

**파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시**

# 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

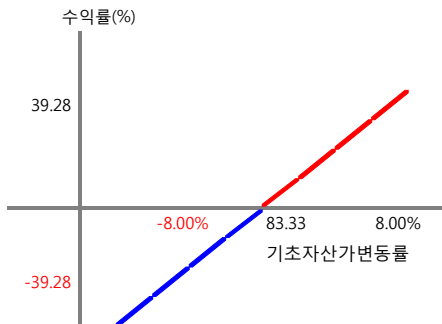
공시일: 2010-12-15

## 1. 계약금액

단위(백만원)

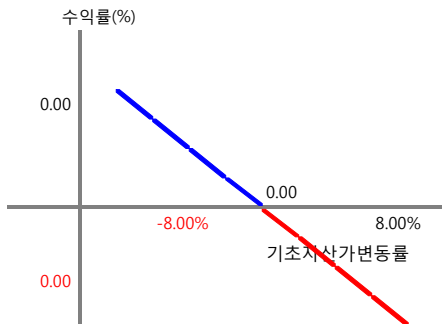
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6     | 0     | 6         | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조



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

CLZ0 WTI CRUDE FUTURE DEC 10 Long



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

## 3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLZ0 WTI CRUDE FUTURE DEC 10 Long

| 구분                   | 시나리오   |        |
|----------------------|--------|--------|
| 기초<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%  | 39.28  |
|                      | 5.33%  | 26.17  |
|                      | 2.67%  | 13.11  |
|                      | 0.00%  | 0.00   |
|                      | -2.67% | -13.11 |
|                      | -5.33% | -26.17 |
|                      | -8.00% | -39.28 |

### 최대손실 시나리오

|     |        |
|-----|--------|
| 위험액 | -39.28 |
|-----|--------|

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |        |
|-----|--------|
| 위험액 | 159.19 |
|-----|--------|

# 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

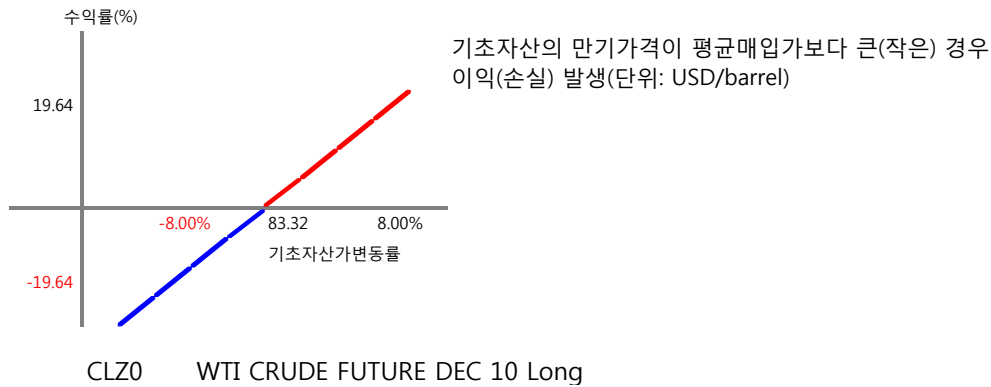
공시일: 2010-12-15

## 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))

CLZ0 WTI CRUDE FUTURE DEC 10 Long

| 구분    | 시나리오   |        |
|-------|--------|--------|
| 기초 자산 | 8.00%  | 39.28  |
|       | 5.33%  | 26.17  |
|       | 2.67%  | 13.11  |
| 시나리오  | 0.00%  | 0.00   |
|       | -2.67% | -13.11 |
|       | -5.33% | -26.17 |
|       | -8.00% | -39.28 |

### 최대손실 시나리오

|     |        |
|-----|--------|
| 위험액 | -39.28 |
|-----|--------|

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |        |
|-----|--------|
| 위험액 | 103.77 |
|-----|--------|

# 메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

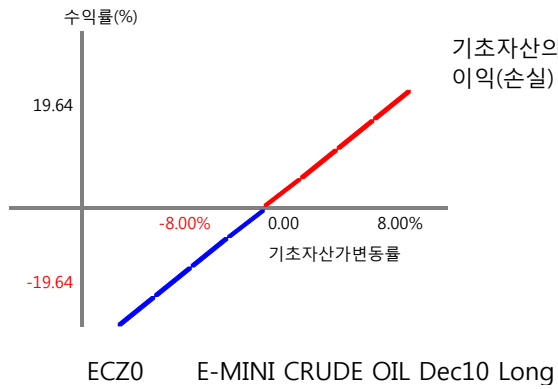
공시일: 2010-12-15

## 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

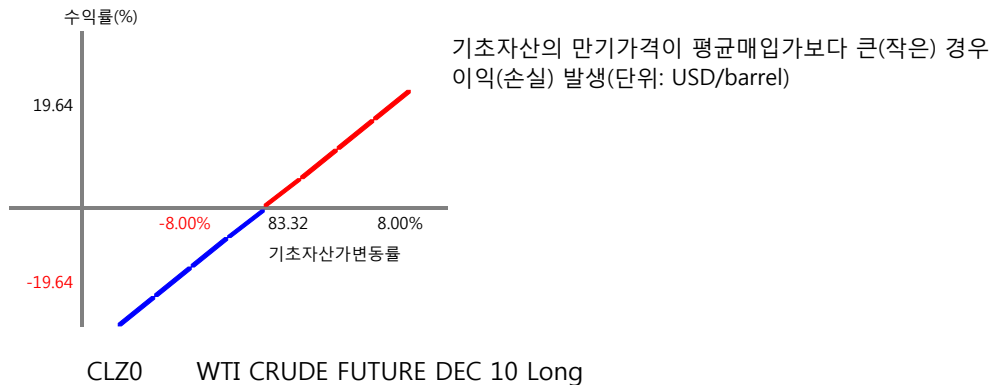
공시일: 2010-12-15

## 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))

CLZ0 WTI CRUDE FUTURE DEC 10 Long

| 구분    | 시나리오   |         |
|-------|--------|---------|
| 기초 자산 | 8.00%  | 279.62  |
|       | 5.33%  | 186.30  |
|       | 2.67%  | 93.32   |
| 시나리오  | 0.00%  | 0.00    |
|       | -2.67% | -93.32  |
|       | -5.33% | -186.30 |
|       | -8.00% | -279.62 |

### 최대손실 시나리오

|     |         |
|-----|---------|
| 위험액 | -279.62 |
|-----|---------|

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |          |
|-----|----------|
| 위험액 | 1,112.74 |
|-----|----------|

# 메리츠PremiumCommodity특별자산1

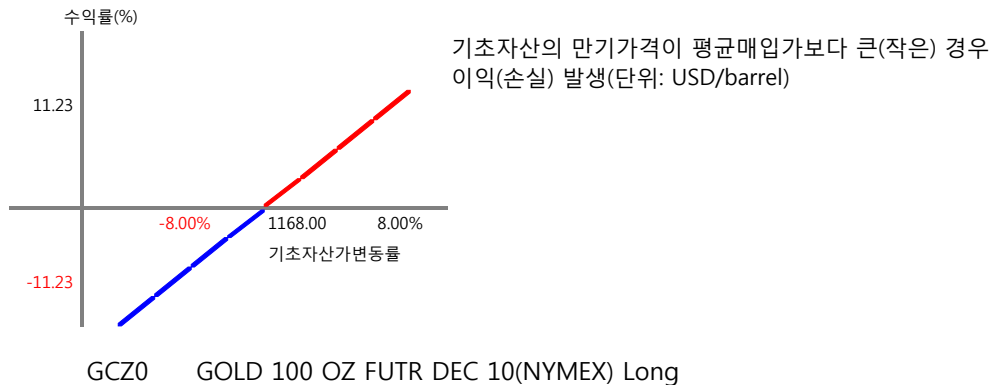
공시일: 2010-12-15

## 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

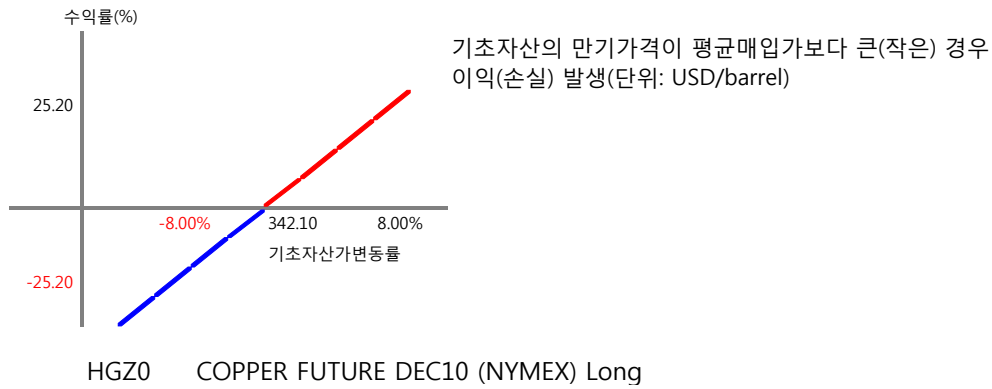
공시일: 2010-12-15

## 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

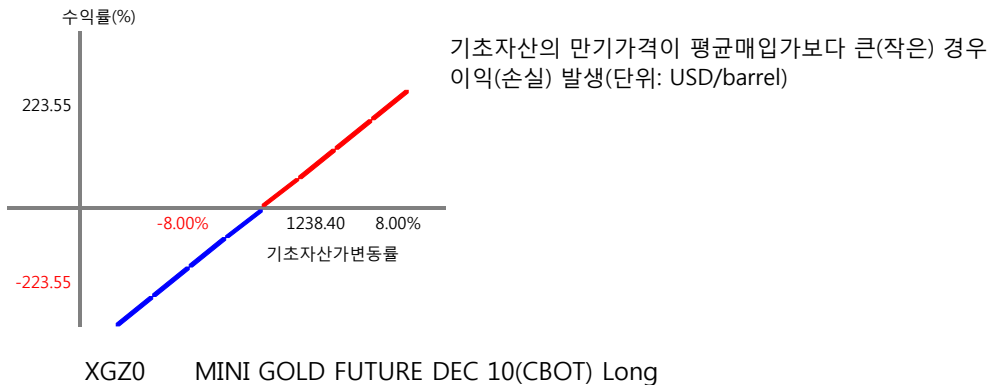
공시일: 2010-12-15

## 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   | 2     | 0     | 2         | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조





# 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

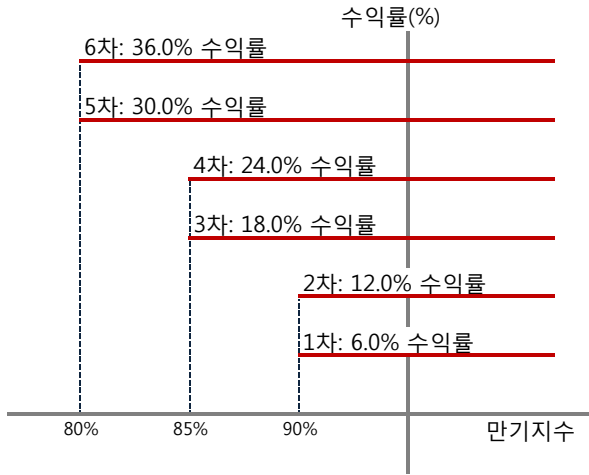
공시일: 2010-12-15

## 1. 계약금액

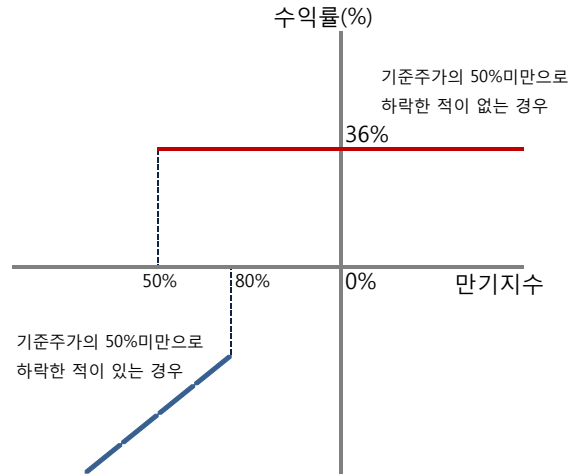
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 1,542 | 0     | 1,542     | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

| 구분         | 변동성 시나리오 | 단위(백만원) |         |         |         |         |         |          |
|------------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|
|            |          | -25.00% | -16.67% | -8.33%  | 0.00%   | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%   |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00%    | 78.13   | 67.00   | 55.88   | 44.76   | 33.63   | 22.51   | 11.39    |
|            | 5.33%    | 66.80   | 55.68   | 44.55   | 33.43   | 22.31   | 11.18   | 0.06     |
|            | 2.67%    | 51.88   | 40.76   | 29.63   | 18.51   | 7.39    | (3.74)  | (14.86)  |
|            | 0.00%    | 33.37   | 22.25   | 11.12   | 0.00    | (11.12) | (22.25) | (33.37)  |
|            | -2.67%   | 11.27   | 0.15    | (10.98) | (22.10) | (33.23) | (44.35) | (55.47)  |
|            | -5.33%   | (14.42) | (25.55) | (36.67) | (47.79) | (58.92) | (70.04) | (81.17)  |
|            | -8.00%   | (43.71) | (54.83) | (65.96) | (77.08) | (88.20) | (99.33) | (110.45) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |               | 단위(백만원) |
|---------------------|---------------|---------|
| KR6502348032        | 신한투자(ELS)1408 | 110.45  |
| 총 최대손실 예상금액         |               | 110.45  |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |        |
|-----|--------|
| 위험액 | 100.06 |
|-----|--------|

# 메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

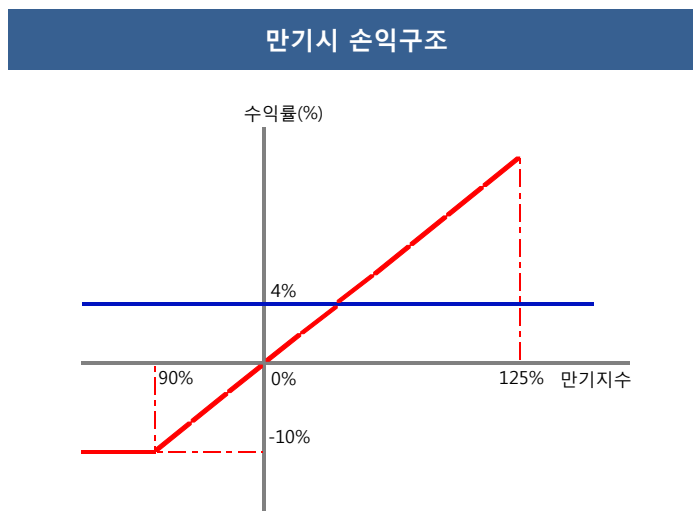
공시일: 2010-12-15

## 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<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%    | (17.67) | (20.11) | (22.55) | (24.99) | (27.43) | (29.87) | (32.31) |
|                      | 5.33%    | (7.08)  | (9.52)  | (11.96) | (14.40) | (16.84) | (19.28) | (21.72) |
|                      | 2.67%    | 1.25    | (1.19)  | (3.63)  | (6.07)  | (8.51)  | (10.95) | (13.39) |
|                      | 0.00%    | 7.32    | 4.88    | 2.44    | 0.00    | (2.44)  | (4.88)  | (7.32)  |
|                      | -2.67%   | 11.13   | 8.69    | 6.25    | 3.81    | 1.37    | (1.07)  | (3.51)  |
|                      | -5.33%   | 12.68   | 10.24   | 7.80    | 5.36    | 2.92    | 0.48    | (1.96)  |
|                      | -8.00%   | 11.97   | 9.53    | 7.09    | 4.65    | 2.21    | (0.23)  | (2.66)  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |               |              |
|--------------------|---------------|--------------|
| KR6503339048       | 신한투자(ELS)1447 | 32.31        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |               | <b>32.31</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|            |              |
|------------|--------------|
| <b>위험액</b> | <b>18.77</b> |
|------------|--------------|

# 메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

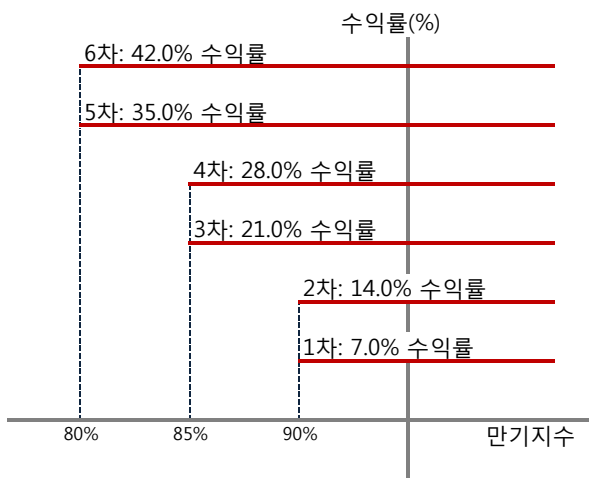
## 1. 계약금액

단위(백만원)

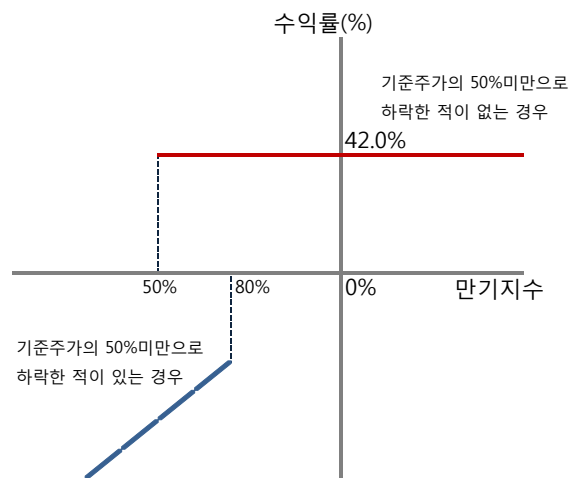
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,131 | 0     | 1,131     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,131 | 0     | 1,131     | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분         | 변동성 시나리오 | 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)

|              |               |      |
|--------------|---------------|------|
| KR6513121063 | 대신증권(ELS)1120 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액  |               | 0.00 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

# 메리츠한증지수연계증권제9호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

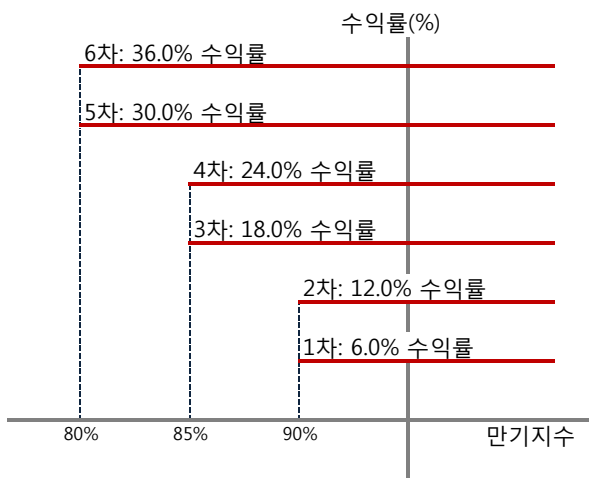
## 1. 계약금액

단위(백만원)

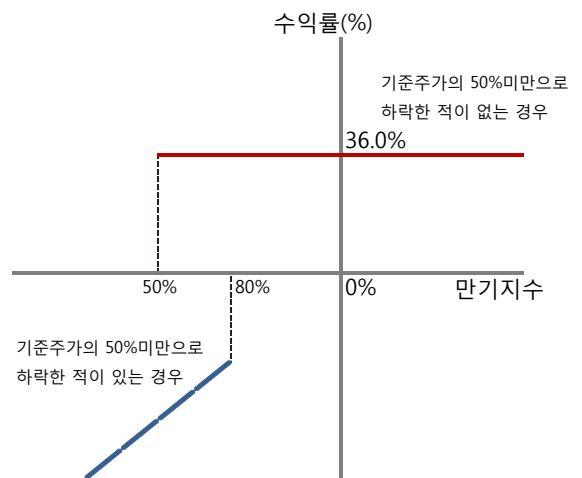
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 2,686 | 0     | 2,686     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,686 | 0     | 2,686     | 장외 |

## 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     | 0.65     | 0.53    | 0.41   | 0.29   | 0.17   | 0.05   | (0.07) |  |
| 8.00%  | 0.37     | 0.25    | 0.13   | 0.01   | (0.11) | (0.23) | (0.35) |  |
| 5.33%  | 0.28     | 0.16    | 0.04   | (0.09) | (0.21) | (0.33) | (0.45) |  |
| 2.67%  | 0.36     | 0.24    | 0.12   | 0.00   | (0.12) | (0.24) | (0.36) |  |
| 0.00%  | 0.63     | 0.51    | 0.39   | 0.27   | 0.15   | 0.03   | (0.09) |  |
| -2.67% | 1.08     | 0.96    | 0.84   | 0.71   | 0.59   | 0.47   | 0.35   |  |
| -5.33% | 1.71     | 1.59    | 1.47   | 1.34   | 1.22   | 1.10   | 0.98   |  |
| -8.00% |          |         |        |        |        |        |        |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |               |      |
|--------------|---------------|------|
| KR6523315085 | 대우증권(ELS)4284 | 0.45 |
| 총 최대손실 예상금액  |               | 0.45 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1.52

# 메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

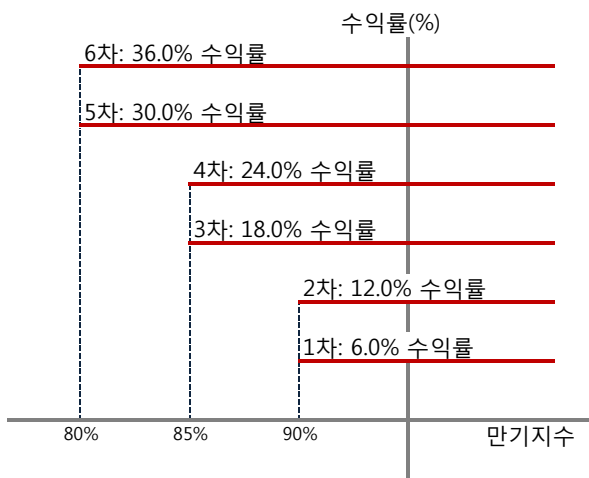
## 1. 계약금액

단위(백만원)

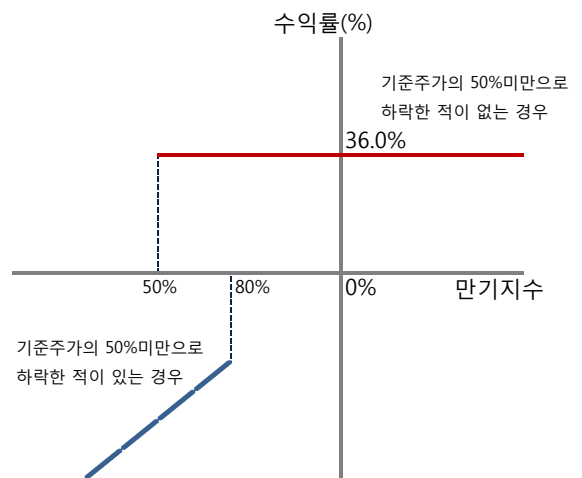
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 512   | 0     | 512       | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 512   | 0     | 512       | 장외 |

## 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 | 6.10     | 5.39    | 4.68    | 3.97    | 3.26    | 2.55    | 1.85    |         |
| 자산 | 5.75     | 5.04    | 4.33    | 3.62    | 2.91    | 2.20    | 1.50    |         |
| 시나 | 4.42     | 3.72    | 3.01    | 2.30    | 1.59    | 0.88    | 0.17    |         |
| 리오 | 0.00%    | 2.13    | 1.42    | 0.71    | 0.00    | (0.71)  | (1.42)  | (2.13)  |
|    | -2.67%   | (1.14)  | (1.85)  | (2.56)  | (3.27)  | (3.98)  | (4.69)  | (5.40)  |
|    | -5.33%   | (5.39)  | (6.10)  | (6.81)  | (7.52)  | (8.22)  | (8.93)  | (9.64)  |
|    | -8.00%   | (10.61) | (11.32) | (12.02) | (12.73) | (13.44) | (14.15) | (14.86) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |               |       |
|--------------|---------------|-------|
| KR65293A8084 | 대우증권(ELS)4375 | 14.86 |
| 총 최대손실 예상금액  |               | 14.86 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 11.11

# 메리츠2Star증권LESF-12호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

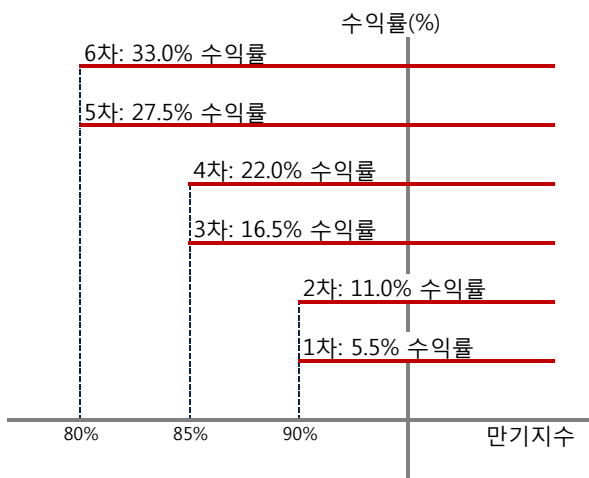
## 1. 계약금액

단위(백만원)

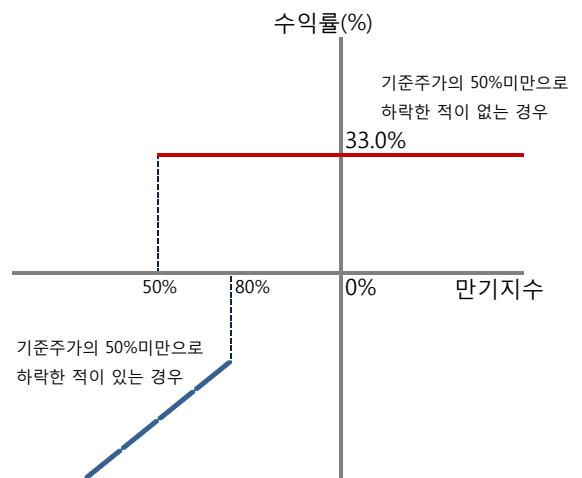
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 851   | 0     | 851       | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 851   | 0     | 851       | 장외 |

## 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 | 9.30     | 7.62    | 5.95    | 4.27    | 2.60    | 0.93    | (0.75)  |         |
| 자산 | 9.28     | 7.61    | 5.93    | 4.26    | 2.58    | 0.91    | (0.76)  |         |
| 시나 | 7.86     | 6.18    | 4.51    | 2.83    | 1.16    | (0.51)  | (2.19)  |         |
| 리오 | 0.00%    | 5.02    | 3.35    | 1.67    | 0.00    | (1.67)  | (3.35)  | (5.02)  |
|    | -2.67%   | 0.78    | (0.89)  | (2.57)  | (4.24)  | (5.92)  | (7.59)  | (9.26)  |
|    | -5.33%   | (4.87)  | (6.55)  | (8.22)  | (9.89)  | (11.57) | (13.24) | (14.92) |
|    | -8.00%   | (11.93) | (13.61) | (15.28) | (16.95) | (18.63) | (20.30) | (21.98) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |               |       |
|--------------|---------------|-------|
| KR6542302098 | 신영증권(ELS)1714 | 21.98 |
| 총 최대손실 예상금액  |               | 21.98 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 14.00

# 메리츠2Star증권LESF-13호[ELS-파생형]

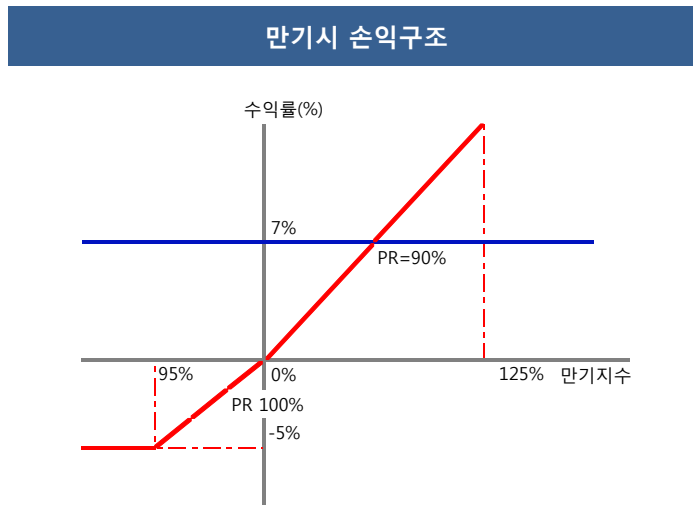
공시일: 2010-12-15

## 1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 588   | 0     | 588       | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 588   | 0     | 588       | 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<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%    | 7.55    | 6.08   | 4.61   | 3.14    | 1.67    | 0.19    | (1.28)  |
|                      | 5.33%    | 7.30    | 5.83   | 4.35   | 2.88    | 1.41    | (0.06)  | (1.53)  |
|                      | 2.67%    | 6.25    | 4.78   | 3.31   | 1.84    | 0.37    | (1.10)  | (2.58)  |
|                      | 0.00%    | 4.41    | 2.94   | 1.47   | 0.00    | (1.47)  | (2.94)  | (4.41)  |
|                      | -2.67%   | 1.78    | 0.31   | (1.16) | (2.63)  | (4.10)  | (5.57)  | (7.04)  |
|                      | -5.33%   | (1.64)  | (3.11) | (4.58) | (6.05)  | (7.53)  | (9.00)  | (10.47) |
|                      | -8.00%   | (5.86)  | (7.33) | (8.80) | (10.27) | (11.74) | (13.21) | (14.68) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |               | 단위(백만원) |
|---------------------|---------------|---------|
| KR6503337091        | 신한투자(ELS)1781 | 14.68   |
| 총 최대손실 예상금액         |               | 14.68   |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |       |
|-----|-------|
| 위험액 | 15.59 |
|-----|-------|

# 메리츠2Star증권LESF-14호 [ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

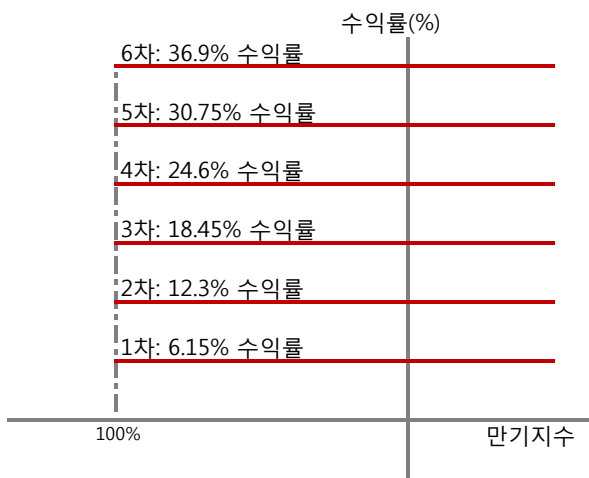
## 1. 계약금액

단위(백만원)

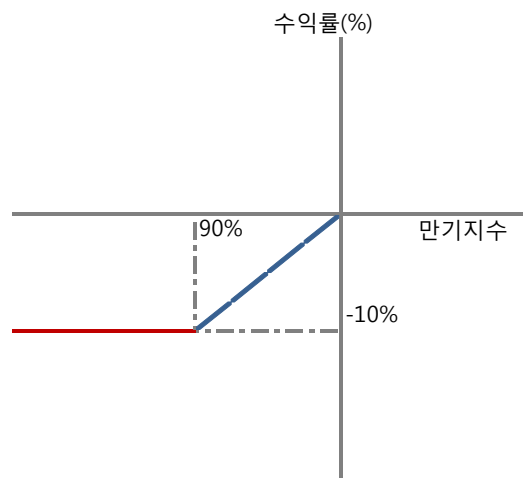
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,271 | 0     | 1,271     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,271 | 0     | 1,271     | 장외 |

## 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 | 31.27    | 29.20   | 27.13   | 25.06   | 22.98   | 20.91   | 18.84   |  |
| 자산 | 26.17    | 24.09   | 22.02   | 19.95   | 17.88   | 15.81   | 13.74   |  |
| 시나 | 17.81    | 15.74   | 13.67   | 11.60   | 9.53    | 7.46    | 5.39    |  |
| 리오 | 0.00%    | 4.14    | 2.07    | 0.00    | (2.07)  | (4.14)  | (6.21)  |  |
|    | -2.67%   | (8.63)  | (10.71) | (12.78) | (14.85) | (16.92) | (18.99) |  |
|    | -5.33%   | (26.73) | (28.80) | (30.88) | (32.95) | (35.02) | (37.09) |  |
|    | -8.00%   | (48.08) | (50.15) | (52.22) | (54.29) | (56.36) | (58.44) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |             |       |
|--------------|-------------|-------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 60.51 |
| 총 최대손실 예상금액  |             | 60.51 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 58.59



# 메리츠2Star증권SEPO-5호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

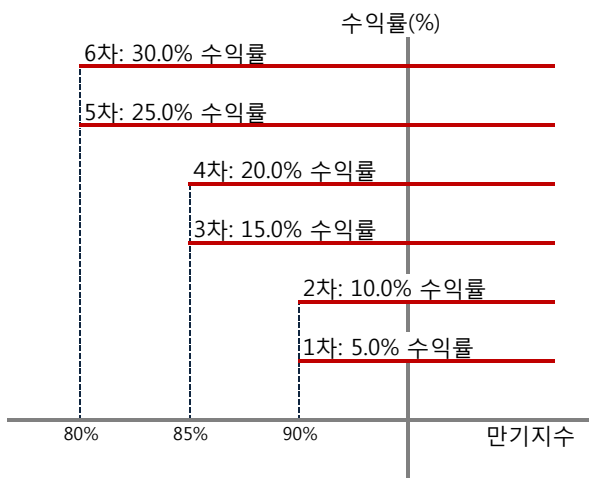
## 1. 계약금액

단위(백만원)

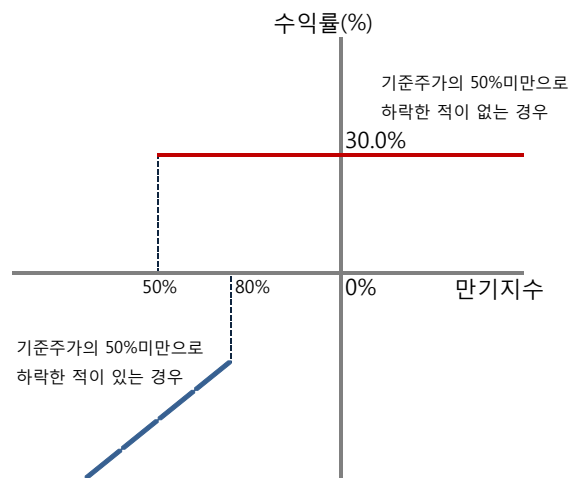
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,834 | 0     | 1,834     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,834 | 0     | 1,834     | 장외 |

## 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 | 45.72    | 39.23   | 32.74   | 26.25   | 19.76   | 13.27   | 6.78    |  |
| 자산 | 39.51    | 33.01   | 26.52   | 20.03   | 13.54   | 7.05    | 0.56    |  |
| 시나 | 30.76    | 24.26   | 17.77   | 11.28   | 4.79    | (1.70)  | (8.19)  |  |
| 리오 | 0.00%    | 12.98   | 6.49    | 0.00    | (6.49)  | (12.98) | (19.47) |  |
|    | -2.67%   | (0.83)  | (7.32)  | (13.81) | (20.31) | (26.80) | (33.29) |  |
|    | -5.33%   | (10.69) | (17.18) | (23.67) | (30.16) | (36.65) | (43.14) |  |
|    | -8.00%   | (29.57) | (36.06) | (42.55) | (49.04) | (55.53) | (62.03) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |               |       |
|--------------|---------------|-------|
| KR65023590A6 | 신한투자(ELS)1851 | 68.52 |
| 총 최대손실 예상금액  |               | 68.52 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 60.32

# 메리츠주가지수연계증권제5호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

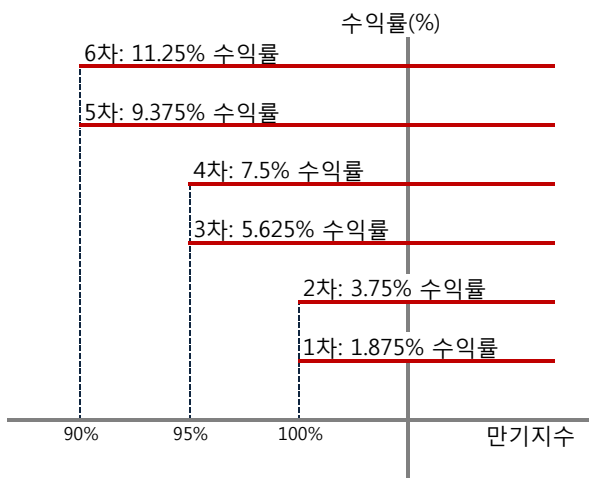
## 1. 계약금액

단위(백만원)

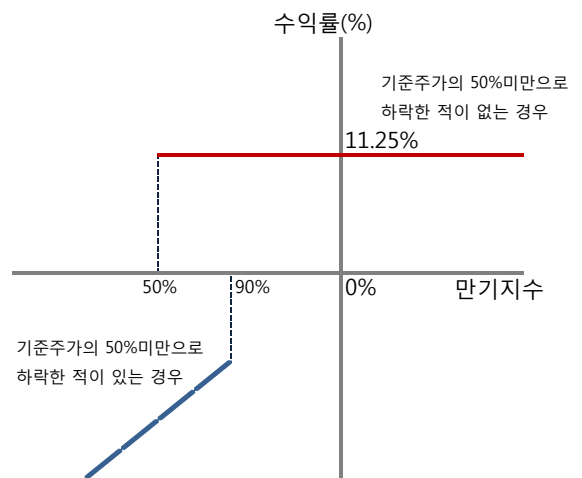
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 5,000 | 0     | 5,000     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,000 | 0     | 5,000     | 장외 |

## 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%    | 26.09    | 26.16   | 26.22  | 26.29 | 26.36 | 26.42  | 26.49  |
|            | 5.33%    | 10.69    | 10.75   | 10.82  | 10.89 | 10.96 | 11.02  | 11.09  |
|            | 2.67%    | 1.92     | 1.99    | 2.06   | 2.12  | 2.19  | 2.26   | 2.33   |
|            | 0.00%    | (0.20)   | (0.13)  | (0.07) | 0.00  | 0.07  | 0.13   | 0.20   |
|            | -2.67%   | 4.31     | 4.38    | 4.45   | 4.51  | 4.58  | 4.65   | 4.72   |
|            | -5.33%   | 15.47    | 15.53   | 15.60  | 15.67 | 15.73 | 15.80  | 15.87  |
|            | -8.00%   | 33.26    | 33.33   | 33.39  | 33.46 | 33.53 | 33.59  | 33.66  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |             |      |
|--------------|-------------|------|
| KR65233960A7 | 대우증권ELS4586 | 0.20 |
| 총 최대손실 예상금액  |             | 0.20 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 16.53

# 메리츠한증지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

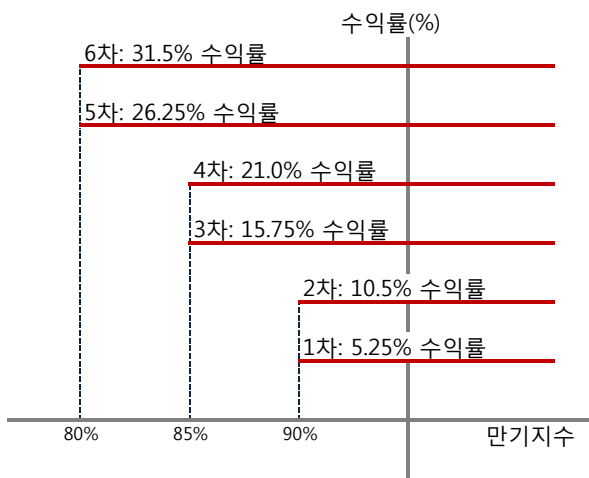
## 1. 계약금액

단위(백만원)

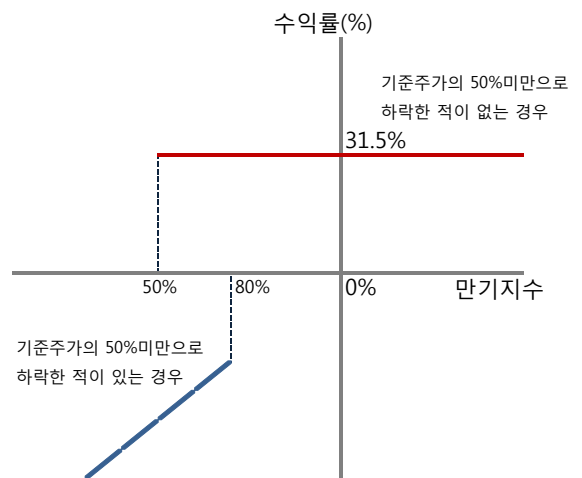
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,417 | 0     | 1,417     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,417 | 0     | 1,417     | 장외 |

## 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%    | 11.53    | 8.99    | 6.46    | 3.93    | 1.40    | (1.13)  | (3.67)  |
|            | 5.33%    | 11.92    | 9.39    | 6.86    | 4.33    | 1.80    | (0.74)  | (3.27)  |
|            | 2.67%    | 10.61    | 8.08    | 5.55    | 3.02    | 0.49    | (2.05)  | (4.58)  |
|            | 0.00%    | 7.60     | 5.06    | 2.53    | 0.00    | (2.53)  | (5.06)  | (7.60)  |
|            | -2.67%   | 2.87     | 0.34    | (2.19)  | (4.72)  | (7.26)  | (9.79)  | (12.32) |
|            | -5.33%   | (3.56)   | (6.09)  | (8.63)  | (11.16) | (13.69) | (16.22) | (18.75) |
|            | -8.00%   | (11.70)  | (14.23) | (16.77) | (19.30) | (21.83) | (24.36) | (26.89) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |                 |       |
|--------------|-----------------|-------|
| KR65533190B6 | 우리투자증권(ELS)3658 | 26.89 |
| 총 최대손실 예상금액  |                 | 26.89 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 20.58

# 메리츠주가지수연계증권제6호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-15

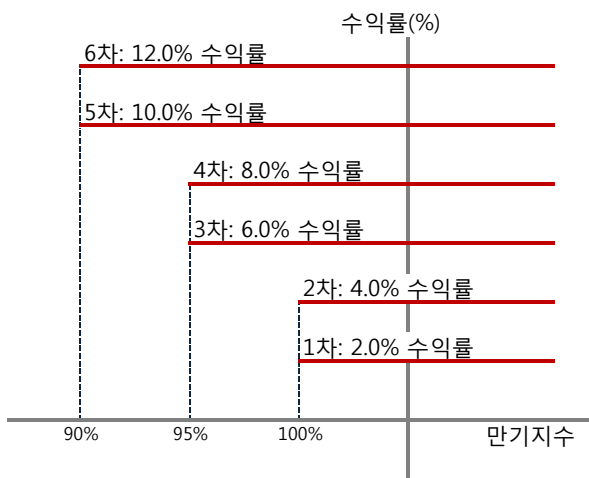
## 1. 계약금액

단위(백만원)

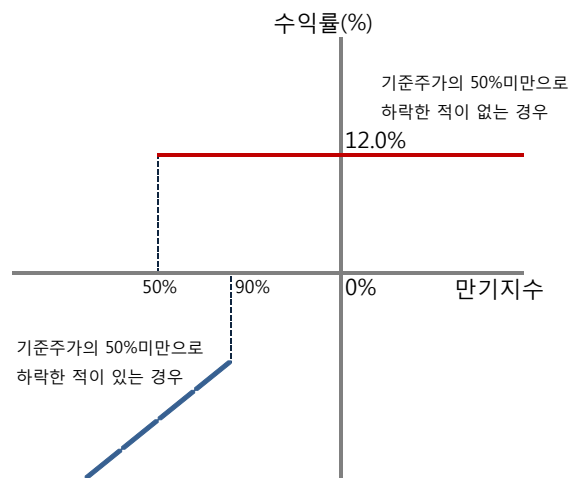
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 5,000 | 0     | 5,000     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,000 | 0     | 5,000     | 장외 |

## 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   | 19.56    | 19.67   | 19.78  | 19.89  | 20.00 | 20.11  | 20.22  |       |
| 자산   | 7.44     | 7.55    | 7.66   | 7.77   | 7.88  | 7.98   | 8.09   |       |
| 시나리오 | 0.81     | 0.92    | 1.03   | 1.14   | 1.25  | 1.35   | 1.46   |       |
|      | 0.00%    | (0.33)  | (0.22) | (0.11) | 0.00  | 0.11   | 0.22   | 0.33  |
|      | -2.67%   | 4.03    | 4.14   | 4.25   | 4.36  | 4.47   | 4.58   | 4.69  |
|      | -5.33%   | 13.88   | 13.99  | 14.10  | 14.21 | 14.32  | 14.43  | 14.54 |
|      | -8.00%   | 29.23   | 29.34  | 29.45  | 29.56 | 29.66  | 29.77  | 29.88 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|              |             |      |
|--------------|-------------|------|
| KR65233210B5 | 대우증권ELS4682 | 0.33 |
| 총 최대손실 예상금액  |             | 0.33 |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 17.30