

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

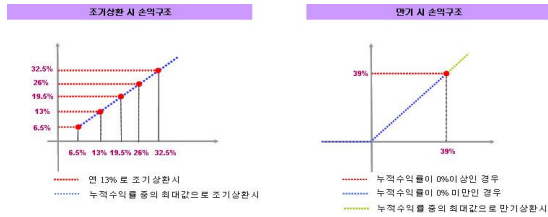
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.15	0.15	0.15	0.15	0.15	0.15	0.15
	5.33%	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09
	2.67%	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
-5.33%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	
-8%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테라즈 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

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 수익률의 단순합계)

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6006903TR1 내부종금(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.27	0.25	0.23	0.22	0.20	0.18	0.17
	5.33%	0.19	0.17	0.15	0.14	0.12	0.10	0.08
시나리오	2.67%	0.11	0.10	0.08	0.06	0.05	0.03	0.01
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.05
	-2.67%	-0.00	-0.02	-0.04	-0.05	-0.07	-0.09	-0.10
	-5.33%	-0.04	-0.06	-0.08	-0.10	-0.11	-0.13	-0.15
	-8%	-0.08	-0.09	-0.11	-0.13	-0.15	-0.16	-0.18

최대 손실 시나리오

위험액	-0.18
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

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

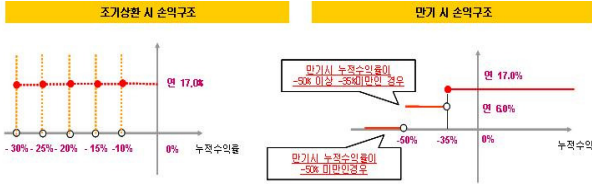
3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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 중도상환가려이 낮은 기초자산기준으로 기초자산의 누적수익률이 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. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

단, 만기시까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 권드 해지
만기 평가일의 누적수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 18.0%의 수익률로 상환
만기 평가일의 누적수익률이 -50%미만인 경우: 역면금액 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%	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	5.33%	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01
	2.67%	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	0%	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	-2.67%	0.01	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01
-5.33%	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	
-8%	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.01
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자전략 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

: 만월 * 140%

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

: 만월 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력익성증권(ELS)24호

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	18.81	17.77	16.73	15.69	14.65	13.61	12.57
손익	5.33%	13.65	12.61	11.57	10.53	9.49	8.46	7.42
시나리오	2.67%	8.42	7.38	6.34	5.30	4.26	3.22	2.19
	0%	3.12	2.08	1.04	0.00	-1.04	-2.08	-3.12
	-2.67%	-2.26	-3.30	-4.34	-5.38	-6.42	-7.46	-8.50
	-5.33%	-7.71	-8.75	-9.79	-10.83	-11.87	-12.91	-13.95
	-8%	-13.24	-14.28	-15.31	-16.35	-17.39	-18.43	-19.47

최대 손실 시나리오

위험액 -19.47

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 19.66

[6]에리츠 StepDown 사모펀위패생상물투자신탁 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. 평가시점의 손익구조

1) 상위패생상물의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 평가: 2009년 11월 12일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600345TTB9 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%	13.11	12.49	11.86	11.24	10.61	9.99	9.36
	5.33%	9.38	8.76	8.13	7.51	6.88	6.26	5.64
	2.67%	5.64	5.01	4.39	3.76	3.14	2.52	1.89
	0%	1.87	1.25	0.62	0.00	-1.62	-1.25	-1.87
손익 구조변동 시나리오	-2.67%	-1.91	-2.53	-3.16	-3.78	-4.41	-5.03	-5.66
	-5.33%	-5.71	-6.34	-6.96	-7.59	-8.21	-8.84	-9.46
	-8%	-9.54	-10.16	-10.78	-11.41	-12.03	-12.66	-13.28

최대 손실 시나리오

위험액	-13.28
-----	--------

4. 패생상물의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	13.39
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연기: 2010년 2월 22일

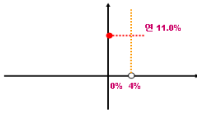
3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

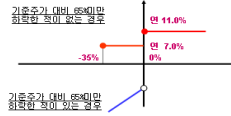
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가액의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확인 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 원본투자 기준가액의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)
 KR600348RT28 변동유보(ELS): 2007-397세

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	408.59	390.93	373.27	355.60	337.94	320.28	302.62
5.33%	289.18	271.52	253.85	236.19	218.53	200.86	183.20
2.67%	170.64	152.98	135.32	117.66	99.99	82.33	64.67
0%	52.99	35.33	17.66	0.00	-17.66	-35.33	-52.99
-2.67%	-63.79	-81.45	-99.11	-116.78	-134.44	-152.10	-169.76
-5.33%	-179.68	-197.35	-215.01	-232.67	-250.33	-268.00	-285.66
-8%	-294.70	-312.36	-330.03	-347.69	-365.35	-383.01	-400.68

최대 손실 시나리오

위험액	-400.68
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	395.62
-----	--------

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 104%이상 상승한적이 있는 경우 연월 11.2%의 수익률로 중도상환이 됨.

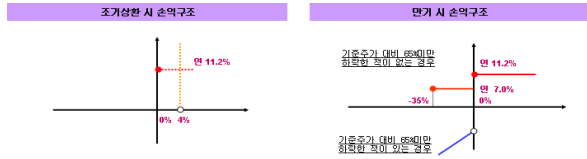
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345ST27 환비드 유가(ELS): 2017-398회

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	39.39	37.70	36.00	34.31	32.61	30.92	29.23
시나리오	5.33%	27.86	26.16	24.47	22.77	21.08	19.38	17.69
	2.67%	16.42	14.72	13.03	11.33	9.64	7.94	6.25
	0%	5.08	3.39	1.69	0.00	-1.69	-3.39	-5.08
	-2.67%	-6.15	-7.84	-9.54	-11.23	-12.93	-14.62	-16.32
	-5.33%	-17.28	-18.97	-20.67	-22.36	-24.06	-25.75	-27.45
	-8%	-28.31	-30.00	-31.70	-33.39	-35.09	-36.78	-38.48

최대 손실 시나리오

위험액	-38.48
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	37.78
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

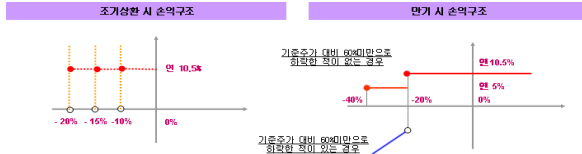
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600172Y743 신영투자(ELS)552

손익 구조표인 톱 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	467.67	439.65	412.04	384.22	356.40	328.59	300.77
시나리오	5.33%	363.29	335.47	307.65	279.83	252.02	224.20	196.38
	2.67%	235.21	207.40	179.58	151.76	123.94	96.13	68.31
	0%	89.45	56.63	27.62	0.00	-27.62	-56.63	-89.45
	-2.67%	-92.00	-119.82	-147.63	-175.45	-203.27	-231.08	-258.90
	-5.33%	-291.14	-318.95	-346.77	-374.59	-402.40	-430.22	-458.04
	-8%	-513.96	-541.78	-569.59	-597.41	-625.23	-653.04	-680.86

최대 손실 시나리오

위험액	-680.86
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	718.18
-----	--------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 6월 3일

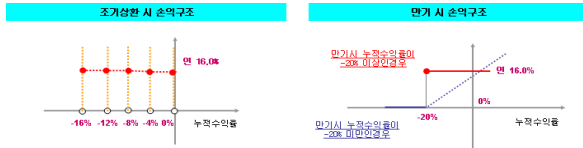
3) 만드점산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 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%	0.97	0.90	0.83	0.76	0.69	0.62	0.55
	5.33%	0.70	0.63	0.56	0.49	0.42	0.35	0.28
	2.67%	0.45	0.38	0.31	0.24	0.17	0.10	0.03
	0%	0.21	0.14	0.07	0.00	-0.07	-0.14	-0.21
손익구조범용 시나리오	-2.67%	-0.02	-0.08	-0.15	-0.22	-0.29	-0.36	-0.43
	-5.33%	-0.22	-0.29	-0.36	-0.43	-0.50	-0.57	-0.64
	-8%	-0.42	-0.48	-0.55	-0.62	-0.69	-0.76	-0.83

최대 손실 시나리오

위험액	-0.83
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

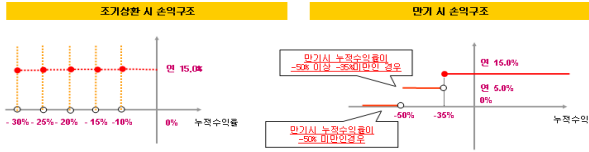
[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

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 기한을 설정하고, 기초자산(국민은행, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환함.
(누적 수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만도 해지
만기 평가일의 누적수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환
만기 평가일의 누적수익률이 -50%미만인 경우: 액면금액 지급 (원금보장주주)
- 6) 만도의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상증권(ELS)191

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.30	1.04	0.77	0.50	0.24	-0.03	-0.29
시나리오	5.33%	1.18	0.91	0.65	0.38	0.12	-0.15	-0.42
	2.67%	1.01	0.75	0.48	0.21	-0.05	-0.32	-0.59
	0%	0.80	0.53	0.27	0.00	-0.27	-0.53	-0.80
	-2.67%	0.54	0.27	0.01	-0.26	-0.52	-0.79	-1.06
	-5.33%	0.24	-0.03	-0.29	-0.56	-0.83	-1.09	-1.36
	-8%	-0.11	-0.38	-0.64	-0.91	-1.17	-1.44	-1.71

최대 손실 시나리오

위험액	-1.71
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.94
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제10호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주

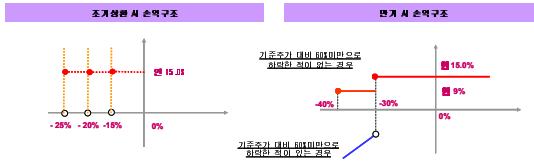
2) 만기: 2009년 9월 18일

3) 펀드청산 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/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762L97 미래에셋증권(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	362.97	359.87	356.78	353.69	350.59	347.50	344.40
	5.33%	250.04	246.95	243.86	240.76	237.67	234.57	231.48
시나리오	2.67%	132.15	129.06	125.96	122.87	119.77	116.68	113.58
	0%	9.28	6.19	3.09	0.00	-3.09	-6.19	-9.28
	-2.67%	-118.56	-121.65	-124.74	-127.84	-130.93	-134.03	-137.12
	-5.33%	-251.37	-254.46	-257.55	-260.65	-263.74	-266.84	-269.93
	-8%	-389.15	-392.24	-395.34	-398.43	-401.52	-404.62	-407.71

최대 손실 시나리오

위험액	-407.71
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	521.96
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

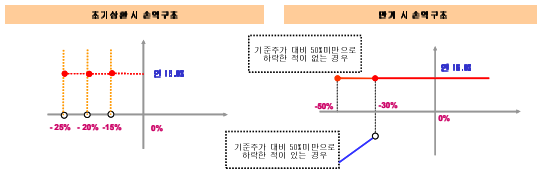
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 14일
- 3) 만드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(현대모비스, 삼성중공업 보통주)의 중도상환가액이 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 수익 확정 후 만드 확정
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 132%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익구조의 최(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762HTA9 미래에셋증권 ELS(232)

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	119.46	116.86	114.25	111.65	109.04	106.43	103.83
시나리오	5.33%	79.57	76.96	74.36	71.75	69.15	66.54	63.94
	2.67%	42.35	39.73	37.14	34.54	31.93	29.33	26.72
	0%	7.82	5.21	2.61	0.00	-2.61	-5.21	-7.82
	-2.67%	-24.04	-26.65	-29.25	-31.86	-34.47	-37.07	-39.68
	-5.33%	-53.22	-55.83	-58.43	-61.04	-63.65	-66.25	-68.86
	-8%	-79.73	-82.33	-84.94	-87.54	-90.15	-92.76	-95.36

최대 손실 시나리오

위험액	-95.36
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	100.67
-----	--------

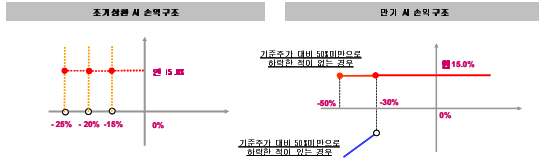
[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

1. 계약금액

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

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



3. 손익구조의 최(최대)손실가능금액(단위:백만원)

KR603762BTB0 비례예상증권(ELS)240

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	3.58	3.39	3.20	3.01	2.82	2.63	2.44
	5.33%	2.80	2.61	2.42	2.23	2.04	1.85	1.66
	2.67%	1.80	1.60	1.41	1.22	1.03	0.84	0.65
	0%	0.57	0.38	0.19	0.00	-0.19	-0.38	-0.57
	-2.67%	-0.87	-1.06	-1.25	-1.44	-1.63	-1.82	-2.02
	-5.33%	-2.54	-2.73	-2.92	-3.11	-3.30	-3.49	-3.68
	-8%	-4.42	-4.61	-4.80	-4.99	-5.18	-5.37	-5.56

최대 손실 시나리오

위험액	-5.56
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	5.40
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

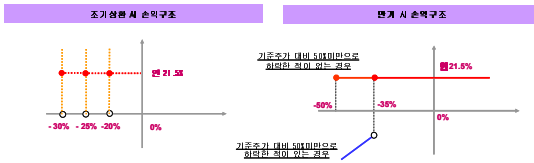
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010 년 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(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600345EV11 변동주변(ELS)2008-647

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	231.71	211.61	191.51	171.42	151.32	131.22	111.12
	5.33%	173.66	153.57	133.47	113.37	93.28	73.18	53.08
시나리오	2.67%	116.53	96.43	76.33	56.23	36.14	16.04	-4.06
	0%	60.29	40.19	20.10	0.00	-20.10	-40.19	-60.29
손익 구조변동	-2.67%	4.96	-15.14	-35.23	-55.33	-75.43	-95.52	-115.62
	-5.33%	-49.47	-69.58	-89.68	-109.78	-129.88	-149.98	-170.08
	-8%	-102.99	-123.08	-143.18	-163.28	-183.37	-203.47	-223.57

최대 손실 시나리오	
위험액	-223.57

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	262.94
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 괴생상품 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

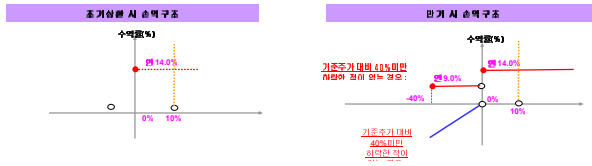
3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	422.66	406.52	390.37	374.21	358.05	341.89	325.74
	5.33%	313.71	297.55	281.40	265.24	249.08	232.92	216.77
시나리오	2.67%	188.97	172.82	156.66	140.50	124.34	108.19	92.03
	0%	48.47	32.32	16.16	0.00	-16.16	-32.32	-48.47
	-2.67%	-107.79	-123.95	-140.11	-156.27	-172.43	-188.58	-204.74
	-5.33%	-279.83	-295.99	-312.14	-328.30	-344.46	-360.62	-376.77
	-8%	-467.63	-483.78	-499.94	-516.10	-532.26	-548.41	-564.57

최대 손실 시나리오

위험액	-564.57
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	538.73
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위특성26호

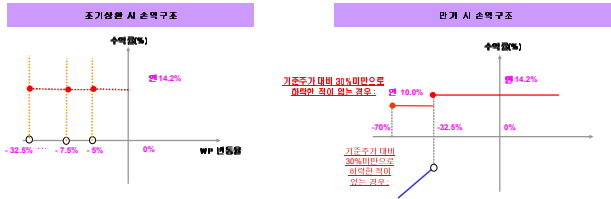
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867B1B0 코루남산한동림(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	214.58	185.53	156.47	127.41	98.35	69.30	40.24
	5.33%	171.72	142.67	113.61	84.55	55.50	26.44	-2.62
	2.67%	129.25	100.20	71.14	42.08	13.03	-16.03	-45.09
	0%	87.17	58.11	29.06	0.00	-23.08	-68.11	-97.17
	-2.67%	45.48	16.42	-12.64	-41.69	-70.75	-99.81	-128.87
-5.33%	4.17	-24.88	-53.94	-83.00	-112.06	-141.11	-170.17	
-8%	-36.74	-65.80	-94.86	-123.92	-152.97	-182.03	-211.09	

최대 손실 시나리오

위험액	-211.09
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	212.45
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

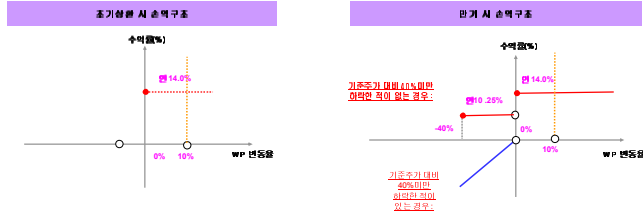
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

구분	손익구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	95.24	90.40	85.57	80.73	75.89	71.05	66.21	
손익	67.86	63.02	58.18	53.35	48.51	43.67	38.83	
손익률	40.95	36.11	31.26	26.44	21.60	16.76	11.92	
변동성	14.51	9.68	4.84	0.00	-4.84	-9.68	-14.51	
최대손실	-11.45	-16.29	-21.13	-25.97	-30.80	-35.64	-40.48	
최대손실률	-36.95	-47.78	-46.62	-61.46	-56.30	-61.14	-65.98	
최대손실률률	-61.97	-66.81	-71.65	-76.48	-81.32	-86.16	-91.00	

최대 손실 시나리오	
위험액	66.21

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	88.78
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서 5호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

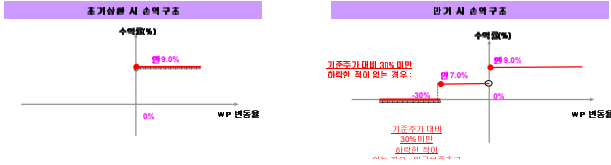
단, 평가시점에 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락할 적 이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 * 121%

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

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	45.08	41.79	38.50	35.22	31.93	28.64	25.36	
시나리오	5.33%	3.42%	30.96	27.67	24.39	21.10	17.81	
	2.67%	22.51	19.22	15.93	12.65	9.36	6.08	
	0%	9.86	6.57	3.29	0.00	-3.29	-6.57	
	-2.67%	-3.10	-6.39	-10.27	-13.56	-16.84	-20.13	
	-5.33%	-16.17	-21.45	-24.74	-28.03	-31.31	-34.60	
	-8%	-33.54	-36.83	-40.12	-43.40	-46.69	-49.97	
							-53.26	

최대 손실 시나리오

위험액	25.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	52.51
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

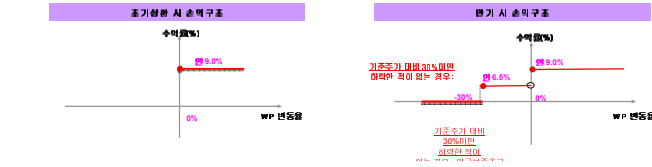
1. 계약금액

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 증가
 - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 만기보다 기준가격의 70% 미만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만 하락한 적이 있는 경우: 원금 * 100%



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR603762OV23 미래에셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
8%	32.22	29.80	27.38	24.96	22.54	20.12	17.70	
5.33%	24.47	22.05	19.64	17.22	14.80	12.38	9.96	
2.67%	16.15	13.73	11.32	8.90	6.48	4.06	1.64	
0%	7.26	4.84	2.42	0.00	-2.42	-4.84	-7.26	
-2.67%	-2.22	-4.64	-7.05	-9.47	-11.89	-14.31	-16.73	
-5.33%	-12.27	-14.69	-17.11	-19.52	-21.94	-24.36	-26.78	
-8%	-22.90	-25.31	-27.73	-30.15	-32.57	-34.99	-37.41	

최대 손실 시나리오

위험액	17.70
-----	-------

4. 거래상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	38.75
-----	-------

[2] 메리츠저축은행계사모단위파생7호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 2월 21일

3) 판도청산결정주기: 매 6개월

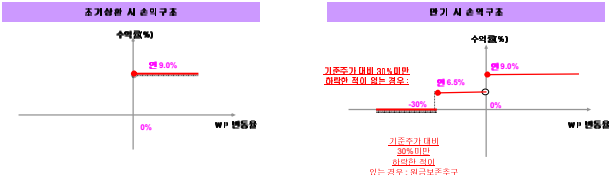
4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 종도상환기간을 설정하고, 기초자산(LG보통주, SK HOLDINGS보통주)의 종도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 종도상환함.

단, 평가시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정후판도해지

- 두 기초자산의 가격이 판도기준가격의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만 하락한 적이 있는 경우

6) 판도의 수익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	25.06	23.18	21.29	19.41	17.53	15.65	13.77	
손익	5.33%	19.04	17.15	15.27	13.39	11.51	9.63	
시나리오	2.67%	12.56	10.68	8.80	6.92	5.04	3.16	
	0%	5.64	3.76	1.88	0.00	-1.88	-3.76	
	-2.67%	-1.72	-3.61	-5.49	-7.37	-9.25	-11.13	
	-5.33%	-9.54	-11.42	-13.30	-15.19	-17.07	-18.95	
	-8%	-17.81	-19.69	-21.57	-23.45	-25.33	-27.22	

최대손실 시나리오

위험액	13.77
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	30.14
-----	-------

[28] 매리츠월중지수연계사모파생1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 만기: 2010년 08월 04일

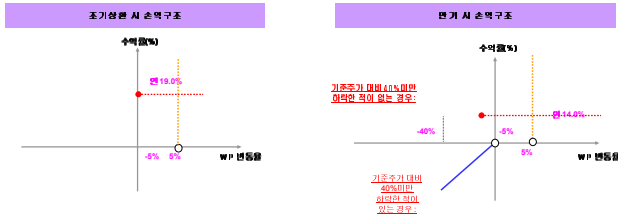
3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI지수)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, 만기시까지 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 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 * (만기 기준지수/초기 기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	133.71	125.17	116.64	108.11	99.57	91.04	82.51
	5.33%	98.14	89.61	81.07	72.54	64.01	55.47	46.94
	2.67%	62.10	53.57	45.04	36.50	27.97	19.44	10.90
	0%	25.60	17.07	8.53	0.00	-8.53	-17.07	-25.60
	-2.67%	-11.37	-19.91	-28.44	-36.97	-45.51	-54.04	-62.57
	-5.33%	-48.81	-57.35	-65.88	-74.41	-82.95	-91.48	-100.01
	-8%	-86.73	-95.26	-103.79	-112.33	-120.86	-129.39	-137.93

최대 손실 시나리오

위험액	-137.93
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	142.20
-----	--------

[24] 테리츠 주가지수연계사모펀드상품 제 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

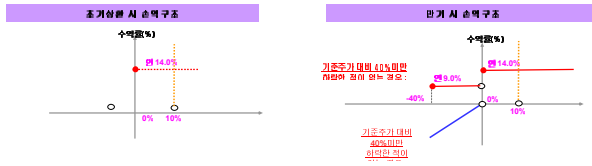
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

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%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 * (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%	91.05	498.25	478.45	458.64	438.84	419.04	399.23
	5.33%	384.50	364.69	344.89	325.09	305.28	285.48	265.68
	2.67%	231.61	211.81	192.01	172.20	152.40	132.60	112.79
	0%	99.41	39.61	19.80	0.00	-19.80	-39.61	-59.41
	-2.67%	-132.12	-151.92	-171.72	-191.53	-211.33	-231.13	-250.94
-5.33%	-342.97	-362.77	-382.57	-402.38	-422.18	-441.98	-461.79	
-8%	-573.14	-592.94	-612.75	-632.55	-652.35	-672.16	-691.96	

최대 손실 시나리오

위험액	-691.96
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	660.29
-----	--------

[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

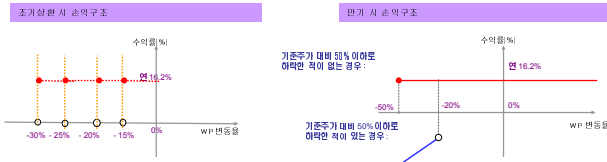
2) 만기: 2010년 09월 30일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도 상환 기 간을 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) 연달 16.2%의 수익률로 중도 상환이 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%	-0.25	-0.28	-0.31	-0.34	-0.37	-0.41	-0.44
	5.33%	-0.05	-0.06	-0.11	-0.14	-0.17	-0.20	-0.24
	2.67%	0.07	0.04	0.01	-0.03	-0.06	-0.09	-0.12
	0%	0.10	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.10
	-2.67%	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09	-0.12	-0.16
	-8.33%	-0.12	-0.15	-0.18	-0.21	-0.24	-0.27	-0.31
	-8%	-0.35	-0.38	-0.42	-0.45	-0.48	-0.51	-0.54

최대 손실 시나리오

위험액	-0.64
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.74
-----	------

[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

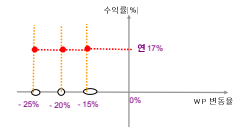
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	승모자산(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,096	0	1,096	상위

단위(백만원)

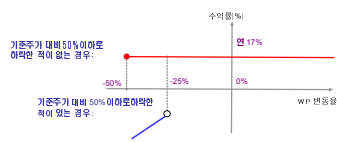
2. 만기시점의 손익구조

- 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 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)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) 만 17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 151.0%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR657234591 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	-2.84	-3.63	-4.42	-5.21	-5.99	-6.78	-7.57
	5.33%	1.60	0.81	0.03	-0.76	-1.55	-2.34	-3.12
	2.67%	3.34	2.55	1.76	0.97	0.19	-0.60	-1.39
	0%	2.36	1.58	0.79	0.00	-0.79	-1.58	-2.36
	-2.67%	-1.32	-2.11	-2.90	-3.68	-4.47	-5.26	-6.05
	-5.33%	-7.71	-8.50	-9.29	-10.08	-10.87	-11.65	-12.44
	-8%	-16.82	-17.61	-18.39	-19.18	-19.97	-20.76	-21.55

최대 손실 시나리오

위험액	-21.55
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	12.88
-----	-------

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 09월 20일

3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

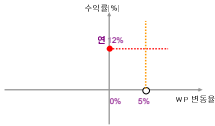
: 원금 * 124%

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

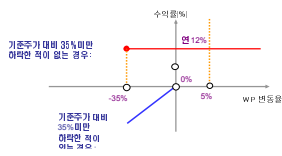
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조인 톱(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 파생 13

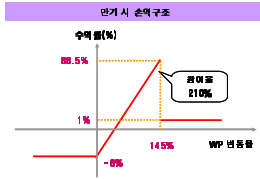
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 손익 구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 만기 전 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가일 수가 최초 기준가격 이상이고 최초 기준가격의 145% 미만일 경우
: 원금 * (94% + 210% * (만기 기준지수 / 최초 기준지수 - 1))
 - 만기 평가일 수가 최초 기준가격 미만일 경우
: 원금 * 94%
- 6) 펀드의 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-77.98	-85.60	-93.22	-100.84	-108.46	-116.08	-123.70
시나리오	5.33%	-41.47	-49.09	-56.71	-64.33	-71.95	-79.57	-87.19
	2.67%	-7.86	-15.48	-23.10	-30.72	-38.34	-45.96	-53.58
	0%	22.86	15.24	7.62	0.00	-7.62	-15.24	-22.86
	-2.67%	50.66	43.06	35.44	27.82	20.20	12.58	4.96
	-5.33%	75.60	67.98	60.36	52.74	45.12	37.50	29.88
	-8%	97.63	90.01	82.39	74.77	67.15	59.53	51.91

최대 손실 시나리오

위험액	51.91
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	114.32
-----	--------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

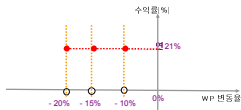
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위:백만원

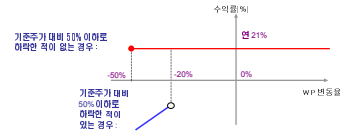
2. 연기사점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



연기 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%	6.22	5.17	4.11	3.06	2.00	0.95	-0.11
초	5.33%	5.60	4.74	3.69	2.63	1.58	0.52	-0.53
자	2.67%	4.78	3.73	2.67	1.61	0.56	-0.50	-1.55
산	0%	3.17	2.11	1.06	0.00	-1.06	-2.11	-3.17
시	-2.67%	0.95	-0.10	-1.16	-2.21	-3.27	-4.32	-5.38
나	-5.33%	-1.83	-2.91	-3.96	-5.00	-6.07	-7.13	-8.18
리	-8%	-5.26	-6.31	-7.37	-8.42	-9.48	-10.53	-11.59

최대 손실 시나리오

위험액	-11.59
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.32
-----	------

[80-1] 메리츠주가지수연계시드증권2호
KR600594DVL1 메리츠주가지수연계시드증권2호
주리투자증권(ELS)2136

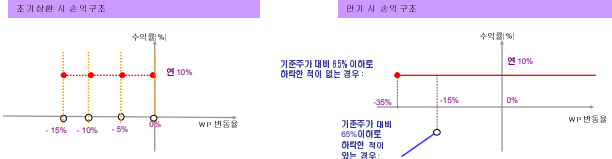
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기사실의 손익구조

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



3. 손익구조변동/최대손실가능금액(단위:백만원)

메리츠주가지수연계시드증권2호

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 최대 손실 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)

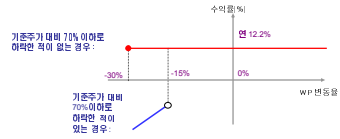
2. 연기시점의 손익구조

- 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%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (반기기존지수/최초기존지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



반기 시 손익구조



[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교
 KR600690M/M7 당주증권ELS2697

1. 계약금액

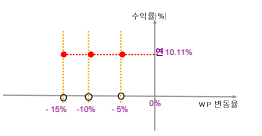
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

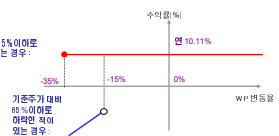
2. 연가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 14일
- 3) 펀드형산 결정주기: 매4개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 만월10.11%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 110.11%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)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] 매리츠주가지수연계사로증권2.-4
 KR6008678V51 롯데당 신안증권(ELS)890

1. 계약금액

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

단위(백만원)

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

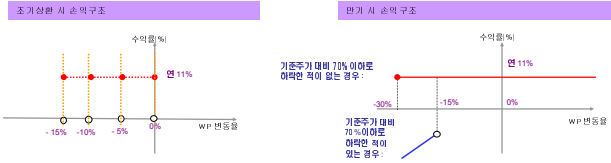
- 두 기준지수의 가격이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 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

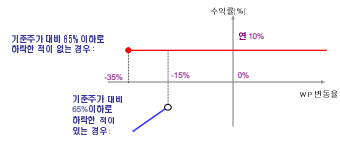
4) 기 존지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가

- 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 * (반기기존지수/최초기존지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



반기 시 수익구조



[80-6] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR600867AV62 메리츠신한증권(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

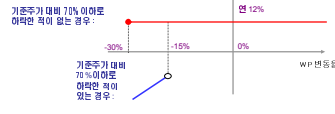
4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

- 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 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

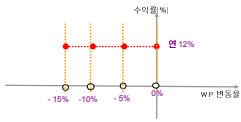
1. 계약금액

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 준지 수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 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 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

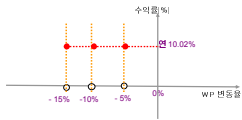
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위: (백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 종의파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 18일
- 3) 권드청산 결정 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 초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 만을 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기 초자산의 가격 이 한반드 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 110.02%
 - 두 기 초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 준지수 /최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

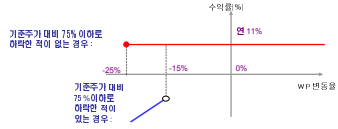
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 증권파생상품의 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 환반드 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 111%
 - 두 기초자산의 가격(장종포함)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] **메리츠투자자산수익계사로증권2호**

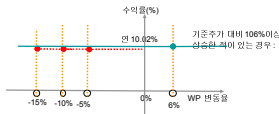
1. 계약금액

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

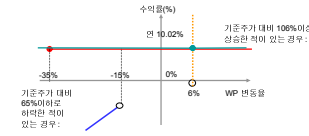
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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

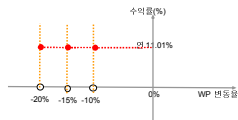
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	924.4	0	924	차입

단위:백만원

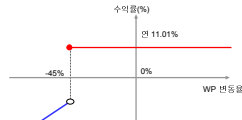
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 증권파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 2) 만기: 2012년 4월 12일
- 3) 편드형산결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차지수의 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 권드 해지
 - 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 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조인용(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR66923071445 NAF투자증권(ELS)32

손익구조변동 시나리오

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

최대손실 시나리오

위험액	-0.01
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[62] 데리츠2SI(사모증권투자STWF-1)

1. 계약금액

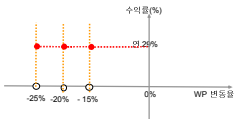
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위: (백만원)

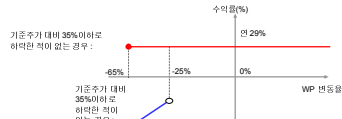
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융저주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 2.9%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 12.9%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조인용(최대손실가능금액(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%	1.99	1.77	1.54	1.32	1.10	0.88	0.66
	5.33%	1.26	1.04	0.82	0.59	0.37	0.15	-0.07
	2.67%	0.82	0.60	0.38	0.15	-0.07	-0.29	-0.51
	0%	0.67	0.44	0.22	0.00	-0.22	-0.44	-0.66
	-2.67%	0.80	0.58	0.36	0.13	-0.09	-0.31	-0.53
	-5.33%	1.22	1.00	0.78	0.55	0.33	0.11	-0.11
	-8%	1.93	1.71	1.48	1.26	1.04	0.82	0.60

최대손실 시나리오

위험액	0.60
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.10
-----	------

[68] 데리츠2Star사로증권LEHC-1호

1. 계약금액

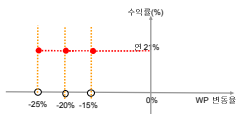
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2045.8	0	2,046	잔위

단위(백만원)

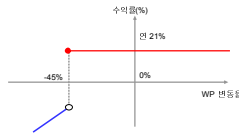
2. 만기시점의 손익구조

- 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%이상인 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



만기시 손익구조



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%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
손익	5.33%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
시나리오	2.67%	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	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%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	0.00
-----	------

[67] 데리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

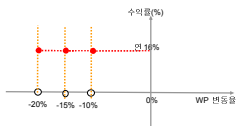
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	837.0	0	837	잔위

단위: (백만원)

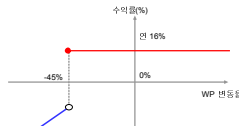
2. 만기시점의 손익구조

- 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 효력을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 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 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%	1.81	1.27	0.73	0.19	-0.35	-0.89	-1.44
산	5.33%	2.43	1.89	1.35	0.81	0.27	-0.27	-0.81
시나리오	2.67%	2.37	1.83	1.29	0.75	0.21	-0.53	-0.87
	0%	1.62	1.08	0.54	0.00	-0.54	-1.08	-1.62
	-2.67%	0.19	-0.35	-0.89	-1.43	-1.97	-2.52	-3.06
	-5.33%	-1.93	-2.47	-3.01	-3.55	-4.09	-4.64	-5.18
	-8%	-4.74	-5.28	-5.82	-6.36	-6.90	-7.44	-7.98

최대 손실 시나리오

위험액	-7.98
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	7.36
-----	------

[65] 데리츠2Star사모증권POKB-2호

1. 계약금액

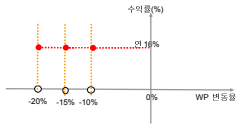
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50	잔위

단위(백만원)

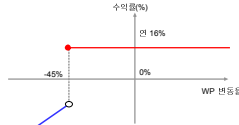
2. 만기시점의 손익구조

- 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 효력을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가액 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가액(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 가능금액 (다위:백만원))
KR6562340W48 유인투기증권(ELS)2405

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.11	0.08	0.04	0.01	-0.02	-0.05	-0.09
	5.33%	0.15	0.11	0.06	0.05	0.02	-0.02	-0.05
	2.67%	0.14	0.11	0.06	0.04	0.01	-0.02	-0.05
	0%	0.10	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.10
	-2.67%	0.01	-0.02	-0.05	-0.09	-0.12	-0.15	-0.18
	-5.33%	-0.12	-0.15	-0.18	-0.21	-0.24	-0.28	-0.31
	-8%	-0.28	-0.32	-0.35	-0.38	-0.41	-0.44	-0.48

최대 손실 시나리오

위험액	-0.48
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	0.44
-----	------

[67] 데리츠2Star사로 증권SE ST-1

1. 계약금액

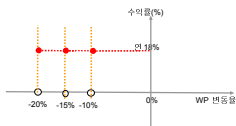
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

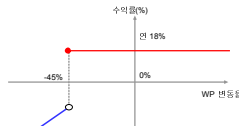
2. 만기시점의 손익구조

- 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 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 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(단위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-3.55	-5.91	-8.27	-10.63	-13.00	-15.36	-17.72
산	5.33%	2.42	0.06	-2.30	-4.66	-7.02	-9.39	-11.75
시나리오	2.67%	5.97	3.61	1.25	-1.12	-3.48	-5.84	-8.20
	0%	7.09	4.72	2.36	0.00	-2.36	-4.72	-7.09
	-2.67%	6.77	3.41	1.05	-1.31	-3.67	-6.04	-8.40
	-5.33%	2.04	-0.33	-2.69	-5.05	-7.41	-9.77	-12.14
	-8%	-4.13	-6.49	-8.86	-11.22	-13.58	-15.94	-18.30

최대 손실 시나리오

위험액	-18.30
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	18.20
-----	-------

[68] 데리츠2Star사로 증권SE ST-4호

1. 계약금액

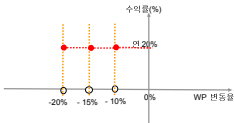
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	500.0	0	500	잔위

단위(백만원)

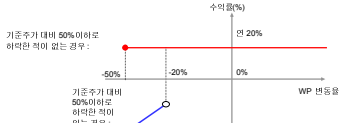
2. 평가시점의 손익구조

- 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%이상인 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%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 120%
- 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%미만으로 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: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%	0.13	-0.54	-1.22	-1.89	-2.57	-3.24	-3.92
	5.33%	1.49	0.81	0.13	-0.54	-1.22	-1.89	-2.57
시나리오	2.67%	2.12	1.44	0.77	0.09	-0.59	-1.26	-1.94
	0%	2.03	1.35	0.68	0.00	-0.68	-1.35	-2.03
	-2.67%	1.22	0.54	-0.13	-0.81	-1.49	-2.16	-2.84
	-5.33%	-0.31	-0.99	-1.67	-2.34	-3.02	-3.69	-4.37
	-8%	-2.57	-3.24	-3.92	-4.59	-5.27	-5.94	-6.62

최대 손실 시나리오

위험액	-6.62
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	9.42
-----	------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

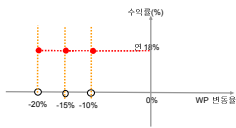
1. 계약금액

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

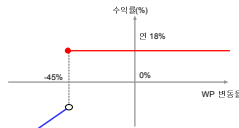
2. 평가시점의 손익구조

- 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, 만기시까지 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%	
기초자산	8%	-1.95	-3.25	-4.55	-5.85	-7.15	-8.45	-9.75
손익	5.33%	1.33	0.03	-1.26	-2.56	-3.86	-5.16	-6.46
시나리오	2.67%	3.28	1.98	0.69	-0.61	-1.91	-3.21	-4.51
	0%	3.90	2.60	1.30	0.00	-1.30	-2.60	-3.90
	-2.67%	3.18	1.88	0.58	-0.72	-2.02	-3.32	-4.62
	-5.33%	1.12	-0.18	-1.48	-2.78	-4.08	-5.38	-6.68
	-8%	-2.27	-3.57	-4.87	-6.17	-7.47	-8.77	-10.07

최대 손실 시나리오

위험액	-10.07
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	8.36
-----	------

[77] 데리츠2SIa사모SEST-3

1. 계약금액

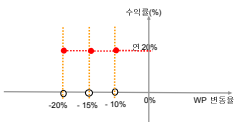
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241.4	0	241	차입

단위(백만원)

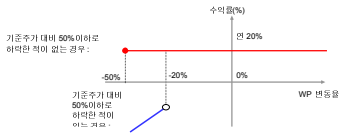
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 평가: 2012년 3월 29일
- 3) 펀드청산 예정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이 상인 경우(세번째, 네 번째 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%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (평가기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



평가 시 손익구조



3. 손익 구조변동 동(최대 손실 가능 금액 (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%	-1.04	-1.68	-2.31	-2.95	-3.59	-4.22	-4.86
	5.33%	0.67	0.03	-0.60	-1.24	-1.88	-2.51	-3.15
산	2.67%	1.65	1.01	0.38	-0.26	-0.89	-1.53	-2.16
	0%	1.91	1.27	0.64	0.00	-0.64	-1.27	-1.91
시나리오	-2.67%	1.44	0.80	0.17	-0.47	-1.10	-1.74	-2.38
	-5.33%	0.24	-0.39	-1.03	-1.67	-2.30	-2.94	-3.57
	-8%	-1.68	-2.32	-2.95	-3.59	-4.22	-4.86	-5.49

최대 손실 시나리오

위험액	-5.49
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	3.37
-----	------

[78] 데리츠2SIar사로STWF-2

1. 계약금액

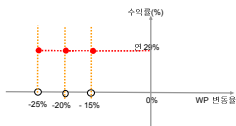
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	잔위

단위(백만원)

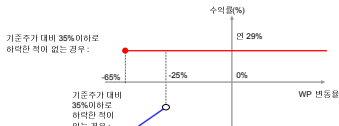
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융저주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, 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) 연율 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환펀드 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 129%
- 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액(단위:백만원))
KR6622313W42 : 코보증권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.73	1.54	1.34	1.15	0.96	0.76	0.57
손익	5.33%	1.10	0.90	0.71	0.52	0.32	0.13	-0.06
시나리오	2.67%	0.71	0.52	0.33	0.13	-0.06	-0.25	-0.45
	0%	0.56	0.38	0.19	0.00	-0.19	-0.39	-0.58
	-2.67%	0.70	0.50	0.31	0.12	-0.08	-0.27	-0.46
	-5.33%	1.06	0.87	0.68	0.48	0.29	0.10	-0.10
	-8%	1.68	1.49	1.29	1.10	0.91	0.71	0.52

최대 손실 시나리오

위험액	0.52
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	6.18
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

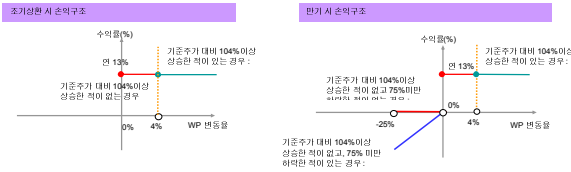
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(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 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 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, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 113%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 수익구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

수익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9,390.01	8,839.71	8,289.42	7,739.12	7,188.83	6,638.53	6,088.23
	5.33%	6,806.21	6,255.91	5,705.61	5,155.32	4,605.02	4,054.73	3,504.43
	2.67%	4,222.50	3,672.20	3,121.91	2,571.61	2,021.32	1,471.02	920.72
	0%	1,638.80	1,088.50	538.20	0.00	-511.90	-1,062.20	-1,612.50
	-2.67%	-924.90	-1,475.20	-2,025.50	-2,575.80	-3,126.10	-3,676.40	-4,226.70
	-5.33%	-3,488.05	-4,038.34	-4,588.64	-5,138.93	-5,689.23	-6,239.52	-6,789.82
	-8%	-6,051.37	-6,601.66	-7,151.96	-7,702.25	-8,252.55	-8,802.85	-9,353.14

최대손실 시나리오

위험액	-9,353.14
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,425.07
-----	----------

[79-2] **메리츠투자자산수익계사표8호**

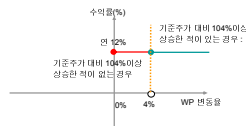
1. **계약금액**

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

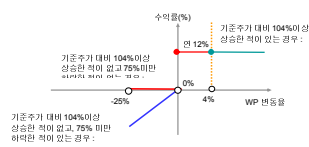
2. **반기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 반기: 2010년 11월 8일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
 - 4) 기준지수: 2007년 11월 8일 KOSPI200지수의 증가
 - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일절에 최초기준가격 이상이거나 또는 말기기간 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 * (반기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6030613TB2 **교보증권(ELS)82**

[79-3] **메리츠투자기수연계사모8호**

1. 계약금액

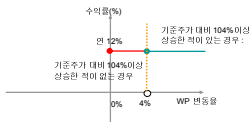
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔액

단위: 백만원

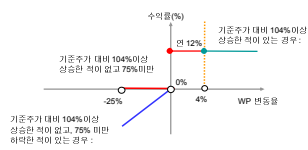
2. 평가시점의 손익구조

- 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 (장중 포함) 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

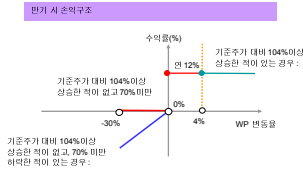
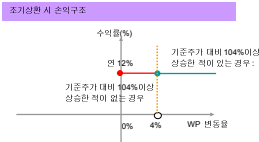
[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 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



KR6008679TA3 곳님신한증권(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

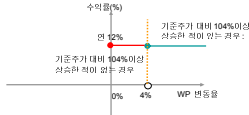
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 10일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

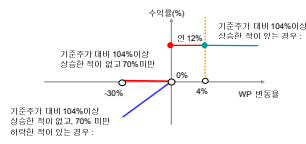
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008676TB7 곳모닝 신환증권(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	상위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

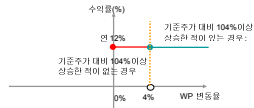
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

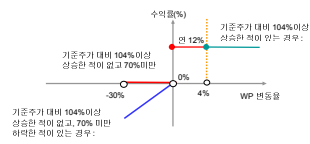
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600867CTB8 코트남 신원증권(ELS)804

[79-7] 에리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

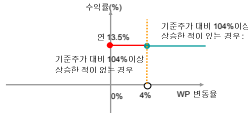
2. 만기시점의 손익구조

- 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

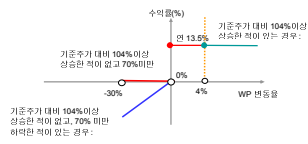
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 일반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우
 : 원금 * 113.5%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 준지수/최 초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008675TC7 코트나눔 신원증권(ELS)809

[79-8] 에리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

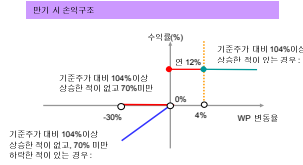
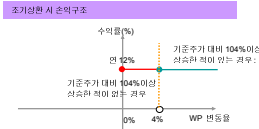
2. 만기시점의 손익구조

- 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 한번이라도 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 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기 준지수/최초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 에리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

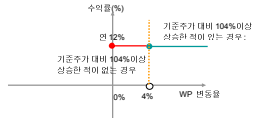
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	상위

단위(백만원)

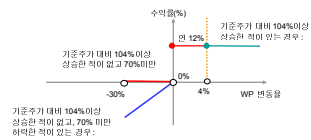
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(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 가격이 한번도 기준가격의 65%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기 준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 메리츠투자지수연계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

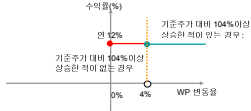
- 1) 평가대상종목의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지수 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 12%의 수익률로 중도상환

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

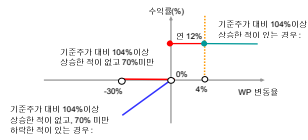
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

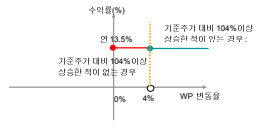
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	장외

단위(백만원)

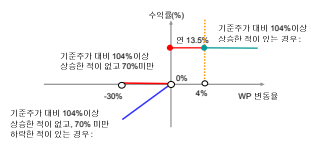
2. 만기시점의 손익구조

- 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 가격 이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 113.5%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)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



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		상환

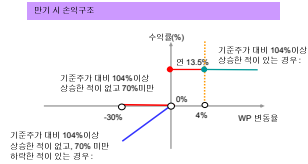
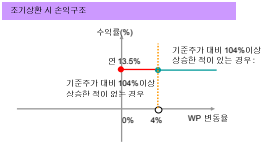
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기 준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 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 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.3.5%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기 준지수/최초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 데리 초주가지 수연계 사모증권5호

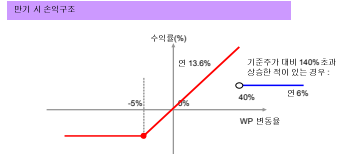
1. 계약금액

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 결정 주기: 만기 전 가일 1회
- 4) 기 존지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기 존지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가지 수가 최초기 존가격 이상이고 최초기 존가격의 140% 미만일 경우
: 원금 * (95% + 100% * (만기기 존지수 / 최초기 존지수 - 1))
 - 만기 평가지 수가 최초기 존가격 미만일 경우
: 원금 * 95%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6523317W30 대우증권ELS2881

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-5.96	-6.49	-6.99	-7.50	-8.00	-8.51	-9.01
산	5.33%	-3.37	-3.88	-4.38	-4.89	-5.39	-5.90	-6.40
시	2.67%	-0.88	-1.38	-1.89	-2.39	-2.90	-3.40	-3.91
나	0%	1.61	1.01	0.50	0.00	-0.50	-1.01	-1.51
리	-2.67%	3.80	3.29	2.79	2.28	1.78	1.27	0.77
오	-5.33%	5.97	5.47	4.96	4.46	3.95	3.45	2.94
	-8%	8.04	7.53	7.03	6.52	6.02	5.51	5.01

최대 손실 시나리오

위험액	5.01
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.83
-----	------

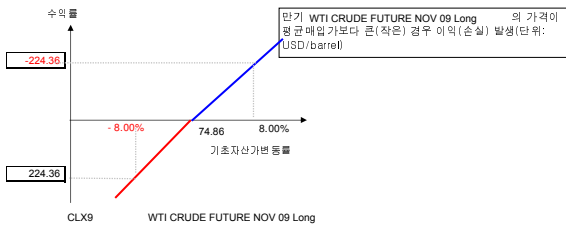
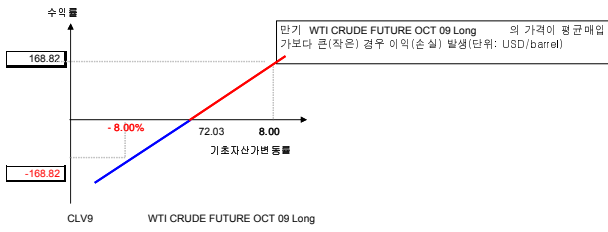
[80] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

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. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

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

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	393.18
	5.33%	261.96
	2.67%	131.22
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-131.22
	-5.33%	-261.96
	-8%	-393.18

최대손실 시나리오	
위험액	-393.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,592
-----	-------

[79] 데리츠주가지 수연계사모증권! 6!E

1. 계약금액

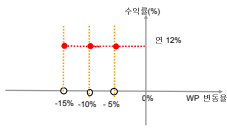
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	차입

단위: 백만원

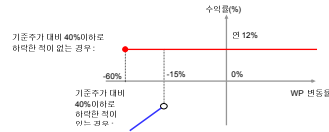
2. 연가시점의 손익구조

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-2.36	-2.39	-2.40	-2.41	-2.42	-2.43	-2.44
산 시 나 리 오	5.33%	-1.02	-1.04	-1.05	-1.06	-1.07	-1.08	-1.09
	2.67%	-0.22	-0.23	-0.24	-0.25	-0.26	-0.27	-0.28
	0%	0.03	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.02	-0.03
	-2.67%	-0.27	-0.28	-0.29	-0.30	-0.31	-0.32	-0.33
	-5.33%	-1.12	-1.13	-1.14	-1.15	-1.16	-1.17	-1.18
	-8%	-2.53	-2.54	-2.55	-2.56	-2.57	-2.58	-2.59

최대 손실 시나리오

위험액	-2.59
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.86
-----	------

[80] 대리주가지수연계사모증권10호

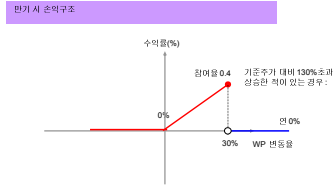
1. 계약금액

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(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최하 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가시 수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 130% 미만일 경우
 - : 원금 * (100%+40%) + 만기기준지수/최초기준지수 - 1)
 - 만기 평가시 수가 최초기준가격 미만일 경우
 - : 원금 * 100%
 - 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최하 기준가격의 130%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우
 - : 원금 * 100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능 금액) (단위:백만원)

KR6673105W54 동부증권-희미플러스(ELS)B1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지수	8%	-6.52	-8.83	-11.14	-13.45	-15.76	-18.07	-20.38
손익	5.33%	-1.54	-3.85	-6.16	-8.47	-10.78	-13.09	-15.40
시나리오	2.67%	2.94	0.63	-1.68	-3.99	-6.30	-8.60	-10.91
최대 손실	0%	6.93	4.62	2.31	0.00	-2.31	-4.62	-6.93
최소 손실	-2.67%	10.42	8.11	5.80	3.49	1.18	-1.13	-3.44
최대 손실	-5.33%	13.41	11.10	8.79	6.48	4.17	1.87	-0.44
최소 손실	-8%	15.91	13.60	11.29	8.98	6.67	4.36	2.05

최대 손실 시나리오

위험액	2.05
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	19.39
-----	-------

[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호

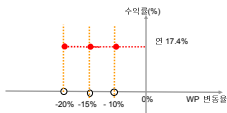
1. 계약금액

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

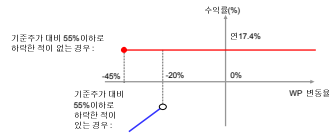
2. 만기시점의 손익구조

- 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 수익률을 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.65	1.39	0.93	0.47	0.01	-0.44	-0.90
	5.33%	2.44	1.99	1.53	1.07	0.61	0.15	-0.31
	2.67%	2.29	1.83	1.37	0.91	0.45	-0.01	-0.46
손익	0%	1.38	0.92	0.46	0.00	-0.46	-0.92	-1.38
시나리오	-2.67%	-0.29	-0.75	-1.21	-1.66	-2.12	-2.58	-3.04
	-5.33%	-2.71	-3.17	-3.62	-4.08	-4.54	-5.00	-5.46
	-8%	-5.88	-6.34	-6.80	-7.25	-7.71	-8.17	-8.63

최대 손실 시나리오

위험액	-8.63
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	8.62
-----	------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

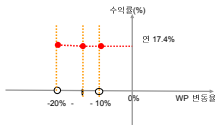
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

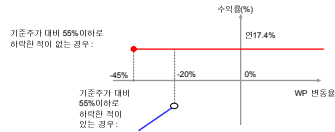
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액)(단위:백만원)

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	11.88	6.93	5.99	3.04	0.09	-2.85	-5.80
손익	5.33%	15.71	12.76	9.81	6.87	3.92	0.97	-1.97
시나리오	2.67%	14.69	11.75	8.80	5.85	2.91	-0.04	-2.98
	0%	8.84	5.89	2.95	0.00	-3.85	-5.89	-8.84
	-2.67%	-1.86	-4.80	-7.75	-10.70	-13.64	-16.59	-19.54
	-5.33%	-17.39	-20.34	-23.29	-26.23	-29.18	-32.13	-35.07
	-8%	-37.77	-40.72	-43.67	-46.61	-49.56	-52.51	-55.45

최대 손실 시나리오

위험액	-55.45
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	55.41
-----	-------

[84] 테라츠2SI(사모증권)SEPO-2호

1. 계약금액

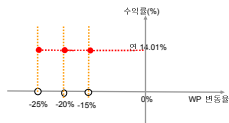
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: (백만원)

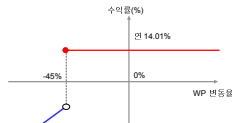
2. 만기시점의 손익구조

- 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 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 114.01%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	8%	-0.44	-0.45	-0.47	-0.49	-0.50	-0.52	-0.53
	5.33%	-0.14	-0.15	-0.17	-0.18	-0.20	-0.21	-0.23
시나리오	2.67%	0.03	0.01	-0.01	-0.02	-0.04	-0.05	-0.07
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.03	-0.05
시나리오	-2.67%	-0.07	-0.09	-0.10	-0.12	-0.13	-0.15	-0.17
	-5.33%	-0.33	-0.35	-0.36	-0.38	-0.40	-0.41	-0.43
	-8%	-0.73	-0.75	-0.76	-0.78	-0.80	-0.81	-0.83

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	1.00
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

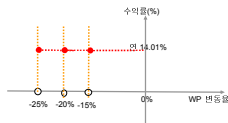
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위: (백만원)

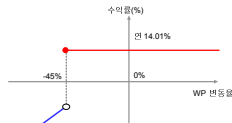
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2011년 5월 31일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 6월 1일 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 14.01%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 114.01%
- 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/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%	-1.59	-1.64	-1.70	-1.76	-1.81	-1.87	-1.92
	5.33%	-0.49	-0.55	-0.61	-0.66	-0.72	-0.77	-0.83
	2.67%	0.09	0.04	-0.02	-0.08	-0.13	-0.19	-0.24
시나리오	0%	0.17	0.11	0.06	0.00	-0.06	-0.11	-0.17
	-2.67%	-0.26	-0.32	-0.38	-0.44	-0.49	-0.54	-0.60
	-5.33%	-1.20	-1.26	-1.31	-1.37	-1.43	-1.48	-1.54
	-8%	-2.65	-2.71	-2.76	-2.82	-2.87	-2.93	-2.99

최대 손실 시나리오

위험액	-2.99
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	3.61
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-I호

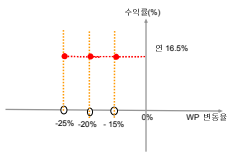
1. 계약금액

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

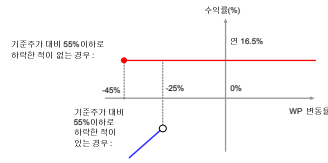
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6662321W56 환위스프레드(ELS)127

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

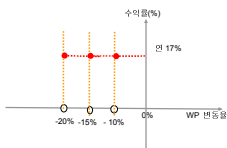
3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

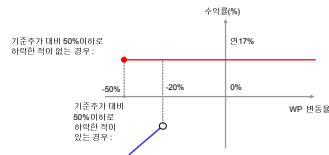
5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6562319W52 증권투자증권 (ELS)2415

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.87	0.57	0.27	-0.03	-0.33	-0.64	-0.94
	5.33%	1.29	0.99	0.69	0.39	0.09	-0.21	-0.51
시나리오	2.67%	1.30	1.00	0.70	0.40	0.10	-0.20	-0.50
	0%	0.90	0.60	0.30	0.00	-0.30	-0.60	-0.90
	-2.67%	0.09	-0.21	-0.51	-0.81	-1.11	-1.41	-1.71
	-5.33%	-1.14	-1.44	-1.74	-2.04	-2.34	-2.64	-2.94
	-8%	-2.78	-3.08	-3.38	-3.68	-3.98	-4.28	-4.58

최대 손실 시나리오

위험액	-4.58
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.23
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

1. 계약금액

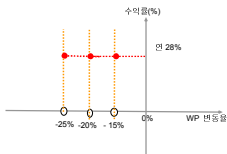
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	462.0	0	462.0	잔위

단위: (백만원)

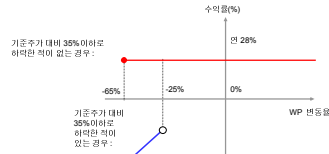
2. 만기시점의 손익구조

- 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 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산의 종가로 각각 최초 기준가격의 85% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상한 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 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 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능 금액) (단위: 백만원)
KR6622309W55 표본증권(ELS)344

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	48.66	37.58	26.51	15.44	4.37	-6.71	-17.78
손실리	5.33%	44.12	33.04	21.97	10.90	-0.17	-11.25	-22.32
오	2.67%	38.97	27.90	16.82	5.75	-5.32	-16.39	-27.47
	0%	33.22	22.18	11.07	0.00	-11.07	-22.15	-33.22
	-2.67%	26.86	15.79	4.72	-5.36	-17.43	-28.50	-39.57
	-5.33%	19.90	8.63	-2.25	-13.32	-24.39	-35.46	-46.54
	-8%	12.33	1.28	-9.81	-20.88	-31.96	-43.03	-54.10

최대 손실 시나리오

위험액	-54.10
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	51.19
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로 증권POLE-2호

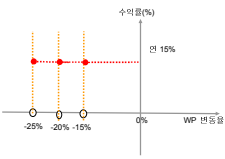
1. 계약금액

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

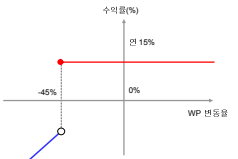
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.17	0.13	0.09	0.05	0.01	-0.03	-0.07
	5.33%	0.19	0.15	0.11	0.07	0.02	-0.02	-0.06
시나리오	2.67%	0.17	0.13	0.09	0.05	0.01	-0.03	-0.07
	0%	0.12	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12
	-2.67%	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12	-0.16	-0.20
	-5.33%	-0.07	-0.11	-0.15	-0.19	-0.24	-0.28	-0.32
	-8%	-0.22	-0.26	-0.30	-0.34	-0.38	-0.42	-0.46

최대 손실 시나리오

위험액	-0.46
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.45
-----	------

[90] 테라츠2Star사로증권POLE-이 호

1. 계약금액

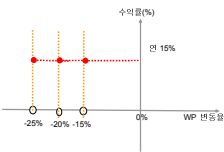
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	차입

단위:백만원

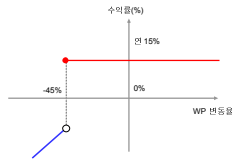
2. 평가시점의 손익구조

- 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 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 기준가액의 55%이상인 경우
: 원금 * 11.5%
- 두 기초자산의 가액 중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)
KR6662311W58 원위스마트(ELS)117

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	13.16	10.05	6.93	3.82	0.70	-2.42	-5.53
산	5.33%	14.34	11.23	8.11	5.00	1.88	-1.24	-4.35
시나리오	2.67%	13.07	9.96	6.84	3.72	0.61	-2.51	-5.62
	0%	9.35	6.23	3.12	0.00	-3.12	-6.23	-9.35
	-2.67%	3.17	0.05	-3.06	-6.18	-9.29	-12.41	-15.52
	-5.33%	-5.46	-8.57	-11.69	-14.81	-17.92	-21.04	-24.15
	-8%	-16.54	-19.66	-22.77	-25.89	-29.00	-32.12	-35.23

최대 손실 시나리오	
위험액	-35.23

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	33.92
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

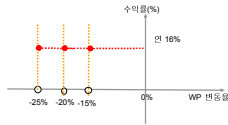
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	차입

단위:백만원

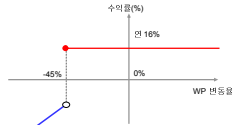
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.23	0.18	0.12	0.07	0.02	-0.04	-0.09
손익	5.33%	0.24	0.19	0.14	0.08	0.03	-0.03	-0.08
시나리오	2.67%	0.22	0.17	0.11	0.06	0.00	-0.05	-0.10
	0%	0.16	0.11	0.05	0.00	-0.05	-0.11	-0.16
	-2.67%	0.07	0.01	-0.04	-0.09	-0.15	-0.20	-0.25
	-5.33%	-0.06	-0.11	-0.17	-0.22	-0.27	-0.33	-0.38
	-8%	-0.22	-0.28	-0.33	-0.38	-0.44	-0.49	-0.55

최대 손실 시나리오

위험액	-0.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.39
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호[EL]

1. 계약금액

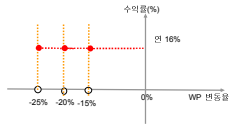
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	차입

단위:백만원

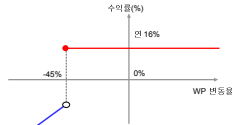
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 10%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 평균 * 118%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.14	3.17	2.21	1.25	0.28	-0.68	-1.64
	5.33%	4.34	3.38	2.42	1.46	0.49	-0.47	-1.43
시나리오	2.67%	3.93	2.97	2.00	1.04	0.08	-0.88	-1.85
	0%	2.89	1.93	0.96	0.00	-0.96	-1.85	-2.89
	-2.67%	1.22	0.26	-0.70	-1.67	-2.63	-3.59	-4.55
	-5.33%	-1.07	-2.03	-2.99	-3.95	-4.92	-5.88	-6.84
	-8%	-3.98	-4.94	-5.91	-6.87	-7.83	-8.79	-9.76

최대 손실 시나리오

위험액	-9.76
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7.02
-----	------

[93] 데리츠2Star사로증권LEHC-3

1. 계약금액

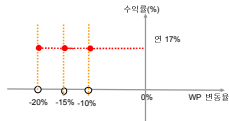
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	차입

단위(백만원)

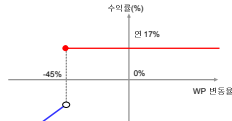
2. 만기시점의 손익구조

- 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 못한 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(장종료합)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 유가투자증권(ELS)2414

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.57	0.37	0.18	-0.01	-0.20	-0.39	-0.58
	5.33%	0.76	0.57	0.38	0.19	-0.00	-0.19	-0.38
시나리오	2.67%	0.76	0.57	0.38	0.19	-0.00	-0.19	-0.38
	0%	0.57	0.38	0.19	0.00	-0.19	-0.38	-0.57
	-2.67%	0.19	-0.00	-0.19	-0.38	-0.57	-0.77	-0.96
	-5.33%	-0.39	-0.58	-0.77	-0.96	-1.15	-1.34	-1.53
	-8%	-1.16	-1.35	-1.54	-1.73	-1.92	-2.11	-2.30

최대 손실 시나리오

위험액	-2.30
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.93
-----	------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

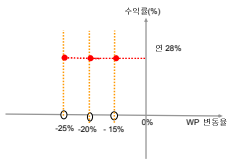
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	잔위

단위:백만원

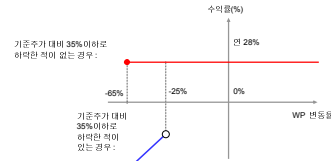
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기준으로 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 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 128%
- 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6622301W53 코브증권(ELS)336

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	38.84	30.42	22.00	13.58	5.16	-3.26	-11.68
손실	5.33%	35.53	27.11	18.69	10.27	1.85	-6.57	-14.99
시나리오	2.67%	31.01	22.59	14.17	5.75	-2.67	-11.10	-19.52
	0%	25.26	16.84	8.42	0.00	-8.42	-16.84	-25.26
	-2.67%	18.30	9.88	1.46	-5.96	-13.38	-23.80	-32.22
	-5.33%	10.12	1.70	-6.72	-15.15	-23.57	-31.99	-40.41
	-8%	0.72	-7.70	-16.12	-24.54	-32.97	-41.39	-49.81

최대 손실 시나리오

위험액	-49.81
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	49.97
-----	-------

[95] 데리츠1Star사모증권SE-1 호

1. 계약금액

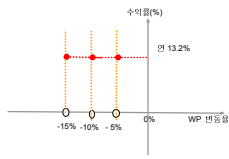
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위(백만원)

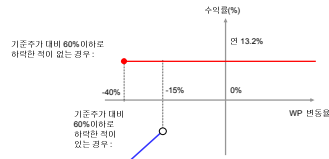
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 14일 삼성전자 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 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 조기 상환 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
-----	------

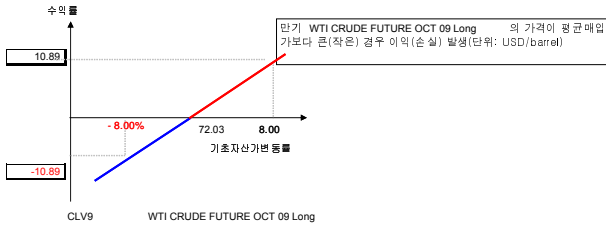
[96] 데리츠WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

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. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	
기초자산	8%	10.89
	5.33%	7.26
	2.67%	3.64
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.64
	-5.33%	-7.26
	-8%	-10.89

최대손실 시나리오	
위험액	-10.89

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	43
-----	----

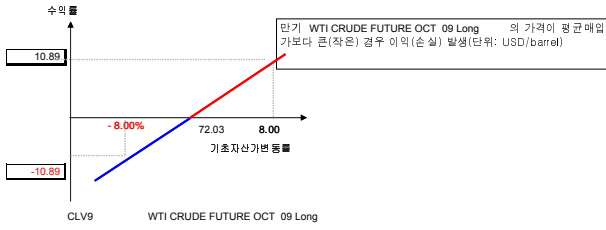
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



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

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	30.67
	5.33%	20.43
	2.67%	10.24
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-10.24
	-5.33%	-20.43
	-8%	-30.67

최대 손실 시나리오	
위험액	-30.67

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	124
-----	-----

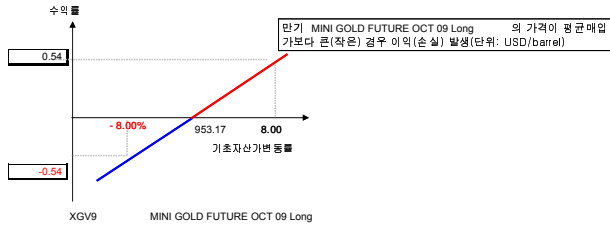
[96-2] 헤지 초 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



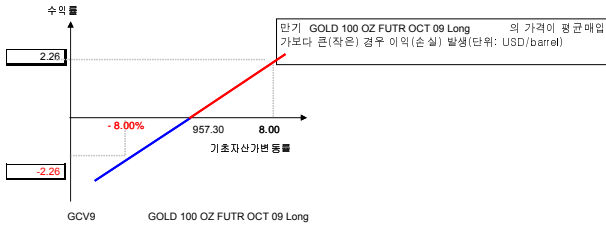
[96-3] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

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

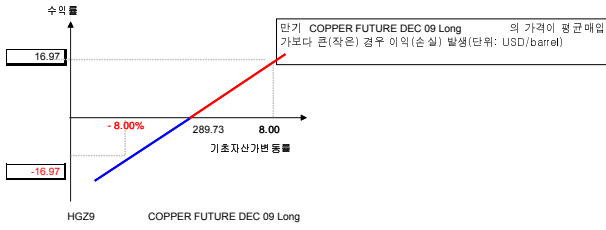


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

단위: (계약)						
구분	거래대상	거래유형	배수(1)	배도(2)	승포지선(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

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

