

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

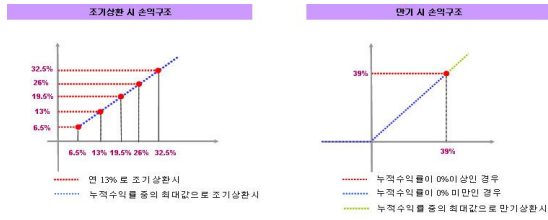
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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] 테리츠 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 구조표본 및(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6006903TR1 내부증권(ELS)1533

손익 구조표본 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) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

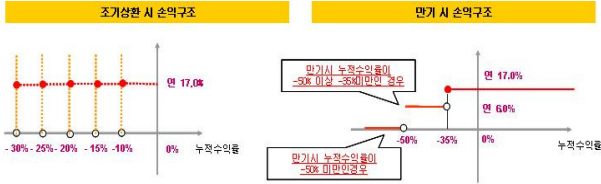
3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상금원(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

[6]메리츠 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. 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) 만을 15.8%의 수익률로 중도상환이 됨.

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

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

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

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600345TTB8 최대 손실(ELS)2007-609

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	9.93	9.91	9.89	9.87	9.85	9.83	9.81
	5.33%	6.64	6.62	6.60	6.58	6.56	6.54	6.52
시나리오	2.67%	3.35	3.33	3.31	3.29	3.27	3.25	3.23
	0%	0.06	0.04	0.02	0.00	-0.02	-0.04	-0.06
손익	-2.67%	-3.23	-3.25	-3.27	-3.29	-3.31	-3.33	-3.35
	-5.33%	-6.52	-6.54	-6.56	-6.58	-6.60	-6.62	-6.64
손익	-8%	-9.81	-9.83	-9.85	-9.87	-9.89	-9.91	-9.93

최대 손실 시나리오

위험액	-9.93
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.93
-----	------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

구분	기대자산	가액유형	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) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600348RT28 비파생상품(ELS) 2007-397세

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	343.17	335.66	328.14	320.62	313.11	305.59	298.07
	5.33%	236.31	228.79	221.27	213.76	206.24	198.72	191.21
	2.67%	129.43	121.92	114.40	106.88	99.37	91.85	84.33
	0%	22.56	15.03	7.52	0.00	-7.52	-15.03	-22.56
	-2.67%	-84.34	-91.88	-99.37	-106.89	-114.41	-121.92	-129.44
-5.33%	-191.24	-198.76	-206.27	-213.79	-221.31	-228.82	-236.34	
-8%	-298.15	-305.66	-313.18	-320.70	-328.21	-335.73	-343.25	

최대 손실 시나리오

위험액	-343.25
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	341.13
-----	--------

[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 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 중도 상환이 됨.

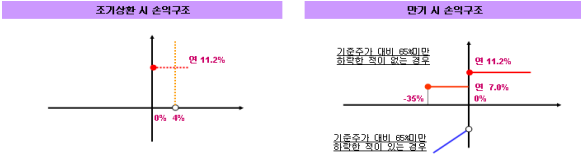
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 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. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345ST27 (비대응액(ELS): 2017-3984)

수익 구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	32.85	32.13	31.41	30.69	29.97	29.25	28.53
	5.33%	22.62	21.90	21.18	20.46	19.74	19.02	18.30
	2.67%	12.39	11.67	10.95	10.23	9.51	8.79	8.07
	0%	2.16	1.44	0.72	0.00	-0.72	-1.44	-2.16
	-2.67%	-8.07	-8.79	-9.51	-10.23	-10.95	-11.67	-12.39
	-8.33%	-18.31	-19.02	-19.74	-20.46	-21.18	-21.90	-22.62
	-8%	-28.54	-29.26	-29.98	-30.70	-31.42	-32.14	-32.86

최대 손실 시나리오

위험액	-32.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	32.86
-----	-------

[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

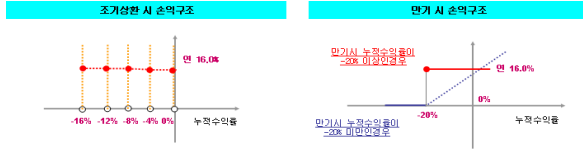
3) 만드정산 결정주기: 매 6개월

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 만드 후 펀드 해지 액면금액 X (100% + MAX [0%, 36개월간 최고 누적 수익률])

6) 만드의 수익구조



3. 수익구조의 손(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007-504

손익구조변동 시나리오

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

[11] 메리츠 글러벳 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 8월 13일

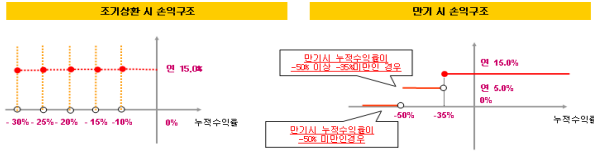
3) 만기점산 결정주기: 매 6개월

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

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

단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 조건에 따라 수익 확정 후 만드 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) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상금리(ELS)1191

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	0.88	0.75	0.61	0.48	0.34	0.21	0.07
	5.33%	0.78	0.64	0.51	0.38	0.24	0.11	-0.03
	2.67%	0.62	0.49	0.35	0.22	0.08	-0.05	-0.19
	0%	0.40	0.27	0.13	0.00	-0.13	-0.27	-0.41
손익 구조변동 시나리오	-2.67%	0.13	-0.00	-0.14	-0.27	-0.41	-0.54	-0.68
	-5.33%	-0.20	-0.34	-0.47	-0.60	-0.74	-0.87	-1.01
	-8%	-0.59	-0.72	-0.86	-0.99	-1.13	-1.26	-1.40

최대 손실 시나리오

위험액	-1.40
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.09
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 피생상품투자신탁 15호

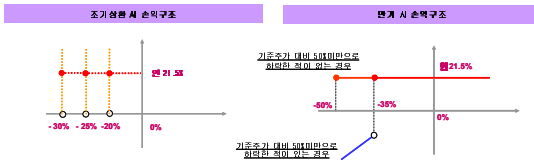
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010년 01월 07일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기일을 설정하고, 기초자산(LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이 상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이 상인 경우(두번째 중도상환일), 70%이 상인 경우(세번째 중도상환일), 65%이 상인 경우(만기 상환일) 연월 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(중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600345EV11 비파생상품(ELS)2008-647

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	189.23	181.62	174.41	167.01	159.60	152.19	144.78
	5.33%	135.29	127.68	120.48	113.07	105.66	98.25	90.84
	2.67%	79.62	72.22	64.81	57.40	49.99	42.58	35.17
	0%	22.23	14.82	7.41	0.00	-7.41	-14.82	-22.23
	-2.67%	-36.90	-44.31	-51.72	-59.13	-66.54	-73.95	-81.35
-5.33%	-97.76	-105.17	-112.58	-119.98	-127.39	-134.80	-142.21	
-8%	-160.34	-167.75	-175.16	-182.57	-189.98	-197.39	-204.80	

최대 손실 시나리오

위험액	-204.80
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	202.94
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위특성26호

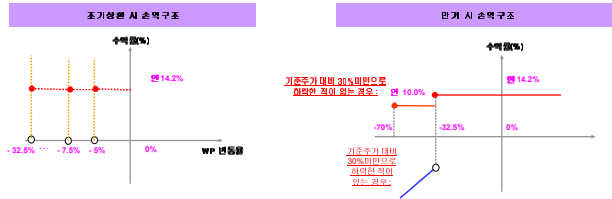
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

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



3. 손익구조인 톱(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600867B1B0 쿠로남산한동증권(ELS)803

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	206.50	183.07	159.64	136.21	112.79	89.36	65.93
	5.33%	161.00	137.58	114.15	90.72	67.29	43.87	20.44
	2.67%	115.60	92.17	68.74	45.32	21.89	-1.54	-24.97
	0%	70.20	46.86	23.43	0.00	-23.43	-46.86	-70.20
	-2.67%	25.06	1.63	-21.80	-45.23	-68.65	-92.08	-115.51
-5.33%	-20.08	-43.51	-66.94	-90.36	-113.79	-137.22	-160.65	
-8%	-65.13	-86.56	-111.96	-135.41	-158.84	-182.27	-205.69	

최대손실 시나리오

위험액	-205.69
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	192.90
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

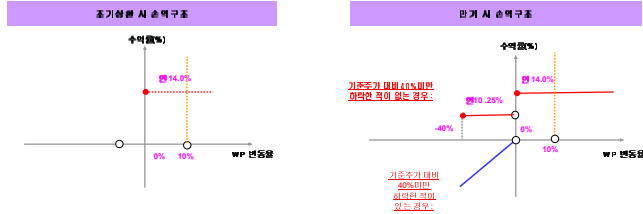
1. 계약금액

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 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 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환번도 기준가격의 60%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 120.5%
 - 두 기초자산의 가격(상종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (만기기준지수/초기기준지수)
 6) 펀드의 수익구조



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	65.31	63.90	62.50	61.09	59.68	58.28	56.87	
시나리오	4.22	2.81	1.41	0.00	-1.41	-2.81	-4.22	
	-16.14	-17.55	-18.95	-20.36	-21.77	-23.17	-24.58	
	-36.50	-37.91	-39.31	-40.72	-42.12	-43.53	-44.94	
	-56.86	-58.26	-59.67	-61.07	-62.48	-63.89	-65.29	

최대 손실 시나리오	위험액	56.87
------------	-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	64.88
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서5호

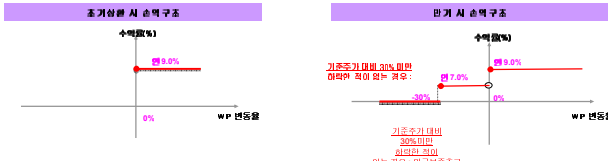
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수
 - 2) 평가: 2011년 1월 24일
 - 3) 펀드청산 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 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가액의 100% 이상인 경우 연이율 9%로 중도상환함.
- 단, 평가시점에 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가액의 70%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우: 원금 * 121%
 - 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 70%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금*100%
- 6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	60.18	57.73	55.28	52.83	50.38	47.93	45.48
시나리오	5.33%	4.354	41.09	38.64	36.19	33.74	31.29
	2.67%	25.93	23.48	21.03	18.58	16.13	13.68
	0%	7.35	4.90	2.45	0.00	-2.45	-4.90
	-2.67%	-12.20	-14.65	-17.10	-19.55	-22.00	-24.45
	-5.33%	-32.71	-35.16	-37.61	-40.06	-42.51	-44.96
	-8%	-64.20	-66.65	-69.10	-71.55	-74.00	-76.45

최대 손실 시나리오

위험액	45.48
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	73.00
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

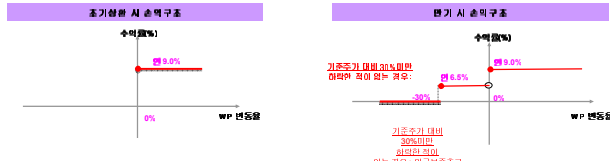
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762OV23 비례예정증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	40.46	38.56	36.66	34.75	32.85	30.95	29.05
손익	5.33%	29.72	27.81	25.91	24.01	22.11	20.20	18.30
손익	2.67%	18.13	16.23	14.33	12.42	10.52	8.62	6.72
손익	0%	5.71	3.80	1.90	0.00	-1.90	-3.80	-5.71
손익	-2.67%	-7.56	-9.46	-11.36	-13.26	-15.17	-17.07	-18.97
손익	-5.33%	-21.66	-23.56	-25.46	-27.37	-29.27	-31.17	-33.07
손익	-8%	-36.60	-38.51	-40.41	-42.31	-44.21	-46.11	-48.02

최대 손실 시나리오

위험액	29.05
-----	-------

4. 거래상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46.97
-----	-------

[2] 메리츠주 수연계 사모단위 파생 7호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2011년 2월 21일

3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 종가

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.

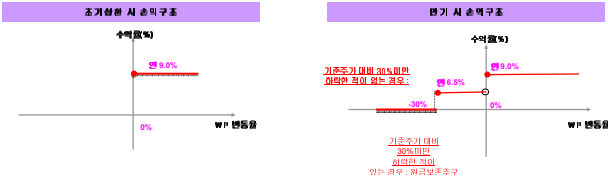
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만도 해지

- 두 기초자산의 가격이 만도 기 준가격 의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기 준가격 보다 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. 수익구조변동(최대손실가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

수익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	31.47	29.99	28.51	27.03	25.55	24.07	22.59
	5.33%	23.11	21.63	20.15	18.67	17.19	15.71	14.24
	2.67%	14.10	12.62	11.14	9.66	8.18	6.70	5.22
시나리오	0%	4.44	2.96	1.48	0.00	-1.48	-2.96	-4.44
	-2.67%	-5.88	-7.36	-8.84	-10.32	-11.80	-13.28	-14.76
	-5.33%	-16.85	-18.33	-19.81	-21.29	-22.77	-24.24	-25.72
	-8%	-26.47	-27.95	-29.43	-30.91	-32.39	-33.87	-35.35

최대손실 시나리오

위험액	22.59
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	36.53
-----	-------

[23] 매리츠월중지수연계사모파생1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 만기: 2010년 08월 04일

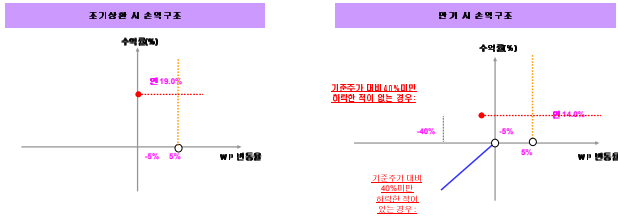
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(NIKKEI225, HSCEI지수)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평균기간 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 수익률 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%	156.58	149.74	142.89	136.05	129.21	122.36	115.52
	5.33%	109.87	103.03	96.18	89.34	82.50	75.65	68.81
	2.67%	64.52	57.68	50.83	43.99	37.15	30.30	23.46
	0%	20.53	13.69	6.84	0.00	-6.84	-13.69	-20.53
	-2.67%	-22.10	-28.94	-35.79	-42.63	-49.47	-56.32	-63.16
-5.33%	-63.37	-70.21	-77.06	-83.90	-90.74	-97.59	-104.43	
-8%	-103.28	-110.12	-116.97	-123.81	-130.66	-137.50	-144.34	

최대 손실 시나리오

위험액	-144.34
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	147.04
-----	--------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생13

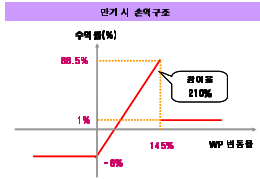
1. 계약금액

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(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초 기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가일 수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우
: 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수 / 최초기준지수 - 1))
 - 만기 평가일 수가 최초기준가격 미만일 경우
: 원금 * 94%
- 6) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 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 등(최대 손실 가능 금액 (단위: 백만원))
KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

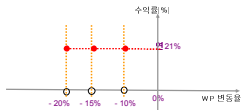
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위(백만원)

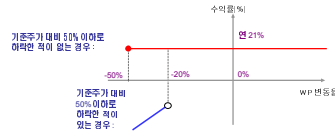
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 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%	-0.71	-1.38	-2.05	-2.71	-3.38	-4.05	-4.72
초	5.33%	0.78	0.12	-0.55	-1.22	-1.89	-2.56	-3.23
자	2.67%	1.69	1.02	0.35	-0.32	-0.99	-1.66	-2.33
산	0%	2.01	1.34	0.67	0.00	-0.67	-1.34	-2.01
시	-2.67%	1.74	1.07	0.40	-0.27	-0.94	-1.61	-2.28
나	-5.33%	0.88	0.21	-0.45	-1.12	-1.79	-2.46	-3.13
리	-8%	-0.56	-1.23	-1.90	-2.57	-3.24	-3.90	-4.57

최대 손실 시나리오

위험액	-4.57
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.07
-----	------

[67] 데리츠2Star사로증권SEST-1

1. 계약금액

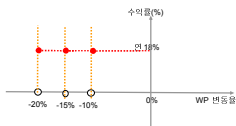
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

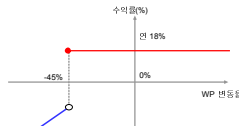
2. 만기시점의 손익구조

- 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%	6.50	6.03	3.56	1.09	-1.38	-3.85	-6.32
산	5.33%	9.50	7.03	4.56	2.09	-0.38	-2.85	-5.32
시나리오	2.67%	9.14	6.67	4.20	1.73	-0.74	-3.21	-5.68
	0%	7.41	4.94	2.47	0.00	-2.87	-4.94	-7.41
	-2.67%	4.32	1.85	-0.62	-3.09	-5.56	-8.03	-10.50
	-5.33%	-0.14	-2.61	-5.08	-7.55	-10.02	-12.49	-14.96
	-8%	-5.96	-8.43	-10.90	-13.37	-15.84	-18.31	-20.78

최대 손실 시나리오

위험액	-20.78
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	15.99
-----	-------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

1. 계약금액

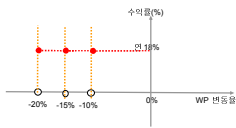
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	잔위

단위(백만원)

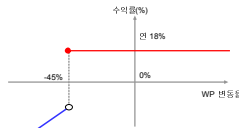
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 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%	4.67	3.31	1.96	0.60	-0.76	-2.12	-3.48
산	5.33%	5.22	3.87	2.51	1.15	-0.21	-1.57	-2.93
시나리오	2.67%	5.03	3.67	2.31	0.95	-0.41	-1.77	-3.13
오	0%	4.08	2.72	1.36	0.00	-1.08	-2.72	-4.08
	-2.67%	2.38	1.02	-0.34	-1.70	-3.08	-4.42	-5.78
	-5.33%	-0.08	-1.43	-2.79	-4.15	-5.51	-6.87	-8.23
	-8%	-3.28	-4.64	-6.00	-7.35	-8.71	-10.07	-11.43

최대 손실 시나리오

위험액	-11.43
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	8.80
-----	------

[77] 데리츠281a사모SEST-3

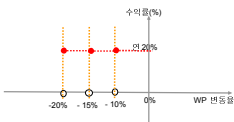
1. 계약금액

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

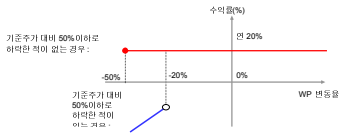
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



평가 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%	2.52	1.91	1.29	0.68	0.06	-0.56	-1.17
산	5.33%	2.63	2.02	1.40	0.79	0.17	-0.44	-1.06
시나리오	2.67%	2.41	1.79	1.18	0.56	-0.05	-0.67	-1.28
	0%	1.85	1.23	0.62	0.00	-0.62	-1.23	-1.85
	-2.67%	0.95	0.33	-0.26	-0.90	-1.51	-2.13	-2.74
	-5.33%	-0.29	-0.90	-1.52	-2.13	-2.75	-3.36	-3.98
	-8%	-1.86	-2.47	-3.09	-3.70	-4.32	-4.94	-5.55

최대 손실 시나리오

위험액	-6.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	5.91
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

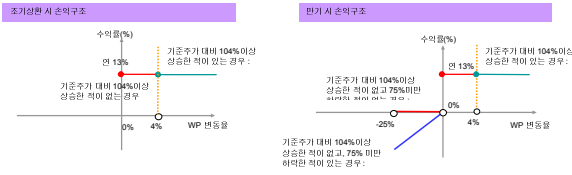
1. 계약금액

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) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 12월 13일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
 - 4) 기준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지수 수익 증가
 - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 113%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 수익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

수익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	9,928.86	9,530.92	9,132.96	8,735.03	8,337.09	7,939.15	7,541.21
	5.33%	6,954.05	6,556.11	6,158.16	5,760.22	5,362.28	4,964.34	4,566.39
	2.67%	4,042.37	3,644.43	3,246.49	2,848.54	2,450.60	2,052.66	1,654.72
	0%	1,193.83	795.88	397.94	0.00	-397.94	-795.88	-1,193.83
	-2.67%	-1,391.58	-1,989.52	-2,587.46	-2,785.41	-3,183.35	-3,581.29	-3,979.23
	-5.33%	-4,313.85	-4,711.79	-5,109.74	-5,507.68	-5,905.62	-6,303.56	-6,701.51
	-8%	-6,972.99	-7,370.93	-7,768.87	-8,166.82	-8,564.76	-8,962.70	-9,360.64

최대 손실 시나리오

위험액	-9,360.64
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,613.80
-----	----------

[79-2] **메리츠투자지수연계사모8호**

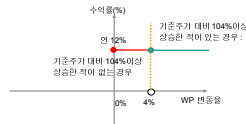
1. 계약금액

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

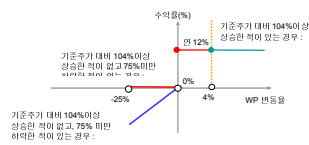
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자기수연계사모8호**

1. 계약금액

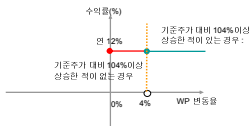
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔액

단위: 백만원

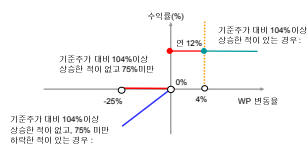
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 11월 16일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
 - 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수
 - 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%이므로 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

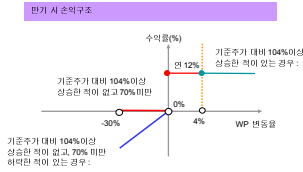
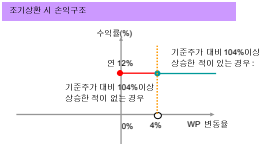
[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

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%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%이만으로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/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)

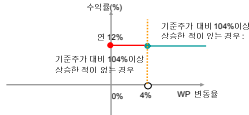
2. 만기시점의 손익구조

- 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 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

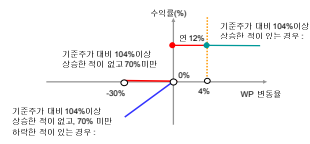
- 단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008676TB7 곳모닝 신환증권(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	장외

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

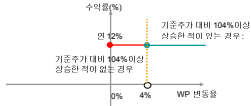
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

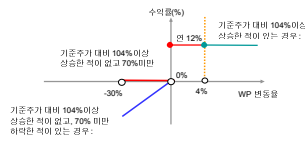
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600867CTB8 코트남 신원증권(ELS)804

[79-7] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

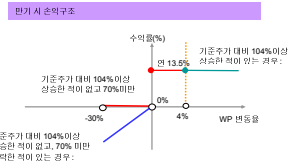
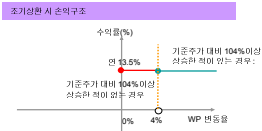
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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

단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격 이 환반도 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



KR6008675TC7 코트나눔 신환증권(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)

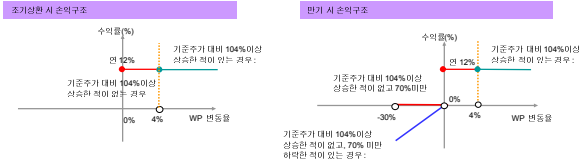
2. 만기시점의 손익구조

- 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, 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 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 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 에리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

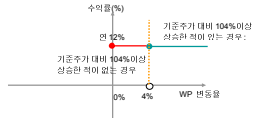
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	상위

단위(백만원)

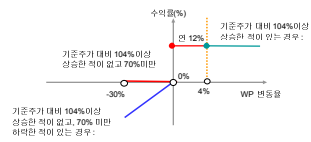
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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 (2차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종 포함) 중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기 준지수/최초기 준지수)
- 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

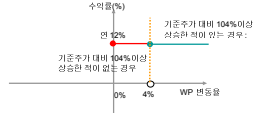
- 1) 참여대상종목의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지수 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 12%의 수익률로 중도상환

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

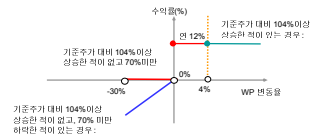
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수연계사료8호

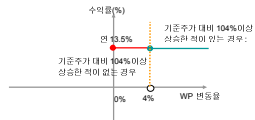
1. 계약금액

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

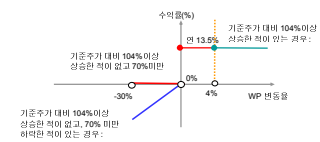
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 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] 메리츠투자지수연계사모8호

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: 매 3개월
- 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

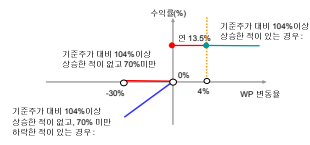
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.3.5%
- 두 기초자산의 가격 (정중포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기 준지수/최초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

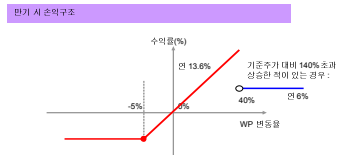
1. 계약금액

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 전 가일 1회
- 4) 기 존지 수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기 존지 수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가일 수가 최초기 존가격 이상이고 최초기 존가격의 140% 미만일 경우
: 원금 * (95% + 100% * (만기 기 존지 수 / 최초기 존지 수 - 1))
 - 만기 평가일 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) 권트의 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
	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
-----	------

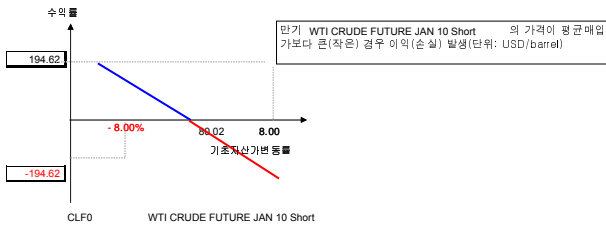
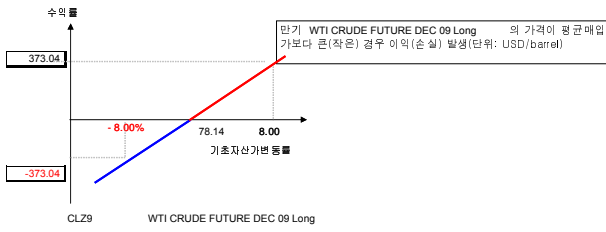
[80-1] 데리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	88	0	88	장내

단위(계약)

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위: 1,000 USD)

CLZ9 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long
CLF0 WTI CRUDE FUTURE JAN 10 Short

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	567.65
	5.33%	378.20
	2.67%	189.45
	0%	0.00
	-2.67%	-189.45
시나리오	-5.33%	-378.20
	-8%	-567.65

최대손실 시나리오	-567.65
위험액	-567.65

4. 매생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2,300
-----	-------

[80] 대리주가지지수연계사모증권10호

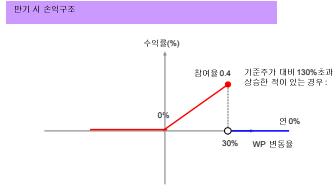
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6673105W54 동부증권-에프엘리스(ELS)B1

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지수	8%	-14.82	-19.80	-24.77	-29.75	-34.73	-39.70	-44.68
손익	5.33%	-2.91	-7.89	-12.87	-17.84	-22.82	-27.80	-32.77
시나리오	2.67%	7.00	2.03	-2.95	-7.93	-12.90	-17.88	-22.86
	0%	14.93	9.95	4.98	0.00	-4.98	-9.95	-14.93
	-2.67%	20.87	15.89	10.91	5.94	0.96	-4.02	-8.99
	-5.33%	24.82	19.84	14.86	9.89	4.91	-0.07	-5.05
	-8%	26.78	21.80	16.82	11.84	6.87	1.89	-3.09

최대 손실 시나리오

위험액	-3.09
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	33.73
-----	-------

[82] 데리츠2Star사로 증권SE ST-8호

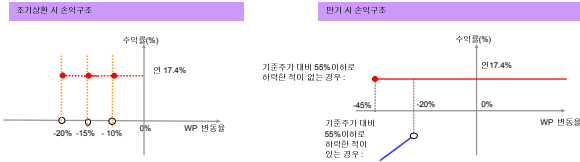
1. 계약금액

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 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%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조별 손(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR652233W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조별 손 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-0.45	-0.45	-0.45	-0.45	-0.45	-0.45	-0.44
	5.33%	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.19
	2.67%	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05	-0.05
손리	0%	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.06	-0.05
	-5.33%	-0.21	-0.21	-0.21	-0.21	-0.21	-0.21	-0.21
	-8%	-0.47	-0.47	-0.47	-0.47	-0.47	-0.47	-0.46

최대 손실 시나리오

위험액	-0.46
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.19
-----	------

[83] 데리츠2Star사모증권SET-5호

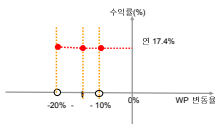
1. 계약금액

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

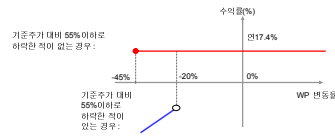
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가액의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 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 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522333W57 (대우증권(ELS)2976)

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-2.67	-2.67	-2.67	-2.67	-2.66	-2.66	-2.66
손실	5.33%	-1.27	-1.27	-1.26	-1.26	-1.26	-1.25	-1.25
시나리오	2.67%	-0.31	-0.31	-0.31	-0.30	-0.30	-0.30	-0.30
	0%	-0.01	-0.01	-0.00	0.00	0.00	0.01	0.01
	-2.67%	-0.36	-0.35	-0.35	-0.34	-0.34	-0.34	-0.34
	-5.33%	-1.35	-1.35	-1.35	-1.34	-1.34	-1.34	-1.34
	-8%	-3.00	-3.00	-3.00	-2.99	-2.99	-2.99	-2.99

최대 손실 시나리오

위험액	-2.99
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.19
-----	------

[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

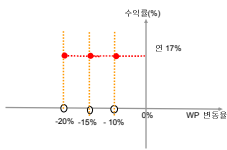
4) 기준지수: 2009년 5월 11일 삼성전자 보통주, KT 보통주의 증가

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.

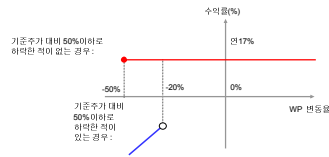
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 환반도 기준가액의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117%

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

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6562319W52 유린 투기증권 (ELS)2415

손익 구조표준 편 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
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

1. 계약금액

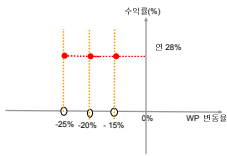
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	462.0	0	462.0	잔위

단위:백만원

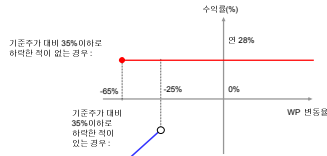
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 15일 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반드 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 128%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)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 구조표준 편(최대 손실 가능금액) (단위:백 만원)
KR6622309W55 표본증권(ELS)344

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초 자산 시나리오	8%	63.70	50.19	36.68	23.18	9.67	-3.84	-17.35
	5.33%	56.35	42.84	29.33	15.83	2.32	-11.19	-24.69
	2.67%	48.62	35.12	21.67	8.10	-5.41	-18.91	-32.42
	0%	40.62	27.01	13.51	0.00	-13.61	-27.01	-40.62
	-2.67%	32.04	18.54	5.03	-5.46	-21.39	-35.49	-49.01
	-5.33%	23.19	9.68	-3.83	-17.33	-30.84	-44.35	-57.85
	-8%	13.96	0.45	-13.06	-26.56	-40.07	-53.58	-67.09

최대 손실 시나리오

위험액	-67.09
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	59.33
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로증권POLE-2호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO

2) 만기: 2012년 5월 11일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우

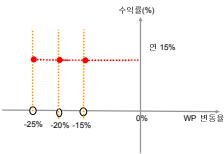
: 원금 * 115%

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

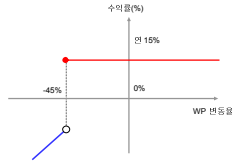
: 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조표 및 최대 손실 가능금액 (단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

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
-----	------

[90] 데리츠2Star사로증권POLE-이호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, POSCO

2) 만기: 2012년 5월 11일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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

연율 15%의 수익률로 중도 상환이 됨.

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

- 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우

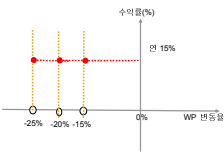
: 원금 * 115%

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

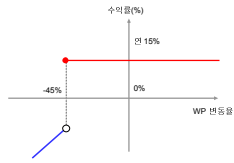
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

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
	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
-----	------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호 [EL]

1. 계약금액

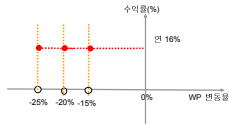
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	차입

단위:백만원

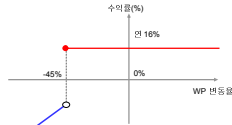
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 원금 * 118%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
 : 원금 * (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 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.46	1.24	1.00	0.76	0.52	0.28	0.04
손익	5.33%	1.38	1.14	0.90	0.66	0.42	0.18	-0.07
시나리오	2.67%	1.13	0.89	0.65	0.40	0.16	-0.08	-0.32
	0%	0.72	0.48	0.24	0.00	-0.24	-0.48	-0.72
	-2.67%	0.17	-0.07	-0.31	-0.56	-0.80	-1.04	-1.28
	-5.33%	-0.54	-0.78	-1.02	-1.26	-1.50	-1.75	-1.99
	-8%	-1.40	-1.64	-1.88	-2.12	-2.36	-2.60	-2.85

최대 손실 시나리오

위험액	-2.85
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.92
-----	------

[92] 테라츠2Star사로증권LESH-1호[EL]

1. 계약금액

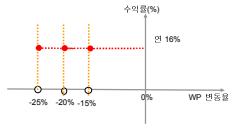
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	차입

단위:백만원

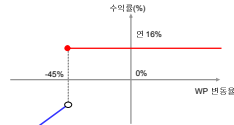
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 증가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 10%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
→ 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
: 원금 * 110%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 원금 * (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 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	26.56	22.24	17.92	13.61	9.29	4.97	0.65
손익	5.33%	24.73	20.42	16.10	11.78	7.46	3.14	-1.18
시나리오	2.67%	20.20	15.88	11.56	7.24	2.93	-1.39	-5.71
	0%	12.96	8.64	4.32	0.00	-4.32	-8.64	-12.96
	-2.67%	3.00	-1.32	-5.63	-9.95	-14.27	-18.59	-22.91
	-5.33%	-9.66	-13.98	-18.30	-22.61	-26.93	-31.25	-35.57
	-8%	-25.03	-29.35	-33.66	-37.98	-42.30	-46.62	-50.94

최대 손실 시나리오

위험액	-50.94
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	52.21
-----	-------

[94] 테라즈스타사모증권HCSV-1

1. 계약금액

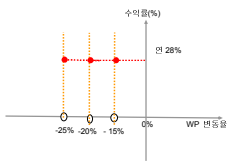
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순보지성(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	차입

단위: 백만원

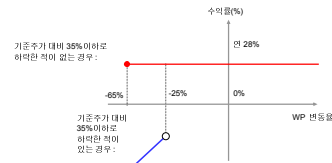
2. 만기시점의 손익구조

- 장외파생상품의 기초자산: 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주
- 만기: 2012년 4월 27일
- 런드청산 결정주기: 매 6개월
- 기준지수: 2009년 4월 30일 현대차 보통주, 삼성증권업 보통주의 증가
- 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(현대차 보통주, 삼성증권업 보통주 증가)의 중도상환가액이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 런드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반도 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 표보증권(ELS)336

손익 구조표준 편 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	7.21	56.58	44.35	30.12	15.89	1.66	-12.57
손익	5.33%	63.55	49.32	35.09	20.86	6.63	-7.60	-21.83
시나리오	2.67%	53.51	39.28	25.05	10.82	-3.41	-17.64	-31.87
	0%	42.69	26.46	14.23	0.00	-14.23	-28.66	-42.69
	-2.67%	31.09	16.86	2.63	-11.60	-23.83	-40.06	-54.29
	-5.33%	18.71	4.48	-9.75	-23.98	-38.21	-52.44	-66.67
	-8%	5.55	-8.68	-22.91	-37.14	-51.37	-65.60	-79.83

최대 손실 시나리오

위험액	-79.83
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	67.05
-----	-------

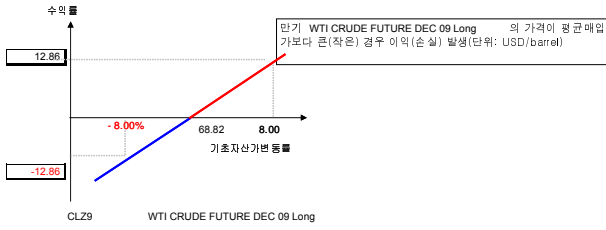
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연기시점의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CL29 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	12.86
	5.33%	8.57
	2.67%	4.29
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-4.29
	-5.33%	-8.57
	-8%	-12.86

최대손실 시나리오	
위험액	-12.86

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	51
-----	----

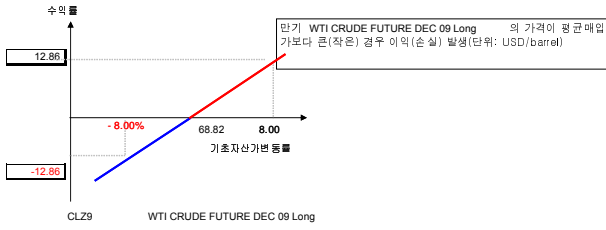
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

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	
기초자산	8%	43.84
	5.33%	29.21
	2.67%	14.63
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-14.63
	-5.33%	-29.21
	-8%	-43.84

최대 손실 시나리오	
위험액	-43.84

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

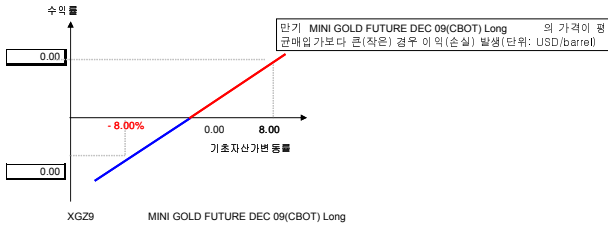
위험액	178
-----	-----

[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	0	0	-	장내

2. 헷지시점의 손익 구조



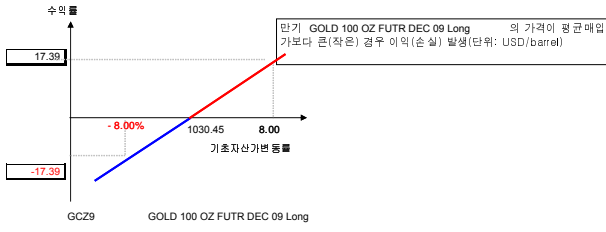
[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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

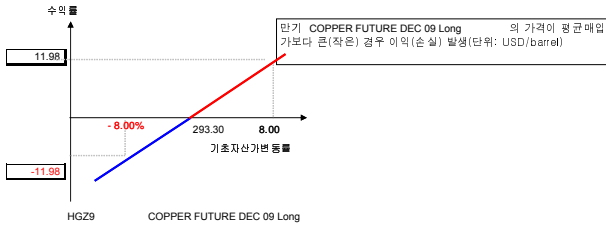


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조

