

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

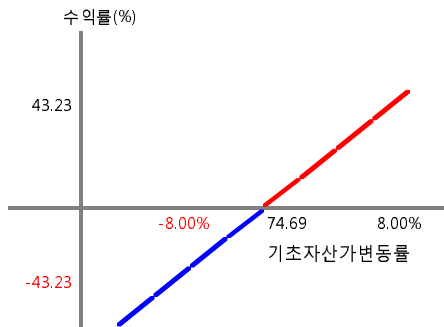
공시일: 2010-09-14

1. 계약금액

단위(백만원)

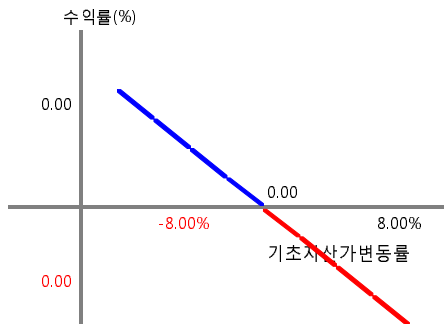
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내

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%	49.41
	5.33%	32.92
	2.67%	16.49
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-16.49
	-5.33%	-32.92
	-8.00%	-49.41

최대손실 시나리오

위험액	-49.41
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	200.17
-----	--------

메리트 WTI Index 사모특별 1호

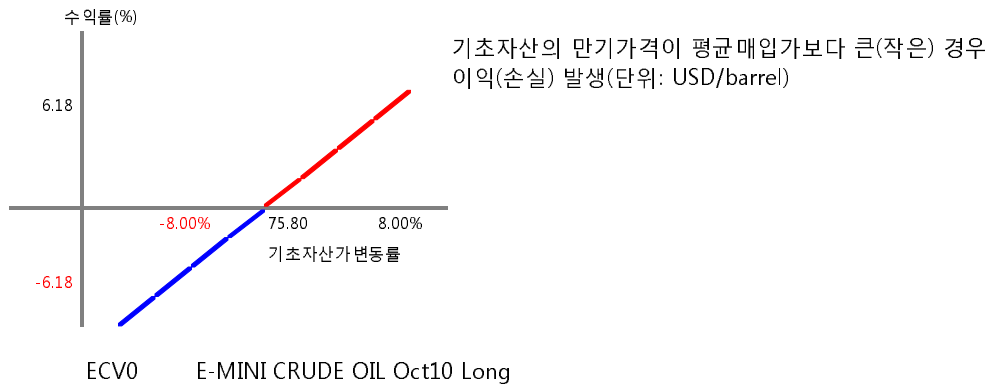
공시일: 2010-09-14

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



메리트WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

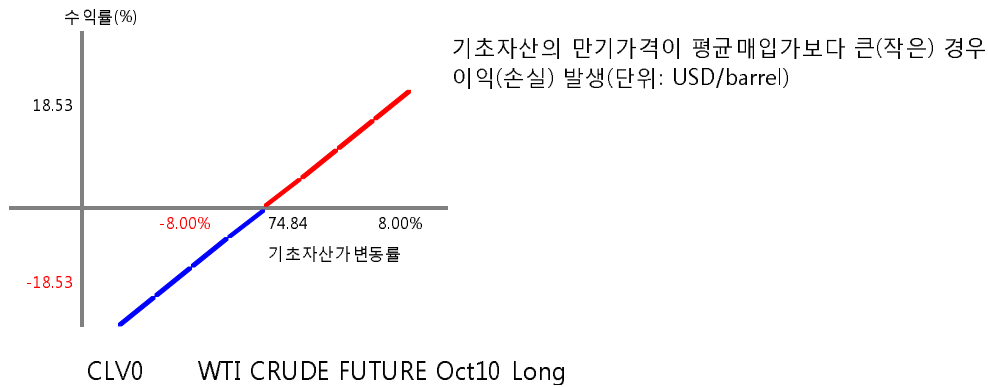
공시일: 2010-09-14

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%	37.05
	5.33%	24.69
	2.67%	12.37
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.37
	-5.33%	-24.69
	-8.00%	-37.05

최대손실 시나리오

위험액	-37.05
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	98.29
-----	-------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

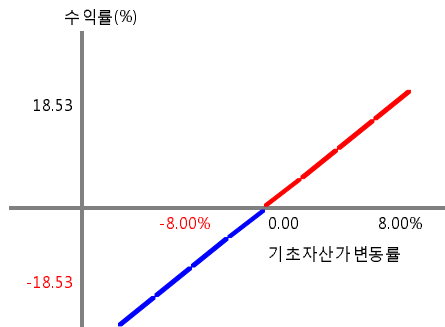
공시일: 2010-09-14

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)

ECV0 E-MINI CRUDE OIL Oct10 Long

메리츠PremiumCommodity특별자산1

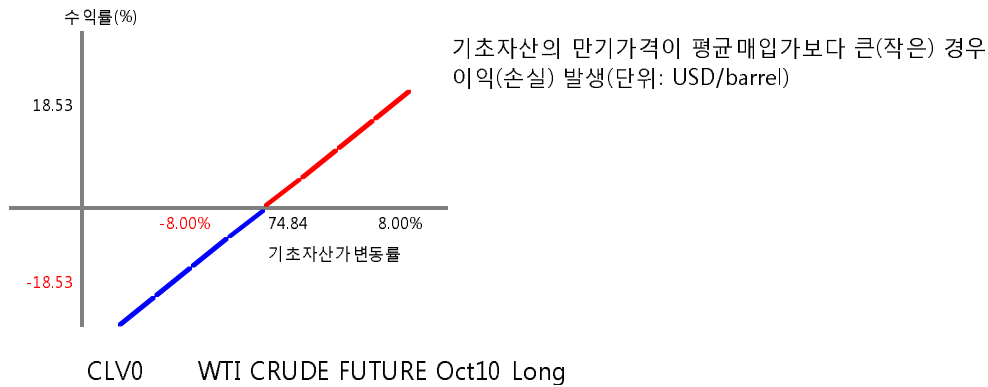
공시일: 2010-09-14

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%	149.23
	5.33%	99.42
	2.67%	49.80
	0.00%	0.00
시나리오	-2.67%	-49.80
	-5.33%	-99.42
	-8.00%	-149.23

최대손실 시나리오

위험액	-149.23
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	593.48
-----	--------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

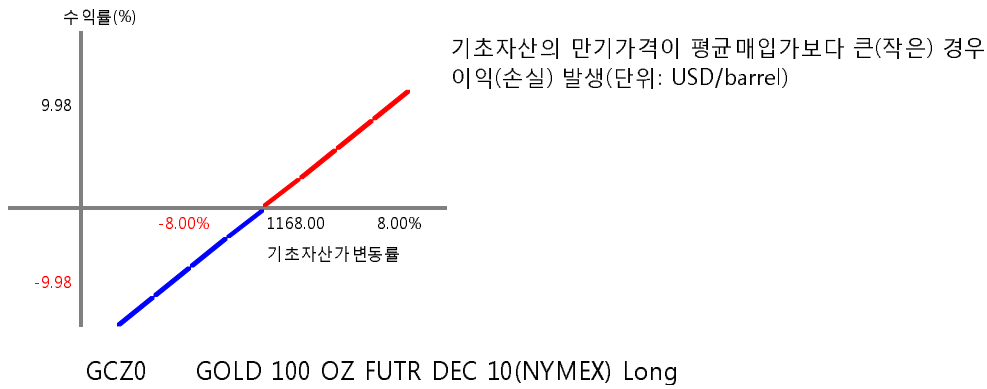
공시일: 2010-09-14

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

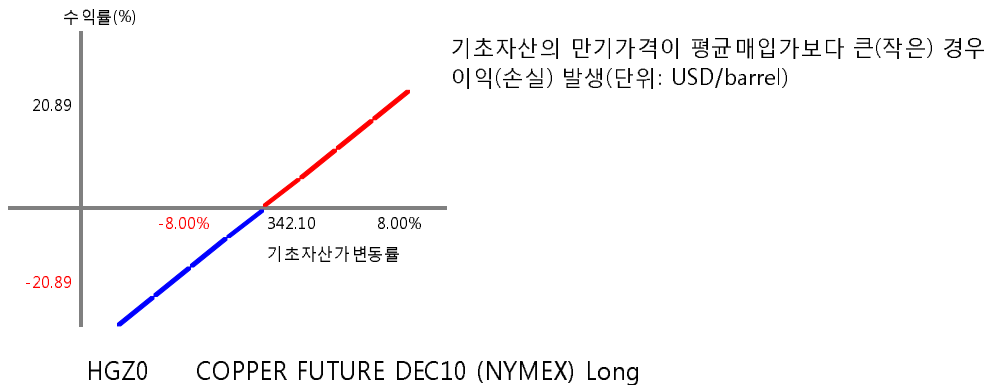
공시일: 2010-09-14

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

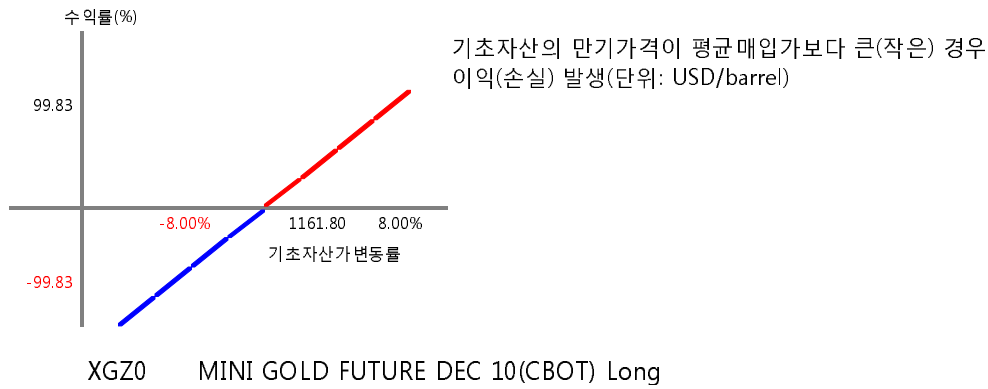
공시일: 2010-09-14

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]

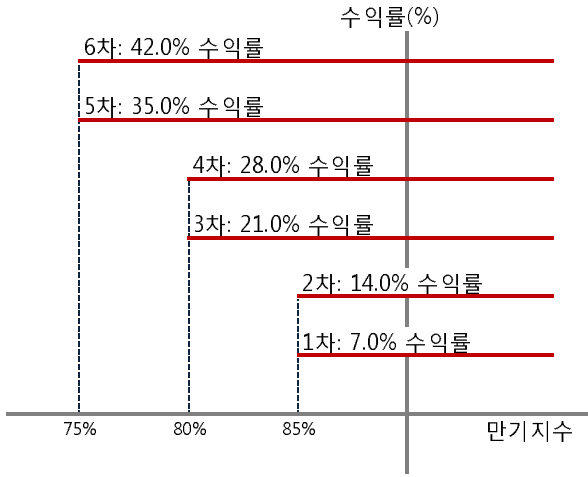
공시일: 2010-09-14

1. 계약금액

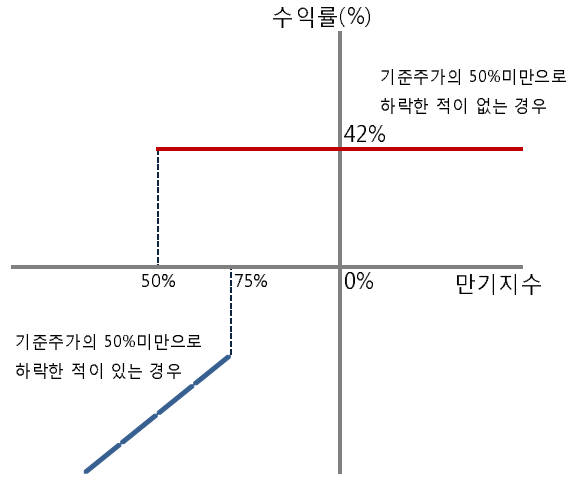
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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)
KR6502333034	신한투자(ELS)1395	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

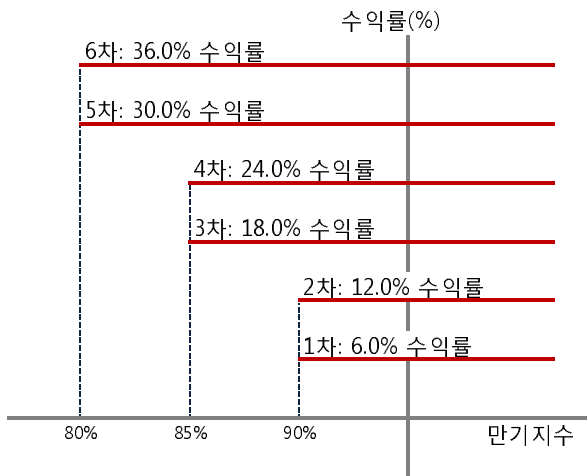
1. 계약금액

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

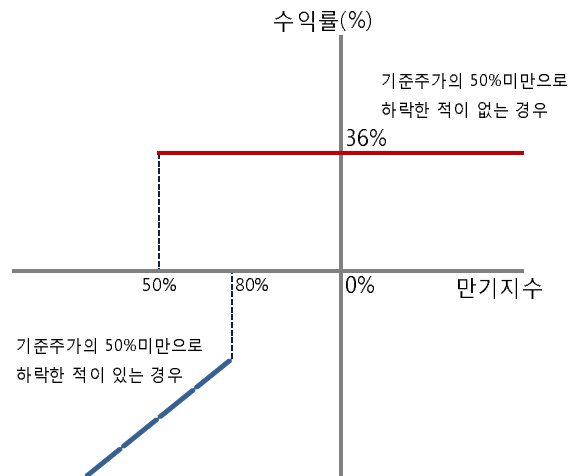
단위(백만원)

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%	109.81	93.17	76.52	59.88	43.23	26.59	9.94
	5.33%	91.46	74.82	58.18	41.53	24.89	8.24	(8.40)
	2.67%	71.50	54.86	38.22	21.57	4.93	(11.72)	(28.36)
	0.00%	49.93	33.29	16.64	0.00	(16.64)	(33.29)	(49.93)
	-2.67%	26.75	10.10	(6.54)	(23.18)	(39.83)	(56.47)	(73.12)
	-5.33%	1.95	(14.69)	(31.34)	(47.98)	(64.63)	(81.27)	(97.92)
	-8.00%	(24.46)	(41.10)	(57.75)	(74.39)	(91.04)	(107.68)	(124.33)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502348032	신한투자(ELS)1408	124.33
총 최대손실 예상금액		124.33

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 126.03

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

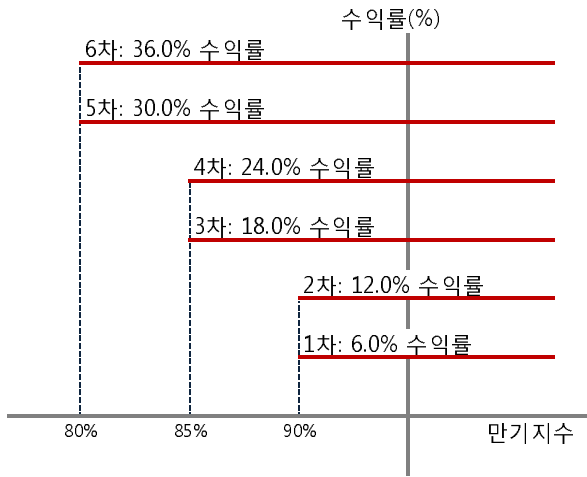
1. 계약금액

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

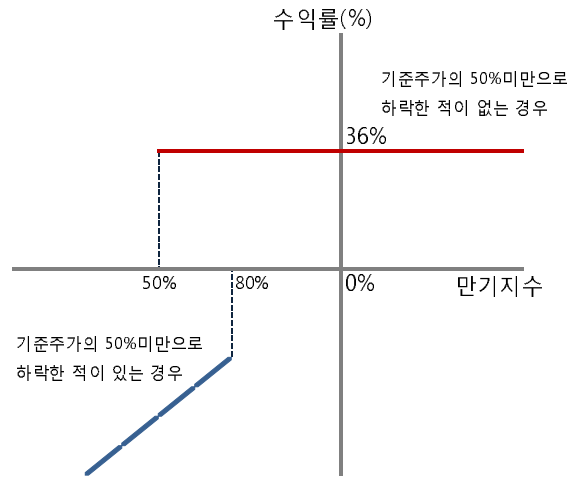
단위(백만원)

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%	32.54	28.00	23.47	18.93	14.40	9.86	5.33
	5.33%	29.00	24.46	19.93	15.39	10.86	6.33	1.79
	2.67%	22.69	18.15	13.62	9.08	4.55	0.02	(4.52)
	0.00%	13.60	9.07	4.53	0.00	(4.53)	(9.07)	(13.60)
	-2.67%	1.75	(2.79)	(7.32)	(11.86)	(16.39)	(20.93)	(25.46)
	-5.33%	(12.88)	(17.42)	(21.95)	(26.49)	(31.02)	(35.56)	(40.09)
	-8.00%	(30.29)	(34.82)	(39.35)	(43.89)	(48.42)	(52.96)	(57.49)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512107048	대신증권(ELS)1029	57.49
총 최대손실 예상금액		57.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 70.49

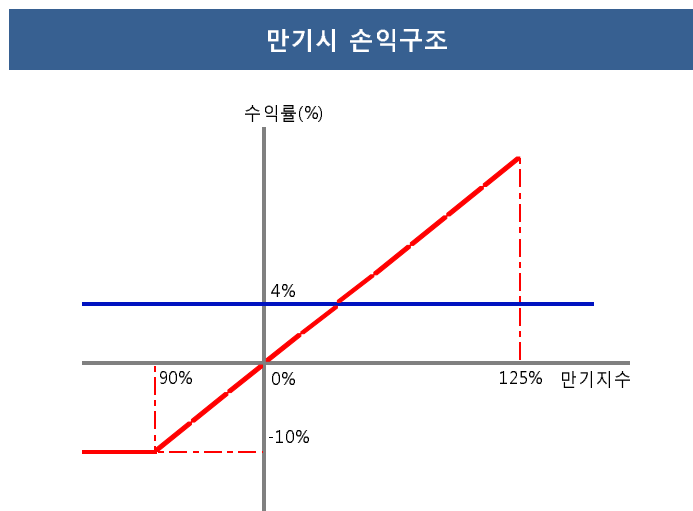
메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

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	8.71	7.28	5.86	4.44	3.01	1.59	0.16
자산	7.95	6.53	5.10	3.68	2.25	0.83	(0.59)
시나	6.47	5.05	3.62	2.20	0.78	(0.65)	(2.07)
리오	4.27	2.85	1.42	0.00	(1.42)	(2.85)	(4.27)
	1.35	(0.07)	(1.50)	(2.92)	(4.34)	(5.77)	(7.19)
	(2.29)	(3.71)	(5.14)	(6.56)	(7.98)	(9.41)	(10.83)
	(6.65)	(8.07)	(9.50)	(10.92)	(12.34)	(13.77)	(15.19)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503339048	신한투자(ELS)1447	15.19
총 최대손실 예상금액		15.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.77
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

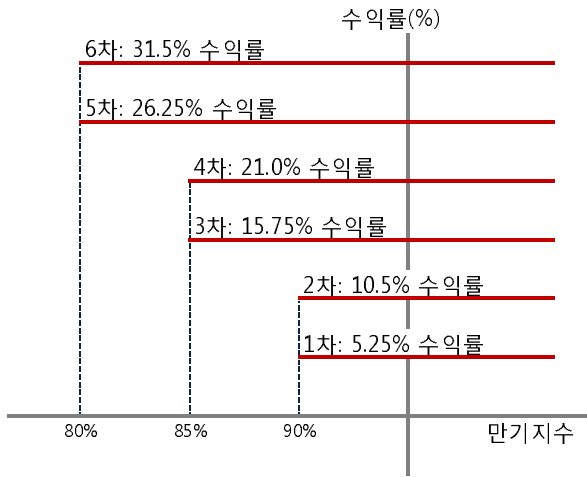
공시일: 2010-09-14

1. 계약금액

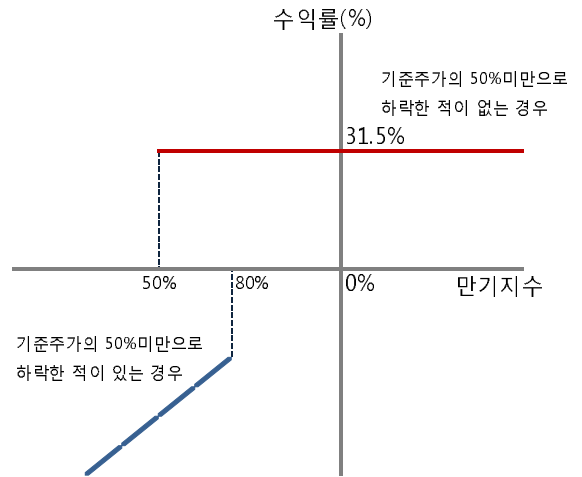
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장외

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%	1.23	0.32	(0.59)	(1.50)	(2.41)	(3.32)	(4.24)
	5.33%	2.13	1.22	0.31	(0.60)	(1.51)	(2.42)	(3.33)
	2.67%	2.64	1.72	0.81	(0.10)	(1.01)	(1.92)	(2.83)
	0.00%	2.73	1.82	0.91	0.00	(0.91)	(1.82)	(2.73)
	-2.67%	2.43	1.52	0.61	(0.31)	(1.22)	(2.13)	(3.04)
	-5.33%	1.72	0.81	(0.10)	(1.01)	(1.92)	(2.84)	(3.75)
	-8.00%	0.61	(0.30)	(1.21)	(2.12)	(3.04)	(3.95)	(4.86)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513135048	대신증권(ELS)1059	4.86
총 최대손실 예상금액		4.86

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 8.16

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

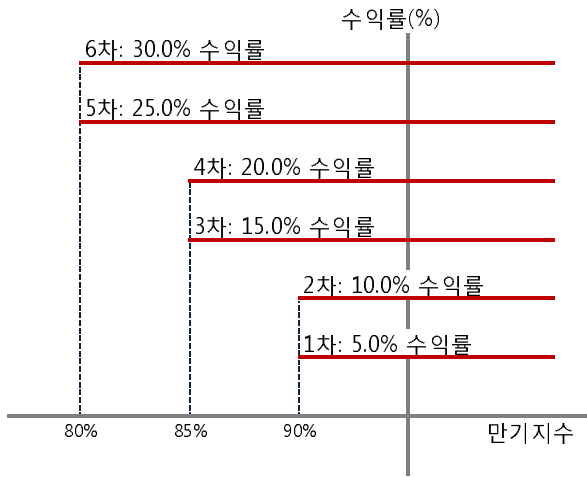
공시일: 2010-09-14

1. 계약금액

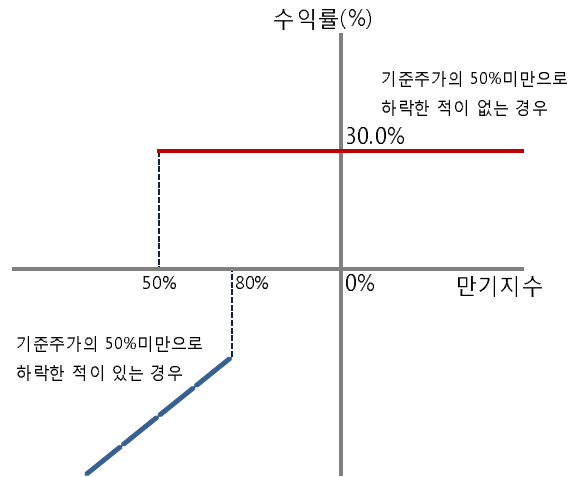
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,146	0	1,146	장외

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%	0.30	0.01	(0.28)	(0.57)	(0.86)	(1.15)	(1.44)
	5.33%	0.64	0.34	0.05	(0.24)	(0.53)	(0.82)	(1.11)
	2.67%	0.83	0.53	0.24	(0.05)	(0.34)	(0.63)	(0.92)
	0.00%	0.87	0.58	0.29	0.00	(0.29)	(0.58)	(0.87)
	-2.67%	0.78	0.49	0.20	(0.09)	(0.38)	(0.68)	(0.97)
	-5.33%	0.54	0.25	(0.04)	(0.33)	(0.62)	(0.91)	(1.20)
	-8.00%	0.17	(0.12)	(0.42)	(0.71)	(1.00)	(1.29)	(1.58)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513118051	대신증권(ELS)1072	1.58
총 최대손실 예상금액		1.58

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.89
-----	------

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

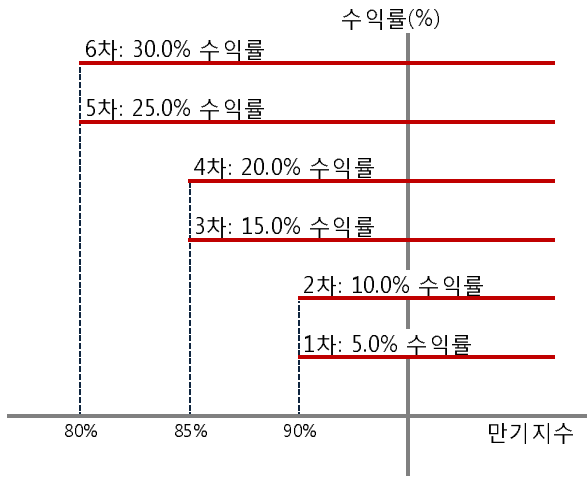
1. 계약금액

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

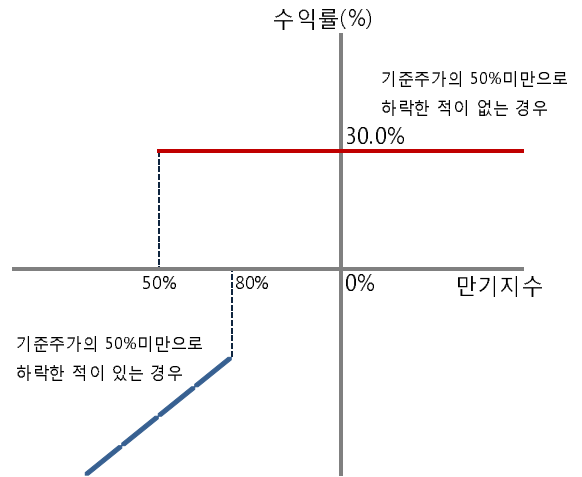
단위(백만원)

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 시나리오	8.00%	12.31	10.04	7.78	5.51	3.24	0.98	(1.29)
	5.33%	12.00	9.73	7.46	5.20	2.93	0.67	(1.60)
	2.67%	10.16	7.89	5.63	3.36	1.10	(1.17)	(3.43)
	0.00%	6.80	4.53	2.27	0.00	(2.27)	(4.53)	(6.80)
	-2.67%	1.91	(0.36)	(2.62)	(4.89)	(7.15)	(9.42)	(11.68)
	-5.33%	(4.50)	(6.77)	(9.04)	(11.30)	(13.57)	(15.83)	(18.10)
	-8.00%	(12.44)	(14.71)	(16.97)	(19.24)	(21.51)	(23.77)	(26.04)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	26.04
총 최대손실 예상금액		26.04

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 18.66

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

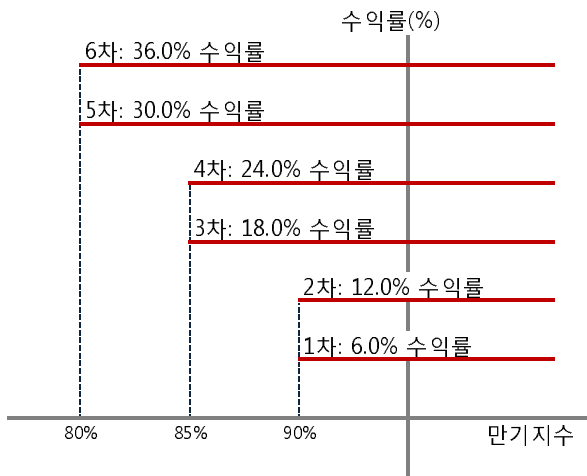
공시일: 2010-09-14

1. 계약금액

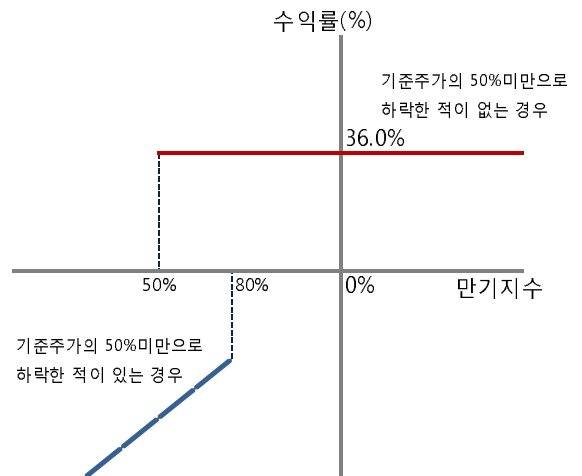
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

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%	1.01	0.76	0.50	0.25	(0.01)	(0.27)	(0.52)
	5.33%	0.96	0.71	0.45	0.20	(0.06)	(0.32)	(0.57)
	2.67%	0.88	0.63	0.37	0.11	(0.14)	(0.40)	(0.65)
	0.00%	0.77	0.51	0.26	0.00	(0.26)	(0.51)	(0.77)
	-2.67%	0.62	0.36	0.11	(0.15)	(0.40)	(0.66)	(0.91)
	-5.33%	0.44	0.19	(0.07)	(0.33)	(0.58)	(0.84)	(1.09)
	-8.00%	0.23	(0.03)	(0.28)	(0.54)	(0.79)	(1.05)	(1.30)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6509358059	신한투자(ELS)1506	1.30
총 최대손실 예상금액		1.30

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.39
-----	------

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

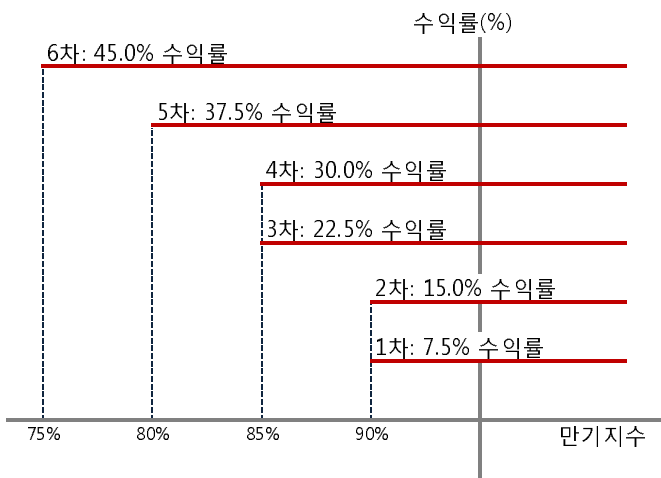
1. 계약금액

단위(백만원)

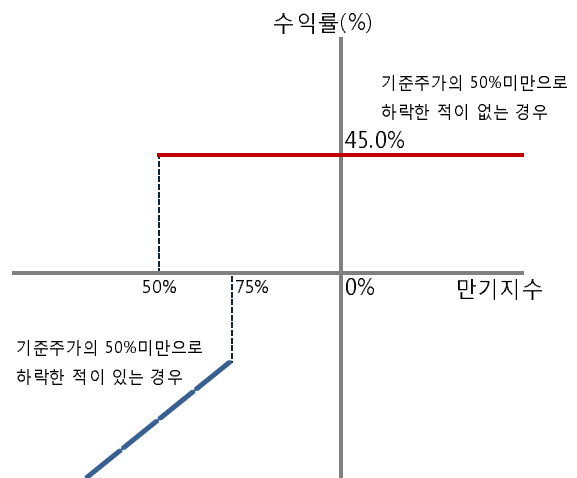
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

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%	14.86	12.19	9.51	6.83	4.16	1.48	(1.20)
	5.33%	13.10	10.42	7.74	5.07	2.39	(0.29)	(2.96)
	2.67%	10.82	8.14	5.46	2.79	0.11	(2.57)	(5.24)
	0.00%	8.03	5.35	2.68	0.00	(2.68)	(5.35)	(8.03)
	-2.67%	4.73	2.05	(0.62)	(3.30)	(5.98)	(8.65)	(11.33)
	-5.33%	0.92	(1.75)	(4.43)	(7.11)	(9.78)	(12.46)	(15.14)
	-8.00%	(3.40)	(6.07)	(8.75)	(11.43)	(14.10)	(16.78)	(19.46)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6519101069	대신증권(ELS)1101	19.46
총 최대손실 예상금액		19.46

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	18.36
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

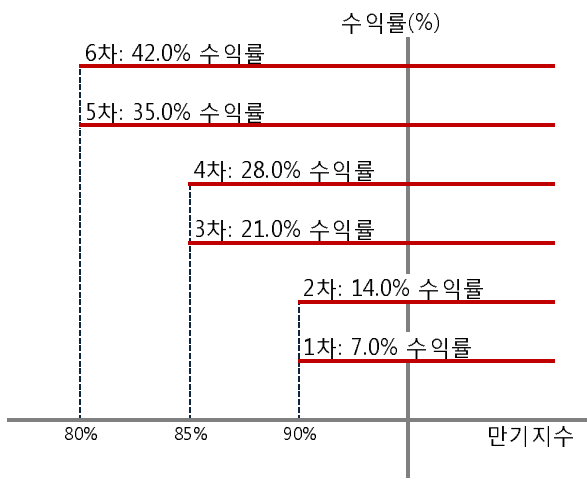
1. 계약금액

단위(백만원)

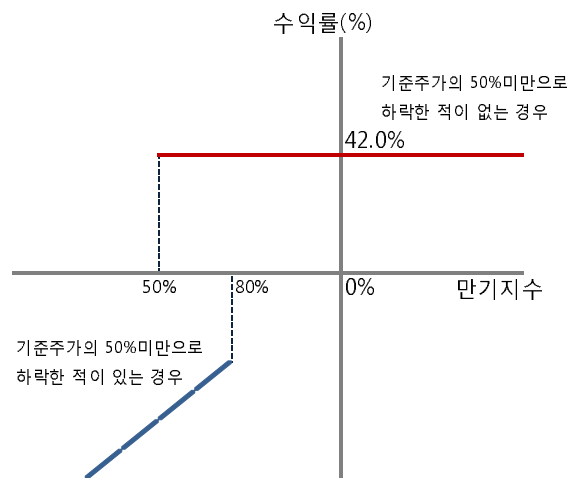
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

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	2.50	1.24	(0.01)	(1.26)	(2.51)	(3.77)	(5.02)	
자산	3.04	1.79	0.53	(0.72)	(1.97)	(3.22)	(4.48)	
시나리오	2.67%	3.46	2.21	0.95	(0.30)	(1.55)	(2.80)	
	0.00%	3.76	2.50	1.25	0.00	(1.25)	(2.50)	
	-2.67%	3.93	2.68	1.43	0.18	(1.07)	(2.33)	
	-5.33%	3.99	2.74	1.49	0.23	(1.02)	(2.27)	
	-8.00%	3.92	2.67	1.42	0.17	(1.09)	(2.34)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513121063	대신증권(ELS)1120	5.02
총 최대손실 예상금액		5.02

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 6.85

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

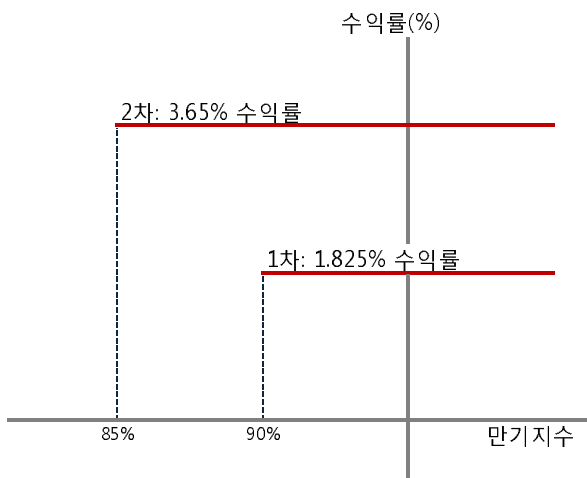
1. 계약금액

단위(백만원)

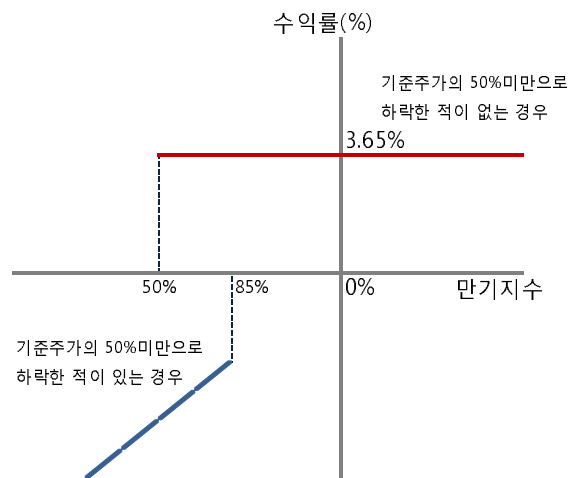
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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: 2010-09-14

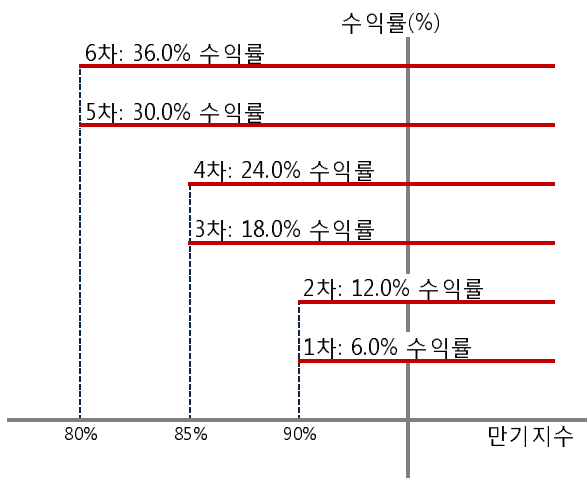
1. 계약금액

단위(백만원)

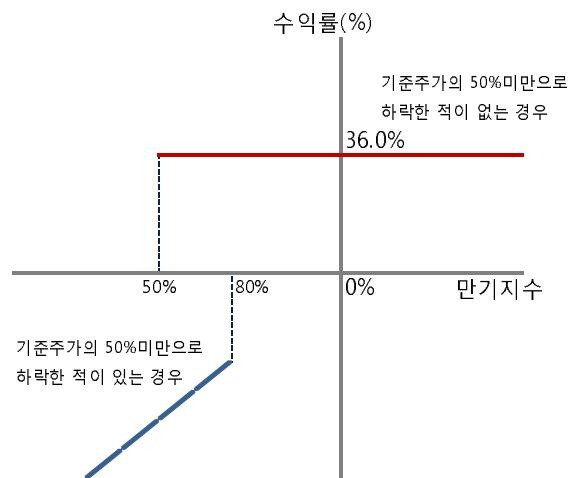
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외
누계	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외

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 자산 시나리오	8.00%	15.80	9.58	3.35	(2.87)	(9.10)	(15.32)	(21.55)
	5.33%	19.00	12.77	6.55	0.32	(5.90)	(12.13)	(18.35)
	2.67%	19.96	13.73	7.51	1.28	(4.94)	(11.17)	(17.39)
	0.00%	18.67	12.45	6.22	0.00	(6.22)	(12.45)	(18.67)
	-2.67%	15.15	8.93	2.70	(3.52)	(9.75)	(15.97)	(22.20)
	-5.33%	9.39	3.17	(3.06)	(9.28)	(15.51)	(21.73)	(27.96)
	-8.00%	1.39	(4.83)	(11.06)	(17.28)	(23.51)	(29.73)	(35.96)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6523315085	대우증권(ELS)4284	35.96
총 최대손실 예상금액		35.96

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	32.17
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

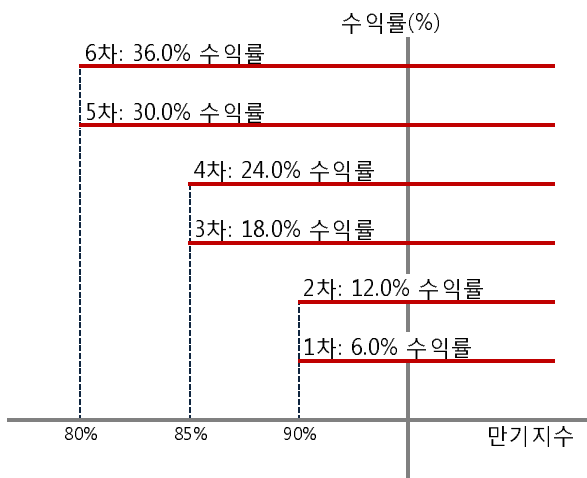
1. 계약금액

단위(백만원)

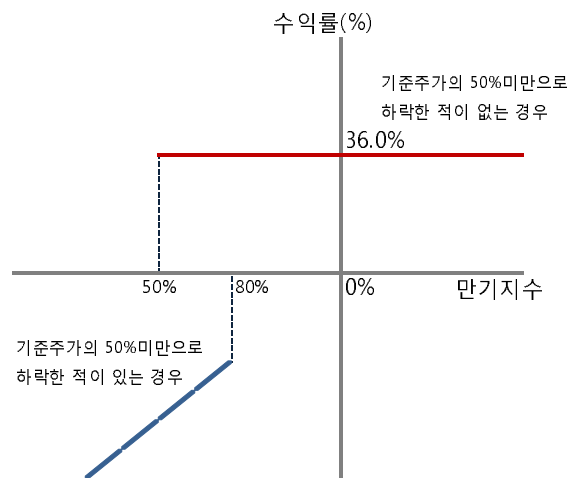
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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%	(24.69)	(24.10)	(23.52)	(22.94)	(22.35)	(21.77)	(21.19)
	5.33%	(24.62)	(24.04)	(23.45)	(22.87)	(22.29)	(21.70)	(21.12)
	2.67%	(16.98)	(16.39)	(15.81)	(15.23)	(14.64)	(14.06)	(13.47)
	0.00%	(1.75)	(1.17)	(0.58)	0.00	0.58	1.17	1.75
	-2.67%	21.05	21.64	22.22	22.81	23.39	23.97	24.56
	-5.33%	51.44	52.02	52.61	53.19	53.77	54.36	54.94
	-8.00%	89.41	89.99	90.57	91.16	91.74	92.32	92.91

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233AD071	대우증권(ELS)4263	24.69
총 최대손실 예상금액		24.69

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 106.66

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-09-14

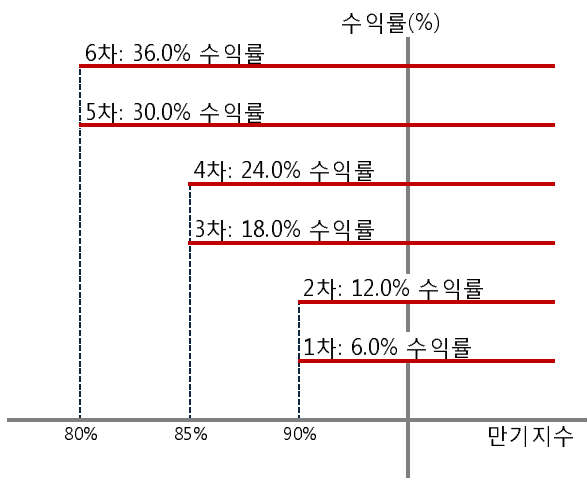
1. 계약금액

단위(백만원)

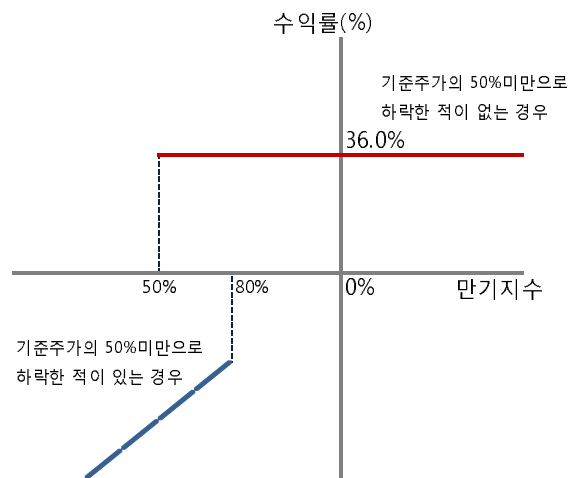
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	512	0	512	장외
누계	유가증권	선물	512	0	512	장외

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 자산 시나 리오	8.00%	22.79	20.12	17.46	14.80	12.14	9.47	6.81
	5.33%	18.76	16.10	13.44	10.77	8.11	5.45	2.79
	2.67%	13.83	11.17	8.50	5.84	3.18	0.52	(2.15)
	0.00%	7.99	5.33	2.66	0.00	(2.66)	(5.33)	(7.99)
	-2.67%	1.24	(1.43)	(4.09)	(6.75)	(9.41)	(12.08)	(14.74)
	-5.33%	(6.43)	(9.09)	(11.75)	(14.41)	(17.08)	(19.74)	(22.40)
	-8.00%	(15.00)	(17.66)	(20.32)	(22.99)	(25.65)	(28.31)	(30.97)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293A8084	대우증권(ELS)4375	30.97
총 최대손실 예상금액		30.97

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 33.50