

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠클리켓단위파생5호

공시일: 2010-07-27

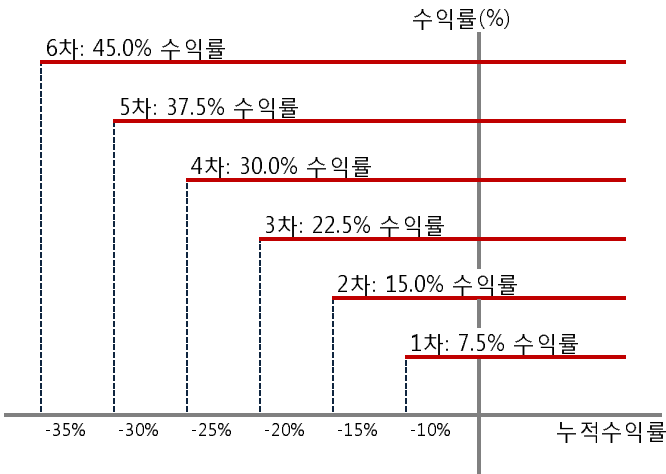
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,674	0	1,674	장외

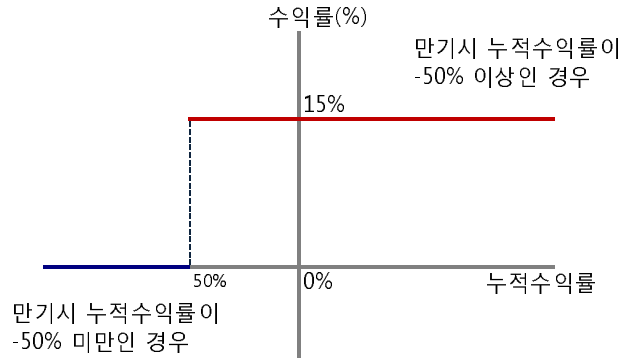
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
자산	5.33%	0.00	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	0.00
	0.00%	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
	-8.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR603762CT80	미래에셋증권(ELS)191	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

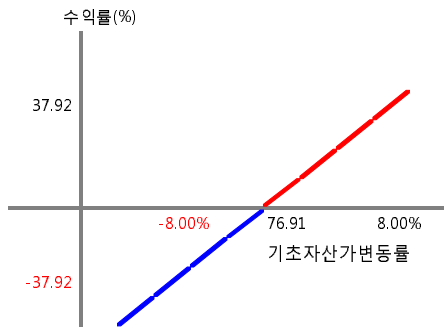
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

단위(백만원)

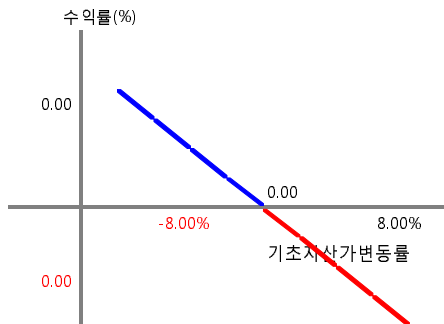
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내

2. 만기시점의 손익구조



기초자산의 만기가격이 평균매입가보다 큰(작은) 경우 이익(손실) 발생(단위: USD/barrel)

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long



기초자산의 만기가격이 평균매입가보다 큰(작은) 경우 이익(손실) 발생(단위: USD/barrel)

3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나 리오	8.00%	37.92
	5.33%	25.26
	2.67%	12.65
	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.65
	-5.33%	-25.26
	-8.00%	-37.92

최대손실 시나리오

위험액	-37.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	153.60
-----	--------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

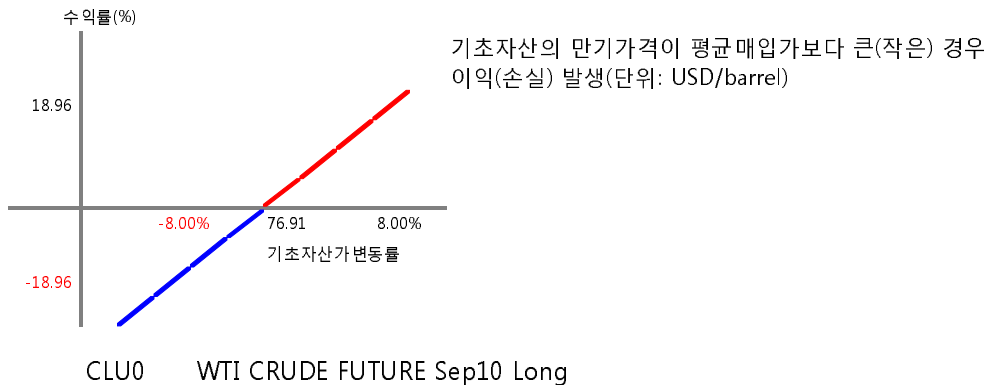
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	37.92
	5.33%	25.26
	2.67%	12.65
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.65
	-5.33%	-25.26
	-8.00%	-37.92

최대손실 시나리오

위험액	-37.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	100.56
-----	--------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

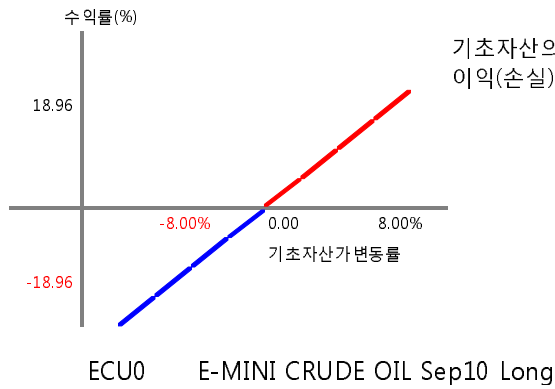
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

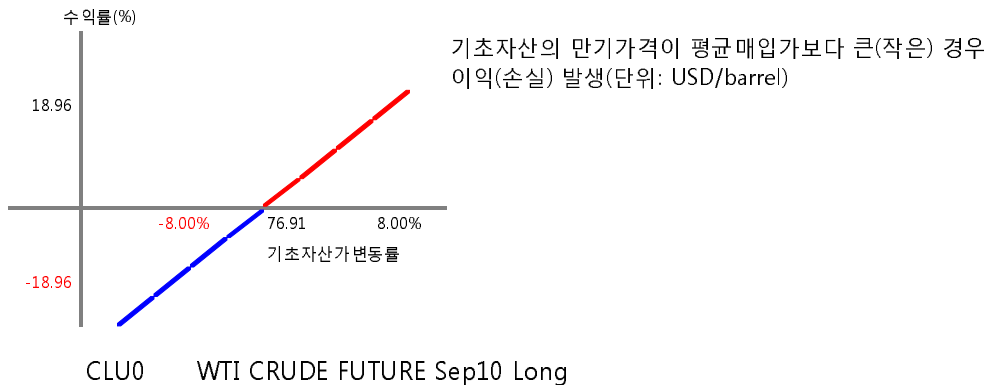
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	47.77
	5.33%	31.83
	2.67%	15.94
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-15.94
	-5.33%	-31.83
	-8.00%	-47.77

최대손실 시나리오

위험액 -47.77

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 190.03

메리츠PremiumCommodity특별자산1

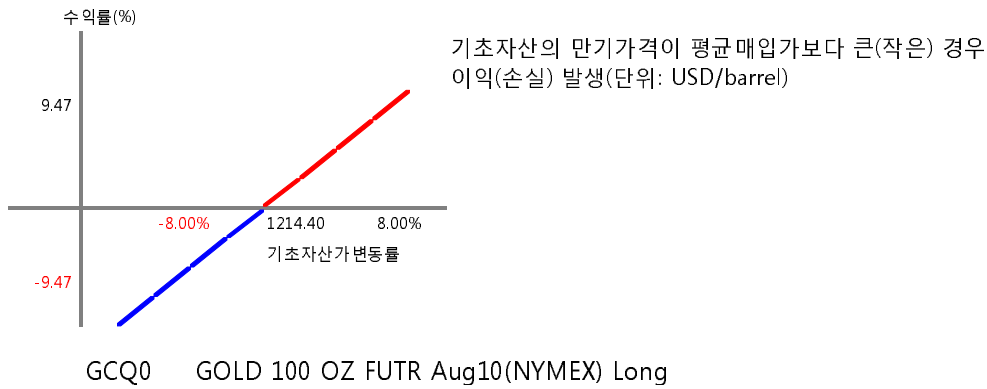
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

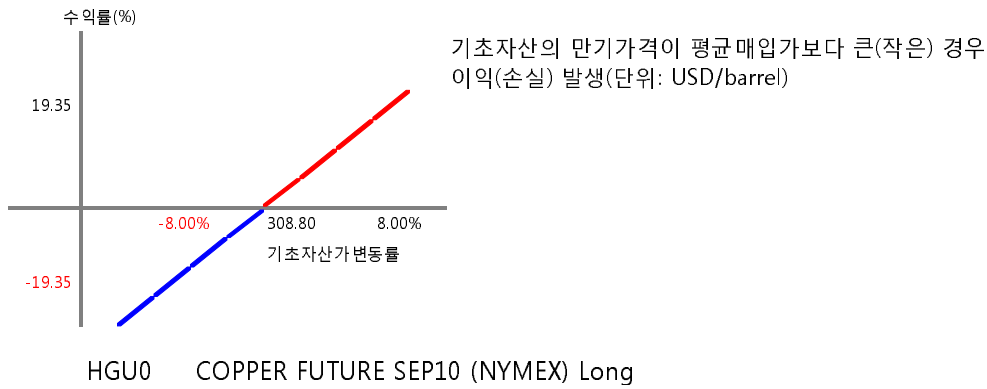
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



메리츠WTIIndex사모특별자산2호

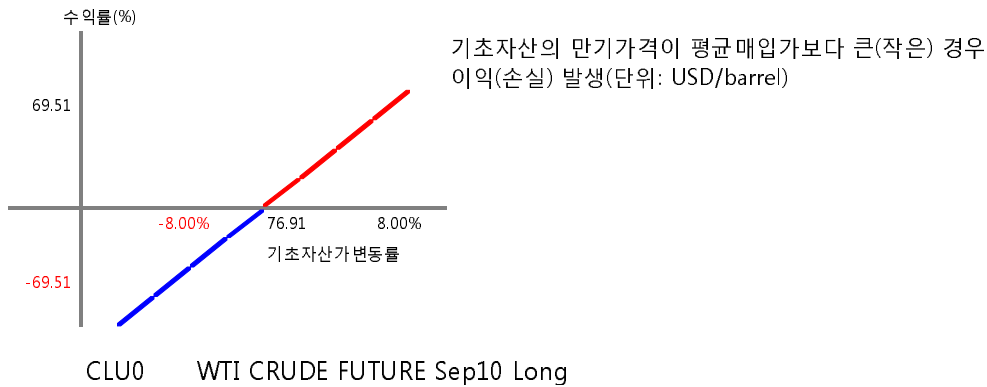
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	69.51
	5.33%	46.31
	2.67%	23.20
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-23.20
	-5.33%	-46.31
	-8.00%	-69.51

최대손실 시나리오	
위험액	-69.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	261.80
-----	--------

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

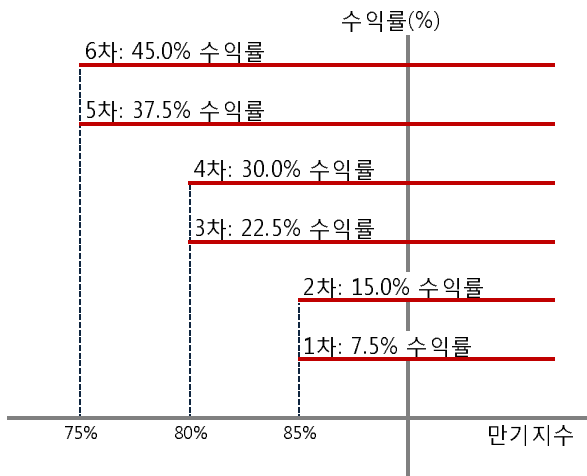
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

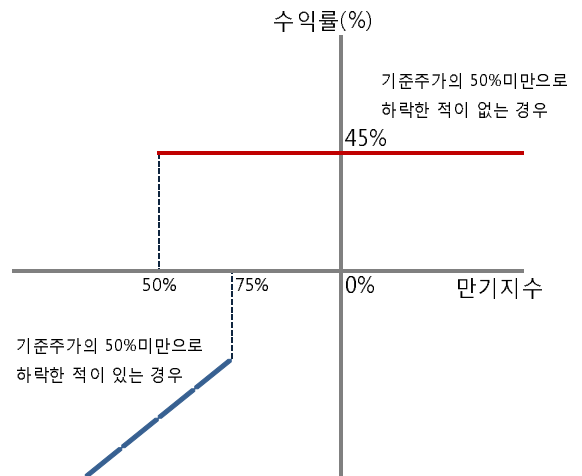
							단위(백만원)
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고	
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외	
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장외	

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	(10.37)	(13.74)	(17.11)	(20.47)	(23.84)	(27.21)	(30.57)
자산	5.33%	5.96	2.59	(0.77)	(4.14)	(7.51)	(10.88)	(14.24)
시나리오	2.67%	12.78	9.42	6.05	2.68	(0.68)	(4.05)	(7.42)
	0.00%	10.10	6.73	3.37	0.00	(3.37)	(6.73)	(10.10)
	-2.67%	(2.09)	(5.46)	(8.82)	(12.19)	(15.56)	(18.92)	(22.29)
	-5.33%	(23.78)	(27.15)	(30.52)	(33.88)	(37.25)	(40.62)	(43.99)
	-8.00%	(54.99)	(58.35)	(61.72)	(65.09)	(68.45)	(71.82)	(75.19)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512111024	대신증권(ELS)966	18.80
KR6582134021	현대증권(ELS)2010-1193	18.80
KR6662335027	동양(ELS)459	18.80
KR6702328024	H&D증권(ELS)499	18.80
총 최대손실 예상금액		75.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 60.88

메리츠한증지수연계증권제5호[ELS-파생형]

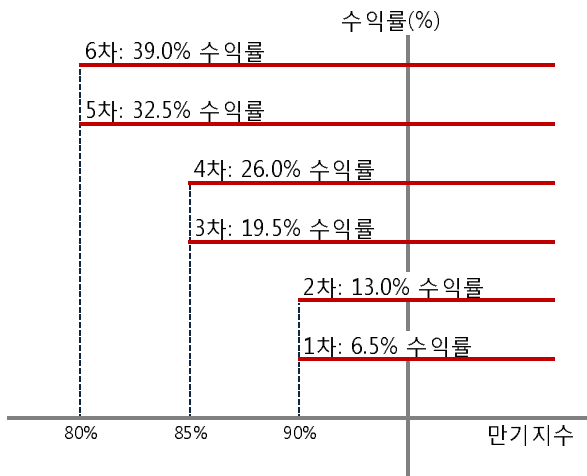
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

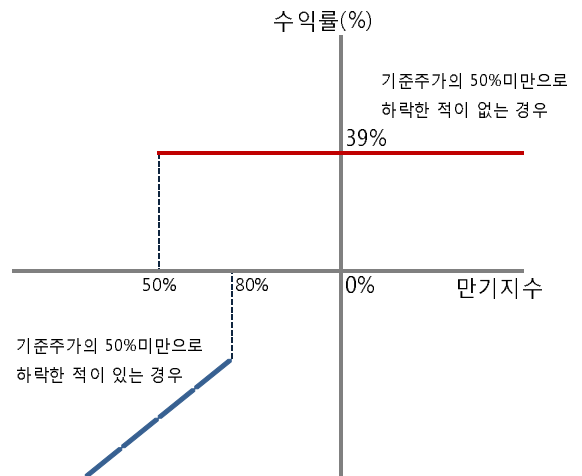
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	0.92	(0.99)	(2.89)	(4.80)	(6.70)	(8.60)	(10.51)
자산	5.33%	2.79	0.89	(1.01)	(2.92)	(4.82)	(6.73)	(8.63)
시나리오	2.67%	4.39	2.49	0.58	(1.32)	(3.22)	(5.13)	(7.03)
	0.00%	5.71	3.81	1.90	0.00	(1.90)	(3.81)	(5.71)
	-2.67%	6.75	4.85	2.95	1.04	(0.86)	(2.77)	(4.67)
	-5.33%	7.52	5.61	3.71	1.81	(0.10)	(2.00)	(3.91)
	-8.00%	8.00	6.10	4.19	2.29	0.39	(1.52)	(3.42)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513101032	대신증권(ELS)993	2.64
KR6553313034	우리투자증권(ELS)2980	2.64
KR6663306035	동양(ELS)485	2.58
KR6703307035	H&D증권(ELS)504	2.64
총 최대손실 예상금액		10.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.48
-----	-------

메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

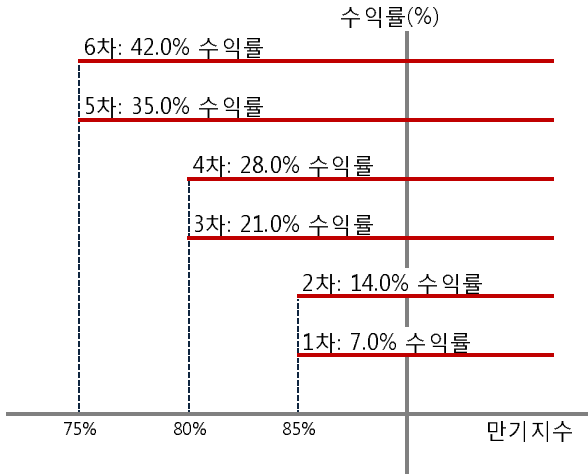
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

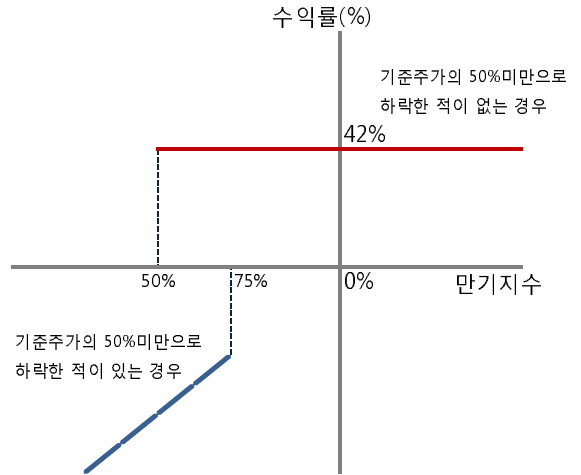
단위(백만원)						
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	19.78	13.66	7.54	1.42	(4.70)	(10.82)	(16.94)
	5.33%	25.79	19.67	13.55	7.43	1.31	(4.81)	(10.93)
	2.67%	25.32	19.20	13.08	6.96	0.84	(5.28)	(11.40)
	0.00%	18.36	12.24	6.12	0.00	(6.12)	(12.24)	(18.36)
	-2.67%	4.92	(1.20)	(7.32)	(13.44)	(19.56)	(25.68)	(31.81)
	-5.33%	(15.01)	(21.13)	(27.25)	(33.37)	(39.49)	(45.61)	(51.73)
	-8.00%	(41.42)	(47.54)	(53.66)	(59.78)	(65.91)	(72.03)	(78.15)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502333034	신한투자(ELS)1395	78.15
총 최대손실 예상금액		78.15

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 58.53

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

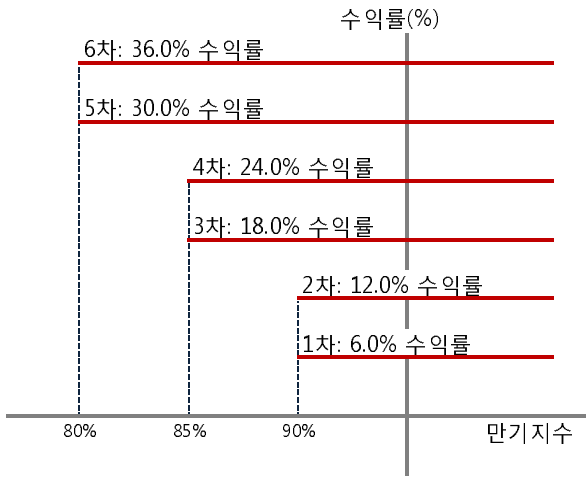
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장외

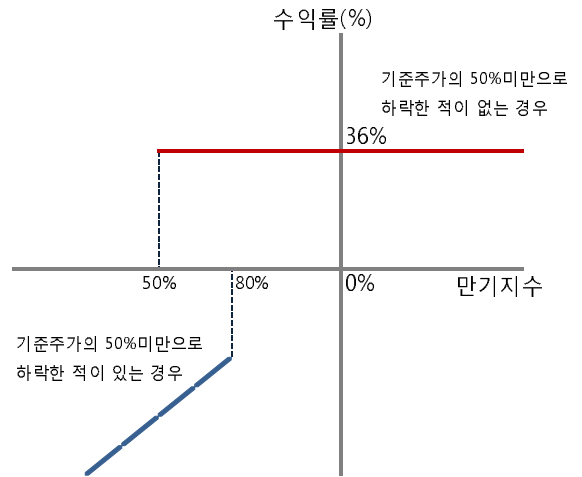
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	40.23	32.17	24.10	16.04	7.97	(0.10)	(8.16)
	5.33%	37.32	29.25	21.19	13.12	5.05	(3.01)	(11.08)
	2.67%	31.97	23.91	15.84	7.77	(0.29)	(8.36)	(16.43)
	0.00%	24.20	16.13	8.07	0.00	(8.07)	(16.13)	(24.20)
	-2.67%	14.00	5.93	(2.14)	(10.20)	(18.27)	(26.33)	(34.40)
	-5.33%	1.37	(6.70)	(14.77)	(22.83)	(30.90)	(38.96)	(47.03)
	-8.00%	(13.69)	(21.76)	(29.82)	(37.89)	(45.96)	(54.02)	(62.09)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	62.09
총 최대손실 예상금액		62.09

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	65.11
-----	-------

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

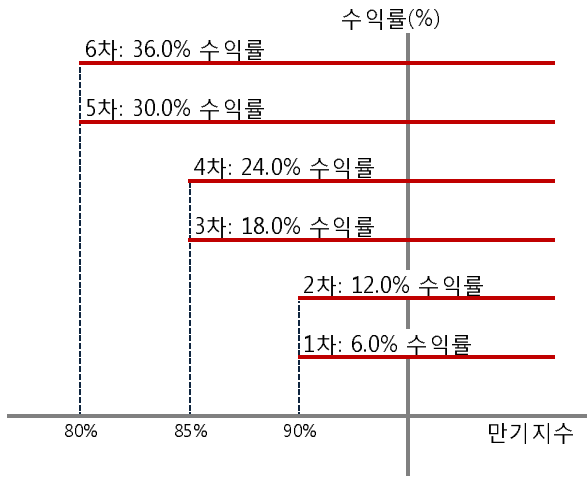
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

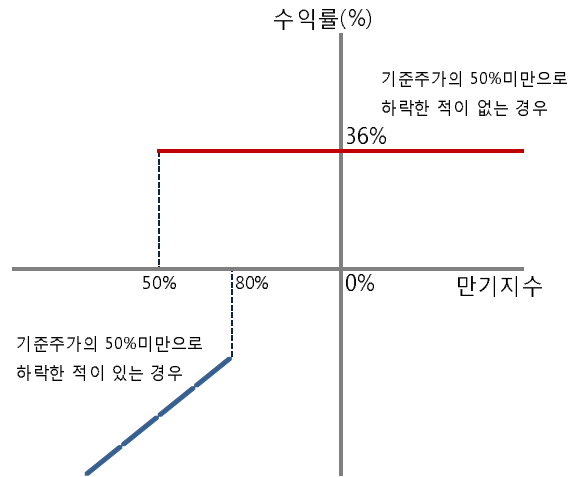
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	38.99	31.26	23.54	15.81	8.09	0.37	(7.36)
	5.33%	36.08	28.36	20.64	12.91	5.19	(2.54)	(10.26)
	2.67%	30.81	23.09	15.36	7.64	(0.08)	(7.81)	(15.53)
	0.00%	23.17	15.45	7.72	0.00	(7.72)	(15.45)	(23.17)
	-2.67%	13.16	5.44	(2.29)	(10.01)	(17.73)	(25.46)	(33.18)
	-5.33%	0.78	(6.94)	(14.66)	(22.39)	(30.11)	(37.84)	(45.56)
	-8.00%	(13.96)	(21.69)	(29.41)	(37.13)	(44.86)	(52.58)	(60.31)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6512107048	대신증권(ELS)1029	60.31
총 최대손실 예상금액		60.31

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	50.52
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

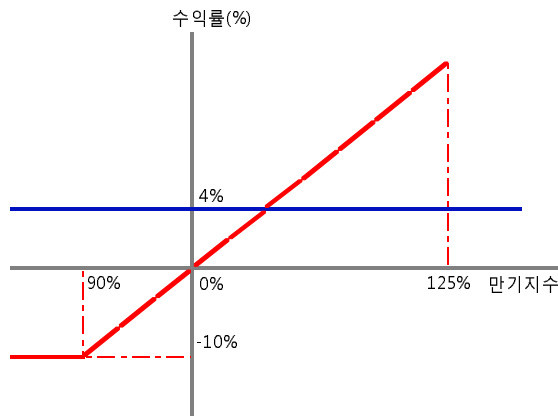
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	445	0	445	장외

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초	9.06	8.02	6.97	5.93	4.89	3.85	2.81
자산	7.49	6.45	5.41	4.36	3.32	2.28	1.24
시나	5.51	4.47	3.43	2.39	1.34	0.30	(0.74)
리오	3.13	2.08	1.04	0.00	(1.04)	(2.08)	(3.13)
	0.33	(0.71)	(1.75)	(2.80)	(3.84)	(4.88)	(5.92)
	(2.87)	(3.92)	(4.96)	(6.00)	(7.04)	(8.09)	(9.13)
	(6.49)	(7.53)	(8.57)	(9.62)	(10.66)	(11.70)	(12.74)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503339048	신한투자(ELS)1447	12.74
총 최대손실 예상금액		12.74

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.88
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

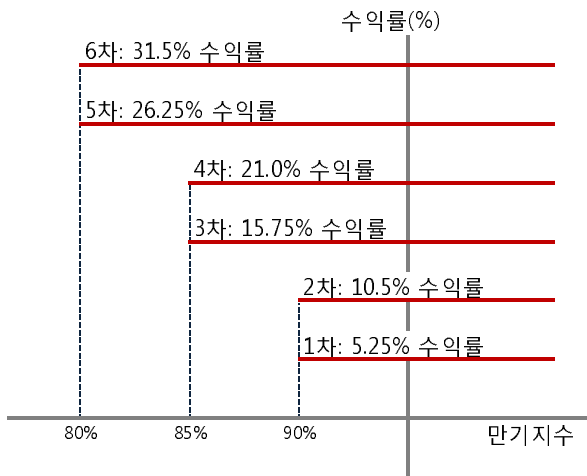
공시일: 2010-07-27

1. 계약금액

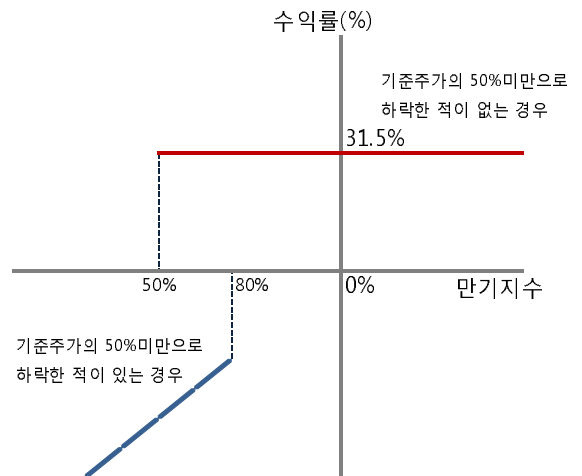
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	15.31	11.11	6.91	2.72	(1.48)	(5.67)	(9.87)
	5.33%	16.16	11.96	7.77	3.57	(0.63)	(4.82)	(9.02)
	2.67%	15.25	11.06	6.86	2.66	(1.53)	(5.73)	(9.92)
	0.00%	12.59	8.39	4.20	0.00	(4.20)	(8.39)	(12.59)
	-2.67%	8.17	3.97	(0.23)	(4.42)	(8.62)	(12.81)	(17.01)
	-5.33%	1.99	(2.21)	(6.41)	(10.60)	(14.80)	(18.99)	(23.19)
	-8.00%	(5.95)	(10.15)	(14.34)	(18.54)	(22.73)	(26.93)	(31.13)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513135048	대신증권(ELS)1059	31.13
총 최대손실 예상금액		31.13

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 24.17

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

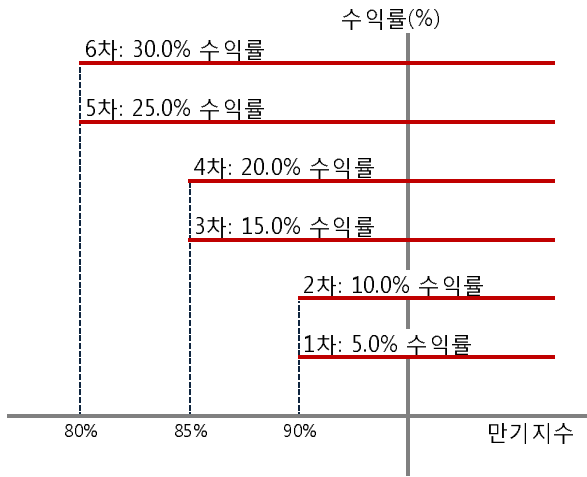
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,146	0	1,146	장외

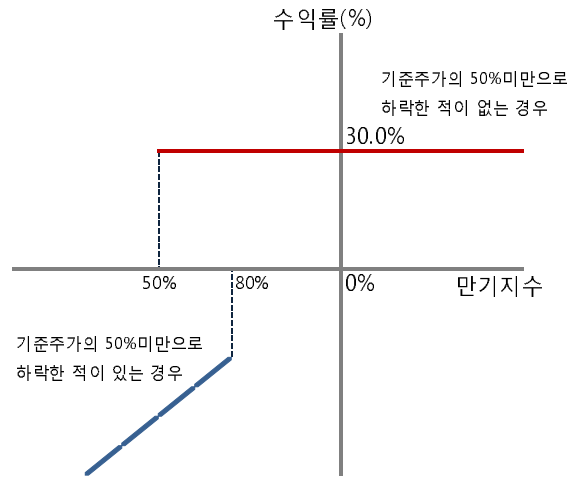
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	8.00%	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	6.19	4.22	2.26	0.29	(1.67)	(3.64)	(5.60)
	5.33%	7.11	5.14	3.18	1.21	(0.75)	(2.72)	(4.69)
	2.67%	7.01	5.05	3.08	1.11	(0.85)	(2.82)	(4.78)
	0.00%	5.90	3.93	1.97	0.00	(1.97)	(3.93)	(5.90)
	-2.67%	3.77	1.80	(0.17)	(2.13)	(4.10)	(6.06)	(8.03)
	-5.33%	0.62	(1.35)	(3.31)	(5.28)	(7.25)	(9.21)	(11.18)
	-8.00%	(3.55)	(5.51)	(7.48)	(9.44)	(11.41)	(13.38)	(15.34)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513118051	대신증권(ELS)1072	15.34
총 최대손실 예상금액		15.34

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 12.54

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

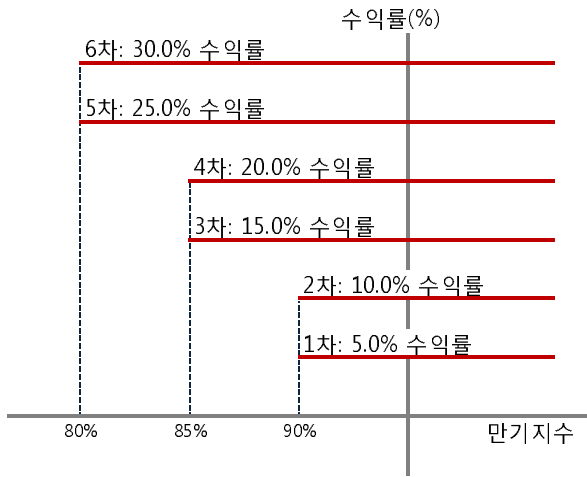
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,347	0	1,347	장외

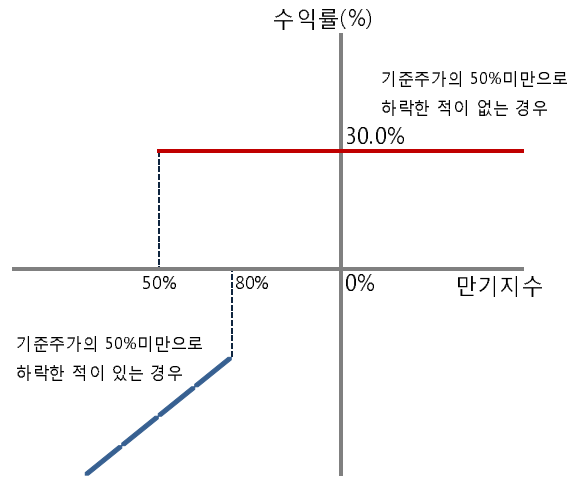
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	8.15	6.04	3.92	1.80	(0.31)	(2.43)	(4.55)
	5.33%	8.65	6.53	4.41	2.30	0.18	(1.94)	(4.05)
	2.67%	8.05	5.93	3.81	1.70	(0.42)	(2.54)	(4.66)
	0.00%	6.35	4.23	2.12	0.00	(2.12)	(4.23)	(6.35)
	-2.67%	3.56	1.44	(0.67)	(2.79)	(4.91)	(7.03)	(9.14)
	-5.33%	(0.33)	(2.44)	(4.56)	(6.68)	(8.79)	(10.91)	(13.03)
	-8.00%	(5.31)	(7.42)	(9.54)	(11.66)	(13.77)	(15.89)	(18.01)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	18.01
총 최대손실 예상금액		18.01

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 12.76

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

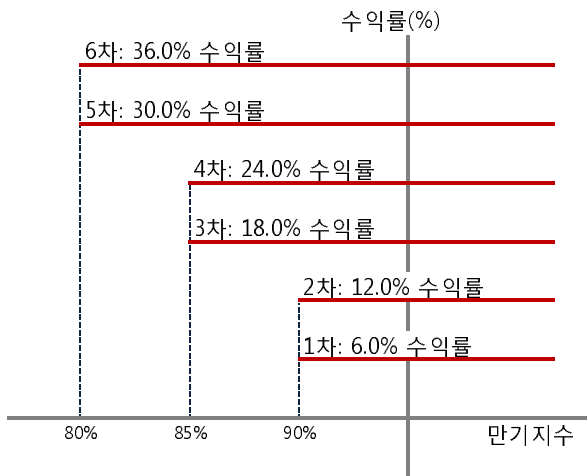
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

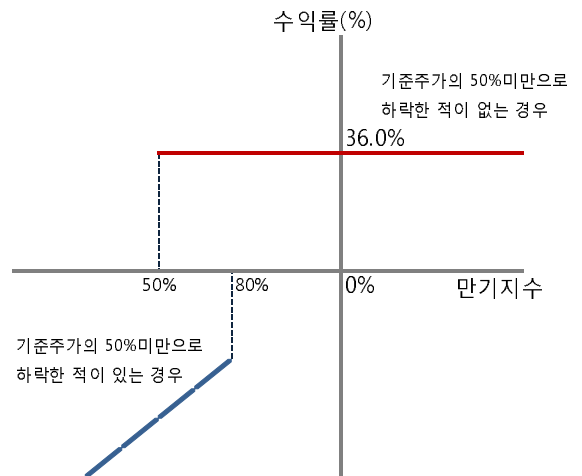
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	1.61	1.21	0.80	0.40	(0.01)	(0.41)	(0.82)
	5.33%	1.65	1.24	0.84	0.44	0.03	(0.37)	(0.78)
	2.67%	1.52	1.11	0.71	0.30	(0.10)	(0.51)	(0.91)
	0.00%	1.21	0.81	0.40	0.00	(0.40)	(0.81)	(1.21)
	-2.67%	0.74	0.34	(0.07)	(0.47)	(0.88)	(1.28)	(1.69)
	-5.33%	0.10	(0.31)	(0.71)	(1.11)	(1.52)	(1.92)	(2.33)
	-8.00%	(0.71)	(1.12)	(1.52)	(1.93)	(2.33)	(2.74)	(3.14)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6509358059	신한투자(ELS)1506	3.14
총 최대손실 예상금액		3.14

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 2.79

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

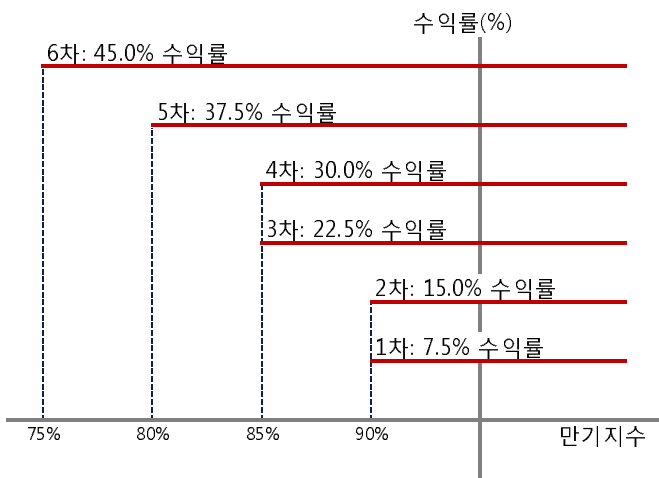
1. 계약금액

단위(백만원)

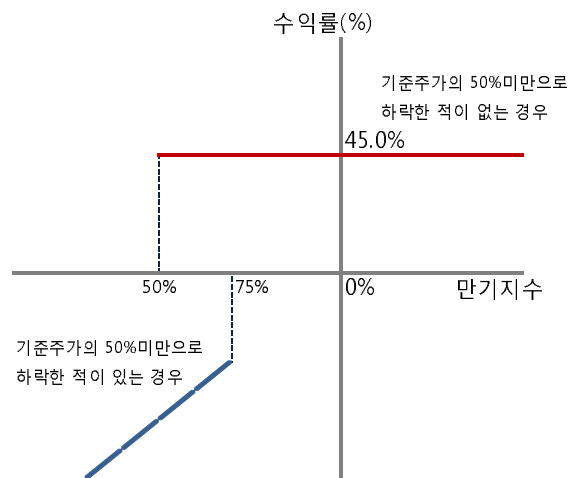
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	15.47	12.35	9.23	6.11	2.99	(0.13)	(3.25)
	5.33%	13.84	10.72	7.61	4.49	1.37	(1.75)	(4.87)
	2.67%	11.81	8.69	5.57	2.45	(0.67)	(3.79)	(6.91)
	0.00%	9.36	6.24	3.12	0.00	(3.12)	(6.24)	(9.36)
	-2.67%	6.50	3.38	0.26	(2.86)	(5.98)	(9.10)	(12.22)
	-5.33%	3.22	0.10	(3.02)	(6.14)	(9.26)	(12.37)	(15.49)
	-8.00%	(0.46)	(3.58)	(6.70)	(9.82)	(12.94)	(16.06)	(19.18)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6519101069	대신증권(ELS)1101	19.18
총 최대손실 예상금액		19.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 18.55

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

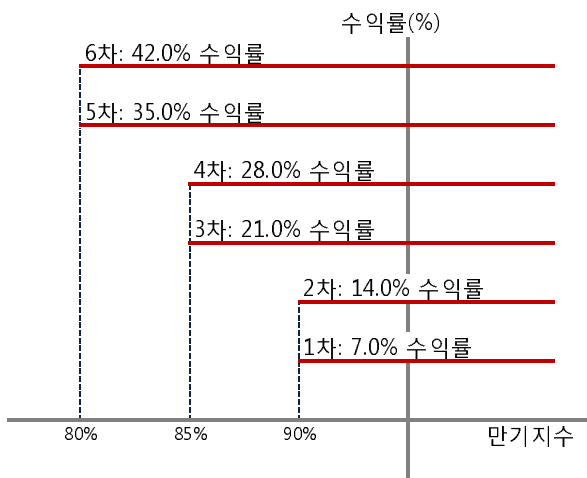
1. 계약금액

단위(백만원)

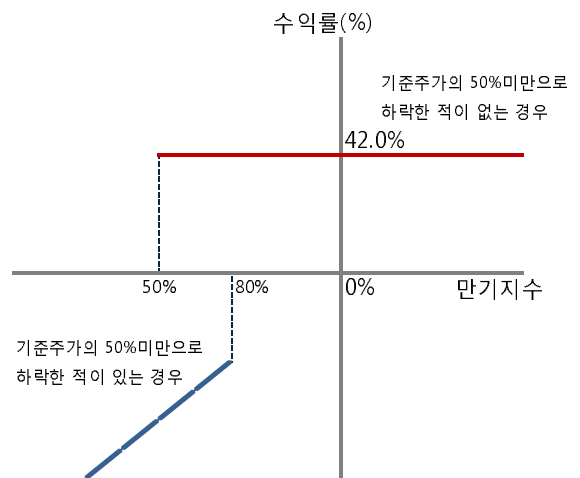
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	11.13	7.85	4.57	1.29	(1.98)	(5.26)	(8.54)
	5.33%	11.57	8.29	5.02	1.74	(1.54)	(4.82)	(8.09)
	2.67%	11.14	7.86	4.59	1.31	(1.97)	(5.25)	(8.53)
	0.00%	9.83	6.56	3.28	0.00	(3.28)	(6.56)	(9.83)
	-2.67%	7.65	4.37	1.09	(2.18)	(5.46)	(8.74)	(12.02)
	-5.33%	4.59	1.31	(1.97)	(5.24)	(8.52)	(11.80)	(15.08)
	-8.00%	0.65	(2.63)	(5.90)	(9.18)	(12.46)	(15.74)	(19.02)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513121063	대신증권(ELS)1120	19.02
총 최대손실 예상금액		19.02

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.94
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-07-27

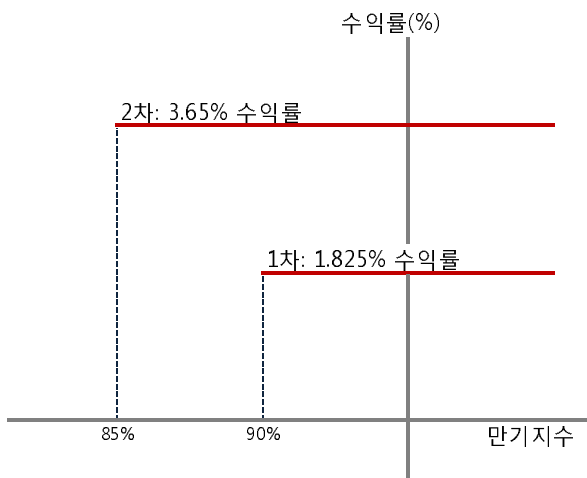
1. 계약금액

단위(백만원)

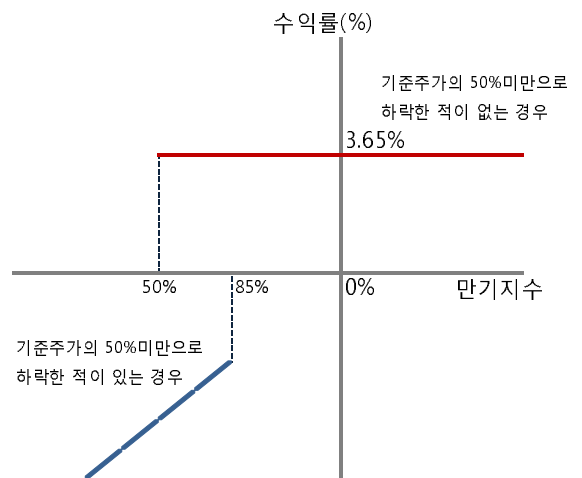
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	5.30	5.31	5.33	5.34	5.36	5.37	5.39
	5.33%	2.10	2.12	2.13	2.15	2.16	2.18	2.19
	2.67%	0.32	0.34	0.35	0.37	0.38	0.40	0.41
	0.00%	(0.05)	(0.03)	(0.02)	0.00	0.02	0.03	0.05
	-2.67%	1.00	1.02	1.03	1.05	1.06	1.08	1.09
	-5.33%	3.46	3.48	3.49	3.51	3.52	3.54	3.55
	-8.00%	7.33	7.35	7.37	7.38	7.40	7.41	7.43

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553352065	우리투자증권(ELS)3254	0.05
총 최대손실 예상금액		0.05

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 3.30