

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

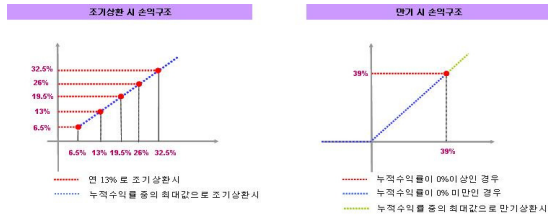
3) 펀드청산 결정 주기: 매 6개월

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(최대손실가능금액(단위:백만원))

KFR00690AT46 대우증권[ELS]1264

손익구조변동률 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
기초자산 시나리오	8%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
손익구조변동률 시나리오	-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
	-10.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[3] 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 3호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자 보통주, 우리금융지주 보통주

2) 만기: 2010년 07월 30일

3) 만드청산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(삼성전자, 우리금융지주 보통주)의 중도상환가액이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -16%(2차 중도상환일), -22%(3차 중도상환일), -28%(4차 중도상환일), -34%(5차 중도상환일), -40%(만기상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 중도상환됨. (누적수익률은 기초자산의 해당 단위 관할되는 수익률의 단순합계)

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

6) 만드의 수익구조



3. 손익 구조표본 및(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR6006903TR1 내부증권(ELS)1533

손익 구조표본 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	0.00
-----	------

4) 테리츠 클리켓 사모 단위파생상품투자신탁 4호

1. 계약금액

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

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: 한국전력 보통주, KT&G 보통주

2) 만기: 2010년 08월 30일

3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

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

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

6) 권드의 수익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6037627198 비례예상증권(ELS)210

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	-0.01
-----	-------

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	잔의

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, 최초기준가액 보다 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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600348RT28 비파생상품(ELS) 2007-3974

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	324.13	318.64	313.15	307.67	302.18	296.69	291.20
	5.33%	221.58	216.09	210.60	205.11	199.62	194.13	188.65
	2.67%	119.02	113.53	108.04	102.56	97.07	91.58	86.09
	0%	16.47	10.98	5.49	0.00	-5.49	-10.98	-16.47
	-2.67%	-86.09	-91.58	-97.07	-102.56	-108.04	-113.53	-119.02
	-8.33%	-188.65	-194.13	-199.62	-205.11	-210.60	-216.09	-221.58
	-8%	-291.20	-296.69	-302.18	-307.67	-313.15	-318.64	-324.13

최대 손실 시나리오

위험액	-324.13
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	322.61
-----	--------

[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

연말 11.2%의 수익률로 중도 상환이 됨.

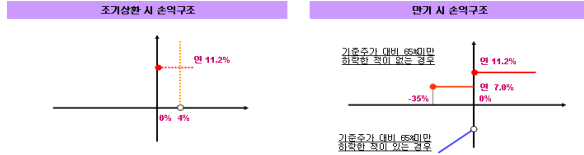
단, 연가시점까지 조기상환 조건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

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

- 두 기초자산의 가격(중도포함)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 환비 운용 (ELS) 2007~398회

수익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%
기초자산 시나리오	8%	31.03	30.50	29.97	29.45	28.92	28.40	27.87
	5.33%	21.21	20.68	20.16	19.63	19.11	18.58	18.06
	2.67%	11.39	10.87	10.34	9.82	9.29	8.77	8.24
	0%	1.58	1.05	0.53	0.00	-0.53	-1.05	-1.58
	-2.67%	-8.24	-8.77	-9.29	-9.82	-10.34	-10.87	-11.39
	-5.33%	-18.06	-18.58	-19.11	-19.63	-20.16	-20.68	-21.21
	-8%	-27.87	-28.40	-28.92	-29.45	-29.97	-30.50	-31.03

최대 손실 시나리오

위험액	-31.03
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	30.68
-----	-------

[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

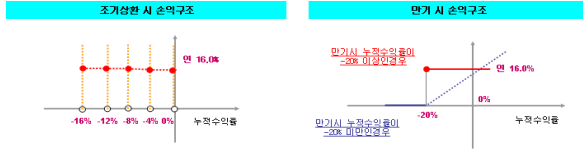
3) 만기점산 결정주기: 매 6개월

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 초기 상환 설정일에 0%(1차 중도상환일), -4%(2차 중도상환일), -8%(3차 중도상환일), -12%(4차 중도상환일), -16%(5차 중도상환일), -20%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 16.0%로 중도상환됨.
(누적 수익률은 기초자산의 매월 단위 관측되는 수익률의 단순합계)

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

6) 펀드의 수익구조



3. 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 글러벡 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

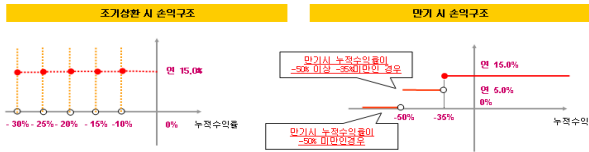
3) 만도침산 결정주기: 매 6개월

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

5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(국민은행, 한국전력 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 기초자산의 누적수익률이 조기상환 결정일에 -10%(1차 중도상환일), -15%(2차 중도상환일), -20%(3차 중도상환일), -25%(4차 중도상환일), -30%(5차 중도상환일), -35%(6차 중도상환일) 이상인 경우 연 15.0%로 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 누적수익률이 -50%이상 -35% 미만인 경우: 15%의 수익률로 상환
만기 평가일의 누적수익률이 -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%	1.03	0.98	0.93	0.88	0.83	0.78	0.73
시나리오	5.33%	0.72	0.67	0.62	0.57	0.52	0.47	0.42
	2.67%	0.42	0.37	0.32	0.28	0.23	0.18	0.13
	0%	0.15	0.10	0.06	0.00	-0.05	-0.10	-0.15
	-2.67%	-0.11	-0.16	-0.21	-0.26	-0.31	-0.36	-0.41
	-5.33%	-0.35	-0.40	-0.45	-0.50	-0.55	-0.60	-0.65
	-8%	-0.58	-0.63	-0.68	-0.73	-0.77	-0.82	-0.87

최대 손실 시나리오

위험액	-0.87
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	1.88
-----	------

[15] 데리츠 Step Down 단위 파생상품투자신탁 15호

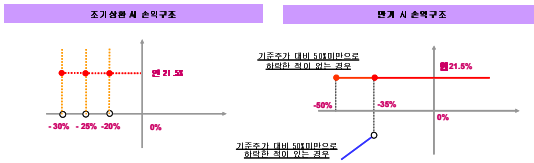
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR600345EV11 최대 손위(ELS)2008=647

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
기초자산 시나리오	8%	316.28	308.43	300.58	292.73	284.88	277.03	269.18
	5.33%	222.07	214.22	206.37	198.52	190.67	182.82	174.97
	2.67%	124.49	116.64	108.79	100.94	93.09	85.24	77.39
	0%	29.58	19.70	7.85	0.00	-7.85	-19.70	-29.58
	-2.67%	-80.76	-88.61	-96.45	-104.30	-112.15	-120.00	-127.85
-5.33%	-188.42	-196.27	-204.12	-211.97	-219.82	-227.67	-235.52	
-8%	-299.46	-307.30	-315.15	-323.00	-330.85	-338.70	-346.55	

최대 손실 시나리오

위험액	-346.55
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	371.34
-----	--------

[17]테리 조StepDown사모단위 편성26호

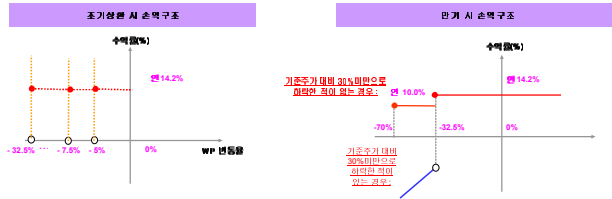
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 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, 만기시 까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 환펀드 기준가격의 30%미만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 67.5%보다 작은 경우 : 원금 * 130%
 - 두 기초자산의 가격(상중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 30%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))

KR600867BTO 코루남신한동원(ELS)803

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	229.33	206.56	183.78	161.00	138.23	115.45	92.68
	5.33%	175.23	152.45	129.68	106.90	84.13	61.35	38.58
	2.67%	121.56	96.79	76.01	53.24	30.46	7.69	-15.09
	0%	68.33	49.56	29.78	0.00	-22.71	-43.58	-69.35
	-2.67%	15.52	-7.25	-30.03	-52.80	-75.58	-98.35	-121.13
-5.33%	-36.85	-59.62	-82.40	-105.17	-127.95	-150.72	-173.50	
-8%	-88.79	-111.56	-134.34	-157.11	-179.89	-202.66	-225.44	

최대 손실 시나리오

위험액	-225.44
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	225.93
-----	--------

[18]테리츠 TOUCH사모단위파생 1호

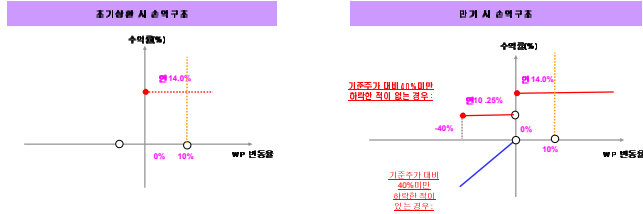
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 수익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주
- 2) 만기: 2010년 1월 15일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기준지수: 2008년 1월 15일 LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주의 종가
- 5) 발행 후 매 3개월 마다 중도상환 기한을 설정하고, 기초자산(LG 보통주, SK HOLDINGS 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산 기준으로 각각 최초기준가격 이상이거나 또는 평가기간 중 상종포함하여 환번이라도 최초기준가격 대비 10%이상 상승한 적이 있을 경우 연 14%의 수익률로 중도상환
단, 만기시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
- 두 기초자산의 가격이 환번도 기준가격의 60%이만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 120.5%
- 두 기초자산의 가격(상종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 60%이만 하락한 적이 있는 경우: 원금 * (만기기준지수/초기기준지수)
6) 펀드의 수익구조



3. 수익구조변동(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6030617V18 표보증권(ELS)121회

구분	수익률							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	61.01	60.18	59.35	58.52	57.70	56.87	56.04	
시나리오	5.33%	41.50	40.68	39.85	39.02	38.19	37.36	
	2.67%	22.00	21.17	20.34	19.51	18.68	17.85	
	0%	2.49	1.66	0.83	0.00	-0.83	-1.66	
	-2.67%	-17.02	-17.85	-18.68	-19.51	-20.34	-21.17	
	-5.33%	-36.53	-37.36	-38.19	-39.02	-39.85	-40.68	
	-8%	-56.04	-56.87	-57.70	-58.52	-59.35	-60.18	

최대 손실 시나리오	위험액	56.04
------------	-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	60.78
-----	-------

[19]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트5호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 수익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 1월 24일

3) 펀드청산결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 1월 25일KOSPI200의 증가

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

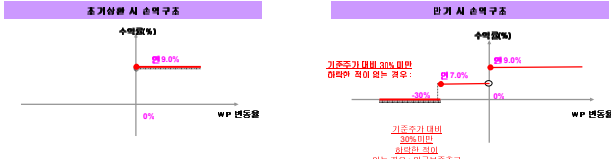
단, 평가시점에 조기상환조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 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	5.33%	43.62	41.39	39.15	36.91	34.68	32.44	30.21
손익	2.67%	25.96	23.73	21.49	19.26	17.02	14.79	12.55
시나리오	0%	6.71	4.47	2.24	0.00	-2.24	-4.47	-6.71
	-2.67%	-4.15	-16.36	-13.62	-20.89	-23.09	-25.33	-27.56
	-5.33%	-16.60	-36.84	-41.07	-45.31	-49.54	-53.78	-58.01
	-8%	-60.65	-62.89	-65.12	-67.36	-69.59	-71.83	-74.06

최대 손실 시나리오

위험액	46.27
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	80.13
-----	-------

[20]테리 조지 수연계 사모단위 퍼센트 6호

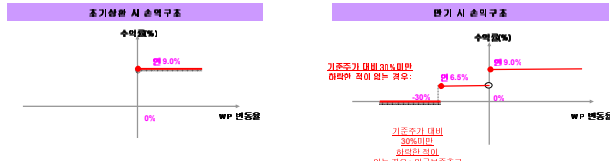
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 평가시점의 손익구조

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액 (단위: 백만원))

KR603762OV23 비례예정증권(ELS)306

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%	
8%	38.70	37.09	35.48	33.87	32.26	30.65	29.04	
5.33%	28.69	27.08	25.47	23.86	22.25	20.64	19.03	
2.67%	17.40	15.79	14.18	12.57	10.96	9.35	7.74	
0%	4.83	3.22	1.61	0.00	-1.61	-3.22	-4.83	
-2.67%	-9.02	-10.63	-12.24	-13.85	-15.46	-17.07	-18.68	
-5.33%	-24.15	-25.76	-27.37	-28.98	-30.59	-32.20	-33.81	
-8%	-40.56	-42.17	-43.78	-45.39	-47.00	-48.61	-50.22	

최대 손실 시나리오

위험액	29.04
-----	-------

4. 거래상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	51.41
-----	-------

[2] 메리츠주요사업부문평가서도면허사항7호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 평가시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산:KOSPI200지수

2) 평가: 2011년 2월 21일

3) 펀드청산 결정주기: 매 6개월

4) 기준지수: 2008년 2월 22일 KOSPI200의 증가

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

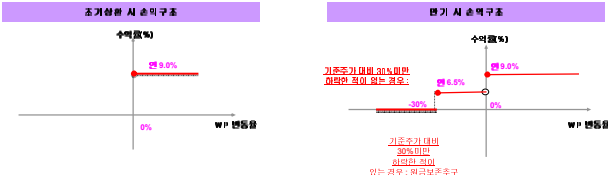
단, 평가시까지 조기상환 조건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지

- 두 기초자산의 가격이 환반도 기준가격의 70%미만 하락한 적이 없고, 최초기준가격보다 작은 경우: 원금 * 119.5%

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

: 원금*100%

6) 펀드의 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	30.10	28.65	27.59	26.34	25.09	23.84	22.58
손익	2.23	21.06	19.81	18.56	17.30	16.05	14.80
손익	1.35	12.28	11.03	9.78	8.52	7.27	6.02
손익	3.76	2.50	1.25	0.00	-1.25	-2.50	-3.76
손익	-7.02	-8.27	-9.52	-10.77	-12.02	-13.28	-14.53
손익	-18.78	-20.03	-21.28	-22.54	-23.79	-25.04	-26.30
손익	-31.55	-32.80	-34.05	-35.30	-36.55	-37.81	-39.06

최대손실 시나리오

위험액	22.58
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.99
-----	-------

[28] 매리츠월중지수연계사모파생1호

1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

1) 장외파생상품의 기초자산: NIKKEI225, HSCEI지수

2) 만기: 2010년 08월 04일

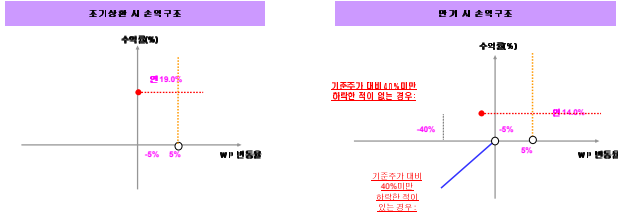
3) 펀드청산 결정 주기: 매 3개월

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR600594WV82 무리투자증권(ELS)2118

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산 시나리오	8%	145.63	139.87	134.11	128.34	122.58	116.81	111.05
	5.33%	101.15	95.39	89.62	83.86	78.09	72.33	66.57
	2.67%	56.37	52.61	46.84	41.08	35.31	29.55	23.79
	0%	17.29	11.53	5.76	0.00	-5.76	-11.53	-17.29
	-2.67%	-22.08	-27.85	-33.61	-39.38	-45.14	-50.91	-56.67
-5.33%	-59.76	-65.52	-71.29	-77.05	-82.82	-88.58	-94.35	
-8%	-95.74	-101.50	-107.26	-113.03	-118.79	-124.56	-130.32	

최대 손실 시나리오

위험액	-130.32
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	132.40
-----	--------

[34] 대리 조주가지 수익계 파생13

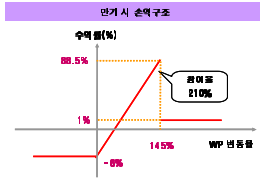
1. 계약금액

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



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

손익구조변동 시나리오

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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[48] 데리츠2Star사모파생상품G-1호

1. 계약금액

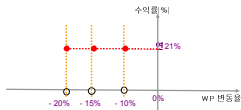
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	238	0	238	잔위

단위: (백만원)

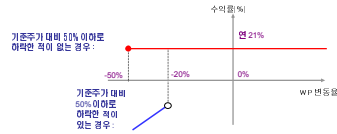
2. 만기시점의 손익구조

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

초기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 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%	-5.00	-5.60	-6.21	-6.82	-7.42	-8.03	-8.64
초	5.33%	-1.67	-2.46	-3.09	-3.69	-4.30	-4.91	-5.52
자	2.67%	0.40	-0.21	-0.82	-1.42	-2.03	-2.64	-3.24
산	0%	1.82	1.21	0.61	0.00	-0.61	-1.21	-1.82
시	-2.67%	2.39	1.79	1.18	0.57	-0.03	-0.64	-1.25
나	-5.33%	2.12	1.51	0.90	0.30	-0.31	-0.92	-1.52
리	-8%	0.99	0.39	-0.22	-0.83	-1.43	-2.04	-2.65

최대 손실 시나리오

위험액	-2.65
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	3.25
-----	------

[67] 데리츠2Star사모증권SEST-1

1. 계약금액

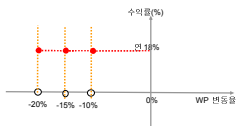
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1027.1	0	1,027	잔위

단위(백만원)

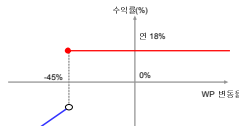
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90%이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(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%	
기초자산	8%	-1.32	-3.46	-5.64	-7.80	-9.97	-12.13	-14.29
시나리오	5.33%	3.15	0.98	-1.16	-3.34	-5.50	-7.67	-9.83
	2.67%	5.75	3.59	1.42	-0.74	-2.90	-5.06	-7.23
	0%	6.48	4.33	2.16	0.00	-2.16	-4.33	-6.48
	-2.67%	5.36	3.20	1.04	-1.04	-3.20	-5.36	-7.51
	-5.33%	2.38	0.22	-1.95	-4.11	-6.27	-8.43	-10.60
	-8%	-2.47	-4.63	-6.79	-8.96	-11.12	-13.28	-15.44

최대 손실 시나리오

위험액	-15.44
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	11.23
-----	-------

[76] 데리츠2Star사모SEST-2

1. 계약금액

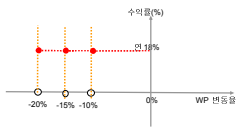
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	565.0	0	565	차입

단위: (백만원)

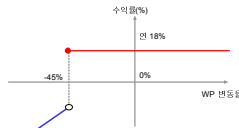
2. 만기시점의 손익구조

- 1) 장외파생상품의 기초자산: 삼성전자, SK텔레콤
- 2) 만기: 2012년 3월 26일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매6개월
- 4) 기준지수: 2009년 3월 27일 삼성전자, SK텔레콤의 증가
- 5) 발행 후 매 6개월 마다 중도상환 기간을 설정하고, 기초자산(삼성전자, SK텔레콤 보통주)의 중도상환가격이 낮은 기초자산기 준으로 각각 최초 기준가격의 90% 이상인 경우(첫번째, 두번째 중도상환일) 85% 이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 80% 이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 8%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못할 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격 모두 최초기준가격의 55%보다 이상인 경우 : 평균 * 118%
 - 만기상환일정일에 두 기초자산의 가격(장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55% 미만인 경우 : 평균 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조변동 등(최대 손실 가능금액 (다위:백만원))

KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

손익 구조변동 시나리오

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67	25%
8%		-0.72	-1.91	-3.10	-4.29	-5.48	-6.67	-7.86
5.33%		1.73	0.54	-0.65	-1.84	-3.03	-4.22	-5.41
2.67%		3.16	1.97	0.78	-0.41	-1.60	-2.79	-3.98
0%		3.57	2.38	1.19	0.00	-1.19	-2.38	-3.57
-2.67%		2.95	1.76	0.57	-0.62	-1.81	-3.00	-4.19
-5.33%		1.31	0.12	-1.07	-2.26	-3.45	-4.64	-5.83
-8%		-1.36	-2.55	-3.74	-4.93	-6.12	-7.31	-8.50

최대 손실 시나리오

위험액	-8.50
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위:백만원)

위험액	6.18
-----	------

[77] 데리츠2SIa사모SEST-3

1. 계약금액

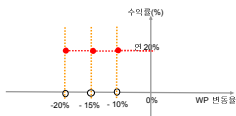
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241.4	0	241	차입

단위(백만원)

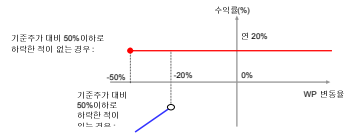
2. 평가시점의 손익구조

- 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 기준가격의50%이므로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 75%보다 작은 경우 : 평균 * 120%
- 두 기초자산의 가격 (장종료함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격의 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 (다위·백만원))

KR6562345W35 유인투기증권 (ELS)2382

손익 구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초지	8%	-1.26	-1.63	-2.36	-2.92	-3.47	-4.02	-4.57
	5.33%	0.24	-0.31	-0.86	-1.40	-1.95	-2.50	-3.04
시나리오	2.67%	1.21	0.67	0.12	-0.43	-0.98	-1.52	-2.07
	0%	1.64	1.09	0.55	0.00	-0.55	-1.09	-1.64
	-2.67%	1.52	0.98	0.43	-0.12	-0.66	-1.21	-1.76
	-5.33%	0.86	0.31	-0.24	-0.76	-1.33	-1.88	-2.42
	-8%	-0.35	-0.90	-1.45	-1.99	-2.54	-3.09	-3.63

최대 손실 시나리오

위험액	-3.63
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (다위·백만원)

위험액	4.04
-----	------

[79-1] 메리츠주가지수연계사모8호

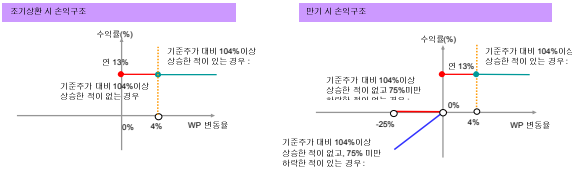
1. 계약금액

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

단위: (백만원)

2. 평가시점의 수익구조

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



KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

3. 수익구조변동률(최대손실가능금액(단위:백만원))

메리츠주가지수연계사모8호

수익구조변동률 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-1.67%	-8.33%	0	8.33%	1.67%	25%	
기초자산	8%	10,437.74	10,088.28	9,738.81	9,389.35	9,039.88	8,690.41	8,340.95
	5.33%	7,226.46	6,877.00	6,527.53	6,178.07	5,828.60	5,479.13	5,129.67
시나리오	2.67%	4,096.68	3,747.22	3,397.75	3,048.28	2,698.82	2,349.35	1,999.88
	0%	1,048.40	698.93	349.47	0.00	-300.00	-650.53	-1,001.06
시나리오	-2.67%	-1,918.39	-2,267.85	-2,617.32	-2,966.78	-3,316.25	-3,665.72	-4,015.18
	-5.33%	-4,803.67	-5,153.14	-5,502.60	-5,852.07	-6,201.54	-6,551.00	-6,900.47
	-8%	-7,607.46	-7,956.93	-8,306.39	-8,655.86	-9,005.32	-9,354.79	-9,704.26

최대손실 시나리오

위험액	-9,704.26
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9,941.76
-----	----------

[79-2] **메리츠주가지수연계사표8호**

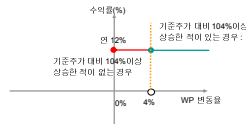
1. 계약금액

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

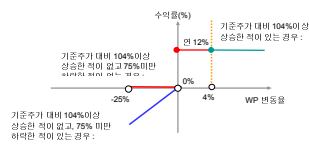
2. 만기시점의 손익구조

- 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

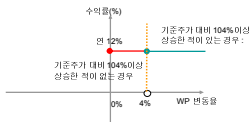
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6000.0	0	5,000	잔액

단위: 백만원

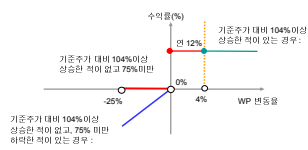
2. 평가시점의 손익구조

- 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%이만으로 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

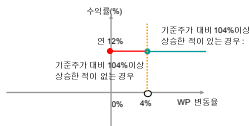
1. 계약금액

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

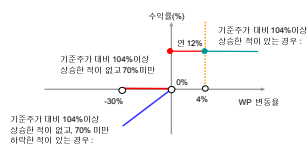
2. 만기시점의 수익구조

- 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 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

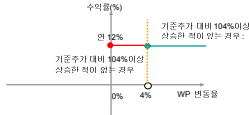
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 10일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

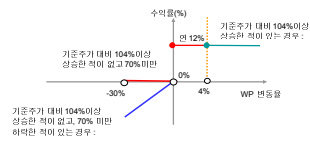
- 두 기초자산의 가격이 동반도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 10%보다 작은 경우 : 원금 * 11.2%
- 두 기초자산의 가격 (장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기 기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6008676TB7 곳모닝 신한증권(ELS)797

[79-6] 메리츠주가지수연계사표8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

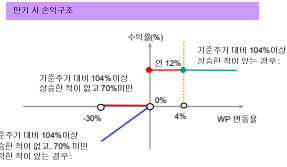
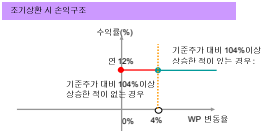
2. 만기시점의 손익구조

- 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



[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

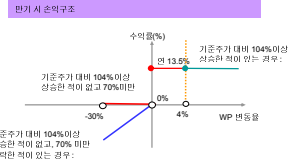
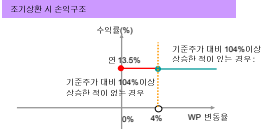
단위(백만원)

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

6) 펀드의 수익구조



KR6008675TC7 코트닉 신원증권(ELS)809

[79-8] 메리츠주가지수연계사모8호

1. 계약금액

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

단위(백만원)

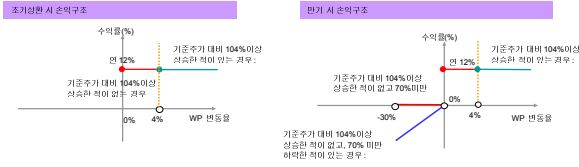
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

[79-9] 메리츠투자지수형계사모8호

1. 계약금액

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

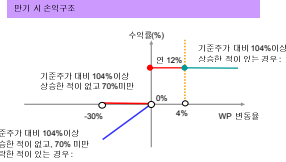
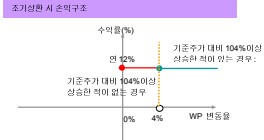
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 08일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매 3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 08일 KOSPI200지수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지수)이 조기 상환결정일에 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 한번도 기준가격의 65%이상으로 하락한 적이 없고, 최초기 준가격의 100%보다 작은 경우
 : 원금 * 11.2%
 - 두 기초자산의 가격 (중도포함)중 어느 하나라도 각각의 기 준가격 의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우
 : 원금 * (만기 기준지수/최초기 준지수)

6) 펀드의 수익구조



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. 만기시점의 손익구조

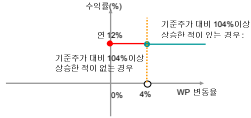
- 1) 참여대상상품의 기초자산: KOSPI200지수
- 2) 만기: 2010년 11월 18일
- 3) 펀드청산 결정주기: 매3개월
- 4) 기 준지수: 2007년 11월 18일 KOSPI200지 수의 증가
- 5) 발행 후 매 3개월마다 중도상환기 간을 설정하고, 기초자산(KOSPI200지 수)이 조기 상환결정일에 최초기준가격 이상이거나 또는 만기기간 중 집중포함하여 한번이라도 최초기준가격 대비 4%이상 상승한 적이 있는 경우 연 12%의 수익률로 중도 상환

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

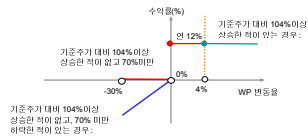
- 두 기초자산의 가격 이 환반도 기준가격의65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의100%보다 작은 경우 : 원금 * 112%
- 두 기초자산의 가격(장종포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)

6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

[79-11] 에리츠주가지수업계약서표8호

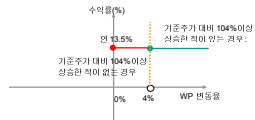
1. 계약금액

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

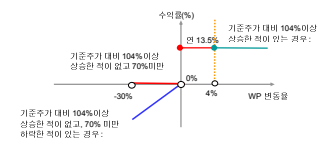
2. 만기시점의 손익구조

- 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 할빈도 기준가격의 65%이만으로 하락한 적이 없고, 최초기준가격의 100%보다 작은 경우 : 원금 * 113.5%
 - 두 기초자산의 가격 (장중포함)중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 70%미만으로 하락한 적이 있는 경우 : 원금 * (만기기준지수/최초기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

[79-12] 메리츠투자지수연계사모8호

1. 계약금액

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

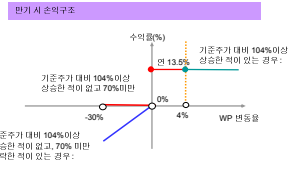
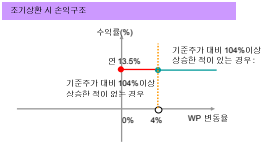
2. 만기시점의 손익구조

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

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

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

6) 펀드의 수익구조



KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

[82] 대리 조주가지 수연계 사모증권5호

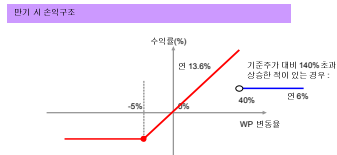
1. 계약금액

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

단위:백만원

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조인 톱(최대 손실 가능금액) (단위:백만원)

KR6523317W30 대우증권ELS2881

손익 구조변동 시나리오

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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

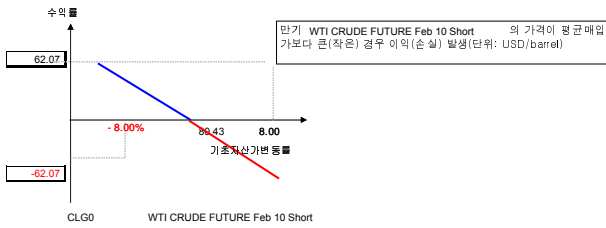
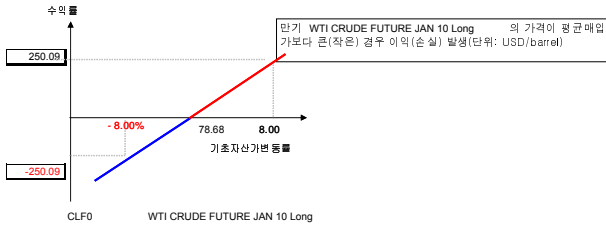
[80-1] 테리츠 WTI Index 사모특별 1호

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%	312.16
	5.33%	207.98
	2.67%	104.18
	0%	0.00
	-2.67%	-104.18
	-5.33%	-207.98
-8%	-312.16	

최대손실 시나리오	
위험액	-312.16

4. 매물상환의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,264
-----	-------

[80] 대리 조주가지 수연계 사모증권 10호

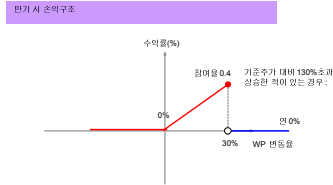
1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

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



3. 손익 구조의 범위(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%	-27.06	-32.72	-38.35	-43.99	-49.63	-55.27	-60.90
산	5.33%	-9.60	-15.23	-20.87	-26.51	-32.15	-37.79	-43.42
시나리오	2.67%	5.07	-0.57	-6.21	-11.85	-17.48	-23.12	-28.76
오	0%	16.91	11.28	5.64	0.00	-5.64	-11.28	-16.91
	-2.67%	25.94	20.30	14.67	9.03	3.39	-2.25	-7.88
	-5.33%	32.15	25.52	20.88	15.24	9.60	3.96	-1.67
	-8%	35.55	29.91	24.27	18.63	13.00	7.36	1.72

최대 손실 시나리오

위험액	1.72
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	44.73
-----	-------

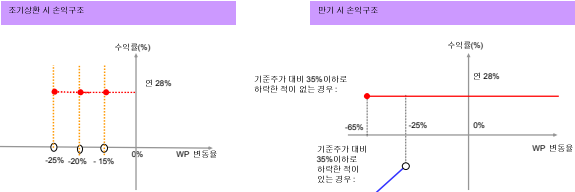
[88] 데리츠2Star사모증권SEDM-1호

1. 계약금액

단위(백만원)						
구분	기래대상	거래유형	액수(1)	액면(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 환반도 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



3. 수익 구조의 리스크(최대 손실 가능금액)(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%	60.80	46.33	35.86	23.39	10.92	-1.55	-14.02
손실	5.33%	53.59	41.12	28.65	16.17	3.70	-8.77	-21.24
시나리오	2.67%	45.79	33.32	20.85	8.38	-4.09	-16.56	-29.04
	0%	37.41	24.98	12.47	0.00	-12.47	-24.98	-37.41
	-2.67%	28.45	15.96	3.51	-8.96	-21.43	-33.90	-46.37
	-5.33%	18.91	6.44	-6.03	-18.50	-30.97	-43.44	-55.92
	-8%	8.79	-3.68	-16.15	-28.62	-41.10	-53.57	-66.04

최대 손실 시나리오

위험액	-66.04
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	59.53
-----	-------

[9] 데리츠2Star사로증권LESH-2호[EL]

1. 계약금액

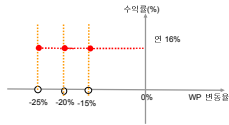
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액수(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	50.0	0	50.0	잔위

단위:백만원

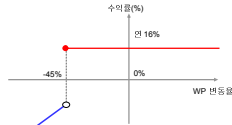
2. 만기시점의 손익구조

- 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, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 평균 * 118%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조의 범위(최대 손실 가능금액)(단위:백만원)

KR6522308W66 대우증권ELS2998

손익 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
-----	------

[92] 데리츠2Star사로증권LESH-1호[EL]

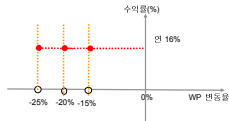
1. 계약금액

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

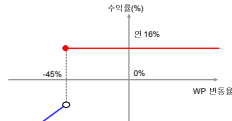
2. 만기시점의 손익구조

- 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, 두번째 중도상환일) 80%이상인 경우(세번째, 네번째 중도상환일), 75%이상인 경우(다섯번째 중도상환일) 연율 18%의 수익률로 중도 상환이 됨.
 단, 만기시 까지 조기상환 요건을 충족하지 못한 경우 아래의 수익 확정 후 펀드 해지
 - 두 기초자산의 가격이 기준가격의 55%이상인 경우
 : 평균 * 118%
 - 두 기초자산의 가격 중 어느 하나라도 각각의 기준가격의 55%미만인 경우
 : 평균 * (만기 기준지수/최초 기준지수)
- 6) 펀드의 수익구조

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



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

손익 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

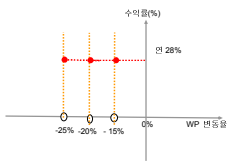
구분	거래대상	거래유형	액수(1)	액면(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	833.3	0	833.3	차입

단위: 백만원

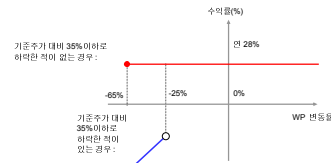
2. 만기시점의 손익구조

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

조기상환 시 손익구조



만기 시 손익구조



3. 손익 구조표현 및(최대 손실 가능금액 (단위:백만원))
KR6622301WES3 코보증권(ELS)336

손익 구조표현 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25%	-16.67%	-8.33%	0	8.33%	16.67%	25%	
기초자산	8%	54.03	41.98	29.92	17.87	5.82	-6.24	-18.29
손익	5.33%	49.47	37.42	25.36	13.31	1.26	-10.80	-22.85
손익	2.67%	43.51	31.46	19.41	7.35	-4.70	-16.75	-28.81
손익	0%	36.16	24.11	12.05	0.00	-12.05	-24.11	-36.16
손익	-2.67%	27.41	15.36	3.30	-6.75	-20.80	-32.86	-44.91
손익	-5.33%	17.26	5.21	-6.85	-18.90	-30.95	-43.01	-55.06
손익	-8%	5.71	-6.34	-18.39	-30.45	-42.50	-54.55	-66.61

최대 손실 시나리오

위험액	-66.61
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	57.01
-----	-------

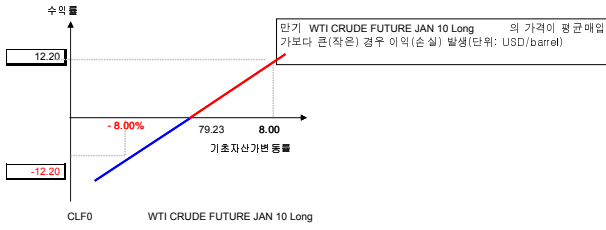
[96] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

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)

CLF0 WTI CRUDE FUTURE JAN 10 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	12.20
	5.33%	8.13
	2.67%	4.07
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-4.07
	-5.33%	-8.13
	-8%	-12.20

최대손실 시나리오	
위험액	-12.20

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	49
-----	----

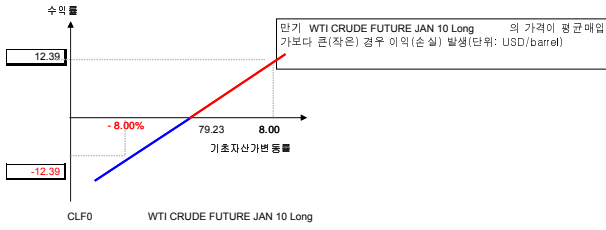
[96-1] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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	손익
기초자산	8%	45.40
	5.33%	30.25
	2.67%	15.15
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-15.15
	-5.33%	-30.25
	-8%	-45.40

최대 손실 시나리오	
위험액	-45.40

4. 해당 상품의 최대 손실 예상금액 (단위: 백만원)

위험액	181
-----	-----

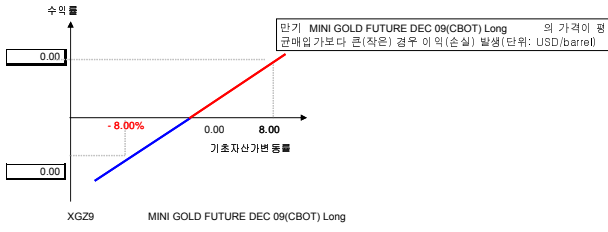
[96-2] 데리브 프리미엄 Commodity 특별 자산1

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

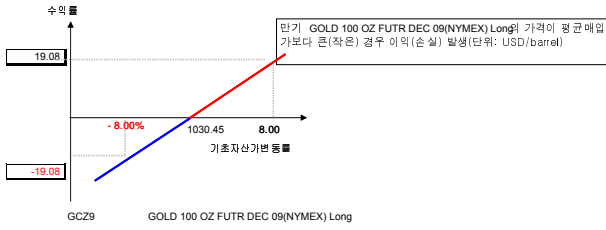


[96-3] 헤지츠 Premium Commodity 특별 자산1

1. 계약 요약

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

2. 헷지시점의 손익 구조

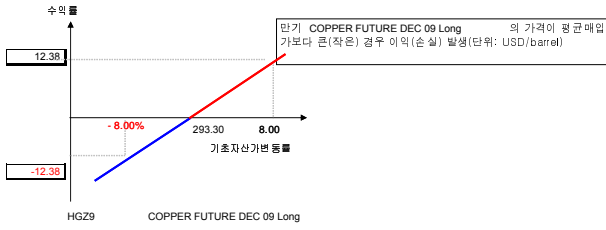


[96-4] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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



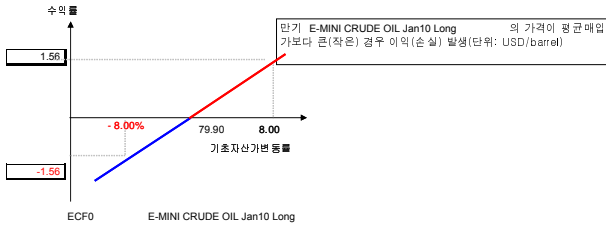
[96-5] 데리츠 Premium Commodity 특별 자산1

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

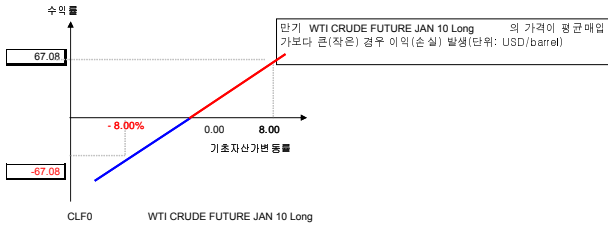


[97] 데리즈WTIindex특별자산1호[원유_파생형]모

1. 계약금액

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

2. 연기사험의 손익구조



3. 손익 구조변동(최대손실가능금액) (단위:1,000 USD)

CLF0 WTI CRUDE FUTURE JAN 10 Long

구분	시나리오	손익
기초자산	8%	67.08
	5.33%	44.69
	2.67%	22.39
시나리오	0%	0.00
	-2.67%	-22.39
	-5.33%	-44.69
	-8%	-67.08

최대손실 시나리오	
위험액	-67.08

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	253
-----	-----