

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1] 데리브 플러깅 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

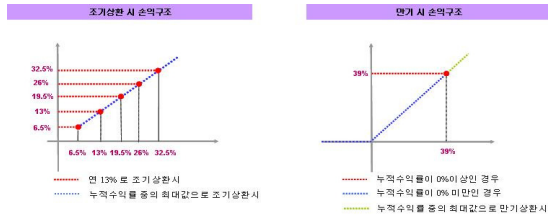
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권[ELS]1264

손익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.15
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.20
-----	------

[3] 테라즈 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

- 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주
- 만기: 2010년 07월 30일
- 관드첨산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2007년 7월 31일 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주
- 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, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 관드 해지
 만기 평가일의 누적수익률이 -50%이상 -40% 미만인 경우: 18.0%의 수익률로 상환
 만기 평가일의 누적수익률이 -50%미만인 경우: 액면금액 지급 (원금보장추구)
- 관드의 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%	0.16	0.14	0.12	0.10	0.09	0.07	0.05
	5.33%	0.12	0.10	0.08	0.07	0.05	0.03	0.01
	2.67%	0.09	0.07	0.05	0.03	0.01	-0.00	-0.02
	0%	0.05	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
	-2.67%	0.02	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.07	-0.09
-5.33%	-0.00	-0.02	-0.04	-0.06	-0.07	-0.09	-0.11	
-8%	-0.03	-0.04	-0.06	-0.08	-0.10	-0.12	-0.14	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.14
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.06
-----	------

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) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백 만원))

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.04
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	0.06
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모단위파생상품투자신탁 24호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 손익구조: 만기시점 기준, 만기후보종목, 만기후보종목

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만기후보종목: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 10월 26일의 만기후보종목, 만기후보종목

5) 발행 후 매 6개월마다 만기후보종목을 설정하고, 만기후보종목(만기후보종목, 만기후보종목)의 만기후보종목가치가 낮은 만기후보종목으로 각각 만기후보종목의 80%이상인 경우(첫번째 만기후보종목), 75%이상인 경우(두번째 만기후보종목), 70%이상인 경우(세번째 만기후보종목), 65%이상인 경우(네번째 만기후보종목) 만기후보종목의 수익률로 만기후보종목이 됨.

단, 만기시점 만기후보종목 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만기후보종목

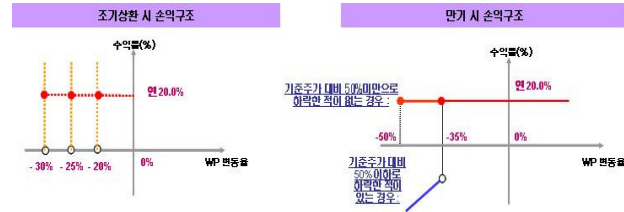
- 두 만기후보종목의 가격이 만기후보종목의 50%이므로 하락한 적이 없고, 만기후보종목의 65%보다 작은 경우

: 만기 * 140%

- 두 만기후보종목의 가격(장종료)중 어느 하나라도 각각의 만기후보종목의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우

: 만기 * (만기후보종목 수/최초기준지수)

6) 만기후보종목의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력(상장종목(ELS)243)

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	11.53	10.63	9.74	8.85	7.95	7.06	6.17
	5.33%	8.87	7.98	7.09	6.19	5.30	4.41	3.52
	2.67%	5.92	5.03	4.14	3.25	2.35	1.46	0.57
	0%	2.68	1.79	0.89	0.00	-0.89	-1.79	-2.68
	-2.67%	-0.86	-1.76	-2.65	-3.54	-4.44	-5.33	-6.22
	-5.33%	-4.70	-5.60	-6.49	-7.38	-8.27	-9.17	-10.06
	-8%	-8.84	-9.73	-10.63	-11.52	-12.41	-13.30	-14.20

최대 손실 시나리오

위험액	-14.20
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	13.80
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자전략 25호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 투신증권업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(투신증권업 보통주, SK에너지 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(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, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 하지

- 두 기초자산의 가격이 만드도 기준가격의 50%이므로 하락한적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 만금 * 131.6%

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

6) 만드의 수익구조



3. 수익구조의 최(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600345TTB9 변동주변(ELS)2007-609

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	16.65	15.84	15.02	14.21	13.40	12.58	11.77
손익	5.33%	11.83	11.01	10.20	9.39	8.57	7.76	6.95
손익	2.67%	7.09	6.28	5.46	4.65	3.84	3.02	2.21
손익	0%	2.44	1.63	0.81	0.00	-0.81	-1.63	-2.44
손익	-2.67%	-2.12	-2.94	-3.75	-4.56	-5.38	-6.19	-7.00
손익	-5.33%	-6.60	-7.41	-8.22	-9.04	-9.85	-10.67	-11.48
손익	-8%	-10.99	-11.80	-12.61	-13.43	-14.24	-15.05	-15.87

최대 손실 시나리오

위험액 -15.87

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 16.31

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연기: 2010년 2월 22일

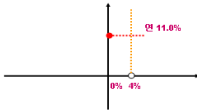
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

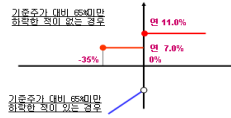
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이 상한 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확인 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 원본투자 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 비터증권(ELS) 2007-397세

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	445.16	425.01	404.85	384.70	364.55	344.39	324.24
손익	5.33%	315.10	294.95	274.79	254.64	234.49	214.33	194.18
손익	2.67%	186.87	166.72	146.56	126.41	106.25	86.10	65.94
손익	0%	60.46	40.31	20.15	0.00	-20.15	-40.31	-60.46
손익	-2.67%	-64.12	-84.27	-104.43	-124.58	-144.73	-164.89	-185.04
손익	-5.33%	-186.87	-207.02	-227.18	-247.33	-267.49	-287.64	-307.80
손익	-8%	-307.80	-327.95	-348.10	-368.26	-388.41	-408.57	-428.72

최대 손실 시나리오

위험액 -428.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 420.53

[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 중도 상환이 됨.

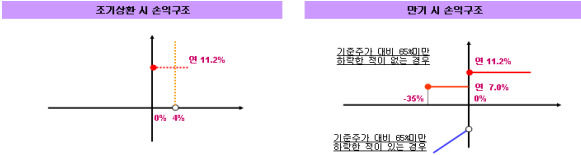
단, 연가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 * (연가기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR60034SST27 (변동유형 ELS) 2007~398회

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	42.89	40.97	39.05	37.14	35.22	33.30	31.38
시나리오	5.33%	30.32	28.40	26.49	24.57	22.65	20.73	18.82
	2.67%	17.94	16.03	14.11	12.19	10.27	8.36	6.44
	0%	5.75	3.84	1.92	0.00	-1.92	-3.84	-5.75
	-2.67%	-6.25	-8.17	-10.08	-12.00	-13.92	-15.84	-17.75
	-5.33%	-18.06	-19.98	-21.90	-23.82	-25.73	-27.65	-29.57
	-8%	-29.69	-31.61	-33.52	-35.44	-37.36	-39.28	-41.19

최대 손실 시나리오

위험액	-41.19
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	40.45
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

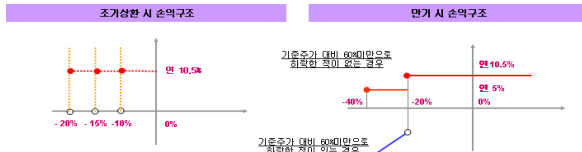
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600172YT43 신영증권(ELS)552

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	480.65	448.42	416.19	383.95	351.72	319.49	287.26
시나리오	5.33%	373.16	340.93	308.70	276.46	244.23	212.00	179.77
	2.67%	245.17	212.94	180.71	148.48	116.25	84.02	51.79
	0%	96.69	64.46	32.23	0.00	-32.23	-64.46	-96.69
	-2.67%	-72.28	-104.51	-136.74	-168.98	-201.21	-233.44	-265.67
	-5.33%	-261.75	-293.98	-326.21	-358.45	-390.68	-422.91	-455.14
	-8%	-471.72	-503.95	-536.18	-568.41	-600.64	-632.87	-665.10

최대 손실 시나리오
위험액 -665.10

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 638.49

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자전략 3호

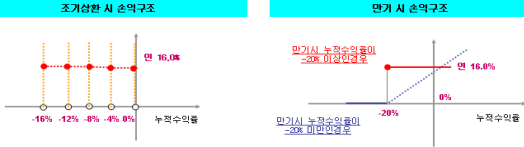
1. 계약금액

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 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 초기 상환 일정일에 0%(1차 중도상환일), -4%(2차 중도상환일), -8%(3차 중도상환일), -12%(4차 중도상환일), -16%(5차 중도상환일), -20%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 16.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)
단, 만기시 까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 누적 수익률])
- 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 손(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%	1.04	1.01	0.99	0.97	0.95	0.92	0.90
	5.33%	0.67	0.65	0.62	0.60	0.58	0.55	0.53
	2.67%	0.35	0.32	0.30	0.28	0.25	0.23	0.21
	0%	0.07	0.05	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.07
	-2.67%	-0.16	-0.18	-0.21	-0.23	-0.25	-0.28	-0.30
	-5.33%	-0.35	-0.37	-0.39	-0.42	-0.44	-0.46	-0.48
	-8%	-0.48	-0.51	-0.53	-0.55	-0.58	-0.60	-0.62

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

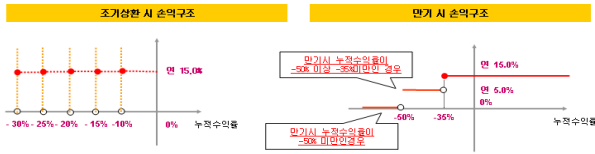
11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상종형(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.15	0.85	0.55	0.25	-0.05	-0.35	-0.65
	5.33%	1.12	0.82	0.52	0.22	-0.08	-0.37	-0.67
	2.67%	1.04	0.74	0.44	0.14	-0.16	-0.46	-0.76
	0%	0.90	0.60	0.30	0.00	-0.30	-0.60	-0.90
	-2.67%	0.70	0.40	0.10	-0.19	-0.49	-0.79	-1.09
	-5.33%	0.45	0.15	-0.15	-0.45	-0.74	-1.04	-1.34
	-8%	0.14	-0.15	-0.45	-0.75	-1.05	-1.35	-1.65

최대 손실 시나리오

위험액	-1.65
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.30
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

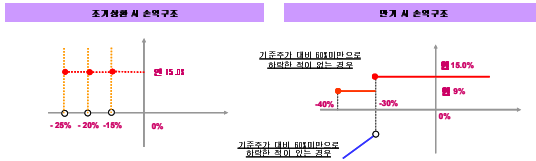
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762L197 미래예상증권(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	174.13	170.85	167.56	164.31	161.04	157.77	154.50
	5.33%	135.96	132.69	129.42	126.15	122.88	119.61	116.34
	2.67%	81.19	77.92	74.65	71.38	68.11	64.84	61.56
	0%	9.81	6.54	3.27	0.00	-3.27	-6.54	-9.81
	-2.67%	-78.17	-81.44	-84.71	-87.98	-91.26	-94.53	-97.80
	-5.33%	-182.76	-186.03	-189.31	-192.58	-195.85	-199.12	-202.39
	-8%	-303.96	-307.23	-310.50	-313.78	-317.05	-320.32	-323.59

최대 손실 시나리오

위험액	-323.59
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	369.32
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

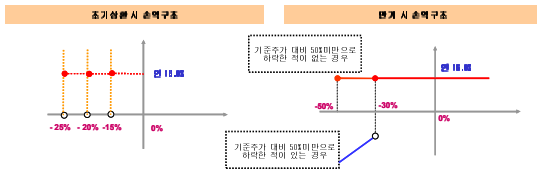
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 14일
- 3) 만도침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(현대모비스, 삼성중공업 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 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 만도침산이 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) 만도의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	146.55	142.25	137.96	133.66	129.36	125.06	120.77
시나리오	5.33%	99.35	95.05	90.75	86.46	82.16	77.86	73.56
	2.67%	54.80	50.50	46.20	41.90	37.61	33.31	29.01
	0%	12.89	8.60	4.30	0.00	-4.30	-8.60	-12.89
	-2.67%	-26.36	-30.66	-34.96	-39.25	-43.55	-47.85	-52.15
	-5.33%	-62.96	-67.26	-71.56	-75.86	-80.15	-84.45	-88.75
	-8%	-96.92	-101.21	-105.51	-109.81	-114.11	-118.41	-122.70

최대 손실 시나리오

위험액	-122.70
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	137.22
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제13호

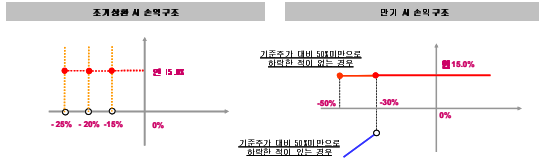
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외괴생상품의 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(만기상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
 - 두 기초자산의 가격(중도포환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762B1B0 비례예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	4.67	4.44	4.22	3.99	3.76	3.54	3.31
	5.33%	3.51	3.28	3.06	2.83	2.60	2.38	2.15
	2.67%	2.18	1.95	1.73	1.50	1.27	1.05	0.82
	0%	0.68	0.45	0.23	0.00	-0.23	-0.45	-0.68
	-2.67%	-0.99	-1.22	-1.44	-1.67	-1.90	-2.12	-2.35
	-5.33%	-2.83	-3.06	-3.28	-3.51	-3.74	-3.96	-4.19
	-8%	-4.84	-5.07	-5.29	-5.52	-5.75	-5.97	-6.20

최대 손실 시나리오

위험액 -6.20

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 6.18

[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

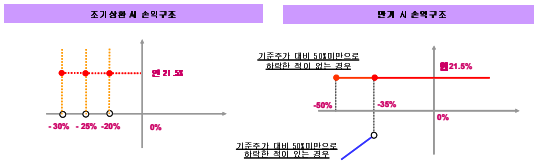
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품의 기초자산: LG디스플레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010년 01월 07일
- 3) 만드첨산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG디스플레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기건을 설정하고, 기초자산(LG디스플레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이상인 경우(두번째 중도상환일), 70%이상인 경우(세번째 중도상환일), 65%이상인 경우(만기 상환일) 인출 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%	227.25	201.93	176.62	151.30	125.99	100.68	75.36
	5.33%	177.23	151.91	126.60	101.29	75.97	50.66	25.34
	2.67%	126.79	101.48	76.17	50.85	25.54	0.22	-25.09
	0%	75.94	50.63	25.31	0.00	-25.31	-50.63	-75.94
	-2.67%	24.68	-0.64	-25.95	-51.27	-76.58	-101.90	-127.21
	-5.33%	-27.01	-52.32	-77.64	-102.95	-128.27	-153.58	-178.89
	-8%	-79.11	-104.42	-129.74	-155.05	-180.37	-205.68	-231.00

최대 손실 시나리오	
위험액	-231.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	230.97
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 파생상품 제 1호

1. 계약금액

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

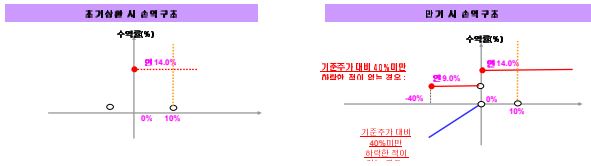
단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수
- 2) 만기: 2010년 7월29일
- 3) 만기점산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일예 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한번이라도 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 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격 보다 작은 경우
 : 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	465.60	447.23	428.86	410.50	392.13	373.77	355.40
시나리오	5.33%	341.74	323.38	305.01	286.64	268.28	249.91	231.55
	2.67%	204.91	186.54	168.18	149.81	131.45	113.08	94.72
	0%	55.10	36.73	18.37	0.00	-18.37	-36.73	-55.10
	-2.67%	-197.89	-179.52	-161.16	-142.79	-124.43	-106.06	-87.70
	-5.33%	-283.46	-301.83	-320.19	-338.56	-356.92	-375.29	-393.65
	-8%	-472.21	-490.57	-508.94	-527.31	-545.67	-564.04	-582.40

최대 손실 시나리오

위험액	-582.40
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	563.45
-----	--------

[17]테리츠 StepDown사모단위 편성 26호

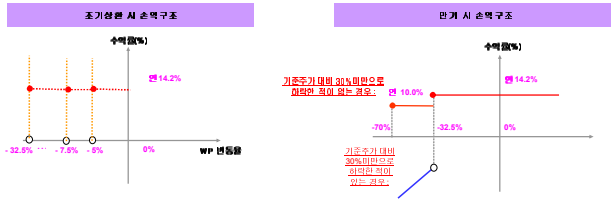
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: CJ 보통주
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 14일의 CJ 보통주의 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 코무보신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	219.70	188.61	157.52	126.43	95.34	64.25	33.16
	5.33%	177.63	146.54	115.45	84.36	53.27	22.18	-8.91
	2.67%	135.48	104.40	73.31	42.22	11.13	-19.96	-61.05
	0%	93.27	62.18	31.09	0.00	-31.09	-62.18	-93.27
	-2.67%	50.98	19.89	-11.20	-42.29	-73.38	-104.47	-135.56
	-5.33%	8.61	-22.48	-53.57	-84.66	-115.74	-146.83	-177.92
	-8%	-33.83	-64.92	-96.01	-127.09	-158.18	-189.27	-220.36

최대 손실 시나리오	
위험액	-220.36

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	231.63
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

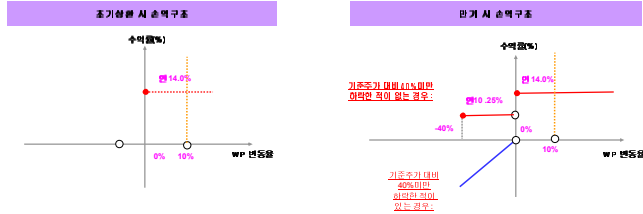
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

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



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	103.28	97.57	91.87	86.16	80.46	74.75	69.05
시나리오	5.33%	73.92	68.21	62.51	56.81	51.10	45.40
	2.67%	45.20	39.49	33.79	28.08	22.38	16.67
	0%	17.11	11.41	5.70	0.00	-5.70	-11.41
	-2.67%	-10.33	-16.04	-21.74	-27.45	-33.15	-38.86
	-5.33%	-37.14	-42.85	-48.55	-54.25	-59.96	-65.66
	-8%	-63.31	-69.02	-74.72	-80.43	-86.13	-91.84

최대 손실 시나리오

위험액	69.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	95.92
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서5호

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.

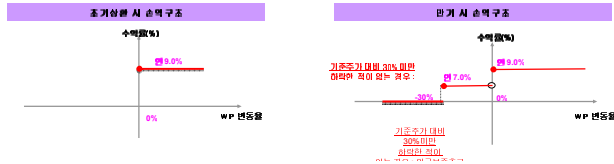
단, 평가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환비도 기준가액의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우 : 원금 * 121%

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

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래에셋증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	45.53	42.09	38.65	35.20	31.76	28.32	24.88
	5.33%	34.53	31.09	27.65	24.21	20.77	17.33	13.89
	2.67%	22.80	19.36	15.92	12.48	9.03	5.59	2.15
	0%	10.32	6.88	3.44	0.00	-3.44	-6.88	-10.32
	-2.67%	-2.89	-6.33	-9.77	-13.22	-16.68	-20.10	-23.54
	-5.33%	-16.85	-20.29	-23.73	-27.17	-30.61	-34.05	-37.49
	-8%	-31.54	-34.99	-38.43	-41.87	-45.31	-48.75	-52.19

최대 손실 시나리오

위험액	24.88
-----	-------

4. 파생상품의 최대 예상금액 (단위:백만원)

위험액	48.88
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼싱 6호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 2월 21일

3) 펀드청산결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

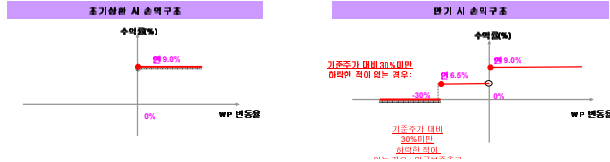
단, 평가시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 비례예정증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	31.89	29.27	26.64	24.01	21.39	18.76	16.13
	5.33%	24.43	21.81	19.18	16.55	13.93	11.30	8.67
	2.67%	16.43	13.80	11.18	8.55	5.92	3.30	0.67
	0%	7.88	5.25	2.63	0.00	-2.63	-5.25	-7.88
최대 손실 시나리오	-2.67%	-1.22	-3.84	-6.47	-9.10	-11.72	-14.35	-16.97
	-5.33%	-10.86	-13.48	-16.11	-18.74	-21.36	-23.99	-26.62
	-8%	-21.04	-23.67	-26.30	-28.92	-31.55	-34.18	-36.80

최대 손실 시나리오

위험액	16.13
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	35.10
-----	-------

[2] 메리츠치주연계사모단위파생7호

1. 계약금액

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

단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

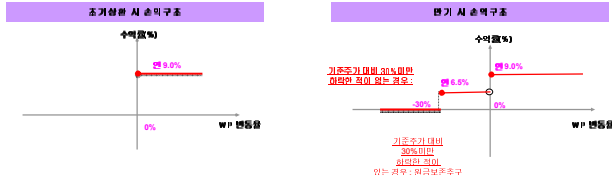
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가격이 만도 만도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기준가격보다 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. 손익구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래예정증권(ELS)317

손익구조변동률 시나리오

구분		변동률 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	24.80	22.76	20.72	18.68	16.63	14.59	12.55
	5.33%	19.00	16.96	14.92	12.88	10.83	8.79	6.75
	2.67%	12.78	10.74	8.69	6.65	4.61	2.56	0.52
	0%	6.13	4.09	2.04	0.00	-2.04	-4.09	-6.13
	-2.67%	-0.95	-2.99	-5.03	-7.07	-9.12	-11.16	-13.20
	-5.33%	-8.44	-10.49	-12.53	-14.57	-16.62	-18.66	-20.70
	-8%	-16.37	-18.41	-20.45	-22.50	-24.54	-26.58	-28.62

최대 손실 시나리오

위험액	12.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	27.30
-----	-------

[23] 매리츠일종지수연계사모파생1호

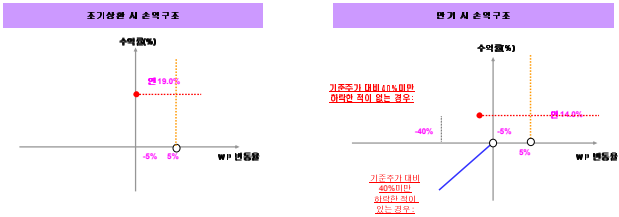
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수
- 2) 만기: 2010년 08월 04일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 7일 NIKKEI225, HSCEI 지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상종 포함하여 한번이라도 최초기준가격의 95% 이상이거나 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 19%의 수익률로 중도상환
 단, 만기시 까지 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 * 138%
 - 두 기초자산의 가격(상종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	134.10	125.20	116.29	107.39	98.48	89.58	80.68
	5.33%	99.28	90.38	81.48	72.57	63.67	54.76	45.86
	2.67%	63.49	54.58	45.66	36.76	27.87	18.97	10.06
	0%	26.71	17.81	8.90	0.00	-8.90	-17.81	-26.71
	-2.67%	-11.04	-19.95	-28.85	-37.76	-46.66	-55.57	-64.47
	-5.33%	-49.78	-58.69	-67.59	-76.49	-85.40	-94.30	-103.21
	-8%	-89.50	-98.40	-107.31	-116.21	-125.12	-134.02	-142.92

최대 손실 시나리오	
위험액	-142.92

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	141.01
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품SEPO-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:삼성전자, POSCO

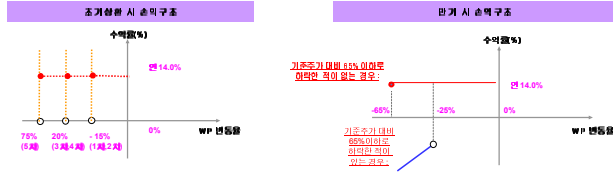
2) 만기: 2011년 08월 26일

3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지 수의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 14.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 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/최초 기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR652307WR2 보유증권(ELS)2723

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
	-8%	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
-----	------

[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

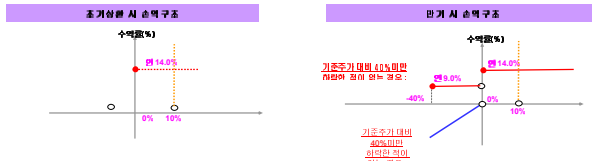
단위:백만원

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 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	570.65	548.14	525.63	503.12	480.61	458.10	435.59
사	5.33%	418.85	396.34	373.83	351.32	328.81	306.30	283.79
나	2.67%	251.14	228.63	206.12	183.61	161.10	138.60	116.09
시	0%	67.53	45.02	22.51	0.00	-22.51	-45.02	-67.53
나	-2.67%	-131.99	-154.50	-177.01	-199.52	-222.03	-244.54	-267.05
리	-5.33%	-347.42	-369.93	-392.44	-414.95	-437.46	-459.97	-482.48
오	-8%	-578.76	-601.27	-623.77	-646.28	-668.79	-691.30	-713.81

최대 손실 시나리오

위험액 -713.81

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 690.59

[26] 데리츠2Star사모파생SE SF-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

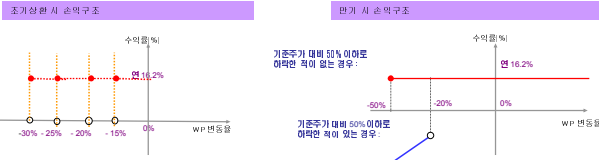
2) 만기: 2010년 09월 30일

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, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익특성 추이대로 처리
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우: 원금 * 132.4%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



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	-0.47	-0.48	-0.49	-0.50	-0.51	-0.52
	5.33%	-0.16	-0.17	-0.18	-0.19	-0.20	-0.21	-0.22
	2.67%	-0.00	-0.01	-0.02	-0.03	-0.04	-0.05	-0.06
	0%	0.03	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.02	-0.03
	-2.67%	-0.07	-0.08	-0.09	-0.10	-0.11	-0.12	-0.13
	-5.33%	-0.30	-0.31	-0.32	-0.33	-0.34	-0.35	-0.36
	-8%	-0.67	-0.68	-0.69	-0.70	-0.71	-0.72	-0.73

최대손실 시나리오

위험액 -0.73

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 0.37

[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

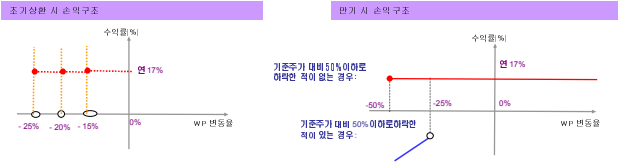
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	승모자산(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,096	0	1,096	상위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011년 09월 23일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 09월 26일 삼성전자, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기준지수준으로 각각 최초 기준가격의 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 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 151.0%
 - 두 기초자산의 가격(장중보합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조인출(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6572345/91 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.39	-1.04	-1.68	-2.33	-2.97	-3.61	-4.26
	5.33%	2.04	1.39	0.75	0.10	-0.54	-1.18	-1.83
	2.67%	2.81	2.17	1.52	0.88	0.24	-0.41	-1.05
	0%	1.93	1.29	0.64	0.00	-0.64	-1.29	-1.93
	-2.67%	-0.60	-1.25	-1.89	-2.54	-3.18	-3.82	-4.47
	-5.33%	-4.79	-5.44	-6.08	-6.73	-7.37	-8.02	-8.66
	-8%	-10.64	-11.28	-11.93	-12.57	-13.22	-13.86	-14.51

최대 손실 시나리오

위험액 -14.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액 14.86

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

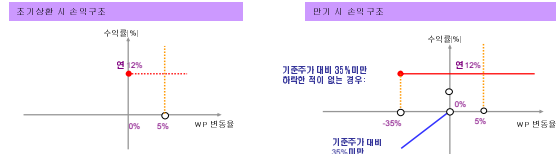
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조인 줄(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6583337V98 현대증권(ELS)2008-945

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액 0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

[34] 대리 조주가지 수익계 파생13

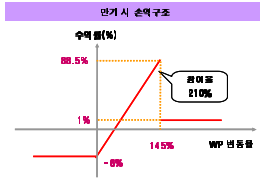
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 펀드청산 결정주기: 만기일 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최고 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우
: 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수 / 최초기준지수 - 1))
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
: 원금 * 94%
- 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%	-64.58	-71.29	-77.99	-84.70	-91.41	-98.12	-104.83
	5.33%	-34.08	-40.79	-47.50	-54.21	-60.92	-67.63	-74.33
	2.67%	-5.84	-12.55	-19.26	-25.97	-32.68	-39.39	-46.10
	0%	20.13	13.42	6.71	0.00	-6.71	-13.42	-20.13
	-2.67%	43.84	37.13	30.42	23.71	17.00	10.29	3.58
	-5.33%	65.29	58.58	51.87	45.16	38.45	31.74	25.03
	-8%	84.47	77.76	71.05	64.34	57.64	50.93	44.22

최대 손실 시나리오

위험액	44.22
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	98.52
-----	-------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

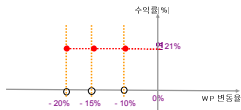
구분	기래자산	가액유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

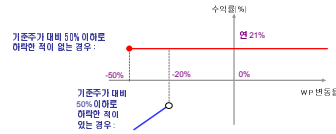
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9.58	8.12	6.67	5.22	3.77	2.32	0.87
	5.33%	8.43	6.98	5.53	4.07	2.62	1.17	-0.28
	2.67%	6.69	5.24	3.78	2.33	0.88	-0.57	-2.02
	0%	4.35	2.90	1.45	0.00	-1.45	-2.90	-4.35
	-2.67%	1.43	-0.02	-1.47	-2.93	-4.38	-5.83	-7.28
	-5.33%	-2.09	-3.54	-4.99	-6.44	-7.90	-9.35	-10.80
	-8%	-6.20	-7.65	-9.10	-10.56	-12.01	-13.46	-14.91

최대 손실 시나리오

위험액	-14.91
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.18
-----	-------

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

1. 계약금액

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

단위(백만원)

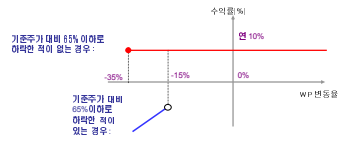
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

단위(백만원)

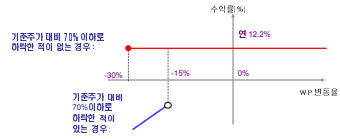
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교
 KR600690MMV7 대우증권ELS2697

1. 계약금액

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

단위(백만원)

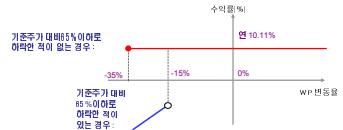
2. 연가시점의 손익구조

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

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

연율11%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

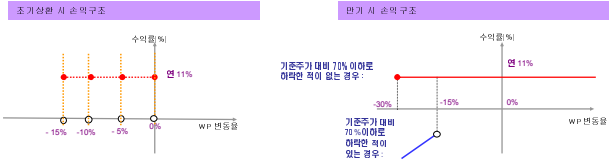
- 두 기준자산의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

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

: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조



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

1. 계약금액

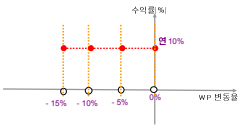
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

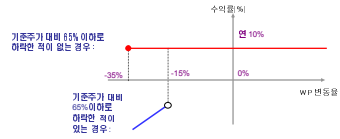
2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 6월 12일

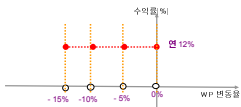
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

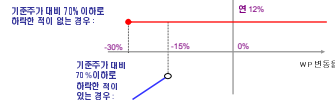
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고,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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

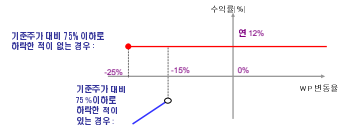
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

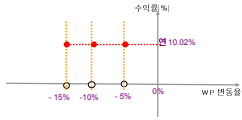
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-9] 메리츠투자지수연계사모증권2호
 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

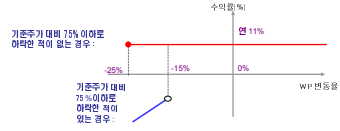
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] 메리츠주가지수연계사로증권2호

1. 계약금액

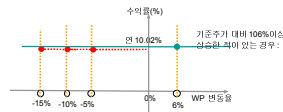
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7547.5	0	7,547.5	장외

단위(백만원)

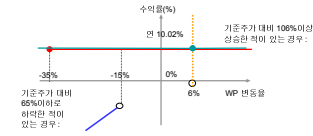
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2011년 5월 27일
- 3) 만드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 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 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 20.04%
 - 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHG-2

1. 계약금액

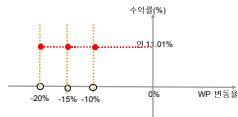
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	잔액

단위(백만원)

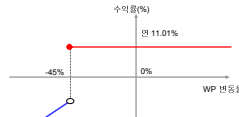
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06	-0.08
	5.33%	0.08	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04
	2.67%	0.09	0.07	0.05	0.03	0.01	-0.01	-0.03
	0%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
	-2.67%	0.00	-0.02	-0.04	-0.06	-0.08	-0.10	-0.12
	-5.33%	-0.09	-0.11	-0.13	-0.15	-0.17	-0.19	-0.21
	-8%	-0.21	-0.23	-0.25	-0.27	-0.29	-0.31	-0.33

최대 손실 시나리오

위험액 -0.33

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 1.97

[62] 데리츠2Star사모증권투자STWF-1

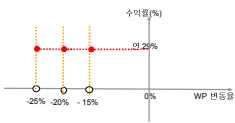
1. 계약금액

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

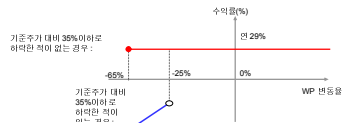
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 만드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융저주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.9%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
 6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	손익 구조변동 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	2.54	2.02	1.50	0.98	0.46	-0.06	-0.58
시나리오	5.33%	3.38	2.86	2.34	1.82	1.30	0.78	0.26
	2.67%	3.06	2.54	2.02	1.50	0.98	0.46	-0.06
	0%	1.56	1.04	0.52	0.00	-0.52	-1.04	-1.56
	-2.67%	-1.11	-1.63	-2.15	-2.67	-3.19	-3.71	-4.23
	-5.33%	-4.95	-5.47	-5.99	-6.51	-7.03	-7.55	-8.07
	-8%	-9.96	-10.48	-11.00	-11.52	-12.04	-12.56	-13.08

최대 손실 시나리오

위험액	-13.08
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	26.01
-----	-------

[66] 테리츠2Star사모증권LEHC-1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차

2) 만기: 2012년 4월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

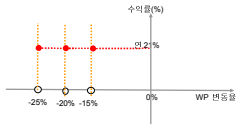
4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

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

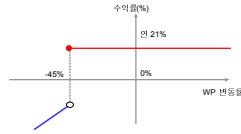
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55% 보다 이상인 경우 : 원금 + 121%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.10	0.05	0.01	-0.03	-0.08	-0.12	-0.17
시나리오	5.33%	0.18	0.13	0.09	0.05	0.00	-0.04	-0.09
	2.67%	0.19	0.15	0.10	0.06	0.01	-0.03	-0.08
	0%	0.13	0.09	0.04	0.00	-0.04	-0.09	-0.13
	-2.67%	0.01	-0.04	-0.06	-0.13	-0.17	-0.22	-0.26
	-5.33%	-0.19	-0.23	-0.28	-0.32	-0.37	-0.41	-0.46
	-8%	-0.45	-0.50	-0.54	-0.59	-0.63	-0.68	-0.72

최대 손실 시나리오

위험액	-0.72
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.35
-----	------

[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

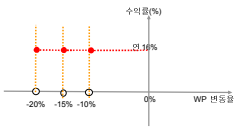
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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.

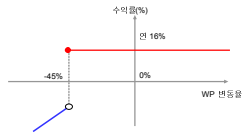
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 11.6%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가액(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

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%	1.50	1.16	0.81	0.46	0.11	-0.24	-0.59	
시나리오	5.33%	1.89	1.54	1.19	0.84	0.49	0.14	-0.20	
	2.67%	1.74	1.39	1.04	0.69	0.34	-0.01	-0.36	
	0%	1.05	0.70	0.35	0.00	-0.35	-0.70	-1.05	
	-2.67%	-0.18	-0.53	-0.88	-1.23	-1.58	-1.93	-2.27	
	-5.33%	-1.94	-2.29	-2.64	-2.99	-3.34	-3.69	-4.04	
	-8%	-4.25	-4.60	-4.94	-5.29	-5.64	-5.99	-6.34	

최대 손실 시나리오

위험액	-6.34
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.52
-----	------

[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

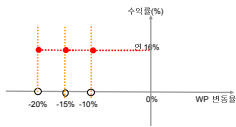
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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.

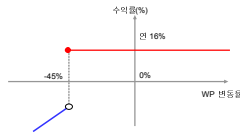
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 11.6%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552340W48 우리투자증권(ELS)2405

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.09	0.07	0.05	0.03	0.01	-0.01	-0.04
시나리오	5.33%	0.11	0.09	0.07	0.05	0.03	-0.01	-0.01
	2.67%	0.10	0.08	0.06	0.04	0.02	-0.00	-0.02
	0%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
	-2.67%	-0.01	-0.03	-0.05	-0.07	-0.09	-0.12	-0.14
	-5.33%	-0.12	-0.14	-0.16	-0.18	-0.20	-0.22	-0.24
	-8%	-0.25	-0.27	-0.30	-0.32	-0.34	-0.36	-0.38

최대 손실 시나리오

위험액	-0.98
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.33
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

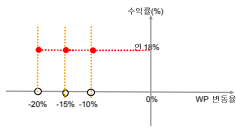
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

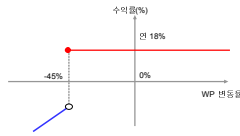
- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
: 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동 (최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동 시나리오		변동성 시나리오							
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	6.10	2.81	-0.49	-3.79	-7.08	-10.38	-13.68	
	5.33%	9.90	6.61	3.31	0.01	-3.28	-6.58	-9.88	
시나리오	2.67%	11.16	7.87	4.57	1.28	-2.02	-5.32	-8.61	
	0%	9.89	6.59	3.30	0.00	-3.30	-6.59	-9.89	
오	-2.67%	6.07	2.78	-0.52	-5.81	-7.11	-10.41	-13.71	
	-5.33%	-0.28	-3.57	-6.87	-10.17	-13.46	-16.76	-20.06	
	-8%	-9.17	-12.46	-15.76	-19.06	-22.35	-25.65	-28.95	

최대 손실 시나리오

위험액	-28.95
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.02
-----	-------

[68] 테리츠2Star사모증권SET-4호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

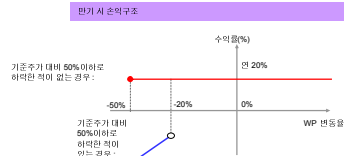
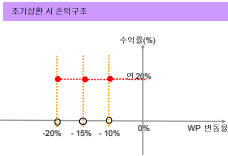
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

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

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622303W44 표보증권(ELS)322

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.55	0.68	-0.20	-1.07	-1.95	-2.82	-3.69
시나리오	5.33%	3.07	2.19	1.32	0.44	-0.43	-1.31	-2.18
	2.67%	3.42	2.55	1.67	0.80	-0.07	-0.95	-1.82
	0%	2.62	1.75	0.87	0.00	-0.87	-1.75	-2.62
	-2.67%	0.67	-0.21	-1.05	-1.96	-2.83	-3.71	-4.58
	-5.33%	-2.45	-3.32	-4.20	-5.07	-5.94	-6.82	-7.69
	-8%	-6.72	-7.59	-8.47	-9.34	-10.21	-11.09	-11.96

최대 손실 시나리오

위험액	-11.96
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.74
-----	------

[76] 데리츠2Star사로 SEST-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드칭산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

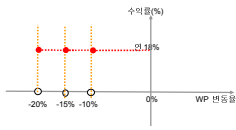
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지

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

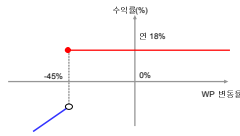
- 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
: 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	3.36	1.54	-0.27	-2.08	-3.90	-5.71	-7.52
	5.33%	5.45	3.63	1.82	0.01	-1.81	-3.62	-5.43
시나리오	2.67%	6.14	4.33	2.52	0.70	-1.11	-2.92	-4.74
	0%	5.44	3.63	1.81	0.00	-1.81	-3.63	-5.44
오	-2.67%	3.34	1.53	-0.26	-2.10	-3.91	-5.72	-7.54
	-5.33%	-0.15	-1.97	-3.78	-5.59	-7.41	-9.22	-11.03
	-8%	-5.04	-6.86	-8.67	-10.48	-12.30	-14.11	-15.92

최대 손실 시나리오

위험액	-15.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.41
-----	-------

[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

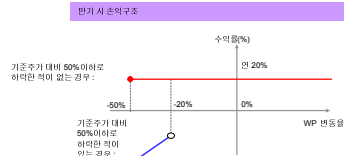
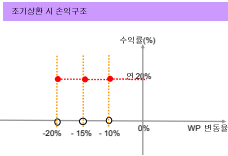
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기준자산기준으로 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 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 일반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	2.55	1.75	0.95	0.15	-0.65	-1.44	-2.24
자신	5.33%	3.17	2.37	1.58	0.78	-0.02	-0.82	-1.62
시나리오	2.67%	3.12	2.32	1.52	0.73	-0.07	-0.87	-1.67
오	0%	2.39	1.60	0.80	0.00	-0.60	-1.60	-2.39
	-2.67%	0.99	0.19	-0.60	-1.40	-2.20	-3.00	-3.80
	-5.33%	-1.09	-1.88	-2.68	-3.48	-4.28	-5.08	-5.87
	-8%	-3.84	-4.64	-5.44	-6.24	-7.03	-7.83	-8.63

최대 손실 시나리오

위험액	-8.63
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	12.55
-----	-------

[78] 데리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

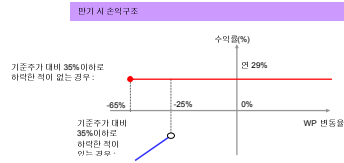
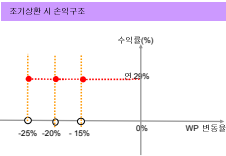
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

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

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

- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
- 두 기초자산의 가액이 합반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 12%
 - 두 기초자산의 가액(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6622313W42 표본증권(ELS)325

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	2.21	1.76	1.30	0.85	0.40	-0.05	-0.51
시나리오	5.33%	2.94	2.49	2.04	1.59	1.13	0.68	0.23
	2.67%	2.66	2.21	1.76	1.30	0.85	0.40	-0.05
	0%	1.36	0.91	0.45	0.00	-0.45	-0.91	-1.36
	-2.67%	-0.97	-1.42	-1.87	-2.32	-2.78	-3.23	-3.68
	-5.33%	-4.31	-4.76	-5.21	-5.67	-6.12	-6.57	-7.02
	-8%	-6.67	-9.12	-9.58	-10.03	-10.48	-10.93	-11.39

최대 손실 시나리오

위험액	-11.39
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.65
-----	-------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

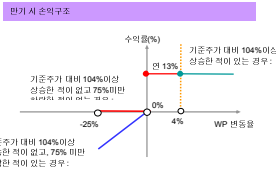
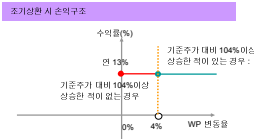
1. 계약금액

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	5.33%	6,869.83	6,278.79	5,687.75	5,096.71	4,505.67	3,914.63	
시나리오	2.67%	4,319.55	3,728.51	3,137.47	2,546.43	1,955.39	1,364.35	
	0%	1,773.12	1,182.08	591.04	0.00	-591.04	-1,182.08	
	-2.67%	-769.46	-1,360.50	-1,951.54	-2,542.59	-3,133.63	-3,724.67	
	-5.33%	-3,308.20	-3,899.24	-4,490.28	-5,081.32	-5,672.36	-6,263.40	
	-8%	-5,843.09	-6,434.13	-7,025.17	-7,616.21	-8,207.25	-8,798.30	

최대 손실 시나리오

위험액	-9,389.34
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,471.35
-----	----------

[79-2] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 8일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 8일 KOSPI200지수의 증가

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

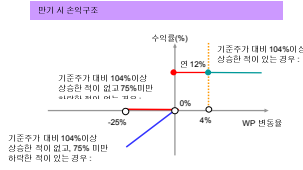
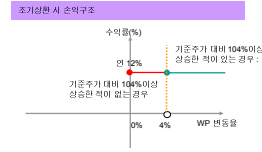
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우

: 원금 * 11.2%

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

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호

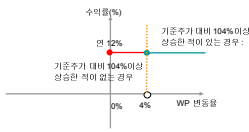
1. 계약금액

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

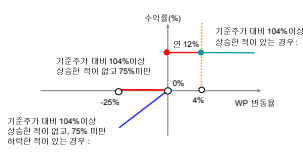
2. 만기시점의 수익구조

- 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 집중표현하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
 - 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (중도표현)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[79-4] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

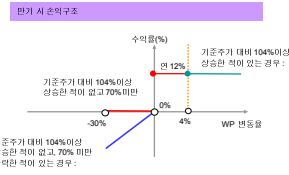
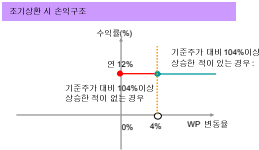
단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 10월 19일
- 3) 만드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일KOSPI200지수의 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 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



KR6008679TA3 굿모닝 신환증권(ELS)786

[79-5] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 10일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

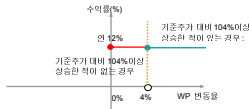
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

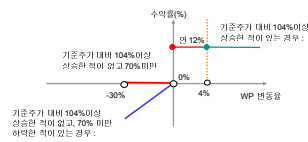
- 두 기초자산의 가격이 한 번도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600086761B7 국토부 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

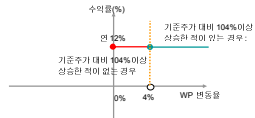
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정점에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

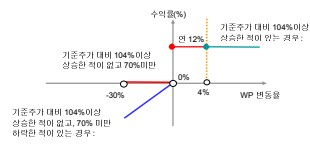
단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6000867CTB8 굿모닝 신한증권(ELS)804

[79-7] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 15일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 12월 19일 KOSPI200지수의 증가

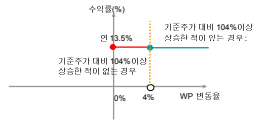
5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한비리드 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환

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

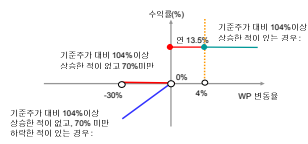
- 두 기초자산의 가격이 한비리드 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 113.5%
- 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나리드 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR60008675TC7 굿모닝 신한증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

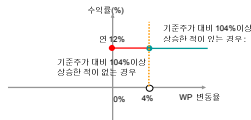
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000.0	0	5,000	차입

단위: (백만원)

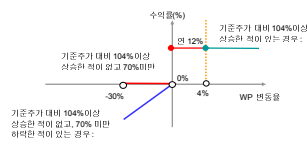
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TN2 우리투자증권 (ELS)1438

[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

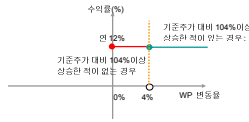
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위(백만원)

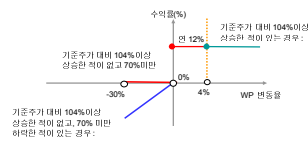
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 증도상환기간을 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 증도상환
 - 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

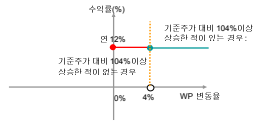
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위: (백만원)

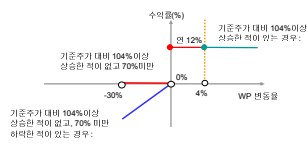
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 13일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

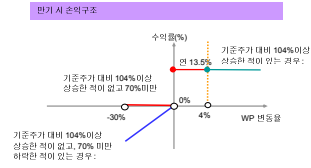
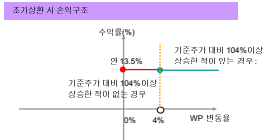
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

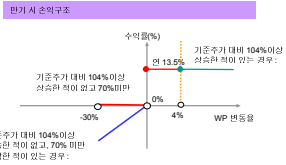
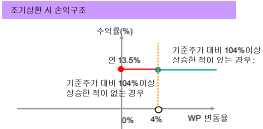
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 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 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 데리 조주가지 수연계사모증권5호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우

- 만기평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우

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

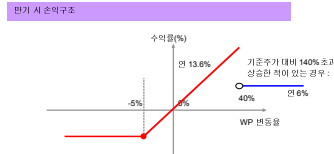
- 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우

: 원금 * 95%

기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 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%	-3.51	-3.94	-4.36	-4.78	-5.20	-5.62	-6.04	
시나리오	5.33%	-1.84	-2.26	-2.68	-3.10	-3.52	-3.95	-4.37	
	2.67%	-0.25	-0.67	-1.09	-1.51	-1.93	-2.35	-2.77	
	0%	1.26	0.84	0.42	0.00	-0.42	-0.84	-1.26	
	-2.67%	2.69	2.27	1.85	1.43	1.00	0.58	0.16	
	-5.33%	4.03	3.61	3.19	2.77	2.35	1.93	1.51	
	-8%	5.29	4.87	4.45	4.03	3.61	3.19	2.76	

최대 손실 시나리오

위험액	2.76
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

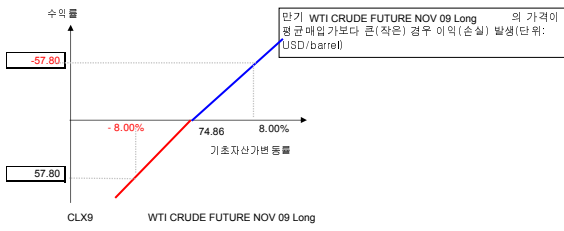
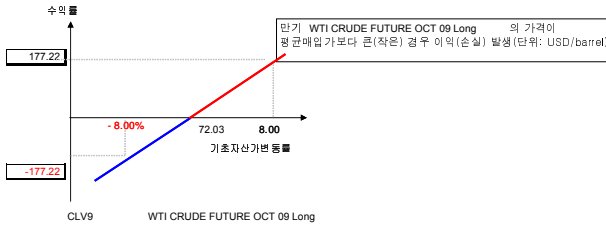
위험액	6.74
-----	------

[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	단위(계약)	비고
누계	유가증권	선물	41	0	41	장내	

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위: 1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long
 CLX9 WTI CRUDE FUTURE NOV 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	235.02
	5.33%	156.58
	2.67%	78.44
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-78.44
	-5.33%	-156.58
	-8%	-235.02

최대손실 시나리오	
위험액	-235.02

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	952
-----	-----

[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

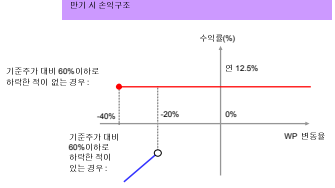
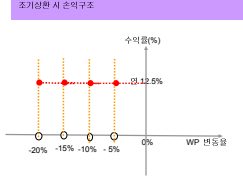
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우

: 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

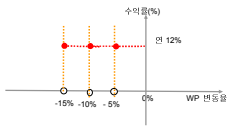
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위: (백만원)

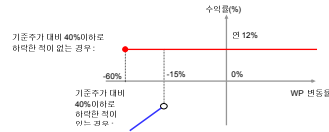
2. 연가시점의 손익구조

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조별 손실 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-2.93	-3.09	-3.24	-3.40	-3.56	-3.72	-3.88
산	5.33%	-0.76	-0.92	-1.07	-1.23	-1.39	-1.55	-1.71
시나리오	2.67%	0.38	0.22	0.06	-0.10	-0.26	-0.42	-0.57
	0%	0.48	0.32	0.16	0.00	-0.16	-0.32	-0.48
	-2.67%	-0.46	-0.62	-0.78	-0.94	-1.09	-1.25	-1.41
	-5.33%	-2.43	-2.59	-2.75	-2.91	-3.07	-3.22	-3.38
	-8%	-5.44	-5.60	-5.75	-5.91	-6.07	-6.23	-6.39

최대 손실 시나리오

위험액	-6.39
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	6.31
-----	------

[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호

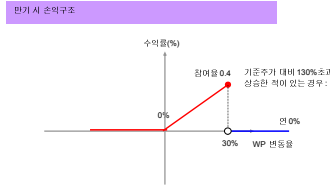
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6673105W54 - 금융증권-채피플러스(ELS)91

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	5.33%	-1.22	-3.23	-5.23	-7.24	-9.24	-11.25	-13.25
손익	2.67%	2.59	0.59	-1.42	-3.42	-5.43	-7.43	-9.44
시나리오	0%	6.01	4.01	2.00	0.00	-2.00	-4.01	-6.01
	-2.67%	9.05	7.04	5.04	3.03	1.03	-0.97	-2.98
	-5.33%	11.69	9.69	7.68	5.68	3.68	1.67	-0.33
	-8%	13.95	11.94	9.94	7.94	5.93	3.93	1.92

최대 손실 시나리오

위험액	1.92
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.97
-----	-------

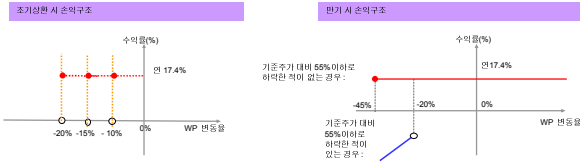
[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조표본들 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	4.42	3.79	3.17	2.54	1.92	1.29	0.67
	5.33%	4.27	3.64	3.02	2.39	1.77	1.14	0.52
시나리오	2.67%	3.42	2.79	2.17	1.55	0.92	0.30	-0.33
	0%	1.87	1.25	0.62	0.00	-0.62	-1.25	-1.87
	-2.67%	-0.37	-0.99	-1.62	-2.24	-2.87	-3.49	-4.12
	-5.33%	-3.31	-3.93	-4.56	-5.18	-5.81	-6.43	-7.06
	-8%	-6.95	-7.57	-8.20	-8.82	-9.45	-10.07	-10.70

최대 손실 시나리오

위험액	-10.70
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	12.33
-----	-------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

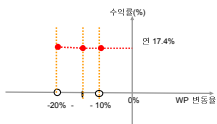
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

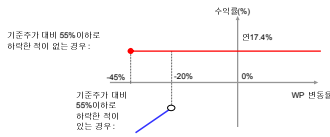
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주) 주가의 중도상환가액이 낮은 기초자산(기준)으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117.4%
- 두 기초자산의 가액 (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 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%	28.37	24.36	20.34	16.33	12.31	8.30	4.29
손시나리오	5.33%	27.41	23.40	19.39	15.37	11.36	7.34	3.33
	2.67%	21.97	17.96	13.94	9.93	5.91	1.90	-2.12
	0%	12.04	8.03	4.01	0.00	-4.01	-8.03	-12.04
	-2.67%	-2.37	-6.39	-10.40	-14.41	-18.43	-22.44	-26.46
	-5.33%	-21.27	-25.28	-29.29	-33.31	-37.32	-41.34	-45.35
	-8%	-44.65	-48.66	-52.68	-56.69	-60.71	-64.72	-68.73

최대 손실 시나리오

위험액	-68.73
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	79.24
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

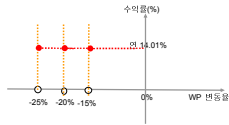
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: (백만원)

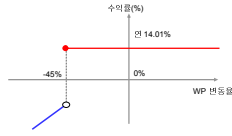
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백 만원)

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	-0.14	-0.17	-0.21	-0.25	-0.28	-0.32	-0.36
	5.33%	0.04	-0.00	-0.04	-0.07	-0.11	-0.15	-0.19
	2.67%	0.12	0.08	0.04	0.01	-0.03	-0.07	-0.10
	0%	0.11	0.07	0.04	0.00	-0.04	-0.07	-0.10
	-2.67%	0.01	-0.02	-0.06	-0.10	-0.13	-0.17	-0.21
	-5.33%	-0.17	-0.21	-0.25	-0.28	-0.32	-0.36	-0.40
	-8%	-0.45	-0.49	-0.52	-0.56	-0.60	-0.63	-0.67

최대 손실 시나리오

위험액	-0.67
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	1.68
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

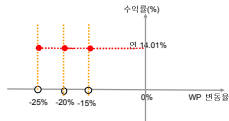
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

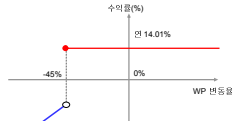
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2011년 5월 31일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 6월 1일 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 14.01%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 114.01%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 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%	-0.49	-0.62	-0.76	-0.89	-1.03	-1.16	-1.30
	5.33%	0.13	-0.00	-0.14	-0.27	-0.41	-0.54	-0.67
시나리오	2.67%	0.43	0.30	0.16	0.03	-0.11	-0.24	-0.38
	0%	0.40	0.27	0.13	0.00	-0.13	-0.27	-0.40
	-2.67%	0.05	-0.08	-0.22	-0.35	-0.49	-0.62	-0.75
	-5.33%	-0.62	-0.76	-0.89	-1.03	-1.16	-1.29	-1.43
	-8%	-1.62	-1.76	-1.89	-2.02	-2.16	-2.29	-2.43

최대 손실 시나리오

위험액	-2.43
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.08
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호

1. 계약금액

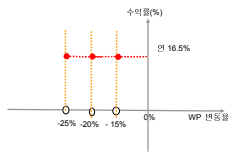
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

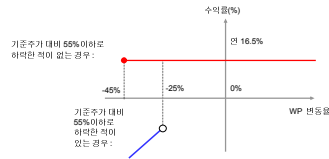
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산(중으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일) 연율 16.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06
	5.33%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
	2.67%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
-2.67%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
-5.33%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05
-8%	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10

최대 손실 시나리오

위험액	-0.10
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.04
-----	------

[87] 데리츠2SIa사모증권SEKT-이 호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

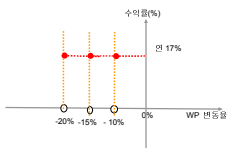
3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

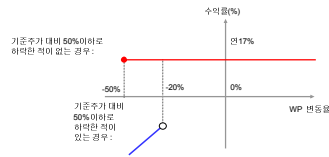
5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.

- 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 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조별 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6562319W52 유인 투기증권 (ELS)2415

손익 구조별 범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	2.11	1.68	1.25	0.82	0.39	-0.03	-0.46
손익	5.33%	2.30	1.87	1.44	1.01	0.58	0.16	-0.27
시나리오	2.67%	2.02	1.59	1.17	0.74	0.31	-0.12	-0.55
	0%	1.28	0.86	0.43	0.00	-0.43	-0.85	-1.28
	-2.67%	0.08	-0.35	-0.77	-1.20	-1.63	-2.06	-2.49
	-5.33%	-1.58	-2.01	-2.44	-2.87	-3.30	-3.72	-4.15
	-8%	-3.71	-4.14	-4.57	-5.00	-5.42	-5.85	-6.28

최대 손실 시나리오

위험액	-6.28
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.97
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SECOM-1호

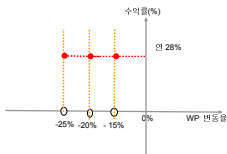
1. 계약금액

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

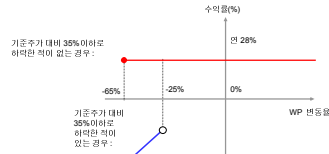
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 15일 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 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 요인을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 128%
→ 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	46.72	36.36	26.00	15.64	5.28	-5.08	-15.44
시나리오	5.33%	41.98	31.62	21.26	10.90	0.53	-9.83	-20.19
	2.67%	36.76	26.40	16.04	5.68	-4.68	-15.04	-25.40
	0%	31.08	20.72	10.36	0.00	-10.36	-20.72	-31.08
	-2.67%	24.93	14.57	4.21	-5.15	-16.81	-28.87	-37.23
	-5.33%	18.31	7.95	-2.41	-12.77	-23.13	-33.49	-43.85
	-8%	11.22	0.86	-9.50	-19.86	-30.22	-40.58	-50.94
	최대 손실 시나리오	위험액	-50.94					

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	52.09
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO

2) 만기: 2012년 5월 11일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2009년 5월 13일 LG전자 보통주, POSCO의 증가

5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, POSCO 주가)의 중도상환가격이

낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일)

80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일)

연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우

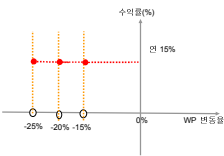
: 원금 * 115%

- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우

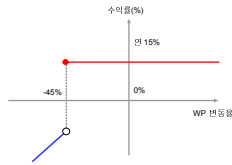
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.14	0.11	0.06	0.05	0.02	-0.01	-0.04
	5.33%	0.15	0.12	0.09	0.06	0.03	-0.00	-0.03
시나리오	2.67%	0.13	0.10	0.07	0.04	0.01	-0.02	-0.05
	0%	0.08	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09
	-2.67%	0.02	-0.01	-0.04	-0.07	-0.10	-0.13	-0.16
	-5.33%	-0.07	-0.10	-0.13	-0.16	-0.19	-0.22	-0.25
	-8%	-0.18	-0.21	-0.24	-0.27	-0.30	-0.33	-0.36

최대 손실 시나리오

위험액	-0.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.26
-----	------

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

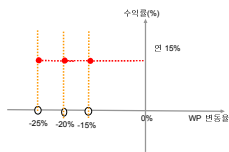
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위: (백만원)

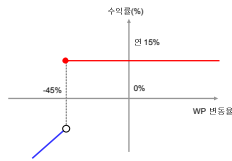
2. 만기시점의 손익구조

- 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) 만을 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	8%	10.48	8.23	5.98	3.72	1.47	-0.79	-3.04
시나리오	5.33%	11.14	8.89	6.63	4.38	2.12	-0.13	-2.38
	2.67%	9.90	7.65	5.39	3.14	0.88	-1.37	-3.62
	0%	6.76	4.51	2.25	0.00	-2.25	-4.51	-6.76
	-2.67%	1.73	-0.53	-2.78	-5.04	-7.29	-9.54	-11.80
	-5.33%	-9.21	-7.46	-5.72	-3.97	-2.23	-0.48	-1.73
	-8%	-14.04	-16.30	-18.55	-20.80	-23.06	-25.31	-27.57

최대 손실 시나리오

위험액	-27.57
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.09
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

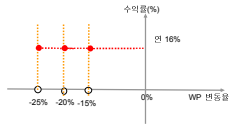
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	차입

단위(백만원)

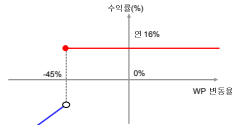
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 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
: 원금 * 110%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.66	0.53	0.40	0.27	0.13	0.00	-0.13
	5.33%	0.62	0.48	0.35	0.22	0.09	-0.04	-0.18
시나리오	2.67%	0.53	0.40	0.26	0.13	0.00	-0.13	-0.26
	0%	0.40	0.26	0.13	0.00	-0.13	-0.26	-0.40
	-2.67%	0.22	0.09	-0.04	-0.18	-0.31	-0.44	-0.57
	-5.33%	0.00	-0.13	-0.26	-0.40	-0.53	-0.66	-0.79
	-8%	-0.26	-0.39	-0.53	-0.66	-0.79	-0.92	-1.06

최대 손실 시나리오

위험액	-1.06
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.79
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

1. 계약금액

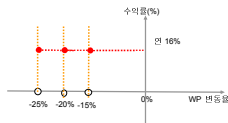
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	차입

단위:백만원

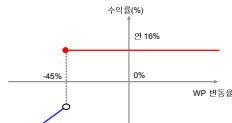
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대손실가능금액(단위:백만원))
KR6522308W66 대우증권ELS2986

손익구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	11.85	9.48	7.12	4.76	2.39	0.03	-2.34
시나리오	5.33%	11.05	8.68	6.32	3.95	1.59	-0.78	-3.14
	2.67%	9.46	7.10	4.73	2.37	0.00	-2.36	-4.72
	0%	7.09	4.73	2.36	0.00	-2.36	-4.73	-7.09
	-2.67%	3.94	1.56	-0.79	-3.15	-5.51	-7.88	-10.24
	-5.33%	0.01	-2.35	-4.72	-7.08	-9.45	-11.81	-14.17
	-8%	-4.70	-7.07	-9.43	-11.80	-14.16	-16.53	-18.89

최대손실 시나리오

위험액	-18.89
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.23
-----	-------

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

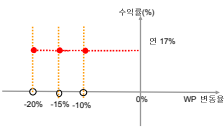
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위(백만원)

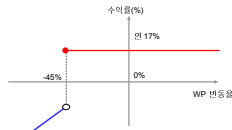
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.46	3.46	2.46	1.46	0.45	-0.55	-1.55
시나리오	5.33%	4.52	3.52	2.52	1.52	0.52	-0.48	-1.49
	2.67%	4.04	3.04	2.03	1.03	0.03	-0.97	-1.97
	0%	3.00	2.00	1.00	0.00	-1.00	-2.00	-3.00
	-2.67%	1.42	0.42	-0.58	-1.58	-2.58	-3.58	-4.59
	-5.33%	-0.71	-1.71	-2.71	-3.71	-4.71	-5.71	-6.72
	-8%	-3.38	-4.39	-5.39	-6.39	-7.39	-8.39	-9.39

최대 손실 시나리오

위험액	-9.39
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.06
-----	-------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

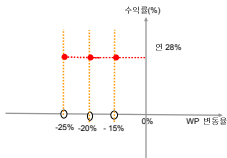
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위:백만원

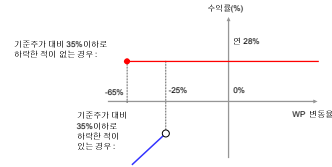
2. 만기시점의 손익구조

- 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) 만할 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 끝드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 35% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우
 : 원금 * 128%
 - 두 기초자산의 가액(장종 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35% 미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	5.33%	30.97	23.44	15.91	8.38	0.85	-6.68	-14.21
시나리오	2.67%	27.37	19.84	12.31	4.78	-2.75	-10.28	-17.81
	0%	22.59	15.06	7.53	0.00	-7.53	-15.06	-22.59
	-2.67%	16.62	9.09	1.56	-6.97	-13.90	-21.03	-28.56
	-5.33%	9.45	1.92	-5.61	-13.14	-20.67	-28.20	-35.73
	-8%	1.10	-6.43	-13.96	-21.49	-29.02	-36.55	-44.08

최대 손실 시나리오

위험액	-44.08
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	47.02
-----	-------

[95] 데리츠1Star사모증권BE-1호

1. 계약금액

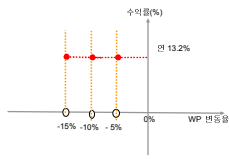
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위: (백만원)

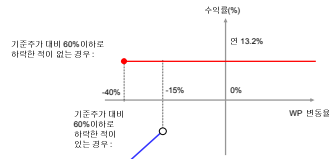
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

손익 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
	-8%	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
-----	------

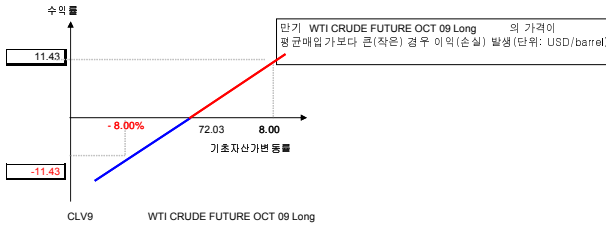
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	11.43
	5.33%	7.62
	2.67%	3.82
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.82
	-5.33%	-7.62
	-8%	-11.43

최대손실 시나리오	
위험액	-11.43

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	45
-----	----

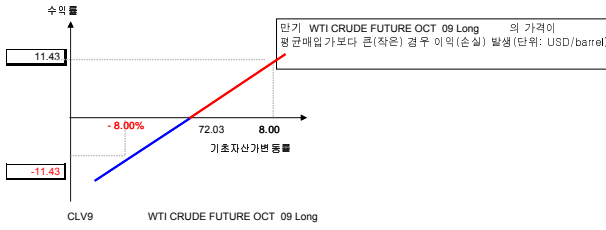
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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 구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	43.80
	5.33%	29.18
	2.67%	14.62
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-14.62
	-5.33%	-29.18
	-8%	-43.80

최대 손실 시나리오	
위험액	-43.80

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

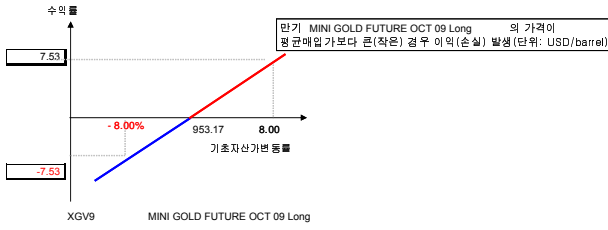
위험액	177
-----	-----

[96-2] 헤지츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 헷지시점의 손익 구조



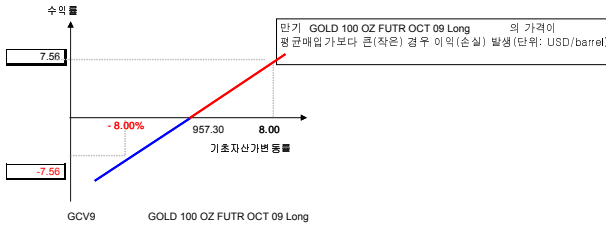
[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조

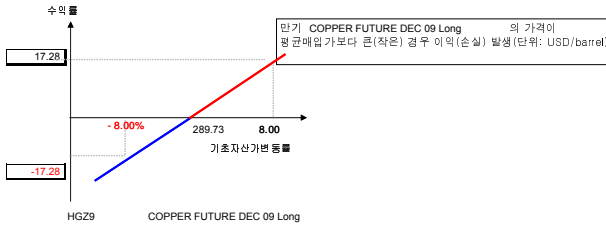


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조

