

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

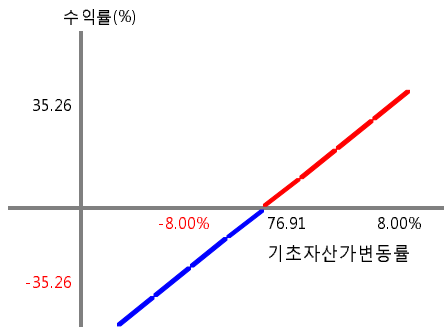
공시일: 2010-08-31

1. 계약금액

단위(백만원)

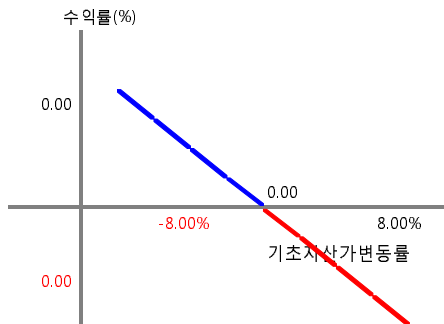
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내

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%	35.26
	5.33%	23.49
	2.67%	11.77
	0.00%	0.00
	-2.67%	-11.77
	-5.33%	-23.49
-8.00%	-35.26	

최대손실 시나리오

위험액	-35.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	142.87
-----	--------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

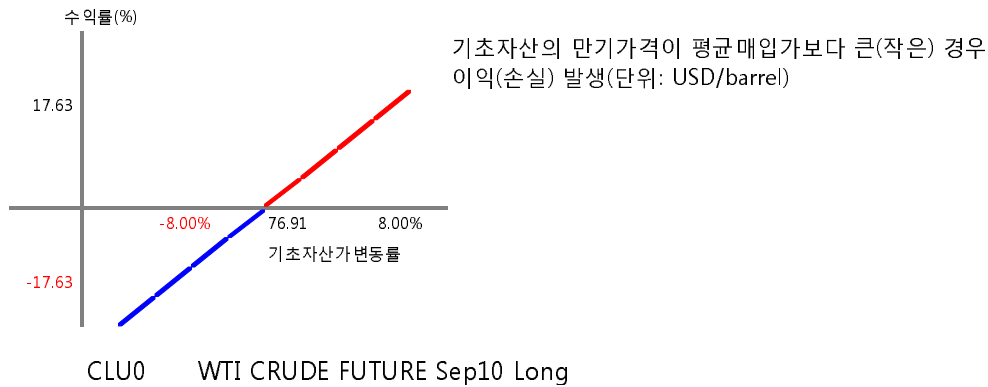
공시일: 2010-08-31

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%	35.26
	5.33%	23.49
	2.67%	11.77
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-11.77
	-5.33%	-23.49
	-8.00%	-35.26

최대손실 시나리오

위험액	-35.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	94.16
-----	-------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

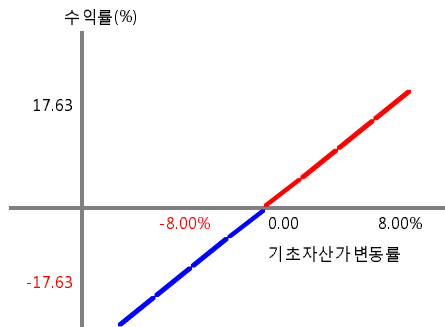
공시일: 2010-08-31

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

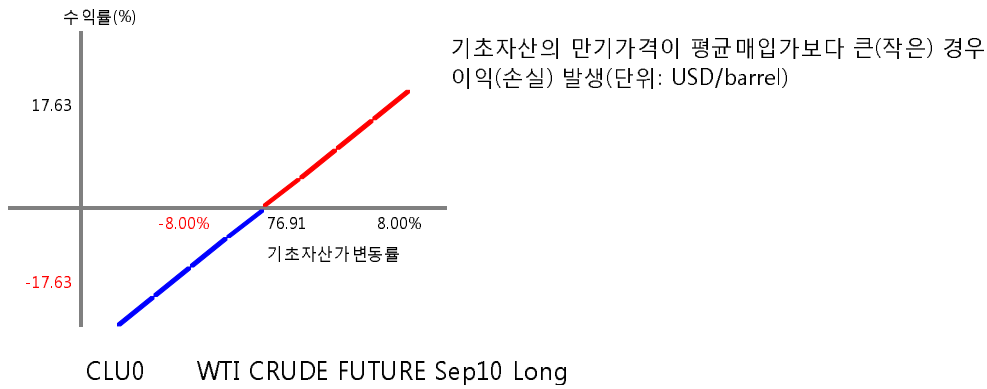
공시일: 2010-08-31

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	47.86
	5.33%	31.89
	2.67%	15.97
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-15.97
	-5.33%	-31.89
	-8.00%	-47.86

최대손실 시나리오

위험액	-47.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	190.42
-----	--------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

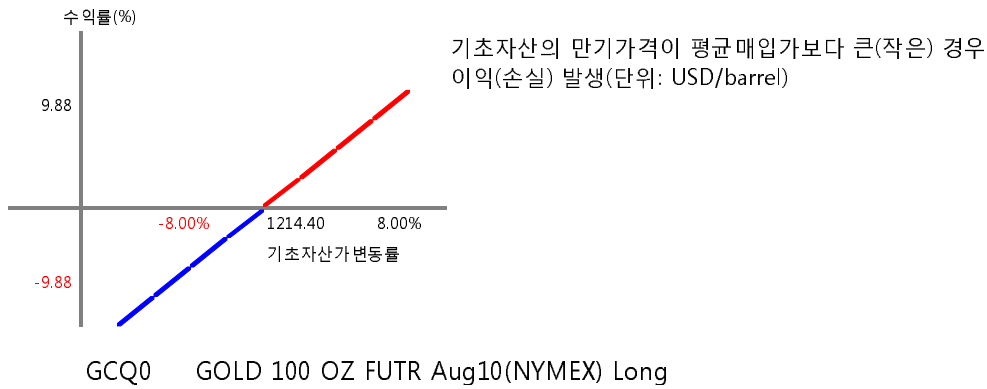
공시일: 2010-08-31

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

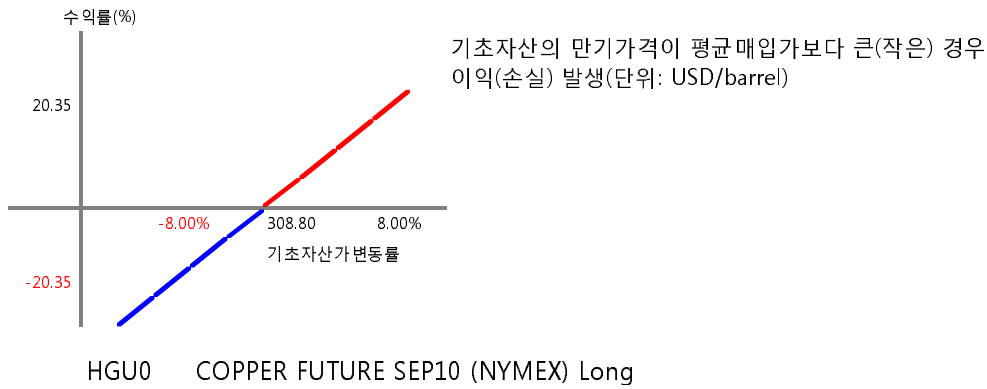
공시일: 2010-08-31

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

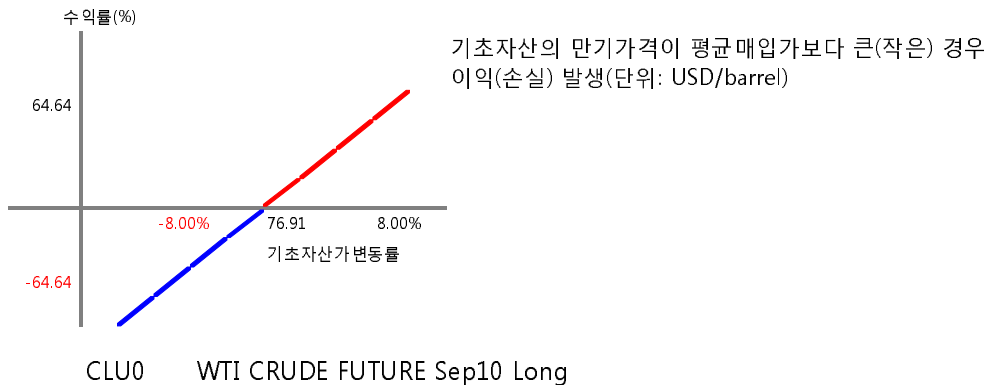
공시일: 2010-08-31

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%	64.64
	5.33%	43.07
	2.67%	21.57
	0.00%	0.00
시나리오	-2.67%	-21.57
	-5.33%	-43.07
	-8.00%	-64.64

최대손실 시나리오	
위험액	-64.64

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	243.50
-----	--------

메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

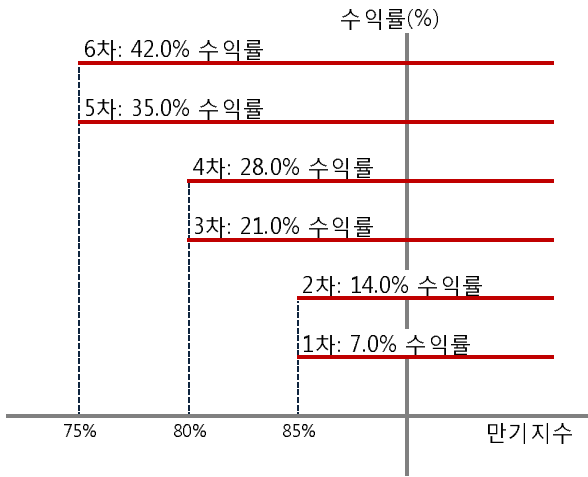
공시일: 2010-08-31

1. 계약금액

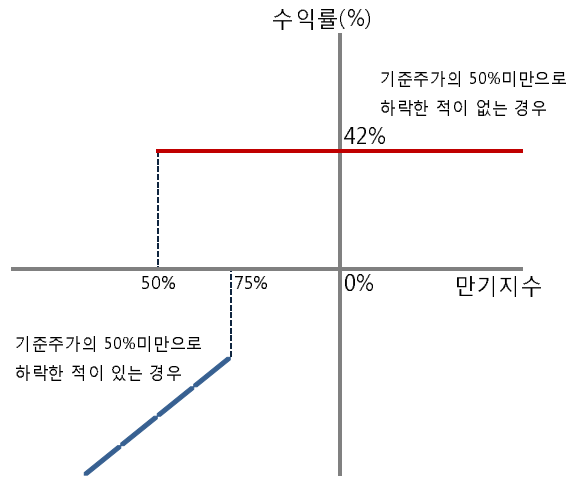
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장외

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%	(31.07)	(32.83)	(34.60)	(36.37)	(38.13)	(39.90)	(41.66)
자산	5.33%	(7.73)	(9.50)	(11.27)	(13.03)	(14.80)	(16.57)	(18.33)
시나리오	2.67%	4.39	2.62	0.86	(0.91)	(2.68)	(4.44)	(6.21)
	0.00%	5.30	3.53	1.77	0.00	(1.77)	(3.53)	(5.30)
	-2.67%	(5.00)	(6.77)	(8.53)	(10.30)	(12.07)	(13.83)	(15.60)
	-5.33%	(26.51)	(28.28)	(30.05)	(31.81)	(33.58)	(35.34)	(37.11)
	-8.00%	(59.23)	(61.00)	(62.77)	(64.53)	(66.30)	(68.07)	(69.83)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502333034	신한투자(ELS)1395	69.83
총 최대손실 예상금액		69.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	42.66
-----	-------

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-31

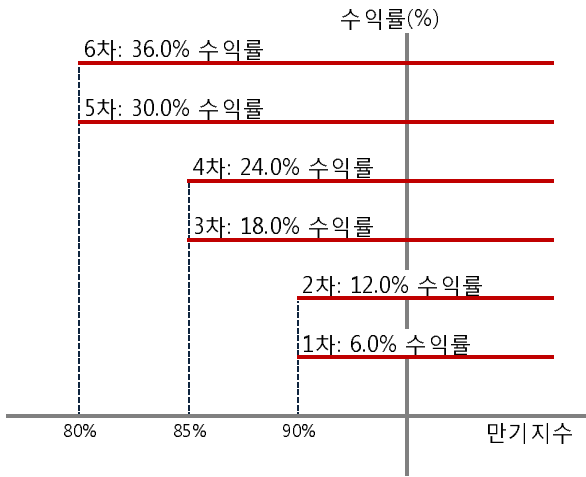
1. 계약금액

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

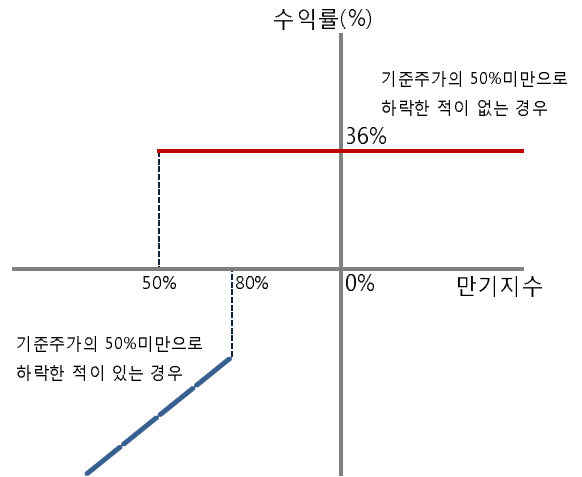
단위(백만원)

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 시나 리오	8.00%	93.31	77.82	62.34	46.86	31.38	15.90	0.42
	5.33%	80.10	64.62	49.13	33.65	18.17	2.69	(12.79)
	2.67%	64.48	48.99	33.51	18.03	2.55	(12.93)	(28.41)
	0.00%	46.44	30.96	15.48	0.00	(15.48)	(30.96)	(46.44)
	-2.67%	26.00	10.52	(4.96)	(20.44)	(35.93)	(51.41)	(66.89)
	-5.33%	3.14	(12.34)	(27.82)	(43.30)	(58.78)	(74.26)	(89.74)
	-8.00%	(22.13)	(37.61)	(53.09)	(68.57)	(84.05)	(99.53)	(115.01)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	115.01
총 최대손실 예상금액		115.01

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	104.50
-----	--------

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

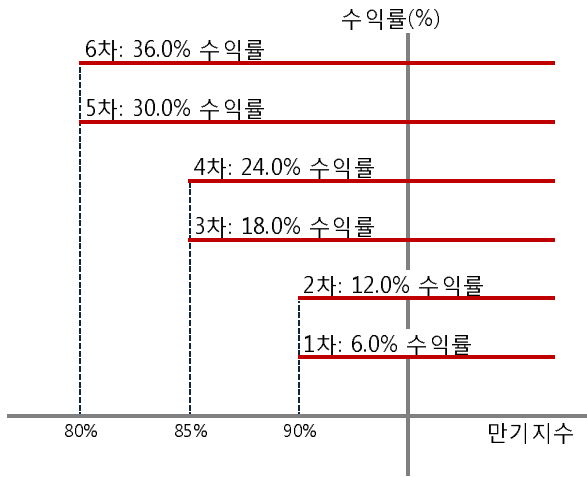
공시일: 2010-08-31

1. 계약금액

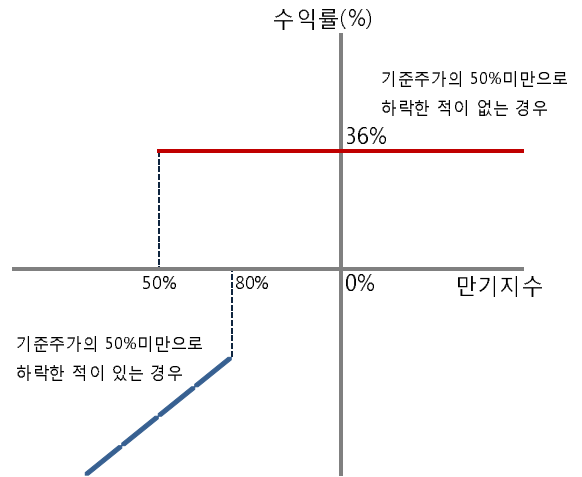
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	21.53	17.58	13.63	9.67	5.72	1.77	(2.18)
	5.33%	20.78	16.83	12.88	8.93	4.97	1.02	(2.93)
	2.67%	17.55	13.60	9.65	5.70	1.75	(2.20)	(6.15)
	0.00%	11.85	7.90	3.95	0.00	(3.95)	(7.90)	(11.85)
	-2.67%	3.68	(0.27)	(4.22)	(8.18)	(12.13)	(16.08)	(20.03)
	-5.33%	(6.97)	(10.92)	(14.87)	(18.83)	(22.78)	(26.73)	(30.68)
	-8.00%	(20.10)	(24.05)	(28.00)	(31.95)	(35.90)	(39.85)	(43.80)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6512107048	대신증권(ELS)1029	43.80
총 최대손실 예상금액		43.80

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	67.20
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-31

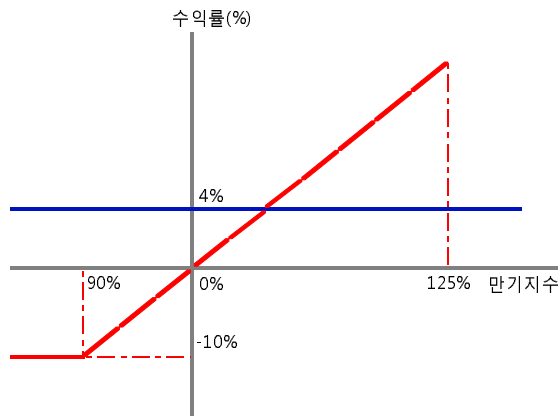
1. 계약금액

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 자산 시나 리오	8.00%	11.20	10.24	9.29	8.33	7.38	6.42	5.47
	5.33%	8.84	7.89	6.94	5.98	5.03	4.07	3.12
	2.67%	6.07	5.11	4.16	3.20	2.25	1.29	0.34
	0.00%	2.86	1.91	0.95	0.00	(0.95)	(1.91)	(2.86)
	-2.67%	(0.77)	(1.72)	(2.67)	(3.63)	(4.58)	(5.54)	(6.49)
	-5.33%	(4.82)	(5.78)	(6.73)	(7.68)	(8.64)	(9.59)	(10.55)
	-8.00%	(9.30)	(10.26)	(11.21)	(12.16)	(13.12)	(14.07)	(15.03)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503339048	신한투자(ELS)1447	15.03
총 최대손실 예상금액		15.03

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.32
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

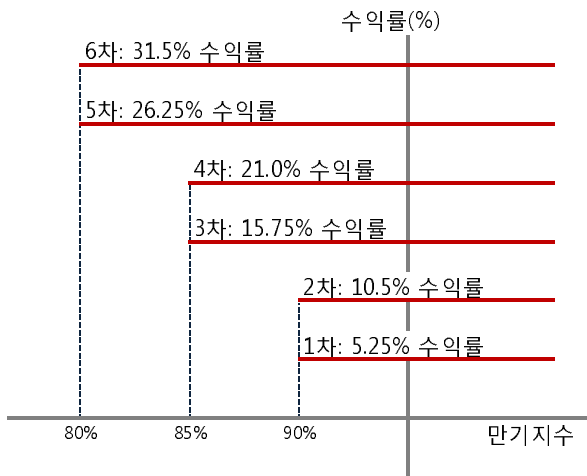
공시일: 2010-08-31

1. 계약금액

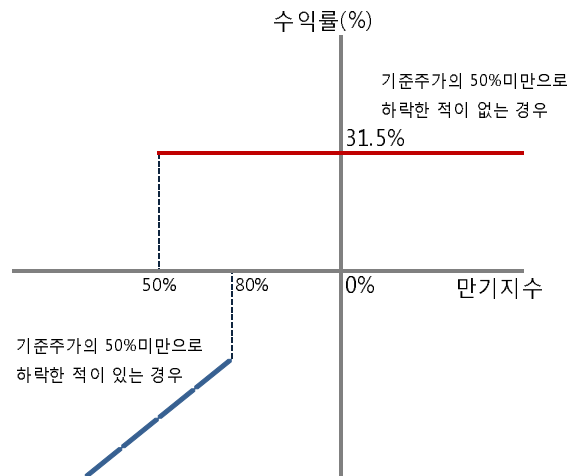
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장외

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 시나리오	8.00%	0.09	(2.90)	(5.89)	(8.88)	(11.87)	(14.86)	(17.85)
	5.33%	4.96	1.97	(1.02)	(4.01)	(7.00)	(9.99)	(12.98)
	2.67%	7.92	4.93	1.94	(1.05)	(4.04)	(7.03)	(10.02)
	0.00%	8.97	5.98	2.99	0.00	(2.99)	(5.98)	(8.97)
	-2.67%	8.10	5.11	2.12	(0.87)	(3.86)	(6.85)	(9.84)
	-5.33%	5.32	2.33	(0.66)	(3.65)	(6.64)	(9.63)	(12.62)
	-8.00%	0.63	(2.36)	(5.35)	(8.34)	(11.33)	(14.32)	(17.31)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513135048	대신증권(ELS)1059	17.85
총 최대손실 예상금액		17.85

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 12.59

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-31

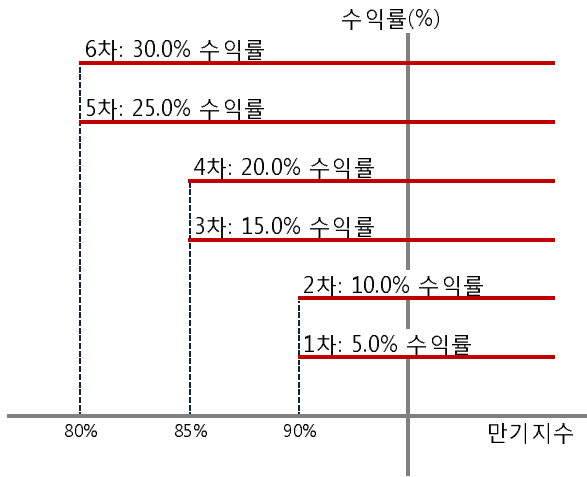
1. 계약금액

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

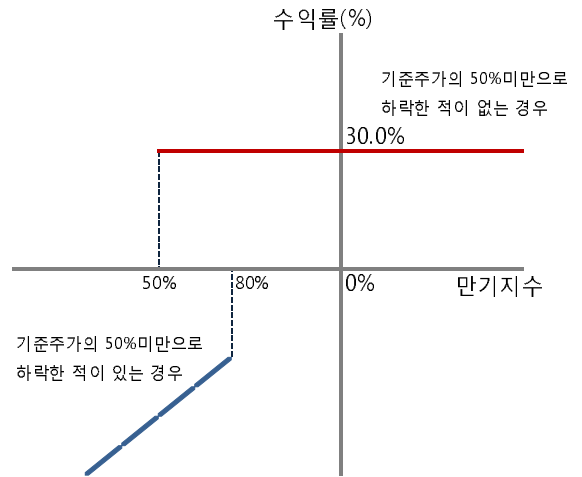
단위(백만원)

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%	1.99	1.01	0.04	(0.94)	(1.91)	(2.89)	(3.86)
	5.33%	2.92	1.95	0.97	(0.01)	(0.98)	(1.96)	(2.93)
	2.67%	3.23	2.26	1.28	0.31	(0.67)	(1.65)	(2.62)
	0.00%	2.93	1.95	0.98	0.00	(0.98)	(1.95)	(2.93)
	-2.67%	2.00	1.03	0.05	(0.93)	(1.90)	(2.88)	(3.85)
	-5.33%	0.46	(0.52)	(1.50)	(2.47)	(3.45)	(4.42)	(5.40)
	-8.00%	(1.71)	(2.68)	(3.66)	(4.64)	(5.61)	(6.59)	(7.56)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513118051	대신증권(ELS)1072	7.56
총 최대손실 예상금액		7.56

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.81
-----	------

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-31

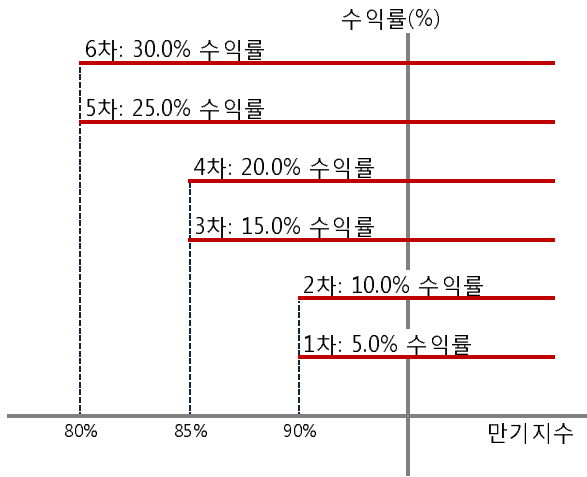
1. 계약금액

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

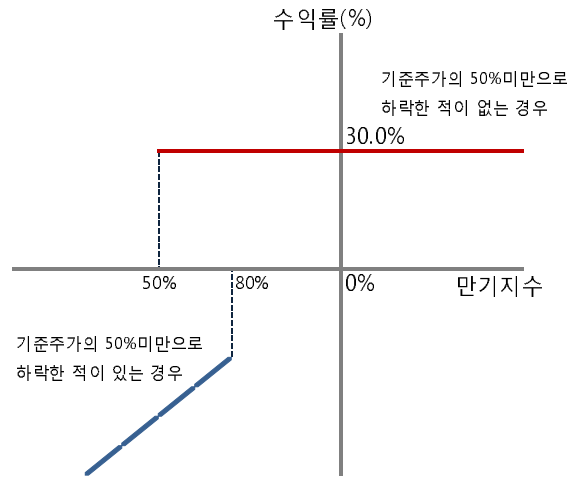
단위(백만원)

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 시나 리오	8.00%	7.61	5.51	3.41	1.31	(0.80)	(2.90)	(5.00)
	5.33%	8.80	6.69	4.59	2.49	0.38	(1.72)	(3.82)
	2.67%	8.36	6.26	4.16	2.05	(0.05)	(2.15)	(4.26)
	0.00%	6.31	4.21	2.10	0.00	(2.10)	(4.21)	(6.31)
	-2.67%	2.64	0.54	(1.57)	(3.67)	(5.77)	(7.88)	(9.98)
	-5.33%	(2.65)	(4.75)	(6.85)	(8.96)	(11.06)	(13.16)	(15.27)
	-8.00%	(9.55)	(11.66)	(13.76)	(15.86)	(17.96)	(20.07)	(22.17)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	22.17
총 최대손실 예상금액		22.17

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 23.86

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

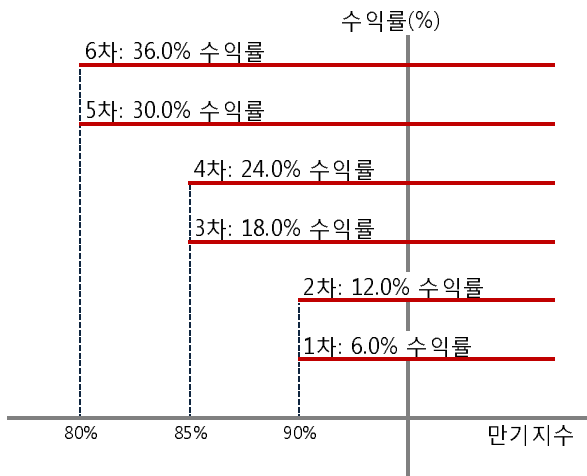
공시일: 2010-08-31

1. 계약금액

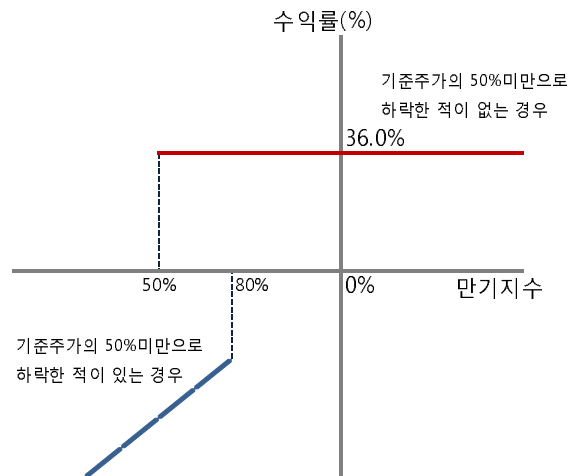
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	0.83	0.62	0.40	0.19	(0.02)	(0.24)	(0.45)
자산	5.33%	0.81	0.60	0.38	0.17	(0.04)	(0.26)	(0.47)
시나리오	2.67%	0.74	0.53	0.32	0.11	(0.11)	(0.32)	(0.53)
	0.00%	0.64	0.43	0.21	0.00	(0.21)	(0.43)	(0.64)
	-2.67%	0.49	0.27	0.06	(0.15)	(0.36)	(0.58)	(0.79)
	-5.33%	0.29	0.08	(0.13)	(0.35)	(0.56)	(0.77)	(0.98)
	-8.00%	0.05	(0.16)	(0.37)	(0.58)	(0.80)	(1.01)	(1.22)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6509358059	신한투자(ELS)1506	1.22
총 최대손실 예상금액		1.22

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.18
-----	------

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-31

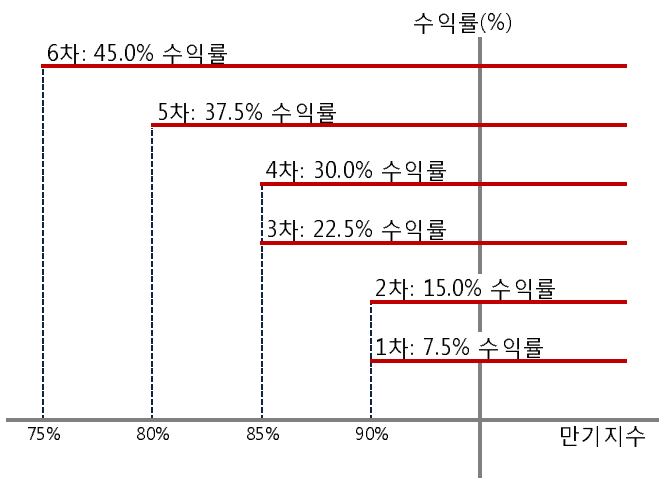
1. 계약금액

단위(백만원)

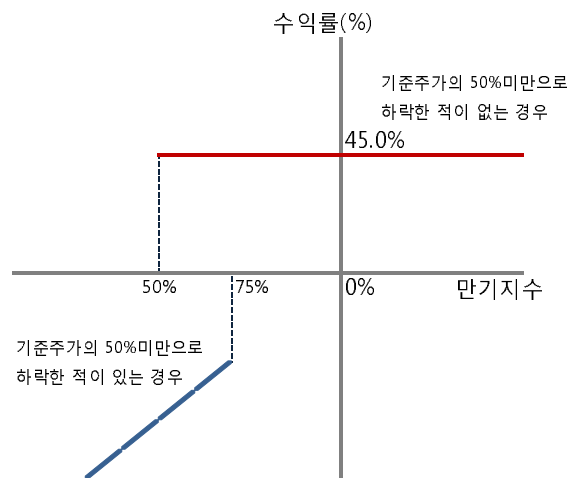
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

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%	12.85	10.14	7.42	4.71	2.00	(0.71)	(3.43)
	5.33%	11.83	9.12	6.41	3.70	0.98	(1.73)	(4.44)
	2.67%	10.26	7.55	4.84	2.13	(0.59)	(3.30)	(6.01)
	0.00%	8.14	5.42	2.71	0.00	(2.71)	(5.42)	(8.14)
	-2.67%	5.46	2.74	0.03	(2.68)	(5.39)	(8.11)	(10.82)
	-5.33%	2.22	(0.49)	(3.21)	(5.92)	(8.63)	(11.34)	(14.06)
	-8.00%	(1.58)	(4.29)	(7.00)	(9.71)	(12.42)	(15.14)	(17.85)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6519101069	대신증권(ELS)1101	17.85
총 최대손실 예상금액		17.85

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	18.09
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-31

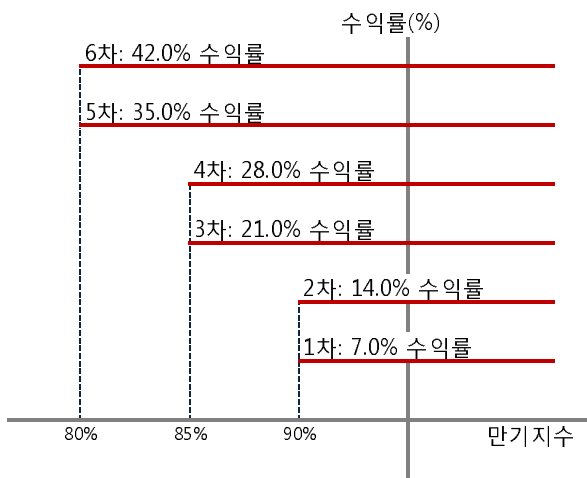
1. 계약금액

단위(백만원)

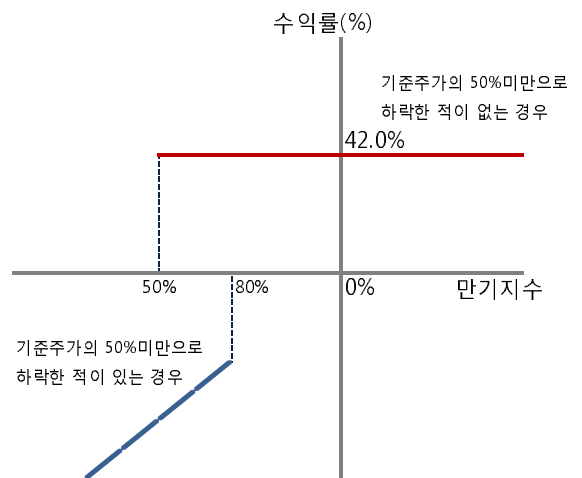
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

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%	7.61	5.37	3.13	0.89	(1.35)	(3.59)	(5.83)
	5.33%	7.53	5.29	3.05	0.81	(1.43)	(3.67)	(5.91)
	2.67%	7.24	5.00	2.76	0.52	(1.72)	(3.96)	(6.20)
	0.00%	6.72	4.48	2.24	0.00	(2.24)	(4.48)	(6.72)
	-2.67%	5.98	3.74	1.50	(0.74)	(2.98)	(5.22)	(7.46)
	-5.33%	5.02	2.78	0.54	(1.70)	(3.94)	(6.18)	(8.42)
	-8.00%	3.83	1.59	(0.65)	(2.89)	(5.13)	(7.37)	(9.61)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513121063	대신증권(ELS)1120	9.61
총 최대손실 예상금액		9.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 8.83

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-31

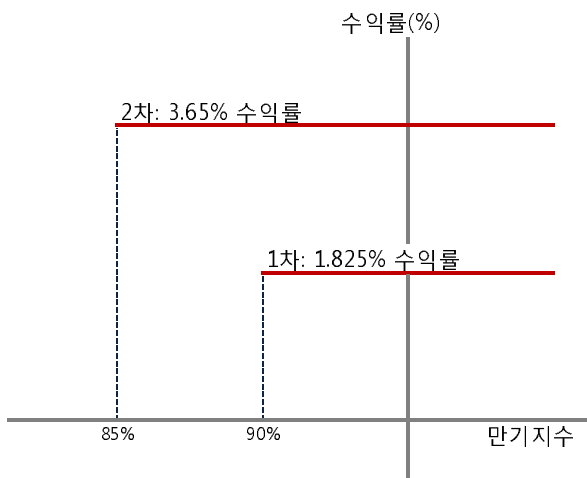
1. 계약금액

단위(백만원)

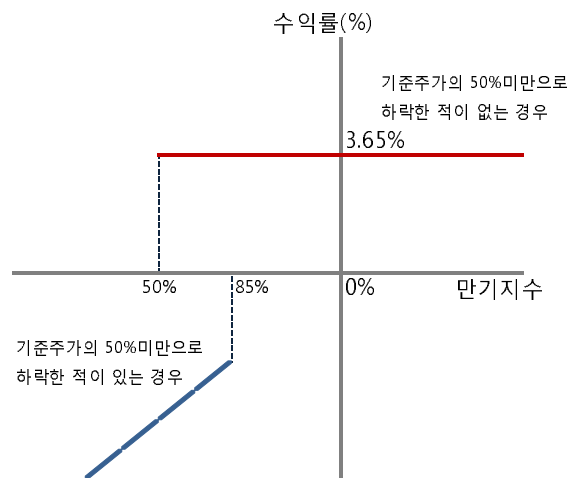
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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 시나리오	8.00%	1.18	1.18	1.18	1.18	1.18	1.18	1.18
	5.33%	0.52	0.52	0.52	0.52	0.52	0.52	0.52
	2.67%	0.13	0.13	0.13	0.13	0.13	0.13	0.13
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.13	0.13	0.13	0.13	0.13	0.13	0.13
	-5.33%	0.52	0.52	0.52	0.52	0.52	0.52	0.52
	-8.00%	1.18	1.18	1.18	1.18	1.18	1.18	1.18

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553352065	우리투자증권(ELS)3254	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00