

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

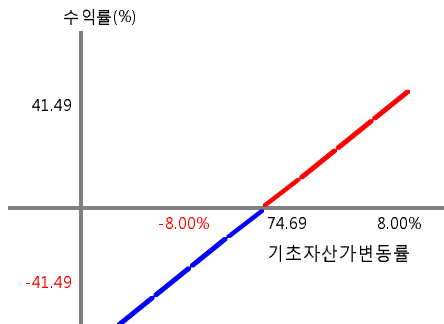
공시일: 2010-09-07

1. 계약금액

단위(백만원)

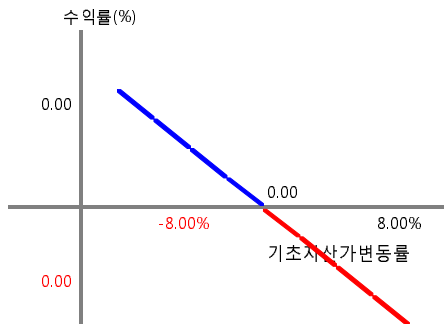
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

CLV0 WTI CRUDE FUTURE Oct10 Long



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

3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLV0 WTI CRUDE FUTURE Oct10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	47.46
	5.33%	31.62
	2.67%	15.84
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-15.84
	-5.33%	-31.62
	-8.00%	-47.46

최대손실 시나리오

위험액	-47.46
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	192.27
-----	--------

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

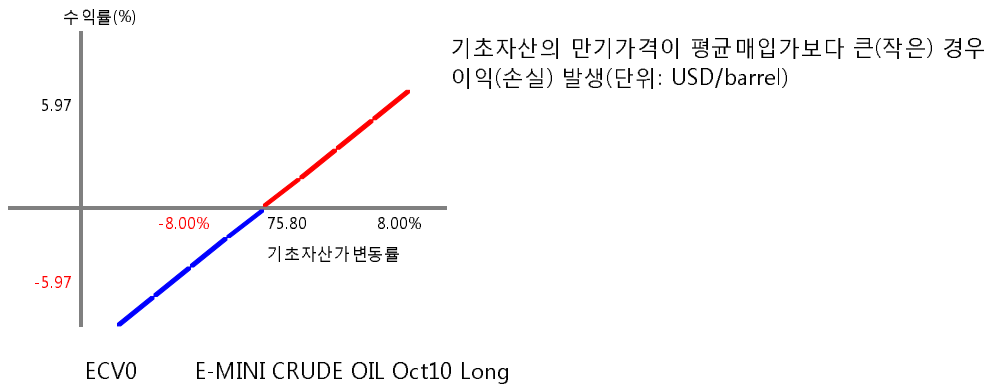
공시일: 2010-09-07

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



메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

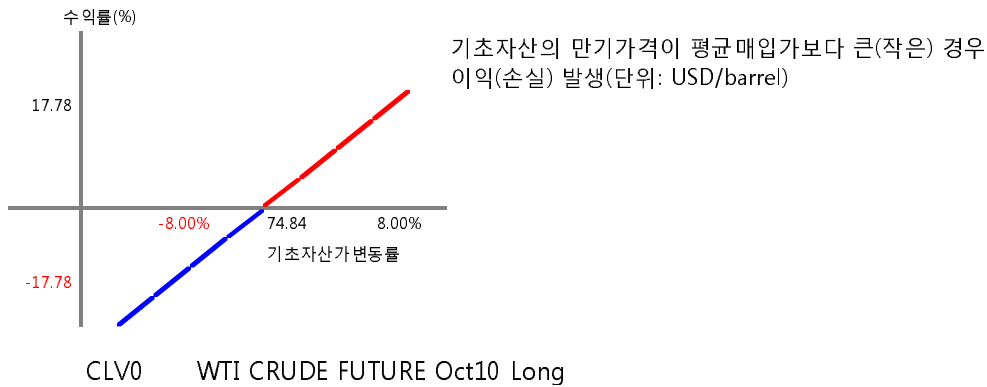
공시일: 2010-09-07

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))

CLV0 WTI CRUDE FUTURE Oct10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	35.56
	5.33%	23.69
	2.67%	11.87
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-11.87
	-5.33%	-23.69
	-8.00%	-35.56

최대손실 시나리오

위험액	-35.56
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	94.49
-----	-------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

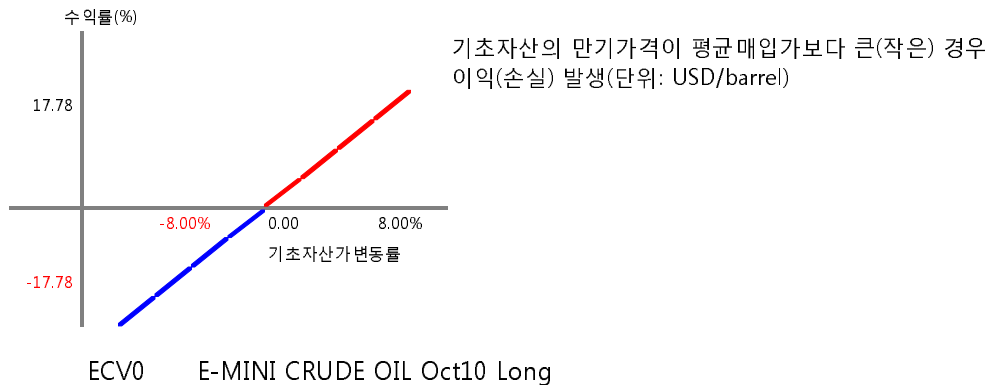
공시일: 2010-09-07

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

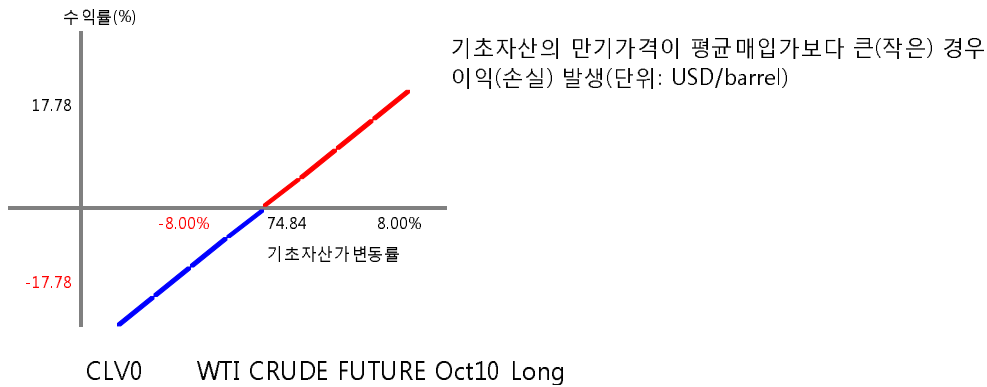
공시일: 2010-09-07

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))

CLV0 WTI CRUDE FUTURE Oct10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	149.02
	5.33%	99.28
	2.67%	49.73
	0.00%	0.00
시나리오	-2.67%	-49.73
	-5.33%	-99.28
	-8.00%	-149.02

최대손실 시나리오

위험액	-149.02
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	592.63
-----	--------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

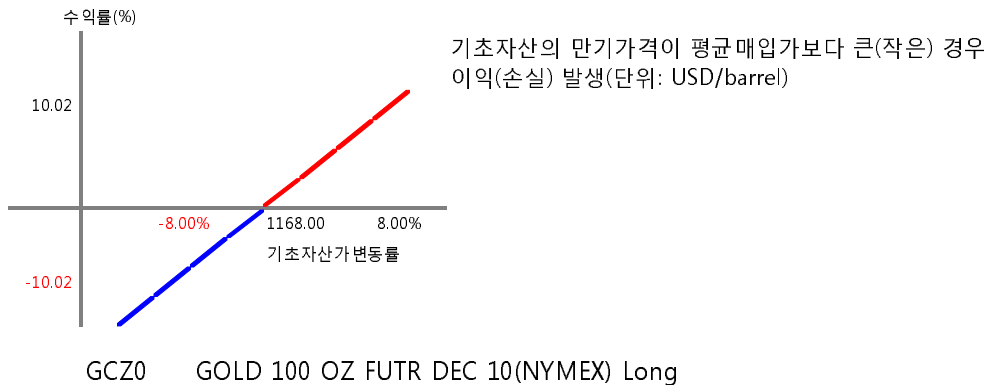
공시일: 2010-09-07

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

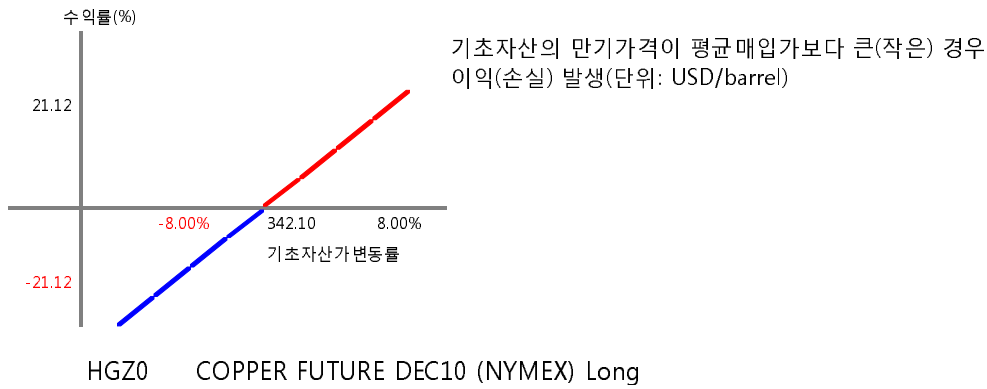
공시일: 2010-09-07

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



메리츠PremiumCommodity특별자산1

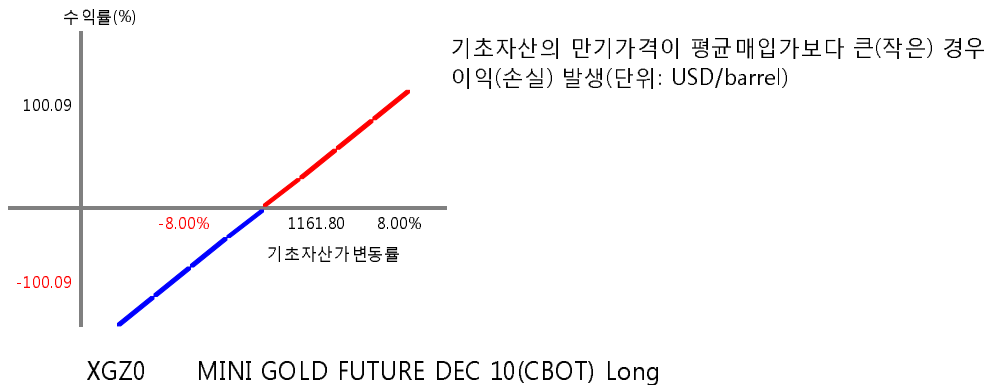
공시일: 2010-09-07

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



메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

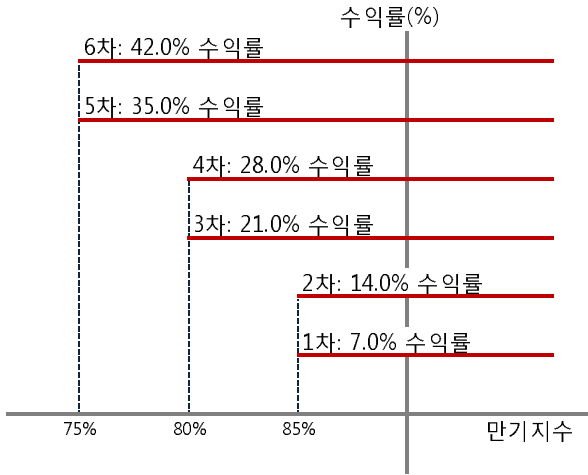
1. 계약금액

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

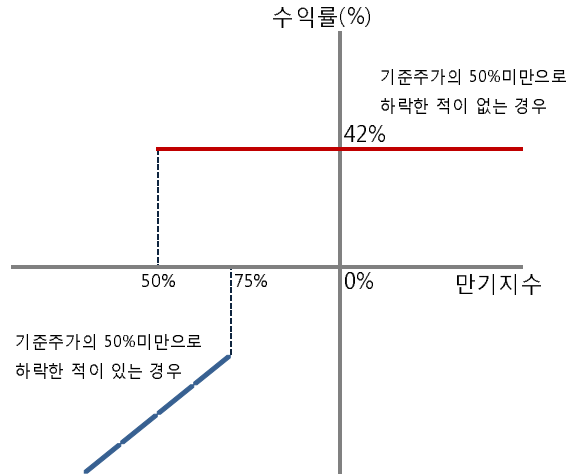
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	(30.49)	(30.54)	(30.58)	(30.63)	(30.68)	(30.72)	(30.77)
자산	5.33%	(13.39)	(13.44)	(13.48)	(13.53)	(13.57)	(13.62)	(13.67)
시나리오	2.67%	(3.18)	(3.23)	(3.27)	(3.32)	(3.36)	(3.41)	(3.46)
	0.00%	0.14	0.09	0.05	0.00	(0.05)	(0.09)	(0.14)
	-2.67%	(3.44)	(3.48)	(3.53)	(3.57)	(3.62)	(3.67)	(3.71)
	-5.33%	(13.90)	(13.95)	(14.00)	(14.04)	(14.09)	(14.13)	(14.18)
	-8.00%	(31.26)	(31.31)	(31.36)	(31.40)	(31.45)	(31.49)	(31.54)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502333034	신한투자(ELS)1395	31.54
총 최대손실 예상금액		31.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 11.76

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

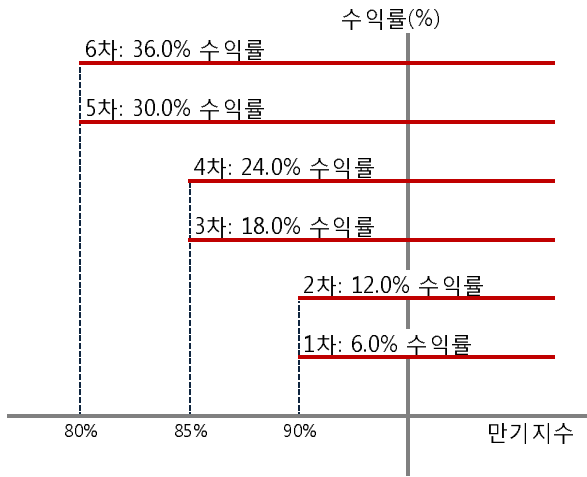
공시일: 2010-09-07

1. 계약금액

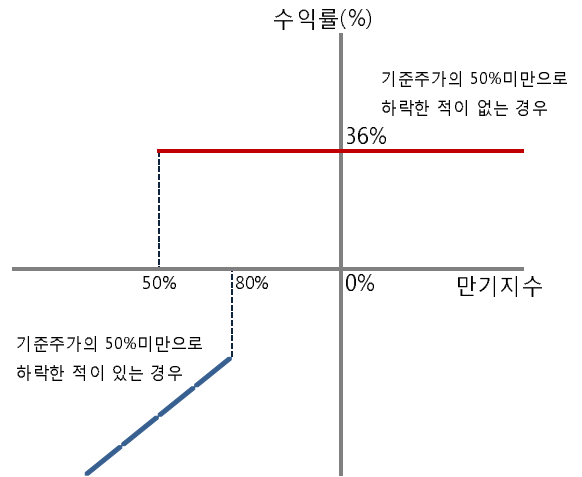
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	107.99	90.78	73.56	56.34	39.12	21.91	4.69
	5.33%	91.54	74.32	57.10	39.89	22.67	5.45	(11.77)
	2.67%	72.76	55.54	38.32	21.10	3.89	(13.33)	(30.55)
	0.00%	51.65	34.43	17.22	0.00	(17.22)	(34.43)	(51.65)
	-2.67%	28.22	11.01	(6.21)	(23.43)	(40.65)	(57.86)	(75.08)
	-5.33%	2.47	(14.75)	(31.96)	(49.18)	(66.40)	(83.61)	(100.83)
	-8.00%	(25.60)	(42.82)	(60.04)	(77.26)	(94.47)	(111.69)	(128.91)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	128.91
총 최대손실 예상금액		128.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	127.65
-----	--------

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

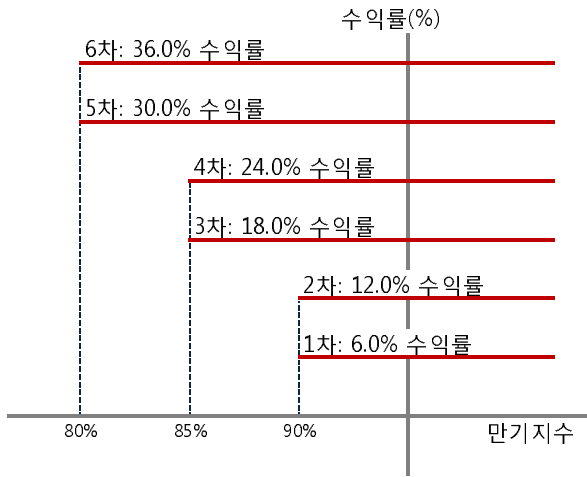
공시일: 2010-09-07

1. 계약금액

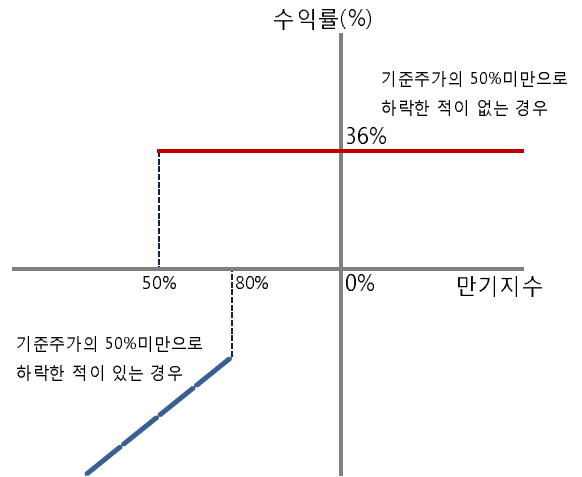
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장외

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 시나 리오	8.00%	56.93	46.67	36.40	26.14	15.87	5.61	(4.66)
	5.33%	51.52	41.25	30.99	20.72	10.46	0.19	(10.07)
	2.67%	42.81	32.54	22.28	12.01	1.75	(8.52)	(18.78)
	0.00%	30.79	20.53	10.26	0.00	(10.26)	(20.53)	(30.79)
	-2.67%	15.49	5.22	(5.04)	(15.31)	(25.57)	(35.84)	(46.10)
	-5.33%	(3.12)	(13.39)	(23.65)	(33.92)	(44.18)	(54.45)	(64.71)
	-8.00%	(25.03)	(35.30)	(45.56)	(55.83)	(66.09)	(76.36)	(86.62)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6512107048	대신증권(ELS)1029	86.62
총 최대손실 예상금액		86.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	52.85
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

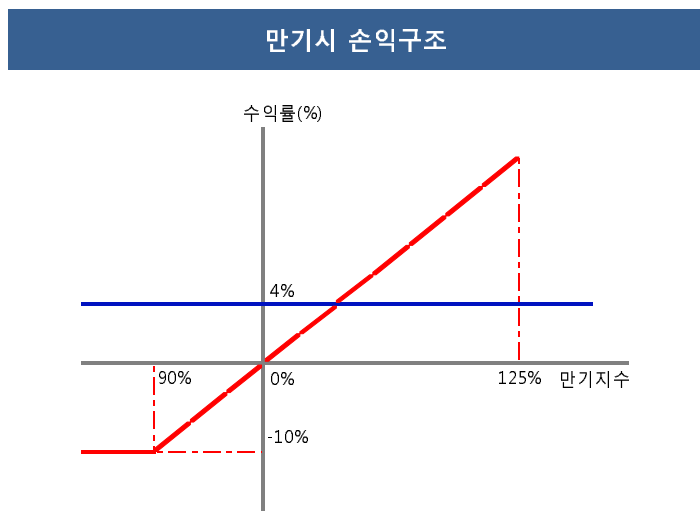
공시일: 2010-09-07

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



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	10.18	8.99	7.79	6.60	5.41	4.21	3.02
자산	8.55	7.36	6.17	4.97	3.78	2.59	1.40
시나	6.35	5.16	3.97	2.77	1.58	0.39	(0.80)
리오	0.00%	3.58	2.39	1.19	0.00	(1.19)	(3.58)
	-2.67%	0.23	(0.96)	(2.16)	(3.35)	(4.54)	(6.93)
	-5.33%	(3.69)	(4.89)	(6.08)	(7.27)	(8.47)	(10.85)
	-8.00%	(8.19)	(9.39)	(10.58)	(11.77)	(12.96)	(15.35)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503339048	신한투자(ELS)1447	15.35
총 최대손실 예상금액		15.35

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.81
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

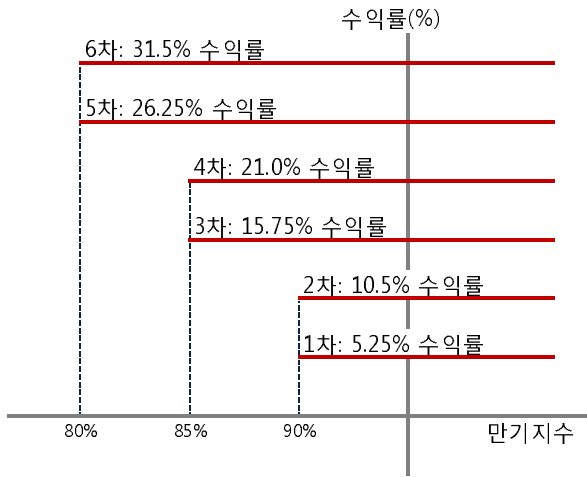
공시일: 2010-09-07

1. 계약금액

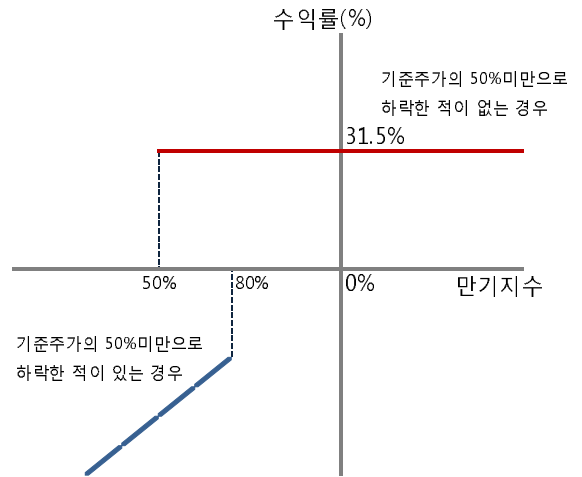
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장외

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%	0.74	(0.62)	(1.99)	(3.36)	(4.72)	(6.09)	(7.46)
	5.33%	2.67	1.30	(0.06)	(1.43)	(2.80)	(4.16)	(5.53)
	2.67%	3.79	2.42	1.06	(0.31)	(1.68)	(3.04)	(4.41)
	0.00%	4.10	2.73	1.37	0.00	(1.37)	(2.73)	(4.10)
	-2.67%	3.60	2.23	0.87	(0.50)	(1.87)	(3.23)	(4.60)
	-5.33%	2.29	0.93	(0.44)	(1.81)	(3.17)	(4.54)	(5.91)
	-8.00%	0.18	(1.19)	(2.56)	(3.92)	(5.29)	(6.66)	(8.02)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513135048	대신증권(ELS)1059	8.02
총 최대손실 예상금액		8.02

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.88
-----	------

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

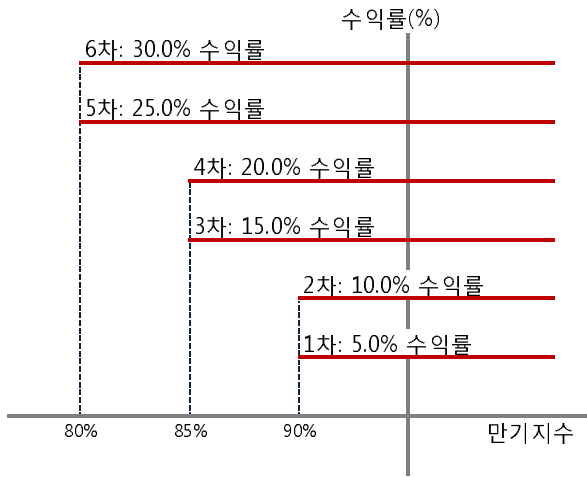
공시일: 2010-09-07

1. 계약금액

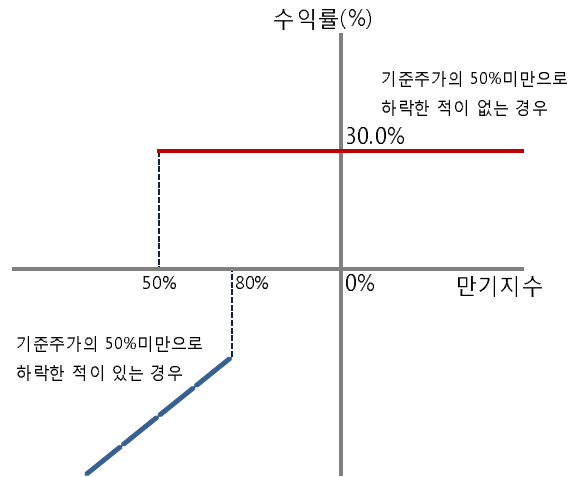
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,146	0	1,146	장외

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%	0.52	0.11	(0.31)	(0.72)	(1.14)	(1.55)	(1.97)
	5.33%	0.97	0.56	0.14	(0.27)	(0.69)	(1.10)	(1.51)
	2.67%	1.21	0.80	0.38	(0.03)	(0.44)	(0.86)	(1.27)
	0.00%	1.24	0.83	0.41	0.00	(0.41)	(0.83)	(1.24)
	-2.67%	1.06	0.65	0.23	(0.18)	(0.59)	(1.01)	(1.42)
	-5.33%	0.67	0.26	(0.16)	(0.57)	(0.99)	(1.40)	(1.81)
	-8.00%	0.07	(0.34)	(0.76)	(1.17)	(1.59)	(2.00)	(2.42)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513118051	대신증권(ELS)1072	2.42
총 최대손실 예상금액		2.42

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.71
-----	------

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

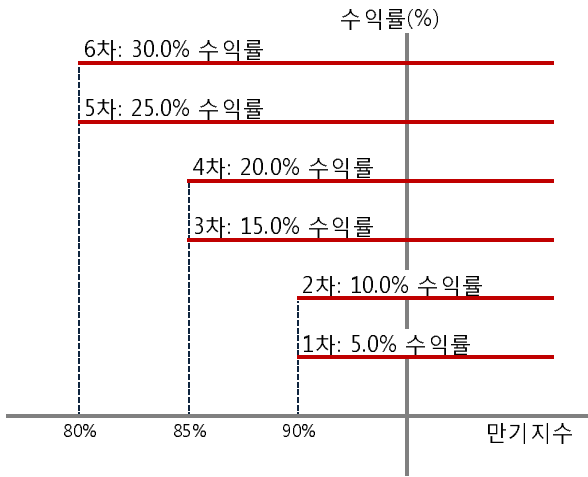
1. 계약금액

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

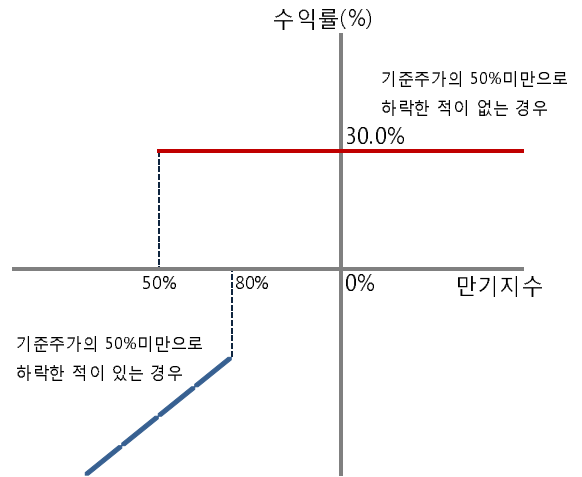
단위(백만원)

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%	10.00	7.81	5.63	3.44	1.25	(0.93)	(3.12)
자산	5.33%	10.26	8.08	5.89	3.71	1.52	(0.67)	(2.85)
시나리오	2.67%	9.12	6.93	4.75	2.56	0.37	(1.81)	(4.00)
	0.00%	6.56	4.37	2.19	0.00	(2.19)	(4.37)	(6.56)
	-2.67%	2.59	0.40	(1.79)	(3.97)	(6.16)	(8.34)	(10.53)
	-5.33%	(2.80)	(4.98)	(7.17)	(9.36)	(11.54)	(13.73)	(15.91)
	-8.00%	(9.59)	(11.78)	(13.97)	(16.15)	(18.34)	(20.52)	(22.71)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	22.71
총 최대손실 예상금액		22.71

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 29.41

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

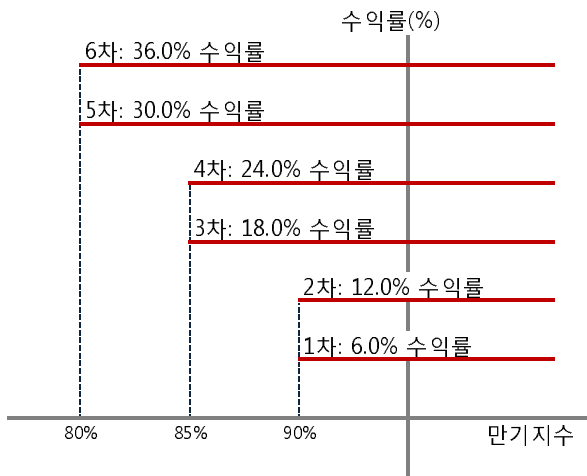
공시일: 2010-09-07

1. 계약금액

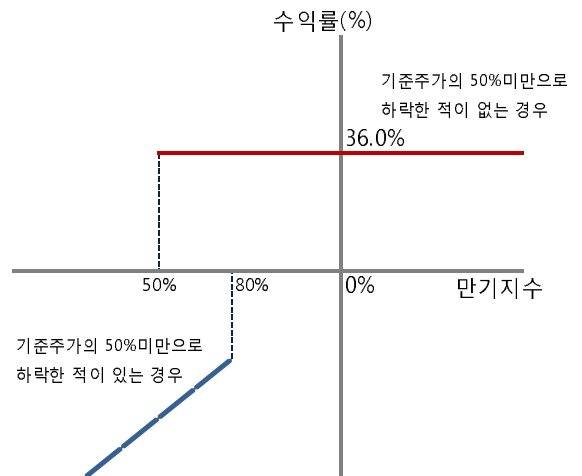
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

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 시나리오	8.00%	0.73	0.50	0.28	0.05	(0.17)	(0.40)	(0.62)
	5.33%	0.74	0.51	0.28	0.06	(0.17)	(0.39)	(0.62)
	2.67%	0.72	0.49	0.27	0.04	(0.19)	(0.41)	(0.64)
	0.00%	0.68	0.45	0.23	0.00	(0.23)	(0.45)	(0.68)
	-2.67%	0.61	0.39	0.16	(0.06)	(0.29)	(0.52)	(0.74)
	-5.33%	0.53	0.30	0.08	(0.15)	(0.38)	(0.60)	(0.83)
	-8.00%	0.42	0.19	(0.03)	(0.26)	(0.49)	(0.71)	(0.94)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6509358059	신한투자(ELS)1506	0.94
총 최대손실 예상금액		0.94

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1.30

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

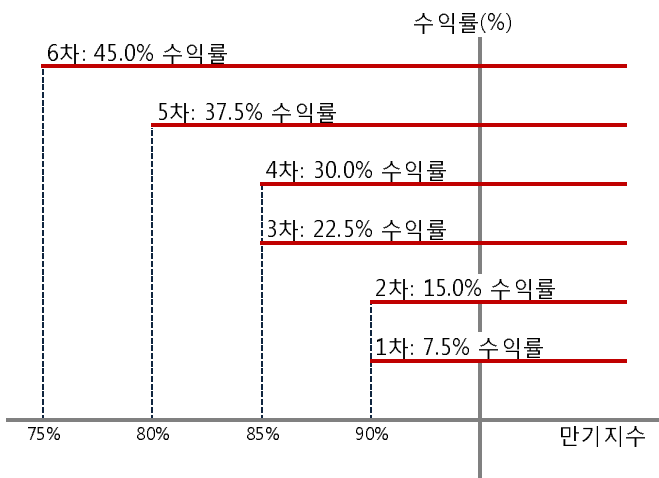
1. 계약금액

단위(백만원)

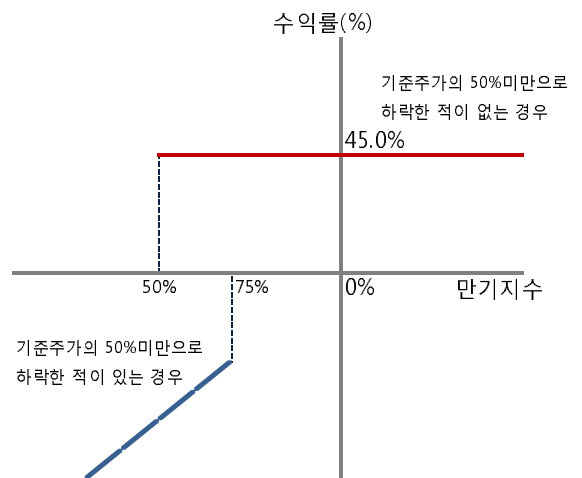
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

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%	14.10	11.37	8.64	5.90	3.17	0.44	(2.29)
	5.33%	12.65	9.92	7.19	4.46	1.73	(1.00)	(3.73)
	2.67%	10.69	7.95	5.22	2.49	(0.24)	(2.97)	(5.70)
	0.00%	8.19	5.46	2.73	0.00	(2.73)	(5.46)	(8.19)
	-2.67%	5.17	2.44	(0.29)	(3.02)	(5.75)	(8.48)	(11.21)
	-5.33%	1.63	(1.10)	(3.83)	(6.56)	(9.29)	(12.03)	(14.76)
	-8.00%	(2.44)	(5.17)	(7.90)	(10.63)	(13.37)	(16.10)	(18.83)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6519101069	대신증권(ELS)1101	18.83
총 최대손실 예상금액		18.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 17.35

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

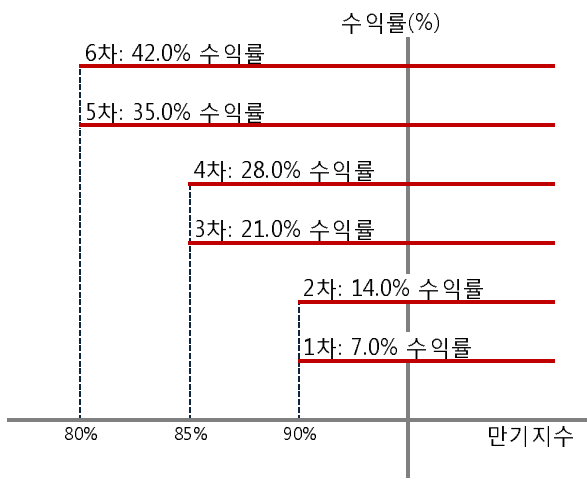
1. 계약금액

단위(백만원)

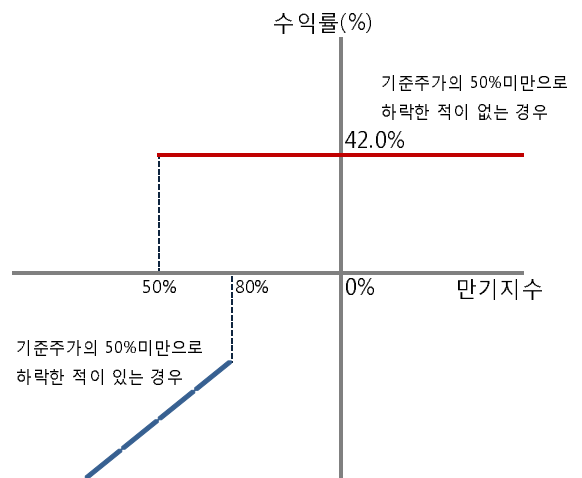
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

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 시나 리오	8.00%	2.72	0.98	(0.76)	(2.50)	(4.25)	(5.99)	(7.73)
	5.33%	3.86	2.12	0.38	(1.36)	(3.11)	(4.85)	(6.59)
	2.67%	4.69	2.95	1.21	(0.53)	(2.27)	(4.01)	(5.75)
	0.00%	5.22	3.48	1.74	0.00	(1.74)	(3.48)	(5.22)
	-2.67%	5.45	3.71	1.97	0.22	(1.52)	(3.26)	(5.00)
	-5.33%	5.37	3.63	1.89	0.14	(1.60)	(3.34)	(5.08)
	-8.00%	4.98	3.24	1.50	(0.24)	(1.98)	(3.72)	(5.47)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513121063	대신증권(ELS)1120	7.73
총 최대손실 예상금액		7.73

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 5.70

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

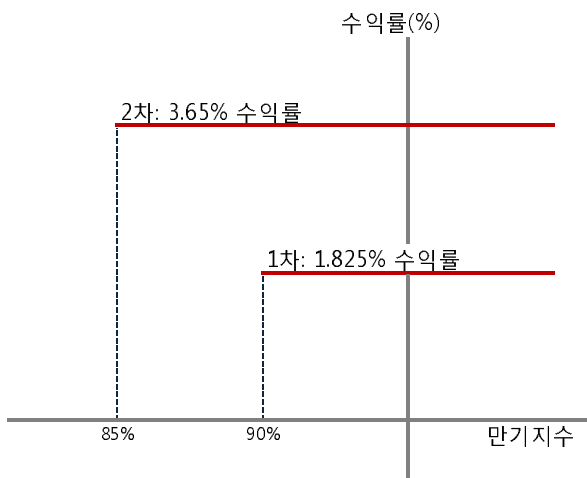
1. 계약금액

단위(백만원)

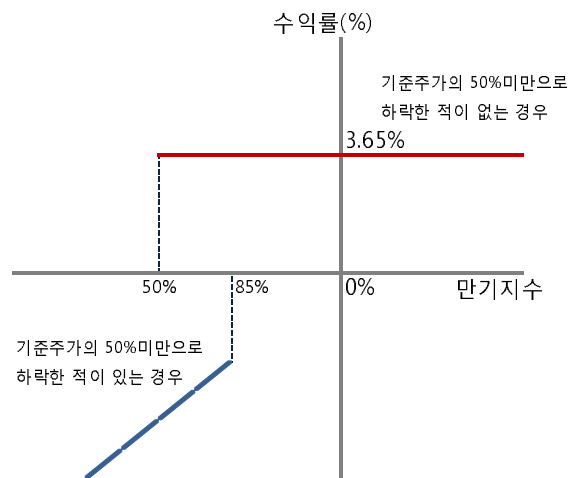
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	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)

KR6553352065	우리투자증권(ELS)3254	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠한증지수연계증권제9호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

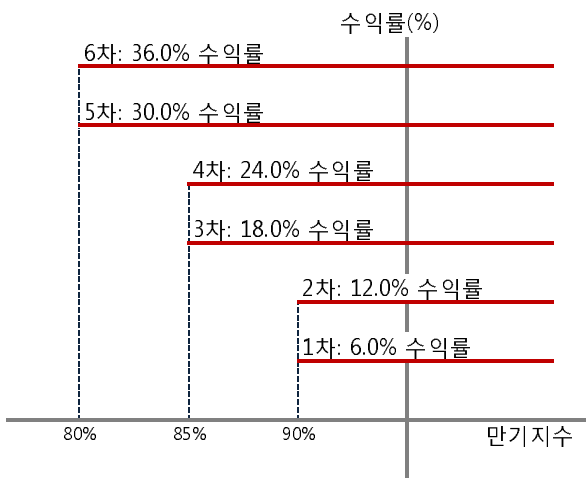
1. 계약금액

단위(백만원)

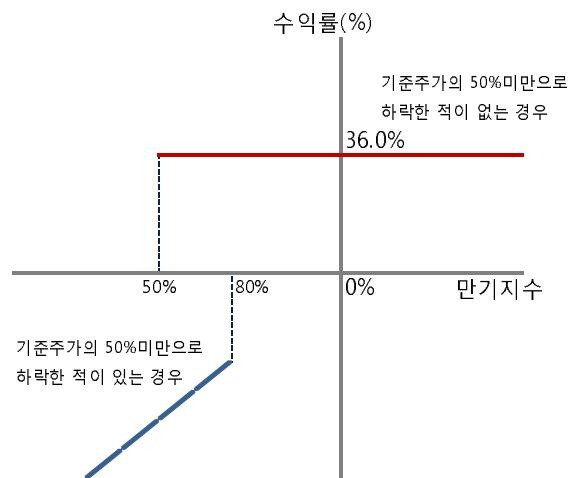
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외
누계	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외

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	22.95	16.52	10.08	3.64	(2.79)	(9.23)	(15.67)	
자산	23.26	16.82	10.39	3.95	(2.49)	(8.92)	(15.36)	
시나	22.05	15.61	9.17	2.74	(3.70)	(10.14)	(16.57)	
리오	0.00%	19.31	12.87	6.44	0.00	(6.44)	(12.87)	
	-2.67%	15.05	8.61	2.18	(4.26)	(10.70)	(17.13)	
	-5.33%	9.27	2.83	(3.60)	(10.04)	(16.48)	(22.91)	
	-8.00%	1.97	(4.47)	(10.91)	(17.34)	(23.78)	(30.22)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523315085	대우증권(ELS)4284	36.65
총 최대손실 예상금액		36.65

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 41.50

메리츠주가지수연계증권제3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

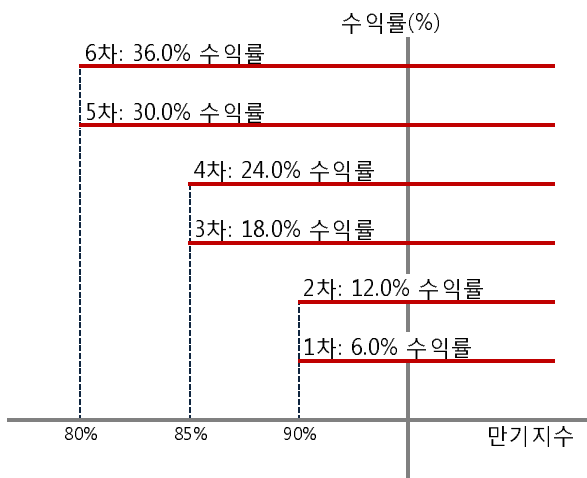
1. 계약금액

단위(백만원)

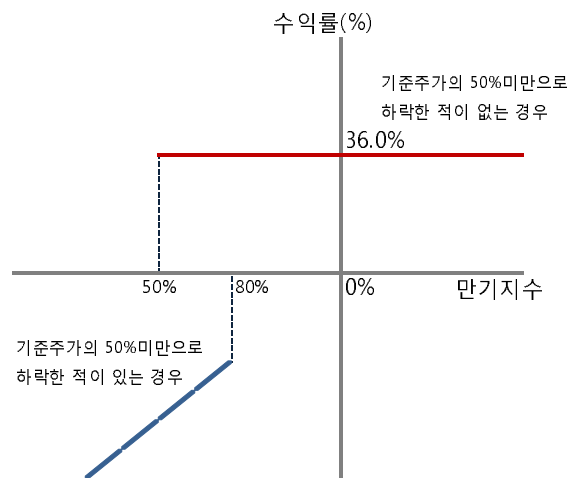
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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%	(51.78)	(51.06)	(50.33)	(49.60)	(48.88)	(48.15)	(47.42)
	5.33%	(40.38)	(39.66)	(38.93)	(38.20)	(37.47)	(36.75)	(36.02)
	2.67%	(23.85)	(23.12)	(22.39)	(21.67)	(20.94)	(20.21)	(19.49)
	0.00%	(2.18)	(1.45)	(0.73)	0.00	0.73	1.45	2.18
	-2.67%	24.62	25.35	26.07	26.80	27.53	28.25	28.98
	-5.33%	56.55	57.28	58.01	58.73	59.46	60.19	60.91
	-8.00%	93.62	94.35	95.07	95.80	96.53	97.25	97.98

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65233AD071	대우증권(ELS)4263	51.78
총 최대손실 예상금액		51.78

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	114.86
-----	--------

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-07

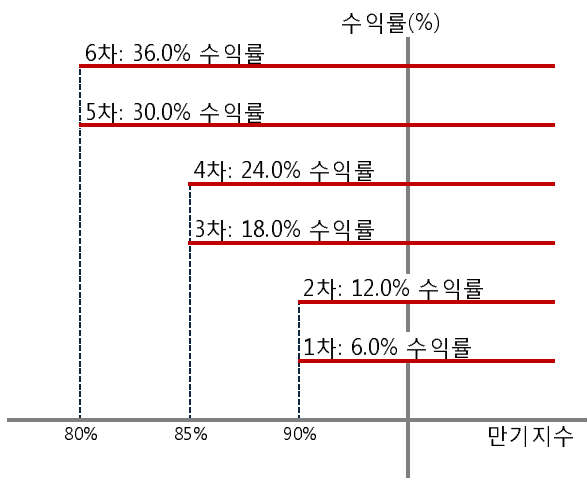
1. 계약금액

단위(백만원)

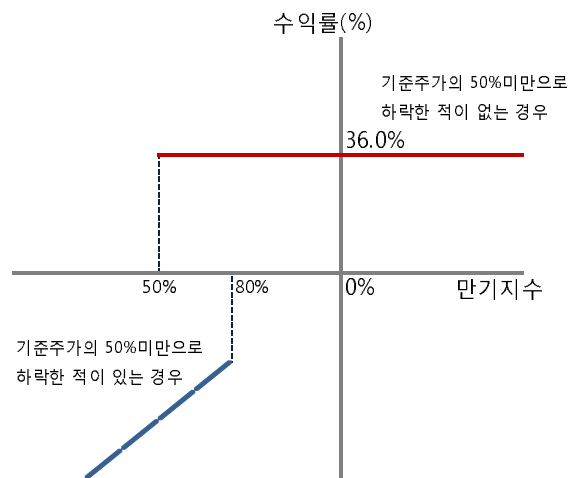
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	512	0	512	장외
누계	유가증권	선물	512	0	512	장외

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	24.74	22.20	19.65	17.11	14.57	12.02	9.48	
자산	19.68	17.14	14.59	12.05	9.51	6.97	4.42	
시나리오	2.67%	13.98	11.43	8.89	6.35	3.80	(1.28)	
	0.00%	7.63	5.09	2.54	0.00	(2.54)	(7.63)	
	-2.67%	0.64	(1.91)	(4.45)	(6.99)	(9.53)	(14.62)	
	-5.33%	(7.00)	(9.54)	(12.09)	(14.63)	(17.17)	(22.26)	
	-8.00%	(15.28)	(17.82)	(20.37)	(22.91)	(25.45)	(30.54)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293A8084	대우증권(ELS)4375	30.54
총 최대손실 예상금액		30.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 34.28