

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

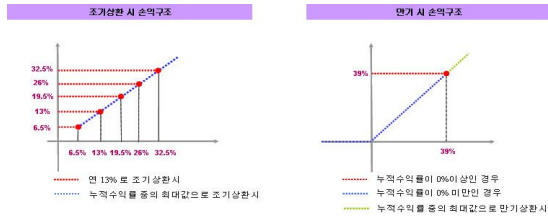
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테라즈 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 우리금융지주 보통주)의 중도상환가려이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -16%(2차 중도상환일), -22%(3차 중도상환일), -28%(4차 중도상환일), -34%(5차 중도상환일), -40%(만기상환일) 이상인 경우 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: 액면금액 지급 (원금보장채주)

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%	0.05	0.04	0.03	0.03	0.02	0.02	0.01
	5.33%	0.04	0.03	0.03	0.02	0.01	0.01	-0.01
	2.67%	0.03	0.02	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.01
	0%	0.02	0.01	0.01	0.00	-0.01	-0.01	-0.02
	-2.67%	0.01	0.00	-0.01	-0.01	-0.02	-0.02	-0.03
-5.33%	0.00	-0.01	-0.01	-0.02	-0.03	-0.03	-0.04	
-8%	-0.01	-0.02	-0.02	-0.03	-0.03	-0.04	-0.05	

최대 손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

4) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모펀위 과정상물투자신탁 24호

1. 계약금액

구분		기래의상	기래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS		611	0	611	잔액

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 만기청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

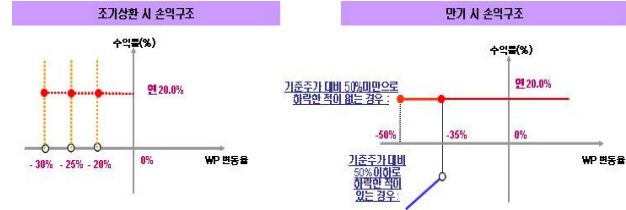
- 두 기초자산의 가격이 만기후론 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 \* 140%

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

: 할금 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR60376207AD 이력정보증권(ELS)243

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	14.35	14.04	13.72	13.41	13.10	12.79	12.47
손익	5.33%	9.98	9.67	9.36	9.05	8.73	8.42
손익	2.67%	5.51	5.20	4.89	4.58	4.26	3.95
손익	0%	0.94	0.63	0.31	0.00	-0.31	-0.63
손익	-2.67%	-3.74	-4.05	-4.37	-4.68	-4.99	-5.31
손익	-5.33%	-6.53	-6.84	-7.15	-7.47	-7.78	-8.09
손익	-8%	-13.42	-13.73	-14.04	-14.36	-14.67	-14.98

최대 손실 시나리오

위험액 -15.29

4. 매월 상환의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액 15.36

[6]에리츠 StepDown 사모펀위과정상물투자신탁 25호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드형산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600345TTB8 최대 손실(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	16.13	15.77	15.40	15.03	14.66	14.30	13.93
	5.33%	10.90	10.53	10.16	9.80	9.43	9.06	8.70
시나리오	2.67%	5.89	5.52	5.15	4.79	4.42	4.05	3.69
	0%	1.10	0.73	0.37	0.00	-0.37	-0.73	-1.10
손익	-2.67%	-3.46	-3.83	-4.20	-4.56	-4.93	-5.30	-5.66
	-5.33%	-7.80	-8.17	-8.53	-8.90	-9.27	-9.63	-10.00
	-8%	-11.91	-12.28	-12.65	-13.01	-13.38	-13.75	-14.12

최대 손실 시나리오

위험액	-14.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.05
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 2월 22일

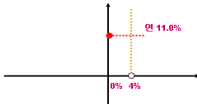
3) 만드점산 결정주기: 매 3개월

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

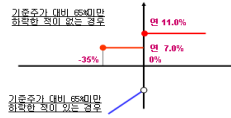
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 선택  
 - 두 기초자산의 가격이 만드점 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%  
 - 두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

6) 만드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600348RT28 만드 유가(ELS): 2007-3974

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	379.52	366.39	353.26	340.13	327.00	313.88	300.75
	5.33%	265.70	252.57	239.44	226.31	213.18	200.05	186.92
	2.67%	152.32	139.19	126.06	112.93	99.80	86.67	73.54
	0%	39.39	26.26	13.13	0.00	-13.13	-26.26	-39.39
	-2.67%	-73.10	-86.23	-99.36	-112.49	-125.61	-138.74	-151.87
	-8.33%	-185.14	-198.26	-211.39	-224.52	-237.65	-250.78	-263.91
	-8%	-296.73	-309.86	-322.99	-336.11	-349.24	-362.37	-375.50

최대 손실 시나리오

위험액	-375.50
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	371.47
-----	--------

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

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

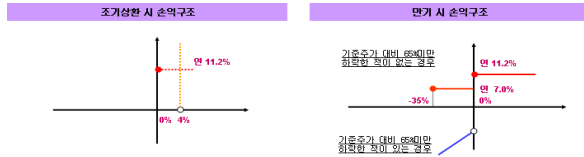
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 \* (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR60034SST27 환비드 유가(ELS): 2017-398회

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	36.39	35.13	33.88	32.62	31.37	30.11	28.86
시나리오	5.33%	25.46	24.21	22.96	21.70	20.45	19.19	17.94
	2.67%	14.53	13.34	12.08	10.83	9.57	8.32	7.06
	0%	3.76	2.51	1.26	0.00	-1.25	-2.51	-3.76
	-2.67%	-7.02	-8.27	-9.52	-10.78	-12.03	-13.29	-14.54
	-5.33%	-17.75	-19.00	-20.26	-21.51	-22.77	-24.02	-25.27
	-8%	-28.43	-29.69	-30.94	-32.20	-33.45	-34.70	-35.96

최대 손실 시나리오

위험액	-35.96
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	35.77
-----	-------

[9] 테리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

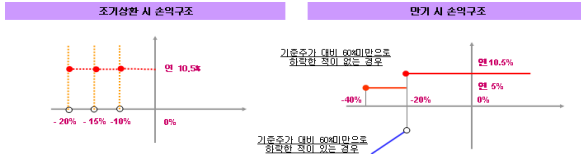
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조별 손(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600172Y143 신영투자(ELS)552

손익 구조별 손 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	-97.76	-99.01	-100.25	-101.50	-102.74	-103.99	-105.24
	5.33%	-33.33	-34.57	-35.82	-37.06	-38.31	-39.55	-40.80
	2.67%	0.91	-0.74	-1.98	-3.23	-4.48	-5.72	-6.97
	0%	3.74	2.49	1.25	0.00	-1.25	-2.49	-3.74
	-2.67%	-23.64	-24.88	-26.13	-27.37	-28.62	-29.86	-31.11
	-8.33%	-81.61	-82.86	-84.10	-85.35	-86.59	-87.84	-89.09
	-8%	-170.19	-171.44	-172.68	-173.93	-175.17	-176.42	-177.67

최대 손실 시나리오

위험액	-177.67
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	205.14
-----	--------



[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

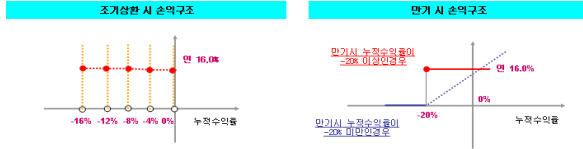
3) 만기점산 결정주기: 매 6개월

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%, 36개월간 최고 누적 수익률])

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS/2007=504)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-0.03	-0.06	-0.13	-0.17	-0.22	-0.27	-0.31
	5.33%	0.06	0.02	-0.03	-0.08	-0.12	-0.17	-0.22
	2.67%	0.12	0.07	0.03	-0.02	-0.07	-0.11	-0.16
	0%	0.14	0.09	0.05	0.00	-0.05	-0.09	-0.14
	-2.67%	0.12	0.07	0.03	-0.02	-0.07	-0.11	-0.16
	-5.33%	0.06	0.02	-0.03	-0.08	-0.12	-0.17	-0.22
	-8%	-0.03	-0.06	-0.13	-0.17	-0.22	-0.27	-0.31

최대 손실 시나리오

위험액	-0.31
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 8월 13일

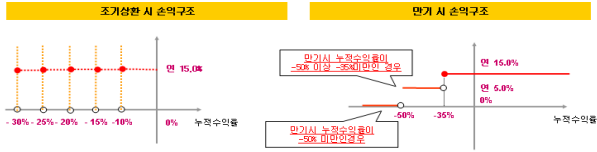
3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상증권(ELS)1191

손익 구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.86	1.53	1.21	0.89	0.57	0.25	-0.07
시나리오	5.33%	1.64	1.31	0.99	0.67	0.35	0.03	-0.29
	2.67%	1.34	1.02	0.70	0.37	0.05	-0.27	-0.59
	0%	0.96	0.64	0.32	0.00	-0.32	-0.64	-0.96
	-2.67%	0.51	0.19	-0.13	-0.45	-0.77	-1.10	-1.42
	-5.33%	-0.02	-0.34	-0.66	-0.98	-1.31	-1.63	-1.95
	-8%	-0.63	-0.95	-1.27	-1.59	-1.91	-2.24	-2.56

최대 손실 시나리오

위험액	-2.56
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	3.39
-----	------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제12호

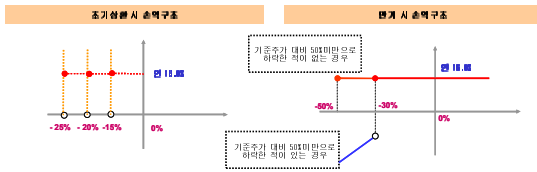
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주
- 2) 만기: 2009년 10월 14일
- 3) 만드침산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2007년 10월 15일의 현대모비스 보통주, 삼성중공업 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(현대모비스, 삼성중공업 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(만기상환일) 연율 16.0%의 수익률로 중도상환이 됨.  
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률로 만드침 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 \* 132%  
- 두 기초자산의 가액(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)

KR603762HTA9 미래에셋증권(ELS)232

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	51.45	51.10	50.75	50.40	50.05	49.70	49.35
	5.33%	34.65	34.30	33.95	33.60	33.25	32.90	32.55
	2.67%	17.85	17.50	17.15	16.80	16.45	16.10	15.75
	0%	1.05	0.70	0.35	0.00	-3.35	-6.70	-10.05
	-2.67%	-15.75	-16.10	-16.45	-16.80	-17.15	-17.50	-17.85
	-8.33%	-32.55	-32.90	-33.25	-33.60	-33.95	-34.30	-34.65
	-8%	-49.35	-49.70	-50.05	-50.40	-50.75	-51.10	-51.45

최대 손실 시나리오

위험액	-51.45
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	51.34
-----	-------

[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

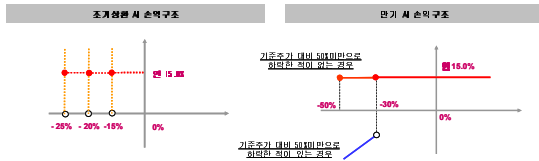
1. 계약금액

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

단위(백만원)

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(만기 상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 확정  
 - 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. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762BTB0 비례예상증권(ELS)240

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	9.87	9.74	9.60	9.46	9.32	9.18	9.05
시나리오	5.33%	6.75	6.61	6.47	6.34	6.20	6.06	5.92
	2.67%	3.60	3.46	3.32	3.18	3.04	2.91	2.77
	0%	0.41	0.28	0.14	0.00	-0.14	-0.28	-0.41
	-2.67%	-2.80	-2.93	-3.07	-3.21	-3.35	-3.49	-3.62
	-5.33%	-6.04	-6.17	-6.31	-6.45	-6.59	-6.73	-6.86
	-8%	-9.30	-9.44	-9.58	-9.72	-9.86	-9.99	-10.13

최대 손실 시나리오

위험액	-10.13
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	11.43
-----	-------

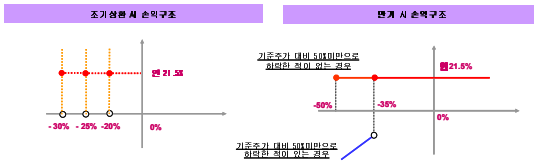
[15] 데리츠 Step Down 단위 피생상품투자신탁 15호

1. 계약금액

단위(백만원)						
구분	기래대상	기래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,020	0	2,020	잔위

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외피생상품의 기초자산: LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010년 01월 07일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 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 한변도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우 : 원금 \* 143%  
 - 두 기초자산의 가격(중중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600345EV11 펀드 운용(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	224.77	210.18	195.60	181.01	166.43	151.84	137.25
	5.33%	163.09	148.50	133.92	119.33	104.75	90.16	75.58
	2.67%	102.75	88.16	73.58	58.99	44.41	29.82	15.24
	0%	42.76	28.17	14.59	0.00	-14.99	-29.17	-43.76
	-2.67%	-13.90	-28.48	-43.07	-57.65	-72.24	-86.82	-101.41
-5.33%	-70.20	-84.79	-99.37	-113.96	-128.54	-143.13	-157.71	
-8%	-125.17	-139.75	-154.34	-168.92	-183.51	-198.09	-212.68	

최대 손실 시나리오

위험액	-212.68
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	232.90
-----	--------

[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

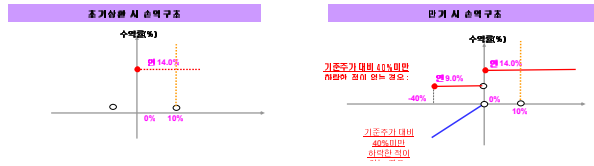
3) 만도청산 결정 주기: 매3개월

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 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조범용 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]테리츠StepDown사모단위파생26호

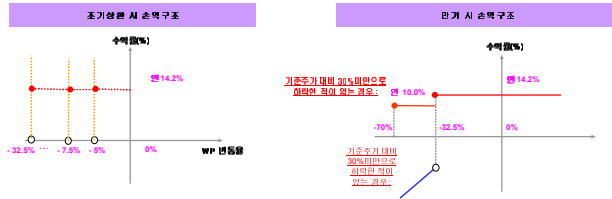
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867B1B0 쿠루남산신통용임(ELS)803

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	230.04	202.65	175.65	146.45	121.26	94.06	66.86
	5.33%	180.59	153.40	126.20	99.01	71.81	44.61	17.42
	2.67%	131.11	103.91	76.72	49.52	22.32	-4.67	-32.07
	0%	81.69	54.39	27.20	0.00	-21.20	-64.39	-81.69
	-2.67%	32.03	-4.83	-22.36	-49.56	-76.75	-103.95	-131.15
-5.33%	-17.56	-44.76	-71.96	-99.16	-126.35	-153.55	-180.74	
-8%	-67.20	-94.39	-121.59	-146.78	-175.98	-203.18	-230.37	

최대 손실 시나리오

위험액	-230.37
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	230.26
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

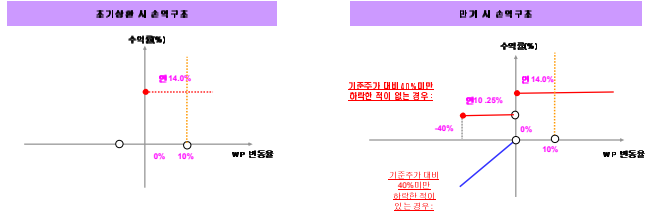
1. 계약금액

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



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

구분	수익구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	95.94	92.46	88.99	85.52	82.05	78.57	75.10	
파생상품	66.90	63.43	59.96	56.48	53.01	49.54	46.06	
기초자산	38.40	34.92	31.45	27.98	24.50	21.03	17.56	
파생상품	10.42	6.95	3.47	0.00	-3.47	-6.95	-10.42	
합계	-17.03	-20.50	-23.96	-27.45	-30.92	-34.39	-37.87	
기초자산	-43.95	-47.42	-50.89	-54.37	-57.84	-61.31	-64.79	
파생상품	-70.34	-73.81	-77.28	-80.76	-84.23	-87.70	-91.18	

최대 손실 시나리오	위험액	75.10
------------	-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	90.38
-----	-------



[19]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트5호

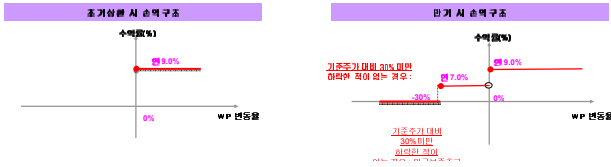
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2011년 1월 24일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
  - 4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가
  - 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가격의 100% 이상인 경우 연이율 9%로 중도상환함.
- 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 \* 121%
  - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금\*100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	40.80	38.21	35.61	33.01	30.42	27.82	25.23	
손익	5.33%	31.19	28.59	26.00	23.40	20.81	18.21	
시나리오	2.67%	20.19	17.59	14.99	12.40	9.80	7.21	
	0%	7.79	5.19	2.60	0.00	-2.60	-5.19	
	-2.67%	-6.00	-6.60	-11.20	-13.79	-16.39	-18.98	
	-5.33%	-21.19	-23.79	-28.39	-30.98	-33.57	-36.16	
	-8%	-37.77	-40.38	-42.98	-45.58	-48.18	-50.78	

최대 손실 시나리오

위험액	25.23
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	54.95
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

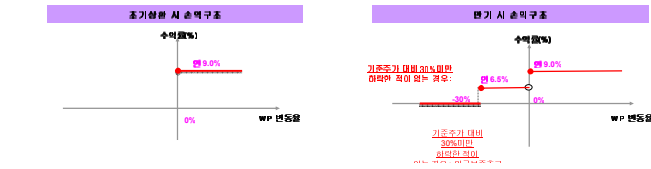
1. 계약금액

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, 평가시점저 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%이만 하락한적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 \* 119.5%
  - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금\*100%



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 비례채증권(ELS)306

구분	손익구조변동 시나리오				변동성 시나리오			
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	27.37	25.44	23.50	21.57	19.64	17.70	15.77	
손익	5.33%	21.28	19.34	17.41	15.48	13.54	11.61	
손익	2.67%	14.09	12.15	10.22	8.29	6.35	4.42	
손익	0%	5.80	3.87	1.93	0.00	-1.93	-3.87	
손익	-2.67%	-3.58	-5.51	-7.45	-9.38	-11.32	-13.25	
손익	-5.33%	-14.06	-15.99	-17.92	-19.86	-21.79	-23.73	
손익	-8%	-25.63	-27.56	-29.50	-31.43	-33.36	-35.30	

최대 손실 시나리오	
위험액	15.77

4. 매매상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	37.56
-----	-------

[2] 메리츠주 수연계 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) 판도청산 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.

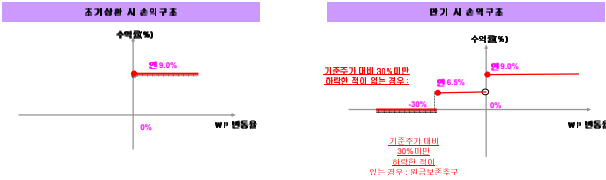
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

- 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 \* 119.5%

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

: 원금\*100%

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조변동 중(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산	8%	21.29	19.78	13.28	16.78	15.27	13.77	12.26
손익	5.33%	16.55	15.04	13.54	12.04	10.53	9.03	7.52
시나리오	2.67%	10.96	9.45	7.95	6.44	4.94	3.44	1.93
	0%	4.51	3.01	1.50	0.00	-1.50	-3.01	-4.51
	-2.67%	-2.78	-4.29	-5.79	-7.30	-8.80	-10.30	-11.81
	-5.33%	-10.93	-12.44	-13.94	-15.44	-16.95	-18.45	-19.96
	-8%	-19.93	-21.44	-22.94	-24.45	-25.95	-27.45	-28.96

최대 손실 시나리오

위험액	12.26
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.21
-----	-------

[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

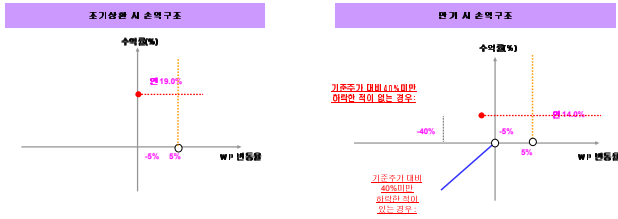
3) 만드침산 결정주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평균기간 중 상환 포함하여 한번이라도 최초기준가격의 95% 이상이거나 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 19%의 수익률로 중도상환

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 무리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	154.69	146.43	138.17	129.91	121.64	113.38	105.12
	5.33%	110.73	102.47	94.21	85.95	77.69	69.43	61.17
	2.67%	67.43	59.17	50.91	42.65	34.39	26.13	17.87
	0%	24.78	16.52	8.26	0.00	-8.26	-16.52	-24.78
손익 구조인 톱	-2.67%	-17.22	-25.48	-33.74	-42.00	-50.26	-58.52	-66.78
	-5.33%	-58.57	-66.83	-75.09	-83.35	-91.61	-99.87	-108.13
	-8%	-99.27	-107.53	-115.79	-124.05	-132.31	-140.57	-148.83

최대 손실 시나리오

위험액	-148.83
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	152.98
-----	--------

[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

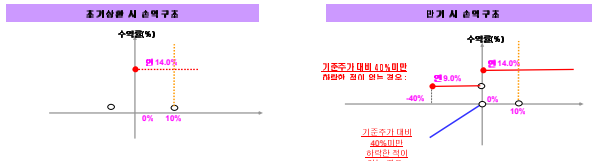
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

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 \* (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR600690BVR2 보유증권(ELS)2660

손익 구조범위 시나리오

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

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, 삼성화재

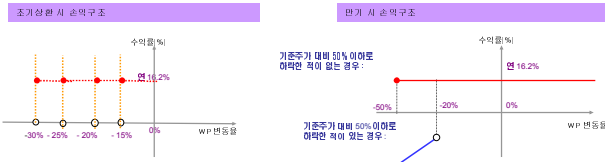
2) 만기: 2010년 09월 30일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

4) 기준지수: 2008년 10월 10일 삼성전자, 삼성화재의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 삼성화재)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 80%이상인 경우(두번째 중도상환일), 75%이상인 경우(세번째 중도상환일), 70%이상인 경우(네번째 중도상환일) 연달아 16.2%의 수익률로 중도상환이 됨. 단, 만기시까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률로 만기 후 펀드 배지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 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
-----	------

**[34] 대리 조주가지 수익계 파생13**

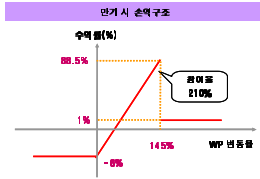
**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 1월 12일
- 3) 만기점산 결정주기: 만기일 가일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
  - 만기 평가일 수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우  
: 원금 \* ( 94% + 210% \* ( 만기기준지수/최초기준지수 - 1 ) )
  - 만기 평가일 수가 최초기준가격 미만일 경우  
: 원금 \* 94%
- 6) 만기점산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우  
: 원금 \* 101%
- 6) 만드의 수익구조



**3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))**  
KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익구조변동 시나리오

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

**[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호**

**1. 계약금액**

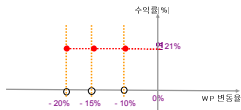
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

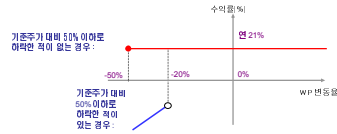
**2. 연기사점의 손익구조**

- 파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 연기: 2012년 02월 15일
- 증권평가일: 매6개월
- 기준지수: 2009년 02월 13일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 발행 후 6개월마다 증권평가를 시행하고, 기초자산(삼성전자 증가, SK텔레콤의 증가)의 평가일 증가가 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 증권평가일), 85%이상인 경우(세번째, 네번째 증권평가일), 80%이상인 경우(다섯번째 증권평가일) 인출 21.0%의 수익률로 종료 상황이 됨.  
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래와 같이 만기 상환금액을 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)
- 만드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
가	8%	2.50	1.75	1.00	0.25	-0.50	-1.25	-2.00
초	5.33%	2.89	2.14	1.39	0.64	-0.11	-0.86	-1.61
자	2.67%	2.81	2.06	1.31	0.56	-0.19	-0.94	-1.69
산	0%	2.25	1.50	0.75	0.00	-0.75	-1.50	-2.25
시	-2.67%	1.21	0.46	-0.29	-1.04	-1.79	-2.54	-3.29
나	-5.33%	-0.30	-1.05	-1.80	-2.55	-3.30	-4.05	-4.80
리	-8%	-2.29	-3.04	-3.79	-4.54	-5.29	-6.04	-6.79

**최대 손실 시나리오**

위험액	-6.79
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	7.41
-----	------



**[6] 데리츠2Star사로증권투신LEHC-2**

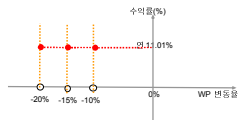
**1. 계약금액**

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

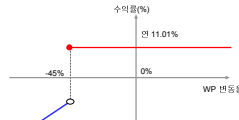
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 증권파생상품의 기초자산: LG전자, 현대차
- 2) 만기: 2012년 4월 12일
- 3) 편드형산결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 13일 LG전자, 현대차지수의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(LG전자, 현대차 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 만을 11.01%의 수익률로 중도상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 끝드 해지  
 → 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가액의 55%보다 이상인 경우  
 : 원금 \* 111.01%  
 - 만기상환결정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55% 미만인 경우  
 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 끝드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익구조인용(최대손실가능금액(단위:백만원))**

KR6692307W45 NA투자증권(ELS)32

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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

**[62] 데리츠2Stier사모증권투자STWF-1**

**1. 계약금액**

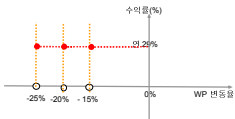
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1771.1	0	1,771	차입

단위(백만원)

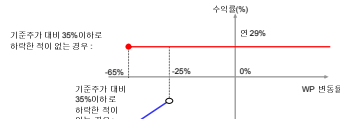
**2. 연기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익구조인출(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%	8.69	8.70	8.72	8.73	8.74	8.76	8.77
	5.33%	3.84	3.85	3.86	3.88	3.89	3.90	3.91
	2.67%	0.93	0.94	0.95	0.97	0.98	0.99	1.00
	0%	-0.94	-0.93	-0.91	0.00	0.01	0.03	0.04
	-2.67%	0.94	0.95	0.97	0.98	0.99	1.00	1.02
	-5.33%	3.86	3.87	3.89	3.90	3.91	3.93	3.94
	-8%	8.73	8.74	8.75	8.77	8.78	8.79	8.81

최대 손실 시나리오

위험액	8.81
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	1.43
-----	------

**[68] 데리츠2Star사로증권LEHC-1호**

**1. 계약금액**

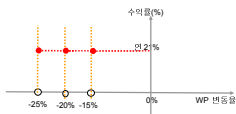
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2045.8	0	2,046	잔위

단위(백만원)

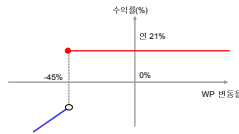
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기시점손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위:백만원))**

KR6682307W43 NH투자증권(ELS)32

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 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 (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) 장기파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

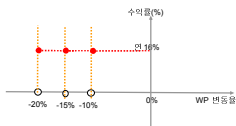
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

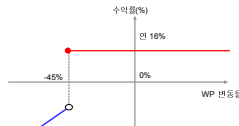
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 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 효력을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 \* 118%  
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)  
 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05
산	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%	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01	-0.01
	-5.33%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	-8%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.05
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)**

위험액	0.00
-----	------

**[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

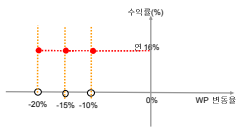
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

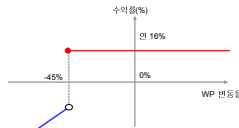
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
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 (다위·백만원)**

위험액	0.00
-----	------

**[67] 데리츠281ar사모증권SEST-1**

**1. 계약금액**

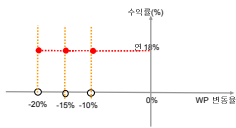
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

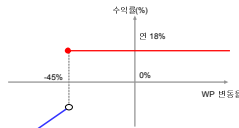
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	10.14	7.23	4.32	1.42	-1.49	-4.39	-7.30
시나리오	5.33%	11.26	8.36	5.45	2.54	-0.36	-3.27	-6.17
	2.67%	10.79	7.88	4.96	2.07	-0.83	-3.74	-6.65
	0%	8.72	5.81	2.91	0.00	-2.91	-5.81	-8.72
	-2.67%	5.05	2.14	-0.77	-3.67	-6.58	-9.48	-12.39
	-5.33%	-0.23	-3.13	-6.04	-8.94	-11.85	-14.76	-17.66
	-8%	-7.10	-10.00	-12.91	-15.82	-18.72	-21.63	-24.53

최대 손실 시나리오

위험액	-24.53
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(다위·백만원)**

위험액	21.55
-----	-------

**[68] 데리츠2Star사로 증권SE ST-4호**

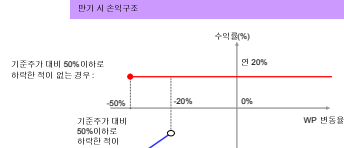
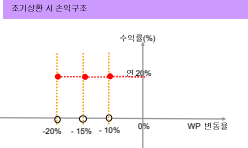
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 06일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 09일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 120%  
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (단위:백 만원))**  
KR6622303W44 : 코분류권(ELS)322

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	2.48	2.48	2.48	2.48	2.48	2.48	2.48
	5.33%	1.10	1.10	1.10	1.10	1.10	1.10	1.10
산	2.67%	0.28	0.28	0.28	0.28	0.28	0.28	0.28
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
시나리오	-2.67%	0.28	0.28	0.28	0.28	0.28	0.28	0.28
	-5.33%	1.10	1.10	1.10	1.10	1.10	1.10	1.10
	-8%	2.48	2.48	2.48	2.48	2.48	2.48	2.48

**최대 손실 시나리오**

위험액	2.48
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)**

위험액	0.13
-----	------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

1. 계약금액

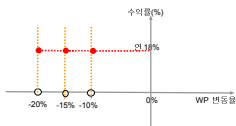
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	차입

단위(백만원)

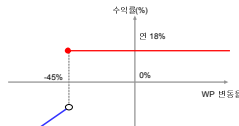
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	5.33%	6.20	4.60	3.00	1.40	-0.20	-1.80	-3.40
산	2.67%	5.94	4.34	2.74	1.14	-0.46	-2.06	-3.66
시나리오	0%	4.80	3.20	1.60	0.00	-1.60	-3.20	-4.80
	-2.67%	2.78	1.18	-0.42	-2.02	-3.62	-5.22	-6.82
	-5.33%	-0.12	-1.72	-3.32	-4.92	-6.52	-8.12	-9.72
	-8%	-3.90	-5.50	-7.10	-8.70	-10.30	-11.90	-13.50

최대 손실 시나리오

위험액	-13.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	11.86
-----	-------



**[77] 데리츠2SIa사모SEST-3**

**1. 계약금액**

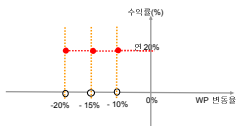
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241.4	0	241	차입

단위(백만원)

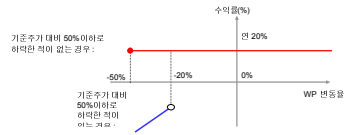
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 비중주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 만을 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 \* 120%  
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))**

KR6562345W35 유인투기증권 (ELS)2382

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	3.17	2.49	1.81	1.13	0.45	-0.23	-0.92
산	5.33%	3.23	2.55	1.87	1.19	0.51	-0.17	-0.86
시나리오	2.67%	2.86	2.18	1.49	0.81	0.13	-0.55	-1.23
	0%	2.05	1.36	0.68	0.00	-0.68	-1.36	-2.05
	-2.67%	0.80	0.11	-0.57	-1.25	-1.93	-2.61	-3.29
	-5.33%	-0.89	-1.57	-2.25	-2.93	-3.62	-4.30	-4.98
	-8%	-3.01	-3.69	-4.37	-5.06	-5.74	-6.42	-7.10

**최대 손실 시나리오**

위험액	-7.10
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)**

위험액	5.88
-----	------

**[78] 데리츠2SIa사모STWF-2**

**1. 계약금액**

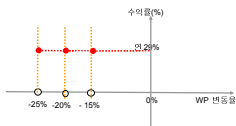
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	잔위

단위: (백만원)

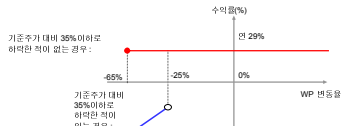
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 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%이 상인 경우(세번째, 네 번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 23%의 수익률로 중도 상환이 됨.  
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 \* 129%  
 - 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

KR6622313W42      코분종권(ELS)325

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	7.56	7.58	7.59	7.60	7.61	7.62	7.63
	5.33%	3.34	3.35	3.36	3.37	3.39	3.40	3.41
산	2.67%	0.81	0.82	0.83	0.84	0.85	0.86	0.87
	0%	-0.03	-0.03	-0.04	0.00	0.01	0.02	0.03
시나리오	-2.67%	0.82	0.83	0.84	0.85	0.86	0.87	0.89
	-5.33%	3.36	3.37	3.38	3.40	3.41	3.42	3.43
	-8%	7.60	7.61	7.62	7.63	7.64	7.66	7.67

**최대 손실 시나리오**

위험액	7.67
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)**

위험액	1.24
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

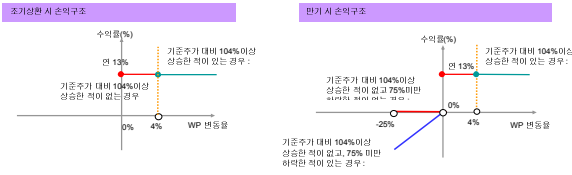
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 수익구조

- 1) 평가대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
  - 2) 만기: 2010년 12월 13일
  - 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
  - 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수 수익 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 (정중 포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 수익구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

수익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	9,627.13	9,181.85	8,736.57	8,291.29	7,846.01	7,400.74	6,955.46
	5.33%	6,873.04	6,427.76	5,982.48	5,537.20	5,091.92	4,646.65	4,201.37
시나리오	2.67%	4,109.27	3,663.99	3,218.72	2,773.44	2,328.16	1,882.88	1,437.60
	0%	1,335.83	890.56	445.28	0.00	-445.28	-890.56	-1,335.83
시나리오	-2.67%	-1,447.28	-1,892.55	-2,337.83	-2,783.11	-3,228.39	-3,673.67	-4,118.94
	-5.33%	-4,240.06	-4,685.34	-5,130.62	-5,575.89	-6,021.17	-6,466.45	-6,911.73
	-8%	-7,042.52	-7,487.79	-7,933.07	-8,378.35	-8,823.63	-9,268.91	-9,714.18

최대손실 시나리오

위험액	-9,714.18
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,798.35
-----	----------

[79-2] **메리츠투자지수연계사모8호**

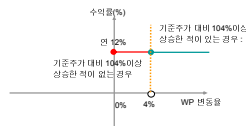
1. 계약금액

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

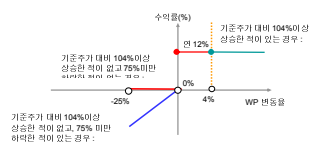
2. 만기시점의 수익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자자산수익계사표8호**

1. **계약금액**

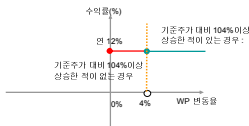
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔위

단위(백만원)

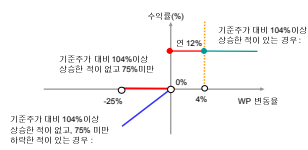
2. **평가시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 16일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수 수의 증가
- 5) 발행 후 매3개월마다 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%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
      - : 원금 \* 112%
    - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
      - : 원금 \* (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR603061ATB9      교보증권(ELS)87

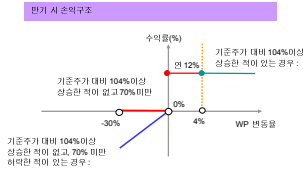
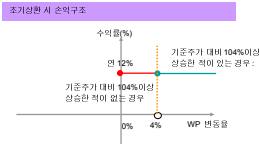
[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 수익구조

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



KR6008679TA3 곳님 신원증권(ELS)786

**[79-5] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

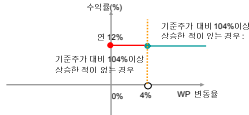
**2. 만기시점의 손익구조**

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

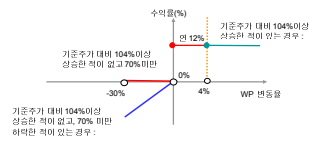
- 단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 \* 112%
  - 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6008676TB7 곳모닝 신환증권(ELS)797

**[79-6] 메리츠주가지수연계서표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

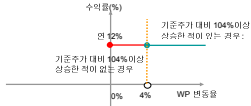
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

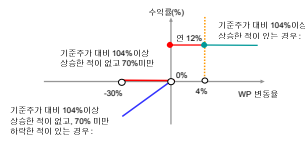
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**





**[79-7] 메리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

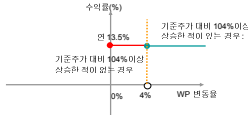
**2. 만기시점의 손익구조**

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

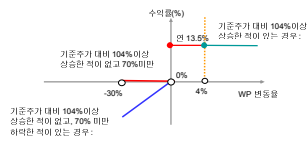
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격 이 할빈도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우  
 : 원금 \* 113.5%  
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 \* (만기 기 준지수/최 초기 준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6008675TC7 코트님 신한증권(ELS)809

**[79-8] 메리츠주가지수연계사모8호**

**1. 계약금액**

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

단위: (백만원)

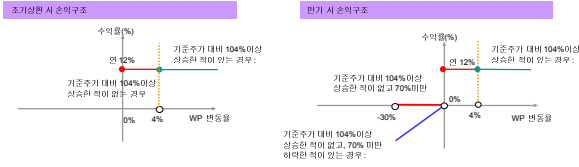
**2. 만기시점의 손익구조**

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

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

- 두 기초자산의 가격 이 일반도 기준가격의 65%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 \* 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (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**

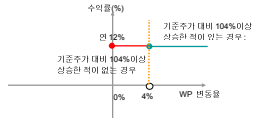
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	상위

단위(백만원)

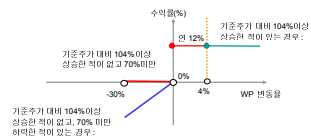
**2. 만기시점의 손익구조**

- 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 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
  - 단, 만기시 (2차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
    - 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 \* 112%
    - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

**[79-10] 에리츠주가지수연계사표8호**

**1. 계약금액**

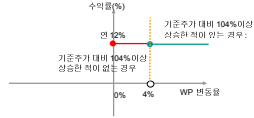
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	장외

단위(백만원)

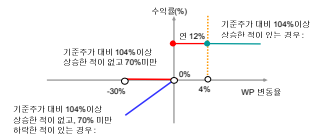
**2. 평가시점의 손익구조**

- 1) 참여대상종목의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지수 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 12%의 수익률로 중도상환  
 단, 만기시(2차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우  
 : 원금 + 11.2%  
 - 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우  
 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

**[79-11] 에리츠주가지수연계사료8호**

**1. 계약금액**

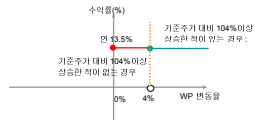
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	장외

단위(백만원)

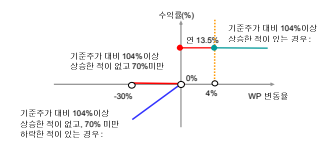
**2. 만기시점의 손익구조**

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

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

**[79-12] 메리츠투자지수형계사모8호**

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 손익구조**

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

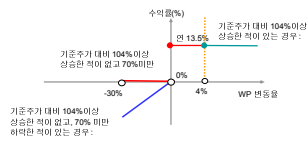
단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
 - 두 기초자산의 가격 이 할빈도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.3.5%  
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기 준지수/최초기 준지수)

**6) 펀드의 수익구조**

**조기상환 시 손익구조**



**만기 시 손익구조**



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

**[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호**

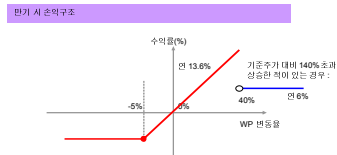
**1. 계약금액**

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

단위:백만원

**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 3월 19일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 만기 만 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 평가지 수가 최초기 존가격 이상이고 최초기 존가격 의 140% 미만일 경우  
: 원금 \* ( 95% + 100% \* ( 만기 기 존지 수 / 최초 기 존지 수 - 1 ) )
  - 만기 평가지 수가 최초기 존가격 미만일 경우  
: 원금 \* 95%
- 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기 존지 수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우  
: 원금 \* 100%
- 6) 권드의 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%	
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
-----	------

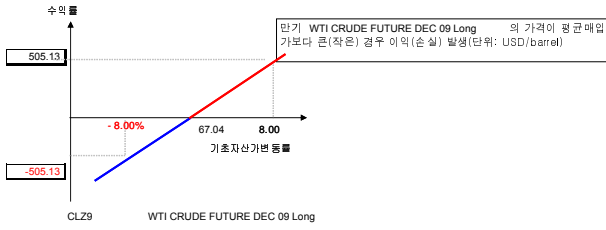
[80-1] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	94	0	94	장내

단위:계약

2. 연기사험의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLZ9 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	505.15
	5.33%	336.55
	2.67%	168.59
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-168.59
	-5.33%	-336.55
	-8%	-505.15

최대손실 시나리오	
위험액	-505.15

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2,111
-----	-------

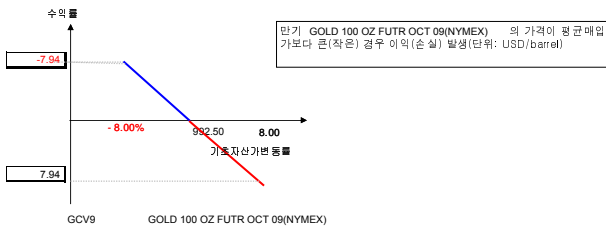
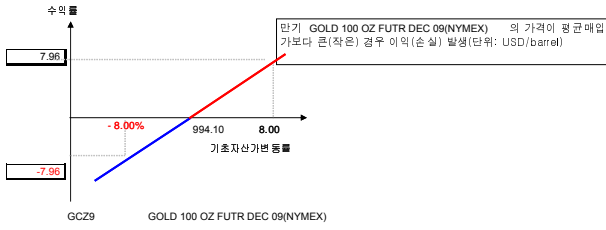


[80-2] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

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

2. 헷지시점의 손익구조



**[80] 대리 조주가지 수연계 사모증권10호**

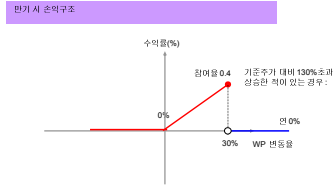
**1. 계약금액**

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

단위(백만원)

**2. 만기시점의 손익구조**

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



**3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR6673105W54 동부증권-엘스플러스(ELS)B1

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
8%	-14.56	-16.66	-18.74	-20.82	-22.90	-24.98	-27.06
5.33%	-7.07	-9.15	-11.23	-13.31	-15.39	-17.47	-19.55
2.67%	-0.13	-2.21	-4.29	-6.37	-8.45	-10.53	-12.62
0%	6.24	4.16	2.08	0.00	-2.08	-4.16	-6.24
-2.67%	12.05	9.97	7.89	5.81	3.73	1.65	-0.44
-5.33%	17.29	15.21	13.13	11.05	8.97	6.88	4.80
-8%	21.96	19.88	17.80	15.72	13.64	11.56	9.48

**최대 손실 시나리오**

위험액	9.48
-----	------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	25.90
-----	-------

**[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호**

**1. 계약금액**

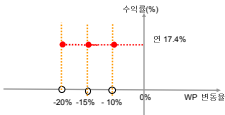
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	275.9	0	275.9	잔위

단위:백만원

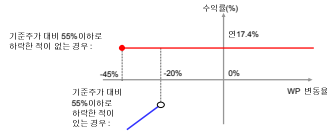
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

**손익 구조변동률 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.71	-0.62	-0.93	-1.05	-1.16	-1.27	-1.38
	5.33%	0.03	-0.08	-0.19	-0.30	-0.41	-0.53	-0.64
시나리오	2.67%	0.38	0.27	0.16	0.05	-0.07	-0.18	-0.29
	0%	0.34	0.22	0.11	0.00	-0.11	-0.22	-0.34
	-2.67%	-0.10	-0.22	-0.33	-0.44	-0.55	-0.66	-0.78
	-5.33%	-0.94	-1.05	-1.16	-1.27	-1.39	-1.50	-1.61
	-8%	-2.17	-2.28	-2.39	-2.50	-2.61	-2.73	-2.84

**최대 손실 시나리오**

위험액	-2.84
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	1.81
-----	------

**[83] 데리츠2Star사모증권SET-5호**

**1. 계약금액**

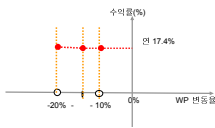
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

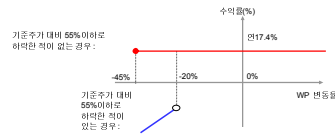
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**

KR6522333W57 대우증권(ELS)2976

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-4.55	-5.27	-5.99	-6.71	-7.44	-8.16	-8.88
	5.33%	0.22	-0.50	-1.22	-1.94	-2.66	-3.39	-4.11
시나리오	2.67%	2.46	1.74	1.01	0.29	-0.43	-1.15	-1.87
	0%	2.16	1.44	0.72	0.00	-0.72	-1.44	-2.16
	-2.67%	-0.66	-1.38	-2.11	-2.83	-3.55	-4.27	-4.99
	-5.33%	-6.02	-6.74	-7.46	-8.18	-8.91	-9.63	-10.35
	-8%	-13.91	-14.63	-15.35	-16.08	-16.80	-17.52	-18.24

최대 손실 시나리오

위험액	-18.24
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	11.64
-----	-------

[84] 테라츠2Star사로 증권SEPO-2호

1. 계약금액

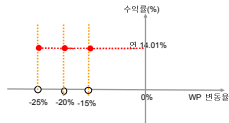
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	390.1	0	390.1	잔위

단위:백만원

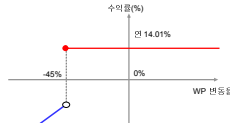
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(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
-----	------

[85] 데리츠2Star사로증권SEP-O-1호

1. 계약금액

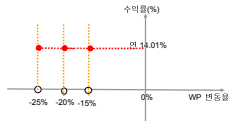
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1408.7	0	1,408.7	잔위

단위:백만원

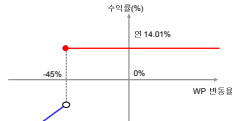
2. 만기시점의 손익구조

- 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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))  
KR6662305W64 권위스마트(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
-----	------

**[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호**

**1. 계약금액**

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

**2. 만기시점의 손익구조**

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, KT 보통주

2) 만기: 2012년 5월 10일

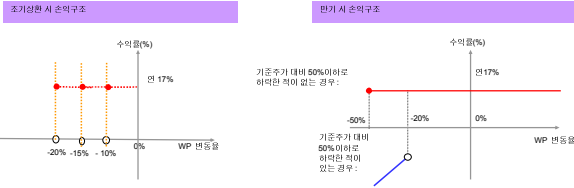
3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



**3. 손익 구조표인 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))**

KR6562319W52 유가증권 (ELS)2415

**손익 구조표인물 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.25	-0.29	-0.32	-0.35	-0.38	-0.41	-0.45
	5.33%	-0.06	-0.09	-0.12	-0.15	-0.19	-0.22	-0.25
시나리오	2.67%	0.06	0.03	-0.01	-0.04	-0.07	-0.10	-0.13
	0%	0.10	0.06	0.03	0.00	-0.03	-0.06	-0.10
	-2.67%	0.05	0.02	-0.01	-0.04	-0.07	-0.11	-0.14
	-5.33%	-0.07	-0.10	-0.13	-0.16	-0.19	-0.23	-0.26
	-8%	-0.27	-0.30	-0.33	-0.36	-0.39	-0.43	-0.46

**최대 손실 시나리오**

위험액	-0.46
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	1.18
-----	------

**[88] 데리츠2Star사로증권SCDM-1호**

**1. 계약금액**

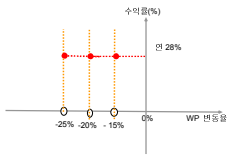
구분		거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS		462.0	0	462.0	차입

단위:백만원

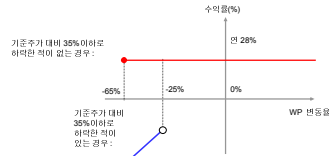
**2. 만기시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	63.72	50.51	37.30	24.09	10.88	-2.33	-15.54
손리	5.33%	55.98	42.77	29.56	16.35	3.14	-10.07	-23.28
오	2.67%	47.95	34.74	21.53	8.32	-4.89	-18.10	-31.31
	0%	39.63	26.42	13.21	0.00	-13.21	-26.42	-39.63
	-2.67%	31.02	17.81	4.60	-3.61	-21.62	-35.03	-48.24
	-5.33%	22.12	8.91	-4.30	-17.51	-30.72	-43.93	-57.14
	-8%	12.93	-0.28	-13.49	-26.70	-39.91	-53.12	-66.33

최대 손실 시나리오

위험액	-66.33
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	69.65
-----	-------



[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

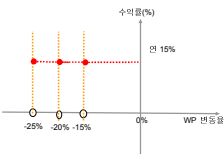
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	30.0	0	30.0	차입

단위:백만원

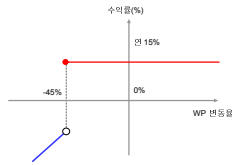
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6662311W58 환위스프레드(ELS)117

손익 구조변동 시나리오

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

[90] 데리츠2Star사로증권POLE-이 호

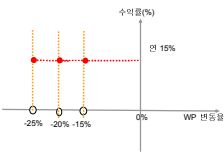
1. 계약금액

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

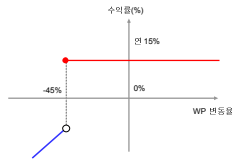
2. 평가시점의 손익구조

- 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 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지  
- 두 기초자산의 가액이 기준가액의 55%이상인 경우  
: 원금 \* 115%  
- 두 기초자산의 가액 중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%미만인 경우  
: 원금 \* (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동률(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%	0.10	-0.18	-0.45	-0.73	-1.00	-1.28	-1.55
	5.33%	0.97	0.70	0.42	0.15	-0.13	-0.40	-0.68
시나리오	2.67%	1.22	0.94	0.67	0.39	0.12	-0.16	-0.44
	0%	0.83	0.55	0.28	0.00	-0.28	-0.55	-0.83
	-2.67%	-0.20	-0.47	-0.75	-1.02	-1.30	-1.57	-1.85
	-5.33%	-1.85	-2.13	-2.40	-2.68	-2.95	-3.23	-3.51
	-8%	-4.14	-4.42	-4.69	-4.97	-5.24	-5.52	-5.79

최대 손실 시나리오

위험액	-6.79
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.09
-----	------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

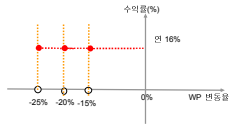
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	잔위

단위(백만원)

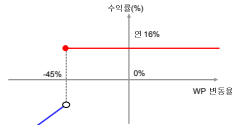
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 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%	0.55	0.42	0.30	0.17	0.04	-0.09	-0.22
	5.33%	0.57	0.44	0.32	0.19	0.06	-0.07	-0.20
시나리오	2.67%	0.52	0.39	0.26	0.13	0.00	-0.12	-0.25
	0%	0.38	0.26	0.13	0.00	-0.13	-0.26	-0.38
	-2.67%	0.18	0.05	-0.06	-0.21	-0.34	-0.46	-0.59
	-5.33%	-0.11	-0.24	-0.36	-0.49	-0.62	-0.75	-0.88
	-8%	-0.47	-0.60	-0.73	-0.85	-0.98	-1.11	-1.24

최대 손실 시나리오

위험액	-1.24
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.93
-----	------

**[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]**

**1. 계약금액**

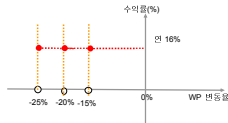
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

단위:백만원

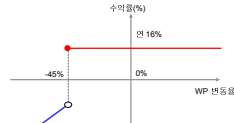
**2. 만기시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 16%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 \* 116%  
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우  
: 평균 \* (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)**

KR6522308W66 대우증권ELS2998

**손익 구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	9.89	7.60	5.30	3.01	0.71	-1.58	-3.88
손익	5.33%	10.25	7.96	5.66	3.37	1.07	-1.22	-3.52
시나리오	2.67%	9.25	6.96	4.66	2.37	0.07	-2.22	-4.52
	0%	6.88	4.58	2.29	0.00	-2.29	-4.59	-6.88
	-2.67%	3.16	0.88	-1.43	-3.73	-6.02	-8.32	-10.61
	-5.33%	-1.94	-4.23	-6.53	-8.82	-11.12	-13.41	-15.71
	-8%	-8.39	-10.69	-12.98	-15.28	-17.57	-19.87	-22.16

**최대 손실 시나리오**

위험액	-22.16
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	16.59
-----	-------

**[93] 데리츠2Star사로증권LEHC-3**

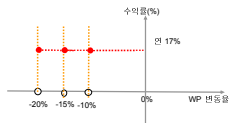
**1. 계약금액**

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

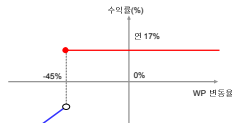
**2. 평가시점의 손익구조**

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



**3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)**  
KR6562310W51 유가증권(ELS)2414

**손익구조변동 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-0.66	-1.05	-1.42	-1.79	-2.16	-2.53	-2.90
손익	5.33%	0.61	0.24	-0.13	-0.50	-0.87	-1.24	-1.61
손익	2.67%	1.21	0.84	0.47	0.10	-0.27	-0.64	-1.01
손익	0%	1.11	0.74	0.37	0.00	-0.37	-0.74	-1.11
손익	-2.67%	0.32	-0.05	-0.42	-0.79	-1.16	-1.53	-1.90
손익	-5.33%	-1.16	-1.53	-1.90	-2.27	-2.64	-3.01	-3.38
손익	-8%	-3.34	-3.71	-4.08	-4.45	-4.82	-5.19	-5.56

**최대 손실 시나리오**

위험액	-5.56
-----	-------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)**

위험액	7.08
-----	------

**[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1**

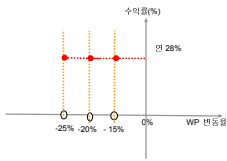
**1. 계약금액**

단위(백만원)						
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순보지선(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	잔위

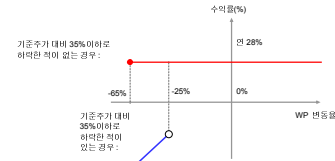
**2. 만기시점의 손익구조**

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

**손익 구조표준 편 시나리오**

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	48.35	37.06	25.76	14.46	3.16	-8.13	-19.43
	5.33%	45.20	33.90	22.60	11.31	0.01	-11.29	-22.59
손익	2.67%	40.38	29.08	17.78	6.49	-4.81	-16.11	-27.41
	0%	38.89	22.60	11.30	0.00	-11.29	-22.60	-33.89
시나리오	-2.67%	29.74	14.45	3.15	-8.13	-19.45	-30.75	-42.04
	-5.33%	15.93	4.63	-6.67	-17.97	-29.26	-40.56	-51.86
	-8%	4.45	-6.85	-18.15	-29.45	-40.74	-52.04	-63.34

최대 손실 시나리오

위험액	-63.34
-----	--------

**4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)**

위험액	50.40
-----	-------

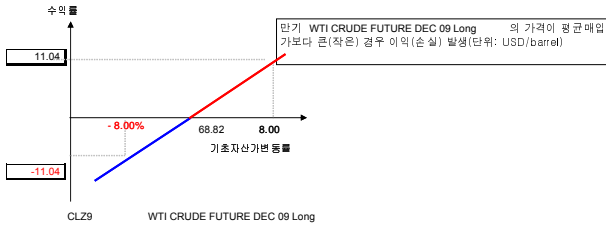
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유\_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CL29 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	11.04
	5.33%	7.35
	2.67%	3.68
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-3.68
	-5.33%	-7.35
	-8%	-11.04

최대손실 시나리오	
위험액	-11.04

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.4
-----	-----

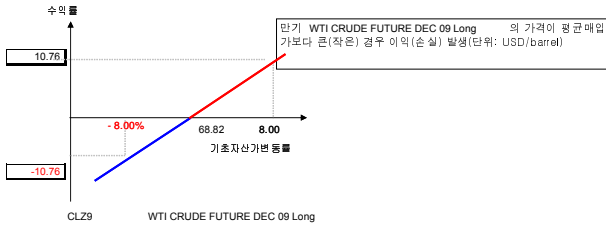
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



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

CLZ9 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	37.54
	5.33%	25.01
	2.67%	12.53
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-12.53
	-5.33%	-25.01
	-8%	-37.54

최대 손실 시나리오	
위험액	-37.54

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	152
-----	-----

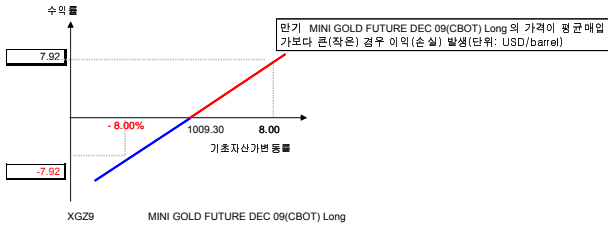


[96-2] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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



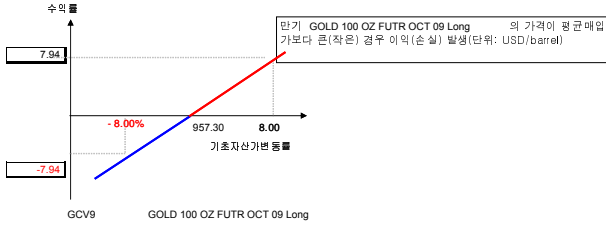
[96-3] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조

