0.99	0.47	-0.06	-0.58
	0%	1.57	1.04	0.52	0.00	-0.52	-1.04	-1.57
	-2.67%	-0.09	-0.62	-1.14	-1.66	-2.18	-2.70	-3.23
	-5.33%	-2.42	-2.95	-3.47	-3.99	-4.51	-5.04	-5.56
	-8%	-5.43	-5.95	-6.47	-6.99	-7.52	-8.04	-8.56

최대 손실 시나리오

위험액	-8.56
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.51
-----	------

[65] 테리츠2Star사모증권POKB-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

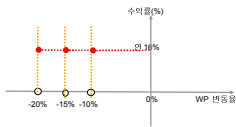
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

- 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55% 보다 이상인 경우 : 원금 + 11.6%

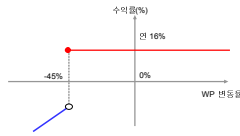
- 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 주권투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.15	0.12	0.09	0.06	0.03	-0.01	-0.04
시나리오	5.33%	0.17	0.14	0.11	0.08	0.05	-0.02	-0.02
	2.67%	0.15	0.12	0.09	0.06	0.03	-0.00	-0.03
	0%	0.09	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09
	-2.67%	-0.01	-0.04	-0.07	-0.10	-0.13	-0.16	-0.19
	-5.33%	-0.14	-0.18	-0.21	-0.24	-0.27	-0.30	-0.33
	-8%	-0.32	-0.36	-0.39	-0.42	-0.45	-0.48	-0.51

최대 손실 시나리오

위험액	-0.51
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.45
-----	------

[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) 만드청산 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.

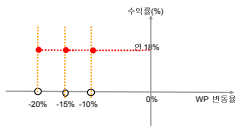
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

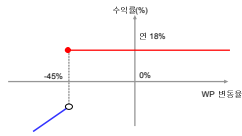
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우  
: 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	11.88	8.04	4.20	0.36	-3.48	-7.32	-11.16
시나리오	5.33%	13.98	10.14	6.30	2.46	-1.38	-5.22	-9.06
오	2.67%	13.86	10.02	6.18	2.34	-1.50	-5.34	-9.18
	0%	11.52	7.68	3.84	0.00	-3.84	-7.68	-11.52
	-2.67%	6.96	3.12	-0.72	-4.56	-6.40	-12.24	-16.08
	-5.33%	0.19	-3.66	-7.50	-11.34	-15.18	-19.02	-22.86
	-8%	-6.81	-12.65	-16.49	-20.33	-24.18	-28.02	-31.86

최대 손실 시나리오

위험액	-31.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.71
-----	-------

**[6B] 테리츠2Star사모증권SET-4호**

**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

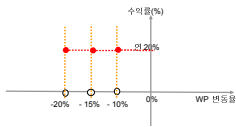
4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

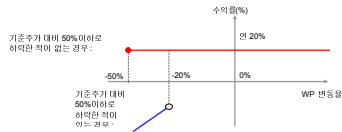
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 120%  
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))**

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.70	0.69	-0.32	-1.33	-2.34	-3.35	-4.35
시나리오	5.33%	3.45	2.44	1.44	0.43	-0.58	-1.59	-2.60
	2.67%	3.90	2.89	1.88	0.87	-0.14	-1.14	-2.15
	0%	3.02	2.02	1.01	0.00	-1.01	-2.02	-3.02
	-2.67%	0.84	-0.17	-1.16	-2.19	-3.19	-4.20	-5.21
	-5.33%	-2.66	-3.67	-4.68	-5.69	-6.69	-7.70	-8.71
	-8%	-7.48	-8.48	-9.49	-10.50	-11.51	-12.52	-13.52

최대 손실 시나리오

위험액	-13.52
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	12.48
-----	-------

[76] 데리츠2Star사로 SEST-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드칭산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

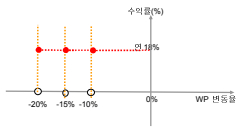
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우  
: 원금 \* 118%

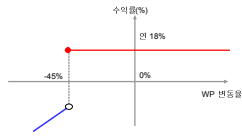
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우  
: 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	6.54	4.42	2.31	0.20	-1.91	-4.03	-6.14
시나리오	5.33%	7.69	5.58	3.47	1.35	-0.76	-2.87	-4.99
	2.67%	7.63	5.51	3.40	1.29	-0.83	-2.94	-5.05
	0%	6.34	4.23	2.11	0.00	-2.11	-4.23	-6.34
	-2.67%	3.83	1.72	-0.40	-2.51	-4.62	-6.73	-8.85
	-5.33%	0.10	-2.01	-4.12	-6.24	-8.35	-10.46	-12.58
	-8%	-4.85	-6.96	-9.07	-11.19	-13.30	-15.41	-17.52

최대 손실 시나리오

위험액	-17.52
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.34
-----	-------

[77] 테리츠2Star사로 SEST-3

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 29일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

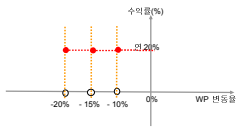
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

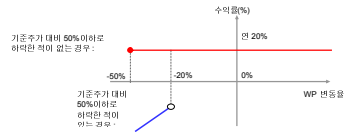
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 120%  
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	3.27	2.27	1.28	0.28	-0.71	-1.71	-2.70
시나리오	5.33%	3.90	2.90	1.91	0.91	-0.08	-1.07	-2.07
	2.67%	3.60	2.61	1.61	0.62	-0.17	-1.17	-2.16
	0%	2.98	1.99	0.99	0.00	-0.99	-1.99	-2.98
	-2.67%	1.44	0.44	-0.55	-1.55	-2.54	-3.54	-4.53
	-5.33%	-0.84	-1.83	-2.83	-3.82	-4.81	-5.81	-6.80
	-8%	-3.84	-4.83	-5.83	-6.82	-7.81	-8.81	-9.80

최대 손실 시나리오

위험액	-9.80
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	11.13
-----	-------

**[78] 테리츠2Star사로 STWF-2**

**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

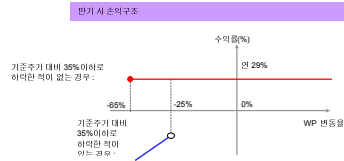
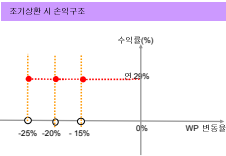
3) 만드상품 결제주기: 매6개월

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

5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융지주, 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, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12%
  - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조



**3. 수익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))**

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

**수익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오				
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%
기초자산	8%	0.90	0.28	-0.33	-0.95
시나리오	5.33%	2.64	2.03	1.41	0.80
	2.67%	2.96	2.34	1.73	1.11
	0%	1.88	1.23	0.62	0.00
	-2.67%	-0.70	-1.31	-1.93	-2.54
	-5.33%	-4.67	-5.28	-3.90	-6.51
	-8%	-1.07	-1.68	-1.30	-1.92
					6.33%
					16.67
					25%
					-2.79
					-1.05
					-0.73
					-1.85
					-4.39
					-8.36
					-13.76

**최대 손실 시나리오**

위험액	-13.76
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	8.60
-----	------



[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

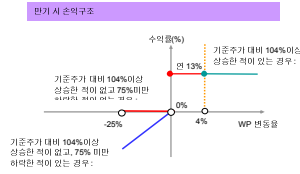
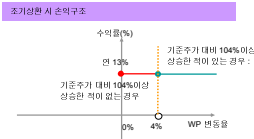
단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모6호

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	8.33%	1.67%	25%	
기초자산	8%	9,413,426	8,816,899	8,220,372	7,623,844	7,027,327	6,430,790	5,834,263
시나리오	5.33%	6,864,466	6,267,939	5,671,412	5,074,885	4,478,358	3,881,831	3,285,304
	2.67%	4,323,177	3,726,650	3,130,123	2,533,606	1,937,079	1,340,552	744,025
	0%	1,789,588	1,193,061	596,534	0.00	-596,534	-1,193,061	-1,789,588
	-2.67%	-736,333	-1,332,860	-1,929,387	-2,525,914	-3,122,441	-3,718,968	-4,315,495
	-5.33%	-3,254,555	-3,851,082	-4,447,619	-5,044,146	-5,640,673	-6,237,200	-6,833,727
	-8%	-5,765,098	-6,361,625	-6,958,162	-7,554,699	-8,151,226	-8,747,753	-9,344,280

최대 손실 시나리오

위험액	-9,344,280
-----	------------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,347,811
-----	-----------

**[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 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

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

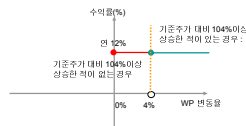
: 원금 \* 11.2%

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

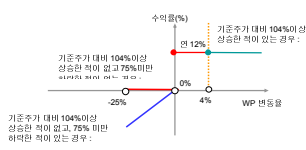
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

**조기상환시 수익구조**



**만기시 수익구조**



KR6030613TB2      교보증권(ELS)82

**[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호**

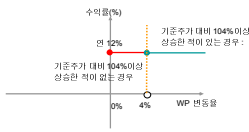
**1. 계약금액**

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

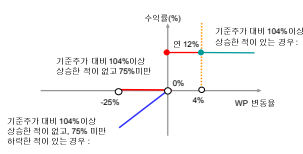
**2. 만기시점의 수익구조**

- 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 \* 112%
    - 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

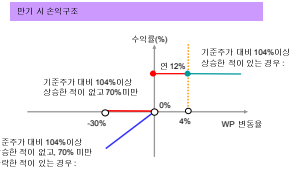
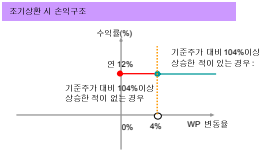
단위(백만원)

**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	차입

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 10일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

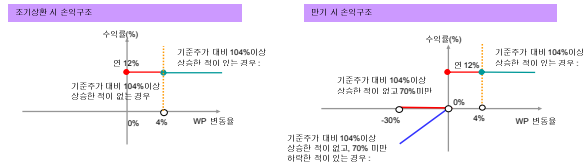
4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 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



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

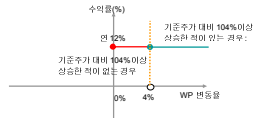
단위: (백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

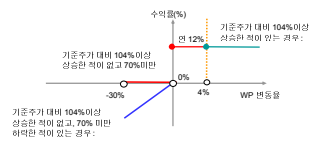
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 11월 19일
  - 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
  - 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
  - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기일을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정원에 최초기준가격 이상이거나 또는 원가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 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 코도넬 신한증권(ELS)804

**[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 15일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

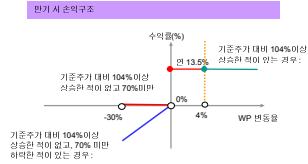
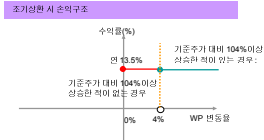
4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR60008675TC7    굿모닝 신한증권(ELS)809

**[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

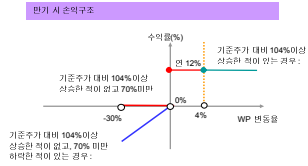
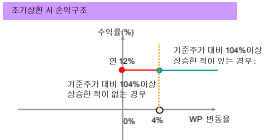
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000.0	0	5,000	차입

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산:KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 10월 15일
  - 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
  - 4) 기준지수: 2007년 10월 15일KOSPI200지수의 증가
  - 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 월기기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
- 두 기초자산의 가격이 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
    - : 원금 \* 11.2%
  - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 한나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
    - : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438



**[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

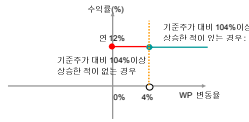
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위: (백만원)

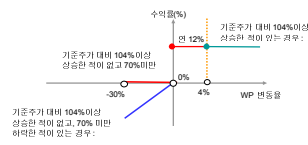
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 11월 08일
  - 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
  - 4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
  - 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
: 원금 \* 11.2%
  - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

**[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호**

**1. 계약금액**

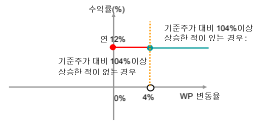
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

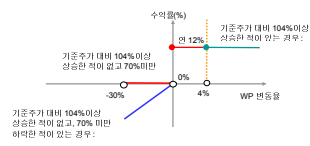
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 13일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

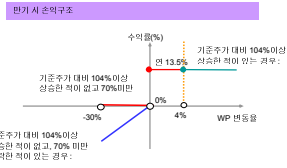
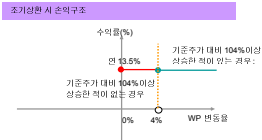
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월마다 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

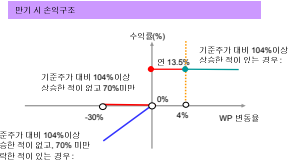
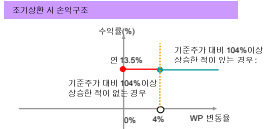
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환

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

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

**6) 펀드의 수익구조**



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

**[82] 데리 조주가지 수연계 사모증권5호**

**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우

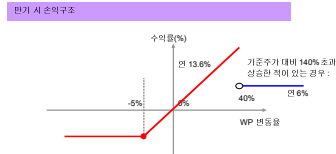
- 만기평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우  
: 원금 \* ( 95% + 100% \* ( 만기기준지수/최초기준지수 - 1 ) )

- 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우  
: 원금 \* 95%

기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우

: 원금 \* 108%

6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))**

KR6523317W30 대우증권ELS2881

구분	손익 구조변동률 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-3.16	-3.79	-4.42	-5.04	-5.67	-6.30	-6.93
시나리오	5.33%	-1.34	-1.97	-2.60	-3.23	-3.86	-4.48	-5.11
	2.67%	0.34	-0.29	-0.92	-1.55	-2.17	-2.80	-3.43
	0%	1.88	1.26	0.63	0.00	-0.63	-1.26	-1.88
	-2.67%	3.30	2.67	2.04	1.41	0.78	0.16	-0.47
	-5.33%	4.57	3.94	3.32	2.69	2.06	1.43	0.80
	-8%	5.71	5.09	4.46	3.83	3.20	2.57	1.94

**최대 손실 시나리오**

위험액	1.94
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	7.44
-----	------

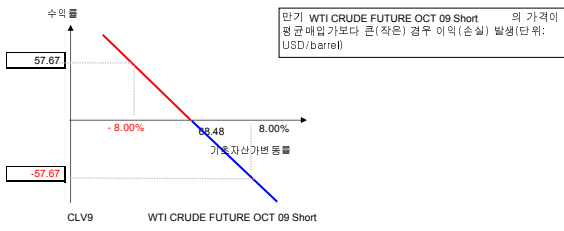
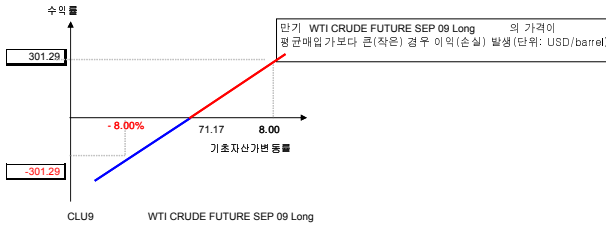
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

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%	243.63
	5.33%	162.32
	2.67%	81.31
	0%	0.00
	-2.67%	-81.31
	-5.33%	-162.32
	-8%	-243.63

최대손실 시나리오	
위험액	-243.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,454
-----	-------

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

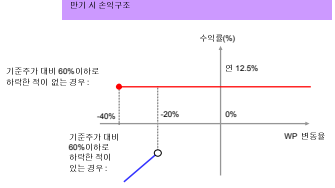
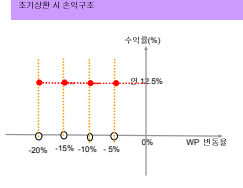
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우

: 원금 \* 112.5%

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

: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



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%
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	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] 데리츠주가지 수연계사모증권!61E**

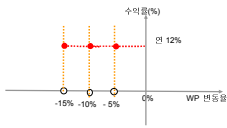
**1. 계약금액**

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	천원

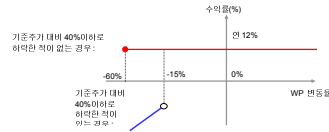
**2. 연가시점의 손익구조**

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-4.91	-5.06	-5.21	-5.36	-5.51	-5.66	-5.81
	5.33%	-1.65	-1.80	-1.95	-2.10	-2.25	-2.40	-2.55
산	2.67%	0.14	-0.01	-0.16	-0.32	-0.47	-0.62	-0.77
	0%	0.45	0.30	0.15	0.00	-0.15	-0.30	-0.45
시나리오	-2.67%	-0.70	-0.85	-1.01	-1.16	-1.31	-1.46	-1.61
	-5.33%	-3.33	-3.48	-3.63	-3.78	-3.94	-4.09	-4.24
	-8%	-7.43	-7.58	-7.73	-7.88	-8.03	-8.19	-8.34

**최대 손실 시나리오**

위험액	-8.34
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	4.15
-----	------



**[80] 대리 초주가지 수연계사로증권10호**

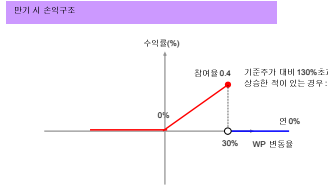
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 만기일 당일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 5월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
  - 만기일까지 수가가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 130% 미만일 경우
    - : 원금 \* (100% + 40% \* (만기 기준지수/최초 기준지수 - 1))
    - : 원금 \* 100%
  - 만기일까지 수가가 최초기준가격 미만일 경우
    - : 원금 \* 100%
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6673105W54 - 금융증권-채피플러스(ELS)91

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-4.91	-7.00	-9.10	-11.19	-13.28	-15.38	-17.47
손익	5.33%	-0.77	-2.87	-4.96	-7.05	-9.15	-11.24	-13.34
손익	2.67%	2.96	0.86	-1.23	-3.32	-5.42	-7.51	-9.61
손익	0%	6.28	4.19	2.09	0.00	-2.09	-4.19	-6.28
손익	-2.67%	9.20	7.11	5.01	2.92	0.83	-1.27	-3.36
손익	-5.33%	11.72	9.62	7.53	5.43	3.34	1.25	-0.85
손익	-8%	13.82	11.73	9.64	7.54	5.45	3.36	1.26

**최대 손실 시나리오**

위험액	1.26
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	16.91
-----	-------

**[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호**

**1. 계약금액**

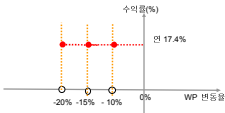
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	275.9	0	275.9	잔위

단위:백만원

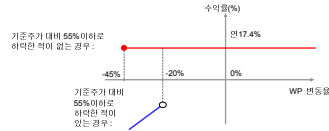
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 평균 \* 117.4%  
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조별 손/최대 손실 가능금액 (단위:백만원)**

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

**손익 구조별 손 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	5.51	4.75	3.96	3.22	2.46	1.70	0.93
손실	5.33%	5.15	4.38	3.62	2.86	2.10	1.33	0.57
손익	2.67%	4.07	3.31	2.55	1.78	1.02	0.26	-0.50
시나리오	0%	2.29	1.53	0.76	0.00	-0.76	-1.53	-2.29
	-2.67%	-0.21	-0.97	-1.73	-2.50	-3.26	-4.02	-4.78
	-5.33%	-3.41	-4.18	-4.94	-5.70	-6.46	-7.23	-7.99
	-8%	-7.33	-8.09	-8.85	-9.62	-10.38	-11.14	-11.91

**최대 손실 시나리오**

위험액	-11.91
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	12.76
-----	-------

**[83] 데리츠2Star사모증권SET-5호**

**1. 계약금액**

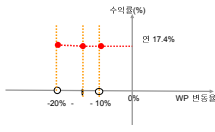
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	차입

단위(백만원)

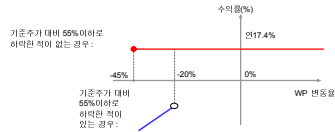
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 환반드 기준가액의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 \* 117.4%  
- 두 기초자산의 가액(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	35.41	30.51	25.60	20.70	15.80	10.90	6.00
손실	5.33%	33.07	28.17	23.27	18.37	13.47	8.57	3.67
시나리오	2.67%	26.17	21.27	16.37	11.47	6.57	1.67	-3.23
	0%	14.70	9.80	4.90	0.00	-4.90	-9.80	-14.70
	-2.67%	-1.33	-6.23	-11.13	-16.03	-20.93	-25.83	-30.73
	-5.33%	-21.93	-26.83	-31.73	-36.63	-41.53	-46.43	-51.33
	-8%	-47.10	-52.00	-56.90	-61.80	-66.70	-71.60	-76.50

최대 손실 시나리오

위험액	-76.50
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	62.02
-----	-------

**[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호**

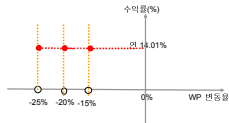
**1. 계약금액**

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

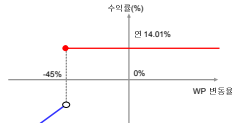
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)**

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

**손익 구조표준 편 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.17	-0.21	-0.25	-0.29	-0.34	-0.38	-0.42
	5.33%	0.06	0.02	-0.02	-0.07	-0.11	-0.15	-0.20
시나리오	2.67%	0.16	0.12	0.07	0.03	-0.01	-0.05	-0.10
	0%	0.13	0.09	0.04	0.00	-0.04	-0.09	-0.13
	-2.67%	-0.03	-0.07	-0.12	-0.16	-0.20	-0.24	-0.29
	-5.33%	-0.32	-0.36	-0.40	-0.45	-0.49	-0.53	-0.58
	-8%	-0.74	-0.78	-0.82	-0.86	-0.91	-0.95	-0.99

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.99
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	1.28
-----	------

[85] 테라츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

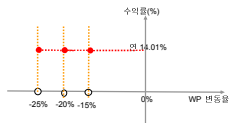
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	차입

단위:백만원

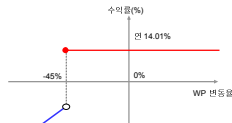
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	8%	-0.60	-0.75	-0.91	-1.06	-1.22	-1.37	-1.52
	5.33%	0.22	0.07	-0.09	-0.24	-0.40	-0.55	-0.71
시나리오	2.67%	0.57	0.42	0.26	0.11	-0.04	-0.20	-0.35
	0%	0.46	0.31	0.15	0.00	-0.15	-0.31	-0.46
	-2.67%	-0.11	-0.27	-0.42	-0.58	-0.73	-0.88	-1.04
	-5.33%	-1.15	-1.31	-1.46	-1.62	-1.77	-1.92	-2.08
	-8%	-2.66	-2.81	-2.97	-3.12	-3.28	-3.43	-3.58

최대 손실 시나리오	
위험액	-3.58

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.63
-----	------

**[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호**

**1. 계약금액**

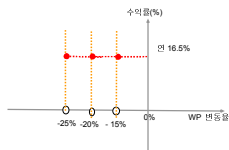
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

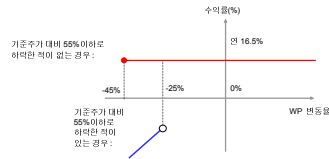
**2. 만기시점의 손익구조**

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

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.12
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	0.32
-----	------

**[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

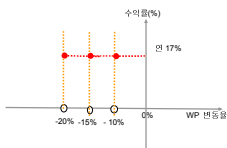
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

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

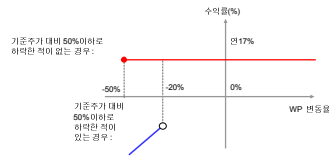
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 \* 117%  
 - 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



**3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6562319W52 유인 투기증권 (ELS)2415

**손익 구조표준 편 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	2.54	1.98	1.43	0.88	0.33	-0.22	-0.78
	5.33%	2.76	2.20	1.65	1.10	0.55	-0.01	-0.56
시나리오	2.67%	2.46	1.91	1.36	0.81	0.25	-0.30	-0.85
	0%	1.66	1.10	0.55	0.00	-0.55	-1.10	-1.66
	-2.67%	0.34	-0.21	-0.77	-1.32	-1.87	-2.42	-2.97
	-5.33%	-1.49	-2.04	-2.60	-3.15	-3.70	-4.25	-4.80
	-8%	-3.83	-4.39	-4.94	-5.49	-6.04	-6.59	-7.15

**최대 손실 시나리오**

위험액	-7.15
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	9.74
-----	------

**[88] 데리츠2Star사모증권SECOM-1호**

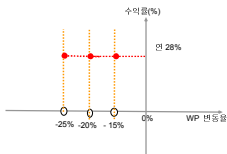
**1. 계약금액**

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

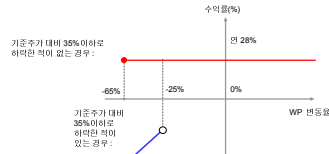
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	51.59	39.94	28.30	16.65	5.00	-6.65	-18.29
	5.33%	46.50	34.86	23.21	11.56	-0.08	-11.73	-23.38
	2.67%	40.95	29.31	17.66	6.01	-5.63	-17.28	-28.93
	0%	34.94	23.29	11.65	0.00	-11.65	-23.29	-34.94
	-2.67%	28.46	16.32	5.17	-5.46	-18.12	-29.77	-41.42
	-5.33%	21.52	9.87	-1.77	-13.42	-25.07	-36.71	-48.36
	-8%	14.11	2.47	-9.18	-20.83	-32.47	-44.12	-55.77

**최대 손실 시나리오**

위험액	-55.77
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	53.29
-----	-------



[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

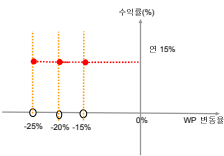
1. 계약금액

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

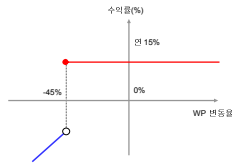
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.16	0.11	0.07	0.03	-0.01	-0.06	-0.10
	5.33%	0.18	0.14	0.10	0.06	0.01	-0.03	-0.07
	2.67%	0.17	0.13	0.09	0.05	0.00	-0.04	-0.08
	0%	0.13	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.13
	-2.67%	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12	-0.17	-0.21
	-5.33%	-0.07	-0.12	-0.16	-0.20	-0.24	-0.29	-0.33
	-8%	-0.23	-0.27	-0.31	-0.36	-0.40	-0.44	-0.48

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.48

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.27
-----	------

**[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호**

**1. 계약금액**

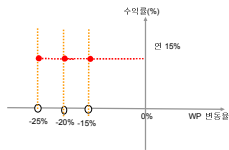
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위: (백만원)

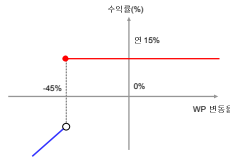
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	11.85	8.63	5.41	2.19	-1.03	-4.25	-7.47
	5.33%	13.88	10.66	7.44	4.22	1.00	-2.22	-5.44
	2.67%	13.15	9.93	6.71	3.49	0.27	-2.95	-6.17
	0%	9.66	6.44	3.22	0.00	-3.22	-6.44	-9.66
	-2.67%	3.42	0.19	-3.03	-6.25	-9.47	-12.69	-15.91
-5.33%	-9.59	-6.81	-12.03	-15.25	-18.47	-21.69	-24.91	
-8%	-17.35	-20.57	-23.79	-27.01	-30.23	-33.45	-36.67	

**최대 손실 시나리오**

위험액	-36.67
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	20.62
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

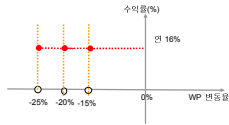
1. 계약금액

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

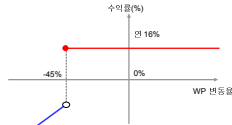
2. 만기시점의 손익구조

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

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.59	0.48	0.37	0.25	0.14	0.03	-0.08
	5.33%	0.54	0.43	0.32	0.21	0.10	-0.01	-0.12
시나리오	2.67%	0.46	0.35	0.24	0.12	0.01	-0.10	-0.21
	0%	0.33	0.22	0.11	0.00	-0.11	-0.22	-0.33
	-2.67%	0.17	0.06	-0.05	-0.16	-0.27	-0.38	-0.50
	-5.33%	-0.03	-0.14	-0.25	-0.37	-0.48	-0.59	-0.70
	-8%	-0.27	-0.39	-0.50	-0.61	-0.72	-0.83	-0.94

최대 손실 시나리오

위험액	-0.94
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.82
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호[EL]

1. 계약금액

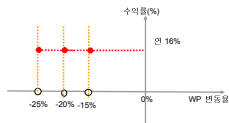
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	차입

단위:백만원

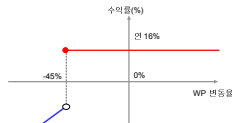
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)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 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  
: 평균 \* 110%  
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우  
: 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	10.53	6.54	6.55	4.56	2.58	0.59	-1.40
	5.33%	9.71	7.72	5.73	3.74	1.76	-0.23	-2.22
시나리오	2.67%	8.19	6.20	4.21	2.22	0.23	-1.75	-3.74
	0%	6.97	3.98	1.99	0.00	-1.99	-3.98	-6.97
	-2.67%	3.04	1.05	-0.94	-2.92	-4.91	-6.90	-8.89
	-5.33%	-0.58	-2.57	-4.56	-6.55	-8.54	-10.53	-12.52
	-8%	-4.91	-6.90	-8.89	-10.88	-12.87	-14.85	-16.84

최대 손실 시나리오

위험액	-16.84
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.75
-----	-------

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

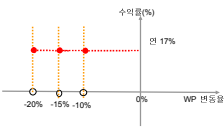
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

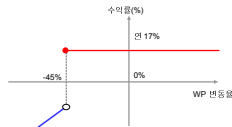
2. 연가시점의 손익구조

- 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 \* (연가기준지수/최초기준지수)
- 연도의 수익구조

조기상환 시 손익구조



연가시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.18	0.37	-0.43	-1.23	-2.03	-2.84	-3.64
시나리오	5.33%	2.38	1.58	0.78	-0.03	-0.83	-1.63	-2.43
	2.67%	2.79	1.99	1.19	0.38	-0.42	-1.22	-2.02
	0%	2.41	1.60	0.80	0.00	-0.80	-1.60	-2.41
	-2.67%	1.23	0.43	-0.38	-1.18	-1.98	-2.78	-3.58
	-5.33%	-0.74	-1.54	-2.35	-3.15	-3.95	-4.75	-5.56
	-8%	-3.51	-4.31	-5.11	-5.91	-6.72	-7.52	-8.32

최대 손실 시나리오

위험액	-8.32
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.15
-----	------

**[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1**

**1. 계약금액**

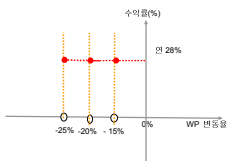
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위(백만원)

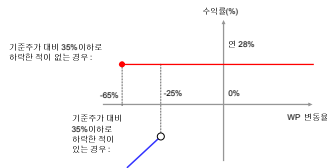
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	5.33%	37.84	26.50	19.15	9.81	0.47	-8.87	-18.21
손익	2.67%	33.56	24.22	14.88	5.54	-3.80	-13.14	-22.49
시나리오	0%	28.02	18.68	9.34	0.00	-9.34	-18.68	-28.02
	-2.67%	21.22	11.88	2.54	-6.80	-16.14	-25.48	-34.82
	-5.33%	13.16	3.82	-5.52	-14.86	-24.20	-33.54	-42.86
	-8%	3.84	-5.50	-14.84	-24.18	-33.52	-42.86	-52.21

**최대 손실 시나리오**

위험액	-52.21
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	54.20
-----	-------

**[95] 데리츠1Star사모증권BE-1호**

**1. 계약금액**

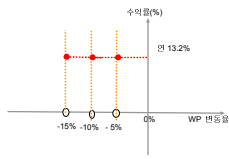
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위: (백만원)

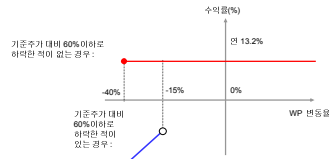
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

**손익 구조변동 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	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)**

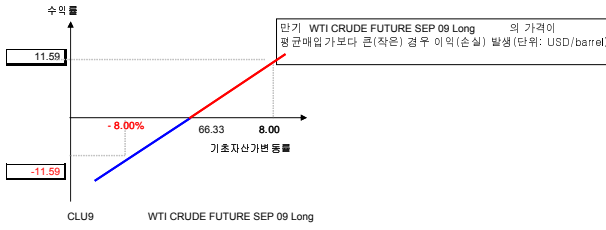
위험액	0.00
-----	------

[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유\_파생형]모

1. 계약금액

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

2. 연기사험의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

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

최대손실 시나리오	
위험액	-11.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46
-----	----



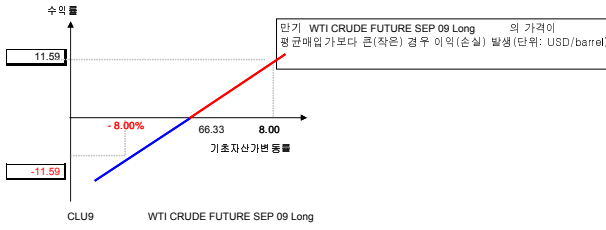
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



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

CLU9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 Long

구분	시나리오	손실액
기초자산	8%	43.83
	5.33%	29.20
	2.67%	14.63
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-14.63
	-5.33%	-29.20
	-8%	-43.83

최대 손실 시나리오	
위험액	-43.83

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

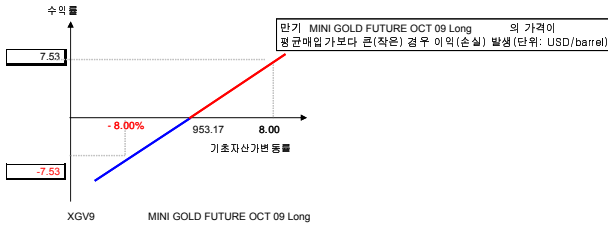
위험액	178
-----	-----

[96-2] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 헷지시점의 손익 구조

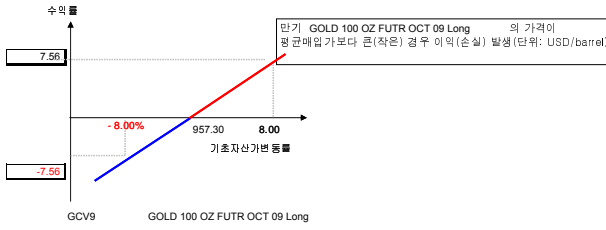


[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



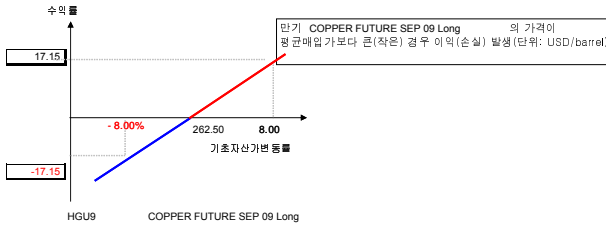
[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조

