

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

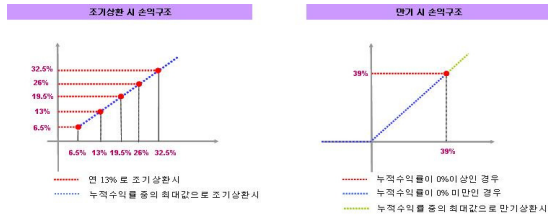
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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 관할하는 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) | 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: 역면금액 지급 (원금보장추구)

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6006903TR1 대우증권(ELS)1533

손익 구조범위 시나리오

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

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[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

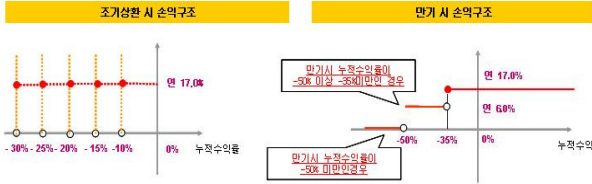
3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

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% | 0.00 | 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 |
|-----|------|

[7]메리츠 지수연계 단위파생상품투자전략 2호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연기: 2010년 2월 22일

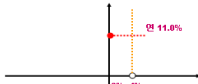
3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월

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

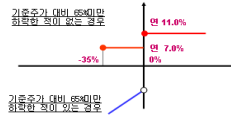
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200, NIKKEI225)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초 기준가액의 100%이상인 경우 또는 기초자산의 증가가 동일일자에 모두 105%이상 상승한 적이 있는 경우 : 연율 11%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확립 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가액이 원본투자 기준가액의 65%초과 하락한 적이 없고, 최초기준가액보다 작은 경우 : 원금 X 121%
 - 두 기초자산의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

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345RT28 비파생상품(ELS): 2007-397세

손익구조범위 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 326.38 | 320.77 | 315.16 | 309.54 | 303.93 | 298.31 | 292.70 |
| | 5.33% | 223.20 | 217.59 | 211.97 | 206.36 | 200.75 | 195.13 | 189.52 |
| | 2.67% | 120.02 | 114.41 | 108.79 | 103.18 | 97.57 | 91.95 | 86.34 |
| | 0% | 16.84 | 11.23 | 5.61 | 0.00 | -5.61 | -11.23 | -16.84 |
| | -2.67% | -86.34 | -91.95 | -97.57 | -103.18 | -108.79 | -114.41 | -120.02 |
| -8.33% | -189.52 | -195.13 | -200.75 | -206.36 | -211.97 | -217.59 | -223.20 | |
| -8% | -292.70 | -298.31 | -303.93 | -309.54 | -315.16 | -320.77 | -326.38 | |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -326.38 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 324.63 |
|-----|--------|

[8]메리츠 지수연계 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 연가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200, NIKKEI225

2) 연가: 2010년 2월 22일

3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

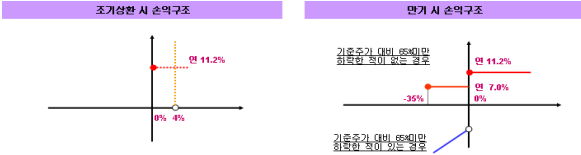
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

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

: 원금 * (연가기준지수/초기기준지수)

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액) (단위: 백만원)

KR60034SST27 펀드 운용 (ELS) 2007~398회

수익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 31.24 | 30.70 | 30.17 | 29.63 | 29.09 | 28.55 | 28.02 |
| | 5.33% | 21.36 | 20.63 | 20.29 | 19.75 | 19.22 | 18.68 | 18.14 |
| 시나리오 | 2.67% | 11.49 | 10.95 | 10.41 | 9.88 | 9.34 | 8.80 | 8.26 |
| | 0% | 1.61 | 1.07 | 0.54 | 0.00 | -0.54 | -1.07 | -1.61 |
| | -2.67% | -8.26 | -8.80 | -9.34 | -9.88 | -10.41 | -10.95 | -11.49 |
| | -5.33% | -18.14 | -18.68 | -19.22 | -19.75 | -20.29 | -20.83 | -21.36 |
| | -8% | -28.02 | -28.55 | -29.09 | -29.63 | -30.17 | -30.70 | -31.24 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -31.24 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 31.09 |
|-----|-------|

[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

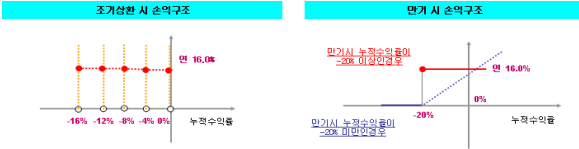
3) 만기점산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조의 범위(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR6003456TR2 최대 손실(ELS)2007-504

손익구조범위 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 글러벡 단위파생상품투자신탁 5호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 국민은행 보통주, 한국전력 보통주

2) 만기: 2010년 8월 13일

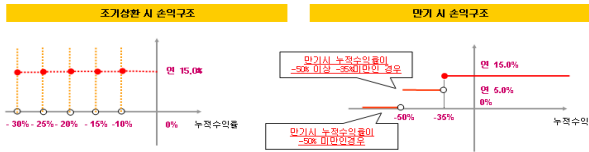
3) 만도청산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762CT80 비례예상증권(ELS)191

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 1.17 | 1.13 | 1.08 | 1.04 | 0.99 | 0.94 | 0.90 |
| | 5.33% | 0.80 | 0.76 | 0.71 | 0.66 | 0.62 | 0.57 | 0.52 |
| | 2.67% | 0.46 | 0.41 | 0.36 | 0.32 | 0.27 | 0.23 | 0.18 |
| | 0% | 0.14 | 0.09 | 0.05 | 0.00 | -0.05 | -0.10 | -0.14 |
| | -2.67% | -0.15 | -0.20 | -0.24 | -0.29 | -0.34 | -0.38 | -0.43 |
| | -5.33% | -0.42 | -0.46 | -0.51 | -0.56 | -0.60 | -0.65 | -0.69 |
| | -8% | -0.65 | -0.70 | -0.74 | -0.79 | -0.84 | -0.88 | -0.93 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -0.93 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.93 |
|-----|------|

[15] 데리츠 Step Down 단위 피생상품투자신탁 15호

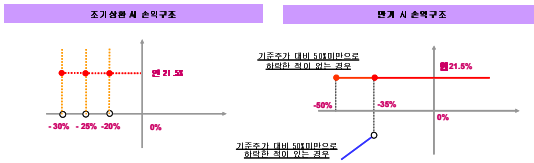
1. 계약금액

| 구분 | 기래자산 | 기래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,020 | 0 | 2,020 | 창의 |

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장의피생상품의 기초자산: LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 2) 만기: 2010년 01월 07일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 9일 LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(LG더 스펙레이 보통주, GS건설 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 80%이상인 경우(첫번째 중도상환일), 75%이상인 경우(두번째 중도상환일), 70%이상인 경우(세번째 중도상환일), 65%이상인 경우(만기 상환일) 인출 21.5%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 한번도 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 65%보다 작은 경우 : 원금 * 143%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 50%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



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

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 263.49 | 255.27 | 247.05 | 238.83 | 230.61 | 222.39 | 214.17 |
| 시나리오 | 5.33% | 190.83 | 182.61 | 174.39 | 166.17 | 157.95 | 149.73 | 141.51 |
| | 2.67% | 111.22 | 103.00 | 94.78 | 86.56 | 78.34 | 70.12 | 61.90 |
| | 0% | 24.86 | 16.44 | 8.22 | 0.00 | -8.22 | -16.44 | -24.86 |
| | -2.67% | -68.85 | -77.07 | -85.29 | -93.51 | -101.73 | -109.95 | -118.17 |
| | -5.33% | -169.31 | -177.53 | -185.75 | -193.97 | -202.19 | -210.41 | -218.63 |
| | -8% | -276.73 | -284.95 | -293.16 | -301.38 | -309.60 | -317.82 | -326.04 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -326.04 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 329.93 |
|-----|--------|

[17]테리츠StepDown사모단위특성26호

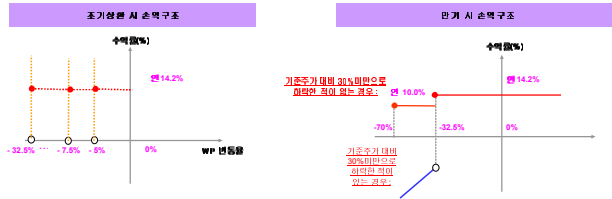
1. 계약금액

| | | | | | | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 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) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2007년 11월 14일의 CJ 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(CJ 보통주)의 최초기준가격의 95%(1차중도상환일), 92.5%(2차중도상환일), 90.0%(3차중도상환일), 87.5%(4차중도상환일), 85%(5차중도상환일), 82.5%(6차중도상환일), 80%(7차중도상환일), 77.5%(8차중도상환일), 75%(9차중도상환일), 72.5%(10차중도상환일), 70.0%(11차중도상환일), 67.5%(만기상환일) 이상인 경우 만이율 14.2%의 수익률로 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) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867B7B0 쿠루남산한동증권(ELS)803

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | 변동률 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | 215.79 | 192.81 | 169.84 | 146.86 | 123.89 | 100.91 | 77.94 |
| | 5.33% | 167.75 | 144.78 | 121.80 | 98.83 | 75.85 | 52.88 | 29.90 |
| | 2.67% | 116.80 | 95.82 | 72.85 | 49.87 | 26.90 | 3.92 | -19.05 |
| | 0% | 66.93 | 45.95 | 22.98 | 0.00 | -22.98 | -45.96 | -68.93 |
| | -2.67% | 18.13 | -4.84 | -27.82 | -50.79 | -73.77 | -96.74 | -119.72 |
| | -5.33% | -33.58 | -56.55 | -79.53 | -102.50 | -125.48 | -148.45 | -171.43 |
| | -8% | -86.21 | -109.18 | -132.16 | -155.13 | -178.11 | -201.08 | -224.06 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -224.06 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 230.61 |
|-----|--------|

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

1. 계약금액

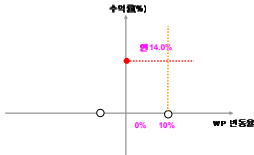
| 구분 | 기래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,550 | 0 | 1,550 | 잔위 |

단위(백만원)

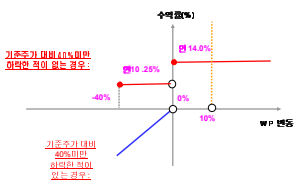
2. 만기시점의 수익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

수익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 61.34 | 60.45 | 59.55 | 58.66 | 57.76 | 56.87 | 55.97 | |
| 시나리오 | 5.33% | 41.79 | 40.90 | 40.00 | 39.11 | 38.21 | 37.31 | 36.42 |
| | 2.67% | 22.24 | 21.34 | 20.45 | 19.55 | 18.66 | 17.76 | 16.87 |
| | 0% | 2.69 | 1.79 | 0.90 | 0.00 | -0.90 | -1.79 | -2.69 |
| | -2.67% | -16.87 | -17.76 | -18.66 | -19.55 | -20.45 | -21.34 | -22.24 |
| | -5.33% | -36.42 | -37.31 | -38.21 | -39.11 | -40.00 | -40.90 | -41.79 |
| | -8% | -55.97 | -56.87 | -57.76 | -58.66 | -59.55 | -60.45 | -61.34 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 55.97 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 61.09 |
|-----|-------|

[19]테리 조지 수연계 사모단위 평가서5호

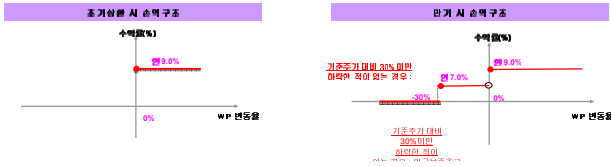
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762RV14 미래셋증권(ELS)289

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 0% | 51.49 | 49.51 | 47.53 | 45.56 | 43.58 | 41.60 | 39.62 |
| | 5.33% | 38.46 | 36.48 | 34.51 | 32.53 | 30.55 | 28.57 | 26.60 |
| 시나리오 | 2.67% | 23.28 | 21.30 | 19.32 | 17.34 | 15.37 | 13.39 | 11.41 |
| | 0% | 5.93 | 3.95 | 1.96 | 0.00 | -1.96 | -3.95 | -5.93 |
| 시나리오 | -2.67% | -13.57 | -15.55 | -17.53 | -19.50 | -21.48 | -23.46 | -25.44 |
| | -5.33% | -35.23 | -37.21 | -39.19 | -41.17 | -43.14 | -45.12 | -47.10 |
| | -8% | -59.05 | -61.03 | -63.01 | -64.99 | -66.96 | -68.94 | -70.92 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 39.62 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 75.17 |
|-----|-------|

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

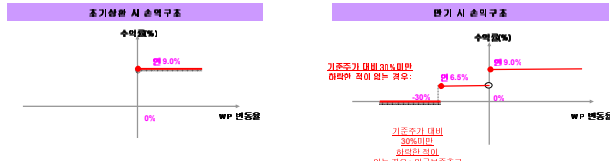
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR603762OV23 비례배분증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 34.89 | 33.28 | 31.64 | 30.01 | 28.38 | 26.75 | 25.12 |
| 손익 | 5.33% | 26.36 | 24.73 | 23.10 | 21.47 | 19.84 | 18.21 | 16.58 |
| 손익 | 2.67% | 16.35 | 14.73 | 13.10 | 11.47 | 9.84 | 8.21 | 6.58 |
| 손익 | 0% | 4.89 | 3.26 | 1.63 | 0.00 | -1.63 | -3.26 | -4.89 |
| 손익 | -2.67% | -8.05 | -9.67 | -11.30 | -12.93 | -14.56 | -16.19 | -17.82 |
| 손익 | -5.33% | -22.44 | -24.07 | -25.70 | -27.33 | -28.96 | -30.59 | -32.22 |
| 손익 | -8% | -36.31 | -39.94 | -41.56 | -43.19 | -44.82 | -46.45 | -48.08 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 25.12 |
|-----|-------|

4. 매매상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 49.65 |
|-----|-------|

[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) 만도청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

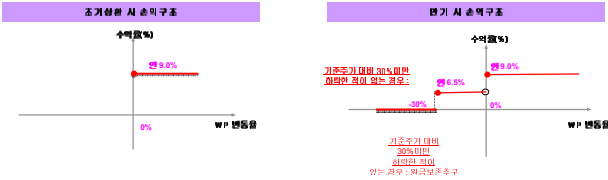
5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기 간을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보 통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 조기상환결정일에 최초기준가격의 100% 이상인 경우 만이율 9%로 중도상환함.

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

- 두 기초자산의 가격이 만도도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없다. 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만 하락한 적이 있는 경우

· 원금*100%

6) 만도의 수익구조



3. 손익 구조변동 중(최대손실가능금액) (단위:백만원)

KR603762RV22 미래셋증권(ELS)317

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% |
| 기초자산 | 27.14 | 25.87 | 24.61 | 23.34 | 22.07 | 20.80 | 19.54 |
| 손익 | 5.33% | 20.50 | 19.23 | 17.97 | 16.70 | 15.43 | 14.16 |
| 시나리오 | 2.67% | 12.72 | 11.45 | 10.19 | 8.92 | 7.65 | 6.39 |
| | 0% | 3.80 | 2.53 | 1.27 | 0.00 | -1.27 | -2.53 |
| | -2.67% | -6.26 | -7.52 | -8.79 | -10.06 | -11.33 | -12.59 |
| | -5.33% | -17.46 | -18.72 | -19.99 | -21.26 | -22.52 | -23.79 |
| | -8% | -29.79 | -31.06 | -32.33 | -33.59 | -34.86 | -36.13 |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 19.54 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 38.62 |
|-----|-------|

[23] 메리츠증권지수연계사모과제1호

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. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 평가: 2010년 08월 04일

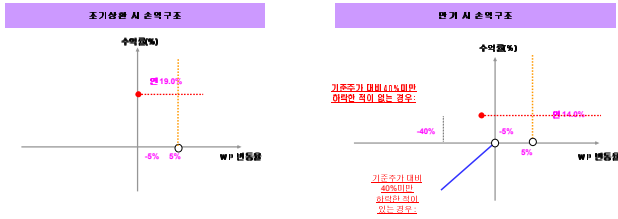
3) 펀드청산결정주기: 매 3개월

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

- 단, 평가시 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 * (평가기준지수/최초기준지수)

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% | 150.25 | 144.57 | 138.89 | 133.21 | 127.52 | 121.84 | 116.16 |
| | 5.33% | 103.93 | 98.25 | 92.57 | 86.89 | 81.20 | 75.52 | 69.84 |
| | 2.67% | 57.61 | 51.93 | 46.25 | 40.57 | 34.89 | 29.20 | 23.52 |
| | 0% | 17.08 | 11.40 | 5.72 | 0.04 | -5.64 | -11.36 | -17.08 |
| | -2.67% | -23.52 | -29.20 | -34.88 | -40.57 | -46.25 | -51.93 | -57.61 |
| | -5.33% | -62.17 | -67.85 | -73.53 | -79.21 | -84.89 | -90.58 | -96.26 |
| | -8% | -96.89 | -102.57 | -108.25 | -113.93 | -119.61 | -125.29 | -130.97 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -132.98 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 140.64 |
|-----|--------|

[34] 대리 조주가지 수연계 파생13

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 연가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 만기: 2010년 1월 12일

3) 만도점산 결정주기: 만기일 가일 1회

4) 기준지수: 2009년 1월 13일 KOSPI200지수의 증가

5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초

기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우

- 만기평가일 수가 최초기준가격 이상이고 최초기준가격의 145% 미만일 경우

: 원금 * (94% + 210% * (만기기준지수 / 최초기준지수 - 1))

- 만기평가일 수가 최초기준가격 미만일 경우

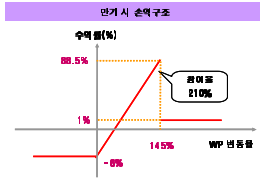
: 원금 * 94%

기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기준지수 평가일 이후 만기평가일까지 장중지수를 포함하여 최초

기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우

: 원금 * 101%

6) 권트의 수익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (단위:백만원))

KR6523312W19 대우증권ELS2856

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

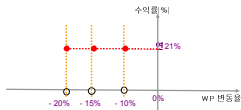
| | | | | | | |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 238 | 0 | 238 | 잔위 |

단위: (백만원)

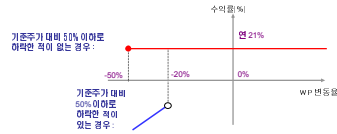
2. 만기시점의 손익구조

- 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 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 만기일 증가 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 / 최초 기준가격)
- 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% | -5.55 | -6.09 | -6.63 | -7.16 | -7.70 | -8.24 | -8.77 |
| 초 | 5.33% | -2.39 | -2.93 | -3.47 | -4.00 | -4.54 | -5.08 | -5.61 |
| 자 | 2.67% | -0.00 | -0.54 | -1.08 | -1.61 | -2.15 | -2.69 | -3.22 |
| 산 | 0% | 1.61 | 1.07 | 0.54 | 0.00 | -0.54 | -1.07 | -1.61 |
| 시 | -2.67% | 2.45 | 1.91 | 1.38 | 0.84 | 0.30 | -0.23 | -0.77 |
| 나 | -5.33% | 2.52 | 1.98 | 1.44 | 0.91 | 0.37 | -0.17 | -0.70 |
| 리 | -8% | 1.81 | 1.27 | 0.74 | 0.20 | -0.34 | -0.87 | -1.41 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -1.41 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 2.67 |
|-----|------|

[67] 데리츠2Star사로 증권SEST-1

1. 계약금액

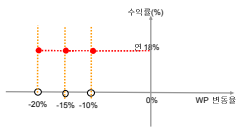
| | | | | | | |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1027.1 | 0 | 1,027 | 잔위 |

단위(백만원)

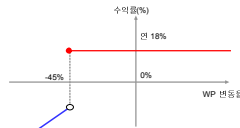
2. 평가시점의 손익구조

- 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(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 (단위:백만원))
KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초지 | 8% | -3.44 | -5.44 | -7.45 | -9.45 | -11.45 | -13.46 | -15.46 |
| 산 | 5.33% | 1.41 | -0.60 | -2.60 | -4.60 | -6.61 | -8.61 | -10.61 |
| 시나리오 | 2.67% | 4.56 | 2.55 | 0.55 | -1.45 | -3.46 | -5.46 | -7.46 |
| | 0% | 6.01 | 4.01 | 2.00 | 0.00 | -2.00 | -4.01 | -6.01 |
| | -2.67% | 9.76 | 3.76 | 1.76 | -0.25 | -2.25 | -4.25 | -6.26 |
| | -5.33% | 3.82 | 1.82 | -0.19 | -2.19 | -4.19 | -6.20 | -8.20 |
| | -8% | 0.18 | -1.82 | -3.83 | -5.83 | -7.83 | -9.84 | -11.84 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -11.84 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 10.04 |
|-----|-------|

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

1. 계약금액

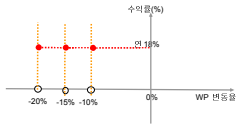
| 구분 | 기래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 565.0 | 0 | 565 | 차입 |

단위(백만원)

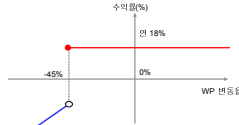
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초지 | 8% | -1.89 | -2.99 | -4.10 | -5.20 | -6.30 | -7.40 | -8.50 |
| | 5.33% | 0.77 | -0.33 | -1.43 | -2.53 | -3.63 | -4.74 | -5.84 |
| 산 | 2.67% | 2.51 | 1.41 | 0.30 | -0.80 | -1.90 | -3.00 | -4.10 |
| | 0% | 3.31 | 2.20 | 1.10 | 0.00 | -1.10 | -2.20 | -3.30 |
| 시나리오 | -2.67% | 3.17 | 2.07 | 0.97 | -0.14 | -1.24 | -2.34 | -3.44 |
| | -5.33% | 2.10 | 1.00 | -0.10 | -1.20 | -2.31 | -3.41 | -4.51 |
| | -8% | 0.10 | -1.00 | -2.11 | -3.21 | -4.31 | -5.41 | -6.51 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -6.51 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 5.52 |
|-----|------|

[77] 데리츠2SIa사모SEST-3

1. 계약금액

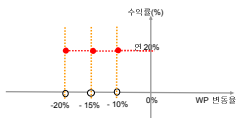
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 241.4 | 0 | 241 | 창의 |

단위(백만원)

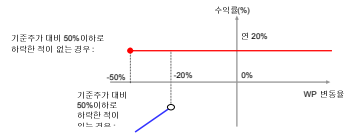
2. 평가시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



평가 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능 금액 (단위:백만원))

KR6562345W35 유인투기증권(ELS)2382

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-----------|----------|---------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초자산 시나리오 | 8% | -1.72 | -2.13 | -2.53 | -2.94 | -3.35 | -3.76 | -4.16 |
| | 5.33% | -0.28 | -0.69 | -1.10 | -1.51 | -1.91 | -2.32 | -2.73 |
| | 2.67% | 0.70 | 0.29 | -0.12 | -0.53 | -0.93 | -1.34 | -1.75 |
| | 0% | 1.22 | 0.81 | 0.41 | 0.00 | -0.41 | -0.81 | -1.22 |
| | -2.67% | 1.29 | 0.89 | 0.46 | 0.07 | -0.34 | -0.74 | -1.15 |
| | -5.33% | 0.91 | 0.50 | 0.09 | -0.31 | -0.72 | -1.13 | -1.53 |
| | -8% | 0.07 | -0.34 | -0.74 | -1.15 | -1.56 | -1.97 | -2.37 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | -2.37 |
|-----|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 2.35 |
|-----|------|

[79-1] 메리츠주가지수연계사모6호

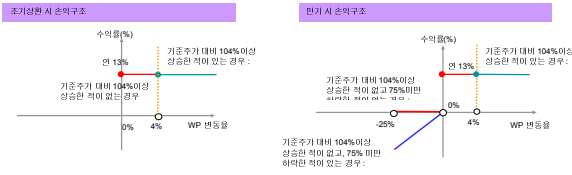
1. 계약금액

| 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) 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 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 정중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 13%의 수익률로 중도상환
- 단, 만기시 (12차 상환일)까지 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 113%
 - 두 기초자산의 가격 (정중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 손익 구조변환 및 최대 손실 가능금액 (단위: 백만원)

메리츠주가지수연계사모6호

손익 구조변환 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | -25% | -1.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 1.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 10,559.40 | 10,204.25 | 9,849.09 | 9,493.94 | 9,138.78 | 8,783.63 | 8,428.47 |
| | 5.33% | 7,315.02 | 6,959.87 | 6,604.71 | 6,249.56 | 5,894.40 | 5,539.25 | 5,184.09 |
| 시나리오 | 2.67% | 4,150.37 | 3,795.22 | 3,440.07 | 3,084.91 | 2,729.76 | 2,374.60 | 2,019.45 |
| | 0% | 1,085.46 | 710.31 | 355.15 | 0.00 | -355.15 | -710.31 | -1,085.46 |
| 손익 | -2.67% | -1,939.71 | -2,294.87 | -2,650.02 | -3,005.18 | -3,360.33 | -3,715.48 | -4,070.64 |
| | -5.33% | -4,865.15 | -5,220.31 | -5,575.46 | -5,930.62 | -6,285.77 | -6,640.92 | -6,996.08 |
| | -8% | -7,710.86 | -8,066.01 | -8,421.17 | -8,776.32 | -9,131.47 | -9,486.63 | -9,841.78 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|-----------|
| 위험액 | -9,841.78 |
|-----|-----------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

| | |
|-----|----------|
| 위험액 | 9,882.05 |
|-----|----------|

[79-2] **메리츠투자지수연계사모8호**

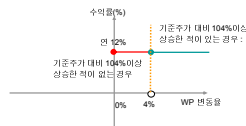
1. 계약금액

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

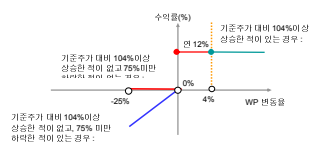
2. 만기시점의 수익구조

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

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

[79-3] **메리츠투자자산수익계사표8호**

1. **계약금액**

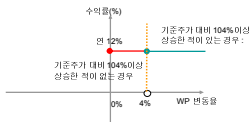
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6000.0 | 0 | 5,000 | 잔위 |

단위:백만원

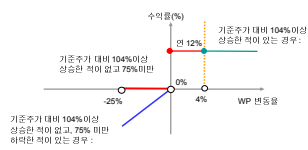
2. **평가시점의 손익구조**

- 1) 장외파생상품의 기초자산: KOSPI200지수
 - 2) 만기: 2010년 11월 16일
 - 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
 - 4) 기준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수
 - 5) 발행 후 매3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환일정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 변동폭이 한변이라도 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 한변도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우
: 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함) 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 75%미만으로 하락한 적이 있는 경우
: 원금 * (만기 기준지수 / 최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



만기 시 수익구조



KR603061ATB9 **교보증권(ELS)87**

[79-4] 메리츠주가지수연계사표8호

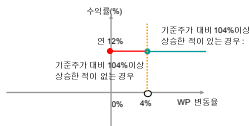
1. 계약금액

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

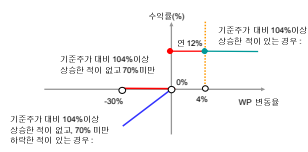
2. 만기시점의 수익구조

- 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 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

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)

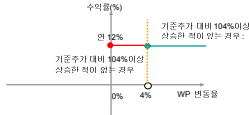
2. 만기시점의 손익구조

- 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

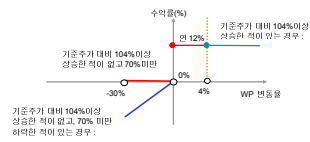
- 단, 만기시 (1차 상환일)까지 조기 상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격 이 한번도 기준가격의 65%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
 - 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008676TB7 코트님 신원증권(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 | 상위 |

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

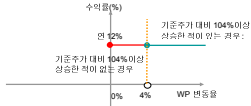
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 19일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 16일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도상환

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

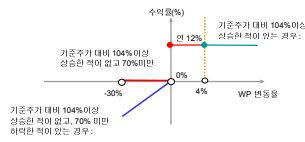
- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장중 포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



[79-7] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

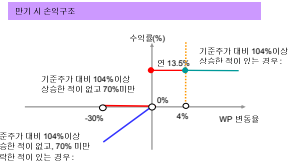
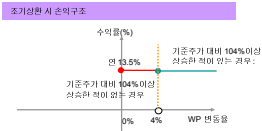
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 12월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 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%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 113.5%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기 준지수/최 초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조



KR6008675TC7 코트닉 신환증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

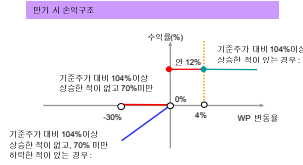
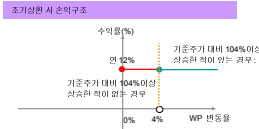
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 메리츠투자지수형계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

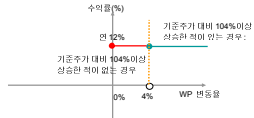
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

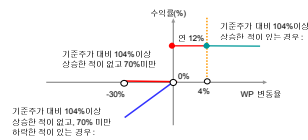
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 수익구조



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

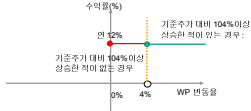
- 1) 참여대상종목의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지수 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한 번이라도 최초기준가격 대비 4% 이상 상승한 적이 있는 경우 12%의 수익률로 중도상환

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

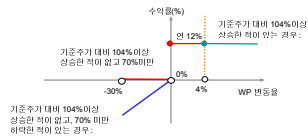
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의 65% 미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 + 11.2%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 + (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수업계약서표8호

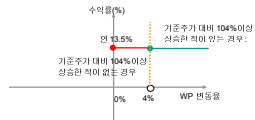
1. 계약금액

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

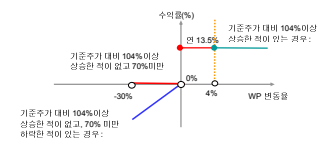
2. 만기시점의 손익구조

- 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 준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠투자지수형계사모8호

1. 계약금액

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

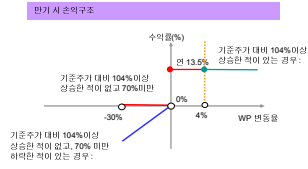
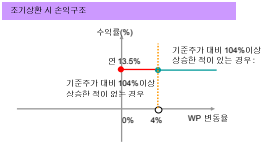
2. 만기시점의 손익구조

- 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



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

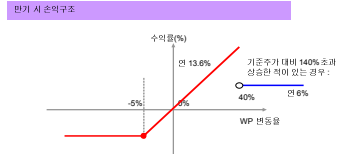
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산 :KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 3월 19일
- 3) 만드첨산 결정 주기: 만기 만 가일 1회
- 4) 기 존지 수: 2009년 3월 20일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기 존지 수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 140%를 초과하여 상승한 적이 없는 경우
 - 만기 평가지 수가 최초기 존가격 이상이고 최초기 존가격 의 140% 미만일 경우
: 원금 * (95% + 100% * (만기 기 존지 수 / 최초 기 존지 수 - 1))
 - 만기 평가지 수가 최초기 존가격 미만일 경우
: 원금 * 95%
- 기초자산(KOSPI200지수의 증가)의 가격이 최초기 존지 수 평가일 이후 만기 평가일까지 장중지수를 포함하여 최초 기준가격의 145%를 초과하여 상승한 적이 있는 경우
: 원금 * 100%
- 6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6523317W30 대우증권ELS2881

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------------|----------|---------|--------|------|-------|-------|------|------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67 | 25% | |
| 기초 자산 시나리오 | 8% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 5.33% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 2.67% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 0% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -5.33% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -8% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

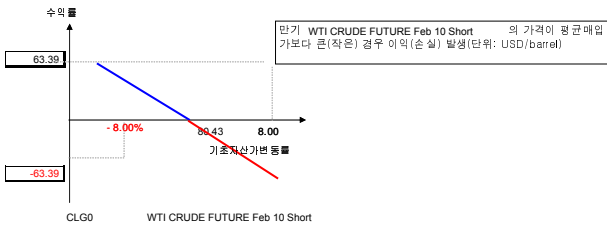
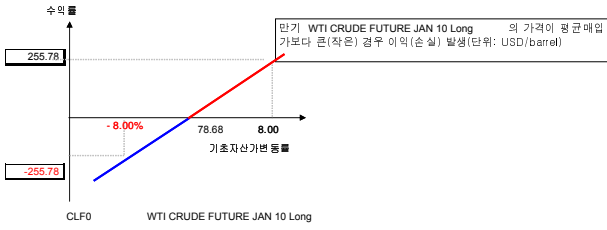
[80-1] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 51 | 0 | 51 | 장내 |

단위:계약

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLF0 WTI CRUDE FUTURE JAN 10 Long
CLG0 WTI CRUDE FUTURE Feb 10 Short

| 구분 | 시나리오 | |
|--------------|---------|---------|
| 기초자산 시나리오 | 8% | 319.17 |
| | 5.33% | 212.65 |
| | 2.67% | 106.52 |
| | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -106.52 |
| | -5.33% | -212.65 |
| -8% | -319.17 | |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|---------|
| 위험액 | -319.17 |

4. 매물상환의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 1,293 |
|-----|-------|

[80] 대리 조주가지 수연계사모증권10호

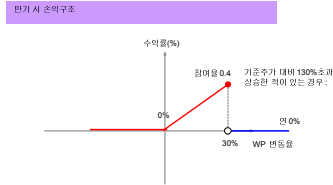
1. 계약금액

| 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

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6673105W54 동부증권-희미플러스(ELS)B1

손익 구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초지 | 8% | -26.16 | -33.44 | -38.71 | -43.98 | -49.26 | -54.53 | -59.81 |
| 산 | 5.33% | -10.93 | -16.20 | -21.48 | -26.75 | -32.02 | -37.30 | -42.57 |
| 시나리오 | 2.67% | 3.73 | -1.54 | -6.81 | -12.09 | -17.36 | -22.64 | -27.91 |
| 오 | 0% | 16.82 | 10.55 | 5.27 | 0.00 | -5.27 | -10.55 | -15.82 |
| | -2.67% | 25.34 | 20.06 | 14.79 | 9.52 | 4.24 | -1.03 | -6.31 |
| | -5.33% | 32.28 | 27.01 | 21.73 | 16.46 | 11.19 | 5.91 | 0.64 |
| | -8% | 36.65 | 31.38 | 26.10 | 20.83 | 15.56 | 10.28 | 5.01 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 5.01 |
|-----|------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 45.66 |
|-----|-------|

[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

1. 계약금액

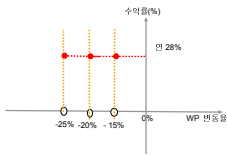
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액면(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 462.0 | 0 | 462.0 | 차입 |

단위:백만원

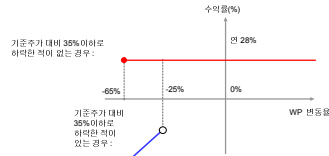
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 14일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 15일 삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자 보통주, 대우조선해양 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산의 종가로 각각 최초 기준가격의 85% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이 상한 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 원금 * 128%
 - 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 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 가능 금액) (단위:백만원)
KR6622309W55 표본증권(ELS)344

손익 구조변동률 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 60.11 | 47.44 | 34.77 | 22.11 | 9.44 | -3.23 | -15.90 |
| 손익 | 5.33% | 53.35 | 40.68 | 28.01 | 15.34 | 2.68 | -9.99 | -22.66 |
| 시나리오 | 2.67% | 45.98 | 33.31 | 20.64 | 7.97 | -4.69 | -17.36 | -30.03 |
| | 0% | 38.00 | 25.33 | 12.67 | 0.00 | -12.67 | -25.33 | -38.00 |
| | -2.67% | 29.42 | 16.75 | 4.09 | -3.68 | -21.25 | -33.92 | -46.58 |
| | -5.33% | 20.23 | 7.57 | -5.10 | -17.77 | -30.44 | -43.10 | -55.77 |
| | -8% | 10.44 | -2.23 | -14.90 | -27.56 | -40.23 | -52.90 | -65.56 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -65.56 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 57.73 |
|-----|-------|

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

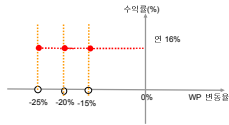
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 50.0 | 0 | 50.0 | 잔위 |

단위:백만원

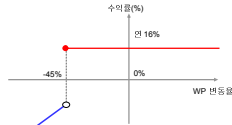
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 30일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 평균 * 118%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 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 |
|-----|------|

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호 [EL]

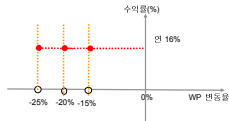
1. 계약금액

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

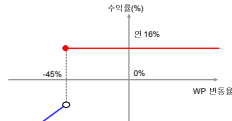
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG전자 보통주, 신한지주 보통주
- 2) 만기: 2012년 5월 25일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월
- 4) 기준지수: 2009년 5월 29일 LG전자 보통주, 신한지주 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 6개월마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(LG전자 보통주, 신한지주 보통주 주가)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기준으로 각각 최초 기준가격의 85%이상인 경우(첫번째 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 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 평균 * 11.6%
 - 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% | 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 |
|-----|------|

[94] 데리츠2Star사모증권HCSV-1

1. 계약금액

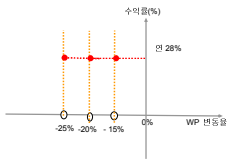
| 구분 | 기대대상 | 거래유형 | 액수(1) | 액수(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 833.3 | 0 | 833.3 | 차입 |

단위:백만원

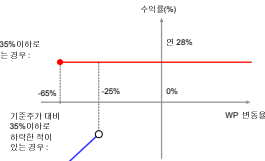
2. 만기시점의 손익구조

- 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 기초자산(기준으로 각각 최초 기준가액의 85%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일))만을 28%의 수익률로 중도 상환이 됨.
단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 런드 해지
- 두 기초자산의 가액이 환반드 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가액의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 128%
- 두 기초자산의 가액 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가액의 35%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 런드의 수익구조

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액(단위:백만원))
KR6622301W53 코브증권(ELS)336

손익 구조표본 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25% | -16.67% | -8.33% | 0 | 8.33% | 16.67% | 25% | |
| 기초자산 | 8% | 51.79 | 39.98 | 28.16 | 16.35 | 4.53 | -7.28 | -19.10 |
| 손익 | 5.33% | 47.72 | 35.90 | 24.09 | 12.27 | 0.46 | -11.36 | -23.17 |
| 시나리오 | 2.67% | 42.27 | 30.45 | 18.64 | 6.83 | -4.99 | -16.80 | -28.62 |
| | 0% | 35.44 | 25.63 | 11.81 | 0.00 | -11.88 | -23.63 | -35.44 |
| | -2.67% | 27.24 | 19.43 | 3.61 | -3.20 | -20.02 | -31.83 | -43.65 |
| | -5.33% | 17.67 | 5.85 | -5.96 | -17.78 | -29.59 | -41.41 | -53.22 |
| | -8% | 6.71 | -5.10 | -16.92 | -28.73 | -40.55 | -52.36 | -64.18 |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -64.18 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 66.14 |
|-----|-------|

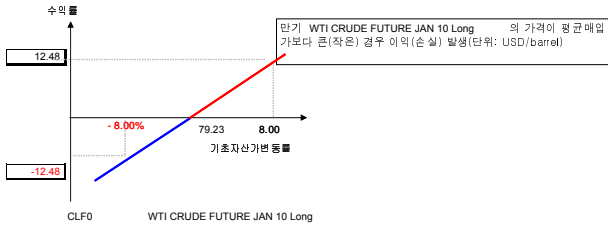
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익구조



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

CLF0 WTI CRUDE FUTURE JAN 10 Long

| 구분 | 시나리오 | 손익 |
|------|--------|--------|
| 기초자산 | 8% | 12.48 |
| | 5.33% | 8.31 |
| | 2.67% | 4.16 |
| 시나리오 | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -4.16 |
| | -5.33% | -8.31 |
| | -8% | -12.48 |

| 최대 손실 시나리오 | |
|------------|--------|
| 위험액 | -12.48 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|----|
| 위험액 | 50 |
|-----|----|

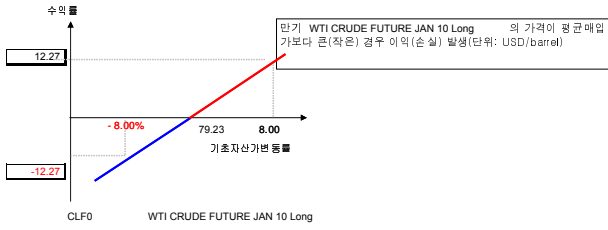
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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)

CLF0 WTI CRUDE FUTURE JAN 10 Long

| 구분 | 시나리오 | |
|------|--------|--------|
| 기초자산 | 8% | 45.48 |
| | 5.33% | 30.30 |
| | 2.67% | 15.18 |
| 시나리오 | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -15.18 |
| | -5.33% | -30.30 |
| | -8% | -45.48 |

| 최대 손실 시나리오 | |
|------------|--------|
| 위험액 | -45.48 |

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-----|
| 위험액 | 181 |
|-----|-----|

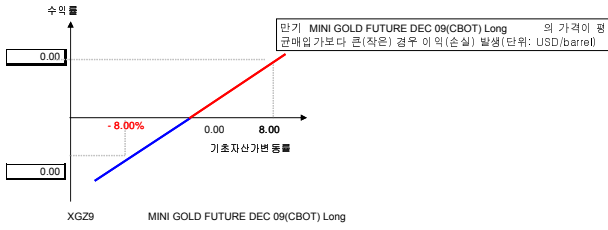
[96-2] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조

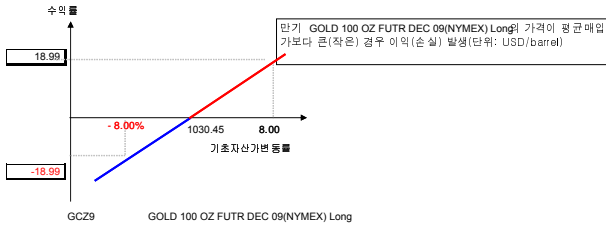


[96-3] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 연가시점의 손익 구조



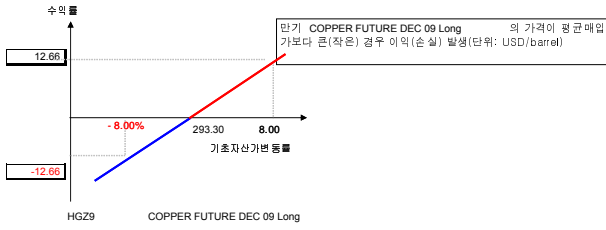
[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 연가시점의 손익 구조



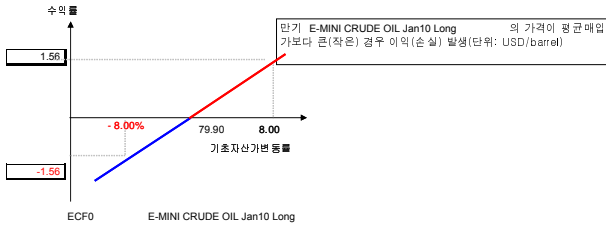
[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

단위:계약

2. 헷지시점의 손익 구조



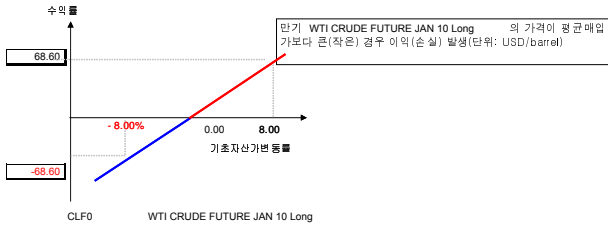
[97] 데리츠WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 11 | 0 | 11 | 장내 |

단위:계약

2. 연기사험의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLF0 WTI CRUDE FUTURE JAN 10 Long

| 구분 | 시나리오 | 손익 |
|------|--------|--------|
| 기초자산 | 8% | 68.60 |
| | 5.33% | 45.71 |
| | 2.67% | 22.90 |
| 시나리오 | 0% | 0.00 |
| | -2.67% | -22.90 |
| | -5.33% | -45.71 |
| | -8% | -68.60 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|--------|
| 위험액 | -68.60 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-----|
| 위험액 | 258 |
|-----|-----|