

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

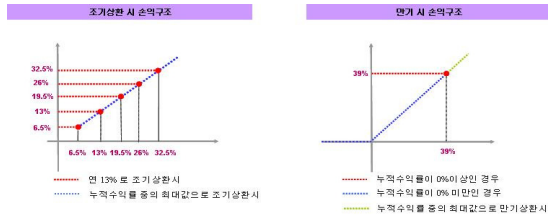
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

							단위(백만원)	
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액수(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 중도상환가려이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -16%(2차 중도상환일), -22%(3차 중도상환일), -28%(4차 중도상환일), -34%(5차 중도상환일), -40%(만기상환일) 이상인 경우 만 15.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 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%	0.04	0.03	0.02	0.01	0.00	-0.00	-0.01
	5.33%	0.04	0.03	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.02
	2.67%	0.03	0.02	0.01	0.01	-0.00	-0.01	-0.02
	0%	0.03	0.02	0.01	-0.00	-0.01	-0.02	-0.03
	-2.67%	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.01	-0.02	-0.03
	-5.33%	0.01	0.00	-0.00	-0.01	-0.02	-0.03	-0.04
	-8%	0.00	-0.00	-0.01	-0.02	-0.03	-0.04	-0.05

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

14) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.06
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모단위 파생상품투자전략 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 만기시점의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

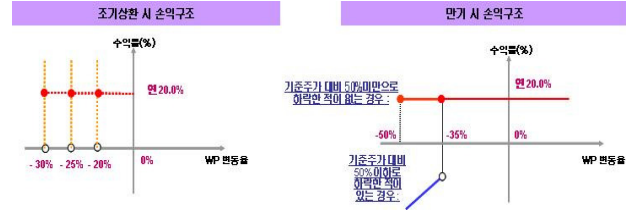
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 * 140%

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

: 할금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 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	5.33%	6.85	8.37	9.89	11.41	12.93	14.45
시나리오	-2.67%	-7.00%	-11.33%	-15.67%	-10.00%	-5.67%	-1.33%
최대 손실	-16.82	-12.86	-8.90	-4.94	-0.98	2.98	8.94

최대 손실 시나리오
위험액

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.35
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모펀위과정상물투자신탁 25호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 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 총 연율 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(장중보합)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

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	17.20	16.54	15.89	15.24	14.59	13.93	13.28
	5.33%	11.91	11.25	10.60	9.95	9.29	8.64	7.99
	2.67%	6.63	6.17	5.52	4.87	4.21	3.56	2.91
	0%	1.98	1.31	0.66	0.00	-0.65	-1.31	-1.96
	-2.67%	-2.70	-3.35	-4.00	-4.66	-5.31	-5.96	-6.61
-5.33%	-7.14	-7.79	-8.45	-9.10	-9.75	-10.41	-11.06	
-8%	-11.37	-12.02	-12.68	-13.33	-13.98	-14.64	-15.29	

최대 손실 시나리오

위험액	-15.29
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.72
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연기: 2010년 2월 22일

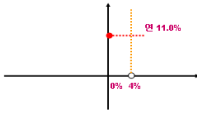
3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

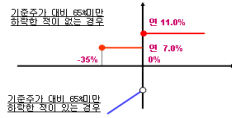
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이 상한 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확립 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 만반트 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
8%	404.96	389.22	373.49	357.75	342.01	326.27	310.53
5.33%	284.81	269.07	253.34	237.60	221.86	206.12	190.38
2.67%	165.56	149.83	134.09	118.35	102.61	86.87	71.14
0%	47.21	31.48	15.74	0.00	-15.74	-31.48	-47.21
-2.67%	-70.24	-85.97	-101.71	-117.45	-133.19	-148.93	-164.68
-5.33%	-186.79	-202.52	-218.26	-234.00	-249.74	-265.48	-281.21
-8%	-302.44	-318.17	-333.91	-349.65	-365.39	-381.13	-396.86

최대 손실 시나리오

위험액	-396.86
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	391.89
-----	--------

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

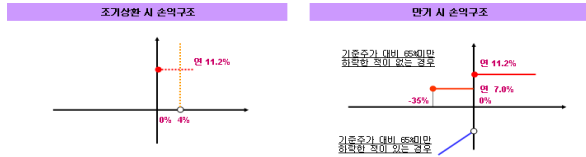
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR60034SST27 (투자유형: ELS) 2017-398회

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	38.94	37.45	35.96	34.47	32.98	31.49	30.00
시나리오	5.33%	27.35	25.66	24.37	22.88	21.39	19.90	18.41
	2.67%	15.86	14.37	12.88	11.39	9.90	8.41	6.92
	0%	4.47	2.98	1.49	0.00	-1.49	-2.98	-4.47
	-2.67%	-6.82	-8.31	-9.80	-11.29	-12.78	-14.27	-15.76
	-5.33%	-16.00	-19.49	-20.98	-22.47	-23.96	-25.45	-26.94
	-8%	-29.06	-30.57	-32.06	-33.55	-35.04	-36.53	-38.02

최대 손실 시나리오

위험액	-36.02
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	38.09
-----	-------

[9] 테리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

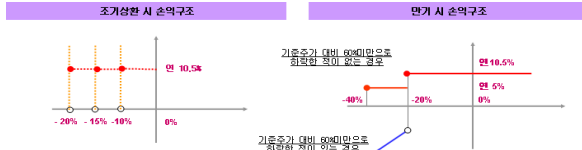
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 04월 19일
- 3) 만도침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 4월 20일 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 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 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 115%
- 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조별 최대/최소 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR600172Y743 신영투자(ELS)552

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	464.53	438.72	412.91	387.11	361.30	335.49	309.68
	5.33%	361.49	335.68	309.87	284.06	258.26	232.45	206.64
	2.67%	232.45	206.64	180.84	155.03	129.22	103.41	77.61
	0%	77.42	51.62	25.81	0.00	-25.81	-51.62	-77.42
	-2.67%	-103.60	-129.41	-155.21	-181.02	-206.83	-232.64	-258.45
	-5.33%	-310.62	-336.42	-362.23	-388.04	-413.85	-439.65	-465.46
	-8%	-543.63	-569.43	-595.24	-621.05	-646.86	-672.66	-698.47

최대 손실 시나리오

위험액	-698.47
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	815.70
-----	--------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 6월 3일

3) 만드점산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 초기 상환 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. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS/2007=504)

수익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	0.38	0.38	0.38	0.38	0.38	0.38
	5.33%	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25
	2.67%	0.12	0.12	0.12	0.12	0.12	0.12
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
수익구조범위 시나리오	-2.67%	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11
	-5.33%	-0.22	-0.22	-0.22	-0.22	-0.22	-0.22
	-8%	-0.31	-0.31	-0.31	-0.31	-0.31	-0.31

최대 손실 시나리오

위험액	-0.31
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

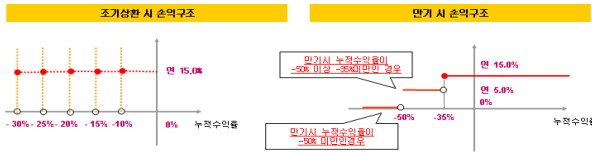
[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR603762CT80 비례예상증권(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.72	0.44	0.16	-0.12	-0.40	-0.68	-0.96
	5.33%	0.67	0.59	0.31	0.03	-0.25	-0.53	-0.81
	2.67%	0.91	0.63	0.35	0.07	-0.21	-0.49	-0.77
	0%	0.84	0.56	0.28	0.00	-0.28	-0.56	-0.84
	-2.67%	0.66	0.38	0.10	-0.18	-0.46	-0.74	-1.02
	-5.33%	0.38	0.10	-0.18	-0.46	-0.74	-1.02	-1.30
	-8%	-0.01	-0.29	-0.57	-0.85	-1.13	-1.41	-1.69

최대 손실 시나리오

위험액	-1.69
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	1.35
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제10호

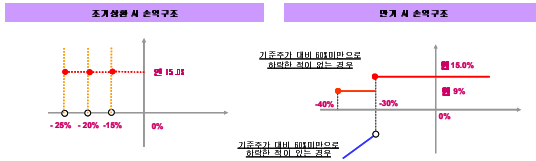
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 만기: 2009년 9월 18일
- 관드첨산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2007년 9월 19일의 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 증가
- 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 중도상환이 됨. 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762L197 미래에셋증권(ELS)219

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	310.47	308.16	305.84	303.53	301.21	298.90	296.59
손익	5.33%	225.63	223.32	221.00	218.69	216.37	214.06	211.75
시나리오	2.67%	124.46	122.14	119.83	117.51	115.20	112.88	110.57
	0%	6.94	4.63	2.31	0.00	-2.31	-4.63	-6.94
	-2.67%	-126.91	-129.22	-131.53	-133.85	-136.16	-138.48	-140.79
	-5.33%	-277.09	-279.41	-281.72	-284.04	-286.35	-288.67	-290.98
	-8%	-443.61	-445.93	-448.24	-450.56	-452.87	-455.19	-457.50

최대 손실 시나리오

위험액	-457.50
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	564.94
-----	--------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

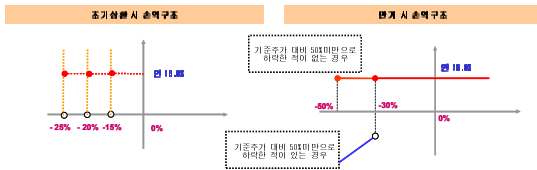
1. 계약금액

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

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 14일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(현대모비스, 삼성중공업 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 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 만드침 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가액의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 132%
 - 두 기초자산의 가액(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	106.60	104.67	102.73	100.79	98.86	96.92	94.98
시나리오	5.33%	70.64	68.70	66.76	64.82	62.89	60.95	59.01
	2.67%	37.04	35.10	33.16	31.23	29.29	27.35	25.41
	0%	6.81	5.87	4.94	4.00	3.07	2.13	1.20
	-2.67%	-23.04	-24.98	-26.92	-28.86	-30.79	-32.73	-34.67
	-5.33%	-49.53	-51.46	-53.40	-55.34	-57.28	-59.21	-61.15
	-8%	-73.64	-75.58	-77.51	-79.45	-81.39	-83.33	-85.26

최대 손실 시나리오

위험액	-85.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	84.92
-----	-------

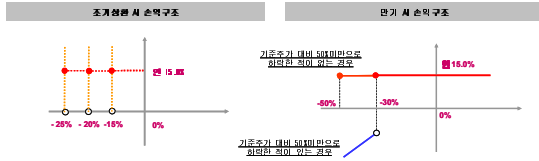
[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

1. 계약금액

						단위(백만원)	
구분	기래대상	거래유형	여수(1)	백도(2)	순포지션(1-2)	비고	
누계	유가증권	ELS	50	0	50		잔위

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762BTB0 비례예상증권(ELS)240

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	4.49	4.30	4.10	3.91	3.72	3.52	3.33
손익	5.33%	3.42	3.22	3.03	2.83	2.64	2.44	2.25
손익	2.67%	2.11	1.92	1.72	1.53	1.33	1.14	0.94
손익	0%	0.56	0.39	0.19	0.00	-0.19	-0.39	-0.56
손익	-2.67%	-1.17	-1.38	-1.56	-1.75	-1.95	-2.14	-2.34
손익	-5.33%	-3.14	-3.34	-3.53	-3.73	-3.92	-4.12	-4.31
손익	-8%	-5.35	-5.54	-5.74	-5.93	-6.12	-6.32	-6.51

최대 손실 시나리오

위험액	-6.51
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.10
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

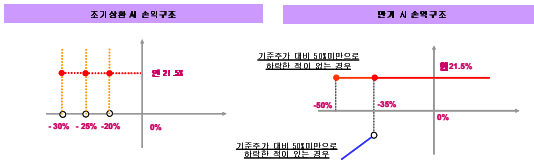
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위: 백만원)

KR600345EV11 최대 손실(ELS)2008-647

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	208.41	189.74	171.07	152.41	133.74	115.08	96.41
	5.33%	157.21	138.55	119.88	101.22	82.55	63.88	45.22
	2.67%	106.41	87.75	69.08	50.41	31.75	13.08	-5.59
	0%	56.00	37.33	18.67	0.00	-18.67	-37.33	-56.00
	-2.67%	5.98	-12.69	-31.36	-50.02	-68.69	-87.35	-106.02
-5.33%	-43.65	-62.32	-80.99	-99.66	-118.32	-136.99	-155.65	
-8%	-92.90	-111.56	-130.23	-148.89	-167.56	-186.23	-204.89	

최대 손실 시나리오

위험액	-204.89
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	208.78
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 괴생상틀 제 1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200 지수

2) 만기: 2010년 7월29일

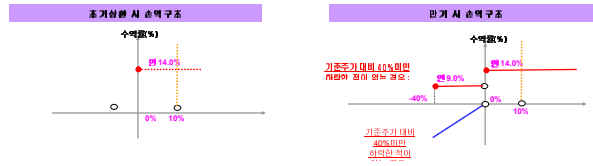
3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600690BVR2 배우증권(ELS)2660

손익 구조범틀 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
8%	350.62	336.20	321.79	307.37	292.96	278.54	264.13
5.33%	269.31	254.89	240.48	226.06	211.65	197.23	182.82
2.67%	166.85	152.43	138.02	123.60	109.19	94.78	80.36
0%	43.24	28.83	14.41	0.00	-10.01	-20.03	-30.05
-2.67%	-101.51	-119.92	-138.34	-144.75	-159.17	-173.58	-187.99
-5.33%	-267.41	-281.82	-296.24	-310.65	-325.06	-339.48	-353.89
-8%	-454.45	-468.87	-483.28	-497.70	-512.11	-526.52	-540.94

최대 손실 시나리오

위험액	-640.94
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	519.98
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위특성26호

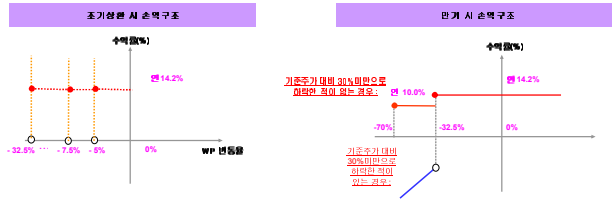
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조인 톱(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600867B1B0 쿠루남신평동원(ELS)803

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	214.12	185.02	155.92	126.82	97.72	68.63	39.53
	5.33%	171.55	142.45	113.35	84.26	55.16	26.06	-3.04
	2.67%	129.26	100.18	71.08	41.98	12.88	-18.21	-45.31
	0%	87.29	58.20	29.10	0.00	-29.10	-88.30	-87.30
	-2.67%	45.60	16.51	-12.59	-41.69	-70.79	-99.89	-128.99
-5.33%	4.20	-24.89	-53.99	-83.09	-112.19	-141.29	-170.39	
-8%	-36.90	-66.00	-95.10	-124.20	-153.30	-182.40	-211.49	

최대손실 시나리오

위험액	-211.49
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	204.63
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

1. 계약금액

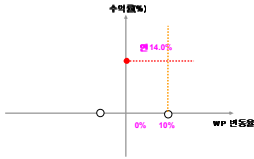
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	잔위

단위:백만원

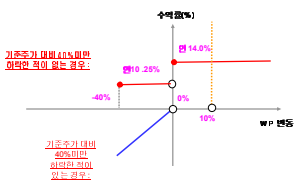
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	103.44	96.54	93.64	88.73	83.83	78.93	74.02
손익	5.33%	73.08	68.18	63.27	58.37	53.47	48.56	43.66
시나리오	2.67%	43.50	38.60	33.70	28.79	23.89	18.99	14.08
	0%	14.71	9.81	4.90	0.00	-4.90	-9.81	-14.71
	-2.67%	-13.30	-18.20	-23.10	-28.01	-32.91	-37.81	-42.72
	-5.33%	-40.52	-45.42	-50.32	-55.23	-60.13	-65.03	-69.94
	-8%	-66.95	-71.86	-76.76	-81.66	-86.57	-91.47	-96.37

최대 손실 시나리오

위험액	74.02
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	96.61
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서 5호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

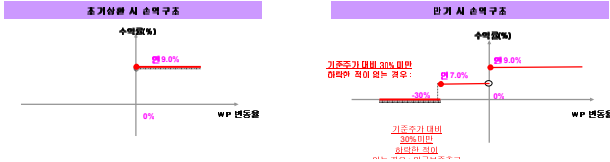
단, 평가시점에 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	5.33%	33.38	30.29	27.20	24.11	21.02	17.93	14.84
손익	2.67%	21.80	18.71	15.62	12.53	9.44	6.35	3.26
시나리오	0%	9.27	6.18	3.09	0.00	-3.09	-6.18	-9.27
	-2.67%	-4.20	-7.29	-10.38	-13.48	-16.57	-19.66	-22.75
	-5.33%	-11.63	-21.72	-24.81	-27.90	-30.99	-34.08	-37.17
	-8%	-33.99	-37.08	-40.17	-43.26	-46.35	-49.44	-52.53

최대 손실 시나리오

위험액	25.48
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	53.37
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

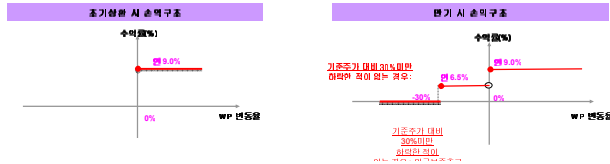
1. 계약금액

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) 만기: 2011년 2월 21일
 - 3) 만기상환결정주기: 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, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 원도 해지
- 두 기초자산의 가격이 만기도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%
 - 두 기초자산의 가격(정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금 * 100%
- 6) 만기의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR603762OV23 비례예정증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
8%	32.85	30.41	27.98	25.54	23.10	20.66	18.22	
5.33%	24.85	22.41	19.97	17.54	15.10	12.66	10.22	
2.67%	16.34	13.90	11.46	9.02	6.59	4.15	1.71	
0%	7.32	4.88	2.44	0.00	-2.44	-4.88	-7.32	
-2.67%	-2.22	-4.66	-7.10	-9.54	-11.97	-14.41	-16.85	
-5.33%	-12.27	-14.71	-17.14	-19.58	-22.02	-24.46	-26.90	
-8%	-22.83	-25.27	-27.70	-30.14	-32.58	-35.02	-37.46	

최대 손실 시나리오

위험액	18.22
-----	-------

4. 거래상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	38.15
-----	-------

[2] 메리츠주 수연계 사모단위 파생 7호

1. 계약금액

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

단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만드형산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

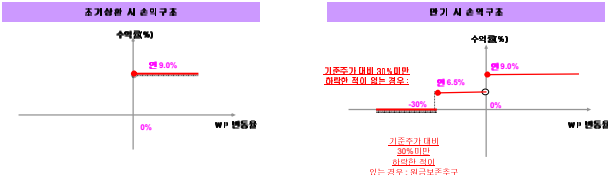
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

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

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

: 원금*100%

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	25.55	23.66	21.76	19.86	17.97	16.07	14.17
손익	19.33	17.43	15.54	13.64	11.74	9.85	7.95
시나리오	2.67%	10.81	8.92	7.02	5.12	3.23	1.33
	0%	5.69	3.79	1.90	0.00	-1.90	-3.79
	-2.67%	-1.73	-3.62	-5.52	-7.42	-9.31	-11.21
	-5.33%	-9.54	-11.44	-13.33	-15.23	-17.13	-19.02
	-8%	-17.75	-19.65	-21.55	-23.44	-25.34	-27.24

최대손실 시나리오

위험액	14.17
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.68
-----	-------

[23] 메리츠증권주연계사모파생1호

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

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 만기: 2010년 08월 04일

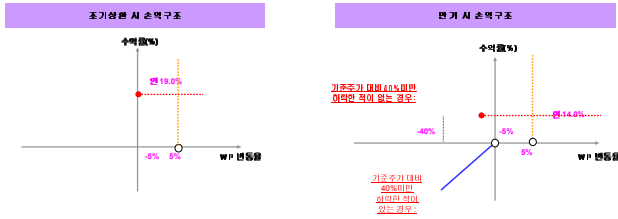
3) 만드침산 결정주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 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

- 만기시 까지 초기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률 후 만드침
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 95%보다 작은 경우 : 원금 * 138%
- 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/초기 기준지수)

6) 만드의 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%	152.92	144.30	135.68	127.06	118.44	109.83	101.21
	5.33%	110.66	102.04	93.42	84.80	76.18	67.56	58.94
	2.67%	68.30	59.68	51.06	42.45	33.83	25.21	16.59
	0%	25.86	17.24	8.62	0.00	-8.62	-17.24	-25.86
	-2.67%	-16.68	-25.30	-33.92	-42.54	-51.16	-59.78	-68.39
-5.33%	-59.31	-67.93	-76.55	-85.17	-93.79	-102.41	-111.03	
-8%	-102.04	-110.66	-119.27	-127.89	-136.51	-145.13	-153.75	

최대 손실 시나리오

위험액	-153.75
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	155.19
-----	--------

[24] 테리츠 주가지수연계사모펀드상품 제 1호

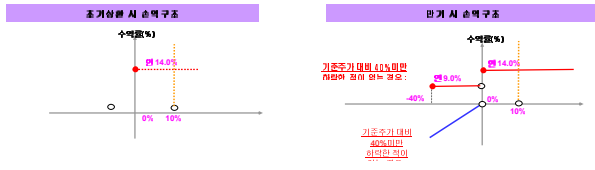
1. 계약금액

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 한반이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도 상환
 - 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격 보다 작은 경우
 - 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	429.73	412.06	394.39	376.73	359.06	341.39	323.73
	5.33%	330.07	312.40	294.74	277.07	259.40	241.74	224.07
	2.67%	204.49	186.83	169.16	151.49	133.83	116.16	98.49
	0%	53.00	35.33	17.67	0.00	-17.67	-35.33	-53.00
	-2.67%	-124.41	-142.08	-159.75	-177.41	-195.08	-212.75	-230.41
-5.33%	-327.74	-345.41	-363.08	-380.74	-398.41	-416.08	-433.74	
-8%	-556.99	-574.66	-592.33	-609.99	-627.66	-645.33	-662.99	

최대 손실 시나리오

위험액	-662.99
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	637.31
-----	--------

[26] 데리츠2Star사모파생SE SF-1

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

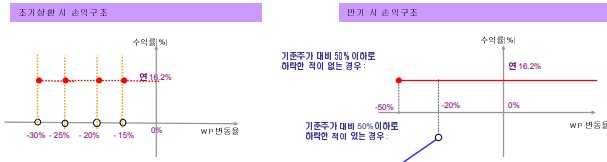
2) 만기: 2010년 09월 30일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6512302/A7 데리츠증권(ELS)713

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.26	-0.26	-0.26	-0.26	-0.26	-0.26	-0.26
	5.33%	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11
	2.67%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	0%	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
	-5.33%	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14
	-8%	-0.30	-0.30	-0.30	-0.30	-0.30	-0.30	-0.30

최대 손실 시나리오

위험액	-0.30
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.41
-----	------

[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

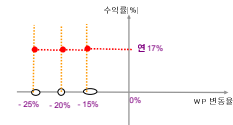
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 장외과성상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO
- 만기: 2011년 09월 23일
- 펀드청산 결정 주기: 매6개월
- 기준지수: 2008년 09월 26일 삼성전자, POSCO의 증가
- 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 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) 만일 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))

KR6572345/91 한국투자증권(ELS)1163

손익구조변동률 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	-7.18	-7.57	-7.95	-8.34	-8.72	-9.11	-9.49
	5.33%	-2.06	-2.44	-2.83	-3.21	-3.60	-3.98	-4.37
	2.67%	0.72	0.33	-0.05	-0.43	-0.82	-1.20	-1.59
	0%	-1.16	0.77	0.98	0.90	-0.38	-0.77	-1.15
	-2.67%	-0.76	-1.14	-1.53	-1.91	-2.29	-2.68	-3.06
	-5.33%	-5.01	-5.40	-5.78	-6.16	-6.55	-6.93	-7.32
	-8%	-11.61	-11.99	-12.38	-12.76	-13.15	-13.53	-13.92

최대 손실 시나리오

위험액	-13.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.99
-----	------

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

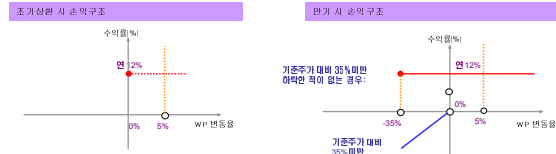
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액금(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	372	0	372	잔위

단위: 백만원

2. 만기시점의 수익구조

- 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 만기: 2010년 09월 20일
 - 펀드청산 결정 주기: 매3개월
 - 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가
 - 발행 후 매 3개월마다 중도 상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 5%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시(8차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한변도 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



3. 수익구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

수익구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

[34] 대리초주가지수연계파생13

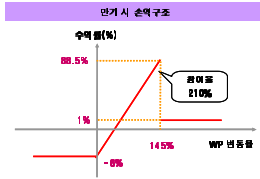
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-84.56	-91.87	-99.18	-106.50	-113.81	-121.12	-128.43
시나리오	5.33%	-46.15	-53.46	-60.77	-68.08	-75.40	-82.71	-90.02
	2.67%	-10.65	-17.96	-25.27	-32.58	-39.90	-47.21	-54.52
	0%	21.94	14.63	7.31	0.00	-7.31	-14.63	-21.94
	-2.67%	51.61	44.30	36.98	29.67	22.36	15.05	7.73
	-5.33%	78.36	71.05	63.74	56.43	49.11	41.80	34.49
	-8%	102.21	94.89	87.58	80.27	72.96	65.64	58.33

최대손실 시나리오

위험액	58.33
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	119.35
-----	--------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

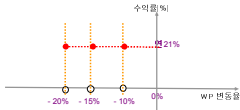
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

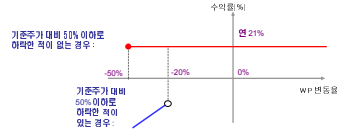
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	10.05	8.41	6.77	5.13	3.49	1.86	0.22
손익	5.33%	9.15	7.51	5.87	4.23	2.59	0.95	-0.68
시나리오	2.67%	7.43	5.80	4.16	2.52	0.88	-0.76	-2.39
최대 손실	0%	4.91	3.28	1.64	0.00	-1.64	-3.28	-4.91
위험액	-2.67%	1.59	-0.05	-1.69	-3.33	-4.97	-6.61	-8.24
	-5.33%	-2.95	-4.19	-5.63	-7.47	-9.11	-10.74	-12.38
	-8%	-7.50	-9.14	-10.78	-12.42	-14.06	-15.69	-17.33

최대 손실 시나리오

위험액	-17.33
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.92
-----	-------

[80-1] 메리츠주가지수연계시도증권2호
KR600594DVL1 우리투자증권(ELS)2136

1. 계약금액

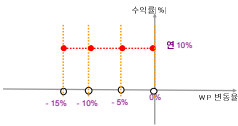
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

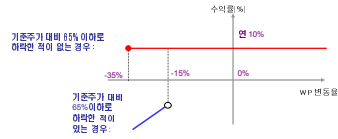
2. 연기사실의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동/최대손실가능금액(단위:백만원)

메리츠주가지수연계시도증권2호

손익구조변동 시나리오

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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

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

1. 계약금액

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

단위(백만원)

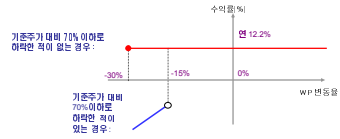
2. 연기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



반기 시 손익구조



[60-3] 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)

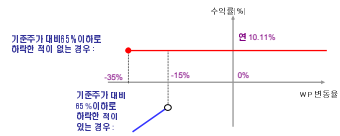
2. 연가시점의 손익구조

- 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 손익구조



[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	잔위

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장의파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만기점산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

낮은기초자산기준으로 각각 최초기준가격의 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, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익확정 후 만드 해지

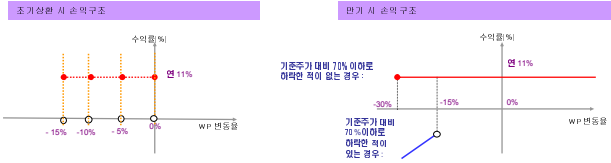
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

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

: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



[80-5] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR6008679V84 롯데당 신안증권(ELS)931

1. 계약금액

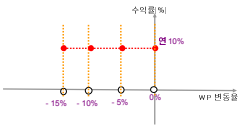
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔위

단위(백만원)

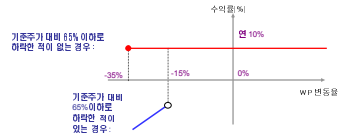
2. 연기시점의 손익구조

- 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] 메리츠투자지수형계사로증권2호
 KR600867AV62 메리츠신안증권(ELS)899

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

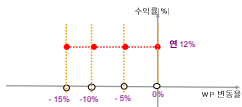
2) 만기: 2009년 6월 12일

3) 펀드청산결정주기: 매3개월

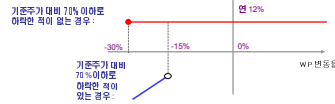
4) 기 준지수: 2008년 6월 10일 KOSPI200지수의 증가

- 5) 발행 후 매3개월 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 가격 이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

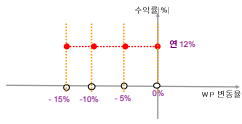
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위(백만원)

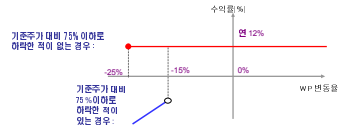
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[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. 만기시점의 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 한반드 기 준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 85%보다 작은 경우

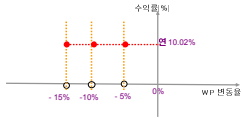
: 원금 * 110.02%

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

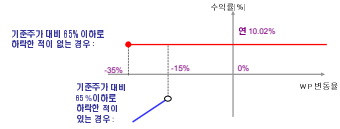
: 원금 * (만기기 준지수/최 초기 준지수)

6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

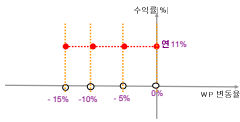
1. 계약금액

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

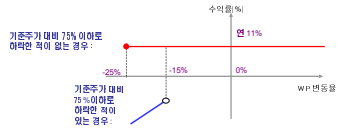
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 증권파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 5월 14일
- 3) 권드청산 결정 주기: 매3개월
- 4) 기 준지 수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기 초자산기 준으로 각각 최초 기 준가액의 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 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기 초자산의 가액이 한반드 기 준가액의 75%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가액의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 111%
 - 두 기 초자산의 가액(장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가액의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 준지 수/최 초기 준지 수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] **메리츠투자자산운용계사로증권2호**

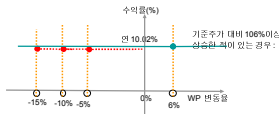
1. 계약금액

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

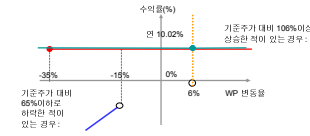
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2011년 5월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가격이 낮은 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 한반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 20.04%
- 두 기초자산의 가격(장중로환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[6] 데리츠2Star사로증권투자LEHC-2

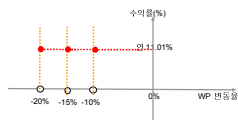
1. 계약금액

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

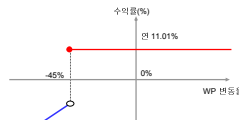
2. 만기시점의 손익구조

- 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 중도상환기 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 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 끝드 해지
 → 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우
 : 원금 * 111.01%
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우
 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 끝드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조인용(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR66923071445 NA투자증권(ELS)32

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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[62] 데리츠2SIa사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

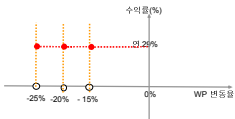
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위: (백만원)

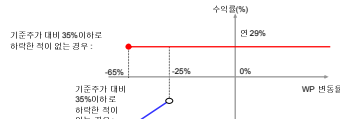
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융지주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 만할 29%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 129%
 - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 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%	-4.62	-5.38	-6.14	-6.90	-7.67	-8.43	-9.19
	5.33%	-2.95	-3.71	-4.47	-5.23	-5.99	-6.75	-7.52
	2.67%	-0.65	-1.41	-2.17	-2.93	-3.69	-4.45	-5.22
	0%	2.28	1.52	0.76	0.00	-0.76	-1.52	-2.28
손익구조변동 시나리오	-2.67%	5.84	5.08	4.32	3.56	2.80	2.04	1.27
	-5.33%	10.03	9.27	8.51	7.75	6.99	6.22	5.46
	-8%	14.85	14.09	13.33	12.57	11.80	11.04	10.28

최대 손실 시나리오

위험액	10.28
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	13.19
-----	-------

[68] 데리츠2Star사로증권LEHC-1호

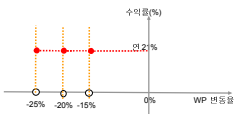
1. 계약금액

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

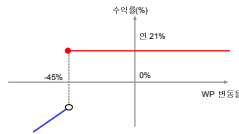
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시점 수익구조



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 시나리오	8%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
-8%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01

최대 손실 시나리오

위험액	0.01
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	0.00
-----	------

[67] 데리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

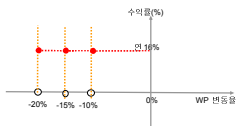
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	837.0	0	837	잔위

단위(백만원)

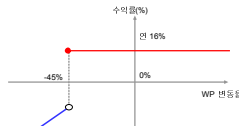
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO
- 2) 만기: 2012년 4월 16일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 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))
KR6562340W48 유린투기증권(ELS)2405

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	-0.54	-0.62	-1.10	-1.38	-1.66	-1.95	-2.23
산	5.33%	0.65	0.37	0.09	-0.19	-0.47	-0.75	-1.04
시나리오	2.67%	1.11	0.83	0.55	0.27	-0.01	-0.29	-0.58
	0%	0.64	0.56	0.28	0.00	-0.28	-0.56	-0.84
	-2.67%	-0.15	-0.44	-0.72	-1.00	-1.28	-1.56	-1.84
	-5.33%	-1.88	-2.17	-2.45	-2.73	-3.01	-3.29	-3.57
	-8%	-4.34	-4.62	-4.91	-5.19	-5.47	-5.75	-6.03

최대 손실 시나리오

위험액	-6.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	8.15
-----	------

[65] 데리츠2Star사로 증권POKB-2호

1. 계약금액

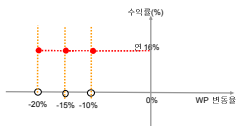
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50	창의

단위(백만원)

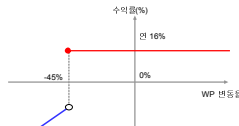
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO
- 2) 만기: 2012년 4월 16일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 90% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85% 이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 효력을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 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%	-0.03	-0.05	-0.07	-0.08	-0.10	-0.12	-0.13
산	5.33%	0.04	0.02	0.01	-0.01	-0.03	-0.05	-0.06
시나리오	2.67%	0.07	0.05	0.03	0.02	-0.00	-0.02	-0.03
	0%	0.05	0.03	0.02	0.00	-0.02	-0.05	-0.05
	-2.67%	-0.01	-0.03	-0.04	-0.06	-0.08	-0.09	-0.11
	-5.33%	-0.11	-0.13	-0.15	-0.16	-0.18	-0.20	-0.21
	-8%	-0.26	-0.28	-0.29	-0.31	-0.33	-0.34	-0.36

최대 손실 시나리오

위험액	-0.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	0.49
-----	------

[67] 데리츠2Star사로 증권SEST-

1. 계약금액

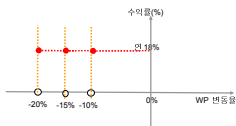
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

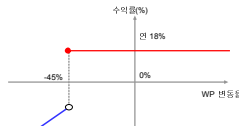
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85% 이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	6.73	3.75	-1.24	-6.23	-11.22	-16.21	-21.20
손익	5.33%	14.26	9.27	4.28	-0.71	-5.70	-10.68	-15.67
시나리오	2.67%	16.34	11.35	6.36	1.37	-3.62	-8.61	-13.60
	0%	14.97	9.98	4.99	0.00	-4.99	-9.98	-14.97
	-2.67%	10.15	5.16	0.17	-4.62	-9.61	-14.60	-19.59
	-5.33%	1.88	-3.11	-8.10	-13.08	-18.07	-23.06	-28.05
	-8%	-9.83	-14.82	-19.81	-24.80	-29.79	-34.78	-39.76

최대 손실 시나리오

위험액	-39.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	48.57
-----	-------

[68] 데리츠2Star사로 증권SE ST-4호

1. 계약금액

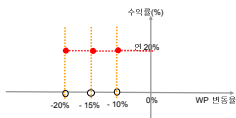
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	500.0	0	500	차입

단위(백만원)

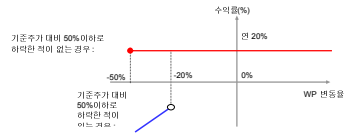
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 06일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 120%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (다위:백만원))
KR6622303W44 : 코보증권(ELS)322

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.03	-0.33	-1.70	-3.07	-4.43	-5.80	-7.17
시나리오	5.33%	3.52	2.15	0.79	-0.58	-1.95	-3.32	-4.68
	2.67%	4.54	3.18	1.81	0.44	-0.93	-2.29	-3.66
	0%	4.10	2.73	1.37	0.00	-1.37	-2.73	-4.10
	-2.67%	2.20	0.83	-0.54	-1.91	-3.27	-4.64	-6.01
	-5.33%	-1.17	-2.54	-3.91	-5.27	-6.64	-8.01	-9.38
	-8%	-6.00	-7.37	-8.74	-10.11	-11.47	-12.84	-14.21

최대 손실 시나리오

위험액	-14.21
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	15.62
-----	-------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

1. 계약금액

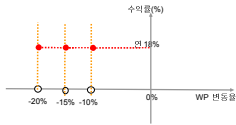
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	차입

단위(백만원)

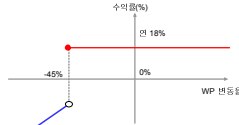
2. 만기시점의 손익구조

- 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 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.80	2.06	-0.66	-3.43	-6.17	-8.92	-11.66
시나리오	5.33%	7.84	5.10	2.36	-0.39	-3.13	-5.88	-8.62
	2.67%	8.99	6.24	3.50	0.75	-1.99	-4.73	-7.48
	0%	6.23	5.49	2.74	0.00	-2.74	-5.49	-8.23
	-2.67%	5.58	2.84	0.09	-2.65	-5.39	-8.14	-10.88
	-5.33%	1.04	-1.71	-4.45	-7.20	-9.94	-12.69	-15.43
	-8%	-5.41	-8.15	-10.90	-13.64	-16.39	-19.13	-21.87

최대 손실 시나리오

위험액	-21.87
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	26.72
-----	-------

[77] 데리츠2SIa사모SEST-3

1. 계약금액

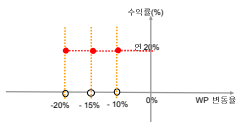
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241.4	0	241	차입

단위(백만원)

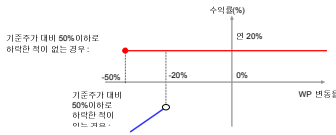
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))

KR6562345W35 유인투기증권 (ELS)2382

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	1.56	0.33	-0.90	-2.13	-3.36	-4.59	-5.82
	5.33%	3.41	2.18	0.94	-0.29	-1.52	-2.75	-3.98
시나리오	2.67%	4.12	2.89	1.65	0.42	-0.81	-2.04	-3.27
	0%	3.69	2.46	1.23	0.00	-1.23	-2.46	-3.69
	-2.67%	2.14	0.91	-0.32	-1.65	-2.79	-4.02	-5.25
	-5.33%	-0.55	-1.78	-3.01	-4.24	-5.47	-6.71	-7.94
	-8%	-4.37	-5.60	-6.83	-8.06	-9.29	-10.52	-11.76

최대 손실 시나리오

위험액	-11.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	11.04
-----	-------

[78] 데리츠2SIa사모STWF-2

1. 계약금액

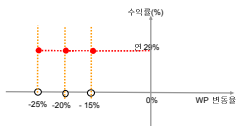
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	잔위

단위(백만원)

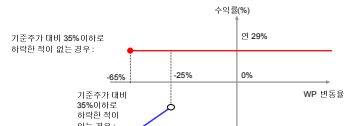
2. 만기시점의 손익구조

- 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 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 129%
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (다위:백만원))

KR6622313W42 : 코분종권(ELS)325

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-4.02	-4.68	-5.35	-6.01	-6.67	-7.34	-8.00
	5.33%	-2.57	-3.23	-3.89	-4.55	-5.22	-5.88	-6.54
	2.67%	-0.56	-1.22	-1.89	-2.55	-3.21	-3.88	-4.54
손익	0%	1.99	1.33	0.66	0.00	-0.66	-1.33	-1.99
시나리오	-2.67%	9.09	4.42	3.76	3.10	2.44	1.77	1.11
	-5.33%	8.73	8.07	7.41	6.75	6.08	5.42	4.76
	-8%	12.93	12.27	11.60	10.94	10.28	9.61	8.95

최대 손실 시나리오

위험액	8.95
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	11.48
-----	-------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

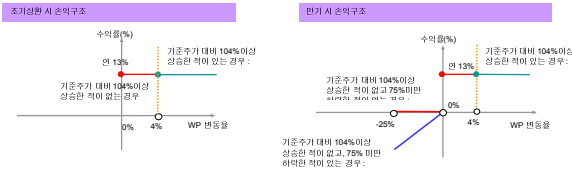
1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 평가시점의 수익구조

- 1) 평가대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 12월 13일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
 - 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가
 - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 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/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 수익구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

수익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	6.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	9,407.83	8,864.50	8,321.17	7,777.84	7,234.51	6,691.18	6,147.86
	5.33%	6,811.82	6,268.49	5,725.16	5,181.83	4,638.50	4,095.17	3,551.84
	2.67%	4,219.20	3,675.87	3,132.54	2,589.21	2,045.88	1,502.56	959.23
	0%	1,628.99	1,086.66	543.33	0.00	-543.33	-1,086.66	-1,628.99
	-2.67%	-935.83	-1,499.16	-2,042.46	-2,585.69	-3,129.14	-3,672.47	-4,215.80
	-5.33%	-3,538.24	-4,081.57	-4,624.90	-5,168.23	-5,711.56	-6,254.88	-6,798.21
	-8%	-6,117.25	-6,660.58	-7,203.91	-7,747.24	-8,290.57	-8,833.90	-9,377.23

최대손실 시나리오

위험액	-9,377.23
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,315.34
-----	----------

[79-2] **메리츠투자지수연계사모8호**

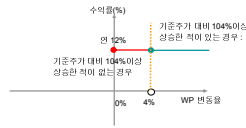
1. 계약금액

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

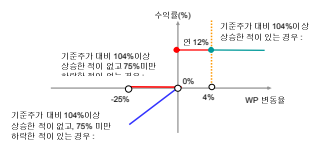
2. 만기시점의 수익구조

- 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

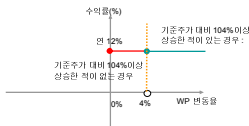
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔위

단위:백만원

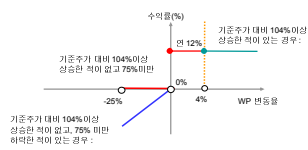
2. 평가시점의 손익구조

- 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 (1)과 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 (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

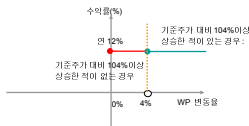
1. 계약금액

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

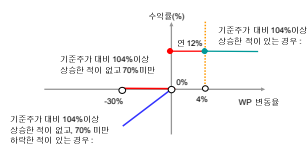
2. 만기시점의 수익구조

- 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

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6008679TA3 곳님 신원증권(ELS)786

[79-5] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

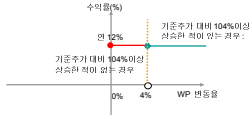
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 10일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

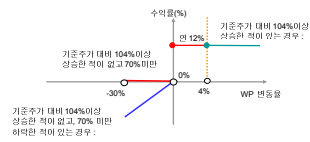
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008676TB7 코트님 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계서표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

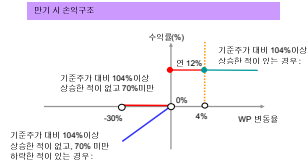
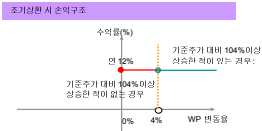
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 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 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



[79-7] 에리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

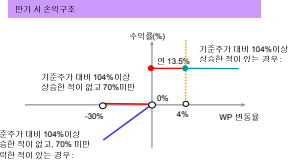
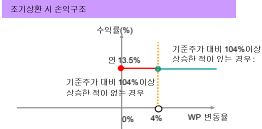
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 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 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 일반도 기준가격의 65%이만으로 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



KR6008675TC7 곳모닝 신환증권(ELS)809

[79-8] 에리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

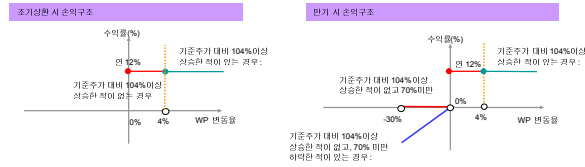
2. 만기시점의 손익구조

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

단, 만기시 (1차 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 (장중 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] 에리츠주가지수연계사료8호

1. 계약금액

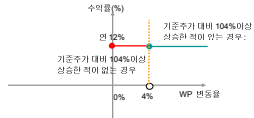
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	상위

단위(백만원)

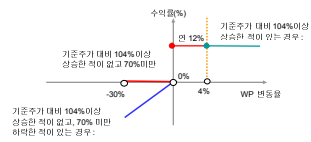
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포함하여 한 번이라도 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%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 메리츠투자지수연계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

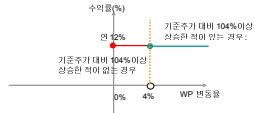
- 1) 평가대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지 수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

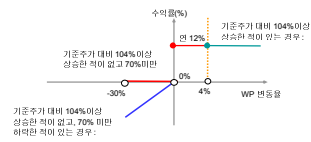
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

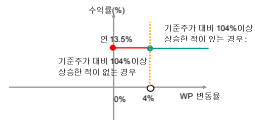
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	장외

단위(백만원)

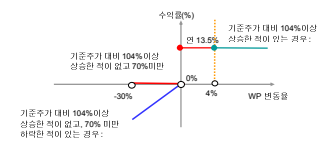
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 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		상환

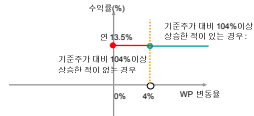
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지 수)이 조기 상환결 정일에 최초기 준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기 준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도 상환

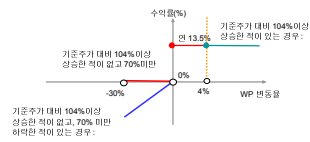
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 할빈도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우
 : 원금 + 11.3.5%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 + (만기기 준지수/최초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

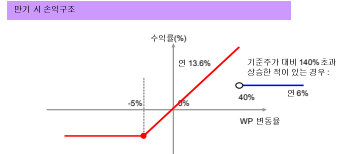
1. 계약금액

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6523317W30 (대우증권ELS2881)

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지수	8%	-6.65	-7.22	-7.60	-7.97	-8.34	-8.72	-9.09
손익	5.33%	-4.12	-4.49	-4.86	-5.24	-5.61	-5.99	-6.36
시나리오	2.67%	-1.46	-1.83	-2.21	-2.58	-2.95	-3.33	-3.70
	0%	1.12	0.75	0.37	0.00	-0.37	-0.75	-1.12
	-2.67%	3.63	3.25	2.88	2.50	2.13	1.76	1.38
	-5.33%	6.05	5.68	5.31	4.93	4.56	4.18	3.81
	-8%	8.41	8.03	7.66	7.28	6.91	6.54	6.16

최대 손실 시나리오

위험액	6.16
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.10
-----	-------

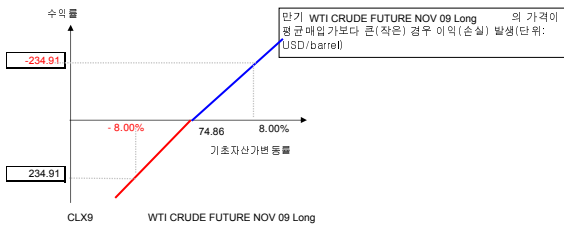
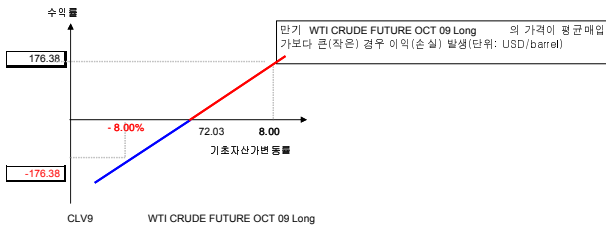
[80] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연기시점의 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%	411.29
	5.33%	274.02
	2.67%	137.27
	0%	0.00
	-2.67%	-137.27
	-5.33%	-274.02
	-8%	-411.29

최대손실 시나리오	
위험액	-411.29

4. 특정상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,666
-----	-------

[79] 데리 초주가지 수연계사모증권!61E

1. 계약금액

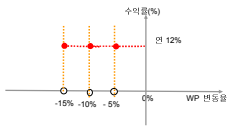
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위:백만원

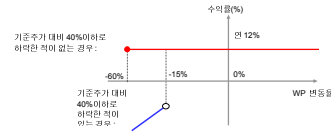
2. 연가시점의 손익구조

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

조기상환시 손익구조



반기시 손익구조



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

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-1.27	-1.27	-1.27	-1.27	-1.27	-1.27	-1.27
	5.33%	-0.57	-0.57	-0.57	-0.57	-0.57	-0.57	-0.56
산	2.67%	-0.15	-0.15	-0.15	-0.14	-0.14	-0.14	-0.14
	0%	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
시나리오	-2.67%	-0.14	-0.13	-0.13	-0.13	-0.13	-0.13	-0.13
	-5.33%	-0.55	-0.55	-0.55	-0.54	-0.54	-0.54	-0.54
	-8%	-1.24	-1.24	-1.23	-1.23	-1.23	-1.23	-1.23

최대 손실 시나리오

위험액	-1.23
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.10
-----	------

[80] 대리 조주가지 수연계 사모증권10호

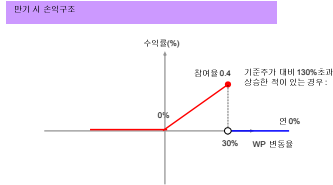
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 5월 07일
- 3) 펀드청산 결정주기: 만기 전 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 5월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최저 기준가격의 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%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6673105W54 동부증권-에프플러스(ELS)B1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-7.15	-9.46	-11.77	-14.08	-16.39	-18.70	-21.01
산	5.33%	-1.95	-4.26	-6.57	-8.88	-11.19	-13.50	-15.81
시나리오	2.67%	2.75	0.44	-1.87	-4.18	-6.49	-8.80	-11.11
오	0%	6.93	4.62	2.31	0.00	-2.31	-4.62	-6.93
	-2.67%	10.60	8.29	5.98	3.67	1.36	-0.95	-3.26
	-5.33%	13.76	11.45	9.14	6.83	4.52	2.21	-0.10
	-8%	16.41	14.10	11.79	9.48	7.17	4.86	2.55

최대 손실 시나리오

위험액	2.55
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	19.96
-----	-------

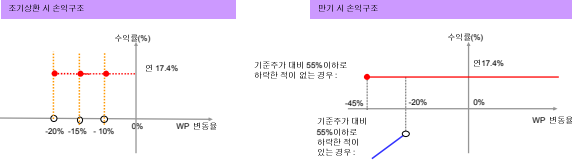
[82] 데리츠2Star사모증권SE-ST-8호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 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%	6.42	5.60	4.77	3.94	3.11	2.28	1.46
	5.33%	5.91	5.09	4.26	3.43	2.60	1.78	0.95
시나리오	2.67%	4.60	3.77	2.95	2.12	1.29	0.46	-0.37
	0%	2.48	1.66	0.83	0.00	-0.83	-1.66	-2.48
	-2.67%	-0.44	-1.27	-2.09	-2.92	-3.75	-4.58	-5.40
	-5.33%	-4.16	-4.99	-5.82	-6.65	-7.47	-8.30	-9.13
	-8%	-8.69	-9.52	-10.35	-11.17	-12.00	-12.83	-13.66

최대 손실 시나리오

위험액	-13.66
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.36
-----	-------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

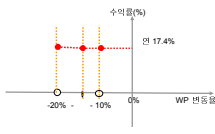
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

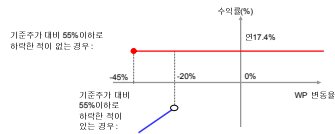
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액)(단위:백만원)

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	41.28	35.96	30.64	25.32	20.00	14.68	9.36
손실	5.33%	38.01	32.69	27.37	22.05	16.73	11.41	6.09
시나리오	2.67%	29.56	24.24	18.92	13.60	8.28	2.96	-2.35
	0%	16.96	10.64	4.32	0.00	-3.32	-10.64	-16.96
	-2.67%	-2.81	-8.13	-13.45	-18.77	-24.09	-29.41	-34.73
	-5.33%	-26.74	-32.06	-37.38	-42.70	-48.02	-53.34	-58.66
	-8%	-55.84	-61.16	-66.48	-71.80	-77.12	-82.44	-87.76

최대 손실 시나리오

위험액	-87.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	92.24
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

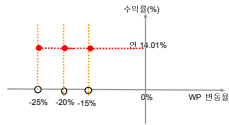
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위: (백만원)

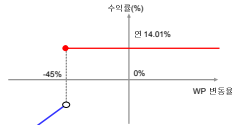
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백 만원)

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산	8%	-0.24	-0.24	-0.25	-0.25	-0.25	-0.26
	5.33%	-0.09	-0.09	-0.10	-0.10	-0.10	-0.11
시나리오	2.67%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.02	-0.02	-0.02
	0%	0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.04	-0.05	-0.05	-0.05	-0.06	-0.06
	-5.33%	-0.16	-0.16	-0.17	-0.17	-0.17	-0.18
	-8%	-0.35	-0.35	-0.35	-0.36	-0.36	-0.36

최대 손실 시나리오

위험액	-0.36
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	0.49
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEPO-1호

1. 계약금액

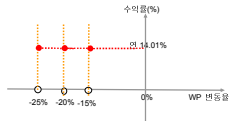
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

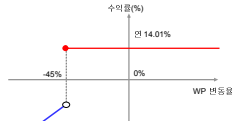
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6662305W64 한화스마트(ELS)132

		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	-0.66	-0.66	-0.69	-0.90	-0.91	-0.92	-0.93
	5.33%	-0.33	-0.34	-0.35	-0.36	-0.37	-0.38	-0.38
	2.67%	-0.03	-0.04	-0.05	-0.06	-0.07	-0.08	-0.08
	0%	0.00	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.02	-0.03
	-2.67%	-0.16	-0.17	-0.18	-0.19	-0.19	-0.20	-0.21
	-5.33%	-0.50	-0.59	-0.60	-0.61	-0.62	-0.63	-0.63
	-8%	-1.25	-1.26	-1.27	-1.28	-1.28	-1.29	-1.30

최대 손실 시나리오

위험액	-1.30
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.76
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-1호

1. 계약금액

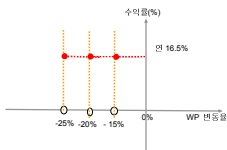
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	649.0	0	649.0	잔위

단위:백만원

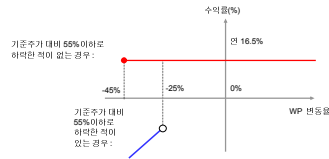
2. 만기시점의 손익구조

- 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 환위스프레드(ELS)127

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[87] 데리츠2SIa사모증권SEKT-이 호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

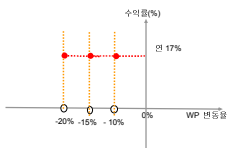
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

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.

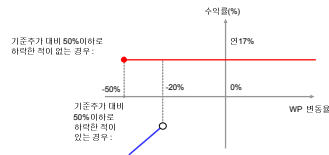
- 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117%
 - 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6562319W52 주권 투기증권 (ELS)2415

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	0.29	0.01	-0.26	-0.56	-0.85	-1.14	-1.42
손익	5.33%	0.92	0.63	0.34	0.06	-0.23	-0.51	-0.80
시나리오	2.67%	1.10	0.82	0.53	0.25	-0.04	-0.32	-0.61
	0%	0.86	0.57	0.29	0.00	-0.29	-0.57	-0.86
	-2.67%	0.17	-0.11	-0.40	-0.68	-0.97	-1.25	-1.54
	-5.33%	-0.94	-1.23	-1.51	-1.80	-2.09	-2.37	-2.66
	-8%	-2.50	-2.78	-3.07	-3.35	-3.64	-3.92	-4.21

최대 손실 시나리오

위험액	-4.21
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	3.48
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

1. 계약금액

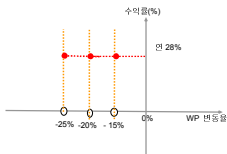
구분		거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS		462.0	0	462.0	차입

단위: (백만원)

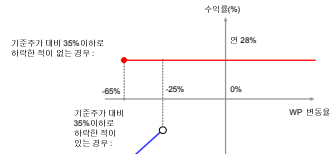
2. 만기시점의 손익구조

- 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 환펀드 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 구조표의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백 만원))
KR6622309W55 코분증권(ELS)344

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	5.33%	49.30	37.19	25.08	12.97	0.86	-11.25	-23.36
산	2.67%	43.03	30.92	18.81	6.70	-5.41	-17.52	-29.63
시나리오	0%	36.33	24.22	12.11	0.00	-12.11	-24.22	-36.33
	-2.67%	29.20	17.09	4.96	-7.13	-19.24	-31.35	-43.46
	-5.33%	21.65	9.54	-2.51	-14.68	-26.79	-38.90	-51.01
	-8%	13.67	1.56	-10.55	-22.66	-34.77	-46.88	-58.99

최대 손실 시나리오

위험액	-58.99
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	54.75
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO

2) 만기: 2012년 5월 11일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우

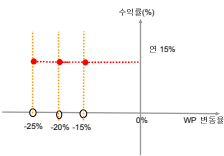
: 원금 * 115%

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

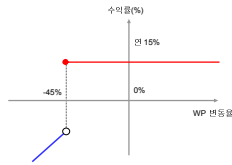
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.15	0.12	0.09	0.06	0.03	-0.00	-0.03
시나리오	5.33%	0.16	0.13	0.10	0.07	0.04	0.00	-0.03
	2.67%	0.14	0.11	0.08	0.05	0.02	-0.02	-0.05
	0%	0.08	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.09
	-2.67%	0.02	-0.01	-0.04	-0.07	-0.11	-0.14	-0.17
	-5.33%	-0.06	-0.11	-0.14	-0.17	-0.21	-0.24	-0.27
	-8%	-0.21	-0.24	-0.27	-0.30	-0.33	-0.36	-0.40

최대 손실 시나리오

위험액	-0.40
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.44
-----	------

[90] 데리츠2Star사로증권POLE-이 호

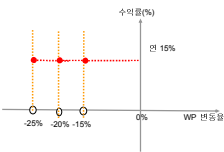
1. 계약금액

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

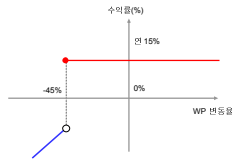
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 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 시나리오	8%	11.72	9.34	6.96	4.57	2.19	-0.19	-2.57
	5.33%	12.24	9.65	7.47	5.09	2.71	0.32	-2.06
	2.67%	10.71	8.33	5.95	3.56	1.18	-1.20	-3.58
	0%	7.15	4.77	2.38	0.00	-2.08	-4.77	-7.15
	-2.67%	1.55	-0.84	-3.22	-5.60	-7.99	-10.37	-12.75
	-5.33%	-6.10	-8.48	-10.86	-13.25	-15.63	-18.01	-20.39
	-8%	-15.78	-18.16	-20.54	-22.93	-25.31	-27.69	-30.08

최대 손실 시나리오

위험액	-30.08
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	33.47
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

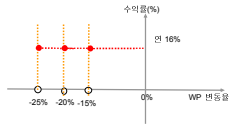
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	잔위

단위:백만원

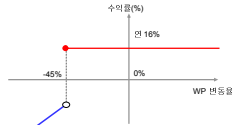
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 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%	0.33	0.28	0.22	0.17	0.12	0.06	0.01
시나리오	5.33%	0.30	0.25	0.19	0.14	0.09	0.04	-0.02
	2.67%	0.24	0.19	0.14	0.09	0.03	-0.02	-0.07
	0%	0.16	0.11	0.06	0.00	-0.05	-0.11	-0.16
	-2.67%	0.04	-0.01	-0.06	-0.11	-0.17	-0.22	-0.27
	-5.33%	-0.10	-0.15	-0.21	-0.26	-0.31	-0.36	-0.42
	-8%	-0.27	-0.33	-0.38	-0.43	-0.48	-0.54	-0.59

최대 손실 시나리오

위험액	-0.59
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.38
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

1. 계약금액

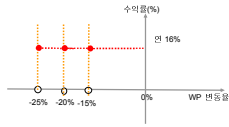
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

단위:백만원

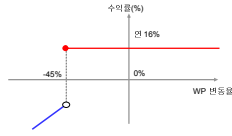
2. 만기시점의 손익구조

- 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, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 10%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 평균 * 110%
→ 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

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	5.67	4.92	3.97	3.03	2.08	1.13	0.18
	5.33%	5.39	4.44	3.49	2.54	1.59	0.64	-0.31
시나리오	2.67%	4.38	3.43	2.48	1.53	0.58	-0.37	-1.31
	0%	2.85	1.90	0.95	0.00	-0.95	-1.90	-2.85
	-2.67%	0.79	-0.16	-1.11	-2.06	-3.00	-3.95	-4.90
	-5.33%	-1.79	-2.74	-3.68	-4.63	-5.58	-6.53	-7.48
	-8%	-4.89	-5.84	-6.78	-7.73	-8.68	-9.63	-10.58

최대 손실 시나리오

위험액	-10.58
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.79
-----	------

[93] 데리츠2Star사로증권LEHC-3

1. 계약금액

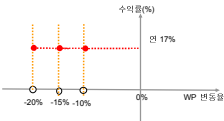
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	잔위

단위: (백만원)

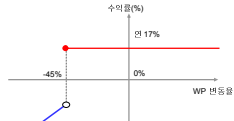
2. 만기시점의 손익구조

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

조가상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.16	-0.39	-0.60	-0.81	-1.02	-1.23	-1.43
	5.33%	0.39	0.18	-0.02	-0.23	-0.44	-0.65	-0.86
	2.67%	0.66	0.45	0.24	0.04	-0.17	-0.38	-0.59
시나리오	0%	0.63	0.42	0.21	0.00	-0.21	-0.42	-0.63
	-2.67%	0.28	0.08	-0.13	-0.34	-0.55	-0.76	-0.97
	-5.33%	-0.36	-0.57	-0.78	-0.99	-1.20	-1.41	-1.62
	-8%	-1.32	-1.52	-1.73	-1.94	-2.15	-2.36	-2.57

최대 손실 시나리오

위험액	-2.57
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	6.94
-----	------

[94] 테라츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

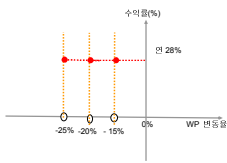
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순보지선(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	잔액

단위: (백만원)

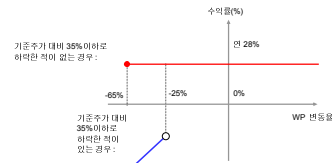
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주
- 2) 만기: 2012년 4월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 30일 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(현대차 보통주, 삼성증권업 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일))만을 28%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요인을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 128%
 - 두 기초자산의 가액 (장종료일)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)
KR6622301W53 코보증권(ELS)336

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	38.25	29.93	21.61	13.28	4.96	-3.36	-11.68
손실	5.33%	35.11	26.79	18.47	10.15	1.82	-6.50	-14.82
시나리오	2.67%	30.68	22.36	14.04	5.72	-2.60	-10.93	-19.25
	0%	24.97	16.64	8.32	0.00	-8.32	-18.64	-24.97
	-2.67%	17.96	9.64	1.31	-7.01	-13.33	-23.65	-31.98
	-5.33%	9.66	1.34	-6.99	-15.31	-23.63	-31.96	-40.27
	-8%	0.07	-8.25	-16.58	-24.90	-33.22	-41.54	-49.86

최대 손실 시나리오

위험액	-49.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	57.27
-----	-------

[95] 데리츠1Star사모증권BE-1호

1. 계약금액

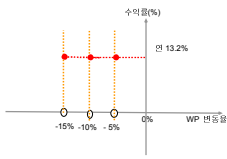
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1810.3	0	1,810.3	잔위

단위: (백만원)

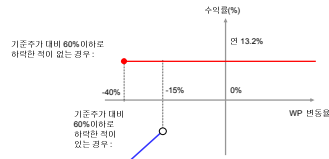
2. 만기시점의 손익구조

- 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 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산가액으로 각각 최초 기준가액의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 연율 13.2%의 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

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

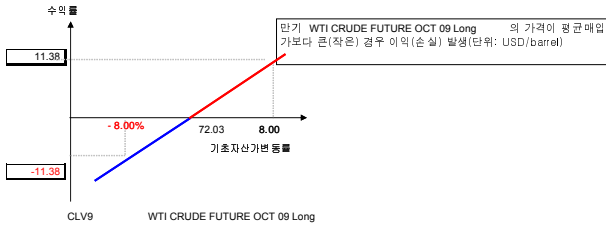
[96] 데리츠WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	11.38
	5.33%	7.58
	2.67%	3.80
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.80
	-5.33%	-7.58
	-8%	-11.38

최대손실 시나리오	
위험액	-11.38

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	45
-----	----

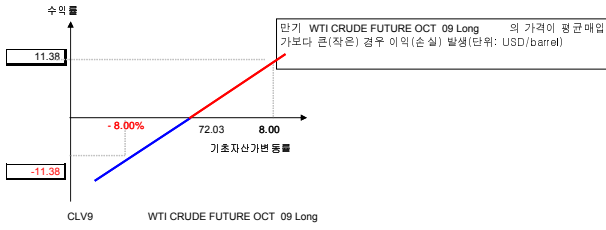
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	32.07
	5.33%	21.36
	2.67%	10.70
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-10.70
	-5.33%	-21.36
	-8%	-32.07

최대 손실 시나리오	
위험액	-32.07

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	130
-----	-----

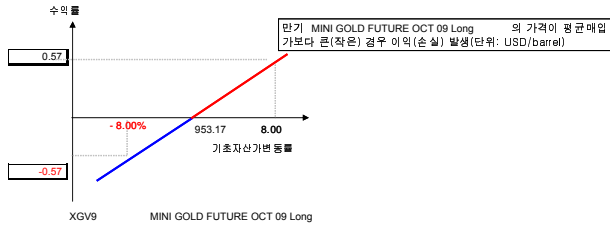
[96-2] 헤지 초 Premium Commodity 특별 자산1

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



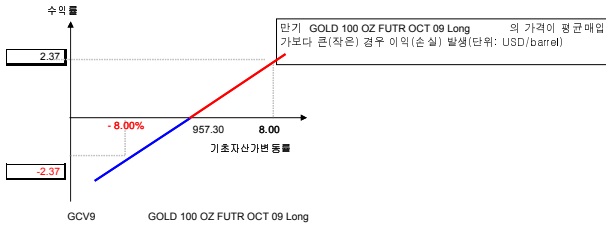
[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



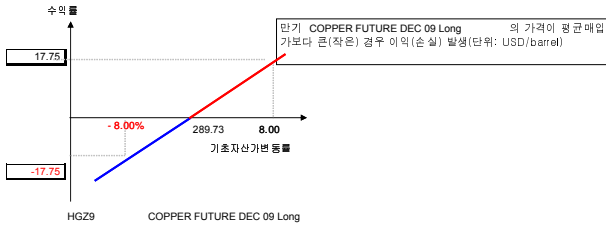
[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 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

