

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

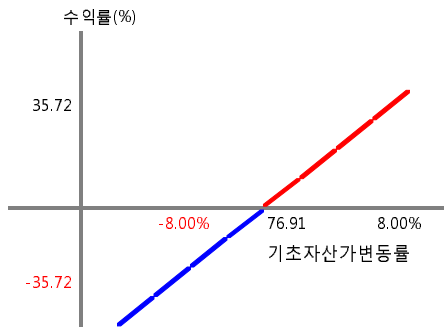
공시일: 2010-09-01

1. 계약금액

단위(백만원)

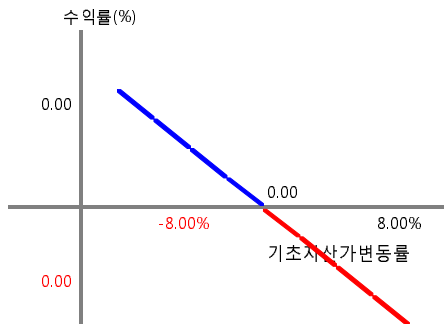
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내

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%	35.72
	5.33%	23.80
	2.67%	11.92
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-11.92
	-5.33%	-23.80
	-8.00%	-35.72

최대손실 시나리오

위험액	-35.72
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	144.76
-----	--------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

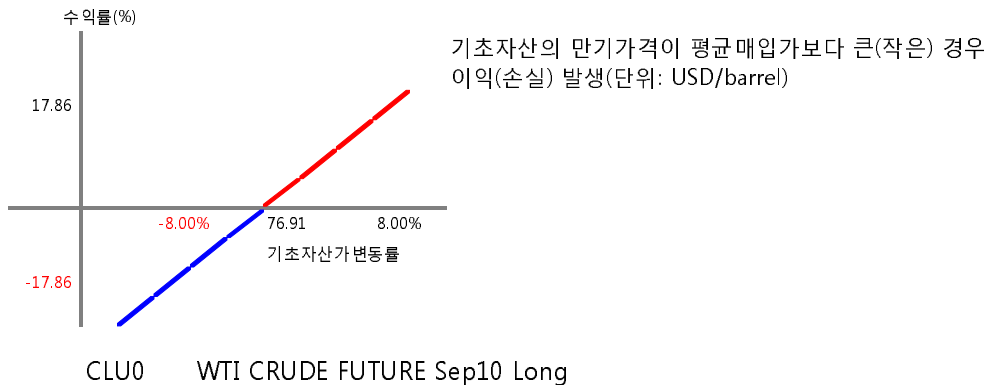
공시일: 2010-09-01

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%	35.72
	5.33%	23.80
	2.67%	11.92
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-11.92
	-5.33%	-23.80
	-8.00%	-35.72

최대손실 시나리오

위험액	-35.72
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	95.09
-----	-------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

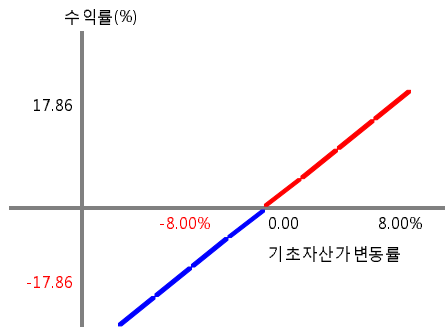
공시일: 2010-09-01

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

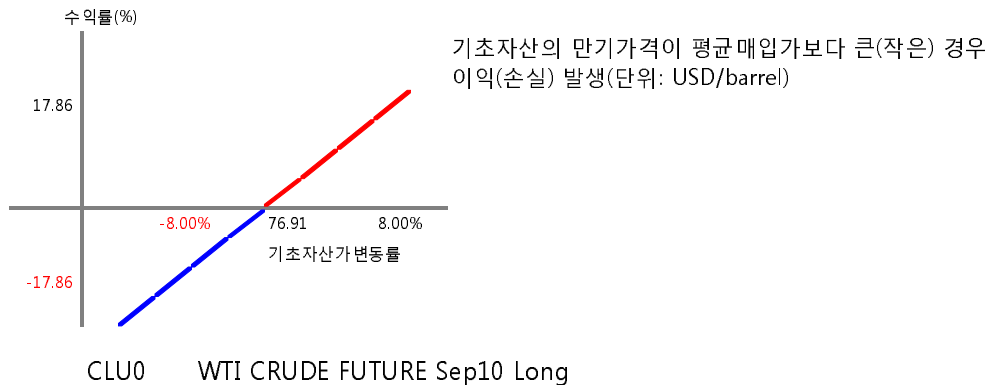
공시일: 2010-09-01

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%	47.92
	5.33%	31.93
	2.67%	15.99
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-15.99
	-5.33%	-31.93
	-8.00%	-47.92

최대손실 시나리오

위험액	-47.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	190.66
-----	--------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

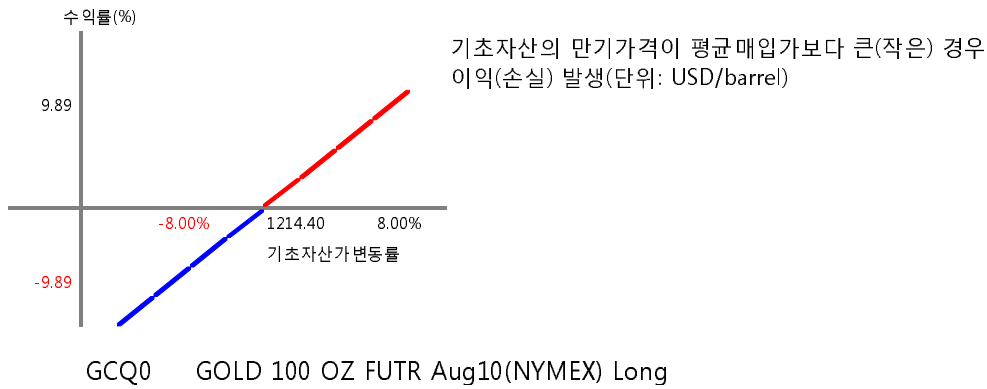
공시일: 2010-09-01

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

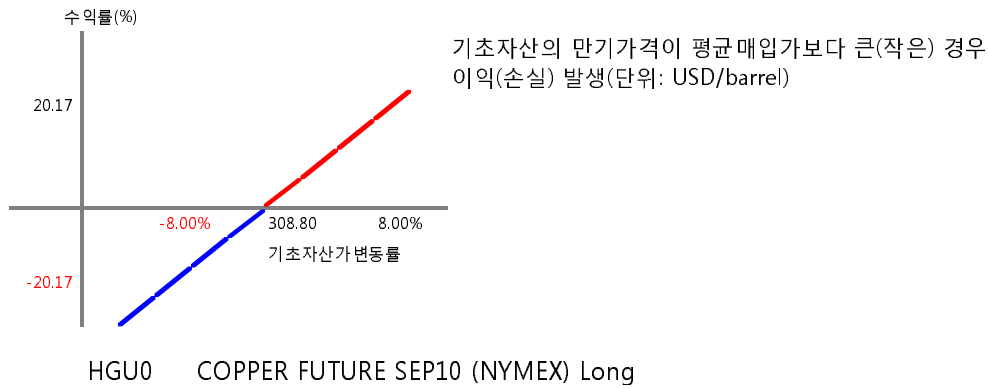
공시일: 2010-09-01

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

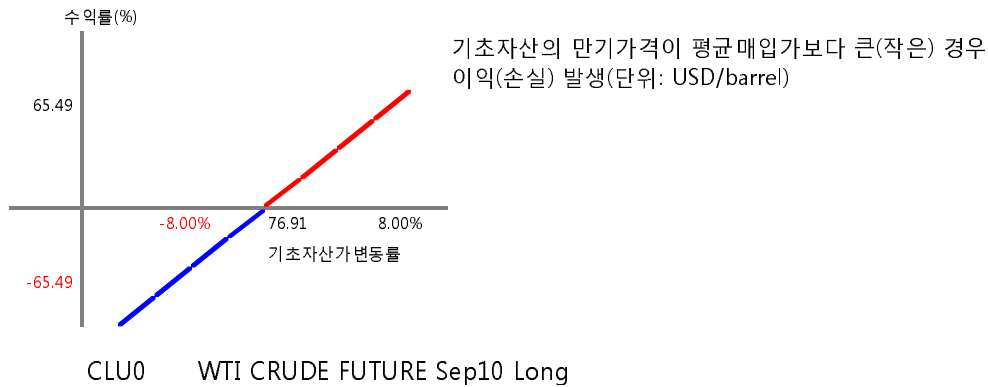
공시일: 2010-09-01

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%	65.49
	5.33%	43.63
	2.67%	21.86
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-21.86
	-5.33%	-43.63
	-8.00%	-65.49

최대손실 시나리오	
위험액	-65.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	246.72
-----	--------

메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

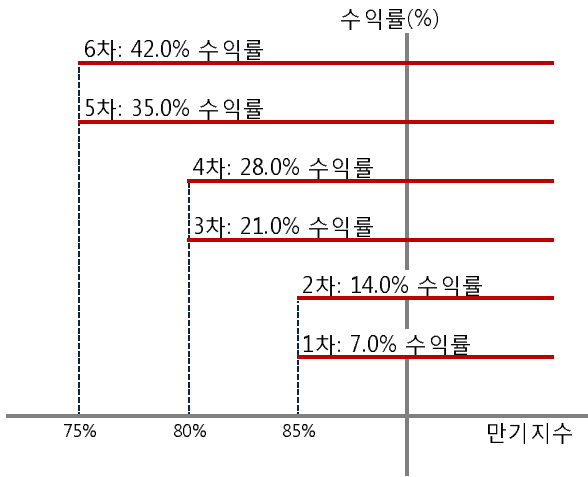
1. 계약금액

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

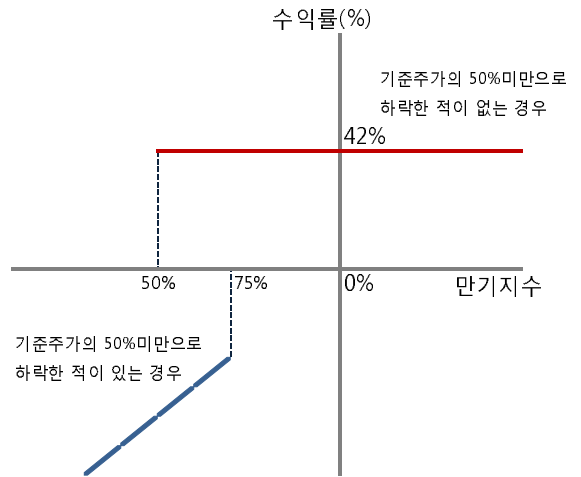
단위(백만원)

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%	(62.84)	(65.34)	(67.83)	(70.33)	(72.83)	(75.32)	(77.82)
	5.33%	(15.81)	(18.30)	(20.80)	(23.29)	(25.79)	(28.29)	(30.78)
	2.67%	7.64	5.14	2.65	0.15	(2.35)	(4.84)	(7.34)
	0.00%	7.49	4.99	2.50	0.00	(2.50)	(4.99)	(7.49)
	-2.67%	(16.25)	(18.75)	(21.24)	(23.74)	(26.24)	(28.73)	(31.23)
	-5.33%	(63.58)	(66.08)	(68.58)	(71.07)	(73.57)	(76.07)	(78.56)
	-8.00%	(134.51)	(137.01)	(139.50)	(142.00)	(144.49)	(146.99)	(149.49)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502333034	신한투자(ELS)1395	149.49
총 최대손실 예상금액		149.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 269.58

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

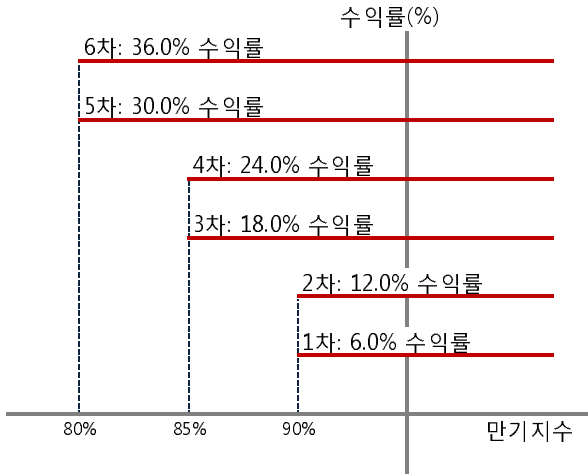
공시일: 2010-09-01

1. 계약금액

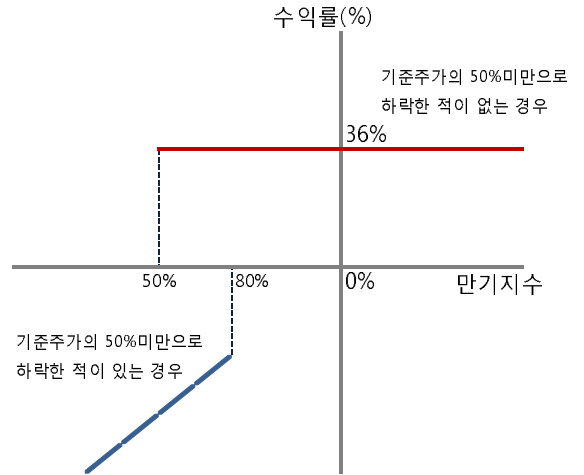
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장외

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%	128.58	112.40	96.22	80.04	63.86	47.68	31.49
	5.33%	102.56	86.38	70.20	54.01	37.83	21.65	5.47
	2.67%	75.88	59.70	43.52	27.33	11.15	(5.03)	(21.21)
	0.00%	48.54	32.36	16.18	0.00	(16.18)	(32.36)	(48.54)
	-2.67%	20.55	4.37	(11.81)	(27.99)	(44.17)	(60.35)	(76.53)
	-5.33%	(8.09)	(24.27)	(40.45)	(56.63)	(72.82)	(89.00)	(105.18)
	-8.00%	(37.39)	(53.57)	(69.75)	(85.93)	(102.12)	(118.30)	(134.48)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	134.48
총 최대손실 예상금액		134.48

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	128.84
-----	--------

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

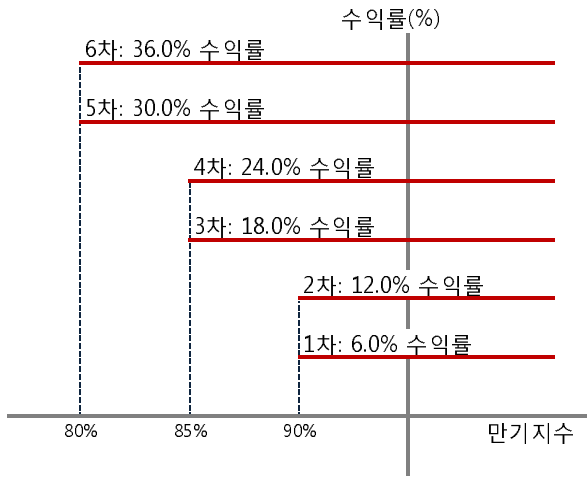
1. 계약금액

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

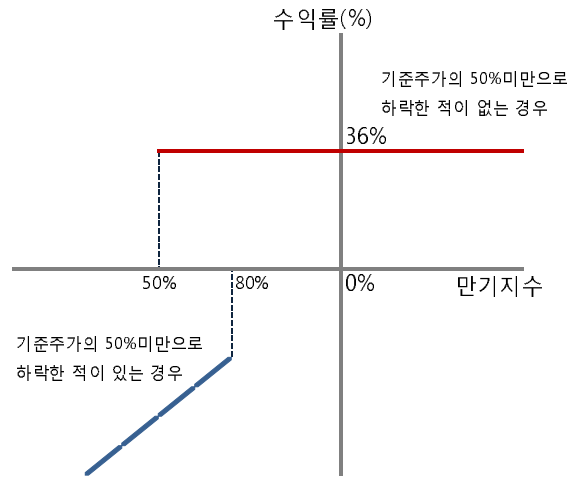
단위(백만원)

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 시나리오	8.00%	52.74	47.07	41.40	35.73	30.07	24.40	18.73
	5.33%	43.81	38.14	32.47	26.80	21.14	15.47	9.80
	2.67%	31.89	26.23	20.56	14.89	9.23	3.56	(2.11)
	0.00%	17.00	11.33	5.67	0.00	(5.67)	(11.33)	(17.00)
	-2.67%	(0.87)	(6.54)	(12.21)	(17.87)	(23.54)	(29.21)	(34.88)
	-5.33%	(21.73)	(27.39)	(33.06)	(38.73)	(44.40)	(50.06)	(55.73)
	-8.00%	(45.56)	(51.23)	(56.90)	(62.57)	(68.23)	(73.90)	(79.57)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6512107048	대신증권(ELS)1029	79.57
총 최대손실 예상금액		79.57

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	73.71
-----	-------

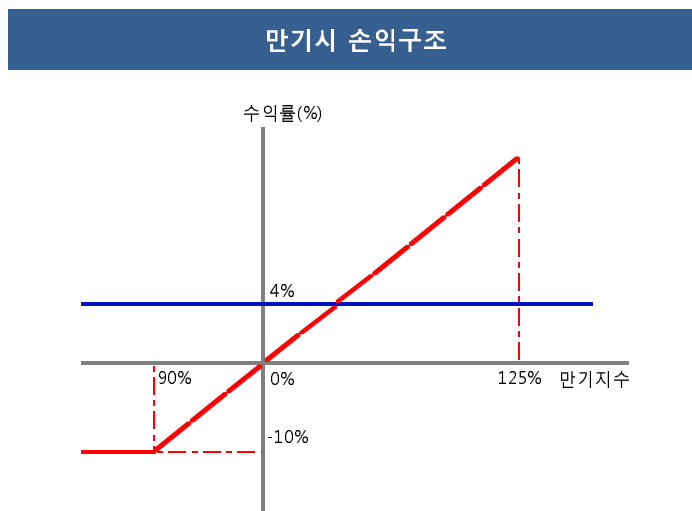
메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

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%	11.72	11.01	10.29	9.57	8.85	8.14	7.42
	5.33%	8.82	8.11	7.39	6.67	5.95	5.24	4.52
	2.67%	5.63	4.91	4.20	3.48	2.76	2.05	1.33
	0.00%	2.15	1.43	0.72	0.00	(0.72)	(1.43)	(2.15)
	-2.67%	(1.62)	(2.34)	(3.05)	(3.77)	(4.49)	(5.20)	(5.92)
	-5.33%	(5.68)	(6.40)	(7.12)	(7.83)	(8.55)	(9.27)	(9.98)
	-8.00%	(10.03)	(10.75)	(11.47)	(12.18)	(12.90)	(13.62)	(14.33)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503339048	신한투자(ELS)1447	14.33
총 최대손실 예상금액		14.33

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.43
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

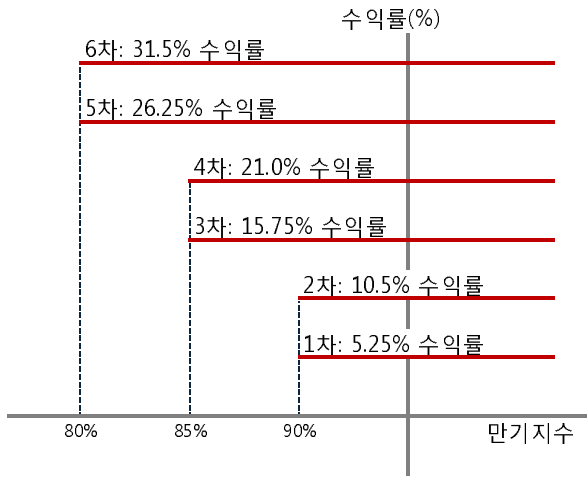
공시일: 2010-09-01

1. 계약금액

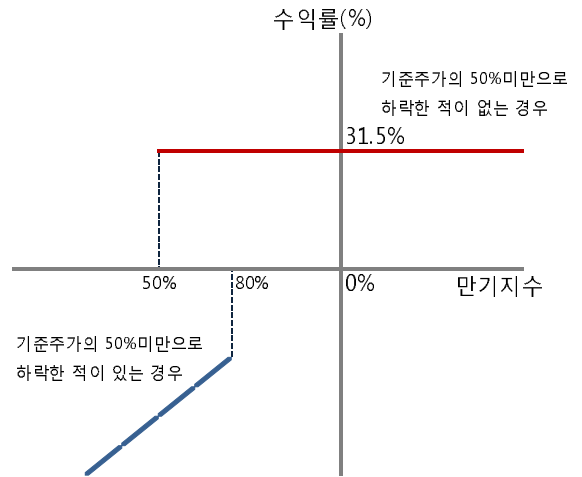
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장외

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%	19.97	16.21	12.45	8.68	4.92	1.16	(2.61)
	5.33%	20.54	16.78	13.01	9.25	5.48	1.72	(2.04)
	2.67%	17.64	13.88	10.12	6.35	2.59	(1.17)	(4.94)
	0.00%	11.29	7.53	3.76	0.00	(3.76)	(7.53)	(11.29)
	-2.67%	1.48	(2.29)	(6.05)	(9.81)	(13.58)	(17.34)	(21.10)
	-5.33%	(11.79)	(15.56)	(19.32)	(23.09)	(26.85)	(30.61)	(34.38)
	-8.00%	(28.53)	(32.29)	(36.05)	(39.82)	(43.58)	(47.34)	(51.11)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513135048	대신증권(ELS)1059	51.11
총 최대손실 예상금액		51.11

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 47.65

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

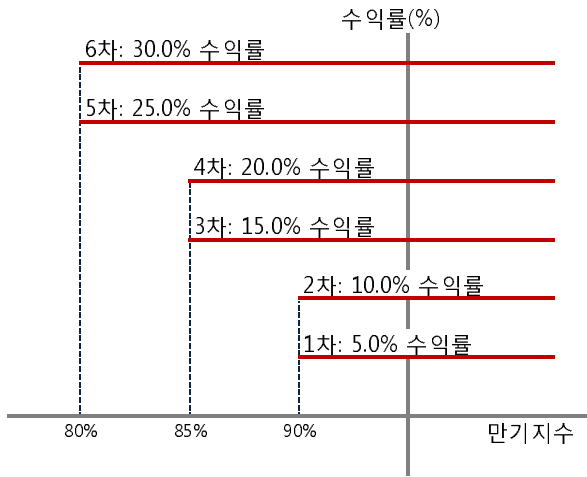
1. 계약금액

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

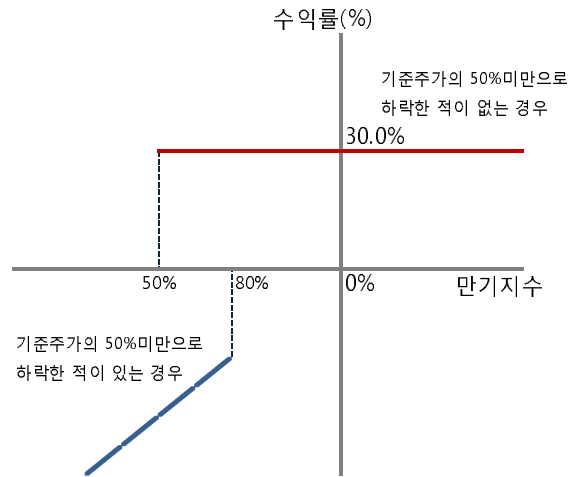
단위(백만원)

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%	5.03	3.75	2.46	1.18	(0.10)	(1.38)	(2.66)
	5.33%	6.57	5.29	4.01	2.73	1.45	0.16	(1.12)
	2.67%	6.18	4.90	3.62	2.33	1.05	(0.23)	(1.51)
	0.00%	3.85	2.56	1.28	0.00	(1.28)	(2.56)	(3.85)
	-2.67%	(0.43)	(1.71)	(2.99)	(4.28)	(5.56)	(6.84)	(8.12)
	-5.33%	(6.64)	(7.93)	(9.21)	(10.49)	(11.77)	(13.06)	(14.34)
	-8.00%	(14.80)	(16.08)	(17.37)	(18.65)	(19.93)	(21.21)	(22.49)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513118051	대신증권(ELS)1072	22.49
총 최대손실 예상금액		22.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	19.15
-----	-------

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

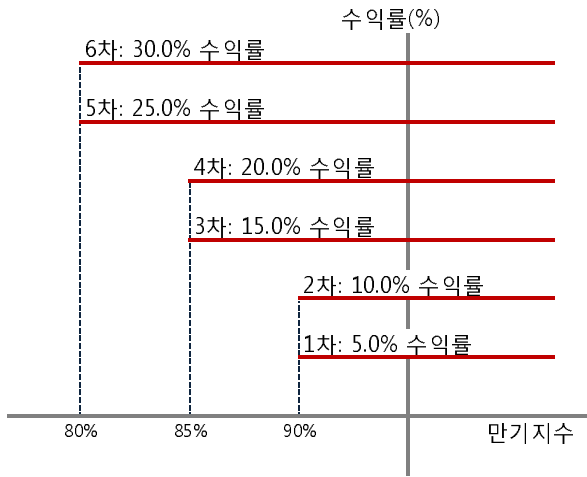
1. 계약금액

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

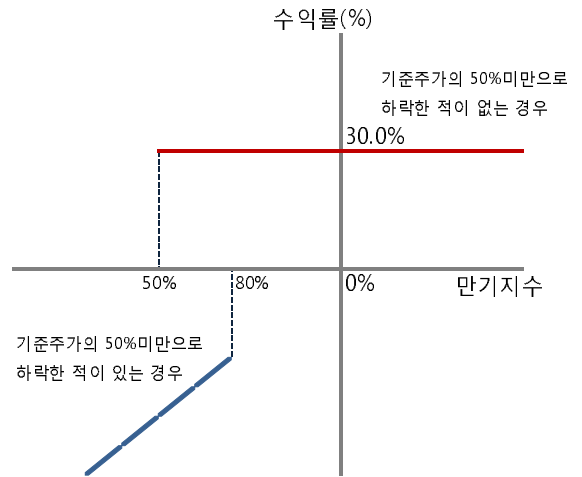
단위(백만원)

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%	29.35	25.88	22.41	18.94	15.47	11.99	8.52
자산	5.33%	25.49	22.02	18.55	15.08	11.60	8.13	4.66
시나리오	2.67%	19.18	15.71	12.23	8.76	5.29	1.82	(1.65)
	0.00%	10.41	6.94	3.47	0.00	(3.47)	(6.94)	(10.41)
	-2.67%	(0.80)	(4.27)	(7.74)	(11.22)	(14.69)	(18.16)	(21.63)
	-5.33%	(14.47)	(17.94)	(21.41)	(24.88)	(28.35)	(31.82)	(35.30)
	-8.00%	(30.59)	(34.06)	(37.53)	(41.00)	(44.47)	(47.94)	(51.41)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	51.41
총 최대손실 예상금액		51.41

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	53.11
-----	-------

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

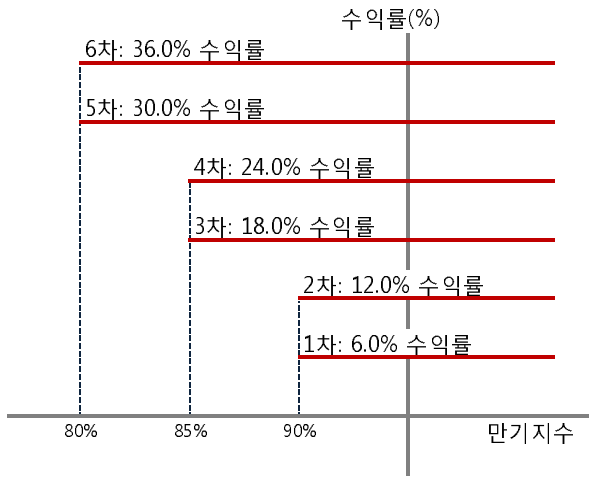
공시일: 2010-09-01

1. 계약금액

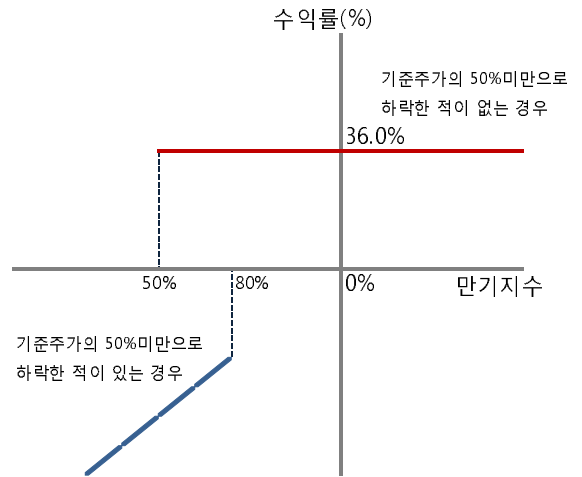
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

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 시나리오	8.00%	1.88	1.49	1.10	0.71	0.31	(0.08)	(0.47)
	5.33%	2.01	1.62	1.23	0.83	0.44	0.05	(0.34)
	2.67%	1.77	1.38	0.99	0.60	0.21	(0.18)	(0.57)
	0.00%	1.17	0.78	0.39	0.00	(0.39)	(0.78)	(1.17)
	-2.67%	0.21	(0.18)	(0.57)	(0.96)	(1.36)	(1.75)	(2.14)
	-5.33%	(1.12)	(1.51)	(1.90)	(2.29)	(2.68)	(3.08)	(3.47)
	-8.00%	(2.81)	(3.20)	(3.59)	(3.99)	(4.38)	(4.77)	(5.16)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6509358059	신한투자(ELS)1506	5.16
총 최대손실 예상금액		5.16

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.64
-----	------

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

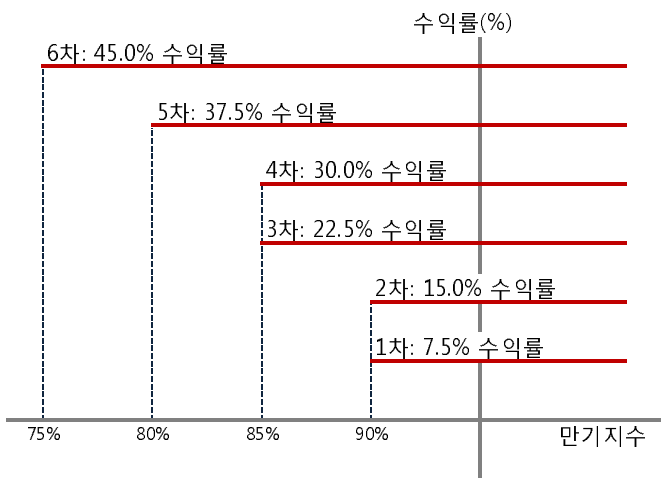
1. 계약금액

단위(백만원)

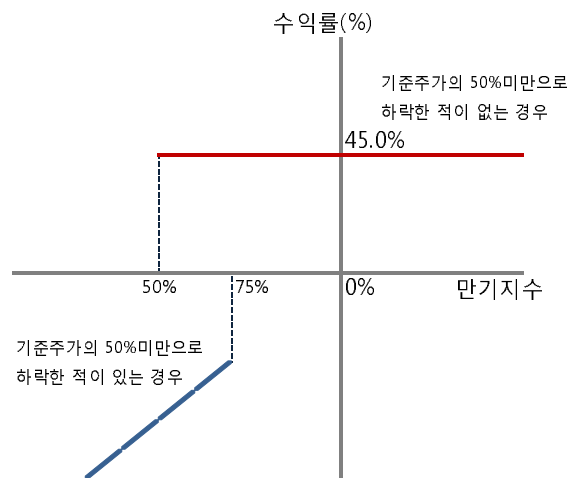
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

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	20.00	16.78	13.56	10.35	7.13	3.91	0.70	
자산	5.33%	17.07	13.85	10.63	7.42	4.20	(2.23)	
시나	2.67%	13.62	10.40	7.18	3.97	0.75	(5.68)	
리오	0.00%	9.65	6.43	3.22	0.00	(3.22)	(9.65)	
	-2.67%	5.16	1.95	(1.27)	(4.49)	(7.70)	(14.14)	
	-5.33%	0.16	(3.06)	(6.28)	(9.49)	(12.71)	(19.14)	
	-8.00%	(5.37)	(8.58)	(11.80)	(15.02)	(18.23)	(24.67)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6519101069	대신증권(ELS)1101	24.67
총 최대손실 예상금액		24.67

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 26.99

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

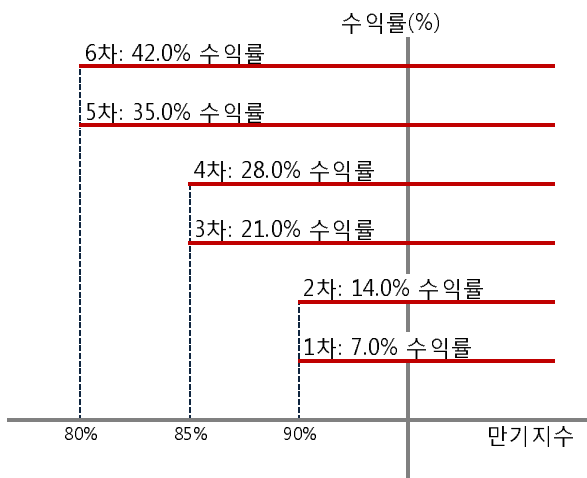
1. 계약금액

단위(백만원)

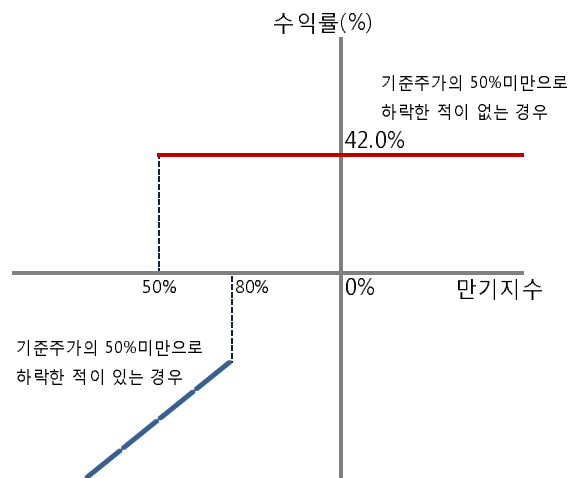
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

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%	12.46	9.52	6.58	3.65	0.71	(2.23)	(5.17)
	5.33%	12.93	10.00	7.06	4.12	1.18	(1.75)	(4.69)
	2.67%	11.72	8.78	5.84	2.91	(0.03)	(2.97)	(5.91)
	0.00%	8.81	5.87	2.94	0.00	(2.94)	(5.87)	(8.81)
	-2.67%	4.22	1.28	(1.66)	(4.60)	(7.53)	(10.47)	(13.41)
	-5.33%	(2.07)	(5.01)	(7.94)	(10.88)	(13.82)	(16.76)	(19.69)
	-8.00%	(10.05)	(12.98)	(15.92)	(18.86)	(21.80)	(24.73)	(27.67)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513121063	대신증권(ELS)1120	27.67
총 최대손실 예상금액		27.67

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	26.25
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-01

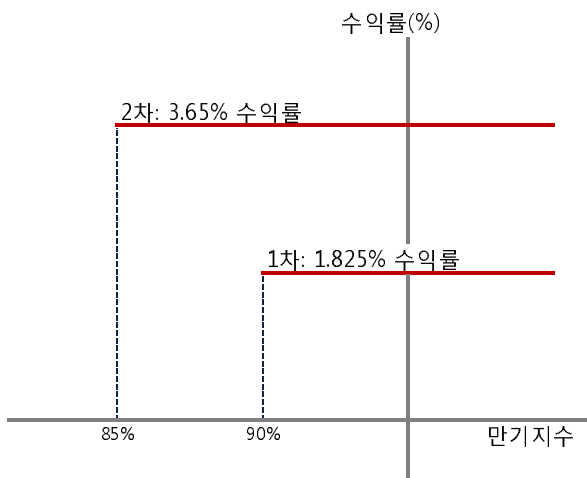
1. 계약금액

단위(백만원)

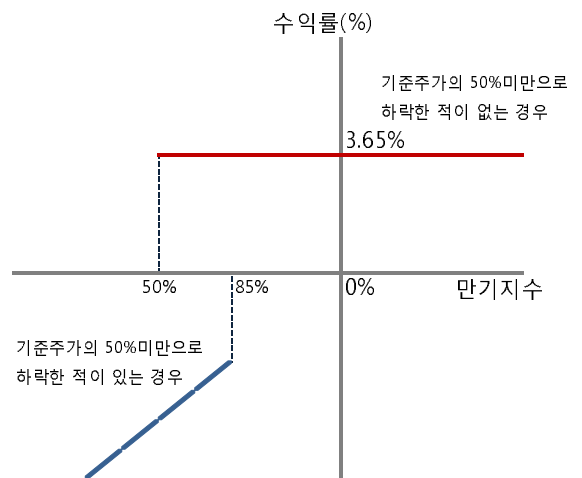
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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%	1.26	1.26	1.26	1.26	1.26	1.26	1.26
	5.33%	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56
	2.67%	0.14	0.14	0.14	0.14	0.14	0.14	0.14
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.14	0.14	0.14	0.14	0.14	0.14	0.14
	-5.33%	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56	0.56
	-8.00%	1.26	1.26	1.26	1.26	1.26	1.26	1.26

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