

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

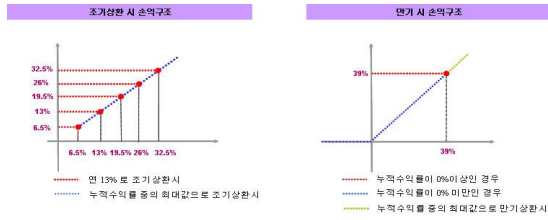
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권[ELS]1264

손익구조변동률 시나리오

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

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.06
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.07
-----	------

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) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.04
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.16
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모단위파생상품투자신탁 24호

1. 계약금액

구분	거래대상	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 기일을 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 한방도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 * 140%

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

: 할금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 만드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력정보증권(ELS)24호

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	7.64	7.25	6.85	6.46	6.06	5.66	5.27
	5.33%	5.93	5.53	5.14	4.74	4.34	3.95	3.55
시나리오	2.67%	3.78	3.38	2.98	2.59	2.19	1.80	1.40
	0%	1.19	0.79	0.40	0.00	-0.40	-0.79	-1.19
	-2.67%	-1.84	-2.23	-2.63	-3.03	-3.42	-3.82	-4.21
	-5.33%	-5.30	-5.70	-6.09	-6.49	-6.88	-7.28	-7.68
	-8%	-9.20	-9.60	-9.99	-10.39	-10.79	-11.18	-11.58

최대 손실 시나리오

위험액	-11.58
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	11.59
-----	-------

[6]에리츠 StepDown 사모펀위과정상물투자신탁 25호

1. 계약금액

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

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) 만을 15.8%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

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

- 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 만금 * (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	8%	25.10	24.32	23.55	22.77	21.99	21.22	20.44
손익	5.33%	17.10	16.33	15.55	14.77	14.00	13.22	12.44
손익	2.67%	9.51	8.74	7.96	7.18	6.41	5.63	4.85
손익	0%	2.33	1.55	0.77	0.00	-0.77	-1.55	-2.33
손익	-2.67%	-4.45	-5.22	-6.00	-6.78	-7.55	-8.33	-9.10
손익	-5.33%	-10.81	-11.59	-12.37	-13.14	-13.92	-14.70	-15.47
손익	-8%	-16.77	-17.55	-18.33	-19.10	-19.88	-20.66	-21.43

최대 손실 시나리오

위험액	-21.43
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	19.79
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 2월 22일

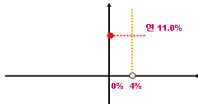
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

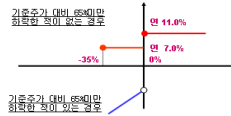
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가액의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확립 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 원본투자 기준가액의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600348RT28 최대 손실(ELS): 2007-3974

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	392.93	378.41	363.90	349.39	334.88	320.36	305.85
	5.33%	276.02	261.51	247.00	232.49	217.97	203.46	188.95
	2.67%	159.56	145.05	130.54	116.02	101.51	87.00	72.49
	0%	43.54	29.03	14.51	0.00	-14.51	-29.03	-43.54
	-2.67%	-72.05	-86.56	-101.07	-115.58	-130.10	-144.61	-159.12
	-5.33%	-187.19	-201.70	-216.21	-230.73	-245.24	-259.75	-274.27
	-8%	-301.89	-316.41	-330.92	-345.43	-359.94	-374.46	-388.97

최대 손실 시나리오

위험액	-388.97
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	384.00
-----	--------

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

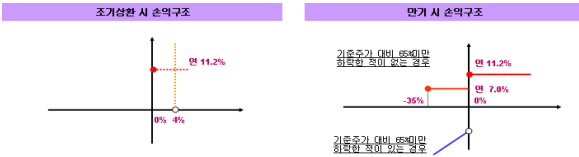
4) 기준지수: 2007년 2월 22일의 KOSPI200, NIKKEI225 증가

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, 최초기 준가격보다 작은 경우: 원금 * 121%
- 두 기초자산의 가격(장중도환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%초과 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR60034SST27 최대 손실(ELS): 2017-3984

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	37.72	36.34	34.96	33.57	32.19	30.80	29.42
시나리오	26.48	25.10	23.71	22.33	20.94	19.56	18.18
	15.23	13.91	12.52	11.14	9.75	8.37	6.99
	4.15	2.77	1.38	0.00	-1.38	-2.77	-4.15
	-6.93	-8.32	-9.70	-11.09	-12.47	-13.86	-15.24
	-17.97	-19.36	-20.74	-22.13	-23.51	-24.90	-26.28
	-28.96	-30.35	-31.73	-33.12	-34.50	-35.89	-37.27

최대 손실 시나리오

위험액	-37.27
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	36.62
-----	-------

[9] 테라츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

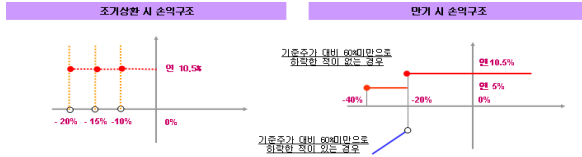
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600172YT43

신영증권(ELS)552

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	41.95	33.36	24.77	16.19	7.60	-0.99	-9.58
시나리오	5.33%	75.74	67.15	58.56	49.97	41.38	32.80	24.21
	2.67%	70.34	61.76	53.17	44.58	35.99	27.40	18.81
	0%	26.77	17.18	8.59	0.00	-8.99	-17.18	-25.77
	-2.67%	-57.99	-66.58	-75.17	-83.76	-92.35	-100.94	-109.53
	-5.33%	-180.93	-189.52	-198.11	-206.70	-215.29	-223.88	-232.47
	-8%	-343.06	-351.65	-360.24	-368.83	-377.41	-386.00	-394.59

최대 손실 시나리오

위험액	-394.59
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	361.91
-----	--------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 6월 3일

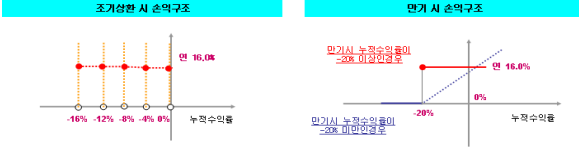
3) 만기점산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 틀(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007=504

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.42	0.35	0.28	0.21	0.14	0.07	-0.00
	5.33%	0.36	0.29	0.22	0.15	0.08	0.02	-0.05
	2.67%	0.29	0.22	0.15	0.08	0.02	-0.05	-0.12
	0%	0.21	0.14	0.07	0.00	-0.07	-0.14	-0.21
	-2.67%	0.11	0.04	-0.03	-0.10	-0.17	-0.24	-0.31
	-5.33%	-0.01	-0.08	-0.15	-0.22	-0.29	-0.36	-0.42
	-8%	-0.14	-0.21	-0.28	-0.35	-0.42	-0.49	-0.55

최대 손실 시나리오

위험액	-0.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

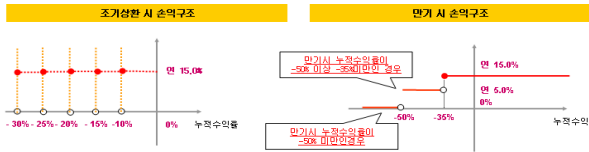
[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주
- 2) 만기: 2010년 8월 13일
- 3) 만도침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 8월 13일의 국민은행 보통주, 한국전력 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(국민은행, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환함.
(누적 수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만도 해지
만기 평가일의 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)191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	2.01	1.62	1.23	0.83	0.44	0.05	-0.35
시나리오	5.33%	1.80	1.40	1.01	0.62	0.22	-0.17	-0.57
	2.67%	1.52	1.12	0.73	0.34	-0.06	-0.45	-0.84
	0%	1.18	0.79	0.39	0.00	-0.33	-0.79	-1.18
	-2.67%	0.78	0.39	-0.00	-0.40	-0.79	-1.18	-1.58
	-5.33%	0.33	-0.06	-0.46	-0.85	-1.24	-1.64	-2.03
	-8%	-0.19	-0.58	-0.97	-1.37	-1.76	-2.15	-2.55

최대 손실 시나리오

위험액	-2.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	3.43
-----	------

[12] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제10호

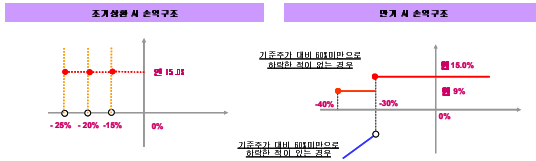
1. 계약금액

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

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, POSCO 보통주
- 2) 만기: 2009년 9월 18일
- 3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 9월 19일의 삼성전자 보통주, POSCO 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(만기상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 최(최대)손실 가능금액 (단위: 백만원)

KR603762L797 미래예상증권(ELS)219

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
-----	------

[13] 메리츠 StepDown 단위과생상품 투자신탁 제12호

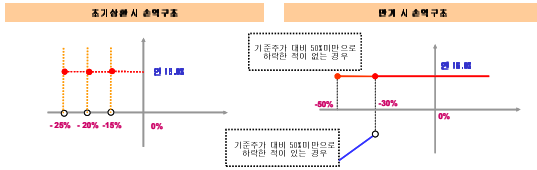
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	94.30	93.24	92.18	91.13	90.07	89.01	87.95
손익	5.33%	61.79	60.73	59.68	58.62	57.56	56.50	55.44
손익	2.67%	31.42	30.36	29.30	28.24	27.18	26.12	25.07
손익	0%	3.18	2.12	1.06	0.00	-1.06	-2.12	-3.18
손익	-2.67%	-22.93	-23.99	-25.05	-26.11	-27.17	-28.23	-29.28
손익	-5.33%	-46.91	-47.97	-49.03	-50.08	-51.14	-52.20	-53.26
손익	-8%	-66.75	-69.81	-70.87	-71.93	-72.98	-74.04	-75.10

최대 손실 시나리오

위험액	-75.10
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	75.62
-----	-------

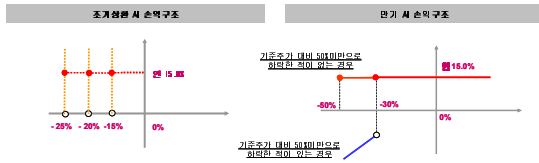
[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 최(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762BTB0 미래에셋증권(ELS)240

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	7.21	7.03	6.85	6.67	6.48	6.30	6.12
	5.33%	5.13	4.95	4.77	4.59	4.41	4.22	4.04
	2.67%	2.91	2.73	2.55	2.36	2.18	2.00	1.82
	0%	0.54	0.36	0.18	0.00	-0.18	-0.36	-0.54
	-2.67%	-1.96	-2.14	-2.33	-2.51	-2.69	-2.87	-3.05
	-8.33%	-4.61	-4.79	-4.98	-5.16	-5.34	-5.52	-5.70
	-8%	-7.41	-7.59	-7.77	-7.95	-8.13	-8.31	-8.49

최대 손실 시나리오

위험액	-8.49
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.38
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

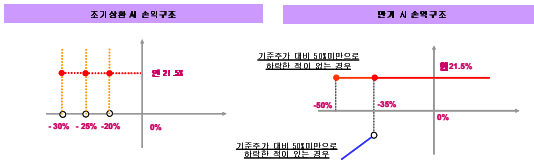
1. 계약금액

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 기일을 설정하고, 기초자산(LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이상인 경우(두번째 중도상환일), 70%이상인 경우(세번째 중도상환일), 65%이상인 경우(만기 상환일) 인출 21.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우 : 원금 * 143%
- 두 기초자산의 가격(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR600345EV11 비파생상품(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	227.99	210.46	192.92	175.38	157.84	140.30	122.76
	5.33%	168.70	151.16	133.63	116.09	98.55	81.01	63.47
	2.67%	110.24	92.70	75.17	57.63	40.09	22.55	5.01
	0%	52.81	35.28	17.74	0.00	-17.84	-35.38	-52.91
	-2.67%	-4.16	-21.72	-39.26	-56.80	-74.33	-91.87	-109.41
	-5.33%	-60.14	-77.68	-95.22	-112.76	-130.30	-147.84	-165.37
	-8%	-115.28	-132.81	-150.35	-167.89	-185.43	-202.97	-220.50

최대 손실 시나리오

위험액	-220.50
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	217.66
-----	--------

[16] 메리츠 주가지수연계 파생상품 제 1호

1. 계약금액

구분	기대자산	거래유형	액수(1)	액수(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

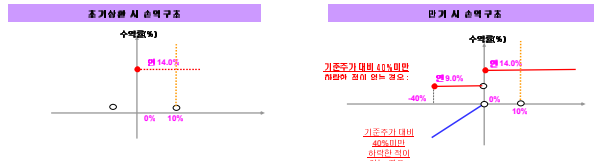
3) 만도청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 종가

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조변동 시나리오

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

[17]테리츠StepDown사모단위특성26호

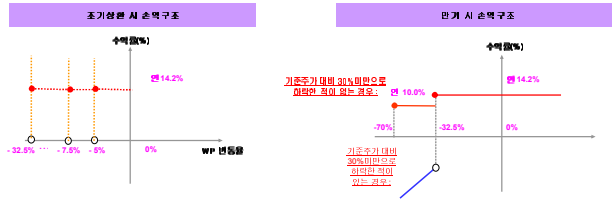
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867BTB0 코루남산한동림(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	221.69	192.90	164.10	135.30	106.51	77.71	48.92
	5.33%	177.27	148.47	119.67	90.88	62.08	33.28	4.49
	2.67%	132.16	103.37	74.57	45.78	16.98	-11.82	-40.61
	0%	86.39	57.59	28.80	0.00	-23.61	-57.59	-86.39
	-2.67%	39.94	11.14	-17.65	-46.45	-75.25	-104.04	-132.84
-5.33%	-7.18	-35.98	-64.78	-93.57	-122.37	-151.16	-179.96	
-8%	-54.96	-83.76	-112.57	-141.37	-170.17	-198.96	-227.76	

최대 손실 시나리오

위험액	-227.76
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	233.62
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

1. 계약금액

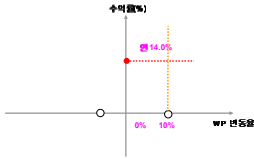
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	잔위

단위(백만원)

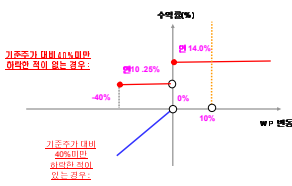
2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주
- 2) 만기: 2010년 1월 15일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 15일 LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상종포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있는 경우 연 14%의 수익률로 중도 상환
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 만드침 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) 만드침의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	93.57	89.49	85.42	81.35	77.27	73.20	69.13	
손익	5.33%	66.01	61.94	57.86	53.79	49.72	45.64	
손익	2.67%	38.89	34.82	30.75	26.67	22.60	18.53	
손익	0%	12.22	8.15	4.07	0.00	-4.07	-8.15	
손익	-2.67%	-14.01	-18.08	-22.16	-26.23	-30.30	-34.38	
손익	-5.33%	-39.80	-43.87	-47.95	-52.02	-56.09	-60.17	
손익	-8%	-65.15	-69.22	-73.29	-77.36	-81.44	-85.51	

최대 손실 시나리오

위험액	69.13
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	88.43
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

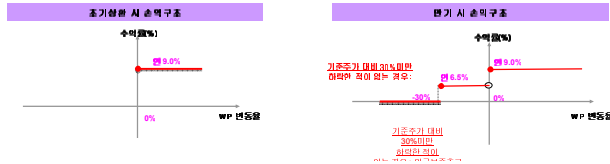
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 평가: 2011년 2월 21일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
 - 4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 종가
 - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.
- 단, 평가시점까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70% 미만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만 하락한 적이 있는 경우: 원금 * 100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 비헤지넷증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
8%	26.12	23.66	21.60	19.34	17.08	14.81	12.55	
5.33%	20.71	18.45	16.19	13.92	11.66	9.40	7.14	
2.67%	14.26	12.00	9.74	7.48	5.22	2.96	0.70	
0%	6.78	4.52	2.26	0.00	-2.26	-4.52	-6.78	
-2.67%	-1.73	-3.99	-6.25	-8.51	-10.77	-13.04	-15.30	
-5.33%	-11.27	-13.54	-15.80	-18.06	-20.32	-22.58	-24.84	
-8%	-21.85	-24.12	-26.38	-28.64	-30.90	-33.16	-35.42	

최대 손실 시나리오

위험액	12.55
-----	-------

4. 매매상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	36.13
-----	-------

[2] 메리츠주연계 사모단위파생7호

1. 계약금액

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

단위:백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 2월 21일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

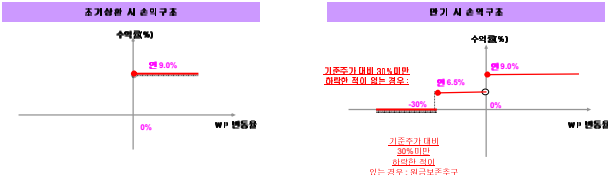
단, 평가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없고, 최초기 준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%

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

: 원금*100%

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	20.32	18.56	18.80	15.04	13.28	11.52	9.76
손익	5.33%	16.11	14.35	12.59	10.83	9.07	7.31	5.55
손익	2.67%	11.09	9.33	7.58	5.82	4.06	2.30	0.54
손익	0%	5.28	3.52	1.76	0.00	-1.76	-3.52	-5.28
손익	-2.67%	-1.34	-3.10	-4.86	-6.62	-8.38	-10.14	-11.90
손익	-5.33%	-6.77	-10.53	-12.29	-14.05	-15.80	-17.56	-19.32
손익	-8%	-11.70	-16.76	-20.51	-22.27	-24.03	-25.79	-27.55

최대손실 시나리오

위험액	9.76
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.10
-----	-------

[23] 매리츠일종지수연계사모파생1호

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

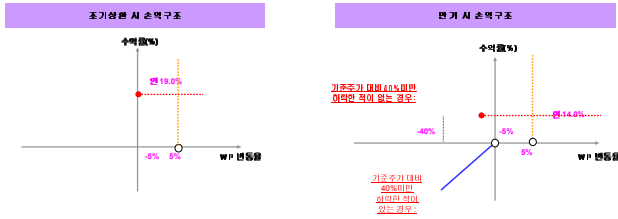
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600594WV82 무리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	164.35	155.62	146.89	138.16	129.43	120.71	111.98
	5.33%	117.57	108.84	100.12	91.39	82.66	73.93	65.20
	2.67%	71.52	62.79	54.06	45.33	36.61	27.88	19.15
	0%	26.18	17.46	8.73	0.00	-8.73	-17.46	-26.18
	-2.67%	-18.43	-27.16	-35.89	-44.61	-53.34	-62.07	-70.80
	-5.33%	-62.32	-71.05	-79.78	-88.51	-97.24	-105.96	-114.69
	-8%	-105.50	-114.23	-122.95	-131.68	-140.41	-149.14	-157.86

최대 손실 시나리오

위험액	-157.86
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	149.23
-----	--------

[24] 테리츠 주가지수연계사모펀드상품 제 1호

1. 계약금액

구분	기대대상	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

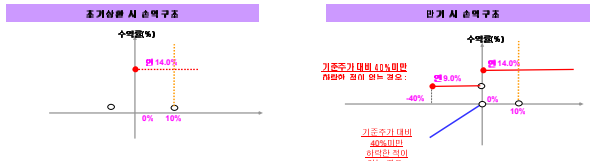
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 7월31일 KOSPI200의 증가

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

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

[26] 데리츠2Star사모파생SE9F-1

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

2) 만기: 2010년 09월 30일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6512302/A7 - 매신증권(ELS)713

손익구조변동 시나리오

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

[29] 테리츠2Star파생 SEPO-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, POSCO

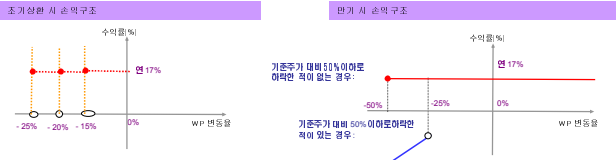
2) 만기: 2011년 09월 23일

3) 펀드청산 결정 주기: 매6개월

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

- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, POSCO의 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일), 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일)만큼 17.0%의 수익률도 중도상환이 됨.
 단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확률 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



3. 손익구조변동률(최대손실가능금액(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%	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
-----	------

[29] 테리 조주가지 수익계 과정 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 09월 20일

3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 09월 22일 KOSPI200지수의 증가

5) 발행 후 매 3개월마다 중도 상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200)이 조기상환결정일에 최초기준거래 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포함하여 한변이라도 최초기준거래 대비 5%이상 상승한적이 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 거래이 한변도 기준거래의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준거래의 100%보다 작은 경우

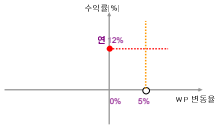
: 원금 * 124%

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

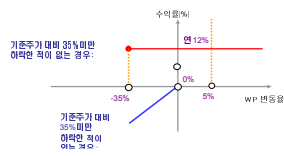
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6583337V98 최대증권(ELS)2008-945

수익구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생13

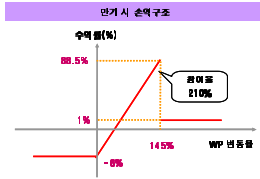
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 연가시점의 손익구조

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



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

손익 구조변동 시나리오

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

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

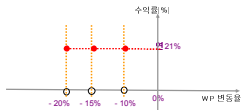
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위:백만원

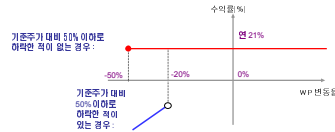
2. 만기시점의 손익구조

- 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 못해 경우 아래와 같이 만기 상당금액을 산출함
- 두 기초자산의 만기일 증가가 모두 최초 기준가격의 80%이상인 경우
: 원금 * 163.0%
- 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 한번이상 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 없는 경우
: 원금 * 163.0%
- 두 기초자산의 만기일 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 80%이하이고 평가기간 동안 기초자산의 증가가 어느 하나라도 최초 기준가격의 50% 미만으로 결정된 적이 있는 경우 만기 평가일의 하락률이 큰 증폭을 기준으로
: 원금 * (만기 평가가격 / 최초기준가격)
- 만일의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	5.65	4.47	3.29	2.11	0.93	-0.25	-1.43
	5.33%	5.59	4.41	3.24	2.06	0.88	-0.30	-1.48
	2.67%	4.89	3.71	2.53	1.35	0.17	-1.01	-2.18
	0%	3.54	2.36	1.18	0.00	-1.18	-2.36	-3.54
	-2.67%	1.53	0.35	-0.82	-2.00	-3.18	-4.35	-5.54
	-5.33%	-1.12	-2.30	-3.46	-4.66	-5.84	-7.02	-8.20
	-8%	-4.43	-5.61	-6.79	-7.96	-9.14	-10.32	-11.50

최대 손실 시나리오

위험액	-11.50
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.78
-----	-------

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

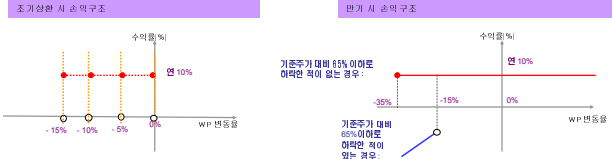
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동/최대손실가능금액(단위:백만원)

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	기래대상	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 6월 12일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기 존지수: 2008년 6월 12일 KOSPI200지수의 증가

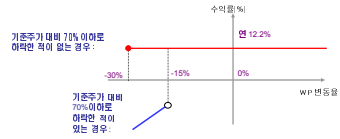
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12.2%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 112.2%
 - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



[80-3] 메리츠주가지수연계사로증권2교
 KR600980MM/M7 당주증권ELS2697

1. 계약금액

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

단위(백만원)

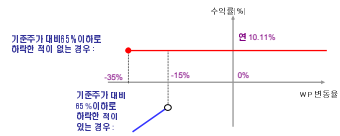
2. 연가시점의 손익구조

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

초기상환 시 수익구조



만기 시 손익구조



[80-4] 매리츠주가지수연계사로증권2.-4
 KR6008678V51 롯데당 신안증권(ELS)890

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장의파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 5월 18일

3) 만도침산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 5월 14일 KOSPI200지수의 증가

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

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

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

연율11%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

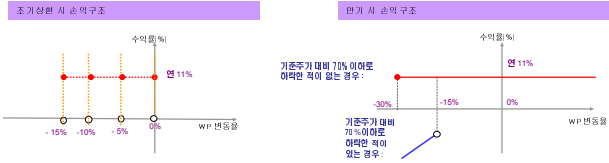
- 두 기준지수의 가격이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다 작은 경우

: 원금 * 111%

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

: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 만도의 수익구조



[80-5] 메리츠투자지수형계사로종업2호
 KR6008679V84 롯데당 신안증권(ELS)931

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 연기: 2009년 8월 17일

3) 펀드청산 결정주기: 매3개월

4) 기준지수: 2008년 8월 14일 KOSPI200지수의 증가

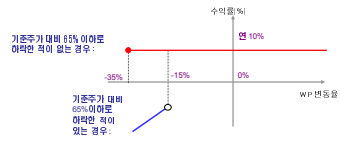
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율10.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2009년 6월 12일

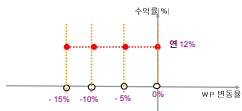
3) 펀드청산결정주기: 매3개월

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

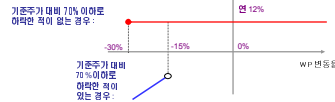
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 95%이상인 경우(두번째 중도상환일), 90%이상인 경우(세번째 중도상환일), 85%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율12%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 85%보다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

2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

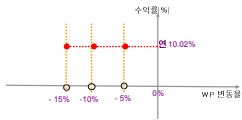
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	잔액

단위: (백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 종의파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2009년 8월 18일
- 3) 권드청산 결정 주기: 매4개월
- 4) 기 준지수: 2008년 8월 18일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지수의 증가)의 중도상환가격이 낮은 기 초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일) 면할 10.02%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 권드 해지
 - 두 기 초자산의 가격 이 한반드 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우
 : 원금 * 110.02%
 - 두 기 초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 준지수 /최 초기 준지수)
- 6) 권드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

1. 계약금액

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

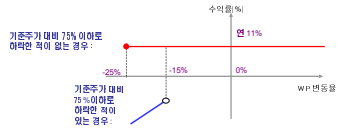
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[60-10] **메리츠투자자산수익계사로증권2호**

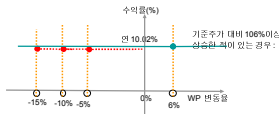
1. 계약금액

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

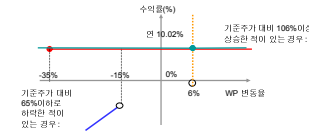
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI 200 지수
- 2) 만기: 2011년 5월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 4개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 KOSPI 200 지수의 증가
- 5) 발행 후 매 4개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI 200 지수 지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산가 준으로 각각 최초 기준가격의 95%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 90%이상인 경우(두번째 중도상환일), 85%이상인 경우(세번째 중도상환일), 80%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연율 10.02%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 기초자산가 기준지수의 106%이상으로 상승한 적이 있을 경우는 행사정지사건에 해당되며, 행사정지사건이 발행 후 18개월 이전에 일어나면 이후 드러하는 중간평가일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급. 18개월 이후에 발생하면 만기일에 연 10.02%의 중도상환금액을 지급
- 두 기초자산의 가격이 한반도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 85%보다 작은 경우 : 원금 * 20.04%
- 두 기초자산의 가격(장중로환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[6] 데리츠2Star사로증권투신LEHO-2

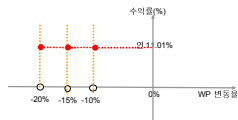
1. 계약금액

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

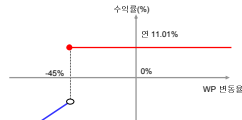
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 증권파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 2) 만기: 2012년 4월 12일
- 3) 편드상환결정주기: 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 편드 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) 편드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조인용(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR66923071445 NAF투자증권(ELS)32

손익구조변동 시나리오

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

최대손실 시나리오

위험액	-0.01
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[62] 데리츠2SIa사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

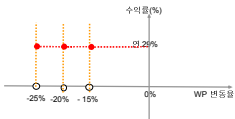
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위(백만원)

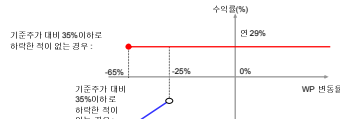
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: 우리금융저주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융저주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융저주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 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 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 129%
 - 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조인용(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%	15.16	14.98	14.80	14.62	14.44	14.26	14.08
	5.33%	5.44	5.26	5.08	4.90	4.72	4.55	4.37
	2.67%	0.57	0.39	0.21	0.03	-0.15	-0.33	-0.51
	0%	0.54	0.36	0.18	0.00	-0.18	-0.36	-0.54
	-2.67%	5.35	5.17	4.99	4.81	4.63	4.45	4.28
-5.33%	15.01	14.83	14.65	14.47	14.29	14.11	13.93	
-8%	29.50	29.33	29.15	28.97	28.79	28.61	28.43	

최대 손실 시나리오

위험액	28.43
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	19.93
-----	-------

[68] 데리츠2Star사로증권LEHC-I 호

1. 계약금액

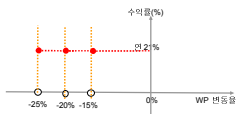
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2045.8	0	2,046	잔위

단위(백만원)

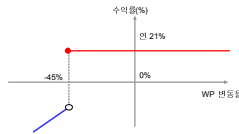
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 2) 만기: 2012년 4월 12일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 2%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우
 : 평균 * 121%
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우
 : 평균 * (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	8%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
손익	5.33%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
시나리오	2.67%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	-5.33%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	-8%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	0.00
-----	------

[67] 데리츠2Star사모증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

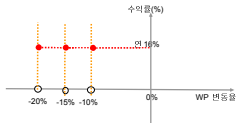
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

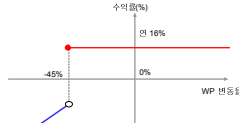
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초지	8%	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11
산	5.33%	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
시나리오	2.67%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	0%	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03	-0.03
	-5.33%	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08	-0.08
	-8%	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17	-0.17

최대 손실 시나리오

위험액	-0.17
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	1.09
-----	------

[65] 데리츠2Star사로 증권POKB-2호

1. 계약금액

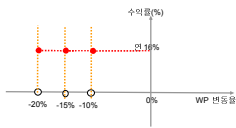
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50	잔위

단위(백만원)

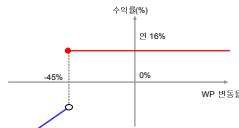
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO
- 2) 만기: 2012년 4월 16일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 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
 - 만기상환일일 때 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일일 때 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (다위:백만원))
KR6562340W48 유린투기증권(ELS)2405

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	-0.01
	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%	-0.01	-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	0.06
-----	------

[67] 데리츠2Star사로 증권SEST-

1. 계약금액

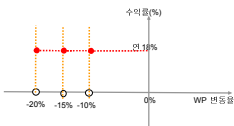
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

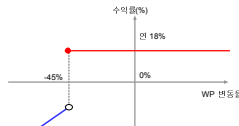
2. 만기시점의 손익구조

- 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 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-22.22	-24.69	-27.17	-29.64	-32.12	-34.59	-37.06
산	5.33%	-8.95	-11.42	-13.90	-16.37	-18.85	-21.32	-23.80
시나리오	2.67%	0.93	-1.54	-4.02	-6.49	-8.97	-11.44	-13.92
오	0%	7.42	4.96	2.47	0.00	-2.47	-4.95	-7.42
	-2.67%	10.53	8.05	5.56	3.11	0.63	-1.84	-4.32
	-5.33%	10.25	7.77	5.30	2.82	0.35	-2.13	-4.60
	-8%	6.58	4.10	1.63	-0.85	-3.32	-5.80	-8.27

최대 손실 시나리오

위험액	-8.27
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	32.25
-----	-------

[68] 데리츠2Star사로 증권SE ST-4호

1. 계약금액

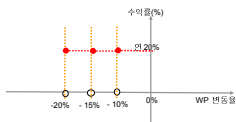
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	500.0	0	500	잔위

단위(백만원)

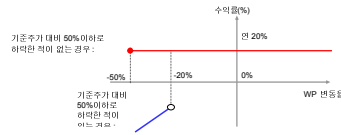
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 06일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%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%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 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/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	-1.73	-2.16	-2.60	-3.03	-3.46	-3.89	-4.33
산	5.33%	-0.32	-0.75	-1.19	-1.62	-2.05	-2.48	-2.92
시나리오	2.67%	0.69	0.26	-0.18	-0.61	-1.04	-1.48	-1.91
	0%	1.30	0.87	0.43	0.00	-0.43	-0.87	-1.30
	-2.67%	1.51	1.08	0.64	0.21	-0.22	-0.65	-1.09
	-5.33%	1.32	0.89	0.45	0.02	-0.41	-0.84	-1.28
	-8%	0.73	0.30	-0.13	-0.57	-1.00	-1.43	-1.86

최대 손실 시나리오

위험액	-1.86
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	2.48
-----	------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

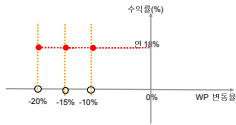
1. 계약금액

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

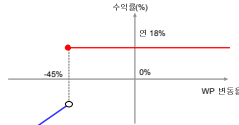
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-1.22	-13.56	-14.94	-16.31	-17.67	-19.03	-20.39
산	5.33%	-4.92	-6.28	-7.65	-9.01	-10.37	-11.73	-13.09
시나리오	2.67%	0.51	-0.85	-2.21	-3.57	-4.93	-6.29	-7.66
	0%	4.08	2.72	1.36	0.00	-1.36	-2.72	-4.08
	-2.67%	5.79	4.43	3.07	1.71	0.35	-1.01	-2.36
	-5.33%	5.64	4.28	2.91	1.55	0.19	-1.17	-2.53
	-8%	3.62	2.26	0.90	-0.47	-1.83	-3.19	-4.55

최대 손실 시나리오

위험액	-4.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	17.74
-----	-------

[77] 데리츠2SIa사모SEST-3

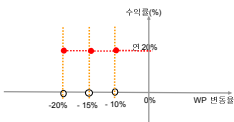
1. 계약금액

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

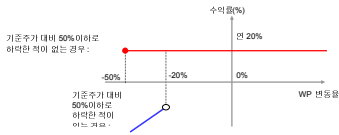
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (다위·백만원))

KR6562345W35 유인투기증권 (ELS)2382

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-4.55	-5.13	-5.72	-6.31	-6.89	-7.48	-8.07
산	5.33%	-1.59	-2.17	-2.76	-3.35	-3.93	-4.52	-5.11
시나리오	2.67%	0.52	-0.07	-0.66	-1.25	-1.83	-2.42	-3.01
	0%	1.76	1.17	0.59	0.00	-0.59	-1.17	-1.76
	-2.67%	2.15	1.56	0.97	0.39	-0.20	-0.79	-1.37
	-5.33%	1.68	1.09	0.50	-0.08	-0.67	-1.26	-1.84
	-8%	0.35	-0.24	-0.82	-1.41	-2.00	-2.58	-3.17

최대 손실 시나리오

위험액	-3.17
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	7.97
-----	------

[78] 데리츠2SIa사모STWF-2

1. 계약금액

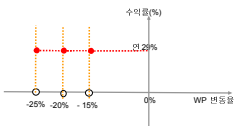
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	잔위

단위(백만원)

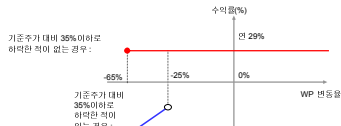
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	13.20	13.04	12.88	12.73	12.57	12.42	12.26
손익	5.33%	4.74	4.58	4.43	4.27	4.11	3.96	3.80
손익	2.67%	0.49	0.34	0.18	0.03	-0.13	-0.29	-0.44
손익	0%	0.47	0.31	0.16	0.00	-0.16	-0.31	-0.47
손익	-2.67%	4.66	4.50	4.35	4.19	4.03	3.88	3.72
손익	-5.33%	13.06	12.91	12.75	12.60	12.44	12.28	12.13
손익	-8%	25.69	25.53	25.37	25.22	25.06	24.91	24.75

최대 손실 시나리오

위험액	24.75
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.35
-----	-------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

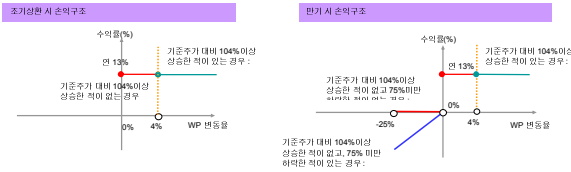
1. 계약금액

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) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 12월 13일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
 - 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%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	9,319.72	8,847.28	8,374.83	7,902.39	7,429.95	6,957.51	6,485.07
	5.33%	6,717.68	6,245.24	5,772.79	5,300.35	4,827.91	4,355.47	3,883.03
시나리오	2.67%	4,083.55	3,611.10	3,138.66	2,666.22	2,193.78	1,721.34	1,248.90
	0%	1,417.32	944.88	472.44	0.00	-472.44	-944.88	-1,417.32
	-2.67%	-1,280.99	-1,753.43	-2,225.87	-2,698.31	-3,170.75	-3,643.20	-4,115.64
	-5.33%	-4,011.39	-4,483.84	-4,956.28	-5,428.72	-5,901.16	-6,373.60	-6,846.04
	-8%	-6,773.89	-7,246.33	-7,718.77	-8,191.21	-8,663.65	-9,136.10	-9,608.54

최대손실 시나리오

위험액	-9,608.54
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,691.80
-----	----------

[79-2] **메리츠주가지수연계사표8호**

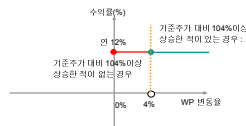
1. 계약금액

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

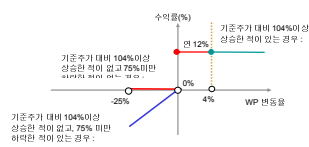
2. 만기시점의 손익구조

- 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 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%이므로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자기수연계사모8호**

1. 계약금액

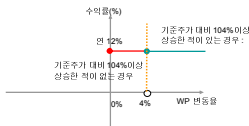
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔액

단위: 백만원

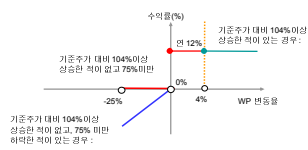
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 16일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
 - 단, 만기시 (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 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

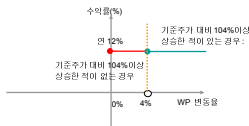
1. 계약금액

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

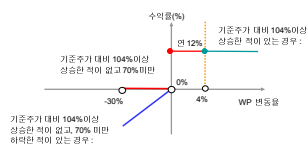
2. 만기시점의 수익구조

- 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 최초 기준가격 이상이거나 또는 말기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초 기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 초기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6008679TA3 곳님 신원증권(ELS)786

[79-6] 메리츠주가지수연계서표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

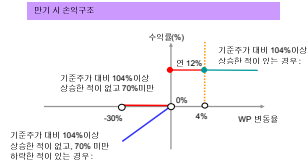
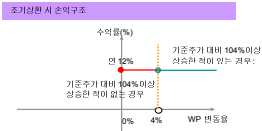
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600867CTB8 코트남 신원증권(ELS)804

[79-7] 에리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

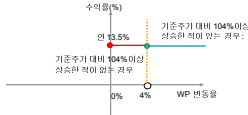
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 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

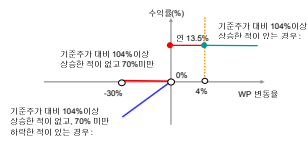
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 일반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 : 원금 * 113.5%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008675TC7 코트닛 신환증권(ELS)809

[79-8] 에리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

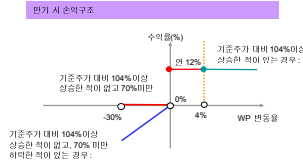
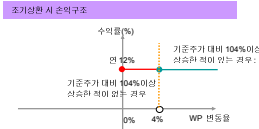
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 에리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

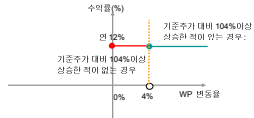
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	상위

단위(백만원)

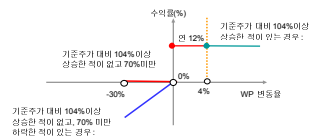
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 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 가격 이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 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/최초 기준지수)
- 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

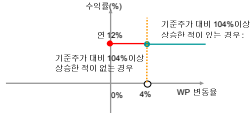
- 1) 참여대상펀드의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지 수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한변이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

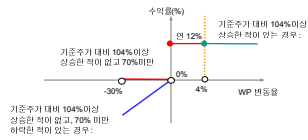
- 두 기초자산의 가격 이 환변도 기준가격의65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수연계사료8호

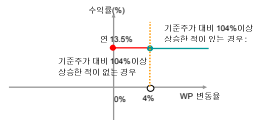
1. 계약금액

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

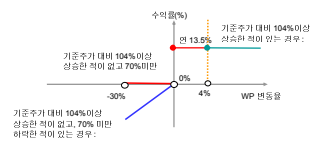
2. 만기시점의 손익구조

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



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠투자지수연계사모8호

1. 계약금액

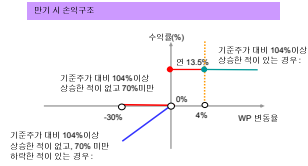
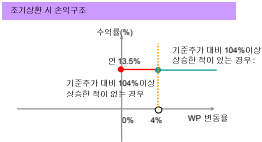
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000		상환

2. 만기시점의 손익구조

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

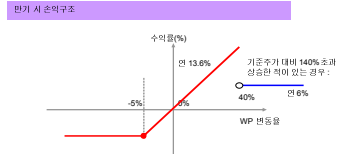
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 3월 19일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 만기 전 가일 1회
- 4) 기 존지 수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기 존지 수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가일 수가 최초기 존가격 이상이고 최초기 존가격의 140% 미만일 경우
: 원금 * (95% + 100% * (만기 기 존지 수 / 최초 기 존지 수 - 1))
 - 만기 평가일 수가 최초기 존가격 미만일 경우
: 원금 * 95%
- 6) 만드의 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%	
기초 자산 시나리오	8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

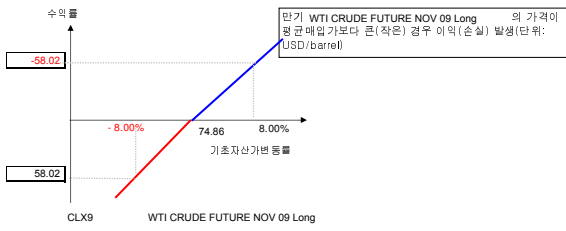
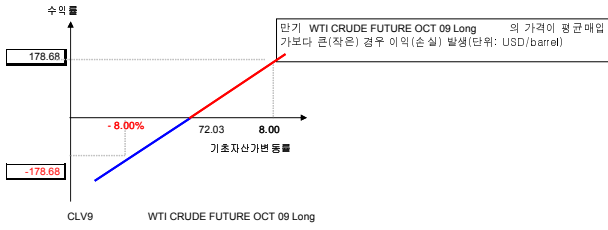
[80] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

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

구분	시나리오	손익
기초자산 시나리오	8%	236.70
	5.33%	157.70
	2.67%	79.00
	0%	0.00
	-2.67%	-79.00
	-5.33%	-157.70
	-8%	-236.70

최대손실 시나리오	
위험액	-236.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	959
-----	-----

[79] 데리 초주가지 수연계사모증권!61E

1. 계약금액

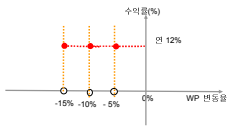
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3842.0	0	3,842.0	잔위

단위:백만원

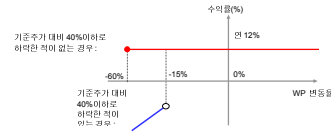
2. 연가시점의 손익구조

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

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조별 손익 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호

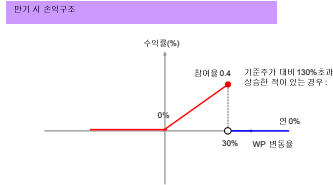
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6673105W54 동부증권-희미플러스(ELS)B1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-12.03	-13.42	-14.81	-16.20	-17.60	-18.99	-20.38
산	5.33%	-6.31	-7.70	-9.09	-10.48	-11.88	-13.27	-14.67
시나리오	2.67%	-0.91	-2.30	-3.69	-5.08	-6.48	-7.87	-9.27
오	0%	4.18	2.79	1.39	0.00	-1.39	-2.79	-4.18
	-2.67%	8.95	7.56	6.16	4.77	3.38	1.98	0.59
	-5.33%	13.41	12.01	10.62	9.23	7.83	6.44	5.05
	-8%	17.55	16.16	14.76	13.37	11.98	10.58	9.19

최대 손실 시나리오

위험액	9.19
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.26
-----	-------

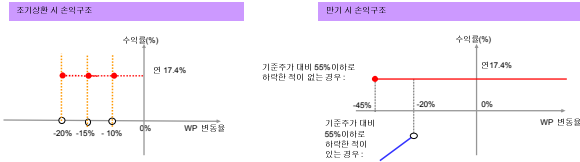
[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조표본들 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.45	0.12	-0.21	-0.54	-0.87	-1.20	-1.53
손익	5.33%	1.36	1.03	0.70	0.37	0.05	-0.28	-0.61
시나리오	2.67%	1.54	1.21	0.88	0.55	0.22	-0.10	-0.43
	0%	0.99	0.66	0.33	0.00	-0.33	-0.66	-0.99
	-2.67%	-0.30	-0.63	-0.96	-1.29	-1.62	-1.94	-2.27
	-5.33%	-2.32	-2.65	-2.98	-3.31	-3.64	-3.97	-4.29
	-8%	-5.08	-5.40	-5.73	-6.06	-6.39	-6.72	-7.05

최대 손실 시나리오

위험액	-7.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.90
-----	------

[83] 데리츠2Star사모증권SE-ST-5호

1. 계약금액

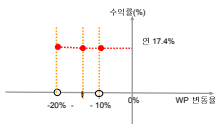
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

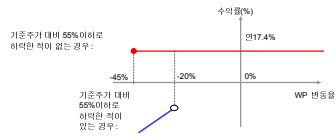
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

손익 구조별 손 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	2.87	0.76	-1.35	-3.47	-5.58	-7.69	-9.81
손익 시나리오	5.33%	8.74	6.63	4.52	2.40	0.29	-1.82	-3.94
	2.67%	9.90	7.78	5.67	3.56	1.45	-0.67	-2.78
	0%	6.34	4.23	2.11	0.00	-2.11	-4.23	-6.34
	-2.67%	-1.93	-4.05	-6.16	-8.27	-10.38	-12.50	-14.61
	-5.33%	-14.92	-17.03	-19.14	-21.26	-23.37	-25.48	-27.60
	-8%	-32.62	-34.73	-36.84	-38.95	-41.07	-43.18	-45.29

최대 손실 시나리오

위험액	-45.29
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.48
-----	-------

[84] 데리츠2SIa사모증권SEPO-2호

1. 계약금액

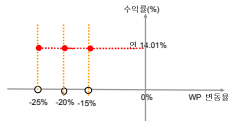
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위:백만원

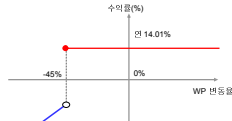
2. 만기시점의 손익구조

- 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/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6662305W64 권위스마트(ELS)132

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	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEP-O-1호

1. 계약금액

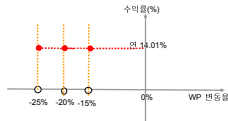
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

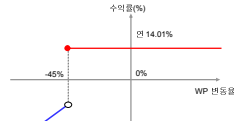
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[86] 데리츠2Star사로증권SELE-1호

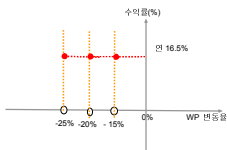
1. 계약금액

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

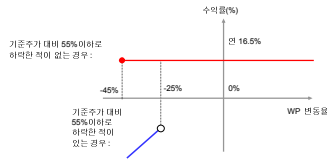
2. 만기시점의 손익구조

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

[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호

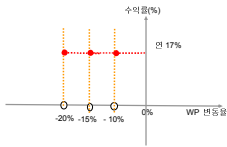
1. 계약금액

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

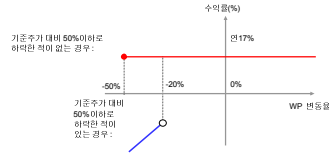
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6562319W52 유가 증권 (ELS)2415

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.19	-0.23	-0.27	-0.31	-0.35	-0.39	-0.43
손익	5.33%	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12	-0.17	-0.21
시나리오	2.67%	0.15	0.10	0.06	0.02	-0.02	-0.06	-0.10
	0%	0.12	0.08	0.04	0.00	-0.04	-0.08	-0.12
	-2.67%	-0.02	-0.06	-0.10	-0.15	-0.19	-0.23	-0.27
	-5.33%	-0.29	-0.33	-0.37	-0.42	-0.46	-0.50	-0.54
	-8%	-0.69	-0.73	-0.77	-0.81	-0.85	-0.89	-0.93

최대 손실 시나리오

위험액	-0.93
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.16
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

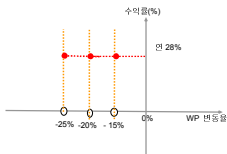
1. 계약금액

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

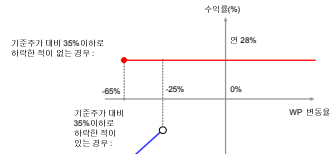
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	34.70	27.23	19.76	12.29	4.82	-2.65	-10.13
시나리오	5.33%	31.26	23.79	16.32	8.85	1.38	-6.09	-13.57
	2.67%	27.17	19.70	12.22	4.75	-2.72	-10.19	-17.66
	0%	22.42	14.94	7.47	0.00	-7.87	-14.94	-22.92
	-2.67%	17.01	9.54	2.06	-5.41	-12.88	-20.35	-27.82
	-5.33%	10.94	3.47	-4.00	-11.47	-18.94	-26.41	-33.89
	-8%	4.22	-3.25	-10.72	-18.19	-25.66	-33.13	-40.61

최대 손실 시나리오

위험액	-40.61
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.96
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

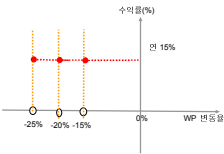
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	30.0	0	30.0	차입

단위:백만원

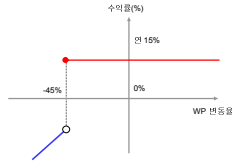
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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 * 115%
- 두 기초자산의 가액 중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만인 경우
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



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

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

최대 손실 시나리오	
위험액	-0.08

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.06
-----	------

[90] 테라츠2Star사로증권POLE-1호

1. 계약금액

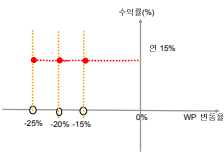
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	잔위

단위:백만원

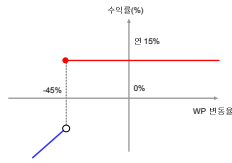
2. 평가시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 리스크(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	0.51	0.11	-0.26	-0.67	-1.07	-1.46	-1.86
손익	5.33%	1.32	0.93	0.53	0.14	-0.25	-0.65	-1.04
시나리오	2.67%	1.55	1.15	0.76	0.36	-0.03	-0.42	-0.82
	0%	1.18	0.79	0.39	0.00	-0.39	-0.79	-1.18
	-2.67%	0.23	-0.17	-0.56	-0.95	-1.35	-1.74	-2.14
	-5.33%	-1.31	-1.71	-2.10	-2.49	-2.89	-3.28	-3.68
	-8%	-3.44	-3.84	-4.23	-4.63	-5.02	-5.41	-5.81

최대 손실 시나리오

위험액	-5.81
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	4.46
-----	------

[9] 테라츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

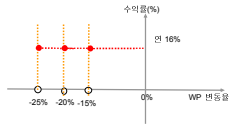
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	잔위

단위:백만원

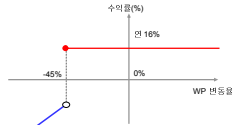
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 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%	1.02	0.83	0.64	0.46	0.27	0.09	-0.10
손익	5.33%	0.93	0.74	0.56	0.37	0.19	0.00	-0.18
시나리오	2.67%	0.78	0.59	0.41	0.22	0.03	-0.15	-0.34
	0%	0.56	0.37	0.19	0.00	-0.19	-0.33	-0.56
	-2.67%	0.27	0.08	-0.10	-0.29	-0.47	-0.66	-0.84
	-5.33%	-0.08	-0.27	-0.46	-0.64	-0.83	-1.01	-1.20
	-8%	-0.51	-0.69	-0.88	-1.06	-1.25	-1.43	-1.62

최대 손실 시나리오

위험액	-1.62
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.84
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

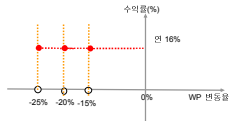
1. 계약금액

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

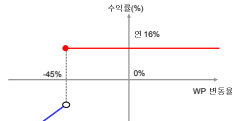
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 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
: 원금 * 110%
→ 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 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%	18.18	14.85	11.53	8.21	4.89	1.57	-1.75
	5.33%	16.64	13.32	10.00	6.68	3.35	0.03	-3.29
시나리오	2.67%	13.90	10.58	7.26	3.94	0.62	-2.70	-6.03
	0%	9.96	6.64	3.32	0.00	-3.32	-6.64	-9.96
	-2.67%	4.83	1.50	-1.82	-5.14	-9.46	-11.78	-15.10
	-5.33%	-1.51	-4.83	-9.15	-13.48	-17.80	-21.44	-25.14
	-8%	-9.05	-12.37	-15.69	-19.01	-22.34	-25.66	-28.98

최대 손실 시나리오

위험액	-28.98
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	32.90
-----	-------

[93] 데리츠2Star사로증권LEHC-3

1. 계약금액

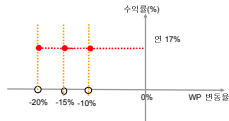
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2000.0	0	2,000.0	차입

단위:백만원

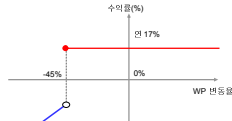
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대손실가능금액(단위:백만원))
KR6562310W51 유가증권(ELS)2414

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	4.39	3.31	2.22	1.14	0.06	-1.02	-2.10
	5.33%	5.05	3.97	2.89	1.80	0.72	-0.36	-1.44
시나리오	2.67%	4.67	3.59	2.50	1.42	0.34	-0.74	-1.82
	0%	3.25	2.16	1.08	0.00	-1.08	-2.16	-3.25
	-2.67%	0.78	-0.30	-1.36	-2.46	-3.55	-4.63	-5.71
	-5.33%	-2.73	-3.81	-4.89	-5.97	-7.05	-8.14	-9.22
	-8%	-7.27	-8.36	-9.44	-10.52	-11.60	-12.68	-13.77

최대손실 시나리오

위험액	-13.77
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.11
-----	-------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

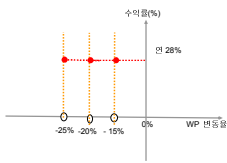
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	잔위

단위(백만원)

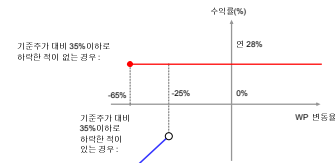
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조표현 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	23.21	17.72	12.24	6.76	1.27	-4.21	-9.69
손익	5.33%	22.18	16.69	11.21	5.73	0.24	-5.24	-10.72
시나리오	2.67%	19.93	14.44	8.96	3.47	-2.01	-7.49	-12.98
	0%	16.48	10.97	5.48	0.00	-5.88	-10.97	-16.48
	-2.67%	11.75	6.27	0.79	-4.91	-10.18	-15.66	-21.15
	-5.33%	5.83	0.35	-5.13	-10.62	-16.10	-21.58	-27.07
	-8%	-1.31	-6.79	-12.27	-17.76	-23.24	-28.73	-34.21

최대 손실 시나리오

위험액	-34.21
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	24.48
-----	-------

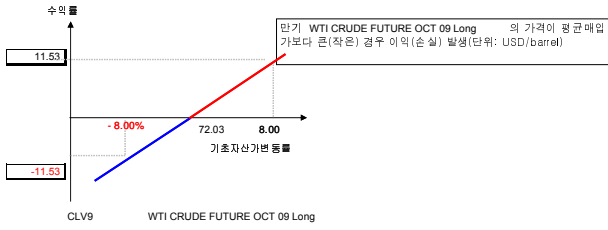
[96] 데리츠WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연기사험의 손익구조



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

CLV9 WTI CRUDE FUTURE SEP 09 long

구분	시나리오	
기초자산	8%	11.53
	5.33%	7.68
	2.67%	3.85
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.85
	-5.33%	-7.68
	-8%	-11.53

최대 손실 시나리오	
위험액	-11.53

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46
-----	----

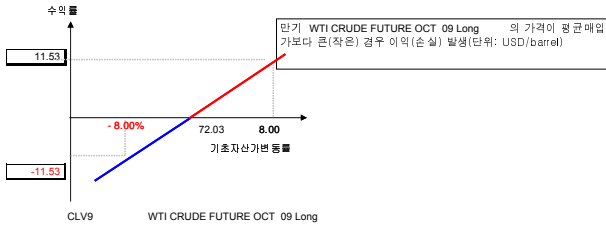
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLV9 WTI CRUDE FUTURE OCT 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	38.51
	5.33%	25.65
	2.67%	12.85
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-12.85
	-5.33%	-25.65
	-8%	-38.51

최대 손실 시나리오	
위험액	-38.51

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

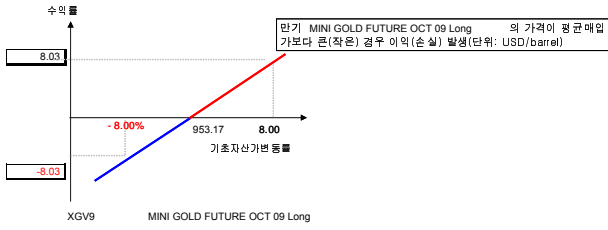
위험액	156
-----	-----

[96-2] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 헷지시점의 손익 구조



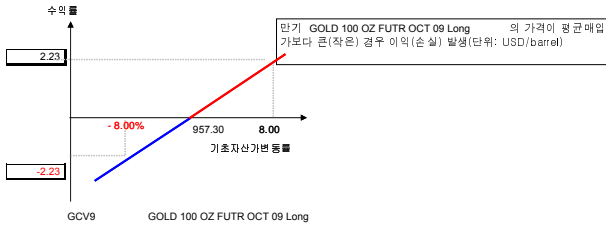
[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조

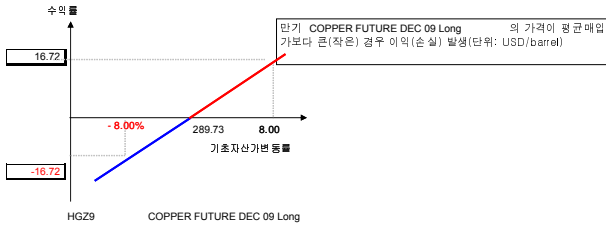


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 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

