

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

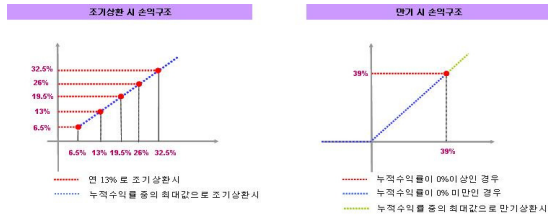
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동률 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
손익구조변동률	-8.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-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 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: 액면금액 지급 (원금보장추구)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.02
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

14) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

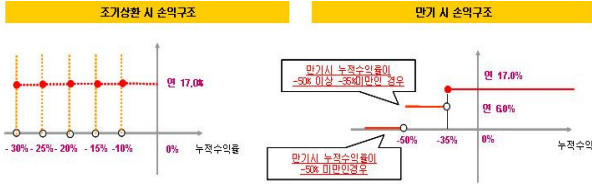
3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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 만드 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) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백 만원))

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.04
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	0.00
-----	------

[5]에리츠 StepDown 사모펀드 파생상품투자전략 24호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 파생상품의 기초자산: 한진해운 보통주, 대우조선해양 보통주

2) 만기: 2009년 10월 23일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

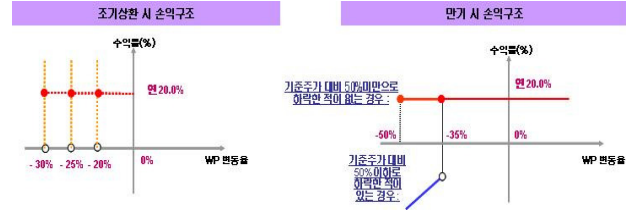
- 두 기초자산의 가격이 한변도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 65%보다 작은 경우

: 할금 * 140%

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

: 할금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동 중(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR60376207AD 이력익성증권 (ELS)243

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산	11.52	11.42	11.32	11.22	11.12	11.02	10.92
손익	5.33%	8.07	7.97	7.87	7.77	7.67	7.47
시나리오	2.67%	4.33	4.23	4.13	4.03	3.93	3.83
	0%	0.30	0.20	0.10	0.00	-0.10	-0.20
	-2.67%	-4.01	-4.12	-4.22	-4.32	-4.42	-4.52
	-5.33%	-6.62	-6.72	-6.82	-6.92	-7.03	-7.13
	-8%	-13.52	-13.62	-13.72	-13.82	-13.92	-14.02

최대 손실 시나리오

위험액 -14.12

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 14.72

[6]에리츠 StepDown 사모펀위과정상물투자신탁 25호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 투산중공업 보통주, SK에너지 보통주

2) 만기: 2009년 11월 12일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

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

- 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))

KR600345TTB8 최대 손실(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	15.52	15.29	15.06	14.82	14.59	14.36	14.12
	5.33%	10.39	10.15	9.92	9.69	9.45	9.22	8.99
	2.67%	5.45	5.21	4.98	4.75	4.51	4.28	4.05
	0%	0.70	0.47	0.23	0.00	-0.23	-0.47	-0.70
손익 구조변동 시나리오	-2.67%	-3.85	-4.09	-4.32	-4.55	-4.79	-5.02	-5.25
	-5.33%	-8.21	-8.44	-8.68	-8.91	-9.14	-9.38	-9.61
	-8%	-12.37	-12.61	-12.84	-13.07	-13.31	-13.54	-13.77

최대 손실 시나리오

위험액	-13.77
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.02
-----	-------

[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) 연기: 2010년 2월 22일

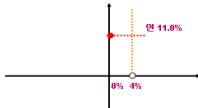
3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

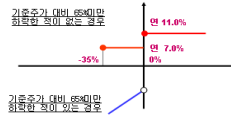
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가격의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확립 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 만보트 기준가격의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600348RT28 최대 손실(ELS): 2007-3974

손익구조범위 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	364.25	353.70	343.15	332.60	322.05	311.50	300.94
	5.33%	253.27	242.72	232.17	221.62	211.07	200.51	189.96
	2.67%	142.41	131.85	121.30	110.75	100.20	89.65	79.10
	0%	31.65	21.10	10.55	0.00	-10.55	-21.10	-31.65
	-2.67%	-79.96	-89.53	-100.08	-110.64	-121.19	-131.74	-142.29
	-5.33%	-189.50	-200.05	-210.61	-221.16	-231.71	-242.26	-252.81
	-8%	-299.91	-310.46	-321.01	-331.56	-342.11	-352.67	-363.22

최대 손실 시나리오

위험액	-363.22
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	361.24
-----	--------

[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 중도 상환이 됨.

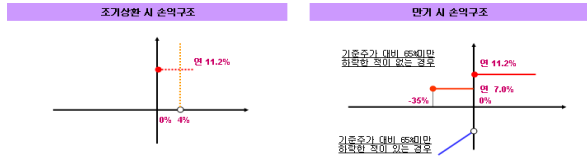
단, 연가시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

- 두 기초자산의 가격(장종료값)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이하 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 시나리오	8%	34.88	33.87	32.86	31.85	30.85	29.84	28.83
	5.33%	24.25	23.24	22.23	21.22	20.22	19.21	18.20
	2.67%	13.63	12.62	11.61	10.61	9.60	8.59	7.58
	0%	3.02	2.02	1.01	0.00	-1.01	-2.02	-3.02
	-2.67%	-7.57	-8.58	-9.59	-10.59	-11.60	-12.61	-13.62
	-5.33%	-16.15	-19.16	-20.16	-21.17	-22.18	-23.19	-24.19
	-8%	-26.72	-29.72	-30.73	-31.74	-32.75	-33.75	-34.76

최대 손실 시나리오

위험액	-34.76
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	34.53
-----	-------

[9] 테리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 8호

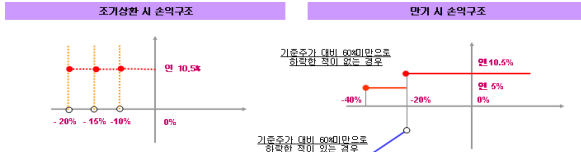
1. 계약금액

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, 만기시까지 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(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조별 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR600172YT43 신영투자(ELS)552

손익 구조별 손익 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13
	5.33%	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50
	2.67%	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13	-3.13
	-5.33%	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50	-12.50
	-8%	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13	-28.13

최대 손실 시나리오

위험액	-28.13
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[10] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 6월 3일

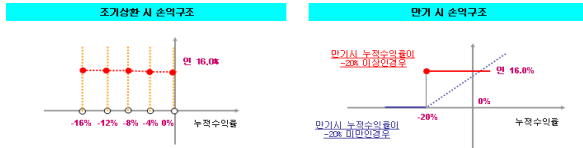
3) 만기점산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007=504

손익 구조범용 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07
	5.33%	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05
	2.67%	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	-5.33%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05
	-8%	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07

최대 손실 시나리오

위험액	-0.07
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

[11] 메리츠 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 8월 13일

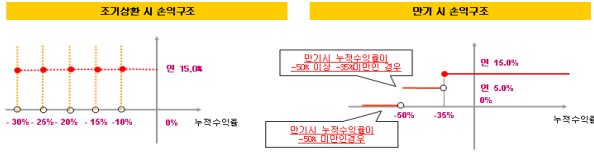
3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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%	1.19	0.99	0.80	0.60	0.41	0.21	0.02
시나리오	5.33%	1.02	0.82	0.63	0.43	0.24	0.04	-0.15
	2.67%	0.82	0.62	0.43	0.23	0.04	-0.15	-0.35
	0%	0.59	0.39	0.20	0.00	-0.20	-0.39	-0.59
	-2.67%	0.32	0.13	-0.07	-0.26	-0.46	-0.66	-0.85
	-5.33%	0.03	-0.17	-0.36	-0.56	-0.75	-0.95	-1.15
	-8%	-0.30	-0.49	-0.69	-0.89	-1.08	-1.28	-1.47

최대 손실 시나리오

위험액	-1.47
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.76
-----	------

[13] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자실태 제12호

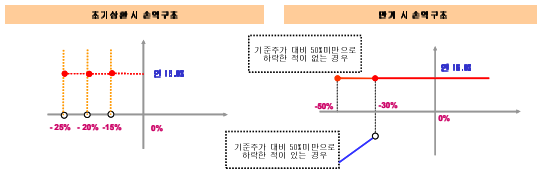
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익구조의 최(최대)손실가능금액(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%	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
-----	------

[14] 메리츠 StepDown 단위파생상품 투자신탁 제13호

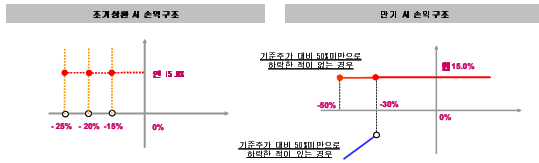
1. 계약금액

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 최초기준가격의 85%이상인 경우(1번째 중도상환일), 80%이상인 경우(2번째 중도상환일), 75%이상인 경우(3번째 중도상환일), 70%이상인 경우(만기상환일) 연율 15.0%의 수익률로 중도상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 70%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
 - 두 기초자산의 가격(중도상환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 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%	15.70	15.63	15.56	15.48	15.41	15.34	15.26
	5.33%	10.11	10.04	9.97	9.89	9.82	9.75	9.67
	2.67%	4.95	4.88	4.81	4.73	4.66	4.59	4.51
	0%	0.22	0.15	0.07	0.00	-0.07	-0.15	-0.22
	-2.67%	-4.06	-4.16	-4.23	-4.31	-4.38	-4.45	-4.53
-5.33%	-7.96	-8.04	-8.11	-8.18	-8.26	-8.33	-8.40	
-8%	-11.41	-11.49	-11.56	-11.63	-11.71	-11.78	-11.85	

최대 손실 시나리오

위험액	-11.85
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.00
-----	-------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

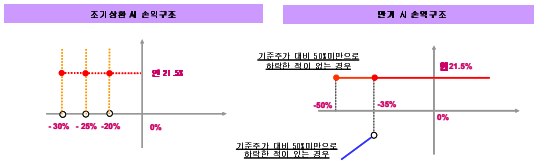
1. 계약금액

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

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 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) 인월 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 최대 손실(ELS)2008-647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	244.14	229.32	214.51	199.69	184.87	170.05	155.23
	5.33%	179.08	164.26	149.45	134.63	119.81	104.99	90.18
	2.67%	112.52	97.70	82.88	68.07	53.25	38.43	23.61
	0%	44.45	29.64	14.82	0.00	-14.82	-29.64	-44.45
	-2.67%	-25.12	-39.93	-54.75	-69.57	-84.39	-99.21	-114.02
	-5.33%	-96.19	-111.01	-125.82	-140.64	-155.46	-170.28	-185.10
	-8%	-166.77	-183.58	-198.40	-213.22	-228.04	-242.85	-257.67

최대 손실 시나리오

위험액	-257.67
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	243.20
-----	--------

[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

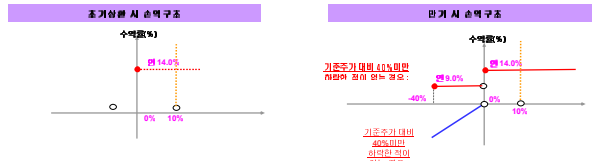
3) 만도청산 결정 주기: 매3개월

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 확립 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 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
-----	------

[17]테리 조StepDown사모단위 편성26호

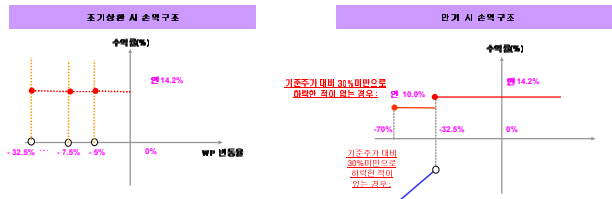
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: CJ 보통주
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 14일의 CJ 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(CJ 보통주)의 최초기준가격의 95%(1차중도상환일), 92.5%(2차중도상환일), 90.0%(3차중도상환일), 87.5%(4차중도상환일), 85%(5차중도상환일), 82.5%(6차중도상환일), 80%(7차중도상환일), 77.5%(8차중도상환일), 75%(9차중도상환일), 72.5%(10차중도상환일), 70.0%(11차중도상환일), 67.5%(만기상환일) 이상인 경우 만이율 14.2%의 수익률도 중도상환이 됨.
 67.5%(만기상환일) 이상인 경우 만이율 14.2%의 수익률도 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 쿠루남산한동림(ELS)803

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	228.68	202.43	176.18	149.94	123.69	97.44	71.19
	5.33%	178.22	151.97	125.72	99.48	73.23	46.98	20.73
	2.67%	128.24	101.99	73.74	49.50	23.25	-3.00	-29.25
	0%	78.74	52.50	26.26	0.00	-23.25	-52.50	-78.74
	-2.67%	29.73	9.48	-22.77	-49.01	-75.26	-101.51	-127.76
-5.33%	-18.80	-45.05	-71.30	-97.55	-123.79	-150.04	-176.29	
-8%	-66.85	-93.10	-119.35	-145.59	-171.84	-198.09	-224.34	

최대 손실 시나리오

위험액	-224.34
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	247.70
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

1. 계약금액

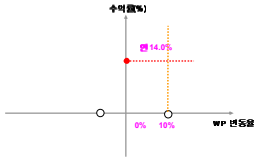
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,550	0	1,550	잔위

단위(백만원)

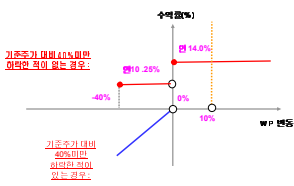
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주
- 2) 만기: 2010년 1월 15일
- 3) 만기점산 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 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 원드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환번도 기준가격의 60%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 120.5%
 - 두 기초자산의 가격(상종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (만기기준지수/초기기준지수)
 6) 만기의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	84.58	81.92	79.27	76.61	73.95	71.29	68.64	
손익	5.33%	58.80	56.14	53.48	50.82	48.17	45.51	
손익	2.67%	33.26	30.60	27.95	25.29	22.63	19.97	
손익	0%	7.97	5.31	2.66	0.00	-2.66	-5.31	
손익	-2.67%	-17.07	-19.73	-22.38	-25.04	-27.70	-30.35	
손익	-5.33%	-41.86	-44.52	-47.17	-49.83	-52.49	-55.15	
손익	-8%	-66.40	-69.06	-71.72	-74.37	-77.03	-79.69	

최대 손실 시나리오

위험액	68.64
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	62.62
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서5호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

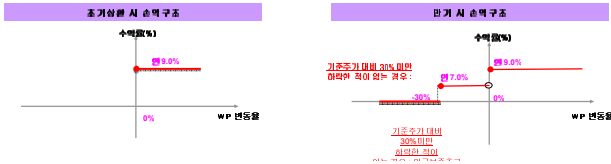
단, 평가시점에 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 원도 해지

- 두 기초자산의 가격이 원배도 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. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	44.57	42.11	39.65	37.18	34.72	32.26	29.80
손익	5.33%	33.73	31.27	28.81	26.35	23.88	21.42
시나리오	2.67%	21.34	18.87	16.41	13.95	11.49	9.03
	0%	7.39	4.92	2.46	0.00	-2.46	-4.92
	-2.67%	-6.12	-10.56	-13.04	-15.51	-17.97	-20.43
	-5.33%	-25.18	-27.64	-30.11	-32.57	-35.03	-37.49
	-8%	-43.80	-46.26	-48.72	-51.19	-53.65	-56.11

최대 손실 시나리오

위험액	29.80
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	59.60
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단원회 구성 6호

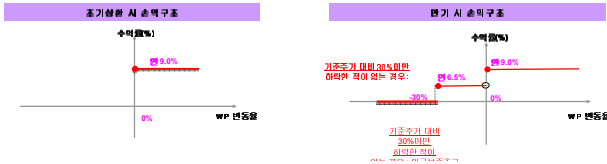
1. 계약금액

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%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR603762OV23 미래에셋증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
8%	30.75	28.90	27.04	25.19	23.33	21.48	19.62	
5.33%	23.47	21.62	19.76	17.91	16.05	14.20	12.34	
2.67%	15.08	13.22	11.37	9.51	7.66	5.80	3.95	
0%	5.57	3.71	1.86	0.00	-1.86	-3.71	-5.57	
-2.67%	-5.06	-6.92	-8.77	-10.63	-12.48	-14.34	-16.19	
-5.33%	-16.81	-18.67	-20.52	-22.38	-24.23	-26.09	-27.94	
-8%	-29.67	-31.53	-33.38	-35.24	-37.09	-38.95	-40.80	

최대 손실 시나리오

위험액	19.62
-----	-------

4. 매매상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.94
-----	-------

[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. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만드형산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

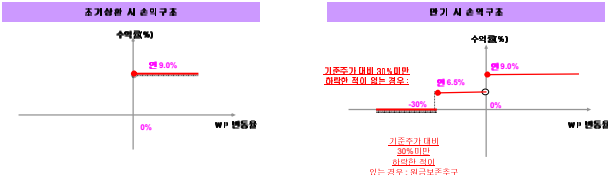
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

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

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

: 원금*100%

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조변동 중(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초 자산	23.92	22.48	21.03	19.59	18.15	16.70	15.26
손익	5.33%	18.26	16.81	15.37	13.93	12.49	11.04
손익	2.67%	11.73	10.28	8.84	7.40	5.96	4.51
손익	0%	4.33	2.89	1.44	0.00	-1.44	-2.89
손익	-2.67%	-3.94	-5.38	-6.82	-8.27	-9.71	-11.15
손익	-5.33%	-13.07	-14.52	-15.96	-17.40	-18.85	-20.29
손익	-8%	-23.06	-24.52	-25.96	-27.41	-28.85	-30.29

최대 손실 시나리오

위험액	15.26
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.07
-----	-------

[28] 메리츠증권주연계사모파생1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 만기: 2010년 08월 04일

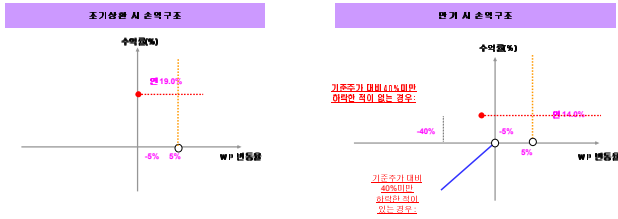
3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 두리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	161.56	153.54	145.52	137.50	129.47	121.45	113.43
	5.33%	115.12	107.09	99.07	91.05	83.02	75.00	66.98
	2.67%	69.29	61.26	53.24	45.22	37.19	29.17	21.15
	0%	24.07	16.05	8.02	0.00	-8.02	-16.05	-24.07
	-2.67%	-20.53	-28.55	-36.58	-44.60	-52.62	-60.65	-68.67
-5.33%	-64.51	-72.54	-80.56	-88.58	-96.61	-104.63	-112.65	
-8%	-107.88	-115.91	-123.93	-131.95	-139.98	-148.00	-156.02	

최대 손실 시나리오

위험액	-156.02
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	156.09
-----	--------

[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

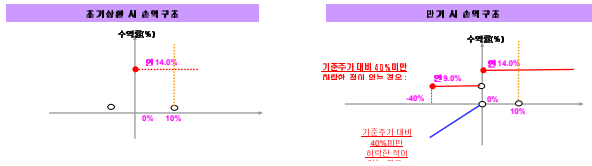
3) 펀드청산 결정 주기: 매3개월

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
-----	------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생13

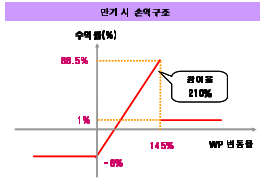
1. 계약금액

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 당일 1회
- 4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가일 수가 최초 기준가격 이상이고 최초 기준가격의 145% 미만일 경우
 - : 원금 * (94% + 210% * (만기 기준지수 / 최초 기준지수 - 1))
 - 만기 평가일 수가 최초 기준가격 미만일 경우
 - : 원금 * 94%
- 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우
 - : 원금 * 101%
- 6) 권드의 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

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

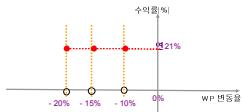
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

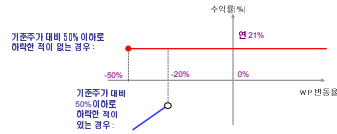
2. 연기사점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
가	8%	-0.16	-0.63	-1.09	-1.55	-2.01	-2.47	-2.93
초	5.33%	0.73	0.27	-0.19	-0.65	-1.11	-1.57	-2.04
자	2.67%	1.25	0.79	0.32	-0.14	-0.60	-1.06	-1.52
산	0%	1.38	0.92	0.46	0.00	-0.46	-0.92	-1.38
시	-2.67%	1.14	0.68	0.22	-0.24	-0.70	-1.16	-1.63
나	-5.33%	0.52	0.06	-0.40	-0.66	-1.32	-1.79	-2.25
리	-8%	-0.45	-0.94	-1.40	-1.86	-2.33	-2.79	-3.25

최대 손실 시나리오

위험액	-3.25
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.28
-----	------

[62] 데리츠2Star사모증권투자STWF-1

1. 계약금액

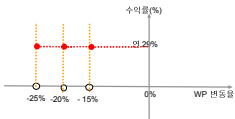
구분		거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS		1771.1	0	1,771	차입

단위(백만원)

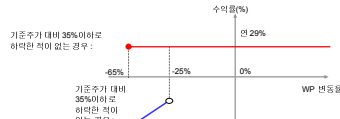
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조인용(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622313W42 코브증권(ELS)325

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	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
-----	------

[67] 데리츠2Star사로증권POKB-1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

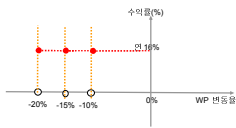
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

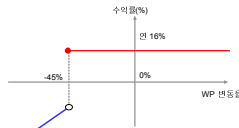
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KB금융, POSCO 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 효력을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일일때 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일일때 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%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
산	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
시나리오	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
-----	------

[65] 데리츠2Star사로 증권POKB-2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KB금융, POSCO

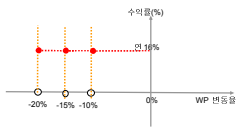
2) 만기: 2012년 4월 16일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

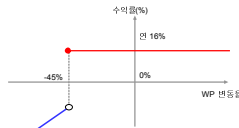
4) 기준지수: 2009년 4월 16일 KB금융, POSCO의 증가

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초지	8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
산	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
시나리오	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] 데리츠2Star사로 증권SEST-

1. 계약금액

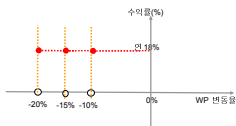
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

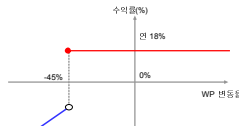
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이 상인 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%	5.29	3.47	1.64	-0.18	-2.00	-3.82	-5.65
산	5.33%	6.47	4.64	2.82	1.00	-0.82	-2.65	-4.47
시나리오	2.67%	6.53	4.70	2.88	1.06	-0.76	-2.59	-4.41
0%	5.47	3.64	1.82	0.00	-1.82	-3.64	-5.47	
-2.67%	3.29	1.47	-0.35	-2.18	-4.00	-5.82	-7.64	
-5.33%	-0.00	-1.83	-3.65	-5.47	-7.29	-9.12	-10.94	
-8%	-4.42	-6.24	-8.06	-9.89	-11.71	-13.53	-15.35	

최대 손실 시나리오

위험액	-15.35
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	19.39
-----	-------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

1. 계약금액

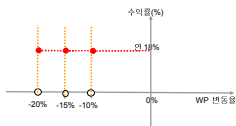
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	차입

단위(백만원)

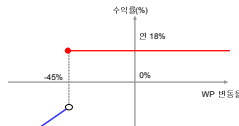
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	2.91	1.91	0.90	-0.10	-1.10	-2.10	-3.11
손익	5.33%	3.56	2.55	1.55	0.55	-0.45	-1.46	-2.46
시나리오	2.67%	3.59	2.59	1.58	0.58	-0.42	-1.42	-2.43
	0%	3.01	2.01	1.00	0.00	-1.00	-2.01	-3.01
	-2.67%	1.81	0.81	-0.19	-1.20	-2.20	-3.20	-4.21
	-5.33%	-0.00	-1.01	-2.01	-3.01	-4.01	-5.02	-6.02
	-8%	-2.43	-3.43	-4.44	-5.44	-6.44	-7.44	-8.45

최대 손실 시나리오

위험액	-8.45
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	10.67
-----	-------

[77] 데리츠2SIa사모SEST-3

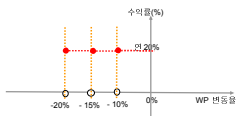
1. 계약금액

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

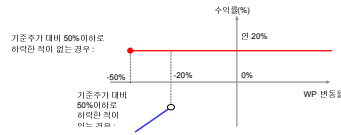
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 평가: 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 20%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 평가시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 120%
 - 두 기초자산의 가격(장종료합)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (평가기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



평가 시 손익구조



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))

KR6562345W35 유인투기증권(ELS)2382

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.37	0.94	0.52	0.09	-0.33	-0.76	-1.18
	5.33%	1.63	1.21	0.79	0.36	-0.06	-0.49	-0.91
시나리오	2.67%	1.60	1.18	0.76	0.33	-0.09	-0.52	-0.94
	0%	1.27	0.85	0.42	0.00	-0.42	-0.85	-1.27
	-2.67%	0.64	0.22	-0.21	-0.63	-1.05	-1.46	-1.90
	-5.33%	-0.29	-0.71	-1.14	-1.56	-1.99	-2.41	-2.83
	-8%	-1.52	-1.94	-2.37	-2.79	-3.22	-3.64	-4.06

최대 손실 시나리오

위험액	-4.06
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	2.84
-----	------

[78] 데리츠2SIa사모STWF-2

1. 계약금액

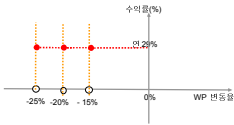
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1541.9	0	1,542	잔위

단위: (백만원)

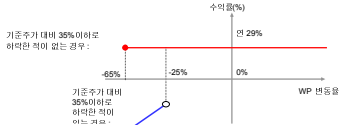
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 우리금융지주, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 4월 20일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 21일 우리금융지주, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(우리금융지주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 만을 29%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환펀드 기준가액의 50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 129%
 - 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

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
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

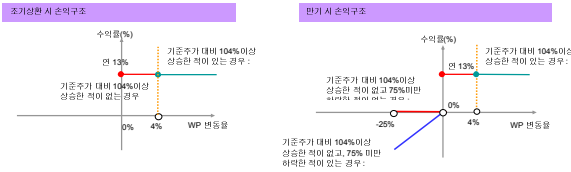
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 평가대상상품의 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 한번도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.3%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

손익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9,869.16	9,439.69	9,010.20	8,580.70	8,151.21	7,721.71	7,292.22
	5.33%	6,996.53	6,567.03	6,137.54	5,708.04	5,278.55	4,849.06	4,419.56
	2.67%	4,136.29	3,706.80	3,277.30	2,847.81	2,418.32	1,988.82	1,559.33
	0%	1,286.48	856.99	429.49	0.00	-403.00	-832.50	-1,268.00
	-2.67%	-1,346.90	-1,916.40	-2,495.90	-2,835.39	-3,264.88	-3,694.38	-4,123.87
	-5.33%	-4,369.87	-4,799.38	-5,228.88	-5,658.38	-6,087.88	-6,517.38	-6,946.88
	-8%	-7,180.41	-7,609.90	-8,039.40	-8,468.89	-8,898.38	-9,327.88	-9,757.37

최대손실 시나리오

위험액	-9,757.37
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,788.06
-----	----------

[79-2] **메리츠투자지수연계사모8호**

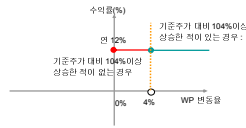
1. 계약금액

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

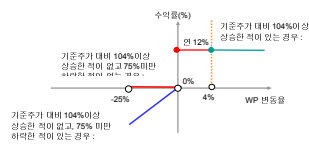
2. 만기시점의 수익구조

- 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 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환일 정일에 최초 기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초 기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
 - 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자기수연계사모8호**

1. 계약금액

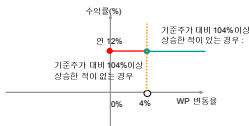
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔액

단위: 백만원

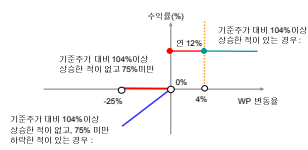
2. 평가시점의 손익구조

- 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 최초 기준가격 이상이거나 또는 평가기간 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 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장중 포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

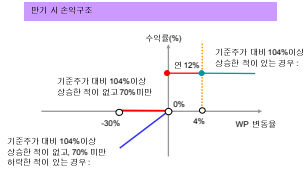
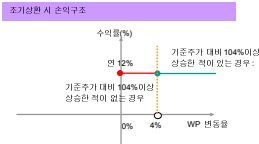
[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

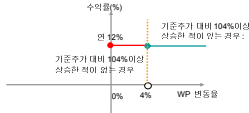
2. 만기시점의 손익구조

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

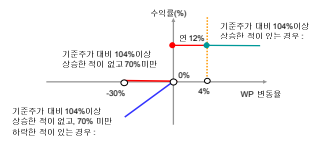
- 단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008676TB7 코트님 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

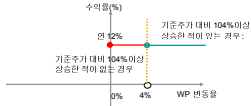
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

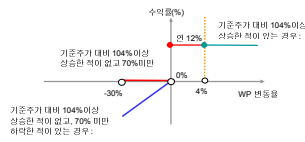
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[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

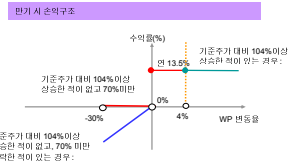
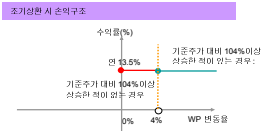
단위(백만원)

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 일반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우
 : 원금 * 113.5%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기 준지수/최 초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6008675TC7 코트나눔 신원증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

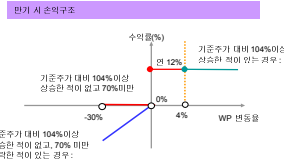
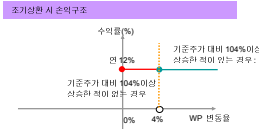
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 메리츠투자지수형계사모8호

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

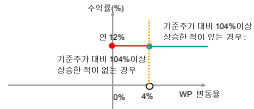
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

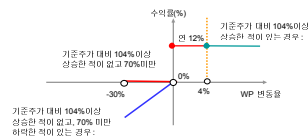
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

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

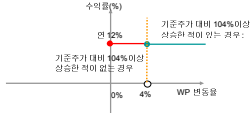
- 1) 참여대상종목의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지수 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 12%의 수익률로 중도상환

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

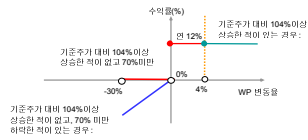
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수업계약서표8호

1. 계약금액

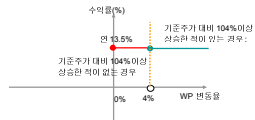
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5000.0	0	5,000	장외

단위(백만원)

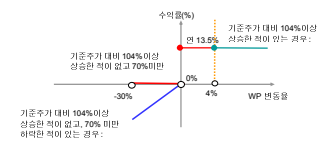
2. 만기시점의 손익구조

- 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%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 113.5%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠투자지수형계사모8호

1. 계약금액

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

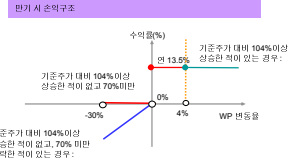
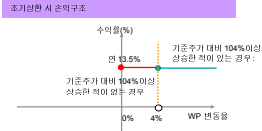
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 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



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

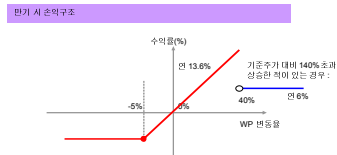
1. 계약금액

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 평가지 수가 최초기 존가격 이상이고 최초기 존가격의 140% 미만일 경우
: 원금 * (95% + 100% * (만기 기 존지 수 / 최초 기 존지 수 - 1))
 - 만기 평가지 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%	
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)

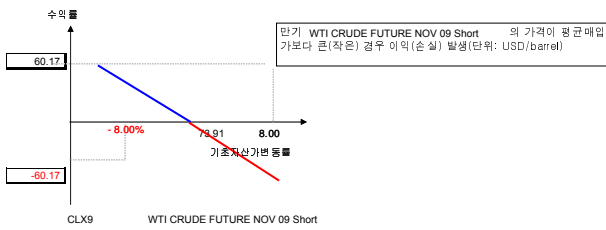
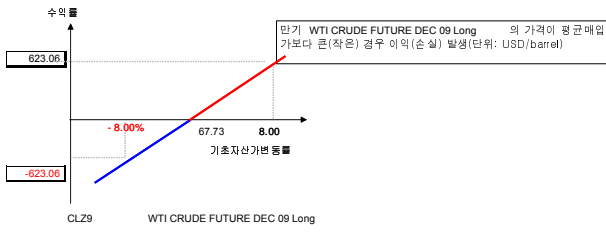
위험액	0.00
-----	------

[80-1] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	단위(계약)	비고
누계	유가증권	선물	113	0	113	장내	

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위: 1,000 USD)

CLZ9 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long
CLX9 WTI CRUDE FUTURE NOV 09 Short

구분	시나리오	
기초자산	8%	683.24
	5.33%	455.21
	2.67%	228.03
	0%	0.00
	-2.67%	-228.03
시나리오	-5.33%	-455.21
	-8%	-683.24

최대손실 시나리오	
위험액	-683.24

4. 매월상환의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	2,768
-----	-------

[80] 대리주가지수연계사모증권10호

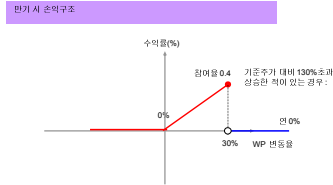
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6673105W54 동부증권-엘스플러스(ELS)B1

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-16.60	-19.68	-22.76	-25.84	-28.91	-31.99	-35.07
산	5.33%	-6.99	-10.07	-13.14	-16.22	-19.30	-22.38	-25.45
시나리오	2.67%	1.62	-1.45	-4.53	-7.61	-10.69	-13.77	-16.84
오	0%	9.23	6.16	3.08	0.00	-3.08	-6.16	-9.23
	-2.67%	15.84	12.76	9.68	6.61	3.53	0.45	-2.63
	-5.33%	21.45	16.37	15.29	12.21	9.13	6.06	2.98
	-8%	26.05	22.97	19.89	16.81	13.74	10.66	7.58

최대 손실 시나리오

위험액	7.58
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.52
-----	-------

[82] 데리츠2Star사로 증권SE ST-8호

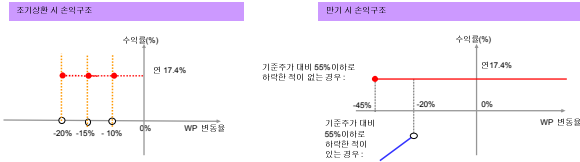
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(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 기초자산(기준으로 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/최초 기준지수)
- 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%	-0.52	-0.53	-0.55	-0.57	-0.59	-0.61	-0.62
손익	5.33%	-0.19	-0.21	-0.23	-0.24	-0.26	-0.28	-0.30
시나리오	2.67%	-0.00	-0.02	-0.04	-0.05	-0.07	-0.09	-0.11
	0%	0.05	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.05
	-2.67%	-0.03	-0.05	-0.07	-0.08	-0.10	-0.12	-0.14
	-5.33%	-0.25	-0.27	-0.29	-0.30	-0.32	-0.34	-0.36
	-8%	-0.61	-0.62	-0.64	-0.66	-0.68	-0.70	-0.71

최대 손실 시나리오

위험액	-0.71
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.32
-----	------

[83] 데리츠2Star사모증권SET-5호

1. 계약금액

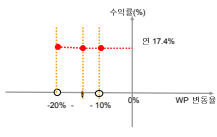
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

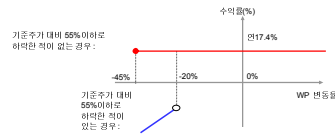
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률을 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117.4%
→ 두 기초자산의 가액 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액) (단위:백만원)

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-3.32	-3.44	-3.55	-3.66	-3.78	-3.89	-4.01
손실	5.33%	-1.22	-1.34	-1.45	-1.56	-1.68	-1.79	-1.91
시나리오	2.67%	-0.00	-0.12	-0.23	-0.34	-0.46	-0.57	-0.68
	0%	0.34	0.23	0.11	0.00	-0.11	-0.23	-0.34
	-2.67%	-0.19	-0.31	-0.42	-0.54	-0.65	-0.76	-0.88
	-5.33%	-1.61	-1.72	-1.84	-1.95	-2.06	-2.18	-2.29
	-8%	-3.90	-4.01	-4.13	-4.24	-4.35	-4.47	-4.58

최대 손실 시나리오

위험액	-4.58
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.04
-----	------

[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

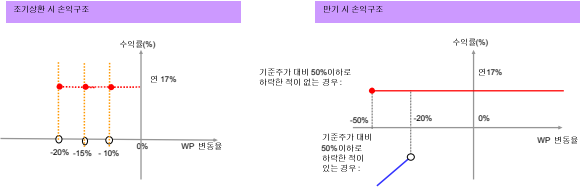
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

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 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 평균 * 117%

- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6562319W52 유가증권 (ELS)2415

손익 구조표본 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	8%	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07	-0.07
손익	5.33%	-0.03	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
시나리오	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%	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
	-5.33%	-0.07	-0.07	-0.07	-0.06	-0.06	-0.06
	-8%	-0.13	-0.13	-0.13	-0.13	-0.13	-0.13

최대 손실 시나리오

위험액	-0.13
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.46
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

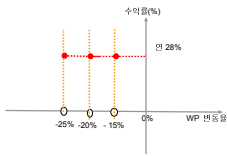
1. 계약금액

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

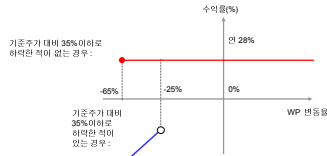
2. 만기시점의 손익구조

- 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% 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(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 35% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



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%	59.07	47.02	34.97	22.93	10.88	-1.16	-13.21
손실	5.33%	51.89	39.85	27.80	15.76	3.71	-8.33	-20.38
시나리오	2.67%	44.25	32.20	20.16	8.11	-3.93	-15.98	-28.02
	0%	36.14	24.09	12.05	0.00	-12.05	-24.09	-36.14
	-2.67%	27.55	15.51	3.46	-8.65	-20.63	-32.67	-44.72
	-5.33%	18.50	6.45	-5.59	-17.64	-29.68	-41.73	-53.77
	-8%	8.97	-3.07	-15.12	-27.16	-39.21	-51.25	-63.30

최대 손실 시나리오

위험액	-63.30
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	60.00
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

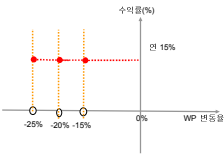
1. 계약금액

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

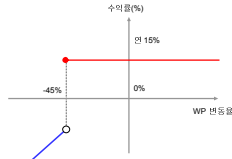
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 평균 * 115%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 평균 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(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%	-0.02	-0.03	-0.03	-0.04	-0.04	-0.05	-0.05
손익	5.33%	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.02	-0.02	-0.03
시나리오	2.67%	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01
	0%	0.01	0.01	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01
	-2.67%	0.00	-0.00	-0.01	-0.01	-0.02	-0.02	-0.02
	-5.33%	-0.02	-0.03	-0.03	-0.03	-0.04	-0.04	-0.05
	-8%	-0.06	-0.06	-0.06	-0.07	-0.07	-0.08	-0.08

최대 손실 시나리오

위험액	-0.08
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.04
-----	------

[90] 데리츠2Star사로증권POLE-이 호

1. 계약금액

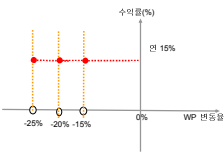
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2280.8	0	2,280.8	잔위

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 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/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-1.64	-2.16	-2.46	-2.79	-3.11	-3.43	-3.75
	5.33%	-0.01	-0.33	-0.65	-0.97	-1.29	-1.61	-1.92
시나리오	2.67%	0.92	0.60	0.28	-0.04	-0.36	-0.67	-0.99
	0%	0.96	0.64	0.32	0.00	-0.32	-0.64	-0.96
	-2.67%	0.10	-0.22	-0.54	-0.86	-1.18	-1.49	-1.81
	-5.33%	-1.65	-1.97	-2.29	-2.61	-2.93	-3.25	-3.57
	-8%	-4.30	-4.62	-4.94	-5.26	-5.57	-5.89	-6.21

최대 손실 시나리오

위험액	-6.21
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	3.38
-----	------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

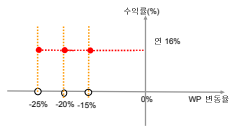
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	잔위

단위:백만원

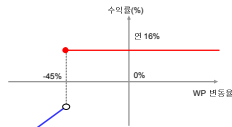
2. 만기시점의 손익구조

- 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, 두번째 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%	0.97	0.79	0.60	0.42	0.24	0.06	-0.12
	5.33%	0.92	0.74	0.56	0.37	0.19	0.01	-0.17
	2.67%	0.78	0.60	0.42	0.23	0.05	-0.13	-0.31
시나리오	0%	0.54	0.36	0.18	0.00	-0.18	-0.36	-0.54
	-2.67%	0.22	0.04	-0.15	-0.33	-0.51	-0.69	-0.87
	-5.33%	-0.25	-0.38	-0.56	-0.75	-0.93	-1.11	-1.29
	-8%	-0.71	-0.90	-1.08	-1.26	-1.44	-1.62	-1.80

최대 손실 시나리오

위험액	-1.80
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.93
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

1. 계약금액

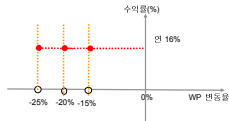
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

단위: (백만원)

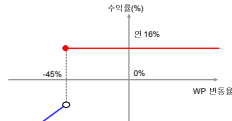
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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 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



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%	
기초지	8%	17.30	14.05	10.80	7.56	4.31	1.06	-2.19
	5.33%	16.45	13.20	9.95	6.70	3.45	0.20	-3.04
산	2.67%	13.93	10.68	7.43	4.18	0.93	-2.31	-5.56
	0%	9.75	6.50	3.25	0.00	-3.25	-6.50	-9.75
시나리오	-2.67%	3.90	0.65	-2.60	-5.64	-9.09	-12.54	-15.99
	-5.33%	-3.61	-6.86	-10.10	-13.35	-16.60	-19.85	-23.10
	-8%	-12.78	-16.03	-19.28	-22.52	-25.77	-29.02	-32.27

최대 손실 시나리오

위험액	-32.27
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	35.61
-----	-------

[93] 데리츠2Star사로증권LEHC-3

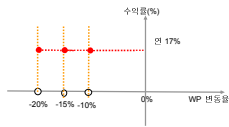
1. 계약금액

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

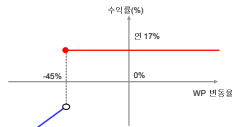
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 현대차 보통주
- 2) 만기: 2012년 4월 27일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 4월 30일 LG전자 보통주, 현대차 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 현대차 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 17%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 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. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)
KR6562310W51 유린투기증권(ELS)2414

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-4.24	-4.44	-4.64	-4.84	-5.04	-5.25	-5.45
	5.33%	-1.37	-1.57	-1.77	-1.98	-2.18	-2.38	-2.58
시나리오	2.67%	0.24	0.04	-0.16	-0.36	-0.56	-0.77	-0.97
	0%	0.61	0.40	0.20	0.00	-0.20	-0.40	-0.61
	-2.67%	-0.29	-0.49	-0.69	-0.89	-1.09	-1.29	-1.50
	-5.33%	-2.43	-2.63	-2.83	-3.03	-3.24	-3.44	-3.64
	-8%	-5.82	-6.03	-6.23	-6.43	-6.63	-6.83	-7.03

최대 손실 시나리오

위험액	-7.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.14
-----	------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

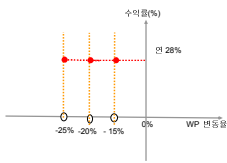
1. 계약금액

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

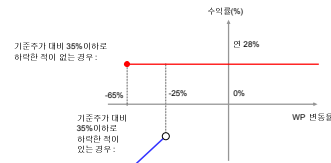
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주
- 만기: 2012년 4월 27일
- 런드정산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2009년 4월 30일 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(현대차 보통주, 삼성증권업 보통주 주가의 중도상환가액이 낮은 기초자산) 기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상한 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 런드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반드 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 128%
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 런드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	71.02	55.80	40.56	25.37	10.15	-5.06	-20.28
손익	5.33%	63.72	48.51	33.29	18.08	2.86	-12.36	-27.57
시나리오	2.67%	55.27	40.05	24.84	9.62	-5.60	-20.81	-36.03
	0%	46.85	30.43	15.22	0.00	-13.22	-30.83	-45.85
	-2.67%	34.87	19.65	4.43	-10.78	-23.00	-41.21	-56.43
	-5.33%	22.92	7.70	-7.51	-22.73	-37.94	-53.16	-68.38
	-8%	9.81	-5.40	-20.62	-35.84	-51.05	-66.27	-81.48

최대 손실 시나리오

위험액	-81.48
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	83.10
-----	-------

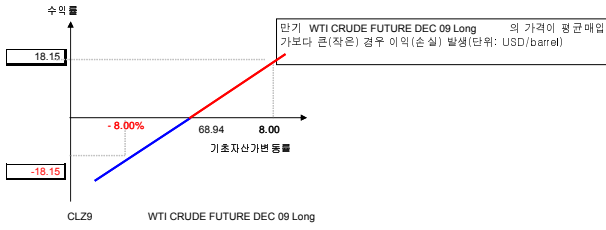
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CL29 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	18.15
	5.33%	12.09
	2.67%	6.06
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-6.06
	-5.33%	-12.09
	-8%	-18.15

최대손실 시나리오

위험액	-18.15
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	72
-----	----

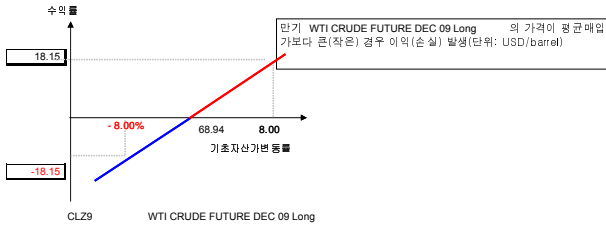
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



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

CLZ9 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long

구분	시나리오	
기초자산	8%	45.22
	5.33%	30.13
	2.67%	15.09
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-15.09
	-5.33%	-30.13
	-8%	-45.22

최대 손실 시나리오	
위험액	-45.22

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

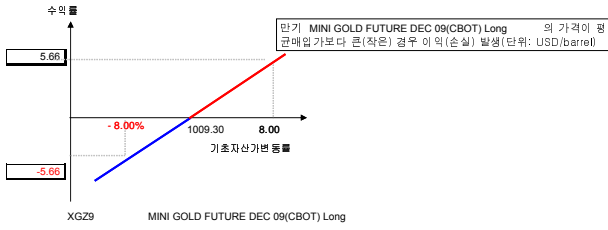
위험액	183
-----	-----

[96-2] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



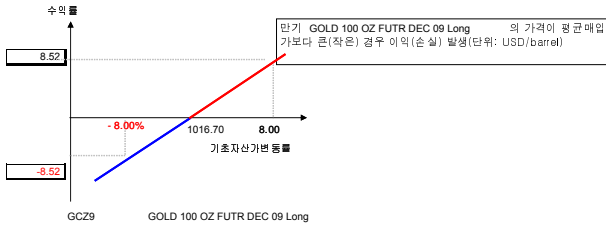
[96-3] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

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



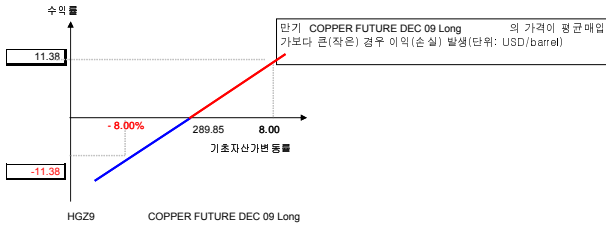
[96-4] 헤지 초Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 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. 연가시점의 손익 구조

