

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

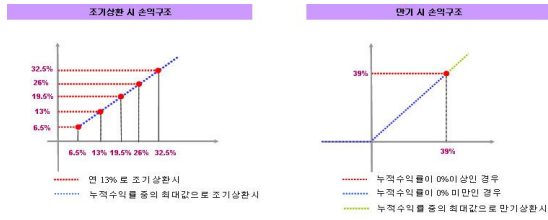
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690A146 대우증권(ELS)1264

손익구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액 -0.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.20

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

							단위(백만원)	
구분	기래대상	기래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고		
누계	유가증권	ELS	1,000	0	1,000	차입		

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.13
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.30
-----	------

4) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자전략 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

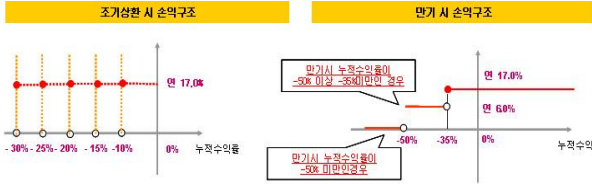
3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198

비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모펀드 파생상품투자전략 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 손익구조: 만기시점 기준, 만기후론 보통주, 만기후론 해당 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만기후론 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 10월 26일의 만기후론 보통주, 만기후론 해당 보통주 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(만기후론 보통주, 만기후론 해당 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 만기 후 처리

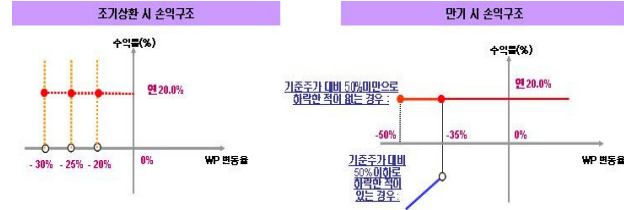
- 두 기초자산의 가격이 만기후론 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 \* 140%

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

: 할금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만기 후의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력정보증권(ELS)243

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	13.00	12.09	11.17	10.26	9.35	8.44	7.52
시나리오	5.33%	9.85	8.94	8.02	7.11	6.20	5.29
	2.67%	6.43	5.52	4.60	3.69	2.78	1.87
	0%	2.74	1.82	0.91	0.00	-0.91	-1.82
	-2.67%	-1.22	-2.14	-3.05	-3.96	-4.87	-5.79
	-5.33%	-5.46	-6.37	-7.28	-8.19	-9.11	-10.02
	-8%	-9.96	-10.87	-11.78	-12.70	-13.61	-14.52

최대 손실 시나리오

위험액	-15.43
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.72
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모펀위과정상물투자신탁 25호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

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

- 두 기초자산의 가격이 만드 만드 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))

KR600345TTB8 최대 손실(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	16.35	15.54	14.73	13.92	13.10	12.29	11.48
	5.33%	11.68	10.86	10.05	9.24	8.43	7.61	6.80
	2.67%	7.04	6.23	5.41	4.60	3.79	2.97	2.16
	0%	2.44	1.63	0.81	0.00	-0.81	-1.63	-2.44
손익 구조변동 시나리오	-2.67%	-2.12	-2.94	-3.75	-4.56	-5.37	-6.19	-7.00
	-5.33%	-6.65	-7.46	-8.27	-9.08	-9.90	-10.71	-11.52
	-8%	-11.13	-11.94	-12.76	-13.57	-14.38	-15.19	-16.01

최대 손실 시나리오

위험액	-16.01
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	16.17
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

구분	기래대상	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) 만도점산 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%이상인 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 만도 해제  
 - 두 기초자산의 가격이 만도점 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%  
 - 두 기초자산의 가격(장중표현)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%초과 하락한 적이 있는 경우 : 원금 X (반기기준지수/최초기준지수)

6) 만도의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600348RT28 비도유권(ELS): 2007-397세

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	434.21	415.13	396.04	376.96	357.88	338.79	319.71
	5.33%	306.91	287.83	268.75	249.66	230.58	211.50	192.41
	2.67%	181.26	162.18	143.09	124.01	104.93	85.84	66.76
	0%	57.26	38.17	19.08	0.00	-19.08	-38.17	-57.26
	-2.67%	-65.12	-84.20	-103.28	-122.37	-141.45	-160.53	-179.62
	-5.33%	-185.84	-204.92	-224.01	-243.09	-262.17	-281.26	-300.34
	-8%	-304.92	-324.00	-343.09	-362.17	-381.25	-400.34	-419.42

최대 손실 시나리오

위험액	-419.42
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	419.18
-----	--------

[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.

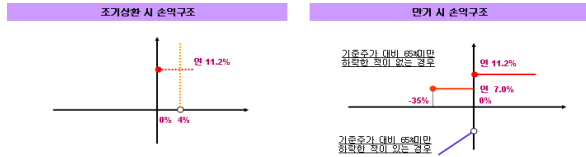
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 \* (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR60034SST27 (투자유형: ELS) 2010-398회

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	41.94	40.11	38.27	36.43	34.59	32.75	30.91
시나리오	29.62	27.78	25.95	24.11	22.27	20.43	18.59
	17.46	15.64	13.80	11.96	10.13	8.29	6.45
	5.30	3.68	2.04	0.00	-1.84	-3.68	-5.52
	-6.27	-8.11	-9.95	-11.79	-13.62	-15.46	-17.30
	-17.88	-19.72	-21.56	-23.39	-25.23	-27.07	-28.91
	-29.31	-31.15	-32.99	-34.82	-36.66	-38.50	-40.34

최대 손실 시나리오

위험액	-40.34
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	40.56
-----	-------

[9] 테리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

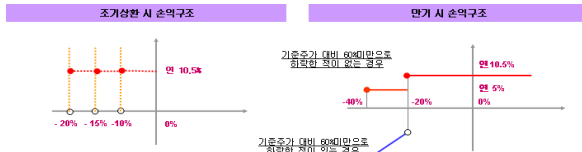
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 04월 19일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 4월 20일 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 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, 만기 상환일) 연율 10.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 확정  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 \* 115%  
 - 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR600172Y143 신영증권(ELS)552

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산	8%	5.33%	2.67%	0%	-2.67%	-5.33%	-8%
시나리오	916.02	398.23	299.90	191.02	78.40	278.37	498.89
	482.34	364.56	226.23	87.38	-112.08	-312.05	-532.56
	448.67	330.88	192.55	33.67	-145.75	-345.72	-566.24
	415.00	297.21	158.88	0.00	-179.42	-379.40	-599.91
	381.32	263.54	125.20	-33.67	-213.10	-413.07	-633.59
	347.65	229.86	91.53	-67.35	-246.77	-446.74	-667.26
	313.97	196.19	57.86	-101.02	-280.45	-480.42	-700.93

최대 손실 시나리오

위험액	-700.93
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	664.65
-----	--------



[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 6월 3일

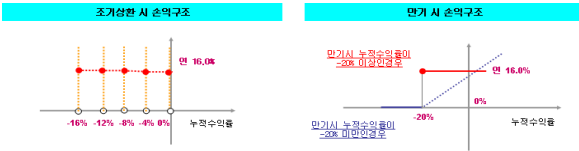
3) 만드정산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 6월 5일의 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 0%(1차 중도상환일), -4%(2차 중도상환일), -8%(3차 중도상환일), -12%(4차 중도상환일), -16%(5차 중도상환일), -20%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 16.0%로 중도상환됨.  
(누적수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)

단, 만기시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 정산 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월 간 최고 누적 수익률])

6) 만드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS/2007=504)

손익구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	1.00	0.66	0.73	0.59	0.45	0.31	0.17
	5.33%	0.83	0.69	0.55	0.42	0.28	0.14	0.00
	2.67%	0.63	0.50	0.36	0.22	0.08	-0.06	-0.20
	0%	0.42	0.28	0.14	0.00	-0.14	-0.28	-0.42
	-2.67%	0.17	0.03	-0.10	-0.24	-0.38	-0.52	-0.66
	-5.33%	-0.09	-0.23	-0.37	-0.51	-0.65	-0.78	-0.92
	-8%	-0.38	-0.52	-0.66	-0.80	-0.93	-1.07	-1.21

최대 손실 시나리오

위험액	-1.21
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

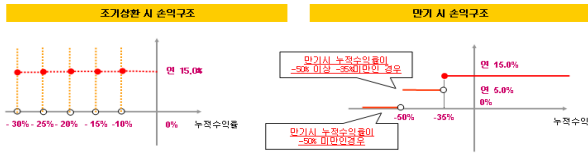
[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 8월 13일
- 3) 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 중도상환함.  
(누적 수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)  
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만도 하지  
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환  
만기 평가일의 누적 수익률이 -50%미만인 경우: 액면금액 지급 (원금보장추구)
- 6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상증권(ELS)1191

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.17	0.90	0.64	0.37	0.10	-0.16	-0.43
시나리오	5.33%	1.07	0.81	0.54	0.27	0.01	-0.26	-0.53
	2.67%	0.95	0.68	0.42	0.15	-0.12	-0.38	-0.65
	0%	0.80	0.53	0.27	0.00	-0.27	-0.53	-0.80
	-2.67%	0.62	0.38	0.09	-0.18	-0.44	-0.71	-0.98
	-5.33%	0.42	0.15	-0.11	-0.38	-0.65	-0.91	-1.18
	-8%	0.19	-0.08	-0.35	-0.61	-0.88	-1.15	-1.41

최대 손실 시나리오

위험액	-1.41
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.36
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자전략 제10호

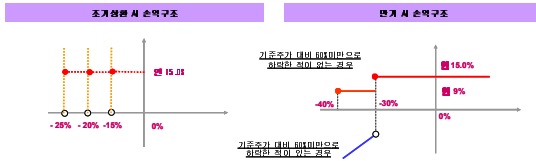
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2009년 9월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 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 비례예상증권(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	203.37	200.10	196.82	193.54	190.26	186.98	183.70
	5.33%	155.07	151.79	148.51	145.24	141.96	138.68	135.40
	2.67%	90.56	87.28	84.00	80.72	77.45	74.17	70.89
	0%	9.83	6.56	3.28	0.00	-3.28	-6.56	-9.83
	-2.67%	-87.10	-90.38	-93.66	-96.93	-100.21	-103.49	-106.77
	-8%	-200.24	-203.52	-206.80	-210.08	-213.36	-216.64	-219.91
	-8%	-329.60	-332.88	-336.16	-339.43	-342.71	-345.99	-349.27

최대 손실 시나리오

위험액	-349.27
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	402.38
-----	--------

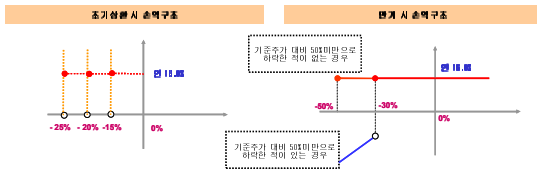
[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

1. 계약금액

					단위(백만원)	
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,347	0	1,347	차입

2. 만기시점의 손익구조

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



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

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	141.30	137.33	133.37	129.40	125.43	121.47	117.50
	5.33%	95.50	91.53	87.57	83.60	79.63	75.67	71.70
	2.67%	52.37	48.40	44.43	40.47	36.50	32.53	28.57
	0%	11.90	7.93	3.97	0.00	-3.97	-7.93	-11.90
	-2.67%	-25.90	-29.87	-33.83	-37.80	-41.77	-45.73	-49.70
-5.33%	-61.04	-65.00	-68.97	-72.94	-76.90	-80.87	-84.84	
-8%	-93.51	-97.47	-101.44	-105.41	-109.37	-113.34	-117.31	

최대 손실 시나리오

위험액	-117.31
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	120.66
-----	--------

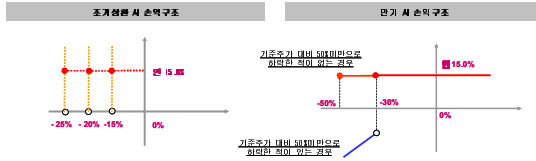
[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

1. 계약금액

구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	50	0	50	천원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 30일
- 3) 만드청산 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 기초자산기준으로 각각 최초기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(만기상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 확정  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 \* 130%  
 - 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762B7B0 미래에셋증권(ELS)240

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	5.07	4.84	4.60	4.36	4.13	3.89	3.65
	5.33%	3.79	3.55	3.31	3.08	2.84	2.60	2.37
	2.67%	2.33	2.09	1.86	1.62	1.39	1.15	0.91
	0%	0.71	0.47	0.24	0.00	-0.24	-0.47	-0.71
	-2.67%	-1.08	-1.32	-1.55	-1.79	-2.02	-2.26	-2.50
-5.33%	-3.03	-3.27	-3.51	-3.74	-3.98	-4.22	-4.45	
-8%	-5.16	-5.39	-5.63	-5.87	-6.10	-6.34	-6.57	

최대 손실 시나리오

위험액	-6.57
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.98
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

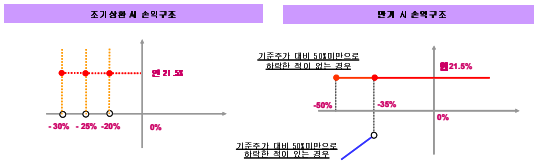
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 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 기건을 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) 인출 21.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우 : 원금 \* 143%  
- 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위: 백만원)  
KR600345EV11 비파생(ELS)2008-647

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	222.06	199.07	176.08	153.10	130.11	107.12	84.13
	5.33%	171.22	148.23	125.24	102.25	79.26	56.27	33.28
	2.67%	120.38	97.20	74.21	51.22	28.23	5.24	-17.75
	0%	69.54	46.36	23.37	0.38	-21.61	-43.62	-65.63
	-2.67%	17.56	-5.43	-28.42	-51.40	-74.39	-97.38	-120.37
-5.33%	-34.03	-57.02	-80.01	-102.99	-125.98	-148.97	-171.96	
-8%	-85.80	-108.79	-131.78	-154.77	-177.76	-200.75	-223.74	

최대 손실 시나리오

위험액	-223.74
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	211.19
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 괴생상틀 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

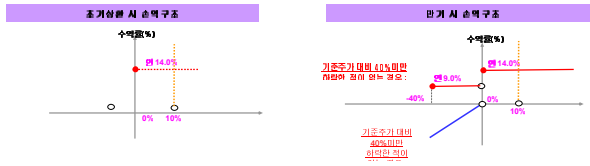
3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 종가

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

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	485.42	467.25	449.08	430.91	412.74	394.57	376.40
	5.33%	354.09	335.92	317.75	299.59	281.42	263.25	245.08
시나리오	2.67%	210.46	192.29	174.12	155.95	137.78	119.61	101.44
	0%	54.51	36.34	18.17	0.00	-18.17	-36.34	-54.51
	-2.67%	-113.75	-131.92	-150.09	-168.26	-186.43	-204.60	-222.77
	-5.33%	-294.33	-312.50	-330.67	-348.84	-367.01	-385.18	-403.35
	-8%	-487.22	-505.39	-523.56	-541.73	-559.90	-578.07	-596.24

최대 손실 시나리오

위험액	-596.24
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	568.62
-----	--------

[17]테리 조StepDown사모단위 편성26호

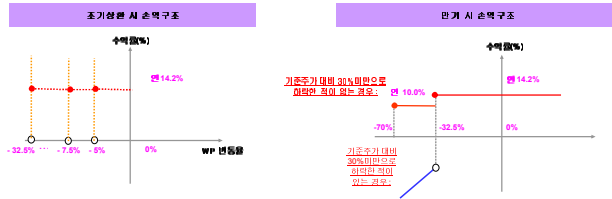
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867B1B0 쿠로남신평동원(ELS)803

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	217.92	187.14	156.36	125.57	94.79	64.01	33.23
	5.33%	176.32	145.54	114.76	83.98	53.20	22.41	-8.37
	2.67%	134.77	103.88	72.90	42.12	11.34	-19.44	-60.23
	0%	92.35	61.56	30.78	0.00	-30.78	-61.56	-92.35
	-2.67%	49.96	19.18	-11.60	-42.38	-73.16	-103.95	-134.73
-5.33%	7.32	-23.46	-54.24	-85.03	-115.81	-146.59	-177.37	
-8%	-35.59	-66.37	-97.15	-127.93	-158.71	-189.49	-220.28	

최대 손실 시나리오

위험액	-220.28
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	222.03
-----	--------



[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

1. 계약금액

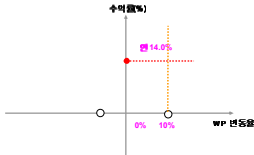
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	창의

단위(백만원)

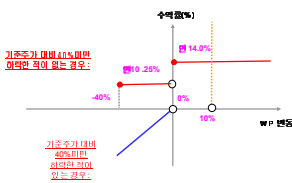
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주
- 2) 만기: 2010년 1월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 존지수: 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 환번이라도 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 환번도 기준가격의 60%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 \* 120.5%  
 - 두 기초자산의 가격(상종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%이만 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/초기기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	102.62	97.09	91.56	86.04	80.51	74.98	69.45
손익	5.33%	73.26	67.74	62.21	56.68	51.15	45.62	40.09
시나리오	2.67%	44.59	39.06	33.53	28.00	22.47	16.94	11.41
	0%	16.59	11.06	5.53	0.00	-5.53	-11.06	-16.59
	-2.67%	-10.73	-16.26	-21.79	-27.32	-32.85	-38.38	-43.91
	-5.33%	-37.37	-42.90	-48.43	-53.96	-59.49	-65.02	-70.55
	-8%	-63.33	-68.86	-74.39	-79.92	-85.45	-90.98	-96.51

최대 손실 시나리오

위험액	69.45
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	94.26
-----	-------

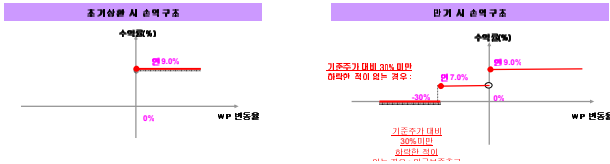
[19]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 수익구조

- 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 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가액의 100% 이상인 경우 연이율 9%로 중도상환함.
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가액의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우: 원금 \* 121%
  - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 70%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금\*100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 비례갹증권(ELS)289

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	5.33%	34.61	31.11	27.62	24.13	20.63	17.14	13.65
시나리오	2.67%	22.92	19.43	15.93	12.44	8.95	5.45	1.96
	0%	10.48	6.99	3.49	0.00	-3.49	-6.99	-10.48
	-2.67%	-2.71	-6.21	-9.70	-13.19	-16.69	-20.18	-23.67
	-5.33%	-16.66	-20.15	-23.65	-27.14	-30.63	-34.13	-37.62
	-8%	-31.36	-34.85	-38.34	-41.84	-45.33	-48.82	-52.32

최대 손실 시나리오

위험액	24.58
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	51.63
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

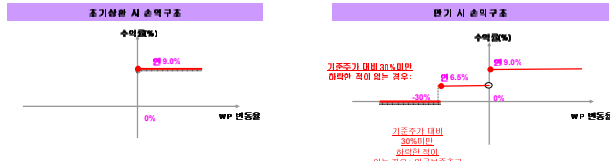
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
  - 2) 평가: 2011년 2월 21일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
  - 4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 종가
  - 5) 발행 후 매 6개월 마다 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 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 \* 119.5%
  - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금\*100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 비례셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	31.80	29.16	26.52	23.87	21.23	18.59	15.95	
손익	24.47	21.83	19.19	16.55	13.91	11.27	8.63	
손익률	16.51	13.87	11.23	8.59	5.95	3.31	0.67	
손익률	7.92	5.28	2.64	0.00	-2.64	-5.28	-7.92	
손익률	-1.30	-3.94	-6.58	-9.22	-11.86	-14.50	-17.15	
손익률	-11.16	-13.80	-16.44	-19.08	-21.72	-24.36	-27.00	
손익률	-21.64	-24.28	-26.92	-29.56	-32.20	-34.85	-37.49	

최대 손실 시나리오

위험액	15.95
-----	-------

4. 매매상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	37.35
-----	-------

[2] 메리츠주식수연계사모단위파생7호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만드형산 결정주기: 매 6개월

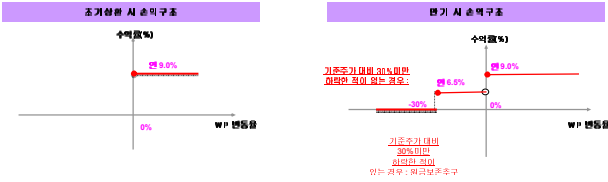
4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

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

- 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없고, 최초기 준가격보다 작은 경우: 원금 \* 119.5%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만 하락한 적이 있는 경우: 원금\*100%

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산	24.73	22.68	20.62	18.57	16.51	14.46	12.41	
손익	5.33%	19.03	16.98	14.93	12.87	10.82	8.76	
시나리오	2.67%	12.84	10.79	8.74	6.68	4.63	2.57	
0%	6.16	4.11	2.05	0.00	-2.05	-4.11	-6.16	
-2.67%	-1.01	-3.07	-5.12	-7.17	-9.23	-11.28	-13.34	
-5.33%	-8.66	-10.73	-12.78	-14.84	-16.89	-18.95	-21.00	
-8%	-16.83	-18.89	-20.94	-23.00	-25.05	-27.10	-29.16	

최대 손실 시나리오

위험액	12.41
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.05
-----	-------

[28] 메리츠증권주연계사모과제1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI주

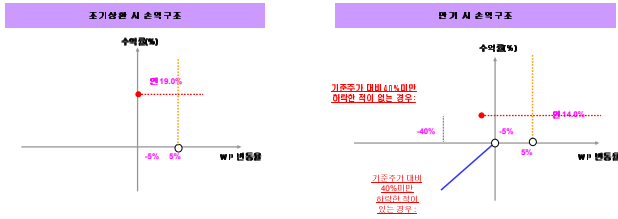
2) 평가: 2010년 08월 04일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상중 포함하여 한번이라도 최초기준가격의 95% 이상이거나 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 19%의 수익률로 중도상환  
 단, 평가시 까지 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 \* 138%  
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)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%	136.80	128.14	119.48	110.82	102.17	93.51	84.85
	5.33%	100.46	91.80	83.14	74.48	65.82	57.17	48.51
	2.67%	63.52	54.86	46.20	37.54	28.88	20.23	11.57
	0%	26.97	17.32	8.66	0.00	-8.66	-17.32	-26.97
	-2.67%	-12.17	-20.83	-29.48	-38.14	-46.80	-55.46	-64.12
	-5.33%	-50.91	-59.57	-68.23	-76.88	-85.54	-94.20	-102.86
	-8%	-90.25	-98.91	-107.57	-116.23	-124.89	-133.54	-142.20

최대 손실 시나리오

위험액	-142.20
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	139.24
-----	--------

[24] 메리츠2Star 파생 상품SEPO-1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

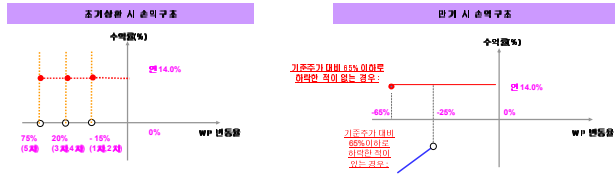
2) 만기: 2011년 08월 26일

3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 8월 8일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매6개월마다 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, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
→ 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 48%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우  
: 원금 \* 142%  
→ 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 45%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
: 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6522907WR2 보유종류(ELS)2723

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 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[25] 테리츠 주가지수연계사모펀드상품 제 1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

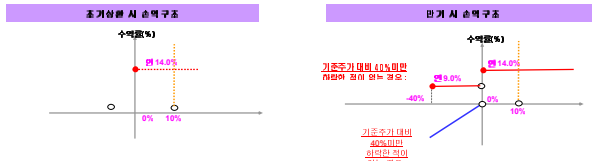
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	594.94	572.67	550.40	528.14	505.87	483.60	461.33
	5.33%	433.99	411.72	389.45	367.18	344.91	322.64	300.37
	2.67%	297.95	235.68	213.41	191.14	168.87	146.60	124.33
	0%	66.81	44.54	22.27	0.00	-22.27	-44.54	-66.81
	-2.67%	-139.42	-161.69	-183.96	-206.23	-228.50	-250.77	-273.04
-5.33%	-360.74	-383.01	-405.28	-427.55	-449.82	-472.09	-494.36	
-8%	-597.15	-619.42	-641.69	-663.96	-686.23	-708.50	-730.77	

최대 손실 시나리오

위험액	-730.77
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	696.92
-----	--------

**[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1**

**1. 계약금액**

						단위(백만원)	
구분	기래대상	가액유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고	
누계	유가증권	ELS	501	0	501	상위	

**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 중도 상환 기간을 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 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 매지
  - 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(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6512302/A7 데리츠증권(ELS)713

**손익구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.17	-0.17	-0.17	-0.18	-0.18	-0.18	-0.18
	5.33%	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.07	-0.07	-0.07
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.01	0.01	0.01	0.01
	0%	0.01	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.01	-0.01
	-2.67%	-0.04	-0.04	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.06
	-5.33%	-0.14	-0.15	-0.15	-0.15	-0.15	-0.16	-0.16
	-8%	-0.30	-0.30	-0.30	-0.31	-0.31	-0.31	-0.31

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.31
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.05
-----	------



[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

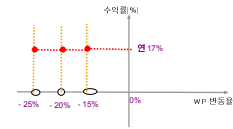
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	승모자산(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,096	0	1,096	상위

단위(백만원)

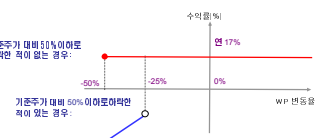
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR65723459/1 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	-1.83	-2.41	-2.99	-3.58	-4.16	-4.75	-5.33
	5.33%	1.22	0.64	0.05	-0.53	-1.11	-1.70	-2.28
	2.67%	2.41	1.83	1.25	0.66	0.08	-0.51	-1.09
	0%	1.75	1.17	0.58	0.00	-0.58	-1.17	-1.75
	-2.67%	-0.77	-1.35	-1.93	-2.52	-3.10	-3.69	-4.27
	-5.33%	-5.14	-5.72	-6.31	-6.89	-7.48	-8.06	-8.64
	-8%	-11.37	-11.95	-12.54	-13.12	-13.71	-14.29	-14.87

최대 손실 시나리오

위험액	-14.87
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.65
-----	-------

**[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호**

**1. 계약금액**

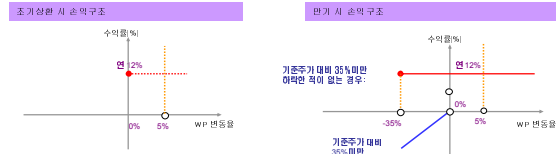
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

단위: 백만원

**2. 만기시점의 수익구조**

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

**6) 펀드의 수익구조**



**3. 수익구조인출(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)**

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

**수익구조변동 시나리오**

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

**[34] 대리 조주가지 수연계 파생13**

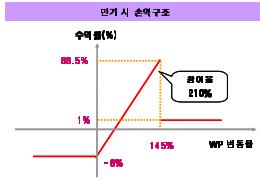
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

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



**3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))**  
KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-66.36	-73.80	-81.25	-88.69	-96.13	-103.57	-111.02
시나리오	5.33%	-34.21	-41.65	-49.09	-56.53	-63.98	-71.42	-78.86
	2.67%	-4.64	-12.09	-19.53	-26.97	-34.41	-41.86	-49.30
	0%	22.33	14.89	7.44	0.00	-7.44	-14.89	-22.33
	-2.67%	46.71	39.26	31.82	24.38	16.93	9.49	2.05
	-5.33%	66.49	61.05	53.60	46.16	38.72	31.28	23.83
	-8%	87.68	80.24	72.80	65.36	57.91	50.47	43.03

최대 손실 시나리오

위험액	43.03
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	102.85
-----	--------

**[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호**

**1. 계약금액**

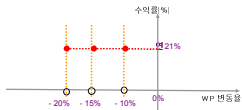
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위: (백만원)

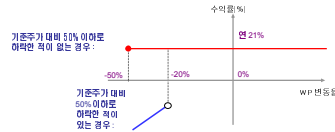
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 02월 15일
- 3) 중간평가일: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 02월 13일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 6개월마다 중간평가를 시행하고, 기초자산(삼성전자 증가, SK텔레콤의 증가)의 평가일 증가가 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중간평가일), 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중간평가일), 80%이상인 경우(다섯번째 중간평가일) 인출 21.0%의 수익률로 종료 상황이 됨.  
 단, 만기시점까지 초기 상황 조건을 충족하지 못해 경우 아래와 같이 만기 상당금액을 산출함  
 - 두 기초자산의 만기일 증가가 모두 최초 기준가격의 80%이상인 경우  
 : 원금 \* 163.0%  
 - 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 한번이상 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 없는 경우  
 : 원금 \* 163.0%  
 - 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 있는 경우 만기 평가일의 하락률이 큰 증폭을 기준으로  
 : 원금 \* (만기 평가가격 / 최초기준가격)
- 6) 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%	
가	8%	7.62	6.32	5.01	3.71	2.40	1.09	-0.21
초	5.33%	7.06	5.75	4.44	3.14	1.83	0.53	-0.78
자	2.67%	5.82	4.52	3.21	1.90	0.60	-0.71	-2.02
산	0%	3.92	2.61	1.31	0.00	-1.31	-2.61	-3.92
시	-2.67%	1.35	0.04	-1.26	-2.57	-3.88	-5.18	-6.49
나	-5.33%	-1.89	-3.20	-4.50	-5.81	-7.11	-8.42	-9.73
리	-8%	-5.79	-7.10	-8.41	-9.71	-11.02	-12.32	-13.63

**최대 손실 시나리오**

위험액	-13.63
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	14.74
-----	-------

**[80-1] 메리츠주가지수연계시모종결2호**  
KR600594DVL1 우리투자증권(ELS)2136

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

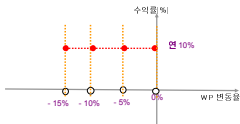
2) 만기: 2009년 8월 17일

3) 만도침산 결정 주기: 매3개월

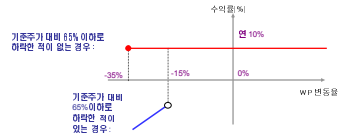
4) 기 존지 수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산가치(중도상환가격)의 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 만도 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 110.0%  
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 만도의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**3. 손익구조변동/최대손실가능금액(단위:백만원)**

메리츠주가지수연계시모종결2호

**손익구조변동 시나리오**

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

**최대손실 시나리오**

위험액	0.00
-----	------

**4. 파생상품의 최대손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

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

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 6월 12일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 존지수: 2008년 6월 12일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12.2%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 연기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 112.2%  
 - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (반기기존지수/최초기존지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



반기 시 손익구조



**[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교**  
 KR600980MM/M7 당주증권ELS2697

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

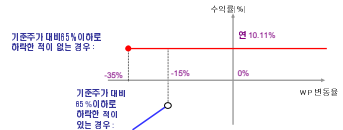
**2. 연가시점의 손익구조**

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

**초기상환 시 수익구조**



**만기 시 수익구조**



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

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장의파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

연율11%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

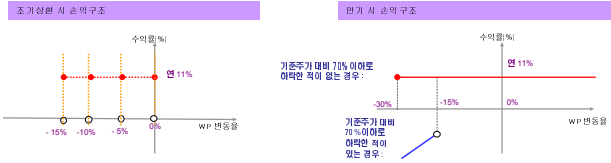
- 두 기준지수의 가격이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 \* 111%

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

: 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조





**[80-5] 메리츠투자지수형계사로증권2호**  
 KR6008679V84 메리츠신한증권(ELS)931

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 연기: 2009년 8월 17일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가

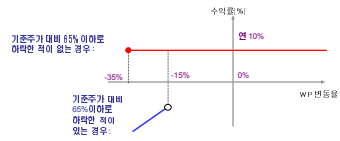
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 연기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 110.0%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (반기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



반기 시 수익구조



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

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 6월 12일

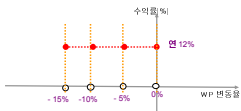
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

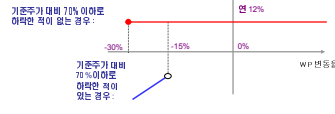
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**[80-7] 메리츠투자지수연계사모증권2호**  
 KR6030617V67  
 교보증권(ELS)Z27호

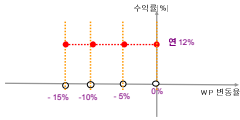
**1. 계약금액**

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

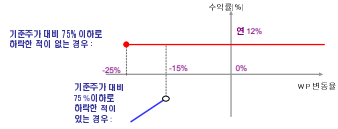
**2. 평가시점의 손익구조**

- 1) 종의파생상품의 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 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 만을 12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 두 기 초자산의 가격이 한반드 기 준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 85%보다 작은 경우  
 : 원금 \* 112%  
 - 두 기 초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 \* (만기 기 준지수/최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**[60-8] 메리츠투자지수형계사로증권2호**  
 KR6030617V83  
 교보증권(ELS)269회

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 평가시점의 손익구조**

1) 종의파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 8월 18일

3) 권드청산 일정 주기: 매4개월

4) 기 준지수: 2008년 8월 18일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

만큼 10.02%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

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

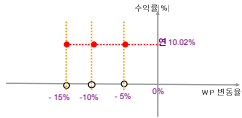
: 원금 \* 110.02%

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

: 원금 \* (만기 기 준지수/최 초기 준지수)

6) 권드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**[80-9] 메리츠투자지수연계사모증권2호**  
 KR6030618V58  
 교환증권(ELS)199회

**1. 계약금액**

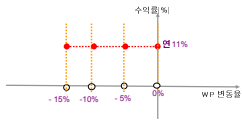
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위: (백만원)

**2. 평가시점의 손익구조**

- 1) 종의파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 5월 14일
- 3) 권드청산 결정 주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 만을 11%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한반드 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] **메리츠투자자산운용계사로증권2호**

1. 계약금액

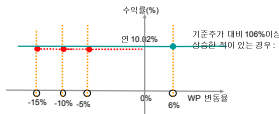
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7547.5	0	7547.5	잔위

단위(백만원)

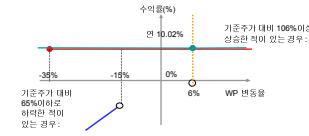
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2011년 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)의 중도상환가격이 낮은 기초자산가 준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일), 80%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 10.02%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 기초자산가 기준지수의 106%이상으로 상승한 적이 있을 경우는 행사정지사건에 해당되며, 행사정지사건이 발행 후 18개월 이전에 일어나면 이후 드러하는 중간평가일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급. 18개월 이후에 발생하면 만기일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급  
- 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 20.04%  
- 두 기초자산의 가격(장중로환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**[6] 데리츠2Star사모증권투신LEHC-2**

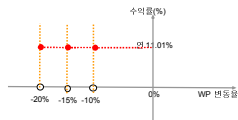
**1. 계약금액**

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

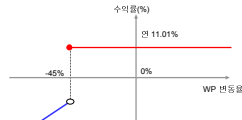
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 증권파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 2) 만기: 2012년 4월 12일
- 3) 편드형산결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차 지수의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 만을 11.01%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기 상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권리 행사  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 \* 111.01%  
 - 만기 상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우  
 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익구조인용(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR66923071445 NA투자증권(ELS)32

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.12
-----	------

**[62] 데리츠2SIa사모증권투자STWF-1**

**1. 계약금액**

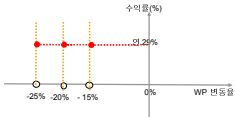
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위(백만원)

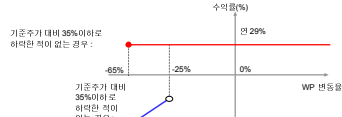
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 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) 만할 29%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 129%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6622313W42 코브증권(ELS)325

**손익구조변동 시나리오**

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	1.67	1.10	0.53	-0.05	-0.62	-1.19	-1.77
	5.33%	2.93	2.35	1.78	1.21	0.63	0.06	-0.51
	2.67%	2.94	2.37	1.80	1.22	0.65	0.08	-0.50
	0%	1.72	1.15	0.57	0.00	-0.97	-1.54	-2.12
	-2.67%	-0.74	-1.31	-1.89	-2.46	-3.03	-3.61	-4.18
	-5.33%	-4.44	-5.01	-5.59	-6.16	-6.73	-7.31	-7.88
	-8%	-9.38	-9.95	-10.52	-11.10	-11.67	-12.24	-12.82

**최대 손실 시나리오**

위험액	-12.82
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	29.37
-----	-------



**[68] 데리츠2Star사로증권LEHC-1호**

**1. 계약금액**

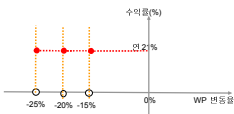
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2045.8	0	2,046	잔위

단위(백만원)

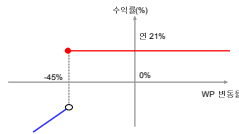
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 2) 만기: 2012년 4월 12일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보통주)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 2%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 121%  
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시점손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))**

KR6682307W43 NH투자증권(ELS)32

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10	-0.10
손익	5.33%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05
시나리오	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%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
	-8%	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.07
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	0.27
-----	------

**[67] 데리츠2Star사모증권POKB-1호**

**1. 계약금액**

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	837.0	0	837	잔위

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

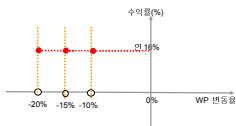
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

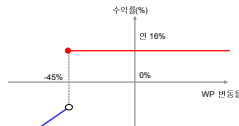
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 118%  
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)  
 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (다위·백만원))**  
KR6562340W48 유인투기증권(ELS)2405

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	0.91	0.52	0.12	-0.27	-0.66	-1.05	-1.44
	5.33%	1.66	1.27	0.88	0.49	0.10	-0.29	-0.69
산 시나리오	2.67%	1.75	1.36	0.97	0.58	0.19	-0.21	-0.60
	0%	1.18	0.78	0.39	0.00	-0.39	-0.78	-1.18
	-2.67%	-0.07	-0.46	-0.85	-1.25	-1.64	-2.03	-2.42
	-5.33%	-1.99	-2.38	-2.77	-3.16	-3.55	-3.94	-4.34
	-8%	-4.57	-4.96	-5.35	-5.74	-6.13	-6.53	-6.92

**최대 손실 시나리오**

위험액	-6.92
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	5.59
-----	------

[65] 데리츠2Star사로 증권POKB-2호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50	창의

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

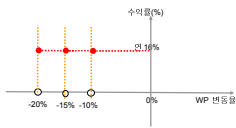
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

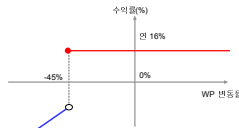
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 효력을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기 상환일정일예 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 118%  
 - 만기 상환일정일예 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)  
 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위:백만원))  
 KR6562340W48 유인투기증권(ELS)2405

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	0.05	0.03	0.01	-0.02	-0.04	-0.06	-0.09
산	5.33%	0.10	0.08	0.05	0.03	0.01	-0.02	-0.04
시나리오	2.67%	0.10	0.08	0.06	0.03	0.01	-0.01	-0.04
	0%	0.07	0.08	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.07
	-2.67%	-0.00	-0.03	-0.05	-0.07	-0.10	-0.12	-0.14
	-5.33%	-0.12	-0.14	-0.17	-0.19	-0.21	-0.24	-0.26
	-8%	-0.27	-0.30	-0.32	-0.34	-0.37	-0.39	-0.41

최대 손실 시나리오

위험액	-0.41
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	0.33
-----	------

**[67] 데리츠2Star사모증권SET-1**

**1. 계약금액**

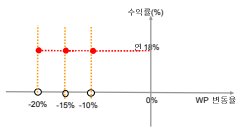
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

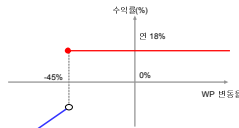
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 118%  
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))**  
KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	3.13	0.09	-2.96	-6.00	-9.05	-12.09	-15.14
	5.33%	7.68	4.63	1.59	-1.46	-4.50	-7.55	-10.59
산	2.67%	9.66	6.63	3.59	0.54	-2.50	-5.55	-8.59
	0%	9.13	6.08	3.04	0.00	-3.04	-6.09	-9.13
시나리오	-2.67%	6.05	3.00	-0.04	-3.09	-6.13	-9.18	-12.22
	-5.33%	0.42	-2.62	-5.67	-8.71	-11.76	-14.80	-17.85
	-8%	-7.75	-10.80	-13.84	-16.89	-19.93	-22.98	-26.02

최대 손실 시나리오

위험액	-26.02
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	34.52
-----	-------

[68] 데리츠2Star사로 증권SE ST-4호

1. 계약금액

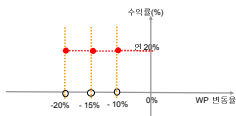
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	500.0	0	500	잔위

단위(백만원)

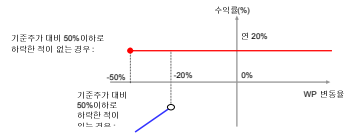
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 06일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)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, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 \* 120%  
- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (단위:백 만원))

KR6622303W44 : 코보증권(ELS)322

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	0.71	-0.05	-0.81	-1.57	-2.33	-3.09	-3.85
산	5.33%	2.33	1.57	0.81	0.05	-0.71	-1.47	-2.23
시나리오	2.67%	2.86	2.10	1.34	0.58	-0.18	-0.94	-1.70
	0%	2.28	1.52	0.76	0.00	-0.76	-1.52	-2.28
	-2.67%	0.60	-0.16	-0.92	-1.68	-2.44	-3.20	-3.96
	-5.33%	-2.17	-2.93	-3.69	-4.45	-5.21	-5.97	-6.73
	-8%	-6.04	-6.80	-7.56	-8.32	-9.08	-9.84	-10.60

최대 손실 시나리오

위험액	-10.60
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	8.69
-----	------

**[76] 데리츠2Star사모SEST-2**

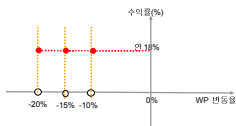
**1. 계약금액**

단위(백만원)						
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	차입

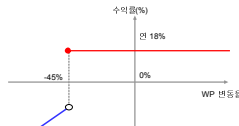
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 118%  
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))**

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	1.72	0.05	-1.63	-3.30	-4.98	-6.65	-8.33
산	5.33%	4.22	2.55	0.87	-0.80	-2.48	-4.15	-5.83
시나리오	2.67%	5.32	3.65	1.97	0.30	-1.38	-3.05	-4.73
	0%	6.03	3.38	1.68	0.00	-1.68	-3.35	-5.03
	-2.67%	3.33	1.65	-0.02	-1.70	-3.37	-5.05	-6.72
	-5.33%	0.23	-1.44	-3.12	-4.79	-6.47	-8.14	-9.82
	-8%	-4.26	-5.94	-7.61	-9.29	-10.97	-12.64	-14.32

**최대 손실 시나리오**

위험액	-14.32
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	18.99
-----	-------

**[77] 데리츠2SIa사모SEST-3**

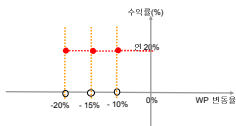
**1. 계약금액**

단위(백만원)						
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241.4	0	241	차입

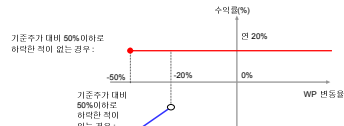
**2. 평가시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 평가: 2012년 3월 29일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 평가시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 \* 120%  
- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (평가기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



평가 시 손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))**  
KR6562345W35 유인투기증권(ELS)2382

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	2.63	1.90	1.17	0.44	-0.29	-1.02	-1.75
	5.33%	3.04	2.31	1.58	0.85	0.12	-0.61	-1.34
시나리오	2.67%	2.89	2.16	1.43	0.70	-0.03	-0.76	-1.49
	0%	2.18	1.46	0.73	0.00	-0.63	-1.46	-2.19
	-2.67%	0.93	0.20	-0.53	-1.26	-1.99	-2.72	-3.45
	-5.33%	-0.88	-1.61	-2.34	-3.07	-3.80	-4.53	-5.27
	-8%	-3.25	-3.98	-4.71	-5.44	-6.18	-6.91	-7.64

최대 손실 시나리오

위험액	-7.64
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	5.77
-----	------

[78] 데리츠2SIa사모STWF-2

1. 계약금액

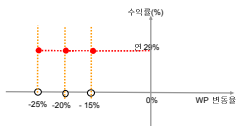
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	창의

단위(백만원)

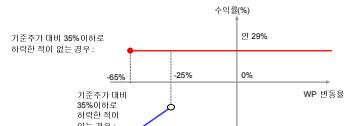
2. 연기사실의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤
- 2) 연기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연말 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 환반드 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 평균 \* 129%  
- 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (단위:백만원))

KR6622313W42 코브증권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.46	0.96	0.46	-0.04	-0.54	-1.04	-1.54
손익	5.33%	2.55	2.05	1.55	1.05	0.55	0.05	-0.45
시나리오	2.67%	2.56	2.06	1.56	1.06	0.57	0.07	-0.43
	0%	1.50	1.00	0.50	0.00	-0.50	-1.00	-1.50
	-2.67%	-0.84	-1.14	-1.64	-2.64	-3.64	-4.64	-5.64
	-5.33%	-3.87	-4.38	-4.88	-5.38	-5.88	-6.38	-6.88
	-8%	-8.16	-8.66	-9.16	-9.66	-10.16	-10.66	-11.16

최대 손실 시나리오

위험액	-11.16
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.57
-----	-------



[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

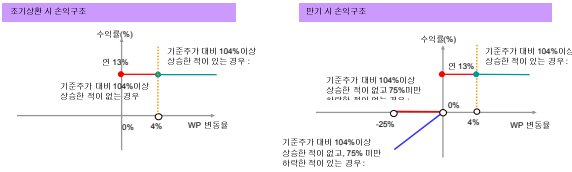
1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 평가시점의 수익구조

- 1) 평가대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 12월 13일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
  - 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수 수익 증가
  - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환일 정일에 최초 기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초 기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 \* 113%
  - 두 기초자산의 가격 (정중 포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 수익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

수익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9,457.29	8,873.72	8,290.15	7,706.58	7,123.01	6,539.44	5,955.88
	5.33%	6,878.59	6,295.02	5,711.45	5,127.88	4,544.31	3,960.75	3,377.18
	2.67%	4,309.73	3,726.16	3,142.59	2,559.02	1,975.45	1,391.88	808.31
	0%	1,750.71	1,167.14	583.57	0.00	-583.57	-1,167.14	-1,750.71
	-2.67%	-139.48	-713.05	-1,398.61	-2,049.18	-2,700.75	-3,352.32	-4,003.89
	-5.33%	-3,337.82	-3,921.39	-4,504.96	-5,088.53	-5,672.10	-6,255.67	-6,839.24
	-8%	-5,867.33	-6,450.90	-7,034.47	-7,618.04	-8,201.60	-8,785.17	-9,368.74

최대 손실 시나리오

위험액	-9,368.74
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	9,496.85
-----	----------

[79-2] **메리츠투자지수연계사모8호**

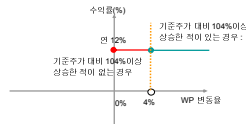
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	천원

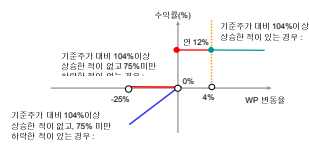
2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 11월 8일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
  - 4) 기준지수: 2007년 11월 8일 KOSPI200지수의 증가
  - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
    - : 원금 \* 11.2%
  - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
    - : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자기수연계사모8호**

1. 계약금액

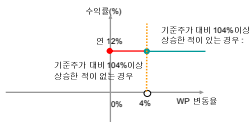
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔액

단위: 백만원

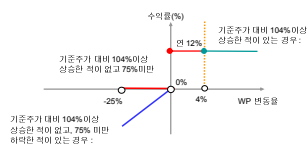
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 11월 16일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
  - 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수 수의 증가
  - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
    - : 원금 \* 112%
  - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
    - : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

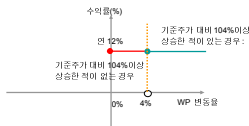
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	천원

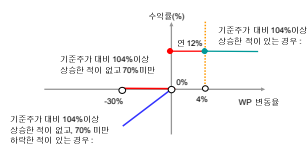
2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 10월 19일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
  - 4) 기 준지수: 2007년 10월 15일KOSPI200지수의 증가
  - 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 말기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
    - : 원금 \* 11.2%
  - 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만으로 하락한 적이 있는 경우
    - : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6008679TA3 곳님 신원증권(ELS)786

**[79-5] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

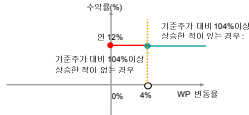
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 10일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

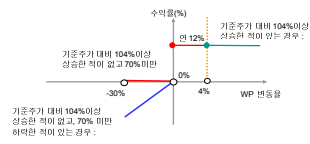
- 단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 \* 11.2%
  - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6008676TB7 코트님 신한증권(ELS)797

**[79-6] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

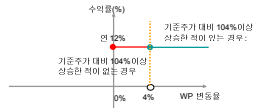
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

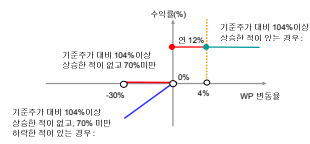
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600867CTB8 코트남 신원증권(ELS)804

**[79-7] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

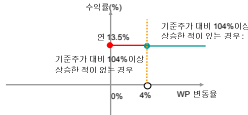
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기 준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한 번이라도 최초기 준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도 상환

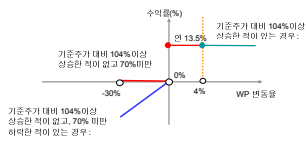
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격 이 일반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우  
 : 원금 \* 113.5%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 \* (만기 기 준지수/최 초기 준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6008675TC7      곳모닝 신환증권(ELS)809

**[79-8] 메리츠주가지수연계사모8호**

**1. 계약금액**

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

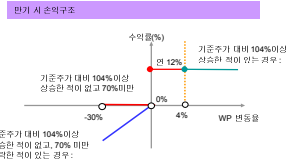
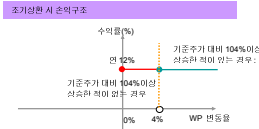
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 10월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 10월 15일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기 준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한 번이라도 최초기 준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

단, 만기시 (2차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격 이 일반도 기준가격의 65%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 \* 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기 준지수/최초기 준지수)

**6) 펀드의 수익구조**



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438



**[79-9] 에리츠주가지수연계사모8호**

**1. 계약금액**

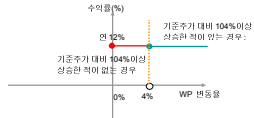
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	상위

단위(백만원)

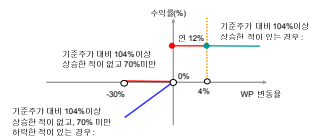
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
  - 단, 만기시 (2차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
    - 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 \* 112%
    - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

**[79-10] 에리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 평가시점의 손익구조**

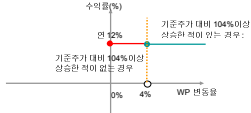
- 1) 참여대상종목의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지 수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

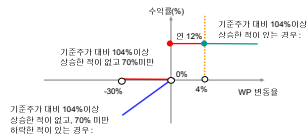
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의100%보다 작은 경우 : 원금 \* 112%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

**[79-11] 에리츠주가지수연계사료8호**

**1. 계약금액**

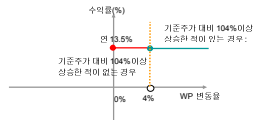
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	장외

단위(백만원)

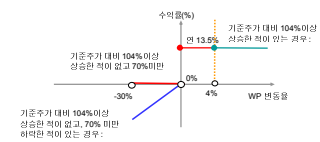
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 12일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도 상환
  - 단, 만기시 (2차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
    - 두 기초자산의 가격이 할인도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 \* 113.5%
    - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

**[79-12] 메리츠투자지수연계사모8호**

**1. 계약금액**

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

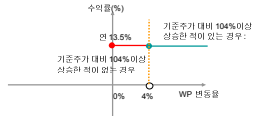
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도 상환

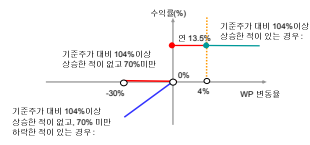
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격 이 할빈도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
 : 원금 + 11.3.5%  
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 + (만기기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환시 손익구조**



**만기시 손익구조**



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

**[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호**

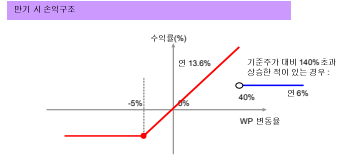
**1. 계약금액**

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	591.3	0	591	잔위

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 3월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 만기 전 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
  - 만기 평가일 수가 최초 기준가격 이상이고 최초 기준가격의 140% 미만일 경우  
: 원금 \* ( 95% + 100% \* ( 만기 기준지수 / 최초 기준지수 - 1 ) )
  - 만기 평가일 수가 최초 기준가격 미만일 경우  
: 원금 \* 95%
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6523317W30 대우증권ELS2881

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지수	8%	-3.90	-4.47	-5.03	-5.60	-6.16	-6.72	-7.29
시나리오	5.33%	-1.92	-2.48	-3.04	-3.61	-4.17	-4.74	-5.30
	2.67%	-0.05	-0.61	-1.18	-1.74	-2.31	-2.87	-3.44
	0%	1.69	1.13	0.56	0.00	-0.56	-1.13	-1.69
	-2.67%	3.31	2.75	2.18	1.62	1.06	0.49	-0.07
	-5.33%	4.81	4.25	3.68	3.12	2.55	1.99	1.43
	-8%	6.19	5.62	5.06	4.49	3.93	3.37	2.80

**최대 손실 시나리오**

위험액	2.80
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	7.88
-----	------

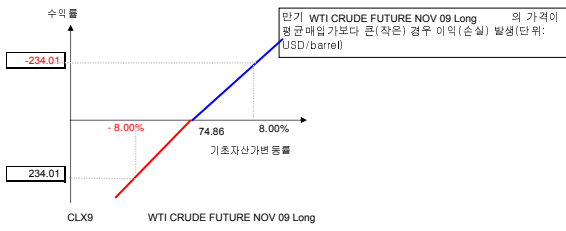
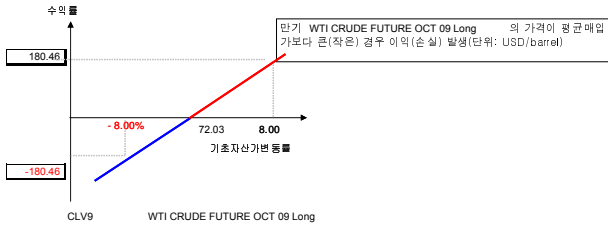
[80] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위:계약

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 시나리오	8%	414.48
	5.33%	276.15
	2.67%	138.33
	0%	0.00
	-2.67%	-138.33
	-5.33%	-276.15
	-8%	-414.48

최대손실 시나리오	
위험액	-414.48

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,678
-----	-------

[78] **대리 조주가지 수연계사모증권I6IE**

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수

2) 연가: 2010년 5월 28일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2009년 5월 29일 KOSPI 200 지 수의 증가

5) 발행 후 매3개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가액이

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

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

연율 12.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.

단, 만기시 잔치 조가 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

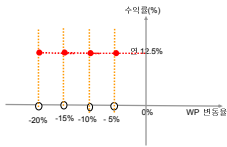
: 원금 \* 112.5%

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

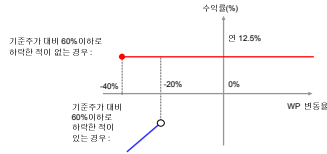
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조가상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6523310W80 대우증권ELS3005

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

**[79] 데리츠주가지 수연계사모증권!61E**

**1. 계약금액**

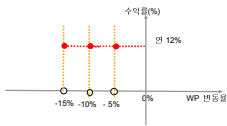
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위:백만원

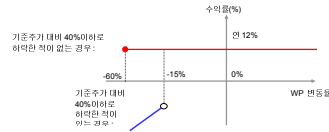
**2. 연가시점의 손익구조**

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



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

**손익 구조별 손실 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-4.62	-4.72	-4.81	-4.91	-5.00	-5.10	-5.19
손실시나리오	5.33%	-1.79	-1.89	-1.96	-2.08	-2.17	-2.27	-2.36
	2.67%	-0.16	-0.25	-0.35	-0.44	-0.54	-0.63	-0.73
	0%	0.28	0.18	0.10	0.00	-0.10	-0.19	-0.29
	-2.67%	-0.46	-0.56	-0.65	-0.75	-0.85	-0.94	-1.04
	-5.33%	-2.41	-2.50	-2.60	-2.69	-2.79	-2.88	-2.98
	-8%	-5.54	-5.64	-5.73	-5.83	-5.92	-6.02	-6.11

**최대 손실 시나리오**

위험액	-6.11
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	1.46
-----	------



**[80] 대리 조주가지 수연계 사모증권10호**

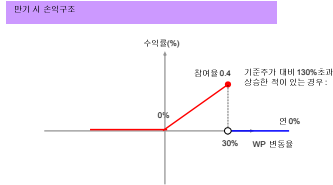
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

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



**3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6673105W54 동부증권-엘리펀트스(ELS)B1

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	-5.37	-7.50	-9.63	-11.76	-13.88	-16.01	-18.14
산	5.33%	-1.03	-3.16	-5.28	-7.41	-9.54	-11.67	-13.80
시나리오	2.67%	2.89	0.76	-1.37	-3.49	-5.62	-7.75	-9.88
오	0%	6.38	4.26	2.13	0.00	-2.13	-4.26	-6.38
	-2.67%	9.45	7.33	5.20	3.07	0.94	-1.19	-3.32
	-5.33%	12.10	9.97	7.84	5.71	3.59	1.46	-0.67
	-8%	14.32	12.19	10.06	7.93	5.81	3.68	1.55

**최대 손실 시나리오**

위험액	1.55
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	17.49
-----	-------

**[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호**

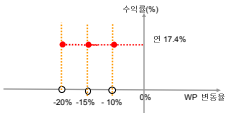
**1. 계약금액**

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

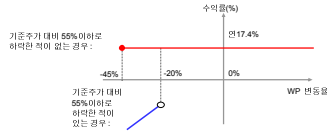
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**3. 손익 구조별 손(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

**손익 구조별 손 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	2.95	2.45	1.96	1.47	0.98	0.49	-0.00
손실	5.33%	3.20	2.70	2.21	1.72	1.23	0.74	0.25
손익	2.67%	2.71	2.21	1.72	1.23	0.74	0.25	-0.24
시나리오	0%	1.48	0.98	0.49	0.00	-0.49	-0.98	-1.48
	-2.67%	-0.50	-0.99	-1.48	-1.97	-2.46	-2.95	-3.45
	-5.33%	-3.21	-3.70	-4.19	-4.68	-5.17	-5.67	-6.16
	-8%	-6.66	-7.15	-7.64	-8.13	-8.63	-9.12	-9.61

**최대 손실 시나리오**

위험액	-9.61
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	10.96
-----	-------

**[83] 데리츠2Star사모증권SET-5호**

**1. 계약금액**

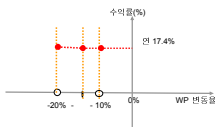
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

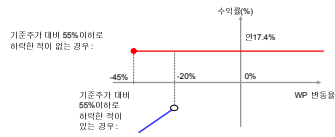
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 (장종료합)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))**  
KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

**손익 구조표본 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	18.93	15.77	12.61	9.45	6.29	3.13	-0.03
손실	5.33%	20.54	17.38	14.22	11.06	7.90	4.74	1.58
시나리오	2.67%	17.39	14.23	11.07	7.91	4.75	1.59	-1.57
	0%	9.48	6.32	3.16	0.00	-3.16	-6.32	-9.48
	-2.67%	-3.16	-6.34	-9.50	-12.66	-15.82	-18.98	-22.14
	-5.33%	-20.60	-23.76	-26.92	-30.08	-33.24	-36.40	-39.56
	-8%	-42.78	-45.94	-49.10	-52.26	-55.42	-58.58	-61.74

**최대 손실 시나리오**

위험액	-61.74
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	70.44
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

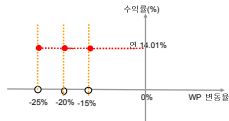
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: 백만원

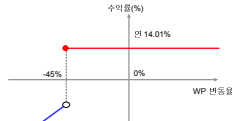
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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 중도상환이 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 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백 만원)

KR6662305W64 원화스프레드(ELS)132

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.46	-0.50	-0.52	-0.53	-0.55	-0.57	-0.58
	5.33%	-0.18	-0.20	-0.22	-0.23	-0.25	-0.27	-0.28
시나리오	2.67%	-0.00	-0.02	-0.04	-0.05	-0.07	-0.09	-0.11
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.08
	-2.67%	-0.02	-0.03	-0.05	-0.07	-0.09	-0.10	-0.12
	-5.33%	-0.21	-0.22	-0.24	-0.26	-0.28	-0.29	-0.31
	-8%	-0.52	-0.54	-0.55	-0.57	-0.59	-0.61	-0.62

최대 손실 시나리오

위험액	-0.62
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백 만원)

위험액	0.09
-----	------

[85] 테라츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

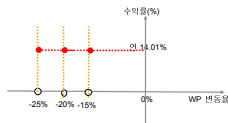
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위: (백만원)

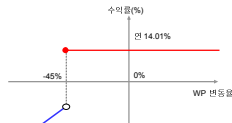
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-1.73	-1.60	-1.66	-1.92	-1.98	-2.05	-2.11
	5.33%	-0.65	-0.71	-0.76	-0.84	-0.90	-0.96	-1.03
시나리오	2.67%	-0.01	-0.07	-0.14	-0.20	-0.26	-0.32	-0.39
	0%	0.08	0.12	0.06	0.00	-0.06	-0.12	-0.18
	-2.67%	-0.06	-0.12	-0.18	-0.24	-0.31	-0.37	-0.43
	-5.33%	-0.74	-0.81	-0.87	-0.93	-0.99	-1.06	-1.12
	-8%	-1.87	-1.94	-2.00	-2.06	-2.12	-2.19	-2.25

최대 손실 시나리오

위험액	-2.25
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.33
-----	------

**[86] 데리츠2Star사로증권SELE-1호**

**1. 계약금액**

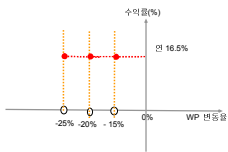
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

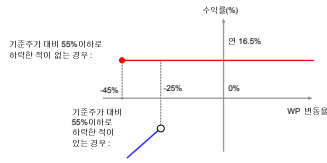
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환펀드 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 116.5%  
 - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조표 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6662321W56 환위스마트(ELS)127

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.02
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

**[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호**

**1. 계약금액**

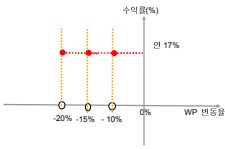
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	341.7	0	341.7	잔위

단위: (백만원)

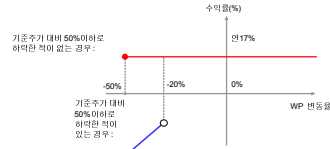
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 10일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산( 삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조가상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 \* 117%  
 - 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



**3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)**  
KR6562319W52 유인 투기증권 (ELS)2415

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.84	1.47	1.10	0.73	0.36	-0.01	-0.38
	5.33%	1.99	1.62	1.25	0.88	0.51	0.14	-0.23
시나리오	2.67%	1.75	1.38	1.01	0.64	0.27	-0.10	-0.47
	0%	1.11	0.74	0.37	0.00	-0.37	-0.74	-1.11
	-2.67%	0.07	-0.30	-0.67	-1.04	-1.41	-1.78	-2.14
	-5.33%	-1.36	-1.73	-2.10	-2.47	-2.84	-3.21	-3.58
	-8%	-3.19	-3.55	-3.92	-4.29	-4.66	-5.03	-5.40

**최대 손실 시나리오**

위험액	-5.40
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	5.71
-----	------

**[88] 데리츠2Star사로증권SCDM-1호**

**1. 계약금액**

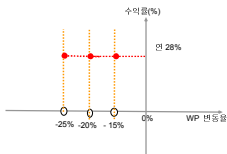
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	462.0	0	462.0	차입

단위:백만원

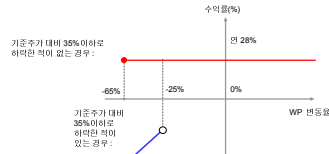
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산( 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 \* 128%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조표선 및(최대 손실 가능금액 (단위:백 만원))**  
KR6622309W55      표본증권(ELS)344

손익 구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초지	8%	48.04	37.30	26.56	15.82	5.08	-5.66	-16.40
	5.33%	43.30	32.56	21.82	11.08	0.34	-10.40	-21.14
산	2.67%	38.02	27.28	16.54	5.81	-4.93	-15.67	-26.41
	0%	32.22	21.48	10.74	0.00	-10.74	-21.85	-32.22
시나리오	-2.67%	25.86	15.14	4.40	-5.34	-11.08	-21.82	-32.56
	-5.33%	19.01	8.27	-2.41	-13.21	-23.95	-34.69	-45.43
	-8%	11.61	0.87	-9.87	-20.61	-31.35	-42.09	-52.83

최대 손실 시나리오

위험액	-52.83
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)**

위험액	50.37
-----	-------



[89] 데리츠2Star사로 증권POLE-2호

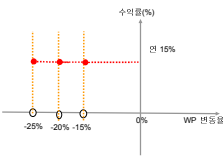
1. 계약금액

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

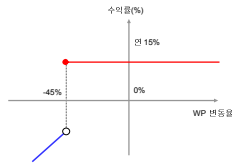
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(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%	0.14	0.10	0.07	0.04	0.01	-0.03	-0.06
	5.33%	0.15	0.12	0.09	0.05	0.02	-0.01	-0.05
시나리오	2.67%	0.14	0.11	0.07	0.04	0.01	-0.03	-0.06
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	-0.03	-0.07	-0.10
	-2.67%	0.03	-0.00	-0.04	-0.07	-0.10	-0.13	-0.17
	-5.33%	-0.07	-0.10	-0.13	-0.17	-0.20	-0.23	-0.26
	-8%	-0.19	-0.22	-0.26	-0.29	-0.32	-0.36	-0.39

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.39

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.28
-----	------

**[90] 데리츠2Star사로증권POLE-이 호**

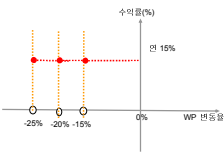
**1. 계약금액**

단위: (백만원)						
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	차입

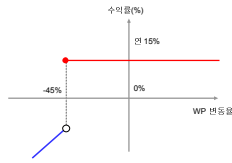
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO
- 2) 만기: 2012년 5월 11일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 13일 LG전자 보통주, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, POSCO 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우  
 : 원금 \* 11.5%  
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우  
 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



**3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위: 백만원)**  
KR6662311WS8 권위스마트(ELS)117

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	10.43	7.92	5.41	2.89	0.38	-2.13	-4.64
손익	5.33%	11.59	9.08	6.57	4.06	1.54	-0.97	-3.48
시나리오	2.67%	10.63	8.12	5.60	3.09	0.58	-1.93	-4.45
	0%	7.94	5.02	2.51	0.00	-2.91	-5.82	-7.94
	-2.67%	2.32	-0.19	-2.70	-5.22	-7.73	-10.24	-12.75
	-5.33%	-5.02	-7.53	-10.05	-12.56	-15.07	-17.58	-20.10
	-8%	-14.49	-17.00	-19.52	-22.03	-24.54	-27.05	-29.57

**최대 손실 시나리오**

위험액	-29.57
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	20.99
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

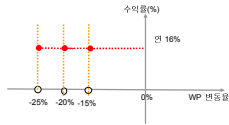
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	차입

단위:백만원

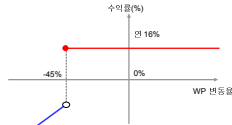
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우  
 : 평균 \* 118%  
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우  
 : 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522308W66 대우증권ELS2998

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.51	0.42	0.33	0.24	0.15	0.05	-0.04
손익	5.33%	0.46	0.37	0.28	0.19	0.10	0.01	-0.09
시나리오	2.67%	0.38	0.29	0.20	0.11	0.02	-0.07	-0.16
	0%	0.27	0.18	0.09	0.00	-0.09	-0.18	-0.27
	-2.67%	0.13	0.04	-0.05	-0.14	-0.23	-0.32	-0.41
	-5.33%	-0.03	-0.13	-0.22	-0.31	-0.40	-0.49	-0.58
	-8%	-0.23	-0.32	-0.42	-0.51	-0.60	-0.69	-0.78

최대 손실 시나리오

위험액	-0.78
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.61
-----	------

**[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]**

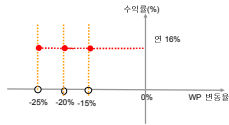
**1. 계약금액**

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

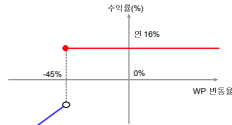
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우  
: 평균 \* 118%  
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우  
: 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))**  
KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	9.13	7.50	5.87	4.24	2.60	0.97	-0.66
손실	5.33%	8.26	6.63	5.00	3.36	1.73	0.10	-1.54
시나리오	2.67%	6.85	5.22	3.58	1.95	0.32	-1.31	-2.95
	0%	4.90	3.27	1.63	0.00	-1.63	-3.27	-4.90
	-2.67%	2.41	0.78	-0.86	-2.49	-4.12	-5.75	-7.39
	-5.33%	-0.62	-2.25	-3.88	-5.51	-7.15	-8.78	-10.41
	-8%	-4.18	-5.81	-7.45	-9.08	-10.71	-12.34	-13.98

최대 손실 시나리오

위험액	-13.98
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	10.90
-----	-------

**[93] 데리츠2Star사로증권LEHC-3**

**1. 계약금액**

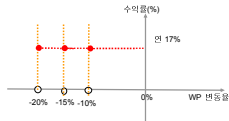
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	차입

단위: (백만원)

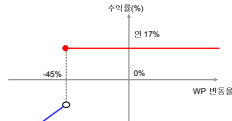
**2. 평가시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 현대차 보통주
- 2) 만기: 2012년 4월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 30일 LG전자 보통주, 현대차 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 현대차 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환펀드 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 \* 117%  
 - 두 기초자산의 가격 (중도포함)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 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)**  
KR6562310W51 유린 투기증권 (ELS)2414

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.83	0.31	-0.20	-0.72	-1.24	-1.76	-2.28
손익	5.33%	1.67	1.15	0.63	0.11	-0.40	-0.92	-1.44
시나리오	2.67%	1.91	1.39	0.87	0.36	-0.16	-0.68	-1.20
	0%	1.66	1.04	0.52	0.00	-0.52	-1.04	-1.56
	-2.67%	0.80	0.09	-0.43	-0.95	-1.47	-1.99	-2.51
	-5.33%	-0.94	-1.46	-1.98	-2.50	-3.02	-3.54	-4.06
	-8%	-3.09	-3.61	-4.13	-4.64	-5.16	-5.68	-6.20

**최대 손실 시나리오**

위험액	-6.20
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	8.18
-----	------

**[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1**

**1. 계약금액**

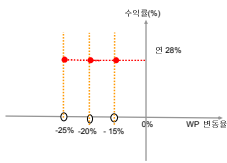
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	잔위

단위:백만원

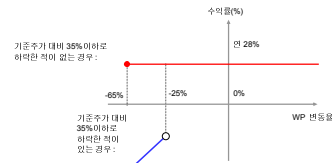
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 평균 \* 128%  
- 두 기초자산의 가액 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조표현 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**  
KR6622301W53 코브증권(ELS)336

**손익 구조표현 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	40.42	32.90	25.38	17.85	10.33	2.80	-4.72
손실리	5.33%	35.07	27.54	20.02	12.49	4.97	-2.56	-10.08
손익	2.67%	29.12	21.59	14.07	6.54	-0.98	-8.51	-16.03
손실리	0%	22.57	15.05	7.52	0.00	-7.52	-15.05	-22.57
손익	-2.67%	15.44	7.91	0.39	-7.52	-14.66	-22.18	-29.11
손실리	-5.33%	7.71	0.19	-7.34	-14.66	-22.38	-29.91	-37.43
손익	-8%	-0.61	-8.13	-15.65	-23.18	-30.70	-38.23	-45.75

최대 손실 시나리오

위험액	-45.75
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	45.23
-----	-------

**[95] 데리츠1Star사로증권BE-1호**

**1. 계약금액**

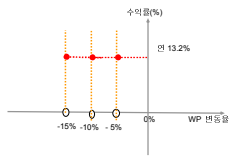
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위:백만원

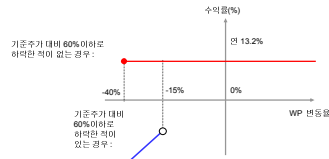
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 주가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산가액으로 각각 최초 기준가액의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 연율 13.2%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우 : 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 표보증권(ELS)341

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

**최대 손실 시나리오**

위험액	0.00
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

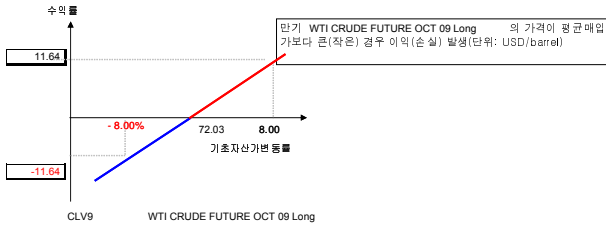
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유\_파생형]모

1. 계약금액

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 SEP 09 long

구분	시나리오	손익
기초자산 시나리오	8%	11.64
	5.33%	7.76
	2.67%	3.89
	0%	0.00
	-2.67%	-3.89
시나리오	-5.33%	-7.76
	-8%	-11.64

최대 손실 시나리오	
위험액	-11.64

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46
-----	----



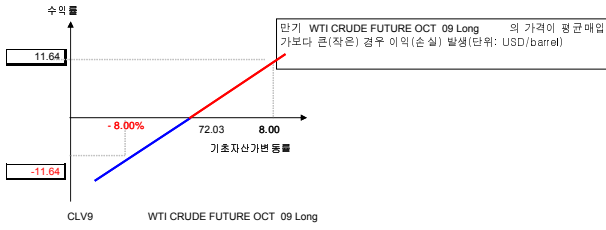
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



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

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	32.20
	5.33%	21.45
	2.67%	10.75
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-10.75
	-5.33%	-21.45
	-8%	-32.20

최대 손실 시나리오	
위험액	-32.20

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	130
-----	-----

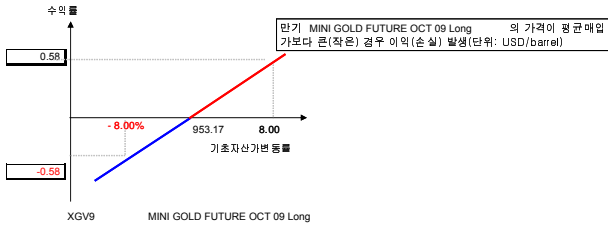
[96-2] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



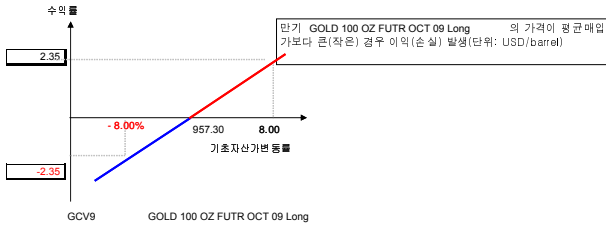
[96-3] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



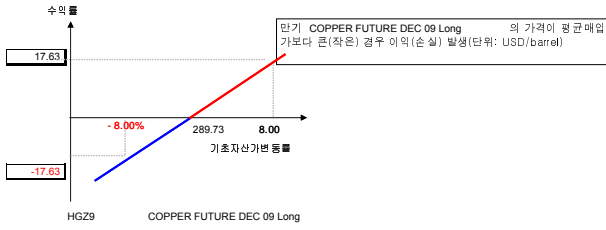
[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

구분	거래대상	거래유형	배수(1)	배도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	1	0	1	장내

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조

