

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

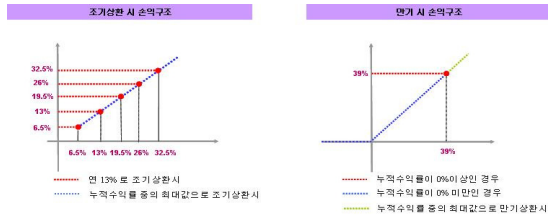
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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 누적수익률])

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%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
손익구조변동률	-8.33%	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
	-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
-----	------

[3] 테라즈 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.06
-----	-------

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 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 기초자산의 누적 수익률이 초기 상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(만기상환일) 이상인 경우 만 17.0%로 중도상환됨. (누적 수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모펀드 파생상품투자전략 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만기청산 결정주기: 매 6개월

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

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

단, 만기시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 만기 후 처리

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

: 할증 \* 140%

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

: 할증 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만기의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력작성증권(ELS)243

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	15.99	15.10	14.22	13.33	12.44	11.55	10.66
	5.33%	11.73	10.85	9.96	9.07	8.18	7.29	6.40
시나리오	2.67%	7.29	6.40	5.51	4.63	3.74	2.85	1.96
	0%	2.67	1.78	0.89	0.00	-0.89	-1.78	-2.67
손익	-2.67%	-2.14	-3.03	-3.92	-4.81	-5.70	-6.59	-7.48
	-5.33%	-7.14	-8.02	-8.91	-9.80	-10.69	-11.58	-12.47
	-8%	-12.31	-13.20	-14.09	-14.98	-15.87	-16.75	-17.64

최대 손실 시나리오

위험액 -17.64

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 18.06

[6]에리츠 StepDown 사모단위파생상품투자전략 25호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600345TTB8 최대 손실(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	13.75	13.14	12.53	11.92	11.31	10.70	10.09
	5.33%	9.78	9.17	8.56	7.95	7.34	6.72	6.11
시나리오	2.67%	5.81	5.20	4.59	3.97	3.36	2.75	2.14
	0%	1.83	1.22	0.61	0.00	-0.61	-1.22	-1.83
시나리오	-2.67%	-2.14	-2.75	-3.36	-3.97	-4.58	-5.20	-5.81
	-5.33%	-6.11	-6.72	-7.34	-7.95	-8.56	-9.17	-9.78
-8%	-10.09	-10.70	-11.31	-11.92	-12.53	-13.14	-13.75	

최대 손실 시나리오

위험액	-13.75
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.04
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)  
KR600348RT28 만드 증권(ELS): 2007-3974

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	403.10	386.05	369.00	351.95	334.90	317.85	300.80
	5.33%	284.85	267.80	250.75	233.70	216.65	199.60	182.55
	2.67%	167.53	150.48	133.43	116.38	99.33	82.28	65.23
	0%	51.18	34.13	17.08	0.00	-17.08	-34.13	-51.18
	-2.67%	-64.29	-81.34	-98.39	-115.44	-132.49	-149.54	-166.59
	-5.33%	-178.79	-195.85	-212.90	-229.95	-247.00	-264.05	-281.10
	-8%	-292.36	-309.41	-326.46	-343.51	-360.56	-377.61	-394.67

최대 손실 시나리오

위험액	-394.67
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	387.60
-----	--------

**[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 3개월마다 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.

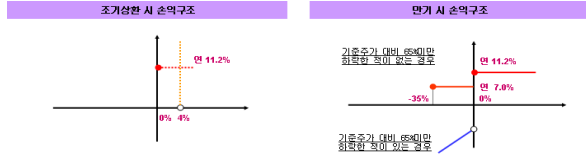
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 \* (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



**3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR60034SST27 환비드 유가(ELS) 2007-398회

**수익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	38.73	37.10	35.47	33.84	32.21	30.58	28.95
	5.33%	27.35	25.72	24.09	22.46	20.83	19.20	17.57
	2.67%	16.07	14.44	12.81	11.18	9.55	7.92	6.29
	0%	4.89	3.26	1.63	0.00	-1.63	-3.26	-4.89
	-2.67%	-6.19	-7.82	-9.45	-11.08	-12.71	-14.34	-15.97
	-5.33%	-17.17	-18.80	-20.43	-22.06	-23.69	-25.32	-26.95
	-8%	-28.05	-29.68	-31.31	-32.94	-34.57	-36.20	-37.84

**최대 손실 시나리오**

위험액	-37.84
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	37.50
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

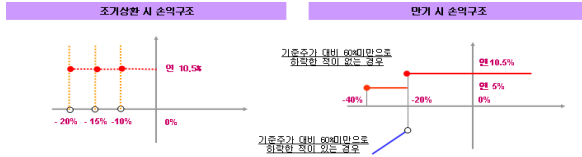
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조별 최대/최소 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR600172Y143 신명유위(ELS)552

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	370.81	347.23	323.65	300.07	276.49	252.92	229.34
손익	5.33%	298.23	274.65	251.06	227.50	203.92	180.34	156.76
손익	2.67%	196.21	174.63	151.05	127.47	103.90	80.32	56.74
손익	0%	70.73	47.15	23.56	0.00	-23.58	-47.16	-70.74
손익	-2.67%	-84.19	-107.77	-131.35	-154.92	-178.50	-202.08	-225.66
손익	-5.33%	-266.56	-290.14	-313.72	-337.30	-360.88	-384.45	-408.03
손익	-8%	-476.39	-499.97	-523.54	-547.12	-570.70	-594.28	-617.85

최대 손실 시나리오

위험액	-617.85
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	658.97
-----	--------



[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 6월 3일

3) 만기점산 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 설정일에 0%(1차 중도상환일), -4%(2차 중도상환일), -8%(3차 중도상환일), -12%(4차 중도상환일), -16%(5차 중도상환일), -20%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 16.0%로 중도상환됨.  
(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. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007=504

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.17	0.10	0.04	-0.03	-0.10	-0.16	-0.23
	5.33%	0.25	0.18	0.11	0.05	-0.02	-0.09	-0.15
	2.67%	0.26	0.19	0.12	0.06	-0.01	-0.08	-0.14
	0%	0.20	0.13	0.07	0.00	-0.07	-0.13	-0.20
	-2.67%	0.07	0.01	-0.06	-0.13	-0.19	-0.26	-0.33
	-5.33%	-0.12	-0.19	-0.25	-0.32	-0.39	-0.46	-0.52
	-8%	-0.38	-0.45	-0.52	-0.58	-0.65	-0.72	-0.79

최대 손실 시나리오

위험액	-0.79
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.27
-----	------

[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 8월 13일

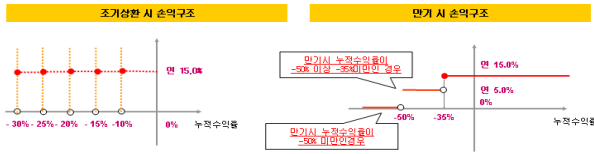
3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2007년 8월 13일의 국민은행 보통주, 한국전력 보통주의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(국민은행, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환됨.  
(누적 수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)

단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만도 하지  
만기 평가일의 누적 수익률이 -50% 이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환  
만기 평가일의 누적 수익률이 -50% 미만인 경우: 역면금액 지급 (원금보장주주)

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상금리(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.00	0.71	0.42	0.12	-0.17	-0.46	-0.75
시나리오	5.33%	1.03	0.74	0.45	0.16	-0.13	-0.42	-0.71
	2.67%	0.99	0.70	0.41	0.12	-0.17	-0.46	-0.75
	0%	0.87	0.58	0.29	0.00	-0.29	-0.58	-0.87
	-2.67%	0.67	0.38	0.09	-0.20	-0.49	-0.78	-1.07
	-5.33%	0.39	0.10	-0.19	-0.48	-0.77	-1.06	-1.35
	-8%	0.03	-0.26	-0.55	-0.84	-1.13	-1.42	-1.72

최대 손실 시나리오

위험액	-1.72
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.92
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위괴생상품 투자신탁 제10호

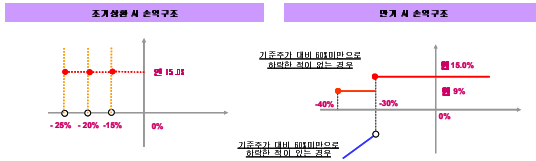
1. 계약금액

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(만기 상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 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. 손익구조의 최(최대)손실 가능금액 (단위:백만원)

KR603762L197 미래에셋증권(ELS)219

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	281.58	278.99	276.40	273.82	271.23	268.64	266.05
	5.33%	206.24	203.65	201.06	198.48	195.89	193.30	190.71
	2.67%	114.97	112.38	109.79	107.20	104.61	102.03	99.44
	0%	7.77	5.18	2.59	0.00	-2.59	-5.18	-7.77
	-2.67%	-115.37	-117.96	-120.55	-123.14	-125.72	-128.31	-130.90
-5.33%	-254.44	-257.03	-259.61	-262.20	-264.79	-267.38	-269.97	
-8%	-409.44	-412.02	-414.61	-417.20	-419.79	-422.38	-424.97	

최대 손실 시나리오

위험액	-424.97
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	604.66
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

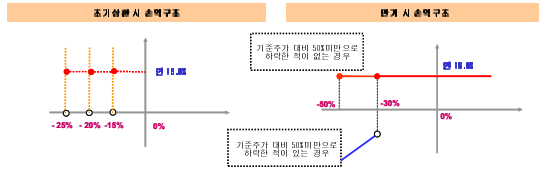
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 만기: 2009년 10월 14일
- 관점자산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 증가
- 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 수익률로 중도상환이 됨.  
- 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 \* 132%  
- 두 기초자산의 가액(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 관점의 수익구조



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

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	116.72	114.15	111.58	109.01	106.44	103.87	101.30
시나리오	5.33%	77.99	75.42	72.85	70.28	67.71	65.14	62.57
	2.67%	41.66	39.09	36.52	33.95	31.38	28.81	26.24
	0%	7.71	5.14	2.57	0.00	-2.57	-5.14	-7.71
	-2.67%	-23.84	-26.41	-28.98	-31.55	-34.12	-36.69	-39.26
	-5.33%	-53.01	-55.58	-58.15	-60.72	-63.29	-65.86	-68.43
	-8%	-79.78	-82.35	-84.92	-87.49	-90.06	-92.63	-95.20

최대 손실 시나리오

위험액	-95.20
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	94.53
-----	-------

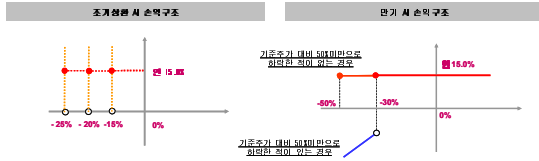
[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG필립스LCD 보통주, LG화학 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 30일
- 3) 만드첨산 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 펀드 해지  
 - 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) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))  
KR603762BTB0 비례예상증권(ELS)240

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	3.84	3.66	3.48	3.31	3.13	2.95	2.77
시나리오	5.33%	2.96	2.78	2.60	2.43	2.25	2.07	1.89
	2.67%	1.86	1.68	1.50	1.32	1.15	0.97	0.79
	0%	0.93	0.96	0.18	0.00	-0.18	-0.36	-0.54
	-2.67%	-1.01	-1.19	-1.37	-1.55	-1.72	-1.90	-2.08
	-5.33%	-2.78	-2.96	-3.14	-3.31	-3.49	-3.67	-3.85
	-8%	-4.77	-4.95	-5.12	-5.30	-5.48	-5.66	-5.84

최대 손실 시나리오

위험액	-5.84
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.22
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

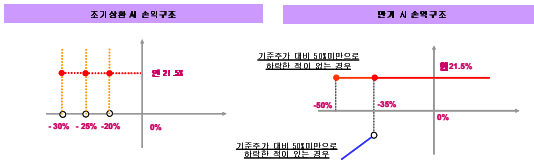
1. 계약금액

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600345EV11 펀드 운용(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	213.78	194.18	174.58	154.99	135.39	115.79	96.20
시나리오	5.33%	161.73	142.13	122.53	102.94	83.34	63.74	44.15
	2.67%	110.06	90.47	70.87	51.27	31.68	12.08	-7.52
	0%	58.79	39.19	19.60	0.00	-19.60	-39.19	-58.79
	-2.67%	7.90	-11.69	-31.29	-50.89	-70.48	-90.08	-109.68
	-5.33%	-42.59	-62.19	-81.79	-101.38	-120.98	-140.58	-160.18
	-8%	-92.71	-112.30	-131.90	-151.50	-171.09	-190.69	-210.29

최대 손실 시나리오

위험액	-210.29
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	195.71
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 피생상품 제 1호

1. 계약금액

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

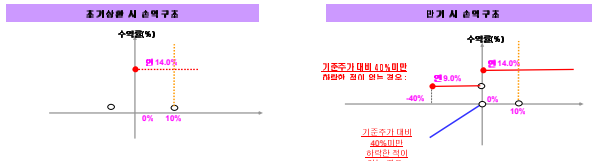
단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수
- 2) 만기: 2010년 7월29일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 장중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도상환

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	459.86	444.05	428.23	412.42	396.61	380.79	364.98
5.33%	334.95	319.13	303.32	287.51	271.69	255.88	240.07
2.67%	197.47	181.66	165.85	150.03	134.22	118.41	102.59
0%	47.44	31.63	15.81	0.00	-15.01	-30.83	-46.64
-2.67%	-115.16	-130.97	-146.78	-162.59	-178.41	-194.22	-210.03
-5.33%	-290.31	-306.12	-321.94	-337.75	-353.56	-369.38	-385.19
-8%	-478.03	-493.84	-509.65	-525.47	-541.28	-557.09	-572.90

최대 손실 시나리오

위험액	-672.90
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	559.87
-----	--------

[17]테리 조StepDown사모단 위 과정26호

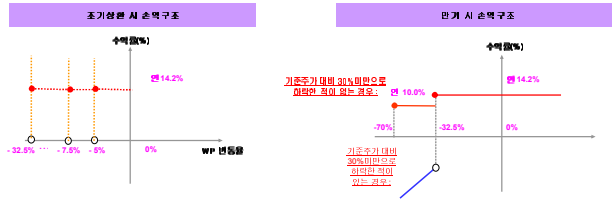
1. 계약금액

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) 만드첨산 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.  
67.5%(만기상환일) 이상인 경우 만이율 14.2%의 수익률로 중도상환이 됨.  
단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 만비드 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) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867B7B0 쿠로남산한동림(ELS)803

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	212.71	183.20	153.70	124.19	94.68	65.18	35.67
시나리오	5.33%	171.34	141.83	112.33	82.82	53.31	23.81	-5.70
	2.67%	129.94	100.44	70.93	41.42	11.92	-17.59	-47.10
	0%	88.52	59.01	29.51	0.00	-23.81	-59.01	-88.52
	-2.67%	47.07	17.56	-11.95	-41.45	-70.96	-100.47	-129.97
	-5.33%	5.59	-23.92	-53.43	-82.93	-112.44	-141.95	-171.45
	-8%	-35.92	-65.43	-94.93	-124.44	-153.95	-183.45	-212.96

최대 손실 시나리오

위험액	-212.96
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	209.60
-----	--------



[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

1. 계약금액

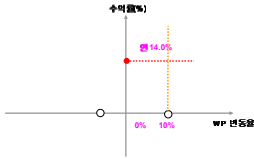
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	잔위

단위(백만원)

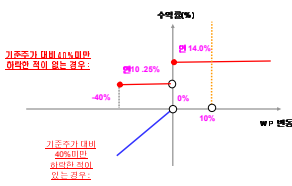
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	별동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	91.15	86.55	81.96	77.36	72.77	68.17	63.58	
손익	5.33%	65.00	60.40	55.81	51.21	46.62	42.02	
시나리오	2.67%	39.21	34.62	30.02	25.43	20.83	16.24	
	0%	13.78	9.19	4.59	0.00	-4.59	-9.19	
	-2.67%	-11.28	-15.87	-20.47	-25.06	-29.66	-34.25	
	-5.33%	-35.98	-40.58	-45.17	-49.77	-54.36	-58.96	
	-8%	-60.32	-64.92	-69.51	-74.11	-78.70	-83.30	

최대 손실 시나리오

위험액	63.58
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	67.20
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서5호

1. 계약금액

구분	거래대상	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 결정일자: 매 6개월

4) 기준일자: 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.

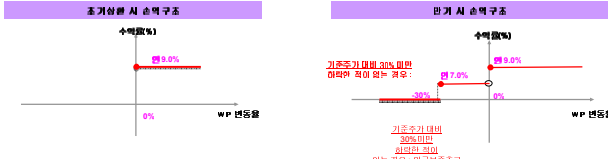
단, 평가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 원도 해지

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

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

: 원금\*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 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	47.32	43.85	40.37	36.89	33.42	29.94	26.46	
시나리오	5.33%	35.85	32.38	28.90	25.42	21.95	18.47	
	2.67%	23.56	20.08	16.60	13.13	9.65	6.17	
	0%	10.43	6.95	3.48	0.00	-3.48	-6.95	
	-2.67%	-3.53	-7.00	-10.48	-13.95	-17.43	-20.91	
	-5.33%	-16.91	-21.78	-25.26	-28.74	-32.21	-35.69	
	-8%	-33.92	-37.40	-40.87	-44.35	-47.83	-51.30	
							-54.78	

최대 손실 시나리오

위험액	26.46
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	56.71
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

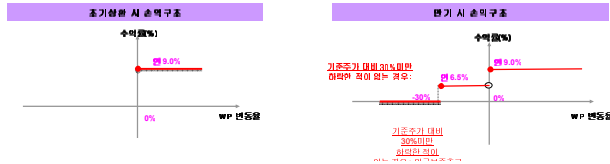
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 평가: 2011년 2월 21일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
  - 4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 종가
  - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.
- 단, 평가시점의 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 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%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR603762OV23 비례배분금 (ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	32.62	30.12	27.62	25.12	22.62	20.11	17.61
손익	5.33%	24.88	22.38	19.88	17.37	14.87	12.37	9.87
시나리오	2.67%	1.651	14.00	11.50	9.00	6.50	4.00	1.50
	0%	7.50	5.00	2.50	0.00	-2.50	-5.00	-7.50
	-2.67%	-2.13	-4.63	-7.13	-9.63	-12.13	-14.64	-17.14
	-5.33%	-1.239	-14.90	-17.40	-19.90	-22.40	-24.90	-27.40
	-8%	-23.29	-25.79	-28.29	-30.79	-33.29	-35.79	-38.29

최대 손실 시나리오

위험액	17.61
-----	-------

4. 매매상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	36.54
-----	-------

[2] 메리츠주 수연계 사모단위 파생 7호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만드형산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 종가

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

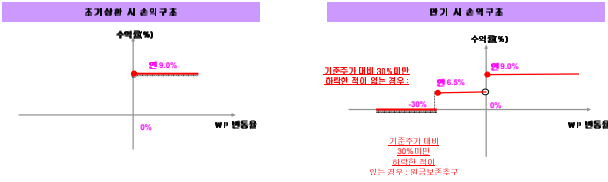
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

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

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

: 원금\*100%

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동 중(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산	8%	25.37	23.43	21.48	19.53	17.59	15.64	13.70
손익	5.33%	19.35	17.40	15.46	13.51	11.57	9.62	7.68
시나리오	2.67%	12.84	10.89	8.95	7.00	5.06	3.11	1.17
	0%	5.84	3.89	1.95	0.00	-1.95	-3.89	-5.84
	-2.67%	-1.66	-3.60	-5.55	-7.49	-9.44	-11.38	-13.33
	-5.33%	-9.64	-11.59	-13.53	-15.48	-17.42	-19.37	-21.31
	-8%	-16.11	-20.06	-22.00	-23.95	-25.89	-27.84	-29.78

최대 손실 시나리오

위험액	13.70
-----	-------

4. 파생 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.42
-----	-------

[28] 매리츠월중지수연계사모파생1호

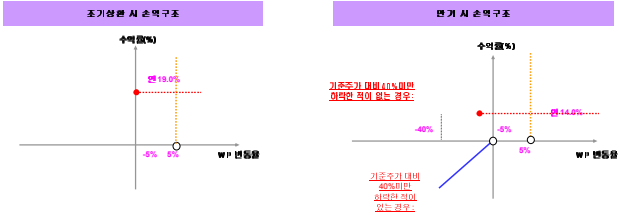
1. 계약금액

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

단위: 백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수
- 만기: 2010년 08월 04일
- 관점자산 결정 주기: 매 3개월
- 기준지수: 2008년 8월 7일 NIKKEI225, HSCEI지수의 증가
- 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 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 \* 138%  
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/초기기준지수)
- 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)  
KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	145.84	136.98	128.12	119.26	110.40	101.54	92.69
	5.33%	106.04	97.18	88.33	79.47	70.61	61.75	52.89
	2.67%	66.29	57.43	48.57	39.71	30.86	22.00	13.14
	0%	26.57	17.72	8.86	0.00	-8.86	-17.72	-26.57
	-2.67%	-13.10	-21.96	-30.82	-39.68	-48.53	-57.39	-66.25
-5.33%	-52.74	-61.59	-70.45	-79.31	-88.17	-97.03	-105.89	
-8%	-92.33	-101.19	-110.05	-118.91	-127.77	-136.62	-145.48	

최대 손실 시나리오

위험액	-145.48
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	145.61
-----	--------

[24] 테리츠 주가지수연계사모펀생상품 제 1호

1. 계약금액

구분		거래대상	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

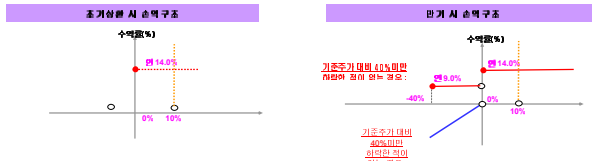
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

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 한번이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도상환

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
8%	963.62	544.24	524.86	505.48	486.09	466.71	447.33
5.33%	410.52	391.14	371.76	352.38	333.00	313.62	294.24
2.67%	242.03	222.65	203.27	183.89	164.51	145.12	125.74
0%	56.14	36.76	17.38	0.00	-19.38	-39.76	-60.14
-2.67%	-141.14	-160.52	-179.90	-199.28	-218.66	-238.04	-257.42
-5.33%	-355.81	-375.20	-394.58	-413.96	-433.34	-452.72	-472.10
-8%	-585.89	-605.27	-624.65	-644.03	-663.41	-682.79	-702.17

최대 손실 시나리오

위험액	-702.17
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	686.19
-----	--------

[26] 데리츠2Star사모파생SE SF-1

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

2) 만기: 2010년 09월 30일

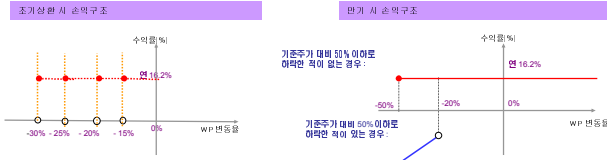
3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도 상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 삼성화재)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일), 70%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 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 - 매신증권(ELS)713

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05
	5.33%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	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%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	-5.33%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
	-8%	-0.09	-0.09	-0.09	-0.09	-0.09	-0.09	-0.09

최대 손실 시나리오

위험액	-0.09
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.05
-----	------

[29] 테리츠2Star과성 SEPO-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외과생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

2) 만기: 2011년 09월 23일

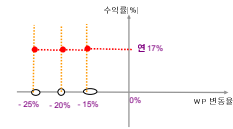
3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

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

- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일)만큼 17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.  
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 151.0%  
 - 두 기초자산의 가액(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR657234591 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동률 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	-5.99	-6.30	-6.60	-6.90	-7.20	-7.50	-7.80
	5.33%	-1.38	-1.68	-1.98	-2.29	-2.59	-2.89	-3.19
	2.67%	0.92	0.62	0.31	0.01	-0.29	-0.59	-0.89
	0%	0.90	0.60	0.30	0.00	-0.30	-0.60	-0.90
	-2.67%	-1.42	-1.72	-2.03	-2.33	-2.63	-2.93	-3.23
	-5.33%	-6.06	-6.36	-6.66	-6.97	-7.27	-7.57	-7.87
	-8%	-13.01	-13.32	-13.62	-13.92	-14.22	-14.52	-14.82

최대 손실 시나리오

위험액	-14.82
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.21
-----	------



**[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호**

**1. 계약금액**

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

단위: 백만원

**2. 만기시점의 수익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 09월 20일

3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가

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

단, 만기시(8차 상환일)까지 조기 상환 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

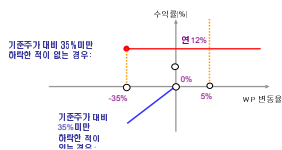
: 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



**3. 수익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))**

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

수익구조변동률 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**

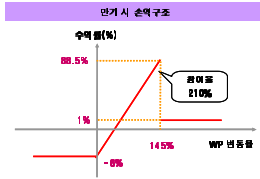
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 만기 전 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 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)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-78.76	-86.96	-95.16	-103.36	-111.56	-119.76	-127.96
시나리오	5.33%	-41.13	-49.33	-57.53	-65.73	-73.93	-82.13	-90.33
	2.67%	-6.67	-14.87	-23.07	-31.27	-39.47	-47.67	-55.87
	0%	24.60	16.40	8.20	0.00	-8.20	-16.40	-24.60
	-2.67%	52.69	44.49	36.29	28.09	19.89	11.69	3.49
	-5.33%	77.60	69.40	61.20	53.00	44.80	36.60	28.40
	-8%	99.32	91.12	82.92	74.72	66.52	58.32	50.12

최대 손실 시나리오	
위험액	50.12

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	116.82
-----	--------

**[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호**

**1. 계약금액**

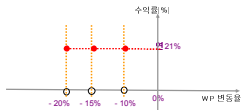
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위:백만원

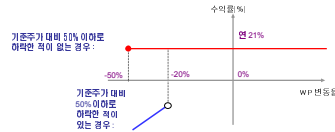
**2. 연기사점의 손익구조**

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

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

KR6562326W20 유인투기증권(ELS)2315

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
가	8%	6.72	5.46	4.21	2.96	1.70	0.45	-0.80
초	5.33%	6.41	5.15	3.90	2.65	1.39	0.14	-1.12
자	2.67%	5.42	4.17	2.91	1.66	0.41	-0.85	-2.10
산	0%	3.76	2.51	1.25	0.00	-1.25	-2.51	-3.76
시	-2.67%	1.43	0.17	-1.08	-2.33	-3.59	-4.84	-6.10
나	-5.33%	-1.58	-2.83	-4.09	-5.34	-6.60	-7.85	-9.10
리	-8%	-5.26	-6.52	-7.77	-9.02	-10.28	-11.53	-12.78

**최대 손실 시나리오**

위험액	-12.78
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	14.68
-----	-------

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

**1. 계약금액**

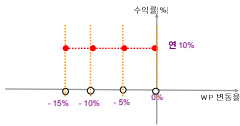
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

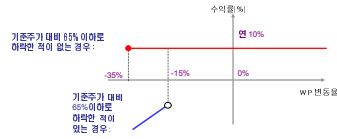
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 17일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 매3개월
- 4) 기 존지 수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가액이 낮은 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 만드 행지  
- 두 기초자산의 가액이 환반드 기준가액의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 110.0%  
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 존가액의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기 존지 수/최 초기 존지 수)
- 6) 만드 의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**3. 손익구조변동/최대손실가능금액(단위:백만원)**  
메리츠주가지수연계시모종결2호  
손익구조변동 시나리오

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

**최대손실 시나리오**

위험액	0.00
-----	------

**4. 파생상품의 최대손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

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

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

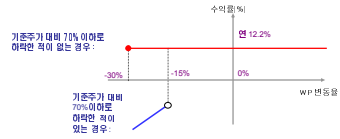
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 만기: 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, 만기시 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 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 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)

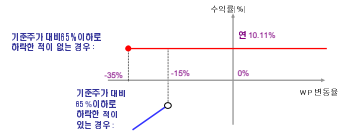
**2. 연가시점의 손익구조**

- 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 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**초기상환 시 수익구조**



**만기 시 수익구조**



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

1. 계약금액

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

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

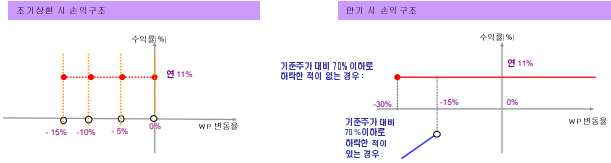
- 두 기준지수의 가격이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 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 롯데당 신안증권(ELS)931

**1. 계약금액**

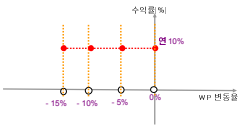
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

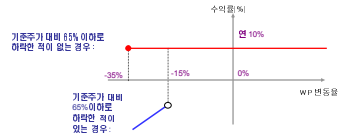
**2. 연기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 연기: 2009년 8월 17일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 연기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 110.0%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (반기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**반기 시 손익구조**





**[80-6] 메리츠투자지수형계사모증권2호**  
 KR600867AV62 메리츠신안증권(ELS)899

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 연기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 6월 12일

3) 펀드청산결정주기: 매3개월

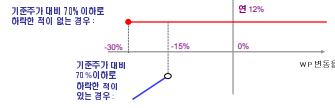
4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 \* 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)Z27회

**1. 계약금액**

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

**2. 평가시점의 손익구조**

- 1) 증권파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 6월 10일
- 3) 권드청산 결정 주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시까지 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 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
   : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 권드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



**[60-8] 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) 종속파생상품의 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 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일)

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

만큼 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

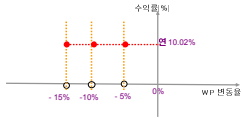
: 원금 \* 110.02%

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

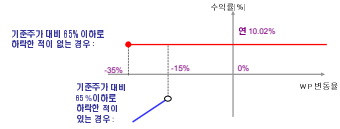
: 원금 \* (만기기 준지수/최 초기 준지수)

6) 권드의 수익구조

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**1. 계약금액**

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

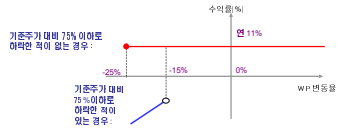
**2. 평가시점의 손익구조**

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

**초기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



[60-10] **메리츠투자자산운용계사로증권2호**

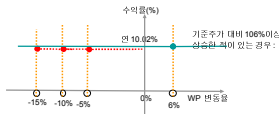
1. 계약금액

						단위(백만원)	
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액금(2)	순포지션(1-2)	비고	
누계	유가증권	ELS	7547.5	0	7,547.5	잔위	

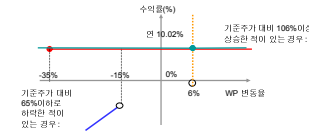
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기 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, 기초자산의 수가 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 한번도 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] 데리츠2Star사로증권투신LEHO-2**

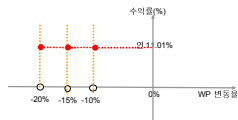
**1. 계약금액**

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

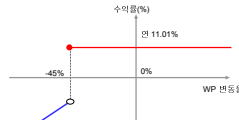
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 증권파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 2) 만기: 2012년 4월 12일
- 3) 편드형산결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 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 편드 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 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 편드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익구조인용(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR66923071445 NA투자증권(ELS)32

손익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.02
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

**[62] 데리츠2SIa사모증권투자STWF-1**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 참여대상상품의 기초자산: 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 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 가액이 한번도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우

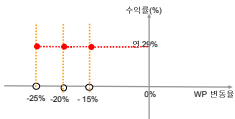
: 원금 \* 12.9%

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

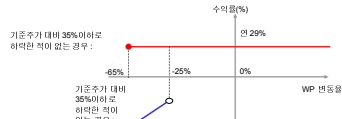
: 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익구조인용(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))**

KR6622313W42 코브증권(ELS)325

**손익구조변동 시나리오**

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	4.64	4.45	4.26	4.07	3.88	3.69	3.51
	5.33%	1.84	1.65	1.46	1.27	1.08	0.89	0.70
	2.67%	0.46	0.29	0.10	-0.09	-0.27	-0.46	-0.65
	0%	0.57	0.38	0.19	0.00	-0.19	-0.38	-0.57
	-2.67%	2.10	1.91	1.72	1.53	1.34	1.15	0.96
	-5.33%	5.07	4.88	4.69	4.50	4.31	4.12	3.93
	-8%	9.46	9.29	9.11	8.92	8.73	8.54	8.35

**최대 손실 시나리오**

위험액	8.35
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	4.90
-----	------

**[68] 데리츠2Star사로증권LEHC-I 호**

**1. 계약금액**

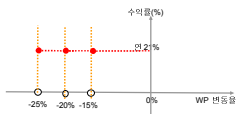
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2045.8	0	2,046	잔위

단위(백만원)

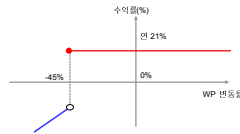
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기상환일경에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 121%  
 - 만기상환일경에 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시점손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))**

KR6682307W43 NH투자증권(ELS)32

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

**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	창의

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장기파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

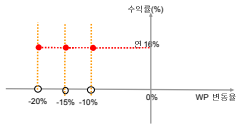
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

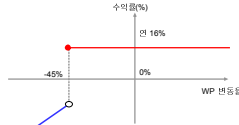
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	1.56	1.26	0.95	0.63	0.31	-0.00	-0.32
산	5.33%	1.83	1.52	1.20	0.88	0.57	0.25	-0.07
시나리오	2.67%	1.62	1.31	0.99	0.67	0.36	0.04	-0.28
	0%	0.95	0.63	0.32	0.00	-0.32	-0.63	-0.95
	-2.67%	-0.19	-0.50	-0.82	-1.14	-1.45	-1.77	-2.09
	-5.33%	-1.79	-2.11	-2.42	-2.74	-3.06	-3.37	-3.69
	-8%	-3.85	-4.17	-4.49	-4.80	-5.12	-5.44	-5.75

최대 손실 시나리오

위험액	-6.75
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(다위·백만원)**

위험액	7.91
-----	------

[65] 데리츠2Star사로 증권POKB-2호

1. 계약금액

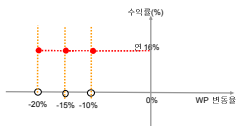
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50	잔위

단위(백만원)

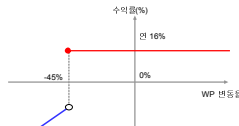
2. 만기시점의 손익구조

- 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 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기 상환일정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 118%  
 - 만기 상환일정일에 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위:백만원))

KR6562340W48 유인투기증권(ELS)2405

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	0.09	0.08	0.06	0.04	0.02	-0.00	-0.02
	5.33%	0.11	0.09	0.07	0.05	0.03	0.01	-0.00
산시나리오	2.67%	0.10	0.08	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02
	0%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
	-2.67%	-0.01	-0.03	-0.05	-0.07	-0.09	-0.11	-0.12
	-5.33%	-0.11	-0.13	-0.14	-0.16	-0.18	-0.20	-0.22
	-8%	-0.23	-0.25	-0.27	-0.29	-0.31	-0.32	-0.34

최대 손실 시나리오

위험액	-0.34
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	0.47
-----	------

**[67] 데리츠2Star사로 증권SEST-1**

**1. 계약금액**

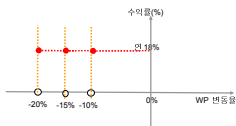
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

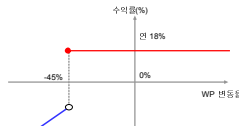
**2. 평가시점의 손익구조**

- 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%	
기초지	8%	-1.95	-4.75	-7.55	-10.36	-13.16	-15.96	-18.76
산	5.33%	4.17	1.37	-1.43	-4.24	-7.04	-9.84	-12.64
시나리오	2.67%	7.62	4.82	2.02	-0.78	-3.59	-6.39	-9.19
오	0%	6.40	5.60	2.60	0.00	-2.60	-5.60	-8.60
	-2.67%	6.52	3.72	0.92	-1.66	-4.69	-7.49	-10.29
	-5.33%	1.97	-0.63	-3.64	-6.44	-9.24	-12.04	-14.84
	-8%	-5.25	-8.06	-10.86	-13.66	-16.46	-19.26	-22.06

최대 손실 시나리오

위험액	-22.06
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	17.51
-----	-------

[68] 데리츠2Star사로 증권SE ST-4호

1. 계약금액

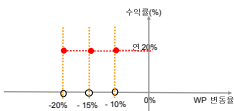
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	500.0	0	500	차입

단위(백만원)

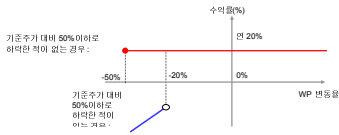
2. 평가시점의 손익구조

- 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%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 120%  
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (다위:백만원))

KR6622303W44 : 코분종권(ELS)322

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.40	-0.20	-0.81	-1.41	-2.01	-2.62	-3.22
시나리오	5.33%	1.64	1.04	0.44	-0.17	-0.77	-1.37	-1.98
	2.67%	2.11	1.51	0.91	0.30	-0.30	-0.90	-1.51
	0%	1.81	1.21	0.60	0.00	-0.60	-1.21	-1.81
	-2.67%	0.74	0.13	-0.47	-1.06	-1.66	-2.26	-2.89
	-5.33%	-1.11	-1.72	-2.32	-2.93	-3.53	-4.13	-4.74
	-8%	-3.74	-4.34	-4.94	-5.55	-6.15	-6.75	-7.36

최대 손실 시나리오

위험액	-7.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	6.76
-----	------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

1. 계약금액

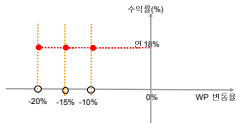
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	차입

단위(백만원)

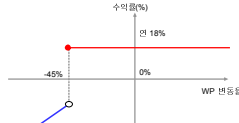
2. 만기시점의 손익구조

- 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 (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%	-1.07	-2.61	-4.16	-5.70	-7.24	-8.78	-10.32
손익	5.33%	2.29	0.75	-0.79	-2.33	-3.87	-5.41	-6.95
시나리오	2.67%	4.19	2.65	1.11	-0.43	-1.97	-3.51	-5.05
	0%	4.62	3.08	1.54	0.00	-1.54	-3.08	-4.62
	-2.67%	3.59	2.05	0.50	-1.04	-2.58	-4.12	-5.66
	-5.33%	1.08	-0.46	-2.00	-3.54	-5.08	-6.62	-8.17
	-8%	-2.89	-4.43	-5.97	-7.51	-9.06	-10.60	-12.14

최대 손실 시나리오

위험액	-12.14
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	9.63
-----	------

**[77] 데리츠2SIa사모SEST-3**

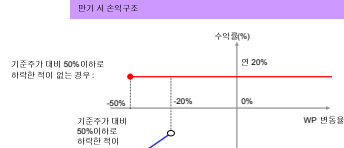
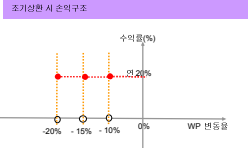
**1. 계약금액**

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 비중주)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 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 : 평균 \* 120%  
- 두 기초자산의 가격 (장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (평가기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조변동 등(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%	-0.56	-1.27	-1.97	-2.67	-3.37	-4.07	-4.78
	5.33%	1.13	0.42	-0.28	-0.98	-1.68	-2.38	-3.09
산	2.67%	2.02	1.31	0.61	-0.09	-0.79	-1.49	-2.20
	0%	2.11	1.40	0.70	0.00	-0.70	-1.40	-2.11
시나리오	-2.67%	1.40	0.69	-0.01	-0.71	-1.41	-2.11	-2.82
	-5.33%	-0.11	-0.82	-1.52	-2.22	-2.92	-3.63	-4.33
	-8%	-2.42	-3.13	-3.83	-4.53	-5.23	-5.94	-6.64

**최대 손실 시나리오**

위험액	-6.64
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	5.88
-----	------

[78] 데리츠2SIa사모STWF-2

1. 계약금액

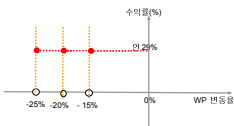
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	잔위

단위(백만원)

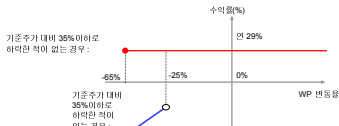
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융지주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 23%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 12.9%  
- 두 기초자산의 가액 (장종료합)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 (다위:백만원))

KR6622313W42 코브증권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	4.04	3.88	3.71	3.55	3.38	3.22	3.05
손	5.33%	1.60	1.44	1.27	1.11	0.94	0.78	0.61
리	2.67%	0.42	0.25	0.09	-0.07	-0.24	-0.40	-0.57
오	0%	0.48	0.33	0.16	0.00	-0.16	-0.33	-0.49
	-2.67%	1.82	1.66	1.50	1.33	1.17	1.00	0.84
	-5.33%	4.41	4.25	4.08	3.92	3.75	3.59	3.42
	-8%	8.26	8.09	7.93	7.76	7.60	7.43	7.27

최대 손실 시나리오

위험액	7.27
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	4.27
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

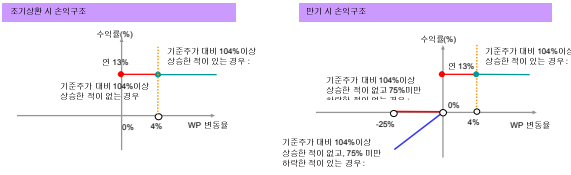
1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 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)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	9,350.15	8,803.37	8,256.60	7,709.82	7,163.04	6,616.26	6,069.48
	5.33%	6,776.94	6,230.16	5,683.38	5,136.60	4,589.82	4,043.05	3,496.27
시나리오	2.67%	4,207.00	3,660.22	3,113.44	2,566.66	2,019.88	1,473.11	926.33
	0%	1,640.33	1,093.56	546.78	0.00	-516.78	-1,063.56	-1,610.33
	-2.67%	-923.05	-1,469.83	-2,016.61	-2,563.39	-3,110.16	-3,656.94	-4,203.72
	-5.33%	-3,483.16	-4,029.94	-4,576.72	-5,123.49	-5,670.27	-6,217.05	-6,763.83
	-8%	-6,039.99	-6,586.77	-7,133.55	-7,680.33	-8,227.10	-8,773.88	-9,320.66

최대 손실 시나리오

위험액	-9,320.66
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,248.03
-----	----------



[79-2] **메리츠투자지수연계사모8호**

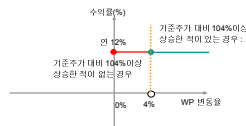
1. 계약금액

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

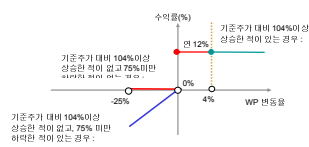
2. 만기시점의 수익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자기수연계사모8호**

1. 계약금액

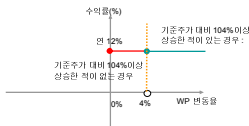
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔위

단위: 백만원

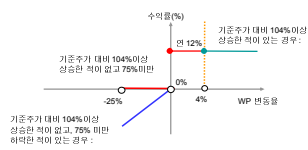
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR603061ATB9      교보증권(ELS)87

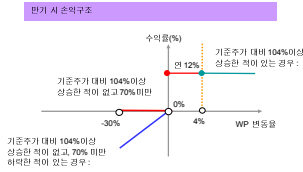
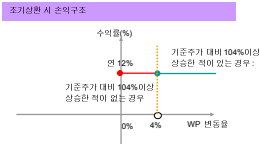
[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 수익구조

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



KR6008679TA3 곳님 신원증권(ELS)786

**[79-5] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

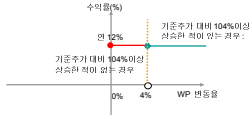
**2. 만기시점의 손익구조**

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

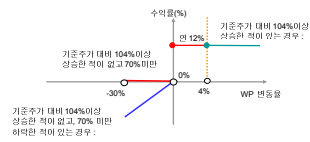
- 단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 \* 11.2%
  - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6008676TB7 코트님 신한증권(ELS)797

**[79-6] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

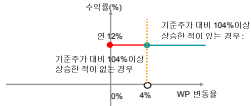
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

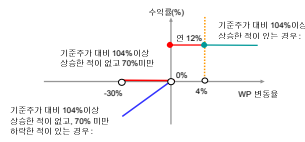
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600867CTB8 코트남 신원증권(ELS)804

**[79-7] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

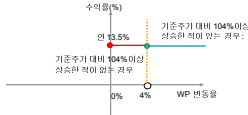
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 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

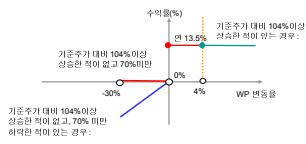
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격 이 일반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우  
 : 원금 \* 113.5%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 \* (만기 기 준지수/최 초기 준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6008675TC7 코트나눔 신한증권(ELS)809

**[79-8] 메리츠주가지수연계사모8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

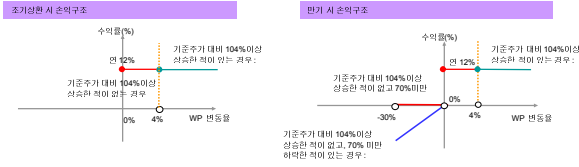
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 12%의 수익률로 중도 상환

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

**[79-9] 에리츠주가지수연계사모8호**

**1. 계약금액**

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

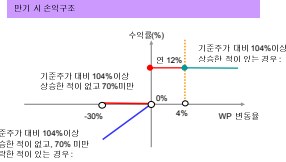
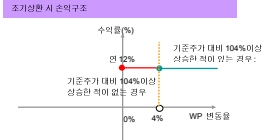
단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

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

단, 만기시 (2차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
 : 원금 \* 11.2%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475



**[79-10] 에리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 평가시점의 손익구조**

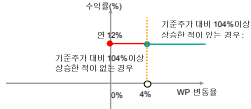
- 1) 종속회계상들의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산( KOSPI200지 수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

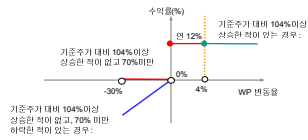
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의100%보다 작은 경우 : 원금 \* 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

**[79-11] 에리츠주가지수연계사료8호**

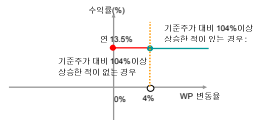
**1. 계약금액**

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

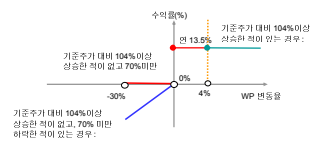
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

**[79-12] 메리츠투자지수형계사모8호**

**1. 계약금액**

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

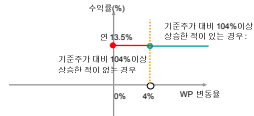
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 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

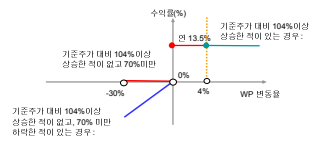
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격 이 할빈도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우  
 : 원금 + 11.3.5%  
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 + (만기기 준지수/최초기 준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환시 손익구조**



**만기시 손익구조**



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

**[82] 대리 초주가지 수연계 사모증권5호**

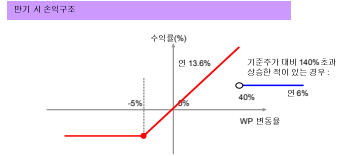
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 3월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 만기일 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
  - 만기 평가지수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 140% 미만일 경우  
: 원금 \* ( 95% + 100% \* ( 만기기준지수 / 최초기준지수 - 1 ) )
  - 만기 평가지수가 최초기준가격 미만일 경우  
: 원금 \* 95%
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6523317W30 대우증권ELS2881

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-6.12	-6.74	-7.37	-8.00	-8.63	-9.25	-9.88
손익	5.33%	-3.31	-3.93	-4.56	-5.19	-5.81	-6.44	-7.07
시나리오	2.67%	-0.64	-1.27	-1.89	-2.52	-3.15	-3.77	-4.40
	0%	1.88	1.26	0.63	0.00	-0.63	-1.26	-1.88
	-2.67%	4.26	3.63	3.00	2.37	1.75	1.12	0.49
	-5.33%	6.48	5.86	5.23	4.60	3.97	3.35	2.72
	-8%	8.56	7.94	7.31	6.68	6.06	5.43	4.80

**최대 손실 시나리오**

위험액	4.80
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	10.55
-----	-------

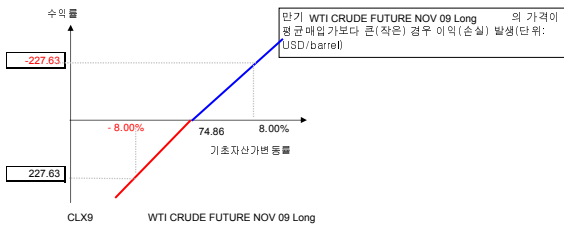
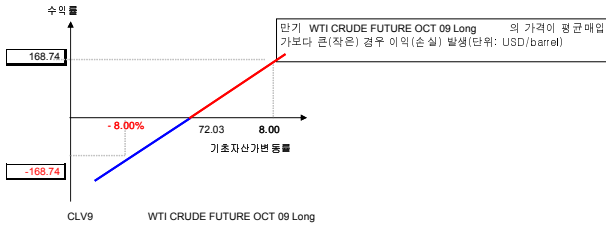
[80] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

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

구분	시나리오	손익
기초자산 시나리오	8%	396.37
	5.33%	264.08
	2.67%	132.29
	0%	0.00
	-2.67%	-132.29
	-5.33%	-264.08
	-8%	-396.37

최대손실 시나리오	
위험액	-396.37

4. 특정상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,606
-----	-------

**[79] 데리츠주가지 수연계사모증권!61E**

**1. 계약금액**

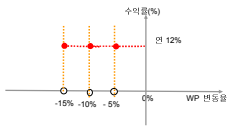
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위: (백만원)

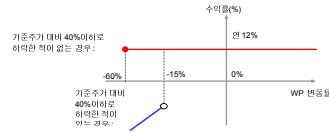
**2. 연가시점의 손익구조**

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

조기상환시 손익구조



연가시 손익구조



**3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6503305W69 코모닝 신한증권(ELS)1039

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-1.76	-1.76	-1.76	-1.76	-1.79	-1.79	-1.79
손실	5.33%	-0.73	-0.73	-0.73	-0.74	-0.74	-0.74	-0.74
시나리오	2.67%	-0.13	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14	-0.15	-0.15
	0%	0.01	0.00	0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	-2.67%	-0.30	-0.31	-0.31	-0.31	-0.31	-0.32	-0.32
	-5.33%	-1.07	-1.07	-1.07	-1.07	-1.08	-1.08	-1.08
	-8%	-2.28	-2.29	-2.29	-2.29	-2.29	-2.30	-2.30

최대 손실 시나리오

위험액	-2.30
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	3.11
-----	------

**[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호**

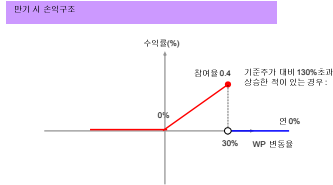
**1. 계약금액**

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



**3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(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%	-6.36	-6.74	-11.13	-13.51	-15.90	-18.28	-20.67
손익	5.33%	-1.33	-3.72	-6.10	-8.49	-10.87	-13.26	-15.65
시나리오	2.67%	3.17	0.79	-1.60	-3.98	-6.37	-8.76	-11.14
오	0%	7.16	4.77	2.39	0.00	-2.39	-4.77	-7.16
	-2.67%	10.62	8.24	5.85	3.46	1.08	-1.31	-3.69
	-5.33%	13.57	11.18	8.80	6.41	4.02	1.64	-0.75
	-8%	15.99	13.61	11.22	8.84	6.45	4.06	1.68

**최대 손실 시나리오**

위험액	1.68
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	19.56
-----	-------

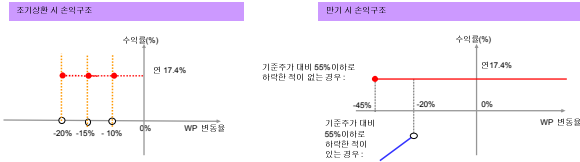
**[82] 데리츠2Star사로 증권SE ST-8호**

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 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 : 평균 \* 117.4%  
- 두 기초자산의 가액(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



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

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	2.46	1.99	1.52	1.05	0.58	0.11	-0.36
	5.33%	2.85	2.38	1.91	1.44	0.97	0.50	0.03
	2.67%	2.50	2.03	1.56	1.09	0.62	0.15	-0.32
손리	0%	1.41	0.94	0.47	0.00	-0.47	-0.94	-1.41
	-2.67%	-0.42	-0.89	-1.36	-1.83	-2.30	-2.77	-3.24
	-5.33%	-3.00	-3.47	-3.94	-4.41	-4.88	-5.35	-5.82
	-8%	-6.31	-6.78	-7.25	-7.72	-8.19	-8.66	-9.13

**최대 손실 시나리오**

위험액	-9.13
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	10.13
-----	-------



**[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호**

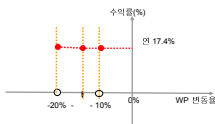
**1. 계약금액**

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

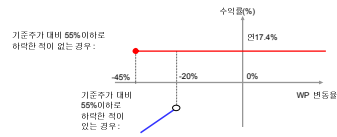
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액)(단위:백만원)**  
KR652233W57 (대우증권(ELS)2976)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	15.62	12.80	9.76	6.76	3.74	0.72	-2.30
손실리	5.33%	18.33	15.31	12.29	9.27	6.25	3.23	0.21
오	2.67%	16.07	13.05	10.03	7.02	4.00	0.98	-2.04
	0%	9.06	6.04	3.02	0.00	-3.02	-6.04	-9.06
	-2.67%	-2.72	-5.74	-8.76	-11.78	-14.80	-17.82	-20.84
	-5.33%	-19.26	-22.28	-25.30	-28.32	-31.34	-34.36	-37.38
	-8%	-40.56	-43.58	-46.60	-49.62	-52.64	-55.66	-58.68

최대 손실 시나리오

위험액	-58.68
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	65.11
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

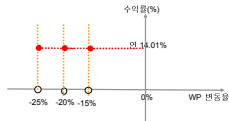
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: (백만원)

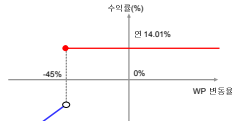
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백 만원)

KR6662305W64 원화스피드(ELS)132

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.25	-0.27	-0.26	-0.30	-0.31	-0.33	-0.34
	5.33%	-0.08	-0.10	-0.11	-0.13	-0.14	-0.16	-0.17
	2.67%	0.02	0.00	-0.01	-0.03	-0.04	-0.06	-0.07
	0%	0.06	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.03	-0.05
	-2.67%	0.00	-0.01	-0.03	-0.04	-0.06	-0.07	-0.09
	-5.33%	-0.12	-0.13	-0.15	-0.16	-0.18	-0.19	-0.21
	-8%	-0.30	-0.32	-0.33	-0.35	-0.36	-0.38	-0.39

최대 손실 시나리오

위험액	-0.39
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	1.18
-----	------

[85] 테라츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

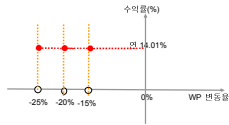
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위: (백만원)

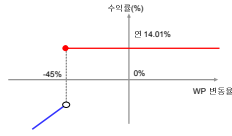
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2011년 5월 31일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 6월 1일 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산( 삼성전자 보통주, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 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:백 만원))  
KR6662305W64 원화스파이트(ELS)132

**손익 구조표본 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.91	-0.96	-1.02	-1.07	-1.13	-1.18	-1.24
손익	5.33%	-0.29	-0.35	-0.40	-0.46	-0.51	-0.57	-0.62
시나리오	2.67%	0.07	0.01	-0.04	-0.10	-0.15	-0.21	-0.26
	0%	0.16	0.11	0.05	0.00	-0.05	-0.11	-0.16
	-2.67%	0.00	-0.05	-0.11	-0.16	-0.22	-0.27	-0.32
	-5.33%	-0.42	-0.47	-0.53	-0.58	-0.64	-0.69	-0.74
	-8%	-1.10	-1.15	-1.21	-1.26	-1.31	-1.37	-1.42

**최대 손실 시나리오**

위험액	-1.42
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백 만원)

위험액	4.26
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-1호

1. 계약금액

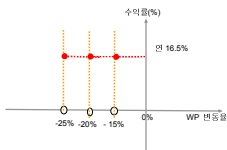
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

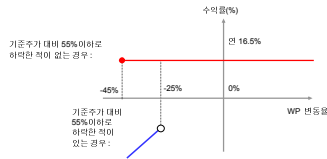
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, LG전자 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 22일 삼성전자 보통주, LG전자 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산( 삼성전자 보통주, LG전자 보통주 주가)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 환위스마트(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**

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

단위: (백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

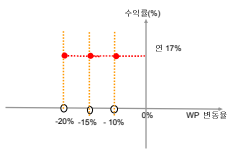
3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

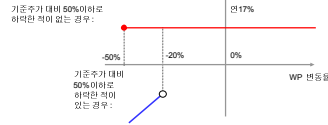
5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, KT 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기시 손익구조**



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

KR6562319W52 유가증권 (ELS)2415

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.65	0.47	0.26	0.09	-0.10	-0.26	-0.47
	5.33%	0.89	0.70	0.52	0.33	0.14	-0.05	-0.23
시나리오	2.67%	0.86	0.67	0.49	0.30	0.11	-0.08	-0.26
	0%	0.56	0.37	0.19	0.00	-0.19	-0.37	-0.56
	-2.67%	-0.01	-0.19	-0.36	-0.51	-0.76	-0.94	-1.13
	-5.33%	-0.84	-1.03	-1.22	-1.40	-1.59	-1.78	-1.97
	-8%	-1.95	-2.14	-2.32	-2.51	-2.70	-2.89	-3.07

**최대 손실 시나리오**

위험액	-3.07
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	3.73
-----	------

**[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호**

**1. 계약금액**

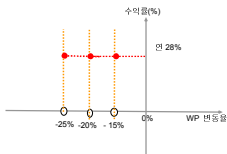
구분		거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS		462.0	0	462.0	차입

단위: (백만원)

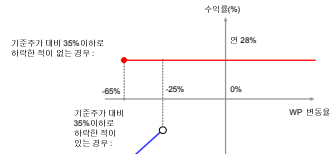
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 15일 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산( 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 35% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 128%  
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	50.03	36.91	27.76	16.65	5.53	-5.60	-16.73
손실	5.33%	45.03	33.90	22.76	11.65	0.52	-10.60	-21.73
시나리오	2.67%	39.48	28.35	17.23	6.10	-5.03	-16.15	-27.28
	0%	33.93	22.28	11.13	0.00	-11.13	-22.25	-33.38
	-2.67%	26.73	15.61	4.46	-5.65	-17.77	-28.90	-40.53
	-5.33%	19.54	8.41	-2.71	-13.84	-24.97	-36.09	-47.22
	-8%	11.80	0.67	-10.46	-21.58	-32.71	-43.84	-54.96

**최대 손실 시나리오**

위험액	-54.96
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)**

위험액	51.63
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

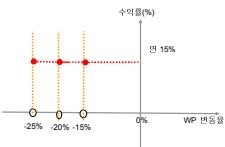
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	30.0	0	30.0	창위

단위:백만원

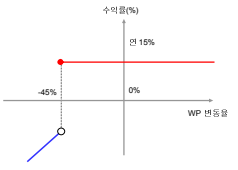
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.13	0.10	0.06	0.03	-0.00	-0.03	-0.07
손익	5.33%	0.15	0.11	0.08	0.05	0.02	-0.02	-0.05
시나리오	2.67%	0.14	0.10	0.07	0.04	0.01	-0.03	-0.06
	0%	0.10	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.10
	-2.67%	0.03	-0.00	-0.03	-0.07	-0.10	-0.13	-0.16
	-5.33%	-0.06	-0.10	-0.13	-0.16	-0.19	-0.23	-0.26
	-8%	-0.19	-0.22	-0.25	-0.28	-0.32	-0.35	-0.38

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.38

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.27
-----	------

**[90] 데리츠2Star사로증권POLE-이 호**

**1. 계약금액**

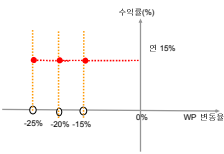
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	차입

단위:백만원

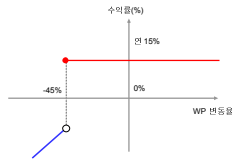
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)**

KR6662311WS8 권위스마트(ELS)117

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	9.76	7.30	4.84	2.38	-0.08	-2.54	-5.00
손익	5.33%	11.09	8.63	6.17	3.71	1.25	-1.21	-3.67
시나리오	2.67%	10.30	7.84	5.38	2.92	0.46	-2.00	-4.46
	0%	7.38	4.92	2.46	0.00	-2.46	-4.92	-7.38
	-2.67%	2.33	-0.13	-2.59	-5.05	-7.51	-9.97	-12.43
	-5.33%	-4.84	-7.30	-9.76	-12.22	-14.68	-17.14	-19.60
	-8%	-14.14	-16.60	-19.06	-21.52	-23.98	-26.44	-28.90

최대 손실 시나리오

위험액	-28.90
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	20.54
-----	-------



[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

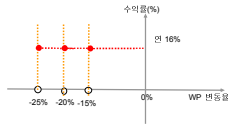
1. 계약금액

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

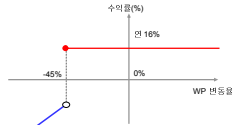
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.36	0.29	0.23	0.16	0.10	0.03	-0.03
	5.33%	0.34	0.28	0.21	0.14	0.08	0.01	-0.05
시나리오	2.67%	0.29	0.22	0.15	0.09	0.02	-0.04	-0.11
	0%	0.20	0.13	0.07	0.00	-0.07	-0.13	-0.20
-2.67%	0.07	0.01	-0.06	-0.12	-0.19	-0.26	-0.32	
	-5.33%	-0.09	-0.15	-0.22	-0.28	-0.35	-0.41	-0.48
	-8%	-0.28	-0.34	-0.41	-0.48	-0.54	-0.61	-0.67

최대 손실 시나리오

위험액	-0.67
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.68
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호[EL]

1. 계약금액

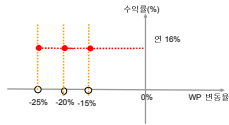
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

단위:백만원

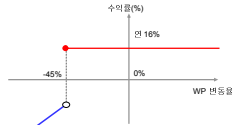
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 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%	6.46	5.28	4.10	2.93	1.75	0.57	-0.61
	5.33%	6.10	4.93	3.75	2.57	1.39	0.22	-0.96
시나리오	2.67%	5.13	3.95	2.77	1.60	0.42	-0.76	-1.93
	0%	3.53	2.35	1.18	0.00	-1.18	-2.85	-3.53
	-2.67%	1.31	0.14	-1.04	-2.22	-3.40	-4.57	-5.75
	-5.33%	-1.53	-2.70	-3.88	-5.06	-6.23	-7.41	-8.59
	-8%	-4.99	-6.17	-7.34	-8.52	-9.70	-10.87	-12.05

최대 손실 시나리오

위험액	-12.05
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	12.12
-----	-------

[93] 데리츠2Star사로증권LEHC-3

1. 계약금액

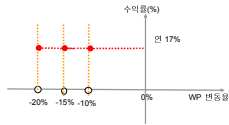
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	잔위

단위:백만원

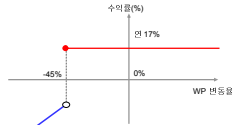
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 현대차 보통주
- 만기: 2012년 4월 27일
- 런드점산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2009년 4월 30일 LG전자 보통주, 현대차 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 현대차 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산의 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 런드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 \* 117%  
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 런드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)  
KR6562310W51 유가증권(ELS)2414

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.54	0.19	-0.17	-0.52	-0.87	-1.22	-1.58
손익	5.33%	1.20	0.84	0.49	0.14	-0.21	-0.57	-0.92
시나리오	2.67%	1.37	1.02	0.66	0.31	-0.04	-0.39	-0.75
	0%	1.06	0.71	0.35	0.00	-0.35	-0.71	-1.06
	-2.67%	0.26	-0.09	-0.44	-0.79	-1.15	-1.50	-1.85
	-5.33%	-1.01	-1.37	-1.72	-2.07	-2.42	-2.78	-3.13
	-8%	-2.77	-3.13	-3.48	-3.83	-4.18	-4.54	-4.89

최대 손실 시나리오

위험액	-4.89
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.91
-----	------

**[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1**

**1. 계약금액**

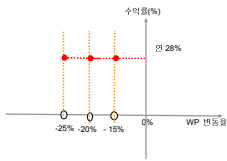
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	잔위

단위:백만원

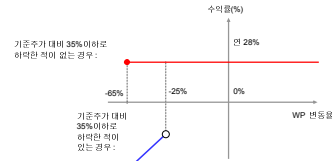
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**손익 구조표현 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	36.26	28.38	20.50	12.62	4.74	-3.14	-11.02
손실	5.33%	33.30	25.42	17.55	9.67	1.79	-6.09	-13.97
시나리오	2.67%	29.10	21.22	13.34	5.46	-2.42	-10.30	-18.18
	0%	23.64	15.76	7.88	0.00	-7.88	-15.76	-23.64
	-2.67%	16.93	9.05	1.17	-5.71	-14.59	-22.47	-30.35
	-5.33%	8.97	1.09	-6.79	-14.67	-22.55	-30.43	-38.31
	-8%	-0.24	-8.12	-16.00	-23.88	-31.76	-39.64	-47.52

**최대 손실 시나리오**

위험액	-47.52
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	38.26
-----	-------

**[95] 데리츠1Star사모증권BE-1호**

**1. 계약금액**

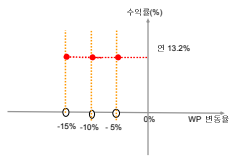
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위(백만원)

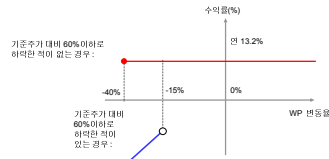
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 수익구조**



**만기 시 수익구조**



**3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)**

KR6621307W59 표보증권(ELS)341

**손익 구조변동 시나리오**

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

**최대 손실 시나리오**

위험액	0.00
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

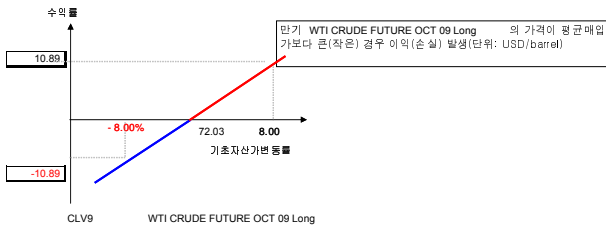
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유\_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연기사험의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	
기초자산	8%	10.89
	5.33%	7.25
	2.67%	3.63
	0%	0.00
시나리오	-2.67%	-3.63
	-5.33%	-7.25
	-8%	-10.89

최대손실 시나리오	
위험액	-10.89

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	43
-----	----

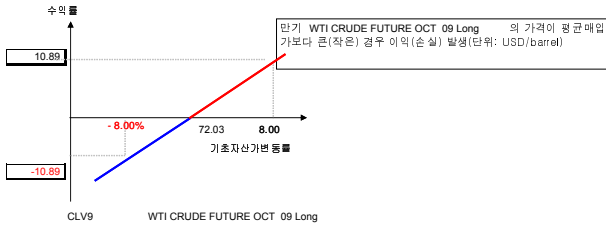
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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 구조변동(최대 손실 가능금액) (단위: 1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	30.94
	5.33%	20.61
	2.67%	10.33
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-10.33
	-5.33%	-20.61
	-8%	-30.94

최대 손실 시나리오

위험액	-30.94
-----	--------

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	125
-----	-----

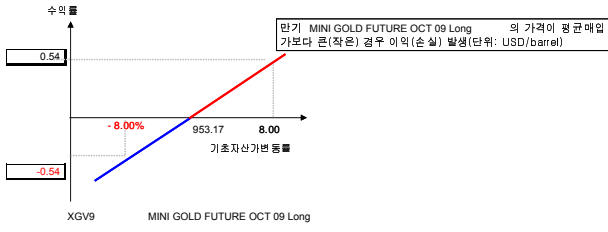
[96-2] 헤지 초 Premium Commodity 특별 자산1

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





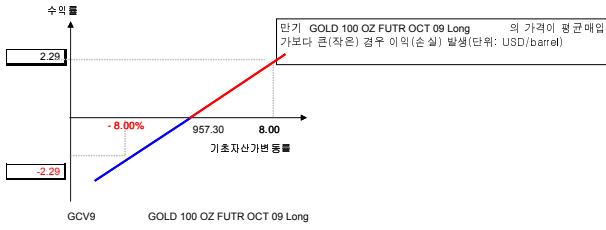
[96-3] 헤지 초 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



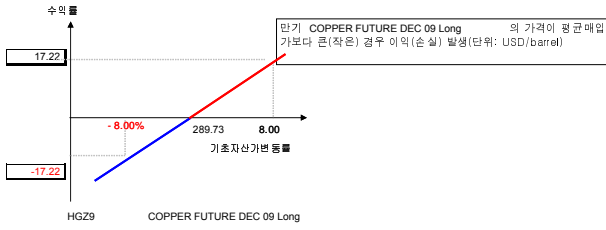
[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조

