

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠클리켓단위파생5호

공시일: 2010-08-13

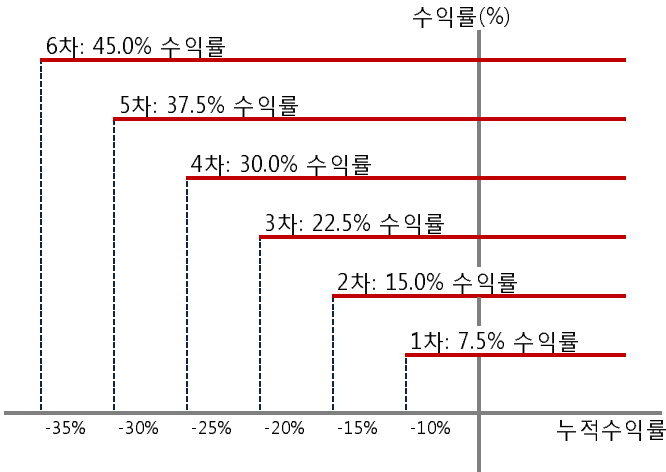
1. 계약금액

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

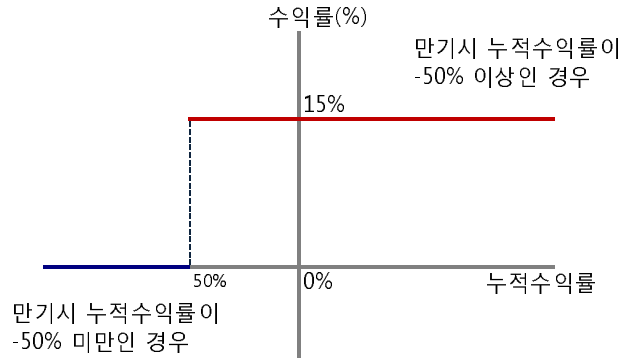
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

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

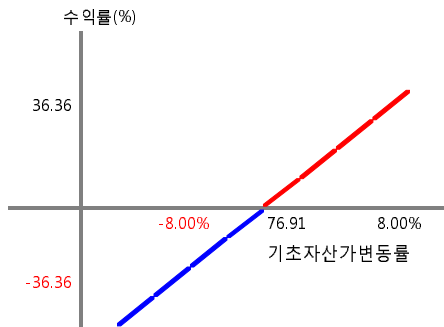
공시일: 2010-08-13

1. 계약금액

단위(백만원)

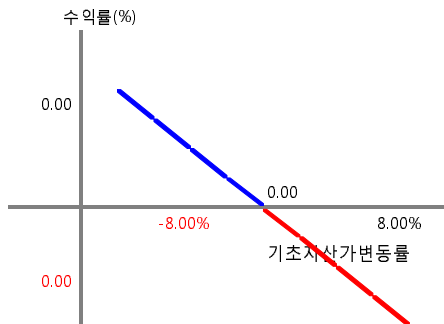
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내

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	8.00%	36.36
	5.33%	24.22
	2.67%	12.13
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.13
	-5.33%	-24.22
	-8.00%	-36.36

최대손실 시나리오

위험액	-36.36
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	147.30
-----	--------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

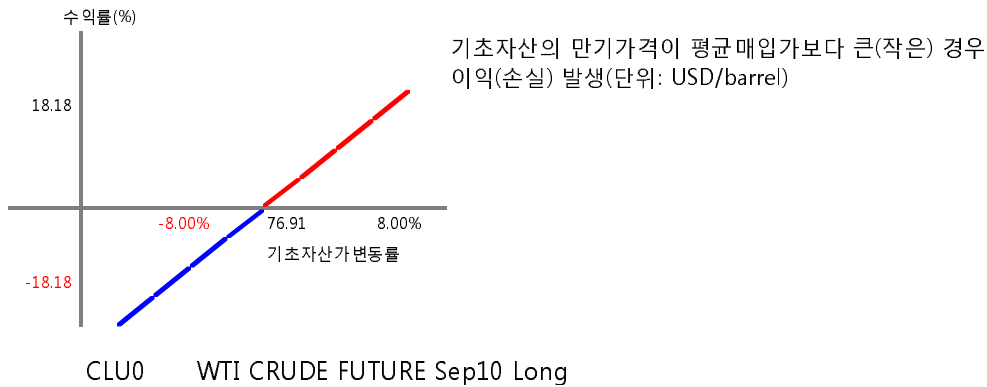
공시일: 2010-08-13

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%	36.36
	5.33%	24.22
	2.67%	12.13
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.13
	-5.33%	-24.22
	-8.00%	-36.36

최대손실 시나리오

위험액	-36.36
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	96.44
-----	-------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

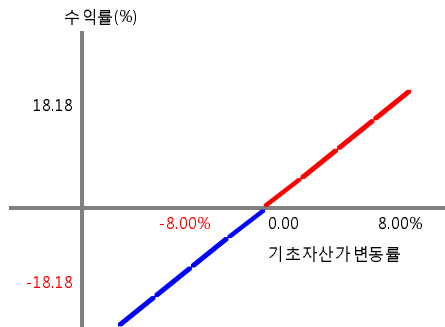
공시일: 2010-08-13

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



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

ECU0 E-MINI CRUDE OIL Sep10 Long

메리츠PremiumCommodity특별자산1

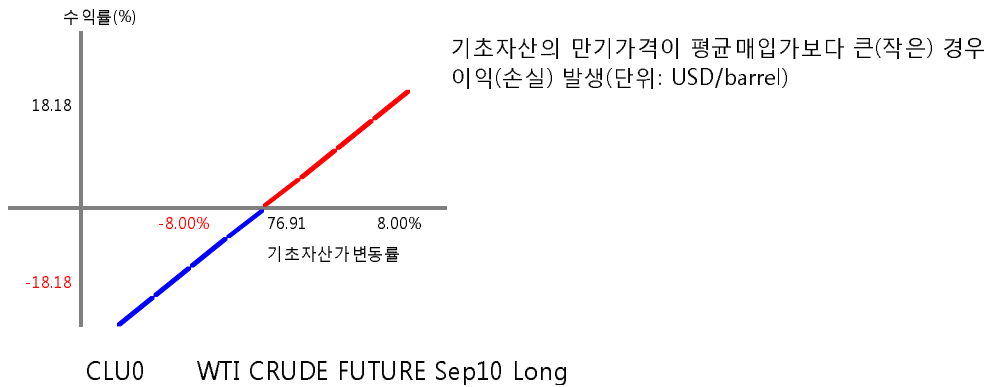
공시일: 2010-08-13

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%	47.61
	5.33%	31.72
	2.67%	15.89
	0.00%	0.00
시나리오	-2.67%	-15.89
	-5.33%	-31.72
	-8.00%	-47.61

최대손실 시나리오

위험액	-47.61
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	189.40
-----	--------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

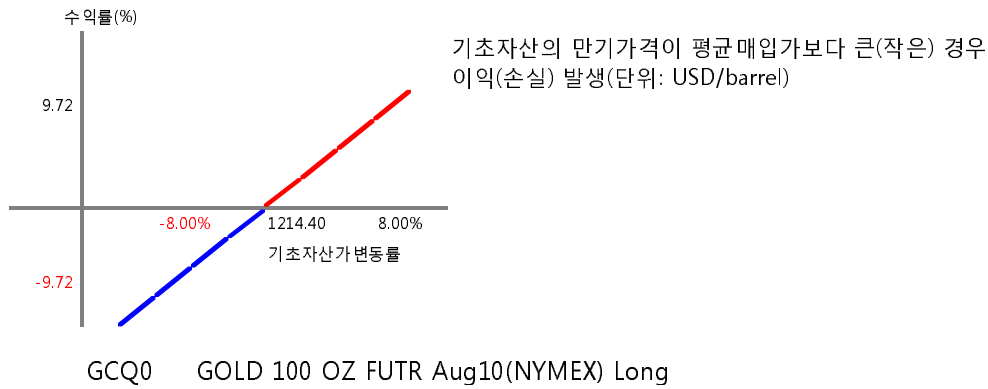
공시일: 2010-08-13

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

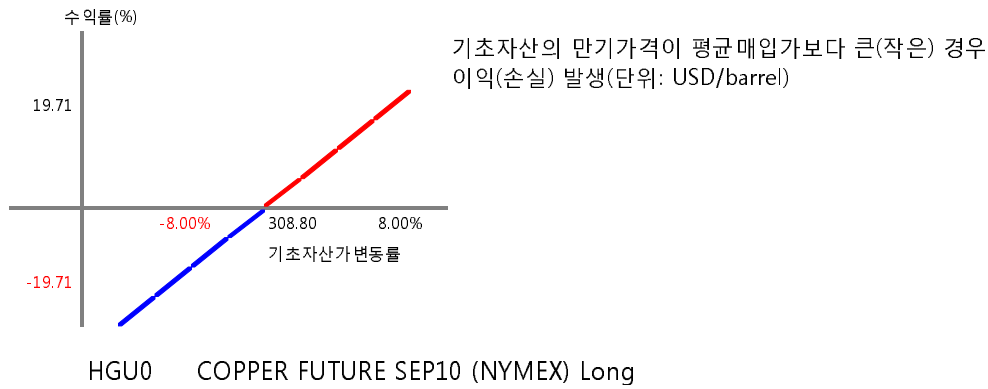
공시일: 2010-08-13

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

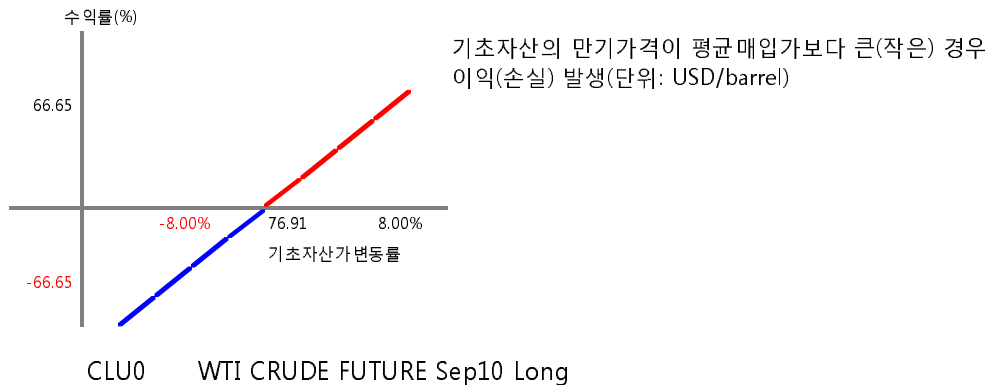
공시일: 2010-08-13

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%	66.65
	5.33%	44.41
	2.67%	22.25
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-22.25
	-5.33%	-44.41
	-8.00%	-66.65

최대손실 시나리오	
위험액	-66.65

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	251.06
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제5호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

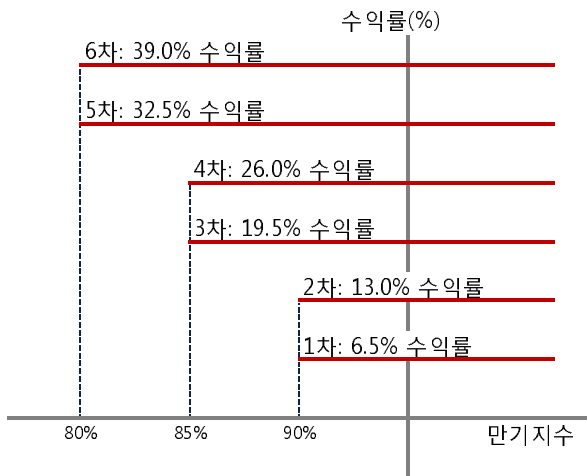
1. 계약금액

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

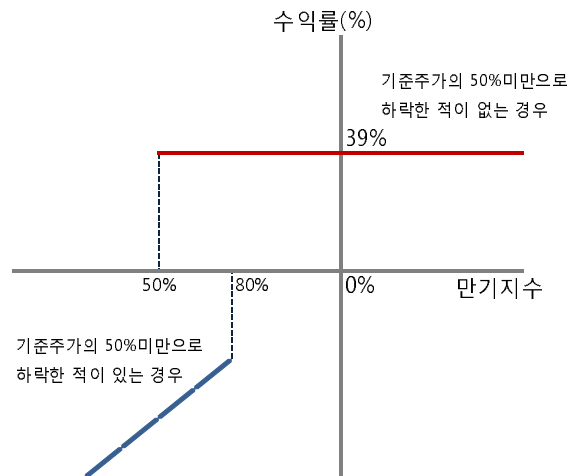
단위(백만원)

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%	(22.93)	(23.18)	(23.42)	(23.67)	(23.92)	(24.17)	(24.41)
자산	5.33%	(9.57)	(9.82)	(10.07)	(10.32)	(10.56)	(10.81)	(11.06)
시나리오	2.67%	(1.68)	(1.93)	(2.18)	(2.42)	(2.67)	(2.92)	(3.17)
	0.00%	0.74	0.49	0.25	0.00	(0.25)	(0.49)	(0.74)
	-2.67%	(2.30)	(2.55)	(2.79)	(3.04)	(3.29)	(3.54)	(3.78)
	-5.33%	(10.81)	(11.05)	(11.30)	(11.55)	(11.79)	(12.04)	(12.29)
	-8.00%	(24.78)	(25.02)	(25.27)	(25.52)	(25.77)	(26.01)	(26.26)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513101032	대신증권(ELS)993	6.69
KR6553313034	우리투자증권(ELS)2980	6.42
KR6663306035	동양(ELS)485	6.55
KR6703307035	H&D증권(ELS)504	6.59
총 최대손실 예상금액		26.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 7.55

메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

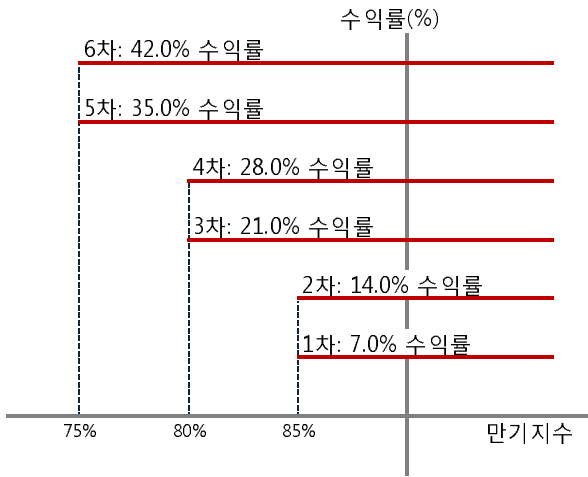
1. 계약금액

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

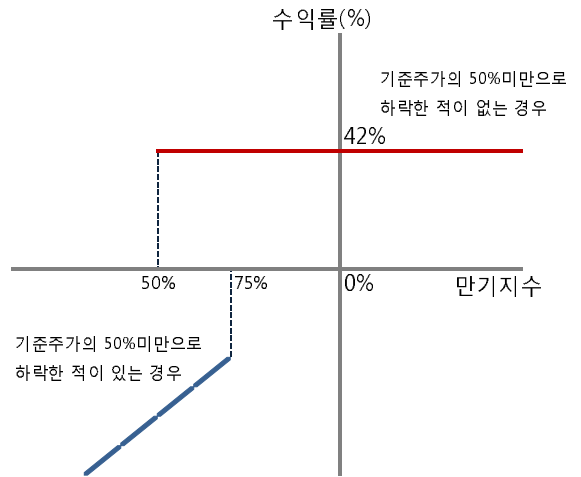
단위(백만원)

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%	4.06	(0.59)	(5.23)	(9.88)	(14.52)	(19.17)	(23.82)
	5.33%	18.76	14.11	9.47	4.82	0.17	(4.47)	(9.12)
	2.67%	22.05	17.40	12.76	8.11	3.47	(1.18)	(5.83)
	0.00%	13.94	9.29	4.65	0.00	(4.65)	(9.29)	(13.94)
	-2.67%	(5.58)	(10.22)	(14.87)	(19.52)	(24.16)	(28.81)	(33.46)
	-5.33%	(36.50)	(41.15)	(45.79)	(50.44)	(55.08)	(59.73)	(64.38)
	-8.00%	(78.82)	(83.47)	(88.12)	(92.76)	(97.41)	(102.06)	(106.70)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502333034	신한투자(ELS)1395	106.70
총 최대손실 예상금액		106.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	90.97
-----	-------

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

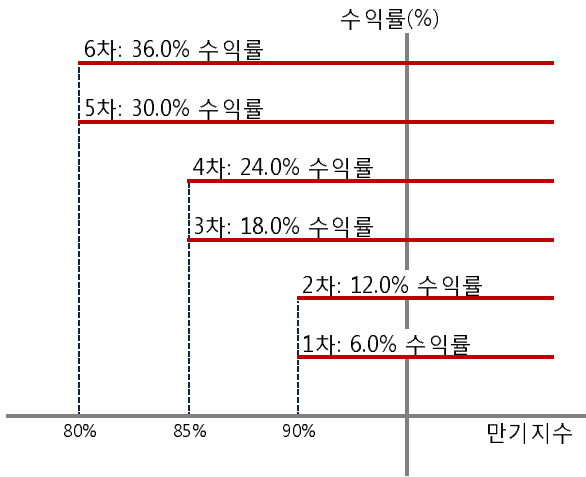
1. 계약금액

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

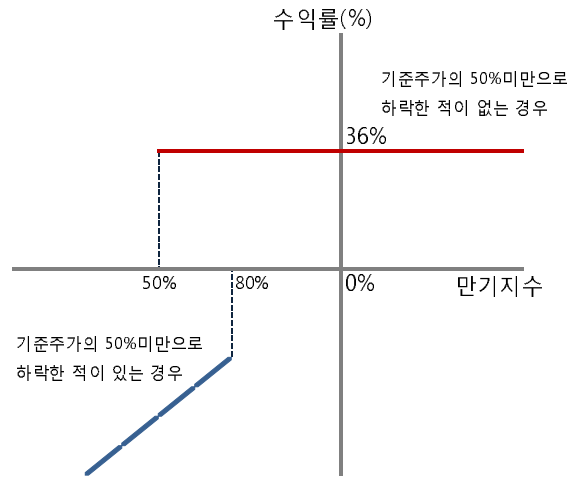
단위(백만원)

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%	111.46	97.52	83.58	69.64	55.70	41.76	27.81
	5.33%	89.85	75.90	61.96	48.02	34.08	20.14	6.20
	2.67%	66.63	52.69	38.75	24.81	10.87	(3.07)	(17.01)
	0.00%	41.82	27.88	13.94	0.00	(13.94)	(27.88)	(41.82)
	-2.67%	15.42	1.48	(12.47)	(26.41)	(40.35)	(54.29)	(68.23)
	-5.33%	(12.59)	(26.53)	(40.47)	(54.41)	(68.35)	(82.29)	(96.23)
	-8.00%	(42.19)	(56.13)	(70.07)	(84.01)	(97.95)	(111.89)	(125.83)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	125.83
총 최대손실 예상금액		125.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	122.74
-----	--------

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

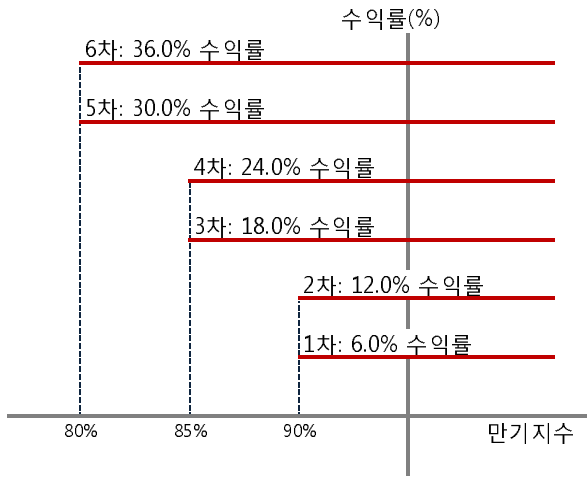
1. 계약금액

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

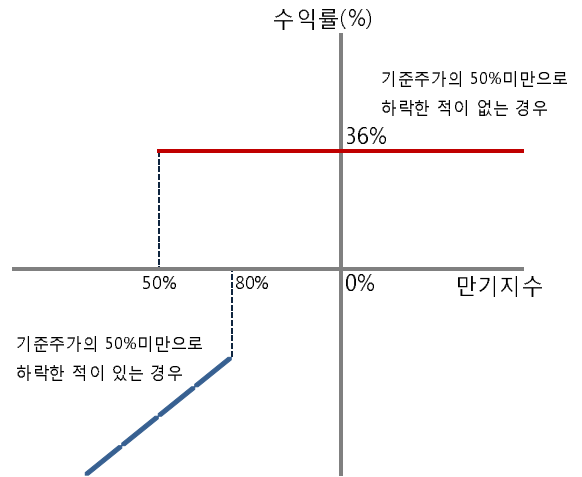
단위(백만원)

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%	48.56	42.78	36.99	31.21	25.43	19.65	13.86
	5.33%	41.08	35.30	29.52	23.74	17.95	12.17	6.39
	2.67%	30.68	24.90	19.11	13.33	7.55	1.77	(4.02)
	0.00%	17.35	11.56	5.78	0.00	(5.78)	(11.56)	(17.35)
	-2.67%	1.09	(4.69)	(10.48)	(16.26)	(22.04)	(27.82)	(33.61)
	-5.33%	(18.10)	(23.88)	(29.66)	(35.44)	(41.23)	(47.01)	(52.79)
	-8.00%	(40.21)	(45.99)	(51.77)	(57.56)	(63.34)	(69.12)	(74.90)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6512107048	대신증권(ELS)1029	74.90
총 최대손실 예상금액		74.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	73.91
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

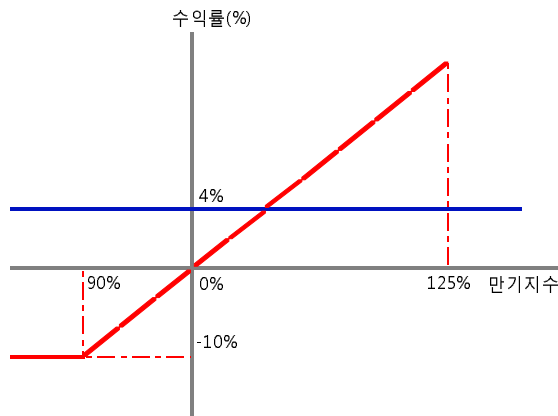
1. 계약금액

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	10.60	10.00	9.40	8.80	8.20	7.60	7.00
자산	7.87	7.27	6.67	6.07	5.47	4.87	4.27
시나	4.94	4.34	3.74	3.14	2.54	1.94	1.34
리오	1.80	1.20	0.60	0.00	(0.60)	(1.20)	(1.80)
	(1.55)	(2.14)	(2.74)	(3.34)	(3.94)	(4.54)	(5.14)
	(5.09)	(5.69)	(6.29)	(6.89)	(7.49)	(8.09)	(8.69)
	(8.85)	(9.45)	(10.04)	(10.64)	(11.24)	(11.84)	(12.44)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503339048	신한투자(ELS)1447	12.44
총 최대손실 예상금액		12.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.25
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

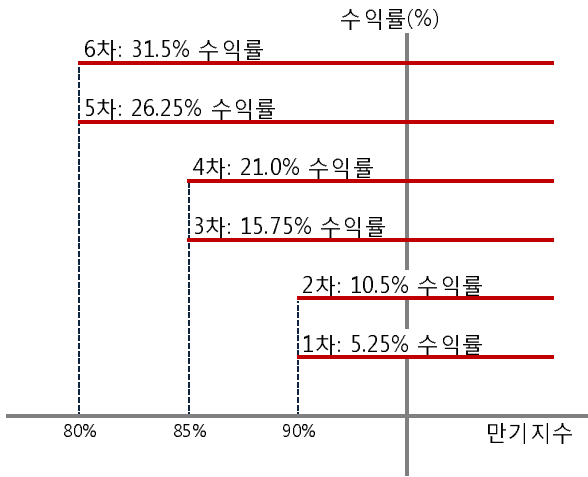
공시일: 2010-08-13

1. 계약금액

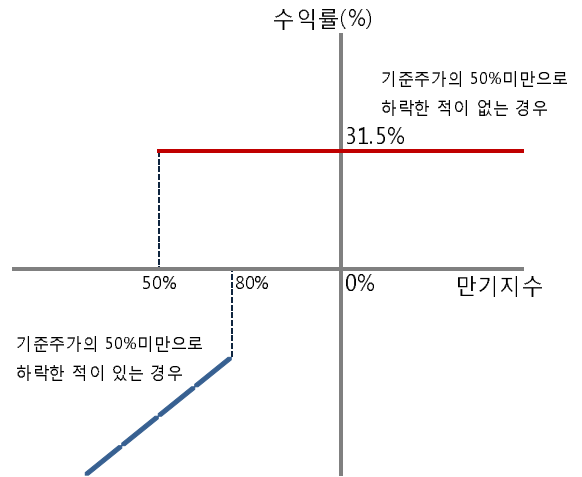
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	27.48	22.93	18.37	13.82	9.27	4.72	0.16
	5.33%	26.08	21.53	16.97	12.42	7.87	3.32	(1.24)
	2.67%	21.47	16.92	12.37	7.81	3.26	(1.29)	(5.84)
	0.00%	13.66	9.11	4.55	0.00	(4.55)	(9.11)	(13.66)
	-2.67%	2.64	(1.92)	(6.47)	(11.02)	(15.57)	(20.13)	(24.68)
	-5.33%	(11.59)	(16.14)	(20.70)	(25.25)	(29.80)	(34.36)	(38.91)
	-8.00%	(29.03)	(33.58)	(38.13)	(42.69)	(47.24)	(51.79)	(56.34)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513135048	대신증권(ELS)1059	56.34
총 최대손실 예상금액		56.34

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	52.98
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

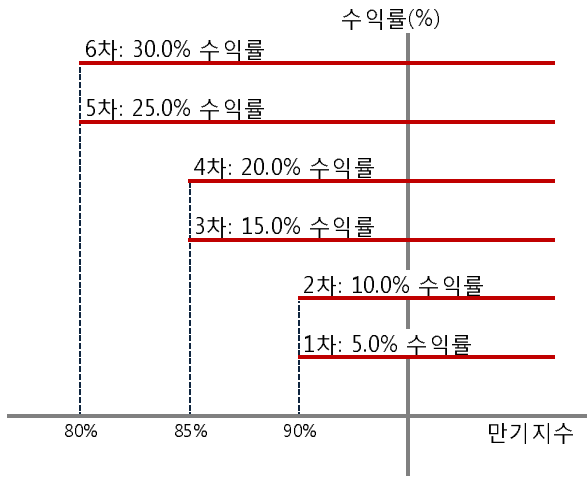
1. 계약금액

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

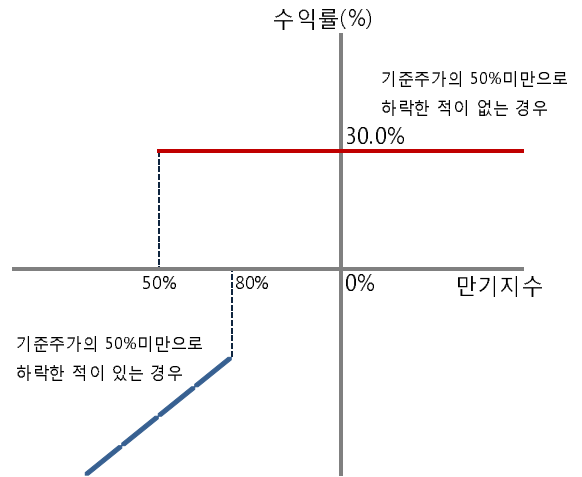
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	12.19	10.37	8.55	6.73	4.91	3.10	1.28
	5.33%	11.61	9.79	7.97	6.15	4.33	2.51	0.69
	2.67%	9.36	7.54	5.72	3.90	2.09	0.27	(1.55)
	0.00%	5.46	3.64	1.82	0.00	(1.82)	(3.64)	(5.46)
	-2.67%	(0.11)	(1.93)	(3.75)	(5.57)	(7.38)	(9.20)	(11.02)
	-5.33%	(7.33)	(9.15)	(10.97)	(12.79)	(14.61)	(16.43)	(18.25)
	-8.00%	(16.22)	(18.04)	(19.86)	(21.68)	(23.50)	(25.31)	(27.13)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513118051	대신증권(ELS)1072	27.13
총 최대손실 예상금액		27.13

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 27.42

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

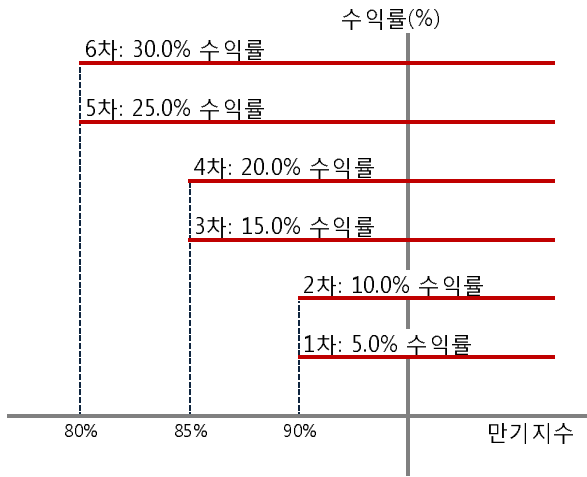
1. 계약금액

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

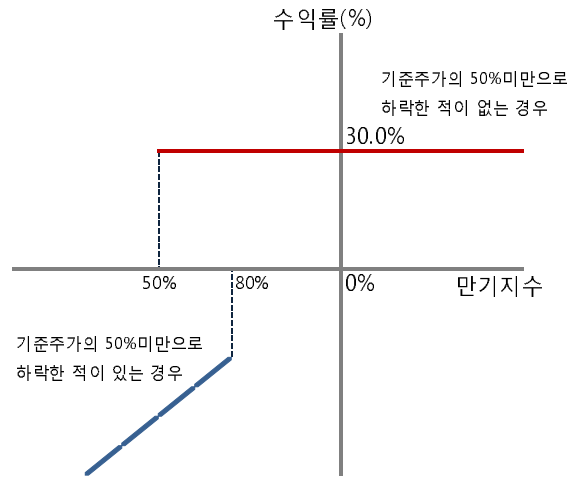
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	29.40	26.16	22.92	19.69	16.45	13.21	9.98
자산	5.33%	24.74	21.50	18.26	15.03	11.79	8.55	5.32
시나리오	2.67%	18.17	14.94	11.70	8.46	5.23	1.99	(1.25)
	0.00%	9.71	6.47	3.24	0.00	(3.24)	(6.47)	(9.71)
	-2.67%	(0.66)	(3.89)	(7.13)	(10.37)	(13.60)	(16.84)	(20.08)
	-5.33%	(12.92)	(16.16)	(19.40)	(22.63)	(25.87)	(29.11)	(32.34)
	-8.00%	(27.09)	(30.33)	(33.56)	(36.80)	(40.04)	(43.27)	(46.51)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	46.51
총 최대손실 예상금액		46.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 58.66

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

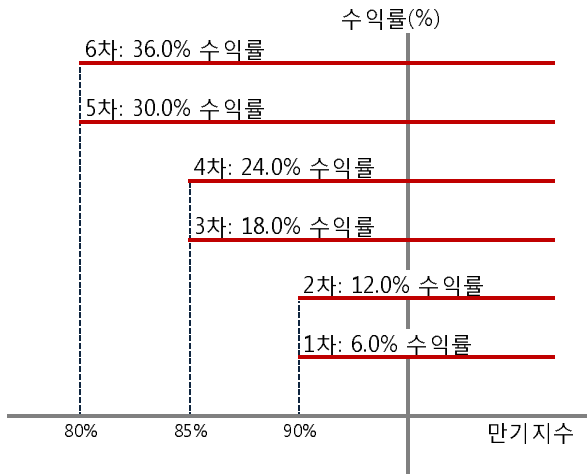
공시일: 2010-08-13

1. 계약금액

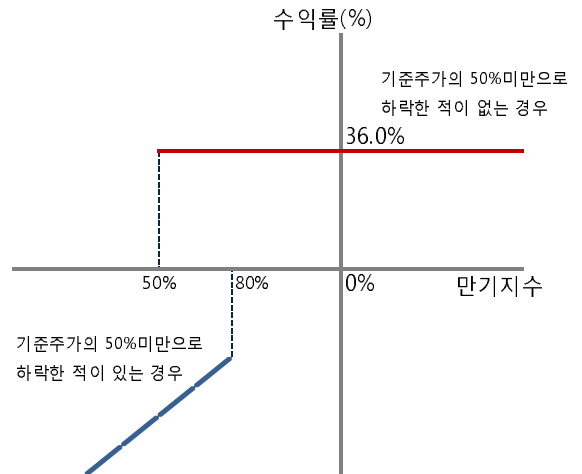
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

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%	2.37	1.95	1.52	1.10	0.68	0.25	(0.17)
	5.33%	2.34	1.92	1.49	1.07	0.65	0.22	(0.20)
	2.67%	1.97	1.55	1.13	0.70	0.28	(0.14)	(0.57)
	0.00%	1.27	0.85	0.42	0.00	(0.42)	(0.85)	(1.27)
	-2.67%	0.23	(0.20)	(0.62)	(1.04)	(1.46)	(1.89)	(2.31)
	-5.33%	(1.15)	(1.57)	(2.00)	(2.42)	(2.84)	(3.27)	(3.69)
	-8.00%	(2.87)	(3.29)	(3.71)	(4.14)	(4.56)	(4.98)	(5.41)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6509358059	신한투자(ELS)1506	5.41
총 최대손실 예상금액		5.41

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 6.89

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

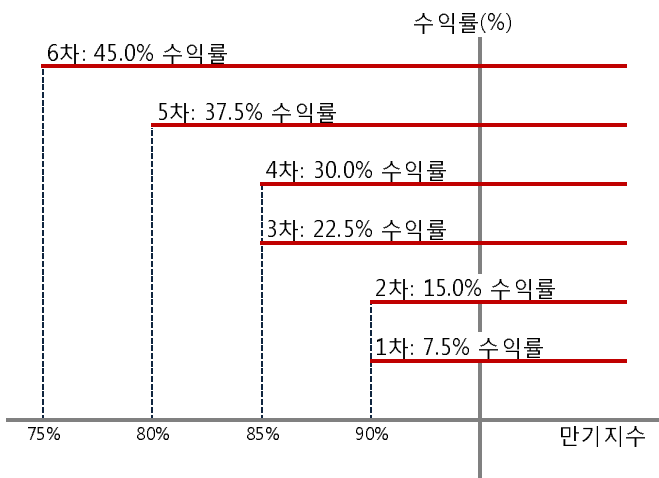
1. 계약금액

단위(백만원)

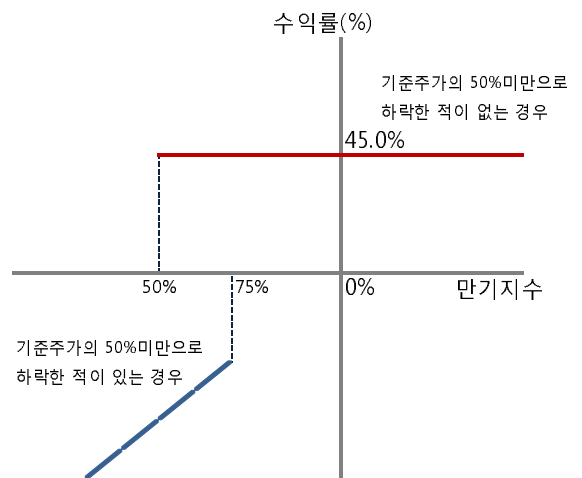
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

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 시나 리오	8.00%	18.36	15.18	11.99	8.81	5.63	2.44	(0.74)
	5.33%	16.02	12.83	9.65	6.47	3.28	0.10	(3.09)
	2.67%	13.08	9.90	6.71	3.53	0.35	(2.84)	(6.02)
	0.00%	9.55	6.37	3.18	0.00	(3.18)	(6.37)	(9.55)
	-2.67%	5.43	2.25	(0.94)	(4.12)	(7.31)	(10.49)	(13.67)
	-5.33%	0.71	(2.47)	(5.65)	(8.84)	(12.02)	(15.20)	(18.39)
	-8.00%	(4.59)	(7.78)	(10.96)	(14.14)	(17.33)	(20.51)	(23.70)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6519101069	대신증권(ELS)1101	23.70
총 최대손실 예상금액		23.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 21.84

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

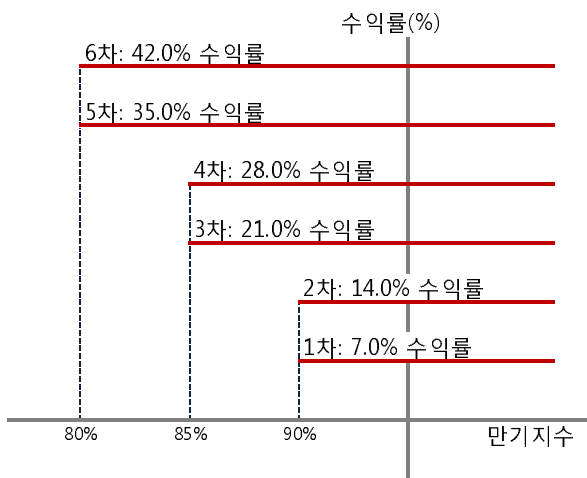
1. 계약금액

단위(백만원)

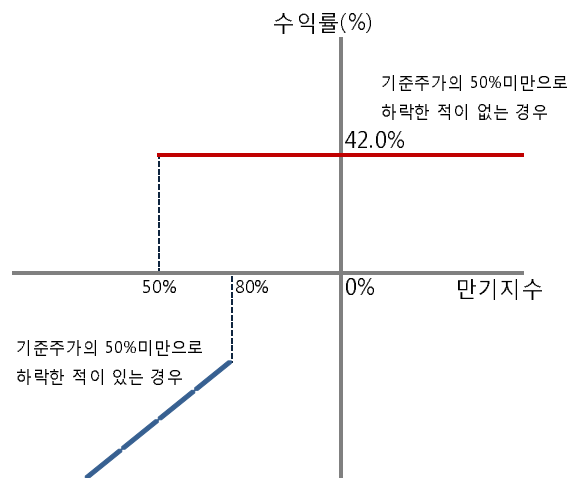
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

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%	20.36	16.79	13.23	9.66	6.10	2.53	(1.03)
	5.33%	18.73	15.16	11.60	8.03	4.47	0.91	(2.66)
	2.67%	15.51	11.94	8.38	4.81	1.25	(2.32)	(5.88)
	0.00%	10.69	7.13	3.56	0.00	(3.56)	(7.13)	(10.69)
	-2.67%	4.29	0.72	(2.84)	(6.41)	(9.97)	(13.54)	(17.10)
	-5.33%	(3.72)	(7.28)	(10.84)	(14.41)	(17.97)	(21.54)	(25.10)
	-8.00%	(13.31)	(16.88)	(20.44)	(24.00)	(27.57)	(31.13)	(34.70)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513121063	대신증권(ELS)1120	34.70
총 최대손실 예상금액		34.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 32.71

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-13

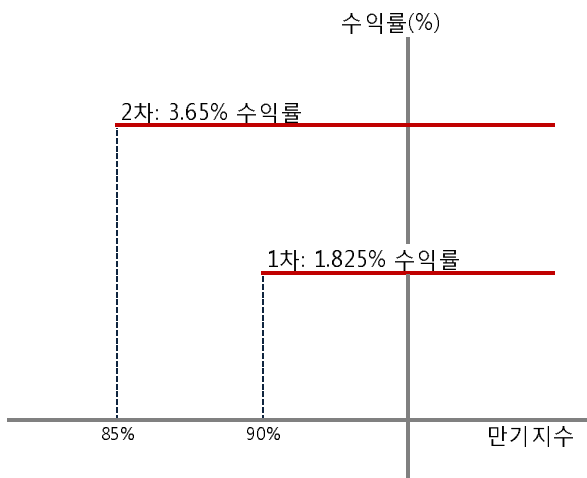
1. 계약금액

단위(백만원)

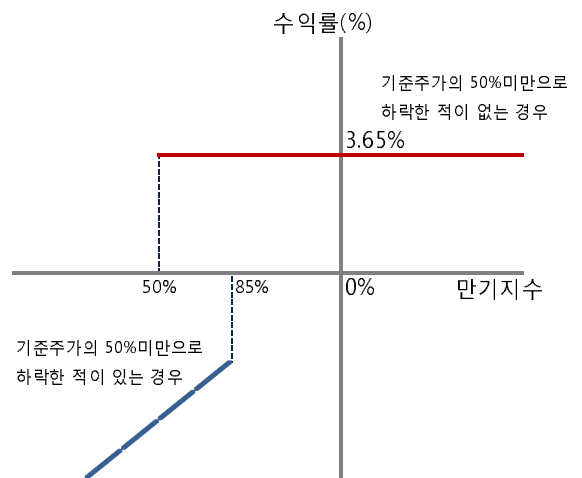
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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	8.00%	5.30	5.30	5.31	5.31	5.32	5.32	5.33
자산	5.33%	2.25	2.25	2.26	2.26	2.27	2.27	2.28
시나	2.67%	0.48	0.48	0.49	0.49	0.50	0.50	0.51
리오	0.00%	(0.02)	(0.01)	(0.01)	0.00	0.01	0.01	0.02
	-2.67%	0.77	0.77	0.78	0.78	0.79	0.80	0.80
	-5.33%	2.83	2.84	2.84	2.85	2.85	2.86	2.86
	-8.00%	6.17	6.18	6.18	6.19	6.19	6.20	6.20

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553352065	우리투자증권(ELS)3254	0.02
총 최대손실 예상금액		0.02

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 2.19