

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

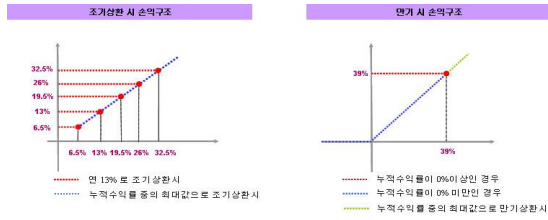
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

단, 만기시 까지 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%	0.08	0.08	0.08	0.08	0.08	0.08	0.08
	5.33%	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05
	2.67%	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	-5.33%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
-8%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 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

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.12
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.17
-----	------

14) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

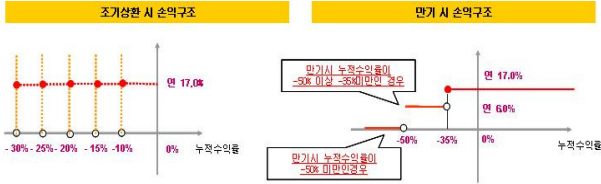
3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.01
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[6]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 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

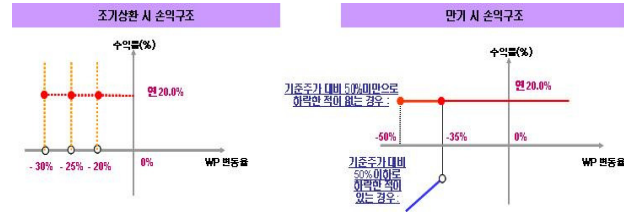
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우

: 원금 * 140%

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

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KRB0376207AD 이력(상종전) (LS)243

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	12.11	11.20	10.29	9.38	8.47	7.56	6.66
	5.33%	9.29	8.38	7.47	6.56	5.65	4.74	3.83
	2.67%	6.16	5.25	4.34	3.43	2.52	1.61	0.71
	0%	2.73	1.82	0.91	0.00	-0.91	-1.82	-2.73
	-2.67%	-1.01	-1.92	-2.83	-3.74	-4.65	-5.55	-6.46
	-5.33%	-5.05	-5.96	-6.87	-7.78	-8.69	-9.59	-10.50
	-8%	-9.40	-10.30	-11.21	-12.12	-13.03	-13.94	-14.85

최대 손실 시나리오

위험액	-14.85
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	15.01
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자신탁 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) 만큼 15.8%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345TTB9 변동주변(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	17.22	16.36	15.50	14.65	13.79	12.93	12.07
손익	5.33%	12.28	11.42	10.56	9.71	8.85	7.99	7.13
손익	2.67%	7.40	6.54	5.68	4.82	3.97	3.11	2.25
손익	0%	2.57	1.72	0.86	0.00	-0.86	-1.72	-2.57
손익	-2.67%	-2.19	-3.05	-3.91	-4.77	-5.62	-6.48	-7.34
손익	-5.33%	-6.90	-7.76	-8.62	-9.47	-10.33	-11.19	-12.05
손익	-8%	-11.55	-12.41	-13.26	-14.12	-14.98	-15.84	-16.69

최대 손실 시나리오

위험액	-16.69
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.70
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

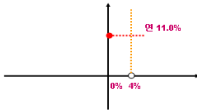
구분	기대자산	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,471	0	7,471	잔위

단위(백만원)

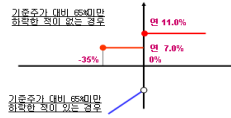
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR600345RT28 비파생상품(ELS) 2007-397세

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	430.74	411.30	391.86	372.42	352.98	333.54	314.10
시나리오	5.33%	305.18	285.74	266.30	246.86	227.42	207.98	188.54
	2.67%	181.04	161.60	142.16	122.72	103.28	83.84	64.40
	0%	58.32	38.88	19.44	0.00	-19.44	-38.88	-58.32
	-2.67%	-62.96	-82.42	-101.86	-121.30	-140.74	-160.18	-179.62
	-5.33%	-182.65	-202.29	-221.73	-241.17	-260.61	-280.05	-299.49
	-8%	-301.31	-320.75	-340.19	-359.63	-379.07	-398.51	-417.95

최대 손실 시나리오

위험액	-417.95
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	416.72
-----	--------

[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.

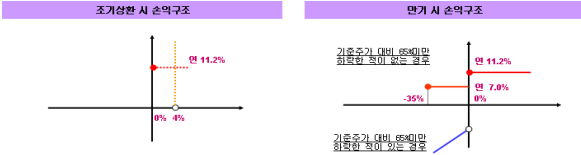
단, 연가시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR60034SST27 최대 손실 (ELS) 2007-3984

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	41.37	39.51	37.64	35.77	33.90	32.04	30.17
시나리오	5.33%	29.31	27.44	25.57	23.71	21.84	19.97	18.10
	2.67%	17.39	15.52	13.65	11.78	9.92	8.05	6.18
	0%	5.60	3.73	1.87	0.00	-1.87	-3.73	-5.60
	-2.67%	-6.04	-7.91	-9.78	-11.64	-13.51	-15.38	-17.25
	-5.33%	-17.54	-19.41	-21.28	-23.15	-25.01	-26.88	-28.75
	-8%	-28.91	-30.77	-32.64	-34.51	-36.38	-38.24	-40.11

최대 손실 시나리오

위험액	-40.11
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.58
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

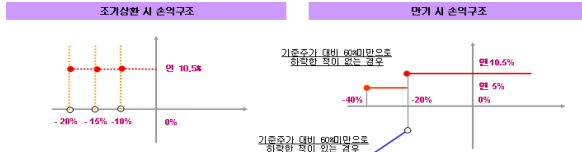
1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 04월 19일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 4월 20일 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월마다 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 만드침
- 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 구조표본들 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	508.67	475.83	442.99	410.15	377.31	344.47	311.64
시나리오	5.33%	392.27	359.43	326.59	293.76	260.92	228.08	195.24
	2.67%	255.55	222.72	189.88	157.04	124.20	91.36	58.52
	0%	98.52	65.68	32.84	0.00	-32.84	-65.68	-98.52
	-2.67%	-78.85	-111.68	-144.52	-177.36	-210.20	-243.04	-275.88
	-5.33%	-276.53	-309.37	-342.20	-375.04	-407.88	-440.72	-473.56
	-8%	-494.53	-527.37	-560.21	-593.05	-625.89	-658.72	-691.56

최대 손실 시나리오

위험액	-691.56
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	695.22
-----	--------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

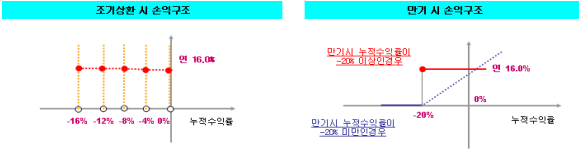
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 만기: 2010년 6월 3일
- 관점자산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2007년 6월 5일의 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 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 16.0%로 중도상환됨.
(누적 수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)
단, 만기시 까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 누적 수익률])
- 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007-504

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.80	0.73	0.66	0.59	0.52	0.45	0.38
	5.33%	0.59	0.52	0.46	0.39	0.32	0.25	0.18
	2.67%	0.40	0.33	0.26	0.19	0.12	0.05	-0.02
	0%	0.21	0.14	0.07	0.00	-0.07	-0.14	-0.21
	-2.67%	0.03	-0.04	-0.11	-0.18	-0.25	-0.32	-0.39
	-5.33%	-0.14	-0.21	-0.28	-0.35	-0.42	-0.49	-0.56
	-8%	-0.31	-0.38	-0.45	-0.52	-0.58	-0.65	-0.72

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

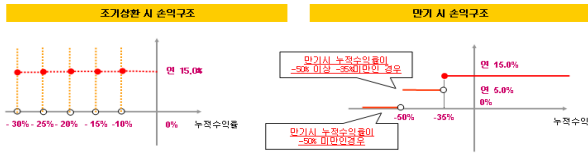
1. 계약금액

구분	기대자산	기대유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,907	0	1,907	잔액

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762C780 미래예상종일(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.87	0.64	0.40	0.17	-0.07	-0.30	-0.54
	5.33%	0.87	0.64	0.40	0.17	-0.07	-0.30	-0.54
	2.67%	0.82	0.58	0.35	0.11	-0.13	-0.36	-0.60
	0%	0.71	0.47	0.24	0.00	-0.24	-0.47	-0.71
	-2.67%	0.54	0.31	0.07	-0.16	-0.40	-0.64	-0.87
	-5.33%	0.32	0.09	-0.15	-0.38	-0.62	-0.86	-1.09
	-8%	0.05	-0.19	-0.42	-0.66	-0.89	-1.13	-1.36

최대 손실 시나리오

위험액	-1.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.51
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제10호

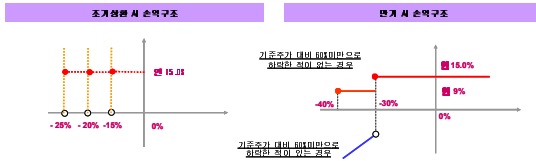
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2009년 9월 18일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 9월 19일의 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(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%	148.00	145.18	142.35	139.53	136.71	133.89	131.07
	5.33%	120.63	117.80	114.96	112.16	109.34	106.51	103.69
	2.67%	74.11	71.29	68.47	65.65	62.83	60.00	57.18
	0%	8.47	5.64	2.82	0.00	-2.82	-5.64	-8.47
	-2.67%	-76.32	-79.14	-81.96	-84.79	-87.61	-90.43	-93.25
	-5.33%	-180.24	-183.06	-185.88	-188.71	-191.53	-194.35	-197.17
-8%	-303.30	-306.12	-308.94	-311.77	-314.59	-317.41	-320.23	

최대 손실 시나리오

위험액 -320.23

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 370.14

[13] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제12호

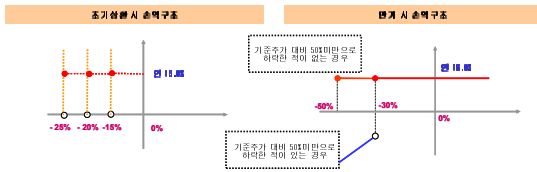
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 최(최대)손실가능금액(단위:백만원)
KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	134.82	131.02	127.22	123.43	119.63	115.83	112.04
	5.33%	91.12	87.33	83.53	79.73	75.93	72.14	68.34
	2.67%	49.98	46.18	42.39	38.59	34.79	30.99	27.20
	0%	11.39	7.59	3.80	0.00	-3.80	-7.59	-11.39
	-2.67%	-24.64	-28.44	-32.24	-36.04	-39.83	-43.63	-47.43
	-5.33%	-58.13	-61.92	-65.72	-69.52	-73.32	-77.11	-80.91
	-8%	-89.05	-92.85	-96.65	-100.45	-104.24	-108.04	-111.84

최대 손실 시나리오

위험액	-111.84
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	118.42
-----	--------

[14] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제13호

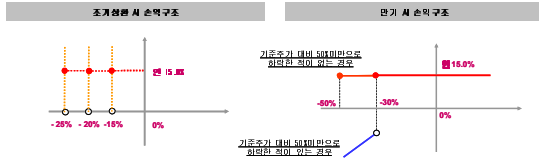
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762B7B0 비례예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.18	4.94	4.70	4.47	4.23	3.99	3.75
	5.33%	3.85	3.61	3.37	3.13	2.89	2.65	2.42
	2.67%	2.36	2.12	1.88	1.64	1.40	1.17	0.93
	0%	0.72	0.48	0.24	0.00	-0.24	-0.48	-0.72
	-2.67%	-1.08	-1.32	-1.56	-1.80	-2.04	-2.28	-2.51
	-5.33%	-3.04	-3.27	-3.51	-3.75	-3.99	-4.23	-4.47
	-8%	-5.14	-5.38	-5.62	-5.86	-6.10	-6.34	-6.57

최대 손실 시나리오

위험액 -6.57

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 6.64

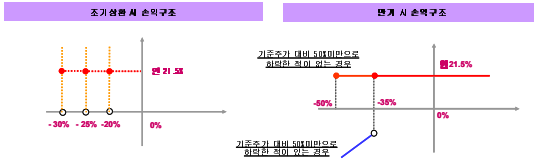
[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345EV11 변동증권(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	215.30	191.51	167.72	143.93	120.14	96.35	72.56
	5.33%	168.04	144.25	120.46	96.67	72.88	49.09	25.30
	2.67%	120.06	96.27	72.48	48.69	24.91	1.12	-22.67
	0%	71.37	47.58	23.79	0.00	-23.79	-47.58	-71.37
	-2.67%	21.95	-1.84	-25.62	-49.41	-73.20	-96.99	-120.78
	-5.33%	-28.18	-51.97	-75.76	-99.55	-123.34	-147.13	-170.92
	-8%	-79.03	-102.82	-126.61	-150.40	-174.19	-197.98	-221.77

최대 손실 시나리오	
위험액	-221.77

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	217.89
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 괴생상률 제 1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

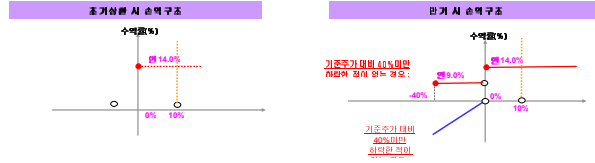
3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 종가

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

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 배후증권(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	552.84	533.71	514.58	495.45	476.32	457.18	438.05
	5.33%	395.07	375.94	356.81	337.68	318.55	299.41	280.28
시나리오	2.67%	229.93	210.79	191.66	172.53	153.40	134.26	115.13
	0%	57.40	38.26	19.13	0.00	-19.13	-38.26	-57.40
	-2.67%	-122.51	-141.84	-161.16	-179.91	-199.04	-218.17	-237.30
	-5.33%	-309.80	-328.93	-348.06	-367.20	-386.33	-405.46	-424.59
	-8%	-504.47	-523.60	-542.73	-561.86	-580.99	-600.13	-619.26

최대 손실 시나리오

위험액	-619.26
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	586.20
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위파생26호

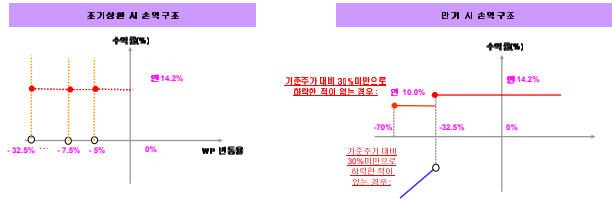
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR600867BTB0 코무보신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	214.67	184.93	155.16	125.44	95.70	65.96	36.22
	5.33%	172.81	143.07	113.33	83.59	53.85	24.11	-5.63
	2.67%	131.00	101.26	71.52	41.78	12.03	-17.71	-47.45
	0%	89.22	59.48	29.74	0.00	-29.74	-59.48	-89.22
	-2.67%	47.49	17.75	-12.00	-41.74	-71.48	-101.22	-130.96
	-5.33%	5.79	-23.95	-53.70	-83.44	-113.18	-142.92	-172.66
	-8%	-35.87	-65.61	-95.36	-125.10	-154.84	-184.58	-214.32

최대 손실 시나리오	
위험액	-214.32

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	259.02
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

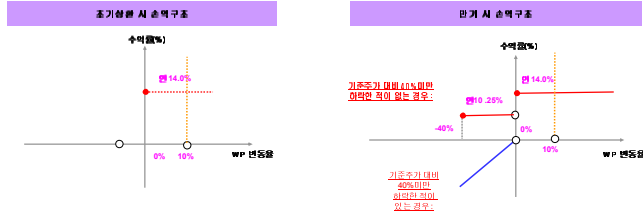
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	103.91	98.38	92.80	87.25	81.69	76.14	70.59
손익	5.33%	74.11	68.58	63.00	57.44	51.89	46.33	40.78
손익	2.67%	45.02	39.47	33.91	28.36	22.80	17.25	11.69
손익	0%	16.66	11.11	5.55	0.00	-5.55	-11.11	-16.66
손익	-2.67%	-10.97	-16.53	-22.06	-27.63	-33.19	-38.74	-44.30
손익	-5.33%	-37.88	-43.44	-48.99	-54.54	-60.10	-65.65	-71.21
손익	-8%	-64.07	-69.62	-75.18	-80.73	-86.28	-91.84	-97.39

최대 손실 시나리오

위험액	70.59
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	97.59
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 퍼싱5호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

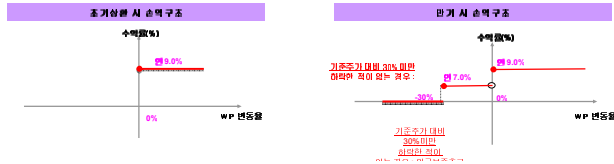
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 * 121%

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

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762RV14 미래에셋증권(ELS)289

구분	손익구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	44.54	41.19	37.84	34.49	31.14	27.78	24.43
	5.33%	33.87	30.52	27.17	23.82	20.47	17.11	13.76
	2.67%	22.38	19.02	15.67	12.32	8.97	5.62	2.27
	0%	10.05	6.70	3.35	0.00	-3.35	-6.70	-10.05
	-2.67%	-3.09	-6.44	-9.80	-13.15	-16.50	-19.85	-23.20
	-5.33%	-17.07	-20.42	-23.77	-27.12	-30.47	-33.82	-37.17
	-8%	-31.86	-35.22	-38.57	-41.92	-45.27	-48.62	-51.97

최대 손실 시나리오

위험액	24.43
-----	-------

4. 파생상품의 최대 예상금액 (단위:백만원)

위험액	54.23
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단원 피싱6호

1. 계약금액

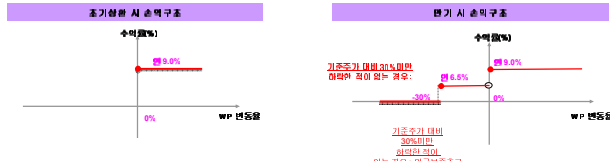
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,080	0	1,080	잔위

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 평가: 2011년 2월 21일
- 3) 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, 평가시점까지 조기상환조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환비도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 * 119.5%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우 : 원금*100%
 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 미래에셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	33.18	30.53	27.87	25.22	22.57	19.91	17.26
	5.33%	25.28	22.63	19.98	17.32	14.67	12.01	9.36
	2.67%	16.88	14.22	11.57	8.91	6.26	3.61	0.95
	0%	7.96	5.31	2.65	0.00	-2.65	-5.31	-7.96
	-2.67%	-1.46	-4.12	-6.77	-9.42	-12.08	-14.73	-17.39
	-5.33%	-11.39	-14.05	-16.70	-19.36	-22.01	-24.66	-27.32
	-8%	-21.83	-24.49	-27.14	-29.80	-32.45	-35.10	-37.76

최대 손실 시나리오

위험액	17.26
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	37.56
-----	-------

[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. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 2월 21일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

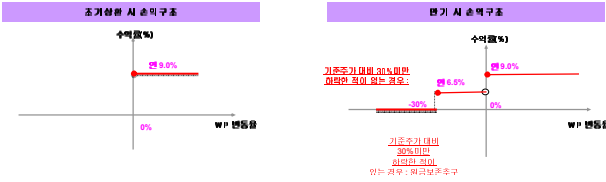
단, 평가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

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

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

: 원금*100%

6) 관트의 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%	25.81	23.74	21.68	19.61	17.55	15.49	13.42
	5.33%	19.66	17.60	15.54	13.47	11.41	9.34	7.28
	2.67%	13.13	11.06	9.00	6.93	4.87	2.81	0.74
	0%	6.19	4.13	2.06	0.00	-2.06	-4.13	-6.19
	-2.67%	-1.14	-3.20	-5.27	-7.33	-9.39	-11.46	-13.52
	-5.33%	-8.86	-10.93	-12.99	-15.05	-17.12	-19.18	-21.25
	-8%	-16.98	-19.05	-21.11	-23.17	-25.24	-27.30	-29.37

최대 손실 시나리오

위험액	13.42
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.22
-----	-------

[23] 메리츠증권 증권계사모과정1호

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) 평가대상상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 평가: 2010년 08월 04일

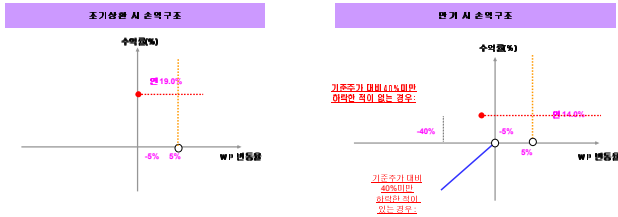
3) 펀드청산결정주기: 매 3개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 우리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	134.59	125.87	117.15	108.42	99.70	90.98	82.25
	5.33%	99.15	90.43	81.71	72.98	64.26	55.54	46.81
	2.67%	63.01	54.29	45.56	36.84	28.12	19.39	10.67
	0%	26.17	17.45	8.72	0.00	-8.72	-17.45	-26.17
	-2.67%	-11.37	-20.10	-28.82	-37.54	-46.27	-54.99	-63.71
	-5.33%	-49.61	-58.34	-67.06	-75.78	-84.51	-93.23	-101.95
	-8%	-88.56	-97.28	-106.00	-114.73	-123.45	-132.17	-140.90

최대 손실 시나리오

위험액 -140.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 137.38

[24] 메리츠2Star 파생 상품 SEPO-1호

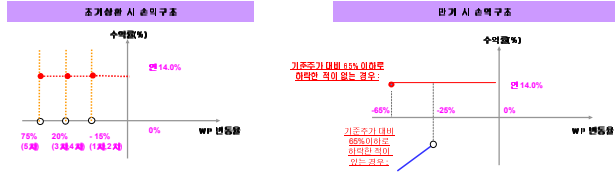
1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011년 08월 26일
- 3) 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/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(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

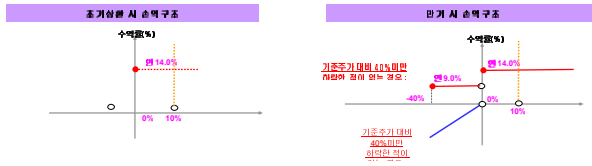
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	677.59	654.14	630.69	607.24	583.79	560.34	536.89
	5.33%	484.22	460.77	437.32	413.87	390.42	366.97	343.52
	2.67%	281.80	258.36	234.91	211.46	188.01	164.56	141.11
	0%	70.35	46.90	23.45	0.00	-23.45	-46.90	-70.35
	-2.67%	-150.15	-173.60	-197.05	-220.50	-243.95	-267.40	-290.85
	-5.33%	-379.70	-403.15	-426.60	-450.05	-473.50	-496.95	-520.39
	-8%	-618.29	-641.74	-665.19	-688.64	-712.09	-735.54	-758.99
	최대 손실 시나리오							
위험액	-758.99							

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 718.47

[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

2) 만기: 2010년 09월 30일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 종가

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(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%	-0.14	-0.15	-0.16	-0.17	-0.19	-0.20	-0.21
	5.33%	-0.02	-0.03	-0.04	-0.06	-0.07	-0.08	-0.09
	2.67%	0.04	0.03	0.01	0.00	-0.01	-0.02	-0.03
	0%	0.04	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.02	-0.04
	-2.67%	-0.03	-0.04	-0.05	-0.06	-0.08	-0.09	-0.10
	-5.33%	-0.15	-0.17	-0.18	-0.19	-0.20	-0.21	-0.22
	-8%	-0.34	-0.35	-0.36	-0.38	-0.39	-0.40	-0.41
	최대 손실 시나리오							
위험액	-0.41							

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.36
-----	------

[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

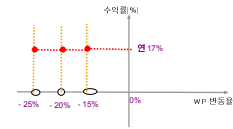
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,096	0	1,096	상위

단위(백만원)

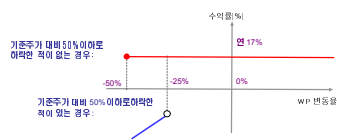
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 2) 만기: 2011년 09월 23일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2008년 09월 26일 삼성전자, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 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)만큼 17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우
 : 원금 * 151.0%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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%	-1.64	-2.15	-2.67	-3.18	-3.69	-4.21	-4.72
	5.33%	0.94	0.43	-0.09	-0.60	-1.11	-1.63	-2.14
	2.67%	2.00	1.49	0.97	0.46	-0.05	-0.57	-1.08
	0%	1.54	1.03	0.51	0.00	-0.51	-1.03	-1.54
	-2.67%	-0.44	-0.95	-1.47	-1.98	-2.49	-3.01	-3.52
	-5.33%	-3.94	-4.45	-4.97	-5.48	-5.99	-6.51	-7.02
	-8%	-8.96	-9.47	-9.99	-10.50	-11.01	-11.53	-12.04

최대 손실 시나리오

위험액	-12.04
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.08
-----	-------

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

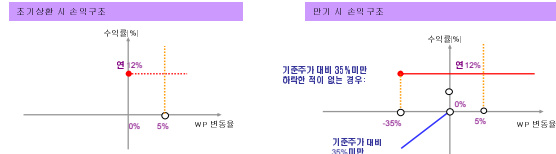
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액금(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조인출(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6583337V98 현대증권(ELS)2008-945

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생 13

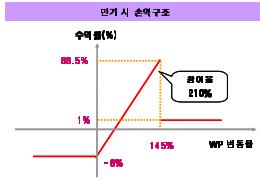
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 펀드청산 결정주기: 만기일 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우
 : 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수 / 최초기준지수 - 1))
 - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우
 : 원금 * 94%
 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우
 : 원금 * 101%
- 6) 펀드의 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-63.89	-71.94	-79.99	-88.04	-96.09	-104.14	-112.19
	5.33%	-31.75	-39.80	-47.86	-55.91	-63.96	-72.01	-80.06
	2.67%	-24.41	-30.46	-36.51	-42.56	-48.61	-54.66	-60.71
	0%	24.15	16.10	8.05	0.00	-8.05	-16.10	-24.15
	-2.67%	47.93	39.88	31.83	23.77	15.72	7.67	-0.38
	-5.33%	68.92	60.86	52.81	44.76	36.71	28.66	20.61
	-8%	87.12	79.07	71.01	62.96	54.91	46.86	38.81

최대 손실 시나리오

위험액	38.81
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	102.76
-----	--------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

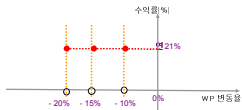
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

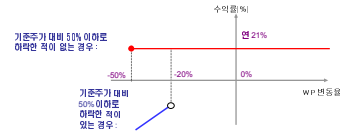
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	8.40	6.99	5.59	4.18	2.78	1.37	-0.03
	5.33%	7.65	6.25	4.84	3.44	2.03	0.63	-0.78
	2.67%	6.26	4.85	3.45	2.04	0.64	-0.77	-2.17
	0%	4.21	2.81	1.40	0.00	-1.40	-2.81	-4.21
	-2.67%	1.52	0.12	-1.28	-2.69	-4.09	-5.50	-6.90
	-5.33%	-1.81	-3.22	-4.62	-6.03	-7.43	-8.84	-10.24
	-8%	-5.80	-7.20	-8.61	-10.01	-11.42	-12.82	-14.22

최대 손실 시나리오

위험액	-14.22
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	16.02
-----	-------

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

1. 계약금액

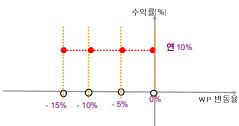
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

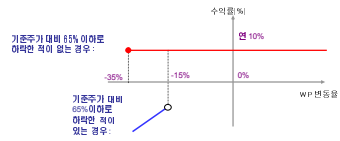
2. 만기시점의 손익구조

- 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 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 0.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가액이 만기기준가액의 65%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동/최대손실가능금액 (다위:백만원)

메리츠주가지수연계사모증권2호

손익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

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

1. 계약금액

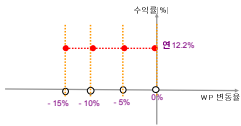
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액금(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위(백만원)

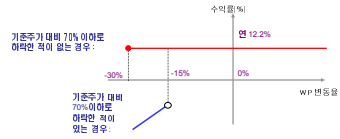
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교
 KR600690MM/M7 대우증권 ELS2697

1. 계약금액

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

단위(백만원)

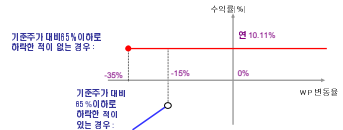
2. 연가시점의 손익구조

- 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 만월10.11%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 → 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 85%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 110.11%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월 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 수익확정 후 만도침지

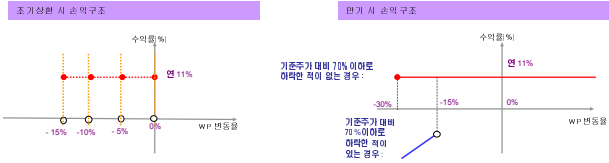
- 두 기준자산의 가격이 만도침 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

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

: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조



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

1. 계약금액

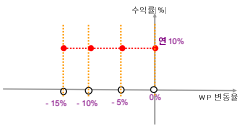
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

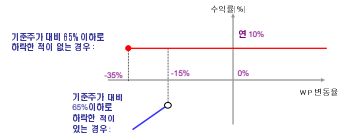
2. 연기시점의 손익구조

- 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 한반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.0%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 6월 12일

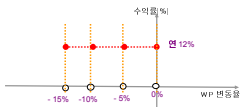
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

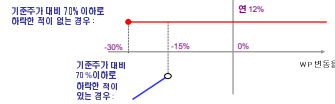
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고,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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기 : 2009년 6월 10일
- 3) 권드청산 결정 주기 : 매3개월
- 4) 기 준지수 : 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[80-8] 메리츠투자지수연계사모증권2호
 KR6030617V83
 교보증권(ELS)269회

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장의파생상품과 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 6월 18일

3) 권드청산 결정 주기: 매4개월

4) 기 준지 수: 2008년 6월 18일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가액이

낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가액 의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일)

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

만족 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

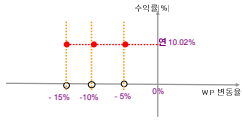
: 원금 * 110.02%

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

: 원금 * (만기 기 준지 수/최 초기 준지 수)

6) 권 드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] **메리츠주가지수연계사로증권2호**

1. **계약금액**

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

단위(백만원)

2. **연기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

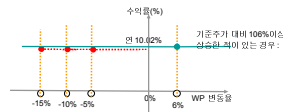
2) 만기: 2011년 5월 27일

3) 만드침산 결정주기: 매 4개월

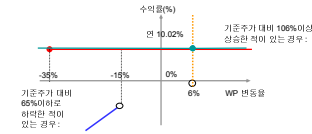
4) 기준지수: 2000년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHG-2

1. 계약금액

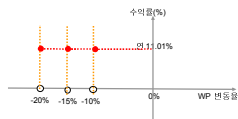
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	잔액

단위(백만원)

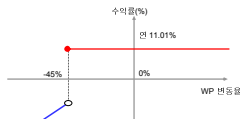
2. 만기시점의 손익구조

- 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%	-0.21	-0.20	-0.19	-0.18	-0.18	-0.17	-0.16			
	5.33%	-0.09	-0.09	-0.08	-0.07	-0.06	-0.05	-0.05			
	2.67%	-0.03	-0.02	-0.02	-0.01	-0.00	0.01	0.02			
	0%	-0.02	-0.02	-0.01	0.00	0.01	0.02	0.02			
	-2.67%	-0.07	-0.06	-0.05	-0.04	-0.04	-0.03	-0.02			
	-5.33%	-0.16	-0.16	-0.15	-0.14	-0.13	-0.12	-0.12			
	-8%	-0.31	-0.30	-0.30	-0.29	-0.28	-0.27	-0.26			

최대 손실 시나리오

위험액 -0.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1.51

[62] 데리츠2Star사모증권투자STWF-1

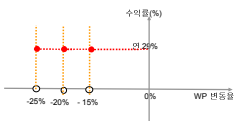
1. 계약금액

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

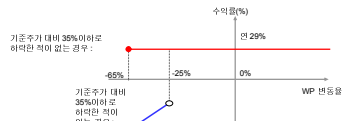
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 만드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융저주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.9%
 - 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 코브증권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	손익 구조변동 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	2.16	1.67	1.19	0.70	0.21	-0.27	-0.76
손익	5.33%	3.34	2.66	2.37	1.88	1.40	0.91	0.42
시나리오	2.67%	3.11	2.62	2.14	1.65	1.16	0.68	0.19
	0%	1.46	0.97	0.49	0.00	-0.49	-0.97	-1.46
	-2.67%	-1.61	-2.09	-2.56	-3.01	-3.55	-4.04	-4.53
	-5.33%	-6.09	-6.58	-7.06	-7.55	-8.04	-8.52	-9.01
	-8%	-11.99	-12.48	-12.96	-13.45	-13.94	-14.42	-14.91

최대 손실 시나리오

위험액	-14.91
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.96
-----	------

[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

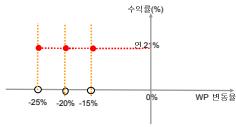
4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가

5) 발행 후 매6개월 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 21%의 수익률로 중도 상환이 됨.

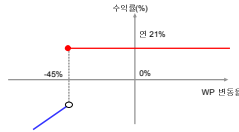
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 121%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

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%	-0.46	-0.44	-0.42	-0.41	-0.39	-0.37	-0.35
시나리오	5.33%	-0.21	-0.19	-0.17	-0.16	-0.14	-0.12	-0.10
	2.67%	-0.07	-0.06	-0.04	-0.02	-0.00	0.02	0.03
	0%	-0.05	-0.04	-0.02	0.00	0.02	0.04	0.05
	-2.67%	-0.15	-0.13	-0.11	-0.10	-0.08	-0.06	-0.04
	-5.33%	-0.36	-0.34	-0.33	-0.31	-0.29	-0.27	-0.26
	-8%	-0.69	-0.67	-0.65	-0.64	-0.62	-0.60	-0.58

최대 손실 시나리오

위험액	-0.66
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	3.35
-----	------

[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

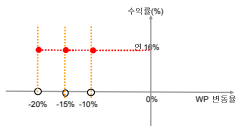
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

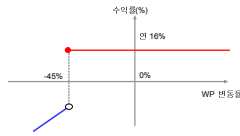
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 + 11.6%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환 시 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%	1.33	1.01	0.69	0.37	0.05	-0.27	-0.59	
시나리오	5.33%	1.71	1.39	1.07	0.75	0.43	0.11	-0.21	
	2.67%	1.58	1.26	0.94	0.62	0.30	-0.02	-0.34	
	0%	0.96	0.64	0.32	0.00	-0.32	-0.64	-0.96	
	-2.67%	-0.16	-0.48	-0.80	-1.12	-1.44	-1.76	-2.08	
	-5.33%	-1.79	-2.11	-2.43	-2.75	-3.07	-3.39	-3.71	
	-8%	-3.92	-4.24	-4.56	-4.88	-5.20	-5.52	-5.84	

최대 손실 시나리오

위험액	-5.64
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	12.68
-----	-------

[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

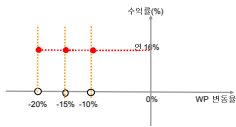
3) 만드정산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

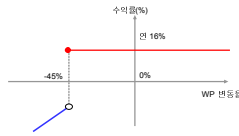
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시점까지 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%	0.08	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04
시나리오	5.33%	0.10	0.08	0.06	0.04	0.03	0.01	-0.01
	2.67%	0.09	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	-0.11	-0.12
	-5.33%	-0.11	-0.13	-0.15	-0.16	-0.18	-0.20	-0.22
	-8%	-0.23	-0.25	-0.27	-0.29	-0.31	-0.33	-0.35

최대 손실 시나리오

위험액	-0.95
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.76
-----	------

[67] 테리츠2Star사모증권SET-1

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

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

- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우

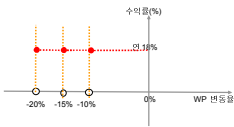
: 원금 + 11.8%

- 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우

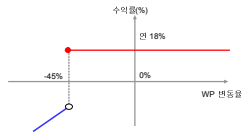
: 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.31	1.31	-1.69	-4.68	-7.68	-10.68	-13.68
시나리오	5.33%	8.36	5.37	2.37	-0.63	-3.63	-6.62	-9.62
오	2.67%	9.93	6.93	3.93	0.93	-2.07	-5.06	-8.06
	0%	8.99	6.00	3.00	0.00	-3.00	-6.00	-8.99
	-2.67%	5.57	2.57	-0.43	-3.43	-6.42	-9.42	-12.42
	-5.33%	-0.36	-3.35	-6.35	-9.35	-12.35	-15.34	-18.34
	-8%	-6.77	-11.77	-14.77	-17.76	-20.76	-23.76	-26.76

최대 손실 시나리오

위험액	-26.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	19.60
-----	-------

[6B] 테리츠2Star사모증권SET-4호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 06일

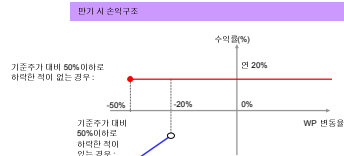
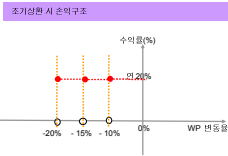
3) 만드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

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

6) 원도의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622303W44 표본증권(ELS)322

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오					변동성 시나리오				
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%			
기초자산	8%	1.01	0.22	-0.58	-1.38	-2.17	-2.97	-3.76		
시나리오	5.33%	2.53	1.73	0.94	0.14	-0.65	-1.45	-2.24		
	2.67%	2.99	2.19	1.39	0.60	-0.20	-0.99	-1.79		
	0%	2.39	1.59	0.80	0.00	-0.60	-1.59	-2.39		
	-2.67%	0.73	-0.07	-0.86	-1.66	-2.45	-3.25	-4.04		
	-5.33%	-1.99	-2.78	-3.58	-4.37	-5.17	-5.96	-6.76		
	-8%	-5.76	-6.56	-7.35	-8.15	-8.94	-9.74	-10.53		

최대 손실 시나리오

위험액	-10.53
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.67
-----	------

[76] 데리츠2Star사로 SEST-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 만드칭산 결정주기: 매 6개월

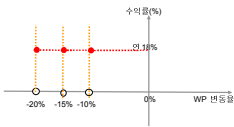
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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

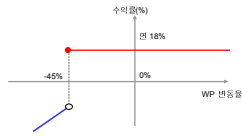
단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 원금 + 11.8%
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(중도포화)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 권드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)Z1

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	2.37	0.72	-0.93	-2.58	-4.23	-5.88	-7.52
시나리오	5.33%	4.60	2.95	1.30	-0.35	-1.99	-3.64	-5.29
오	2.67%	5.46	3.81	2.16	0.51	-1.14	-2.79	-4.43
시나리오	0%	4.95	3.30	1.65	0.00	-1.65	-3.30	-4.95
오	-2.67%	3.06	1.41	-0.24	-1.89	-3.53	-5.18	-6.83
시나리오	-5.33%	-0.20	-1.84	-3.49	-5.14	-6.79	-8.44	-10.09
오	-8%	-4.82	-6.47	-8.12	-9.77	-11.42	-13.07	-14.72

최대 손실 시나리오

위험액	-14.72
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.78
-----	-------

[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

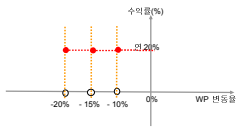
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

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.

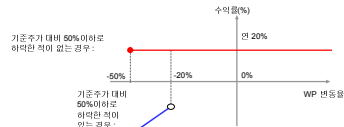
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 + 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료할)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 원도의 수익구조

조기상환시 수익구조



만기시 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552345W35 우리투자증권(ELS)Z382

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.80	0.97	0.15	-0.68	-1.51	-2.33	-3.16
시나리오	5.33%	2.76	1.94	1.11	0.29	-0.54	-1.36	-2.19
	2.67%	2.99	2.16	1.34	0.51	-0.31	-1.14	-1.96
	0%	2.48	1.65	0.83	0.00	-0.63	-1.65	-2.48
	-2.67%	1.22	0.40	-0.43	-1.25	-2.08	-2.90	-3.73
	-5.33%	-0.77	-1.59	-2.42	-3.24	-4.07	-4.89	-5.72
	-8%	-3.50	-4.32	-5.15	-6.97	-7.80	-8.62	-9.45

최대 손실 시나리오

위험액	-8.45
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.11
-----	------

[78] 데리츠2Star사로STWF-2

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤

2) 만기: 2012년 4월 20일

3) 만드청산 결정주기: 매6개월

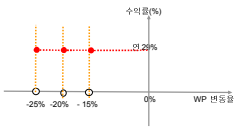
4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가

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.

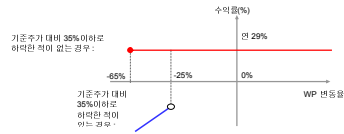
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 연도 해지
- 두 기초자산의 가액이 합반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 129%
 - 두 기초자산의 가액(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6622313W42 표보증권(ELS)325

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.88	1.46	1.03	0.61	0.19	-0.24	-0.66
자신	5.33%	2.91	2.49	2.06	1.64	1.22	0.79	0.37
시나리오	2.67%	2.71	2.28	1.86	1.44	1.01	0.59	0.17
오	0%	1.27	0.85	0.42	0.00	-0.42	-0.85	-1.27
	-2.67%	-1.40	-1.82	-2.25	-2.67	-3.09	-3.52	-3.94
	-5.33%	-5.30	-5.73	-6.15	-6.57	-7.00	-7.42	-7.84
	-8%	-10.44	-10.86	-11.29	-11.71	-12.13	-12.56	-12.98

최대 손실 시나리오

위험액	-12.98
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.67
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

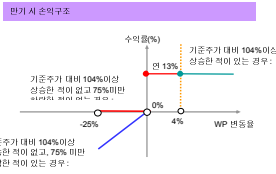
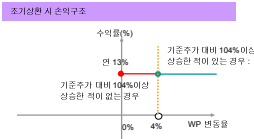
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13%의 수익률로 중도상환
 - 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%이반으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.3%
 - 두 기초자산의 가격(정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%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%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	5.33%	6.876.79	8.857.73	8,268.79	7,679.84	7,090.89	6,501.94	5,912.99
시나리오	2.67%	4,316.84	3,727.89	3,138.94	2,549.99	1,961.05	1,372.10	783.15
	0%	1,766.85	1,177.90	588.95	0.00	-588.95	-1,177.90	-1,766.85
	-2.67%	-773.20	-1,362.15	-1,951.09	-2,540.04	-3,128.99	-3,717.94	-4,306.89
	-5.33%	-3,303.29	-3,892.24	-4,481.19	-5,070.14	-5,659.09	-6,248.04	-6,836.99
	-8%	-5,823.43	-6,412.38	-7,001.33	-7,590.28	-8,179.23	-8,768.18	-9,357.13

최대 손실 시나리오

위험액	-9,357.13
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,342.63
-----	----------

[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

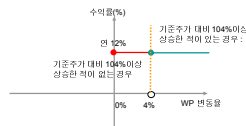
: 원금 * 11.2%

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

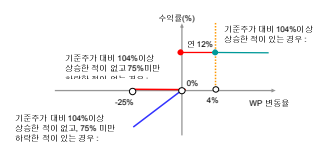
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환시 수익구조



만기시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] 메리츠주가지수연계사모6호

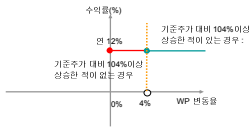
1. 계약금액

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

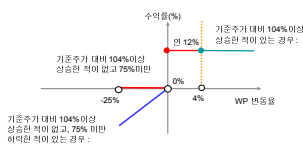
2. 만기시점의 수익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[79-4] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

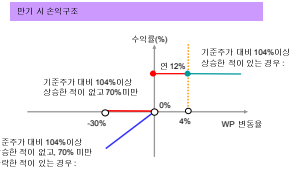
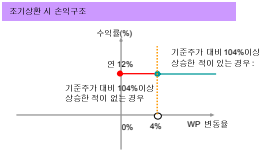
단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 10월 19일
- 3) 만드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중표현하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

- 단, 만기시(12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



KR6008679TA3 굿모닝 신환증권(ELS)786

[79-5] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

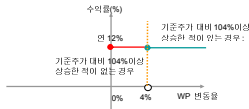
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	차입

단위(백만원)

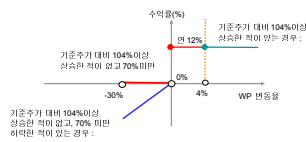
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 10일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한변이라도 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 한변도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600086767B7 국토부 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광의피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 19일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가

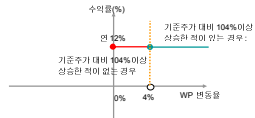
5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기각을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 설정일 정점에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

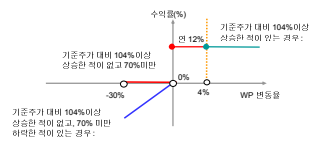
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6000867CTB8 곳도님 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) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 12월 15일

3) 펀드청산 예정주기: 매3개월

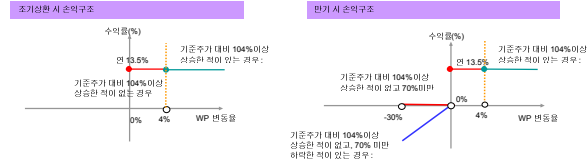
4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한반이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도상환

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR60008675TC7 굿모닝 신한증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

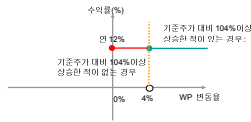
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000.0	0	5,000	차입

단위:백만원

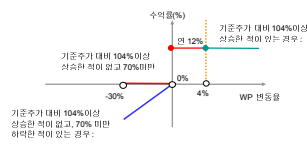
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 10월 15일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기상환일정일에 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 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의100%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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 11월 08일

3) 만트청산 결제주기: 매3개월

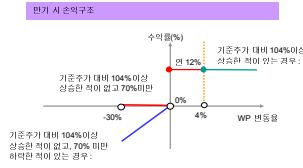
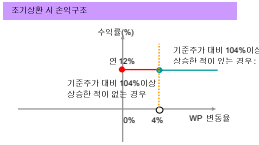
4) 기준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가

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

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

- 두 기초자산의 가격 이 한번도 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) 만트의 수익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

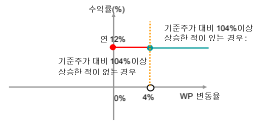
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	차입

단위(백만원)

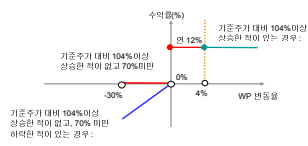
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 광역피생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매3개월마다 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

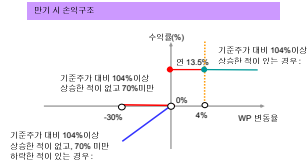
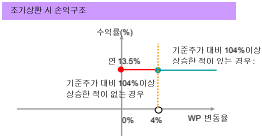
4) 기준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기상환일정일에 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 초기상환조건을 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



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠주가지수연계사모6호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

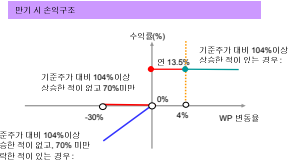
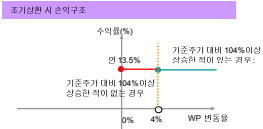
2. 만기시점의 손익구조

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

단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 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 수연계 사모증권5호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 3월 19일

3) 펀드형상 결정주기: 만기평가일 1회

4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가

5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 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))

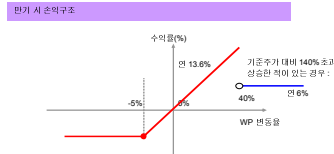
- 만기평가지수가 최초기준가격 미만일 경우

: 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. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6523317W30 대우증권ELS2881

구분	손익구조변동 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-3.58	-4.31	-5.03	-5.75	-6.47	-7.19	-7.91
시나리오	5.33%	-1.51	-2.23	-2.95	-3.67	-4.39	-5.11	-5.84
	2.67%	0.41	-0.31	-1.03	-1.75	-2.48	-3.20	-3.92
	0%	2.16	1.44	0.72	0.00	-0.72	-1.44	-2.16
	-2.67%	3.76	3.04	2.31	1.59	0.87	0.15	-0.57
	-5.33%	5.19	4.47	3.74	3.02	2.30	1.58	0.86
	-8%	6.46	5.74	5.01	4.29	3.57	2.85	2.13

최대손실 시나리오

위험액	2.13
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

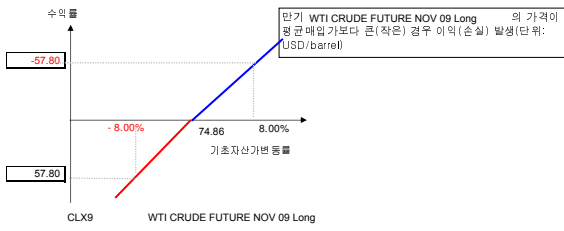
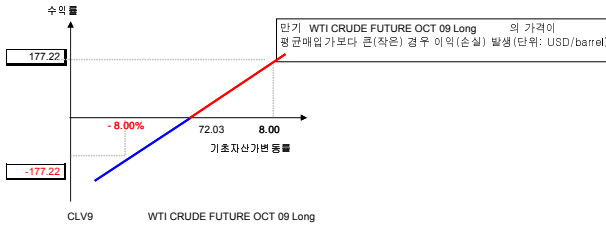
위험액	8.35
-----	------

[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 지 수 지수)의 중도상환가액이

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

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

연율 12.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

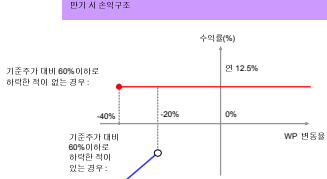
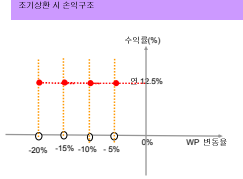
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 112.5%

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

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6523310W80 대우증권ELS3005

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

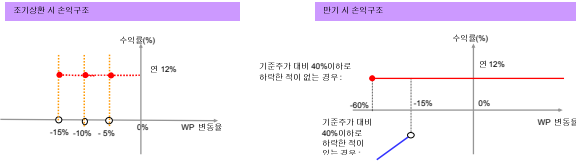
[79] 데리츠주가지 수연계사모증권! 61E

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	38.42

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, 연가시 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 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (연가 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)
KR6503305W69 코무남 신한동권(ELS)1039

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	-5.87	-6.04	-6.21	-6.37	-6.54	-6.71	-6.88
5.33%	-2.13	-2.30	-2.46	-2.63	-2.80	-2.97	-3.13
2.67%	-0.01	-0.17	-0.34	-0.51	-0.67	-0.84	-1.01
0%	0.50	0.33	0.17	0.00	-0.17	-0.33	-0.50
-2.67%	-0.81	-0.78	-0.94	-1.11	-1.28	-1.44	-1.61
-5.33%	-3.34	-3.50	-3.67	-3.84	-4.00	-4.17	-4.34
-8%	-7.68	-7.85	-8.01	-8.18	-8.35	-8.52	-8.68

최대 손실 시나리오

위험액	-8.68
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.54
-----	------

[80] 대리 조주가지 수연계 사모증권10호

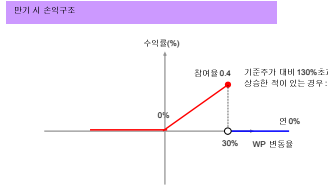
1. 계약금액

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

단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 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))
 - 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	8%	-4.95	-7.14	-9.33	-11.52	-13.72	-15.91	-18.10
시나리오	5.33%	-0.66	-2.87	-5.06	-7.25	-9.44	-11.63	-13.82
	2.67%	3.16	0.97	-1.22	-3.41	-5.60	-7.79	-9.98
	0%	6.57	4.38	2.19	0.00	-2.19	-4.38	-6.57
	-2.67%	9.54	7.35	5.16	2.97	0.78	-1.41	-3.60
	-5.33%	12.08	9.89	7.70	5.51	3.32	1.13	-1.06
	-8%	14.18	11.99	9.80	7.61	5.42	3.23	1.04

최대 손실 시나리오

위험액	1.04
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.40
-----	-------

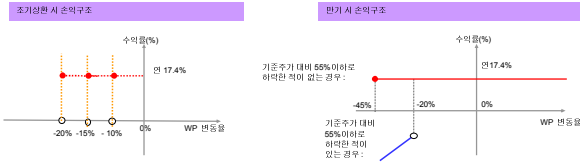
[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호

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 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 수익률을 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 55% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117.4%
- 두 기초자산의 가액(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



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

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	4.00	3.42	2.84	2.27	1.69	1.11	0.53
	5.33%	3.92	3.34	2.76	2.18	1.60	1.02	0.44
	2.67%	3.16	2.58	2.01	1.43	0.85	0.27	-0.31
손익	0%	1.74	1.16	0.58	0.00	-0.58	-1.16	-1.74
시나리오	-2.67%	-0.36	-0.94	-1.52	-2.10	-2.68	-3.26	-3.84
	-5.33%	-3.13	-3.71	-4.29	-4.87	-5.45	-6.02	-6.60
	-8%	-6.57	-7.15	-7.73	-8.31	-8.89	-9.47	-10.04

최대 손실 시나리오

위험액	-10.04
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.53
-----	------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

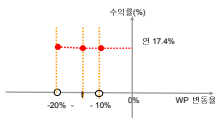
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

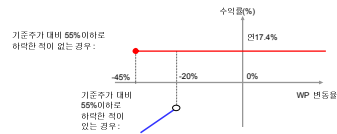
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR652233W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조표본들 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	25.72	22.00	18.26	14.56	10.83	7.11	3.39
손익	5.33%	25.18	21.46	17.74	14.02	10.30	6.57	2.85
시나리오	2.67%	20.33	16.61	12.89	9.17	5.44	1.72	-2.00
	0%	11.17	7.44	3.72	0.00	-3.72	-7.44	-11.17
	-2.67%	-2.31	-6.04	-9.76	-13.48	-17.20	-20.92	-24.64
	-5.33%	-20.11	-23.83	-27.55	-31.27	-34.99	-38.71	-42.44
	-8%	-42.21	-45.93	-49.65	-53.38	-57.10	-60.82	-64.54

최대 손실 시나리오

위험액	-64.54
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	61.21
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

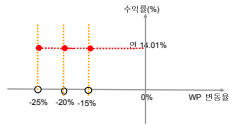
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: (백만원)

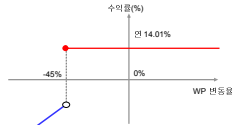
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.13	-0.15	-0.17	-0.19	-0.21	-0.23	-0.26
	5.33%	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.08	-0.10	-0.12
시나리오	2.67%	0.07	0.05	0.03	0.01	-0.01	-0.03	-0.06
	0%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
	-2.67%	-0.02	-0.04	-0.06	-0.08	-0.10	-0.12	-0.15
	-5.33%	-0.17	-0.19	-0.21	-0.24	-0.26	-0.28	-0.30
	-8%	-0.40	-0.42	-0.44	-0.46	-0.48	-0.51	-0.53

최대 손실 시나리오

위험액	-0.53
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.24
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

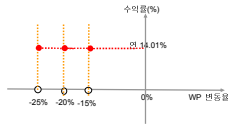
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

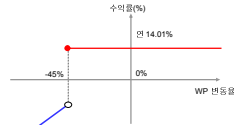
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.46	-0.54	-0.61	-0.69	-0.77	-0.85	-0.92
	5.33%	0.03	-0.04	-0.12	-0.20	-0.28	-0.35	-0.43
시나리오	2.67%	0.26	0.19	0.11	0.03	-0.04	-0.12	-0.20
	0%	0.23	0.15	0.08	0.00	-0.08	-0.15	-0.23
-2.67%	-0.06	-0.14	-0.22	-0.29	-0.37	-0.45	-0.53	
	-5.33%	-0.62	-0.70	-0.78	-0.85	-0.93	-1.01	-1.08
-8%	-1.44	-1.52	-1.60	-1.67	-1.75	-1.83	-1.90	

최대 손실 시나리오	
위험액	-1.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.85
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호

1. 계약금액

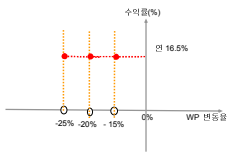
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

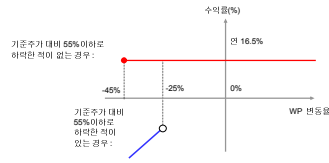
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.08
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.03
-----	------

[87] 데리츠2SIa사모증권SEKT-이 호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

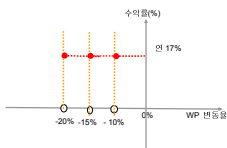
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

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

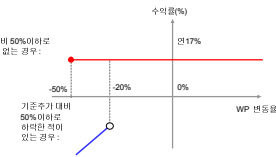
단, 만기시까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117%
 - 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR6562319W52 유인 투기증권 (ELS)2415

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.76	1.41	1.06	0.71	0.36	0.02	-0.33
손익	5.33%	1.91	1.56	1.21	0.86	0.52	0.17	-0.18
시나리오	2.67%	1.67	1.32	0.98	0.63	0.28	-0.07	-0.42
	0%	1.04	0.70	0.35	0.00	-0.35	-0.70	-1.04
	-2.67%	0.03	-0.32	-0.67	-1.02	-1.36	-1.71	-2.06
	-5.33%	-1.38	-1.73	-2.08	-2.42	-2.77	-3.12	-3.47
	-8%	-3.18	-3.53	-3.87	-4.22	-4.57	-4.92	-5.26

최대 손실 시나리오

위험액	-5.26
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	7.08
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

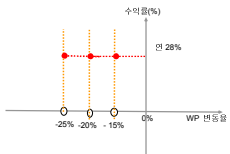
1. 계약금액

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

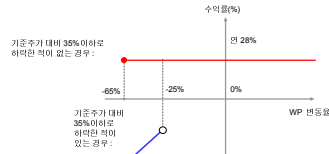
2. 만기시점의 손익구조

- 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 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 환반드 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 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR6622309W55 표본증권(ELS)344

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초지	46.64	36.18	25.73	15.27	4.82	-5.64	-16.09
산	42.00	31.55	21.10	10.64	0.19	-10.27	-20.72
시나리오	2.67%	36.91	26.46	16.00	5.55	-4.90	-25.81
	0%	31.36	20.91	10.45	0.00	-10.45	-20.91
	-2.67%	25.35	14.90	4.44	-0.01	-16.46	-26.92
	-5.33%	18.88	8.43	-2.02	-12.48	-22.93	-33.39
	-8%	11.95	1.50	-8.95	-19.41	-29.86	-40.32
							-50.77

최대 손실 시나리오

위험액	-50.77
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	44.79
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

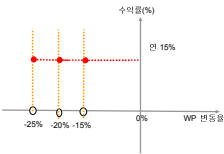
1. 계약금액

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

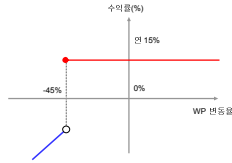
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위: 백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.12	0.10	0.07	0.05	0.02	-0.00	-0.03
	5.33%	0.13	0.10	0.08	0.05	0.03	0.01	-0.02
시나리오	2.67%	0.11	0.09	0.06	0.04	0.01	-0.01	-0.03
	0%	0.07	0.05	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.07
	-2.67%	0.01	-0.01	-0.04	-0.06	-0.09	-0.11	-0.13
	-5.33%	-0.07	-0.10	-0.12	-0.14	-0.17	-0.19	-0.22
	-8%	-0.18	-0.20	-0.23	-0.25	-0.27	-0.30	-0.32

최대 손실 시나리오

위험액	-0.32
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.39
-----	------

[90] 데리츠2Star사모증권POLE-1호

1. 계약금액

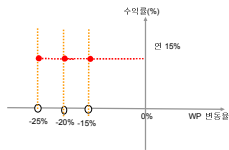
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	상위

단위: (백만원)

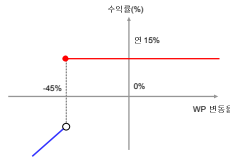
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6652311W58 권위스펀드(ELS)117

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	9.22	7.36	5.50	3.64	1.77	-0.09	-1.95
시나리오	5.33%	9.72	7.85	5.99	4.13	2.27	0.41	-1.45
	2.67%	8.50	6.64	4.78	2.92	1.06	-0.80	-2.66
	0%	5.58	3.72	1.86	0.00	-1.86	-3.72	-5.58
	-2.67%	0.95	-0.91	-2.77	-4.63	-6.49	-8.35	-10.21
	-5.33%	-5.39	-7.25	-9.11	-10.97	-12.83	-14.69	-16.56
	-8%	-13.44	-15.30	-17.16	-19.03	-20.89	-22.75	-24.61

최대 손실 시나리오

위험액	-24.61
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.45
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

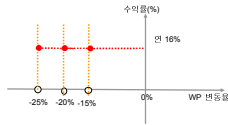
1. 계약금액

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

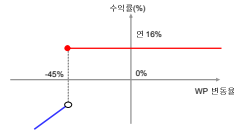
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 평균 * 118%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.73	0.60	0.46	0.35	0.22	0.10	-0.03
	5.33%	0.65	0.53	0.40	0.27	0.15	0.02	-0.11
시나리오	2.67%	0.54	0.41	0.28	0.16	0.03	-0.10	-0.23
	0%	0.38	0.25	0.13	0.00	-0.13	-0.25	-0.38
	-2.67%	0.19	0.06	-0.07	-0.20	-0.32	-0.45	-0.58
	-5.33%	-0.05	-0.18	-0.30	-0.43	-0.56	-0.69	-0.81
	-8%	-0.32	-0.45	-0.58	-0.71	-0.83	-0.96	-1.09

최대 손실 시나리오

위험액	-1.09
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.81
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호[EL]

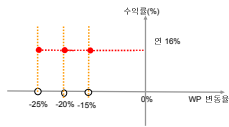
1. 계약금액

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

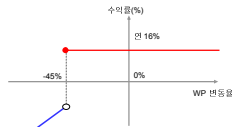
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 평균 * 116%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522308W66 대우증권ELS2998

		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초	8%	13.11	10.83	8.55	6.27	3.99	1.71	-0.57
	5.33%	11.72	9.44	7.17	4.89	2.61	0.33	-1.95
산	2.67%	9.63	7.35	5.08	2.80	0.52	-1.76	-4.04
	0%	6.84	4.56	2.28	0.00	-2.28	-4.56	-8.84
시나리오	-2.67%	3.33	1.05	-1.22	-3.60	-5.78	-8.06	-10.34
	-5.33%	-0.88	-3.18	-5.44	-7.71	-9.99	-12.27	-14.55
	-8%	-5.79	-8.07	-10.35	-12.63	-14.91	-17.19	-19.47

최대 손실 시나리오

위험액	-19.47
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.59
-----	-------

[93] 데리츠2Star사모증권LEHC-3

1. 계약금액

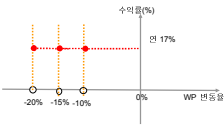
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	상위

단위:백만원

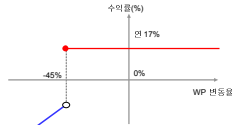
2. 만기시점의 손익구조

- 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) 만월 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117%
 - 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6552310W51 주위 투자증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	3.77	2.76	1.76	0.75	-0.25	-1.26	-2.26
시나리오	5.33%	4.40	3.40	2.39	1.39	0.38	-0.62	-1.63
	2.67%	4.15	3.14	2.14	1.14	0.13	-0.87	-1.88
	0%	3.01	2.01	1.00	0.00	-1.00	-2.01	-3.01
	-2.67%	0.99	-0.01	-1.02	-2.02	-3.02	-4.03	-5.03
	-5.33%	-1.91	-2.92	-3.92	-4.92	-5.93	-6.93	-7.94
	-8%	-5.70	-6.71	-7.71	-8.71	-9.72	-10.72	-11.73

최대 손실 시나리오

위험액	-11.73
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.92
-----	-------

[94] 테라츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

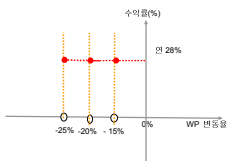
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	상위

단위:백만원

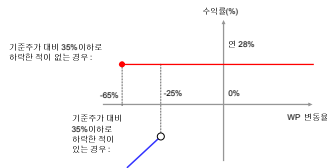
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주
- 2) 만기: 2012년 4월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 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) 만일 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 35% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우
 : 원금 * 128%
 - 두 기초자산의 가액(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35% 미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

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	8%	37.87	30.04	22.21	14.38	6.55	-1.28	-9.11
시나리오	5.33%	34.11	26.28	18.45	10.62	2.79	-5.04	-12.87
	2.67%	29.32	21.49	13.66	5.83	-2.00	-9.83	-17.66
	0%	23.49	15.66	7.83	0.00	-7.83	-15.66	-23.49
	-2.67%	16.63	8.80	0.97	-6.98	-14.69	-22.52	-30.35
	-5.33%	8.78	0.90	-6.93	-14.76	-22.59	-30.42	-38.25
	-8%	-0.20	-8.03	-15.86	-23.69	-31.52	-39.35	-47.18

최대 손실 시나리오

위험액	-47.18
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	42.79
-----	-------

[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호

1. 계약금액

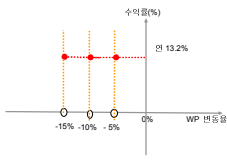
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위:백만원

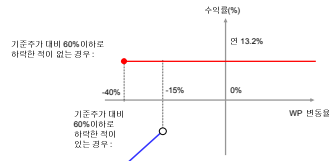
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.01
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

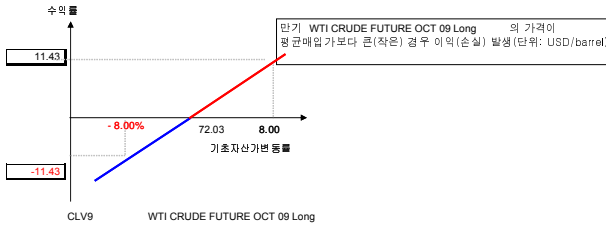
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연기사험의 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
-----	----

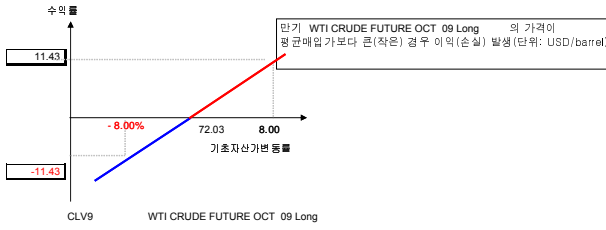
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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 손익구조



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

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	38.54
	5.33%	25.68
	2.67%	12.86
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-12.86
	-5.33%	-25.68
	-8%	-38.54

최대 손실 시나리오

위험액	-38.54
-----	--------

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

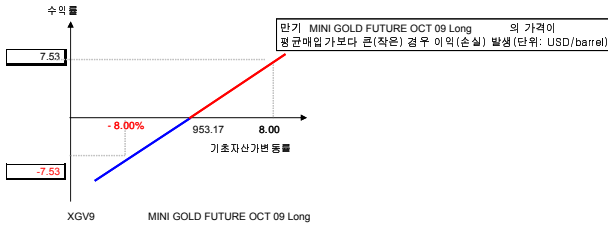
위험액	156
-----	-----

[96-2] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 헷지시점의 손익 구조

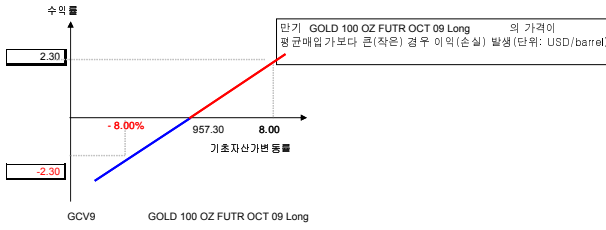


[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조

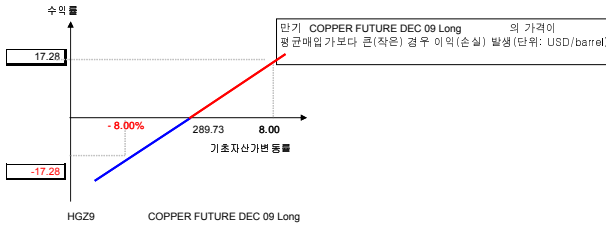


[96-4] 헤지 초 Premium Commodity 특별 자산1

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



[96-5] 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

