

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠클리켓단위파생5호

공시일: 2010-08-16

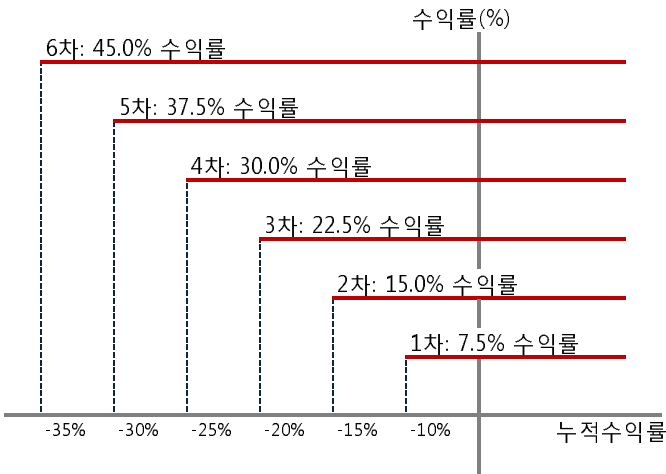
1. 계약금액

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

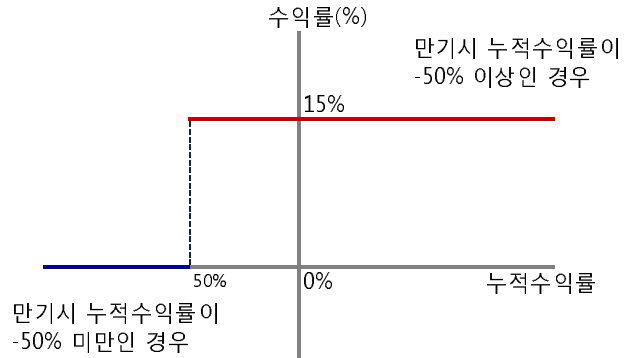
단위(백만원)

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

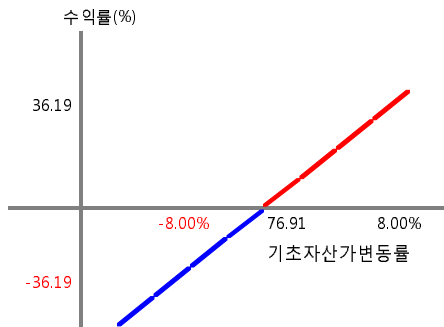
공시일: 2010-08-16

1. 계약금액

단위(백만원)

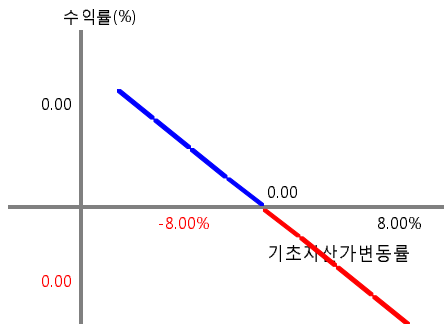
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내

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%	36.19
	5.33%	24.11
	2.67%	12.08
	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.08
	-5.33%	-24.11
	-8.00%	-36.19

최대손실 시나리오

위험액	-36.19
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	146.62
-----	--------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

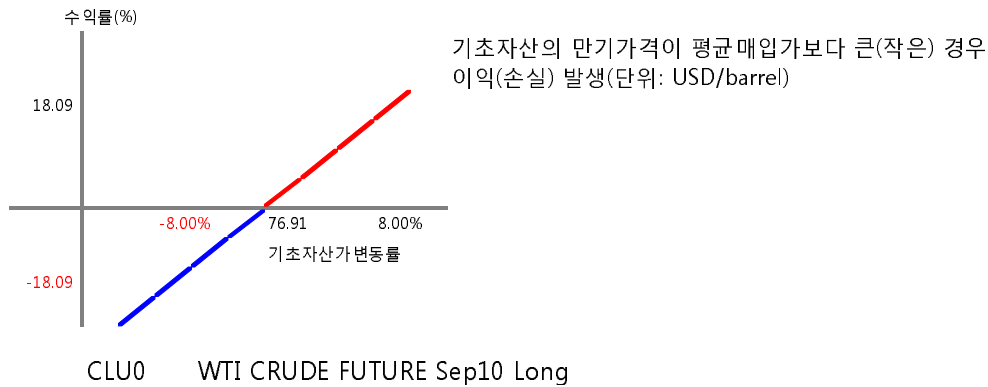
공시일: 2010-08-16

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%	36.19
	5.33%	24.11
	2.67%	12.08
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.08
	-5.33%	-24.11
	-8.00%	-36.19

최대손실 시나리오

위험액	-36.19
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	96.00
-----	-------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

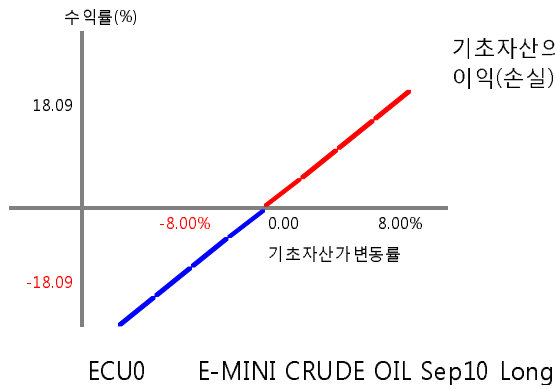
공시일: 2010-08-16

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

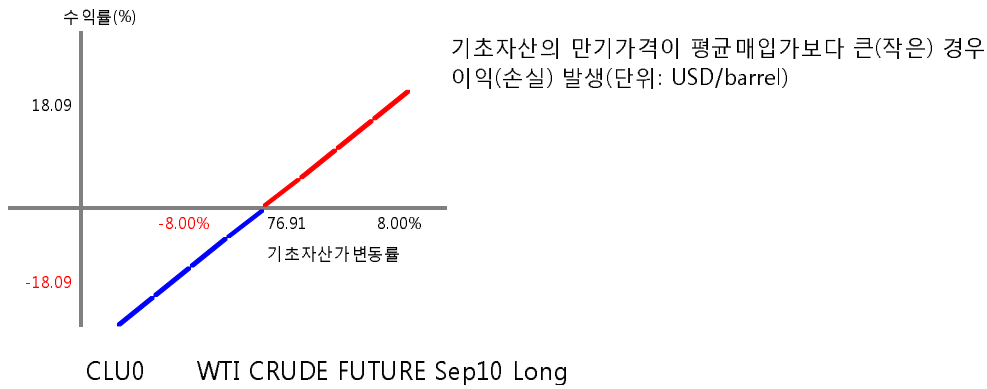
공시일: 2010-08-16

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%	47.33
	5.33%	31.53
	2.67%	15.80
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-15.80
	-5.33%	-31.53
	-8.00%	-47.33

최대손실 시나리오

위험액	-47.33
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	188.30
-----	--------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

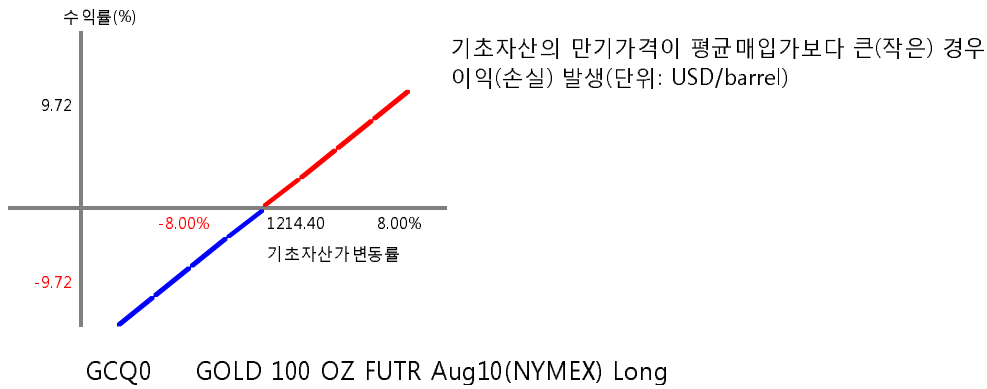
공시일: 2010-08-16

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

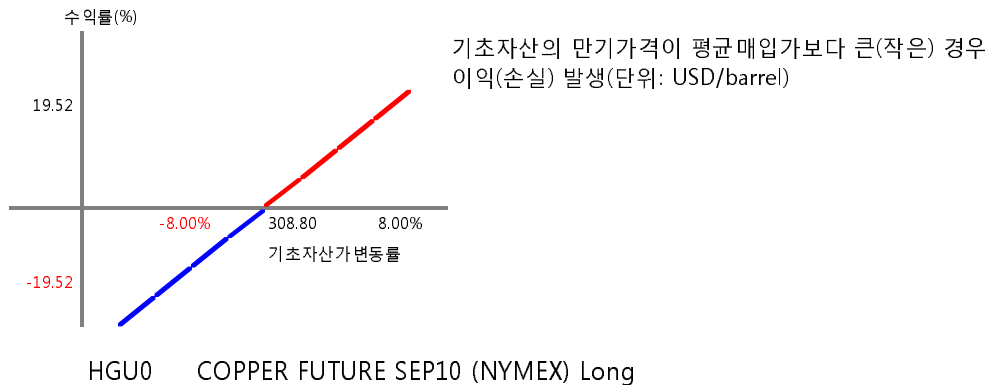
공시일: 2010-08-16

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

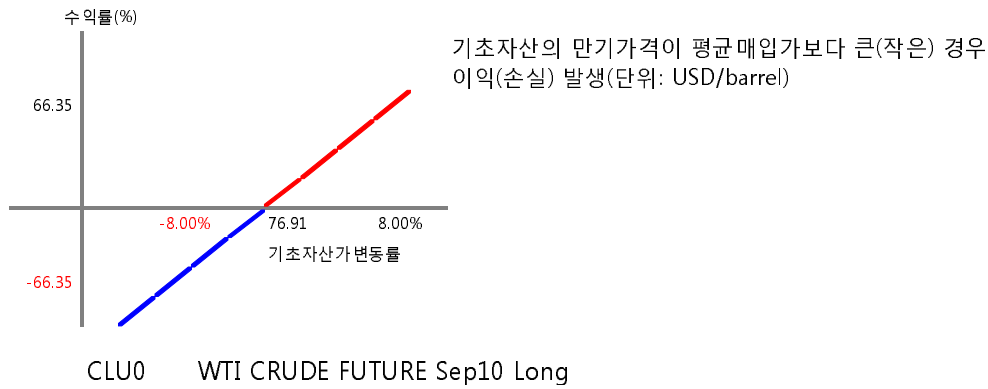
공시일: 2010-08-16

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%	66.35
	5.33%	44.20
	2.67%	22.14
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-22.14
	-5.33%	-44.20
	-8.00%	-66.35

최대손실 시나리오

위험액	-66.35
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	249.90
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제5호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

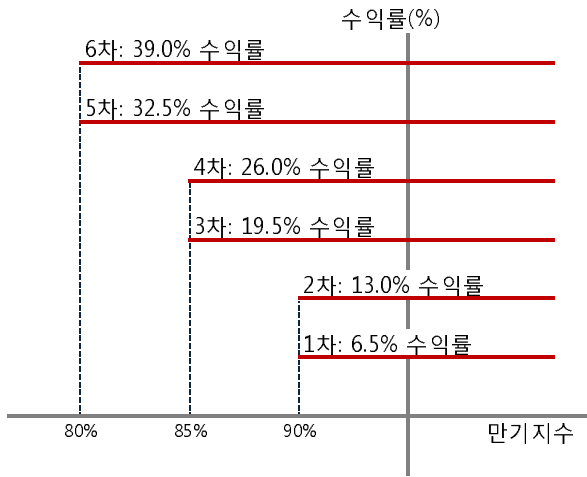
1. 계약금액

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

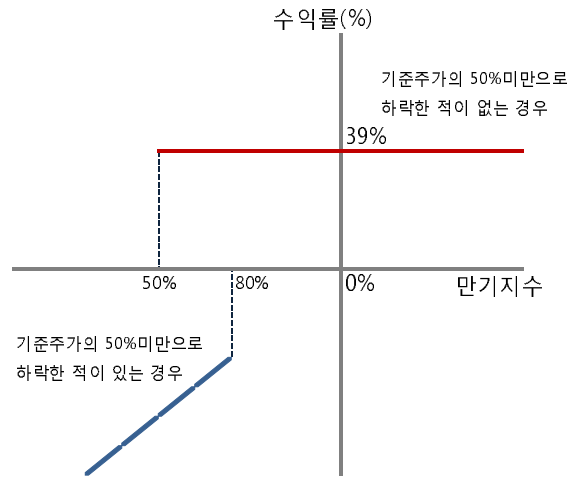
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	(17.87)	(17.99)	(18.11)	(18.23)	(18.36)	(18.48)	(18.60)
	5.33%	(7.55)	(7.67)	(7.79)	(7.91)	(8.03)	(8.15)	(8.27)
	2.67%	(1.47)	(1.59)	(1.71)	(1.83)	(1.95)	(2.07)	(2.19)
	0.00%	0.36	0.24	0.12	0.00	(0.12)	(0.24)	(0.36)
	-2.67%	(2.06)	(2.18)	(2.30)	(2.42)	(2.54)	(2.66)	(2.78)
	-5.33%	(8.73)	(8.85)	(8.97)	(9.09)	(9.21)	(9.33)	(9.45)
	-8.00%	(19.65)	(19.77)	(19.89)	(20.01)	(20.13)	(20.25)	(20.37)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513101032	대신증권(ELS)993	5.19
KR6553313034	우리투자증권(ELS)2980	4.97
KR6663306035	동양(ELS)485	5.09
KR6703307035	H&D증권(ELS)504	5.11
총 최대손실 예상금액		20.37

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.04
-----	------

메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

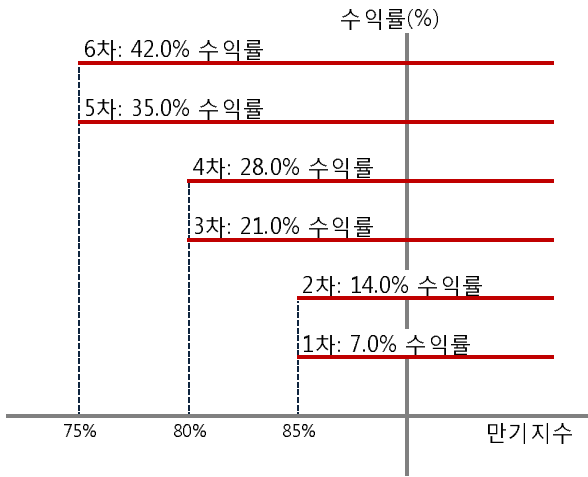
1. 계약금액

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

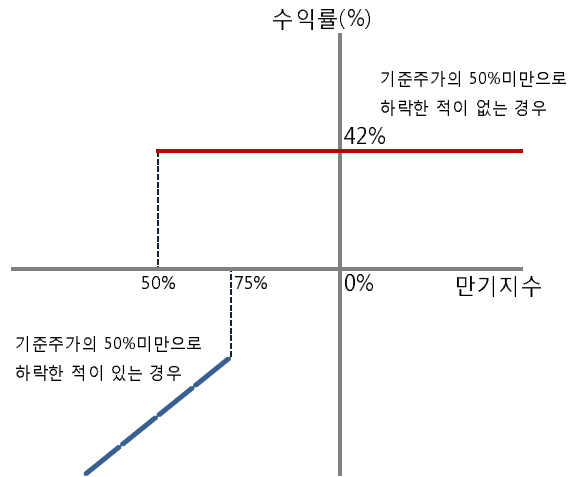
단위(백만원)

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%	(4.19)	(7.72)	(11.25)	(14.78)	(18.31)	(21.85)	(25.38)
	5.33%	10.90	7.37	3.84	0.31	(3.22)	(6.75)	(10.29)
	2.67%	15.83	12.30	8.77	5.24	1.70	(1.83)	(5.36)
	0.00%	10.59	7.06	3.53	0.00	(3.53)	(7.06)	(10.59)
	-2.67%	(4.81)	(8.34)	(11.87)	(15.40)	(18.93)	(22.46)	(25.99)
	-5.33%	(30.37)	(33.90)	(37.43)	(40.96)	(44.49)	(48.03)	(51.56)
	-8.00%	(66.10)	(69.63)	(73.16)	(76.69)	(80.22)	(83.75)	(87.28)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502333034	신한투자(ELS)1395	87.28
총 최대손실 예상금액		87.28

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	57.88
-----	-------

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

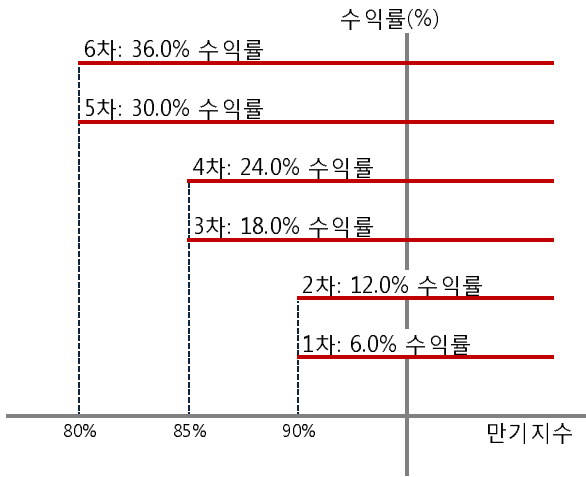
1. 계약금액

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

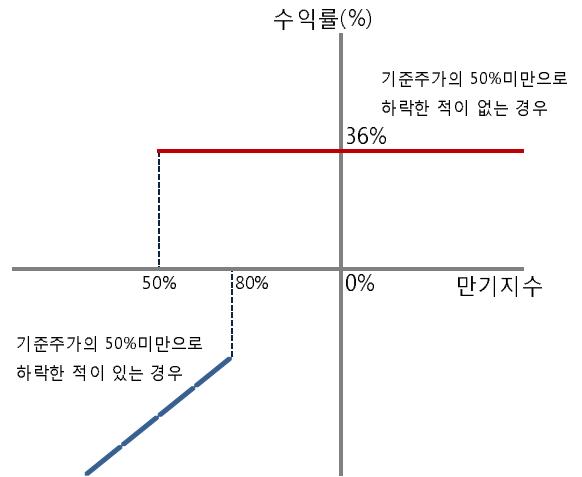
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	8.00%	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초	114.36	101.16	87.95	74.75	61.55	48.34	35.14	
자산	90.65	77.44	64.24	51.04	37.83	24.63	11.43	
시나리오	65.73	52.53	39.32	26.12	12.92	(0.29)	(13.49)	
	39.61	26.41	13.20	0.00	(13.20)	(26.41)	(39.61)	
	12.29	(0.92)	(14.12)	(27.32)	(40.53)	(53.73)	(66.93)	
	(16.24)	(29.44)	(42.65)	(55.85)	(69.05)	(82.26)	(95.46)	
	(45.97)	(59.17)	(72.37)	(85.58)	(98.78)	(111.98)	(125.19)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502348032	신한투자(ELS)1408	125.19
총 최대손실 예상금액		125.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 123.28

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

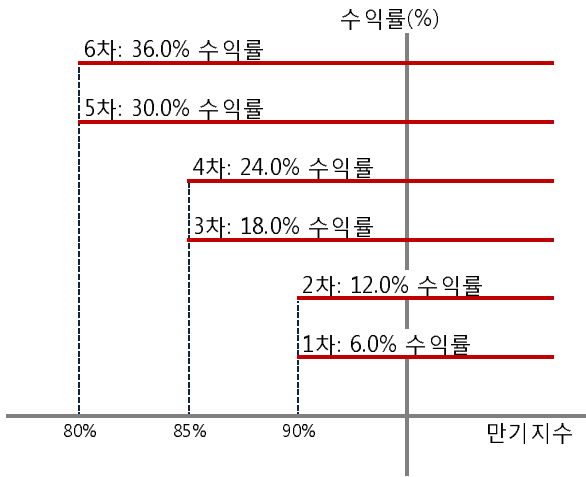
1. 계약금액

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

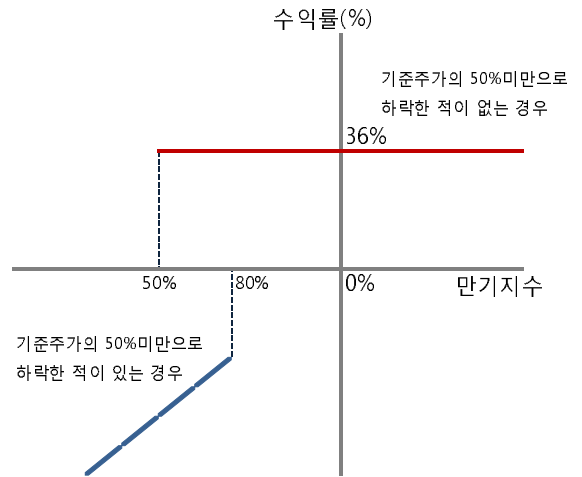
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	8.00%	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	64.74	55.68	46.62	37.56	28.50	19.44	10.38
	5.33%	55.63	46.57	37.51	28.45	19.39	10.33	1.27
	2.67%	43.11	34.05	24.99	15.93	6.87	(2.19)	(11.25)
	0.00%	27.18	18.12	9.06	0.00	(9.06)	(18.12)	(27.18)
	-2.67%	7.84	(1.22)	(10.28)	(19.34)	(28.39)	(37.45)	(46.51)
	-5.33%	(14.90)	(23.96)	(33.02)	(42.08)	(51.14)	(60.20)	(69.26)
	-8.00%	(41.05)	(50.11)	(59.17)	(68.23)	(77.29)	(86.35)	(95.41)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512107048	대신증권(ELS)1029	95.41
총 최대손실 예상금액		95.41

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 82.22

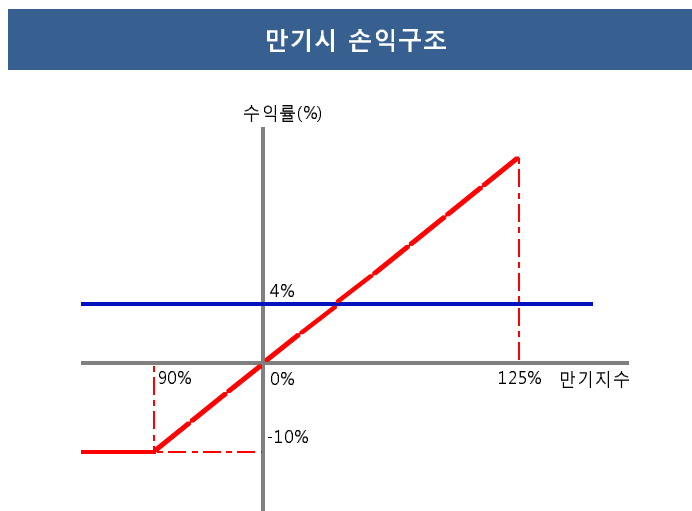
메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

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	445	0	445	장외

2. 만기시점의 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%	10.06	9.27	8.48	7.69	6.90	6.11	5.32
	5.33%	7.79	7.00	6.22	5.43	4.64	3.85	3.06
	2.67%	5.23	4.44	3.65	2.86	2.07	1.29	0.50
	0.00%	2.37	1.58	0.79	0.00	(0.79)	(1.58)	(2.37)
	-2.67%	(0.80)	(1.58)	(2.37)	(3.16)	(3.95)	(4.74)	(5.53)
	-5.33%	(4.26)	(5.04)	(5.83)	(6.62)	(7.41)	(8.20)	(8.99)
	-8.00%	(8.02)	(8.80)	(9.59)	(10.38)	(11.17)	(11.96)	(12.75)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503339048	신한투자(ELS)1447	12.75
총 최대손실 예상금액		12.75

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.72
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

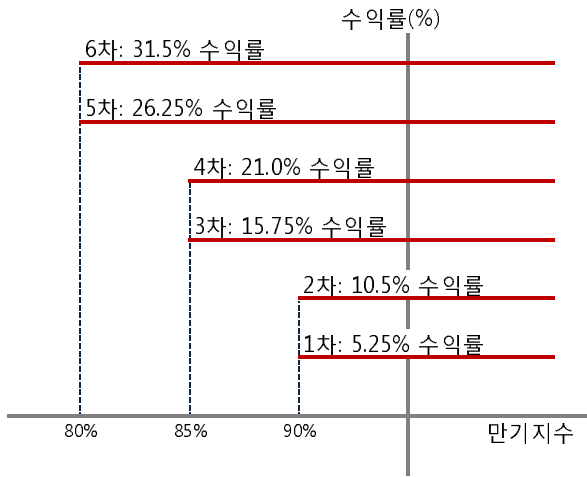
1. 계약금액

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

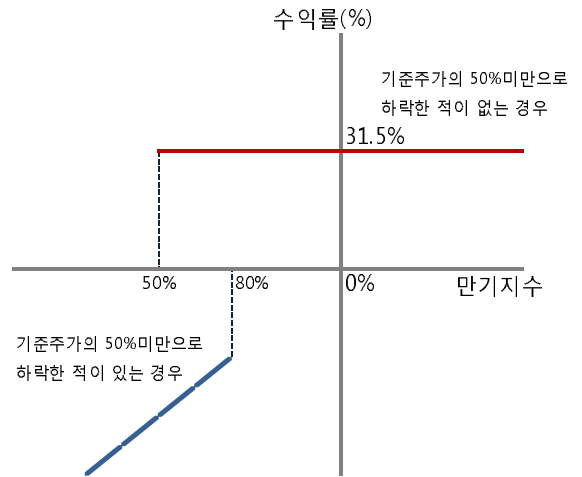
단위(백만원)

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 자산 시나리오	8.00%	23.52	19.24	14.96	10.68	6.40	2.12	(2.16)
	5.33%	23.48	19.20	14.92	10.64	6.36	2.08	(2.21)
	2.67%	19.92	15.64	11.36	7.08	2.80	(1.48)	(5.77)
	0.00%	12.84	8.56	4.28	0.00	(4.28)	(8.56)	(12.84)
	-2.67%	2.25	(2.03)	(6.31)	(10.59)	(14.87)	(19.15)	(23.43)
	-5.33%	(11.86)	(16.14)	(20.42)	(24.70)	(28.98)	(33.26)	(37.54)
	-8.00%	(29.48)	(33.76)	(38.04)	(42.32)	(46.60)	(50.88)	(55.17)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513135048	대신증권(ELS)1059	55.17
총 최대손실 예상금액		55.17

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	53.43
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

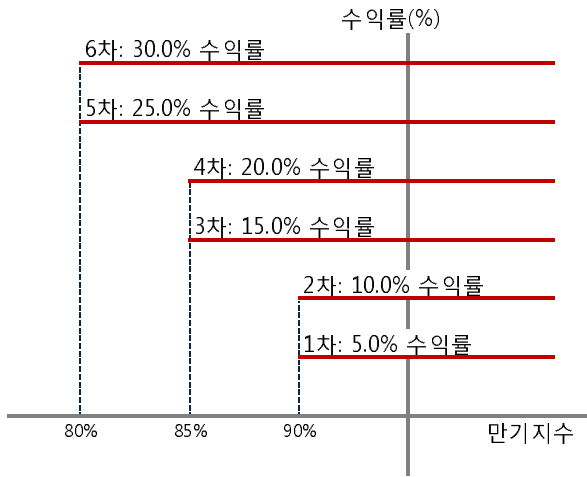
1. 계약금액

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

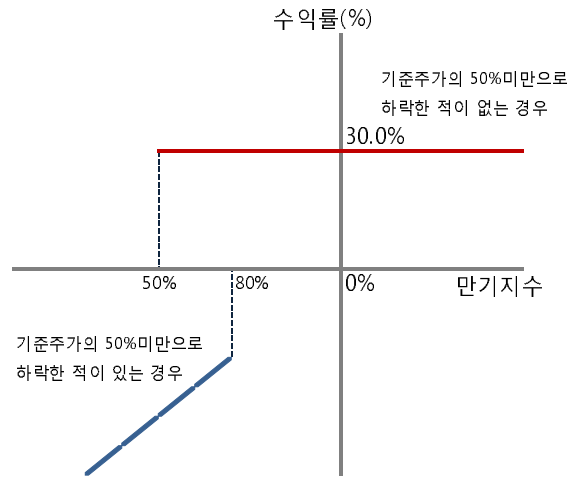
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	9.10	7.36	5.62	3.88	2.14	0.40	(1.34)
	5.33%	9.68	7.94	6.20	4.46	2.72	0.98	(0.76)
	2.67%	8.39	6.65	4.91	3.17	1.43	(0.31)	(2.05)
	0.00%	5.22	3.48	1.74	0.00	(1.74)	(3.48)	(5.22)
	-2.67%	0.17	(1.57)	(3.31)	(5.05)	(6.79)	(8.53)	(10.27)
	-5.33%	(6.75)	(8.49)	(10.23)	(11.97)	(13.71)	(15.45)	(17.19)
	-8.00%	(15.55)	(17.29)	(19.03)	(20.77)	(22.51)	(24.25)	(25.99)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513118051	대신증권(ELS)1072	25.99
총 최대손실 예상금액		25.99

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	23.81
-----	-------

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

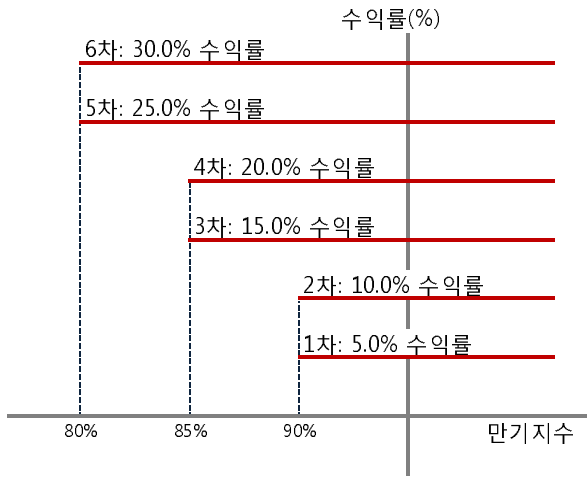
공시일: 2010-08-16

1. 계약금액

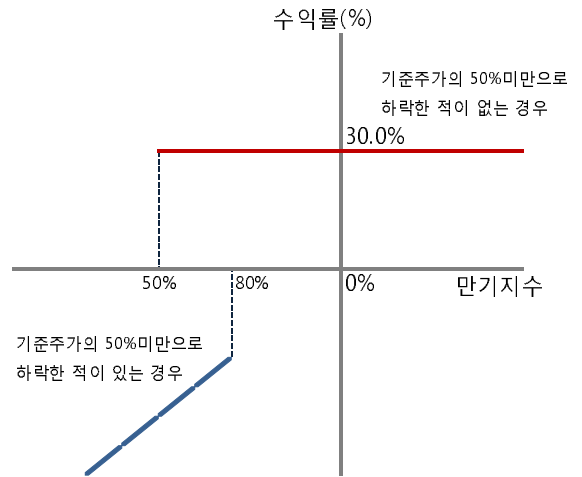
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,347	0	1,347	장외

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	8.00%	22.71	19.68	16.65	13.62	10.59	7.56	4.53
자산	5.33%	20.38	17.35	14.32	11.29	8.26	5.23	2.20
시나리오	2.67%	15.84	12.81	9.78	6.75	3.72	0.69	(2.34)
	0.00%	9.09	6.06	3.03	0.00	(3.03)	(6.06)	(9.09)
	-2.67%	0.13	(2.90)	(5.93)	(8.96)	(11.99)	(15.02)	(18.05)
	-5.33%	(11.04)	(14.07)	(17.10)	(20.13)	(23.16)	(26.19)	(29.22)
	-8.00%	(24.42)	(27.45)	(30.48)	(33.50)	(36.53)	(39.56)	(42.59)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	42.59
총 최대손실 예상금액		42.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 39.20

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

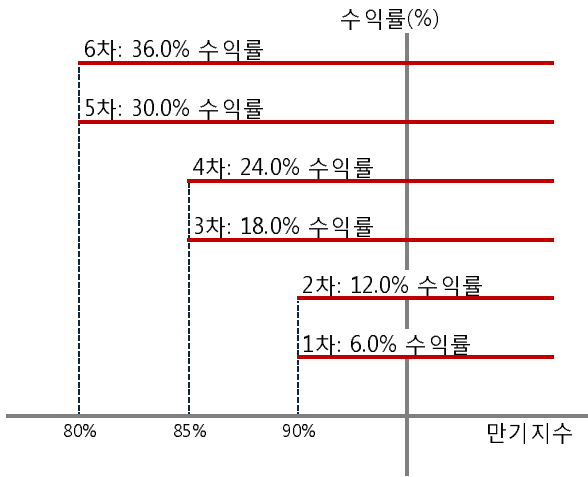
공시일: 2010-08-16

1. 계약금액

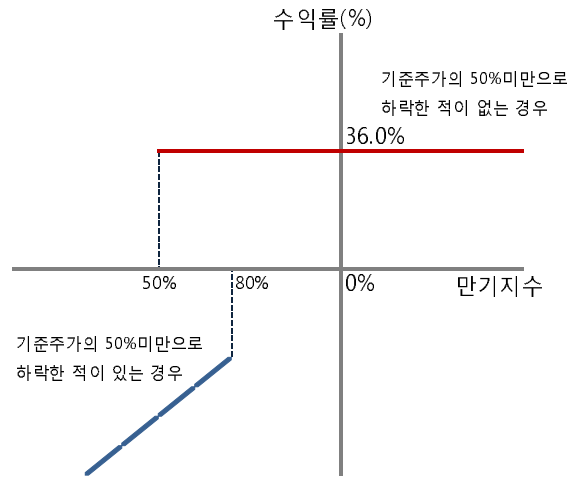
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	1.75	1.39	1.03	0.66	0.30	(0.06)	(0.42)
	5.33%	1.85	1.49	1.13	0.77	0.40	0.04	(0.32)
	2.67%	1.63	1.27	0.91	0.55	0.18	(0.18)	(0.54)
	0.00%	1.09	0.72	0.36	0.00	(0.36)	(0.72)	(1.09)
	-2.67%	0.22	(0.15)	(0.51)	(0.87)	(1.23)	(1.59)	(1.96)
	-5.33%	(0.98)	(1.34)	(1.70)	(2.06)	(2.42)	(2.79)	(3.15)
	-8.00%	(2.49)	(2.86)	(3.22)	(3.58)	(3.94)	(4.30)	(4.67)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6509358059	신한투자(ELS)1506	4.67
총 최대손실 예상금액		4.67

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.88
-----	------

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

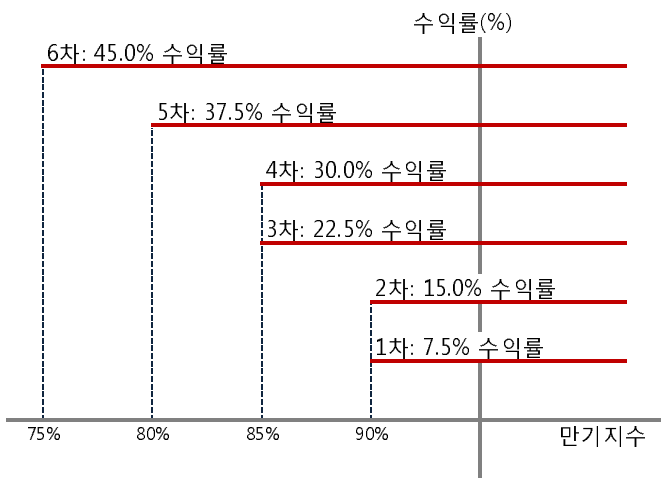
1. 계약금액

단위(백만원)

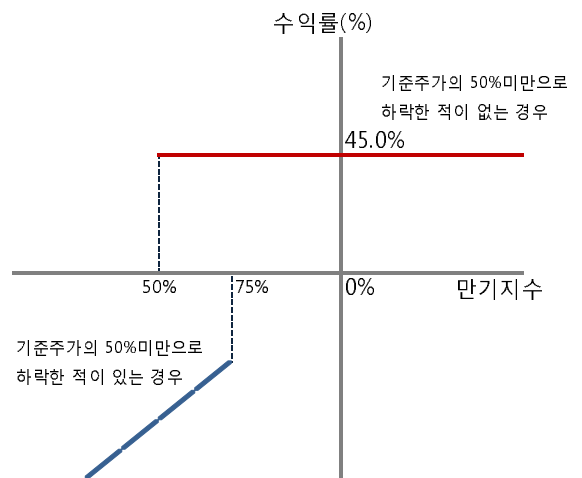
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

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%	17.82	14.79	11.77	8.74	5.71	2.69	(0.34)
	5.33%	15.46	12.43	9.41	6.38	3.36	0.33	(2.70)
	2.67%	12.55	9.52	6.49	3.47	0.44	(2.58)	(5.61)
	0.00%	9.08	6.05	3.03	0.00	(3.03)	(6.05)	(9.08)
	-2.67%	5.05	2.03	(1.00)	(4.02)	(7.05)	(10.08)	(13.10)
	-5.33%	0.48	(2.55)	(5.58)	(8.60)	(11.63)	(14.65)	(17.68)
	-8.00%	(4.66)	(7.68)	(10.71)	(13.74)	(16.76)	(19.79)	(22.81)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6519101069	대신증권(ELS)1101	22.81
총 최대손실 예상금액		22.81

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.38
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

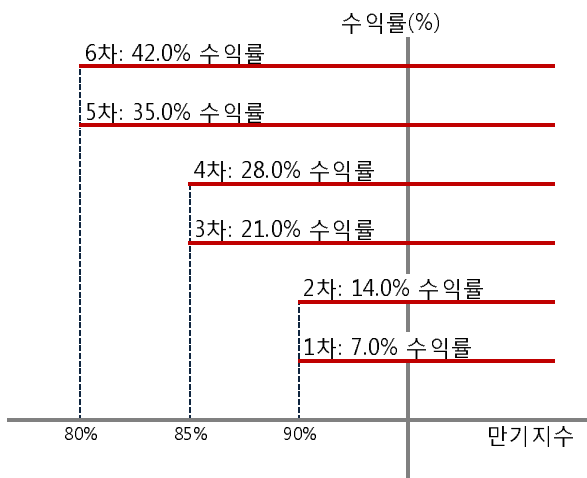
1. 계약금액

단위(백만원)

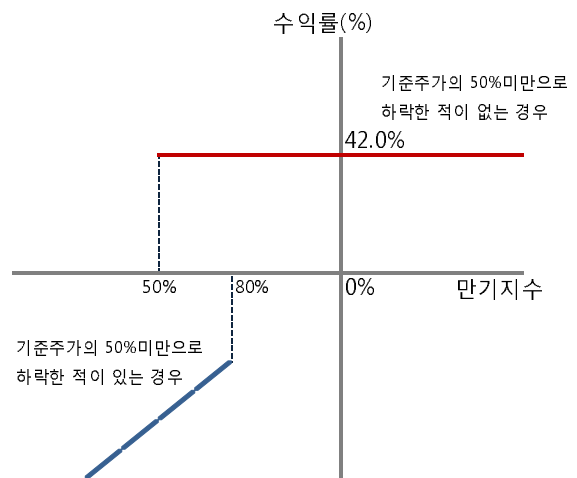
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

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%	16.66	13.28	9.90	6.52	3.14	(0.24)	(3.62)
	5.33%	16.25	12.87	9.49	6.11	2.73	(0.65)	(4.03)
	2.67%	14.07	10.69	7.31	3.93	0.55	(2.83)	(6.21)
	0.00%	10.14	6.76	3.38	0.00	(3.38)	(6.76)	(10.14)
	-2.67%	4.44	1.06	(2.32)	(5.70)	(9.08)	(12.46)	(15.84)
	-5.33%	(3.02)	(6.40)	(9.78)	(13.16)	(16.54)	(19.92)	(23.30)
	-8.00%	(12.24)	(15.62)	(19.00)	(22.38)	(25.76)	(29.14)	(32.52)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513121063	대신증권(ELS)1120	32.52
총 최대손실 예상금액		32.52

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	30.77
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-16

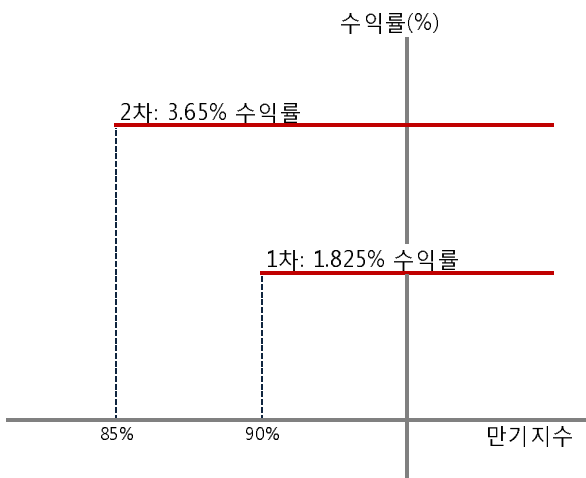
1. 계약금액

단위(백만원)

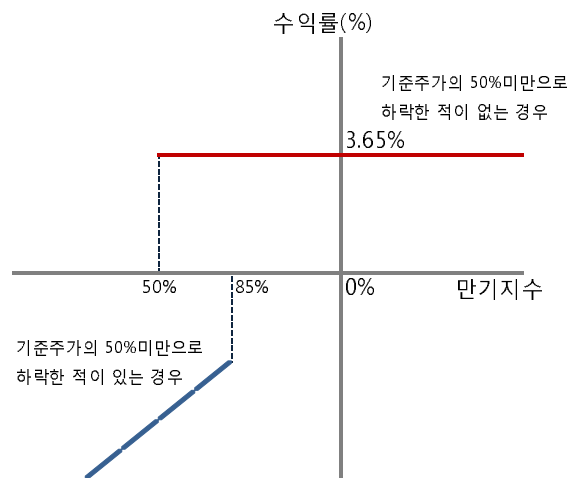
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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%	3.87	3.87	3.87	3.87	3.87	3.88	3.88
	5.33%	1.67	1.67	1.68	1.68	1.68	1.68	1.68
	2.67%	0.38	0.38	0.38	0.39	0.39	0.39	0.39
	0.00%	(0.01)	(0.00)	(0.00)	0.00	0.00	0.00	0.01
	-2.67%	0.51	0.51	0.51	0.52	0.52	0.52	0.52
	-5.33%	1.93	1.93	1.94	1.94	1.94	1.94	1.94
	-8.00%	4.26	4.26	4.26	4.26	4.26	4.27	4.27

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553352065	우리투자증권(ELS)3254	0.01
총 최대손실 예상금액		0.01

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1.09