

파생상품거래투자기구의 위험에 관한 자료공시

[1] 데리브 플리켓 시모던위 파생상품 투자신탁 1호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 만기: 2010년 4월 5일

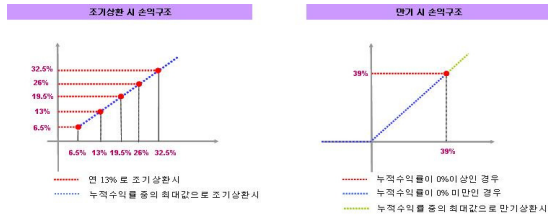
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익구조변동률(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권(ELS)1264

손익구조변동률 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 우리금융지주 보통주)의 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 만 15.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6006903TR1 대우증권(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
-----	------

[4] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자전략 4호

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(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

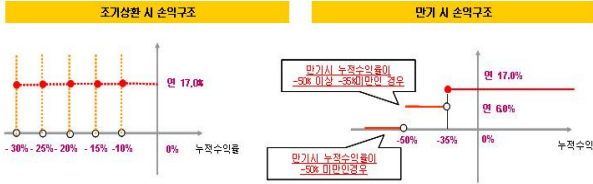
3) 만드침산 결정주기: 매 6개월

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:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

[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) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

단, 만기 시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 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) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR600345TTB9 변동주위(ELS)2007-609

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	10.09	10.08	10.07	10.06	10.05	10.04	10.03
	5.33%	6.74	6.73	6.72	6.71	6.70	6.69	6.68
	2.67%	3.36	3.37	3.36	3.35	3.34	3.33	3.32
	0%	0.03	0.02	0.01	0.00	-0.01	-0.02	-0.03
	-2.67%	-3.32	-3.33	-3.34	-3.35	-3.36	-3.37	-3.38
-5.33%	-6.68	-6.69	-6.70	-6.71	-6.72	-6.73	-6.74	
-8%	-10.03	-10.04	-10.05	-10.06	-10.07	-10.08	-10.09	

최대 손실 시나리오

위험액	-10.09
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	10.09
-----	-------

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 2호

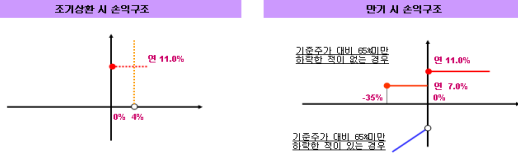
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장의파생상품의 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 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환본트 기준가액의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가액 보다 작은 경우 : 원금 X 121%
- 두 기초자산의 가액(청중표형)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 비파생(ELS) 2007-397세

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	346.85	339.36	331.86	324.37	316.88	309.38	301.89
	5.33%	238.73	231.23	223.74	216.25	208.75	201.26	193.77
	2.67%	130.60	123.11	115.62	108.12	100.63	93.14	85.64
	0%	22.48	14.99	7.49	0.00	-7.49	-14.99	-22.48
	-2.67%	-85.64	-93.14	-100.63	-108.12	-115.62	-123.11	-130.60
	-5.33%	-193.77	-201.26	-208.75	-216.25	-223.74	-231.23	-238.73
	-8%	-301.89	-309.36	-316.86	-324.37	-331.86	-339.36	-346.85

최대 손실 시나리오

위험액	-346.85
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	344.77
-----	--------

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

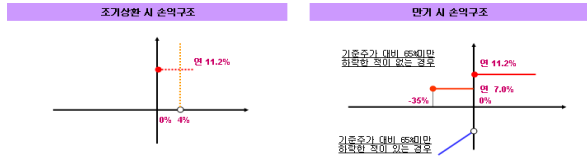
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

- 두 기초자산의 가격(장중도환)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 65%이하 하락한적이 있는 경우

: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익 구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR600345ST27 (투자유형: ELS) 2017-398회

수익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	33.20	32.48	31.77	31.05	30.33	29.61	28.90
시나리오	5.33%	22.85	22.13	21.42	20.70	19.98	19.26	18.55
	2.67%	12.50	11.78	11.07	10.35	9.63	8.91	8.20
	0%	2.15	1.43	0.72	0.00	-0.72	-1.43	-2.15
	-2.67%	-8.20	-8.91	-9.63	-10.35	-11.07	-11.78	-12.50
	-5.33%	-18.55	-19.26	-19.98	-20.70	-21.42	-22.13	-22.85
	-8%	-28.90	-29.61	-30.33	-31.05	-31.77	-32.48	-33.20

최대 손실 시나리오

위험액	-33.20
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	33.00
-----	-------

[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	잔액

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 6월 3일

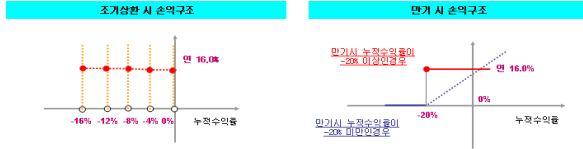
3) 만기점산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 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	거래유형	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

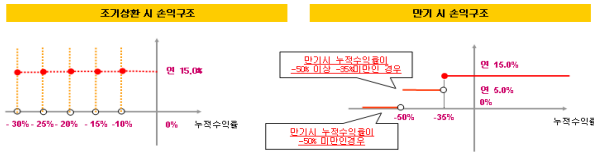
3) 만도점산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만도의 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	8%	0.80	0.72	0.63	0.55	0.47	0.39	0.30
시나리오	5.33%	0.65	0.57	0.49	0.41	0.32	0.24	0.16
	2.67%	0.47	0.39	0.30	0.22	0.14	0.06	-0.03
	0%	0.29	0.18	0.06	0.00	-0.08	-0.16	-0.25
	-2.67%	-0.01	-0.10	-0.18	-0.26	-0.34	-0.42	-0.51
	-5.33%	-0.31	-0.39	-0.48	-0.56	-0.64	-0.72	-0.80
	-8%	-0.65	-0.73	-0.81	-0.89	-0.98	-1.06	-1.14

최대 손실 시나리오

위험액	-1.14
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.39
-----	------

[15] 메리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

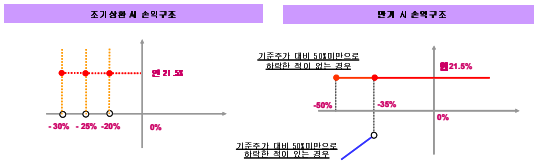
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010 년 01월 07일
- 3) 만드첨산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기일을 설정하고, 기초자산(LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이상인 경우(두번째 중도상환일), 70%이상인 경우(세번째 중도상환일), 65%이상인 경우(만기 상환일) 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(중도상환)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 손위(ELS)2008=647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	163.98	157.11	150.23	143.35	136.47	129.60	122.72
	5.33%	118.84	111.97	105.09	98.21	91.33	84.46	77.58
	2.67%	71.06	64.18	57.30	50.43	43.55	36.67	29.79
	0%	20.83	13.95	6.86	0.00	-3.04	-10.16	-17.28
	-2.67%	-32.44	-39.31	-46.19	-53.07	-59.95	-66.82	-73.70
-5.33%	-88.15	-95.03	-101.90	-108.78	-115.66	-122.54	-129.41	
-8%	-146.51	-153.38	-160.26	-167.14	-174.01	-180.89	-187.77	

최대 손실 시나리오

위험액	-187.77
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	208.40
-----	--------

[17]테리츠StepDown사모단위특성26호

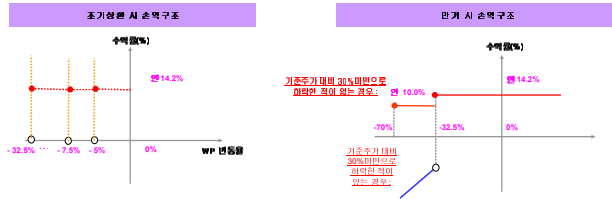
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: CJ 보통주
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 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 수익률도 중도상환이 됨.
67.5%(만기상환일) 미만인 경우 만이율 14.2%의 수익률도 중도상환이 됨.
단, 만기까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 30%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 67.5%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
- 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 30%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867B1B0 쿠루남산한동림(ELS)803

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동률 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	208.60	184.41	160.22	136.03	111.84	87.64	63.45
	5.33%	163.21	139.02	114.83	90.64	66.45	42.25	18.06
	2.67%	117.87	93.68	69.49	45.30	21.10	-3.09	-27.28
	0%	72.58	48.38	24.19	0.00	-24.19	-48.38	-72.58
	-2.67%	27.33	3.13	-21.06	-45.25	-69.44	-93.63	-117.83
	-5.33%	-17.88	-42.07	-66.26	-90.45	-114.65	-138.84	-163.03
	-8%	-63.04	-87.23	-111.42	-135.61	-159.80	-183.99	-208.19

최대 손실 시나리오

위험액	-208.19
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	204.71
-----	--------

[18]테라츠 TOUCH사모단위파생1호

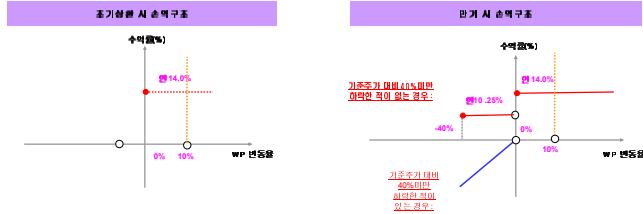
1. 계약금액

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

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 있는 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. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

구분	손익 구조변동 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	66.24	64.85	63.46	62.07	60.69	59.30	57.91	
손익	45.54	44.16	42.77	41.38	39.99	38.61	37.22	
손익	24.85	23.46	22.08	20.69	19.30	17.91	16.53	
손익	4.16	2.77	1.39	0.00	-1.39	-2.77	-4.16	
손익	-16.53	-17.91	-19.30	-20.69	-22.08	-23.46	-24.85	
손익	-37.21	-38.60	-39.99	-41.37	-42.76	-44.15	-45.54	
손익	-57.90	-59.28	-60.67	-62.06	-63.45	-64.83	-66.22	

최대 손실 시나리오	
위험액	57.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	65.62
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트5호

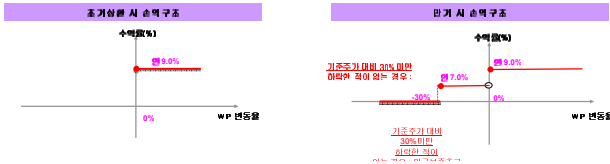
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 수익구조

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



3. 손익 구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	39.55	37.31	35.06	32.82	30.58	28.33	26.09	
손익	5.33%	30.11	27.86	25.62	23.38	21.13	18.89	
손익	2.67%	19.17	16.92	14.68	12.44	10.19	7.95	
손익	0%	6.73	4.49	2.24	0.00	-2.24	-4.49	
손익	-2.67%	-7.21	-9.45	-11.69	-13.94	-16.18	-18.42	
손익	-5.33%	-22.64	-24.89	-27.13	-29.37	-31.61	-33.86	
손익	-8%	-39.57	-41.81	-44.06	-46.30	-48.54	-50.79	
손익							-53.03	

최대 손실 시나리오

위험액	26.09
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	53.76
-----	-------

[2] 메리츠치주연계사모단위파생7호

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 보통주, SK HOLDINGS 보 통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.

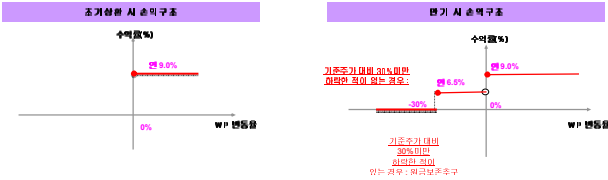
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 만드 해지

- 두 기초자산의 가격이 만만도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 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. 손익구조변동(최대손실가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	21.48	20.22	13.95	17.69	18.43	15.16	13.90
손익	5.33%	16.35	15.09	13.83	12.56	11.30	10.04	8.77
손익	2.67%	10.46	9.19	7.93	6.67	5.40	4.14	2.88
손익	0%	3.79	2.53	1.26	0.00	-1.26	-2.53	-3.79
손익	-2.67%	-3.65	-4.91	-6.17	-7.44	-8.70	-9.96	-11.23
손익	-5.33%	-11.86	-13.12	-14.38	-15.65	-16.91	-18.17	-19.44
손익	-8%	-20.84	-22.10	-23.36	-24.63	-25.89	-27.15	-28.42

최대손실 시나리오

위험액	13.90
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.43
-----	-------

[28] 매리츠일종지수연계사모파생1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 만기: 2010년 08월 04일

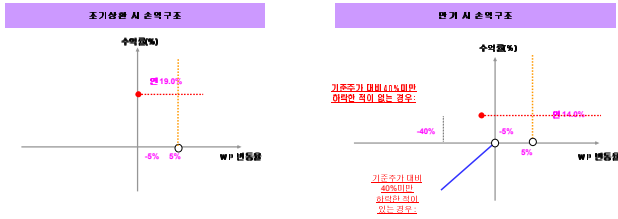
3) 펀드청산결정주기: 매 3개월

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 상중포함하여 한번이라도 최초기준가격의 95% 이상이거나 105% 이상 상승한 적이 있는 경우 연 19%의 수익률로 중도상환

- 단, 만기시까지 초기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익률 결정 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. 손익구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 무리투자증권(ELS)2118

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	157.81	150.65	143.50	136.34	129.19	122.03	114.88
	5.33%	111.40	104.25	97.09	89.94	82.78	75.62	68.47
	2.67%	65.96	58.80	51.64	44.49	37.33	30.18	23.02
	0%	21.47	14.31	7.16	0.00	-7.16	-14.31	-21.47
	-2.67%	-22.06	-29.22	-36.37	-43.53	-50.69	-57.84	-65.00
	-5.33%	-64.63	-71.79	-78.95	-86.10	-93.26	-100.41	-107.57
	-8%	-106.25	-113.40	-120.56	-127.71	-134.87	-142.03	-149.18

최대 손실 시나리오

위험액	-149.18
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	150.00
-----	--------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생13

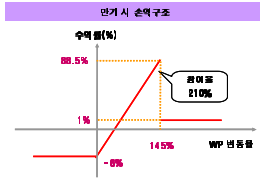
1. 계약금액

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 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가일 수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우
: 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수/최초기준지수 - 1))
 - 만기 평가일 수가 최초기준가격 미만일 경우
: 원금 * 94%
- 6) 기초자산(KOSPI200지수)의 증가의 가격이 최초기준지수 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	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

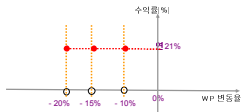
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위: (백만원)

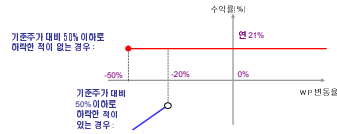
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
가	8%	-5.63	-6.25	-6.86	-7.48	-8.09	-8.71	-9.32
초	5.33%	-2.61	-3.23	-3.84	-4.46	-5.08	-5.69	-6.31
자	2.67%	-0.12	-0.74	-1.35	-1.97	-2.58	-3.20	-3.81
산	0%	1.85	1.23	0.62	0.00	-0.62	-1.23	-1.85
시	-2.67%	3.29	2.67	2.06	1.44	0.83	0.21	-0.41
나	-5.33%	4.20	3.59	2.97	2.36	1.74	1.13	0.51
리	-8%	4.60	3.98	3.36	2.75	2.13	1.52	0.90

최대 손실 시나리오

위험액	0.90
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	6.66
-----	------

[67] 데리츠2Star사로 증권SE ST-1

1. 계약금액

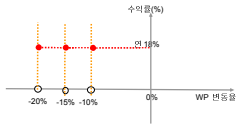
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

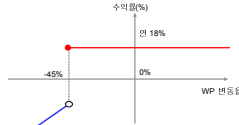
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 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 (단위:백 만원))
KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-10.91	-13.05	-15.19	-17.33	-19.47	-21.61	-23.75
산	5.33%	-3.91	-6.05	-8.19	-10.33	-12.48	-14.62	-16.76
시나리오	2.67%	1.86	-0.28	-2.42	-4.56	-6.70	-8.84	-10.98
오	0%	6.42	4.28	2.14	0.00	-2.14	-4.28	-6.42
	-2.67%	9.76	7.62	5.48	3.34	1.20	-0.94	-3.08
	-5.33%	11.88	9.74	7.60	5.46	3.32	1.18	-0.96
	-8%	12.78	10.64	8.50	6.36	4.22	2.08	-0.06

최대 손실 시나리오

위험액	-0.06
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백 만원)

위험액	18.53
-----	-------

[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. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤

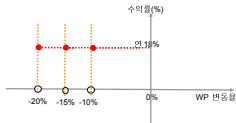
2) 만기: 2012년 3월 26일

3) 펀드청산 결정주기: 매6개월

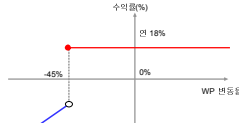
4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가

- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액(다위·백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	-6.00	-7.18	-8.36	-9.53	-10.71	-11.89	-13.07
손익	5.33%	-2.15	-3.33	-4.51	-5.69	-6.86	-8.04	-9.22
시나리오	2.67%	1.03	-0.15	-1.33	-2.51	-3.68	-4.86	-6.04
	0%	3.53	2.36	1.18	0.00	-1.18	-2.36	-3.53
	-2.67%	5.37	4.19	3.01	1.84	0.66	-0.52	-1.70
	-5.33%	6.54	5.36	4.18	3.00	1.83	0.65	-0.53
	-8%	7.03	5.85	4.68	3.50	2.32	1.14	-0.03

최대 손실 시나리오

위험액	-0.03
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(다위·백만원)

위험액	10.19
-----	-------

[77] 데리츠2SIa사모SEST-3

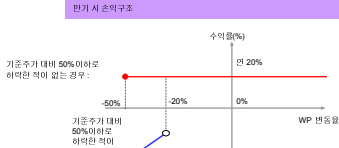
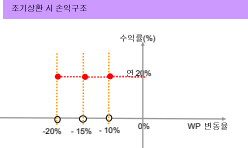
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 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%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 : 원금 * 120%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (평가기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위·백만원))

KR6562345W35 유인투기증권(ELS)2382

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산	8%	-2.46	-3.04	-3.60	-4.16	-4.72	-5.28	-5.84
손익	5.33%	-0.69	-1.25	-1.81	-2.37	-2.93	-3.49	-4.05
시나리오	2.67%	0.69	0.13	-0.43	-0.98	-1.54	-2.10	-2.66
	0%	1.66	1.12	0.56	0.00	-0.56	-1.12	-1.66
	-2.67%	2.22	1.70	1.14	0.58	0.02	-0.54	-1.10
	-5.33%	2.44	1.88	1.32	0.76	0.20	-0.36	-0.92
	-8%	2.22	1.66	1.10	0.54	-0.02	-0.58	-1.14

최대 손실 시나리오	
위험액	-1.14

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	2.23
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

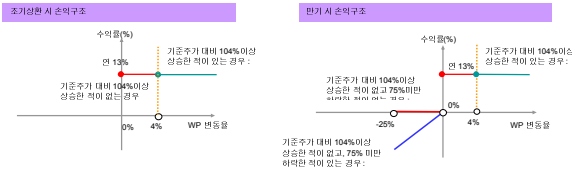
1. 계약금액

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 조기상환일절에 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%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



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	8%	9,625.53	9,227.86	8,830.19	8,432.52	8,034.85	7,637.18	7,239.50
손익	5.33%	6,776.11	6,378.44	5,980.77	5,583.10	5,185.43	4,787.75	4,390.08
손익률	2.67%	3,965.27	3,567.60	3,169.93	2,772.26	2,374.59	1,976.91	1,579.24
손익률	0%	1,198.01	798.34	397.67	0.00	-397.67	-798.34	-1,198.01
손익률	-2.67%	-1,540.86	-1,939.33	-2,338.00	-2,736.66	-3,135.33	-3,534.00	-3,932.66
손익률	-5.33%	-4,235.76	-4,633.43	-5,031.10	-5,428.77	-5,826.44	-6,224.11	-6,621.78
손익률	-8%	-6,892.27	-7,289.94	-7,687.61	-8,085.28	-8,482.95	-8,880.62	-9,278.30

최대손실 시나리오

위험액	-9,278.30
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,403.84
-----	----------

[79-2] **메리츠주가지수연계사표8호**

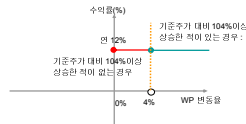
1. 계약금액

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

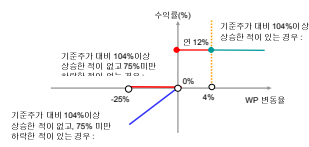
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 8일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 8일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 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 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초 기준가격의 100%보다 작은 경우
 - : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%이므로 하락한 적이 있는 경우
 - : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자기수연계사모8호**

1. 계약금액

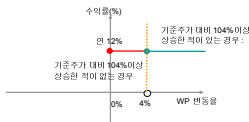
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔액

단위: 백만원

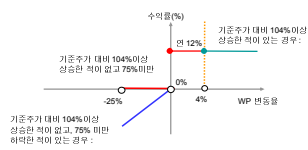
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 11월 16일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
 - 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수 수의 증가
 - 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 초기 상환일 정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환
- 단, 만기시 (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 * 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

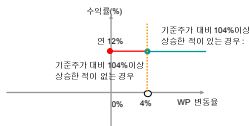
1. 계약금액

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

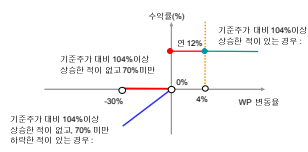
2. 만기시점의 수익구조

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

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6008679TA3 곳님 신원증권(ELS)786

[79-5] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

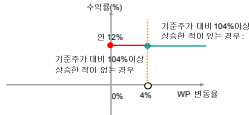
2. 만기시점의 손익구조

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

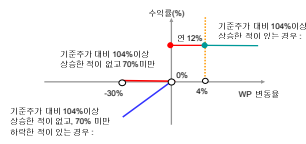
- 단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008676TB7 코트님 신환증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계서표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

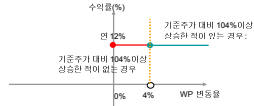
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

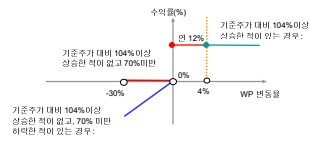
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600867CTB8 코트남 신원증권(ELS)804

[79-8] 메리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

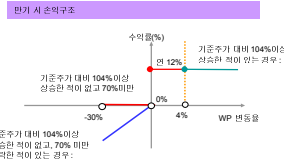
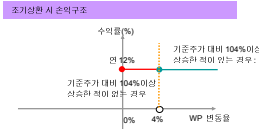
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 에리츠주가지수연계사료8호

1. 계약금액

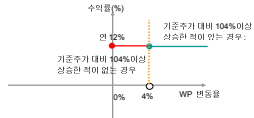
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	10000.0	0	10,000	상위

단위(백만원)

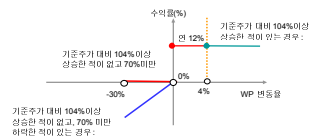
2. 평가시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환
 - 단, 만기시 (2차 상환일)까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 65%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

[79-10] 에리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

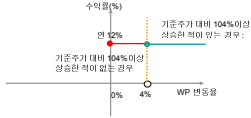
- 1) 참여대상자들의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지 수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

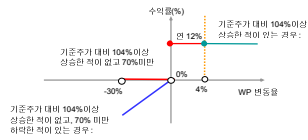
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의100%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수연계사료8호

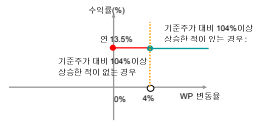
1. 계약금액

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

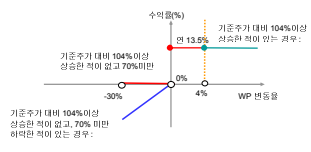
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠투자지수형계사모8호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

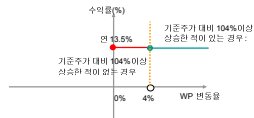
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 13일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 12월 13일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기 초자산(KOSPI200지 수)이 조기 상환결 정일에 최초기 준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기 준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13.5%의 수익률로 중도 상환

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

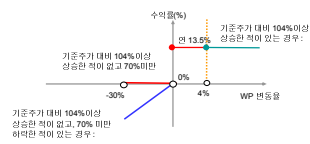
- 두 기초자산의 가격 이 할빈도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.3.5%
- 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%이므로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기기 준지수/최초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

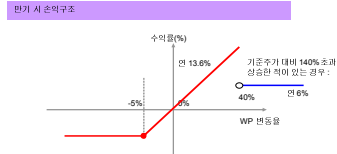
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 3월 19일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 만기 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
-----	------

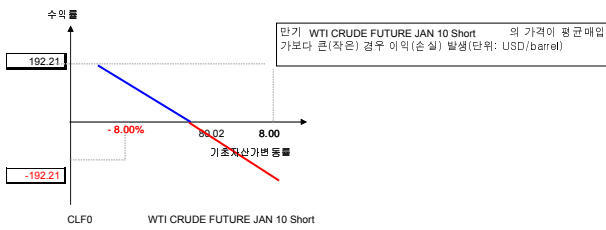
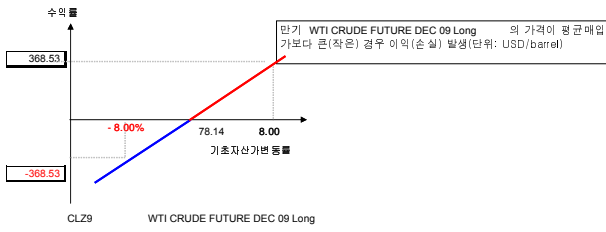
[80-1] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

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 시나리오	8%	560.75
	5.33%	373.60
	2.67%	187.15
	0%	0.00
	-2.67%	-187.15
시나리오	-5.33%	-373.60
	-8%	-560.75

최대손실 시나리오	
위험액	-560.75

4. 매물상환의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2,272
-----	-------

[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호

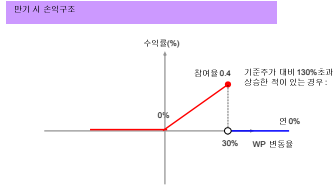
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6673105W54 동부증권-에프엘러스(ELS)B1

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초지	8%	-16.16	-21.18	-26.19	-31.21	-36.23	-41.25	-46.27
산	5.33%	-3.70	-8.72	-13.74	-18.76	-23.78	-28.80	-33.82
시나리오	2.67%	6.71	1.69	-3.33	-8.35	-13.37	-18.39	-23.41
	0%	15.06	10.04	5.02	0.00	-5.02	-10.04	-15.06
	-2.67%	21.36	16.34	11.32	6.30	1.28	-3.74	-8.76
	-5.33%	25.61	20.59	15.57	10.55	5.53	0.51	-4.51
	-8%	27.80	22.78	17.76	12.74	7.73	2.71	-2.31

최대 손실 시나리오

위험액	-2.31
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	34.99
-----	-------

[82] 데리츠2Star사모증권SET-8호

1. 계약금액

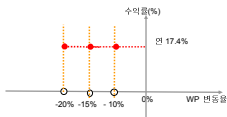
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	275.9	0	275.9	잔위

단위:백만원

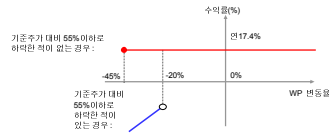
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산	8%	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93	0.93
손익	5.33%	0.41	0.41	0.41	0.41	0.41	0.41
시나리오	2.67%	0.10	0.10	0.10	0.10	0.10	0.10
	0%	-0.00	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.10	0.10	0.11	0.11	0.11	0.11
	-5.33%	0.42	0.42	0.42	0.42	0.42	0.42
	-8%	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94	0.94

최대 손실 시나리오

위험액	0.94
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.15
-----	------

[83] 데리츠2Star사모증권SET-5호

1. 계약금액

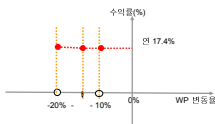
구분	기대대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1772.6	0	1,772.6	잔위

단위(백만원)

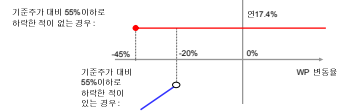
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주
- 2) 만기: 2010년 5월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 20일 삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주의 증가
- 5) 발행 후 매6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째, 여섯번째 중도상환일) 연율 17.4%의 수익률을 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의55%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 80%보다 작은 경우 : 원금 * 117.4%
- 두 기초자산의 가격(장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조변동률(최대 손실가능금액(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%	5.99	5.99	5.99	5.99	5.99	6.00	6.00
	5.33%	2.65	2.65	2.66	2.66	2.66	2.66	2.66
시나리오	2.67%	0.65	0.66	0.66	0.66	0.66	0.66	0.67
	0%	-0.01	-0.00	-0.00	0.00	0.00	0.00	0.01
	-2.67%	0.67	0.67	0.68	0.68	0.68	0.68	0.68
	-5.33%	2.69	2.69	2.69	2.69	2.70	2.70	2.70
	-8%	6.04	6.04	6.05	6.05	6.05	6.05	6.05

최대 손실 시나리오

위험액	6.05
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.93
-----	------

[87] 데리츠2Star사로증권SEKT-이 호

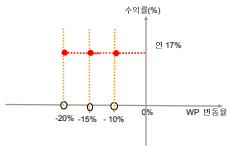
1. 계약금액

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

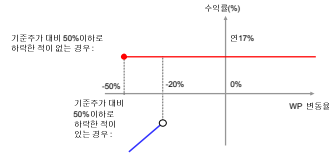
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6562319W52 유가 증권 (ELS)2415

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
-----	------

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

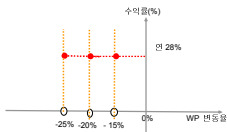
1. 계약금액

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

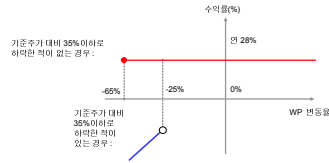
2. 만기시점의 손익구조

- 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 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반드 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 128%
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(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%	65.36	51.16	36.96	22.76	8.56	-5.64	-19.64
손실	5.33%	58.16	43.96	29.76	15.56	1.36	-12.84	-27.04
시나리오	2.67%	50.57	36.37	22.17	7.97	-6.23	-20.43	-34.63
	0%	42.60	28.40	14.20	0.00	-14.20	-28.40	-42.60
	-2.67%	34.24	20.04	5.84	-3.36	-22.56	-36.76	-50.96
	-5.33%	25.50	11.30	-2.90	-17.10	-31.30	-45.50	-59.70
	-8%	16.36	2.16	-12.04	-26.24	-40.44	-54.64	-68.84

최대 손실 시나리오

위험액	-68.84
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	60.68
-----	-------

[89] 데리츠2Star사로 증권POLE-2호

1. 계약금액

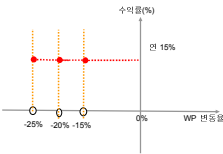
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	30.0	0	30.0	차입

단위: (백만원)

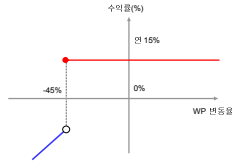
2. 만기시점의 손익구조

- 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
: 평균 * 115%
→ 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
: 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 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	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 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

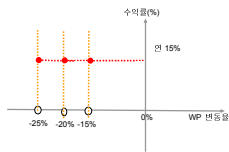
: 원금 * 115%

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

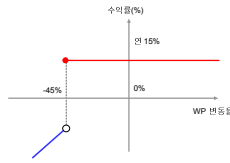
: 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6662311W58 권위스마트(ELS)117

손익구조변동 시나리오

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

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

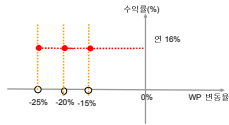
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	차입

단위(백만원)

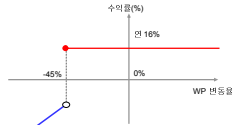
2. 만기시점의 손익구조

- 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 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 평균 * 118%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
 : 평균 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522308W66 대우증권ELS2998

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	1.18	0.92	0.67	0.41	0.16	-0.09	-0.35
	5.33%	1.14	0.88	0.63	0.37	0.12	-0.13	-0.39
시나리오	2.67%	1.00	0.75	0.49	0.24	-0.02	-0.27	-0.53
	0%	0.76	0.51	0.25	0.00	-0.25	-0.51	-0.76
	-2.67%	0.43	0.17	-0.08	-0.34	-0.59	-0.84	-1.10
	-5.33%	-0.01	-0.26	-0.52	-0.77	-1.02	-1.28	-1.53
	-8%	-0.54	-0.79	-1.05	-1.30	-1.56	-1.81	-2.07

최대 손실 시나리오	
위험액	-2.07

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.04
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

1. 계약금액

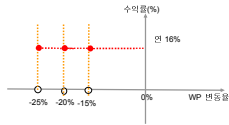
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	895.0	0	895.0	잔위

단위:백만원

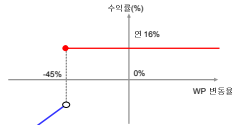
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	21.08	16.53	11.97	7.42	2.87	-1.69	-6.24
손익	5.33%	20.37	15.82	11.27	6.71	2.16	-2.39	-6.95
시나리오	2.67%	17.90	13.35	8.79	4.24	-0.31	-4.87	-9.42
	0%	13.86	9.11	4.55	0.00	-1.65	-9.11	-13.86
	-2.67%	7.86	3.10	-1.45	-5.00	-10.56	-15.11	-19.66
	-5.33%	-0.11	-4.67	-9.22	-13.77	-18.33	-22.88	-27.43
	-8%	-9.65	-14.20	-18.75	-23.31	-27.86	-32.41	-36.97

최대 손실 시나리오

위험액	-36.97
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	36.45
-----	-------

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

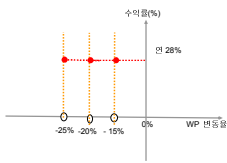
1. 계약금액

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

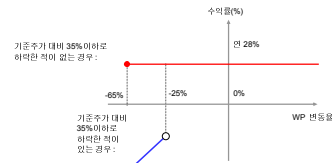
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표현 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6622301W53 코보증권(ELS)336

손익 구조표현 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	60.00	46.02	32.04	18.06	4.07	-9.91	-23.89
손실	5.33%	55.07	41.09	27.11	13.13	-0.85	-14.83	-28.82
손익	2.67%	49.06	35.07	21.09	7.11	-6.87	-20.85	-34.83
시나리오	0%	41.94	27.96	13.98	0.00	-13.98	-27.96	-41.94
	-2.67%	33.74	19.76	5.78	-3.20	-22.18	-38.17	-50.15
	-5.33%	24.45	10.47	-3.52	-17.50	-31.48	-45.46	-59.44
	-8%	14.06	0.08	-13.90	-27.89	-41.87	-55.85	-69.83

최대 손실 시나리오

위험액	-69.83
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	91.73
-----	-------

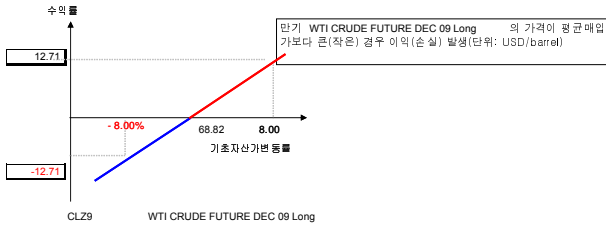
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연기사험의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CL29 WTI CRUDE FUTURE DEC 09 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	12.71
	5.33%	8.47
	2.67%	4.24
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-4.24
	-5.33%	-8.47
	-8%	-12.71

최대손실 시나리오	
위험액	-12.71

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	51
-----	----

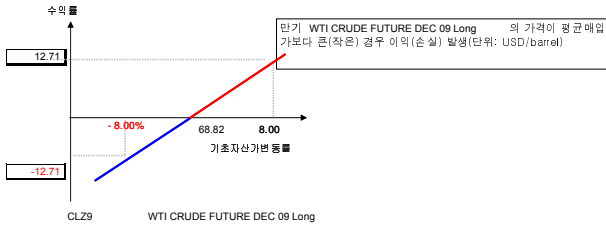
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산

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	손익
기초자산	8%	43.80
	5.33%	29.18
	2.67%	14.62
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-14.62
	-5.33%	-29.18
	-8%	-43.80

최대 손실 시나리오	
위험액	-43.80

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

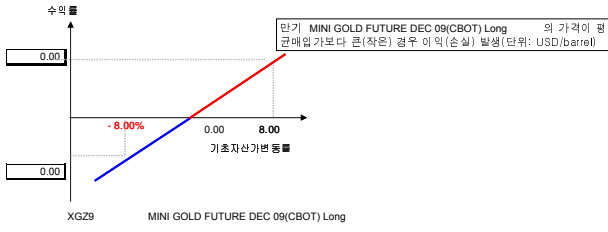
위험액	177
-----	-----

[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



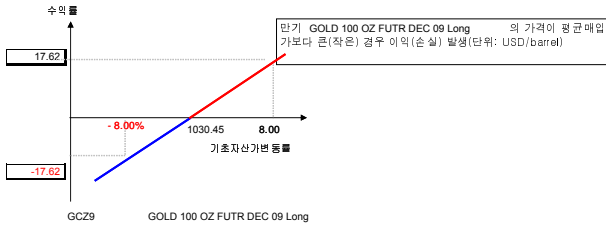
[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조

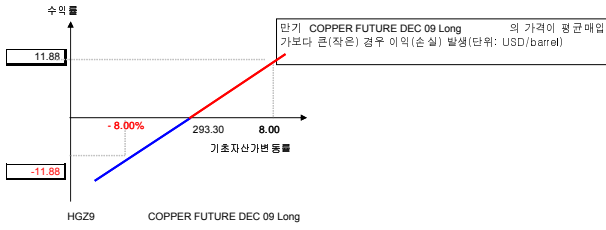


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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

