

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

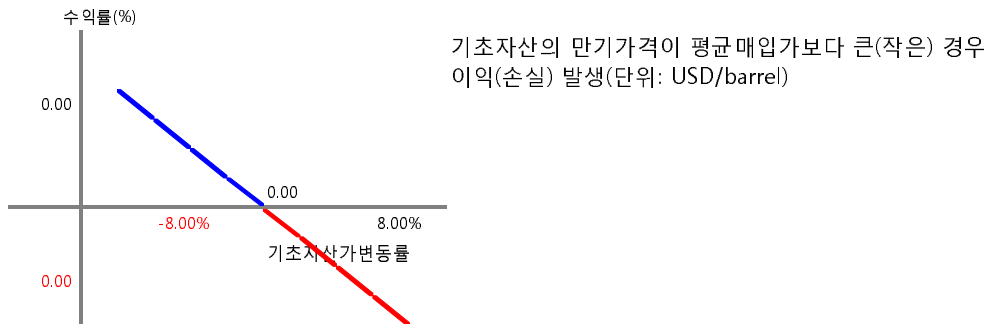
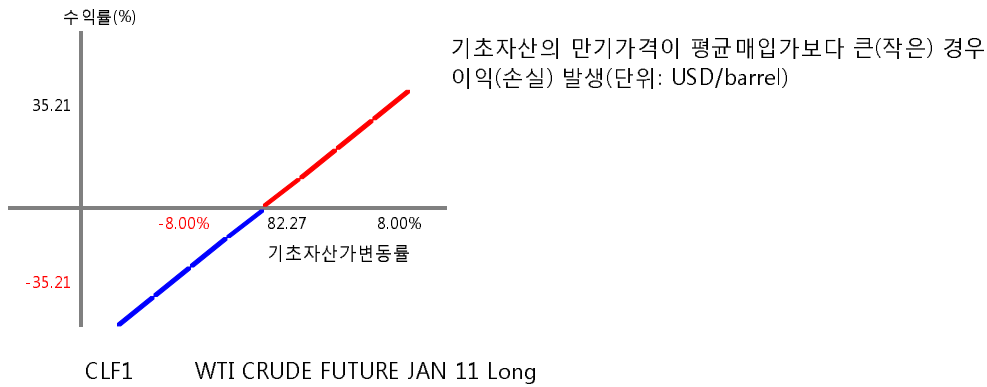
공시일: 2010-12-31

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	5	0	5	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLF1 WTI CRUDE FUTURE JAN 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나 리오	8.00%	35.21
	5.33%	23.46
	2.67%	11.75
	0.00%	0.00
	-2.67%	-11.75
	-5.33%	-23.46
	-8.00%	-35.21

최대손실 시나리오	
위험액	-35.21

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	142.65
-----	--------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

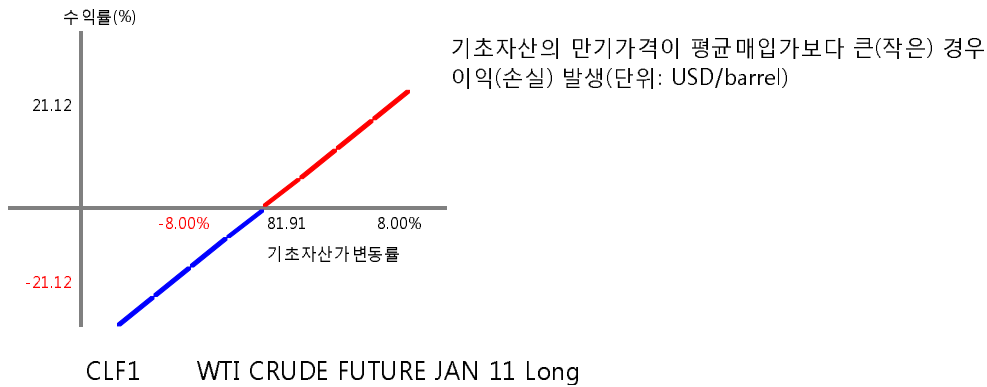
공시일: 2010-12-31

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))

CLF1 WTI CRUDE FUTURE JAN 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	42.25
	5.33%	28.15
	2.67%	14.10
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-14.10
	-5.33%	-28.15
	-8.00%	-42.25

최대손실 시나리오

위험액	-42.25
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	111.97
-----	--------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

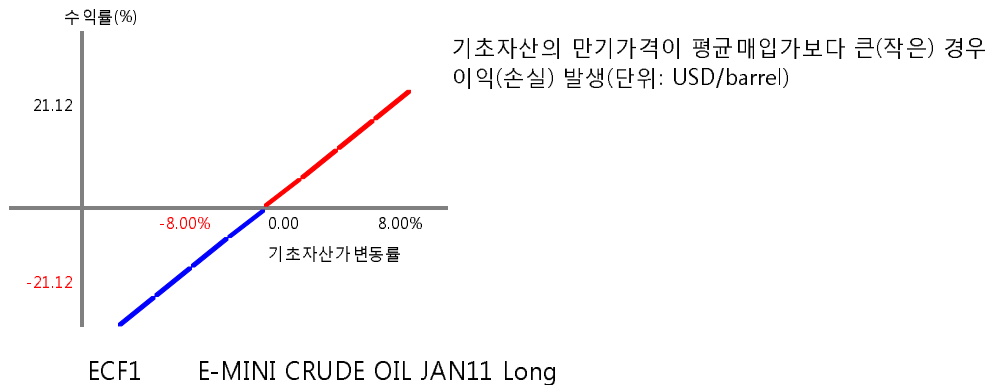
공시일: 2010-12-31

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

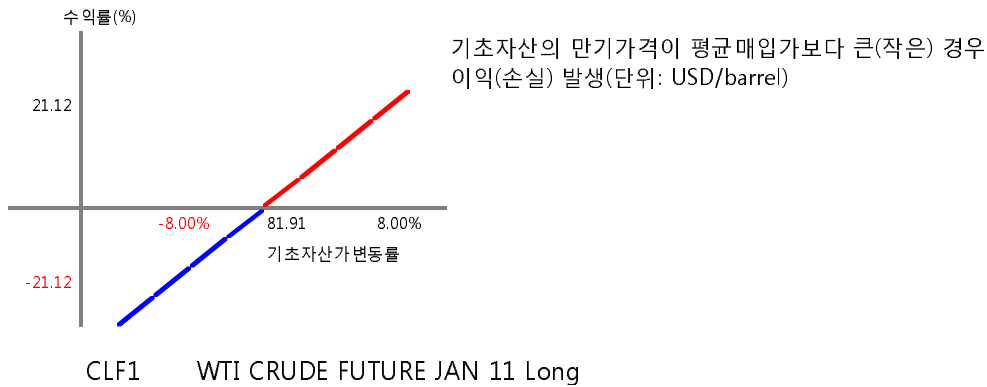
공시일: 2010-12-31

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))

CLF1 WTI CRUDE FUTURE JAN 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	284.79
	5.33%	189.74
	2.67%	95.05
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-95.05
	-5.33%	-189.74
	-8.00%	-284.79

최대손실 시나리오	
위험액	-284.79

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,132.91
-----	----------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

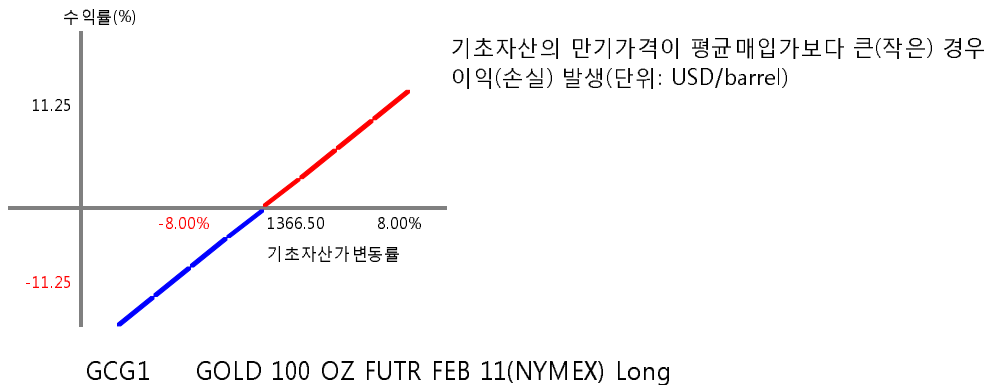
공시일: 2010-12-31

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

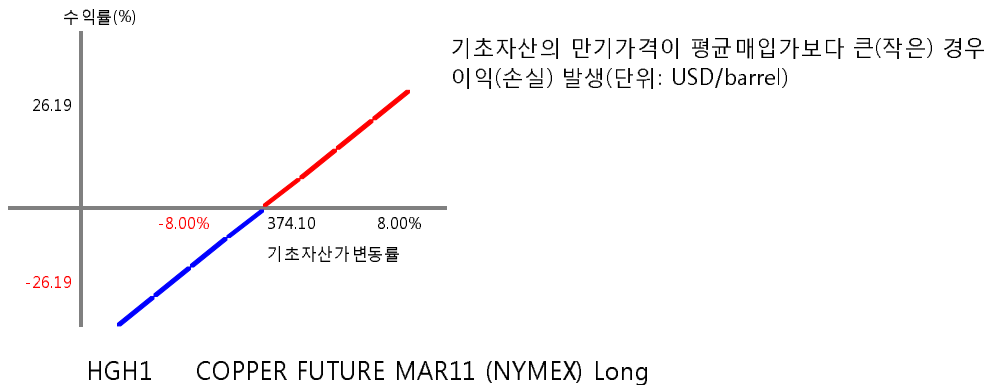
공시일: 2010-12-31

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



메리츠PremiumCommodity특별자산1

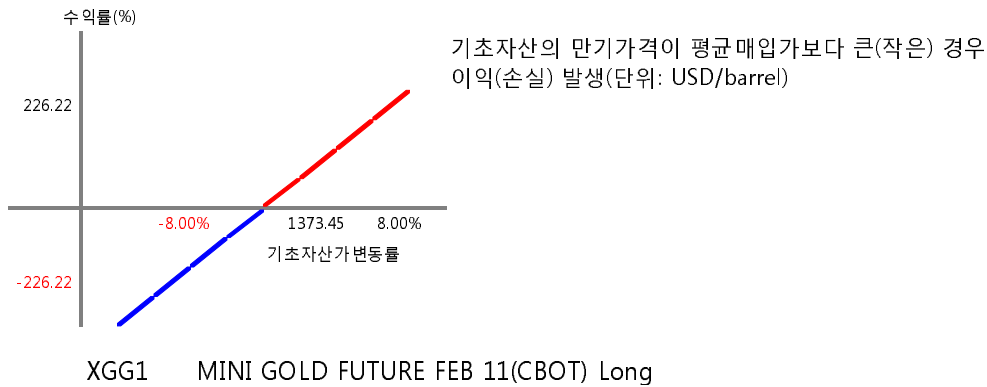
공시일: 2010-12-31

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

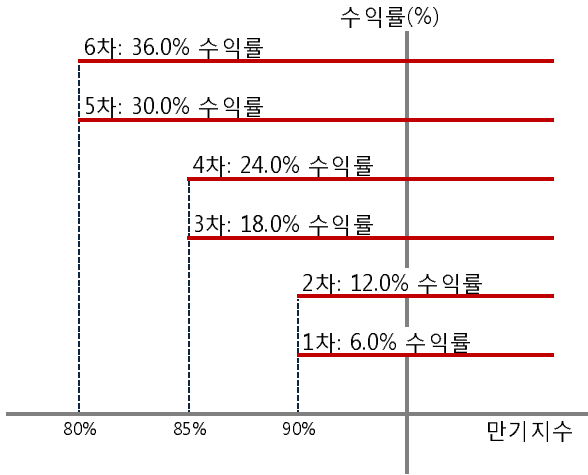
공시일: 2010-12-31

1. 계약금액

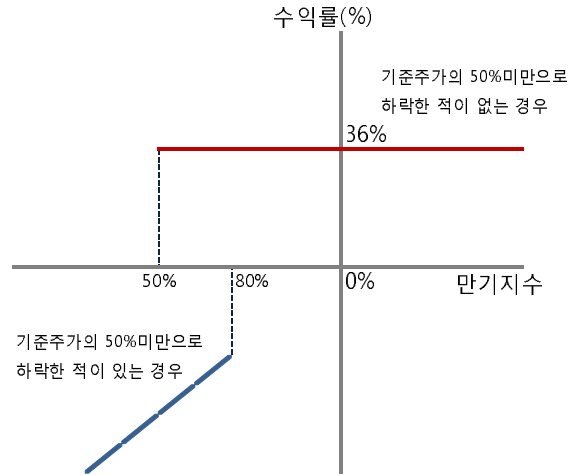
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장외

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%	62.82	53.97	45.12	36.27	27.42	18.57	9.73
	5.33%	54.19	45.34	36.49	27.65	18.80	9.95	1.10
	2.67%	42.10	33.25	24.40	15.56	6.71	(2.14)	(10.99)
	0.00%	26.54	17.70	8.85	0.00	(8.85)	(17.70)	(26.54)
	-2.67%	7.52	(1.32)	(10.17)	(19.02)	(27.87)	(36.72)	(45.56)
	-5.33%	(14.96)	(23.81)	(32.66)	(41.50)	(50.35)	(59.20)	(68.05)
	-8.00%	(40.91)	(49.76)	(58.61)	(67.45)	(76.30)	(85.15)	(94.00)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	94.00
총 최대손실 예상금액		94.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	95.08
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

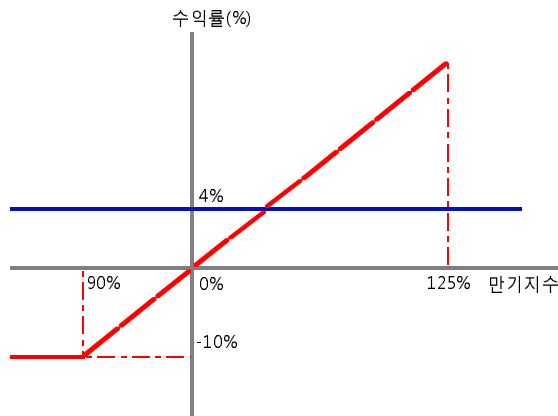
1. 계약금액

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%	(26.11)	(28.21)	(30.31)	(32.41)	(34.51)	(36.60)	(38.70)
	5.33%	(13.02)	(15.12)	(17.21)	(19.31)	(21.41)	(23.51)	(25.61)
	2.67%	(2.22)	(4.31)	(6.41)	(8.51)	(10.61)	(12.71)	(14.80)
	0.00%	6.29	4.20	2.10	0.00	(2.10)	(4.20)	(6.29)
	-2.67%	12.51	10.41	8.32	6.22	4.12	2.02	(0.08)
	-5.33%	16.44	14.34	12.24	10.15	8.05	5.95	3.85
	-8.00%	18.07	15.98	13.88	11.78	9.68	7.58	5.49

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503339048	신한투자(ELS)1447	38.70
총 최대손실 예상금액		38.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	27.43
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제9호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

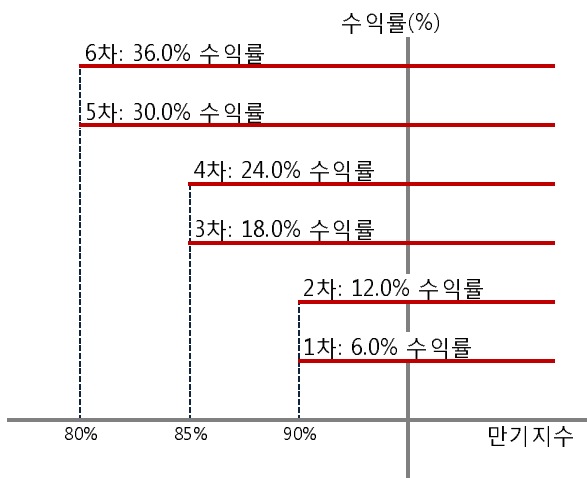
1. 계약금액

단위(백만원)

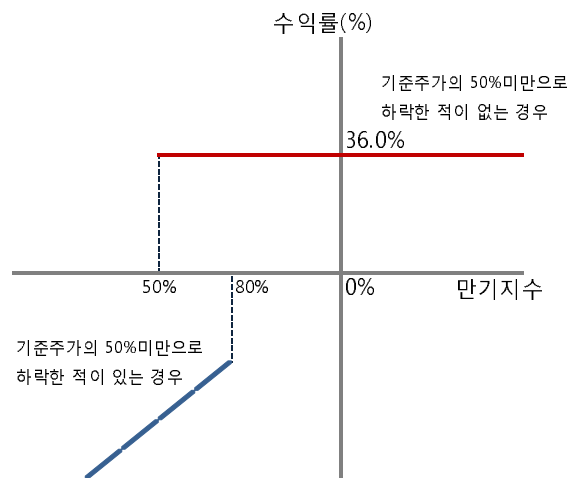
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외
누계	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외

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 시나 리오	8.00%	0.95	0.91	0.86	0.81	0.77	0.72	0.67
	5.33%	0.41	0.36	0.31	0.27	0.22	0.17	0.13
	2.67%	0.14	0.09	0.04	(0.00)	(0.05)	(0.10)	(0.14)
	0.00%	0.14	0.09	0.05	0.00	(0.05)	(0.09)	(0.14)
	-2.67%	0.42	0.37	0.32	0.28	0.23	0.18	0.14
	-5.33%	0.97	0.92	0.88	0.83	0.78	0.74	0.69
	-8.00%	1.80	1.75	1.70	1.66	1.61	1.56	1.52

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523315085	대우증권(ELS)4284	0.14
총 최대손실 예상금액		0.14

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 3.24

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

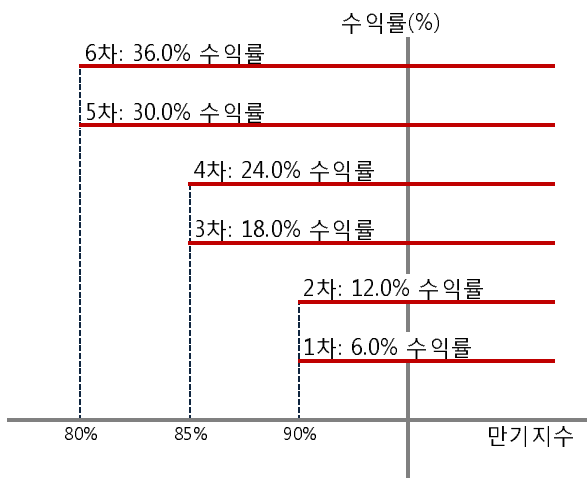
1. 계약금액

단위(백만원)

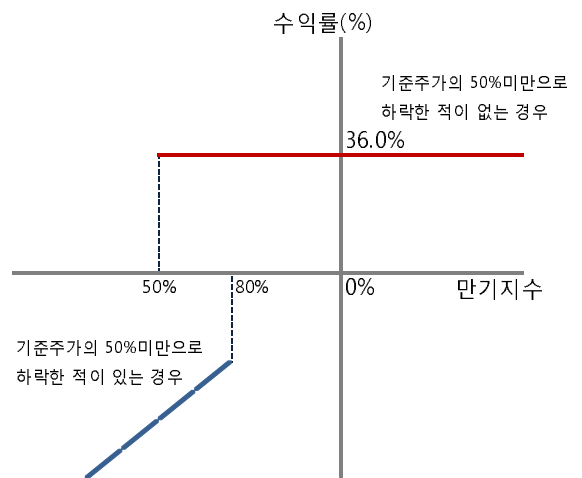
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	512	0	512	장외
누계	유가증권	선물	512	0	512	장외

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	7.72	6.86	6.00	5.14	4.28	3.42	2.56	
자산	7.23	6.37	5.51	4.65	3.79	2.93	2.07	
시나리오	5.52	4.66	3.80	2.94	2.08	1.22	0.35	
	2.58	1.72	0.86	0.00	(0.86)	(1.72)	(2.58)	
	(1.58)	(2.44)	(3.30)	(4.16)	(5.02)	(5.88)	(6.75)	
	(6.97)	(7.83)	(8.69)	(9.55)	(10.41)	(11.27)	(12.13)	
	(13.58)	(14.44)	(15.30)	(16.16)	(17.02)	(17.88)	(18.74)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293A8084	대우증권(ELS)4375	18.74
총 최대손실 예상금액		18.74

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 19.13

메리츠2Star증권LESF-12호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

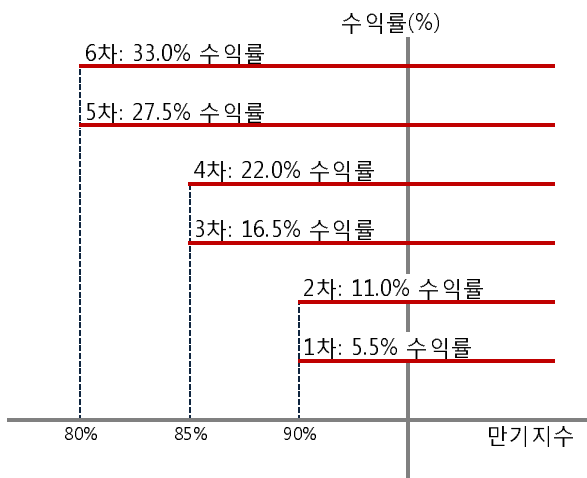
1. 계약금액

단위(백만원)

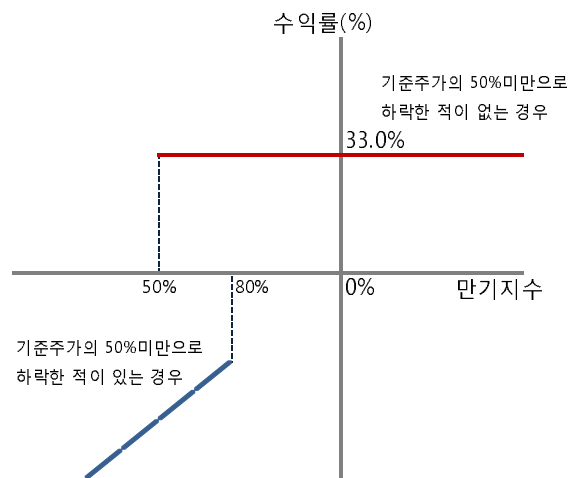
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	851	0	851	장외
누계	유가증권	선물	851	0	851	장외

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	4.87	3.87	2.86	1.86	0.85	(0.15)	(1.16)	
자산	5.47	4.46	3.46	2.45	1.45	0.44	(0.56)	
시나	4.85	3.85	2.84	1.83	0.83	(0.18)	(1.18)	
리오	0.00%	3.02	2.01	1.01	0.00	(1.01)	(2.01)	(3.02)
	-2.67%	(0.03)	(1.04)	(2.04)	(3.05)	(4.05)	(5.06)	(6.07)
	-5.33%	(4.30)	(5.30)	(6.31)	(7.31)	(8.32)	(9.32)	(10.33)
	-8.00%	(9.78)	(10.78)	(11.79)	(12.79)	(13.80)	(14.80)	(15.81)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6542302098	신영증권(ELS)1714	15.81
총 최대손실 예상금액		15.81

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	21.96
-----	-------

메리츠2Star증권LESF-13호[ELS-파생형]

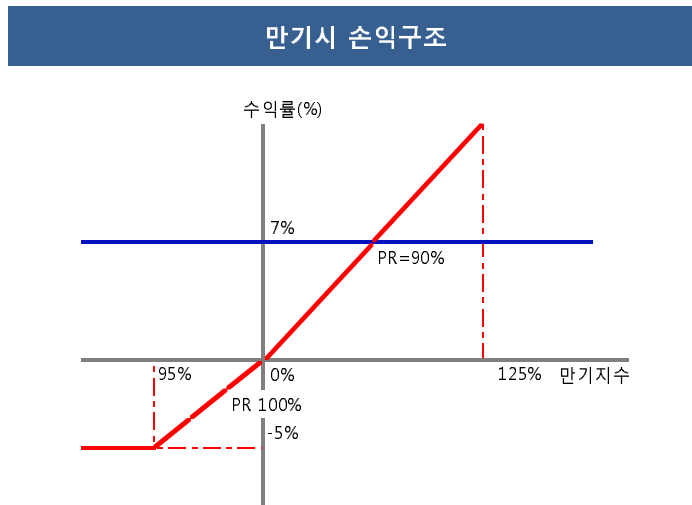
공시일: 2010-12-31

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 자산 시나 리오	8.00%	4.52	3.03	1.53	0.03	(1.47)	(2.97)	(4.47)
	5.33%	5.41	3.91	2.41	0.91	(0.58)	(2.08)	(3.58)
	2.67%	5.40	3.90	2.40	0.90	(0.59)	(2.09)	(3.59)
	0.00%	4.49	3.00	1.50	0.00	(1.50)	(3.00)	(4.49)
	-2.67%	2.69	1.20	(0.30)	(1.80)	(3.30)	(4.80)	(6.29)
	-5.33%	0.00	(1.50)	(3.00)	(4.49)	(5.99)	(7.49)	(8.99)
	-8.00%	(3.59)	(5.09)	(6.58)	(8.08)	(9.58)	(11.08)	(12.58)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503337091	신한투자(ELS)1781	12.58
총 최대손실 예상금액		12.58

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	12.85
-----	-------

메리츠2Star증권LESF-14호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

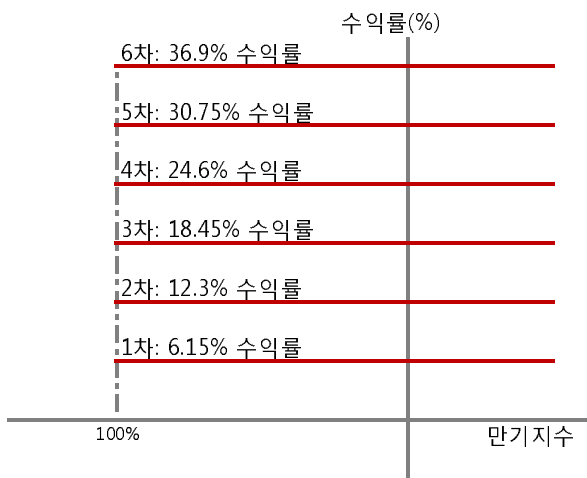
1. 계약금액

단위(백만원)

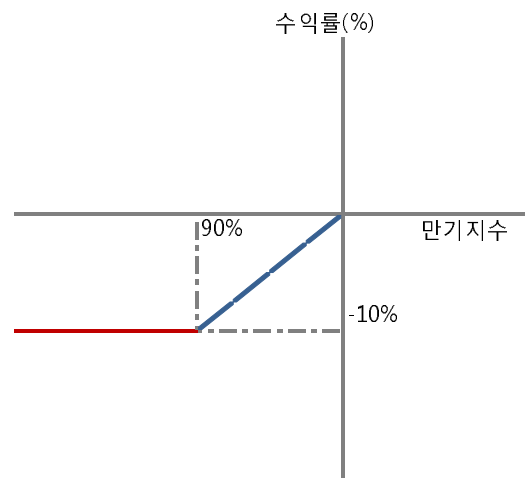
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,271	0	1,271	장외
누계	유가증권	선물	1,271	0	1,271	장외

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	37.56	35.27	32.97	30.68	28.38	26.09	23.79	
자산	30.49	28.19	25.90	23.60	21.31	19.01	16.72	
시나	20.26	17.97	15.67	13.38	11.08	8.79	6.49	
리오	6.89	4.59	2.30	0.00	(2.30)	(4.59)	(6.89)	
	(9.65)	(11.94)	(14.24)	(16.53)	(18.83)	(21.12)	(23.42)	
	(29.33)	(31.62)	(33.92)	(36.21)	(38.51)	(40.80)	(43.10)	
	(52.16)	(54.46)	(56.75)	(59.05)	(61.34)	(63.64)	(65.93)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293160A1	대우증권ELS4537	65.93
총 최대손실 예상금액		65.93

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 67.94

메리츠2Star증권SEPO-5호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

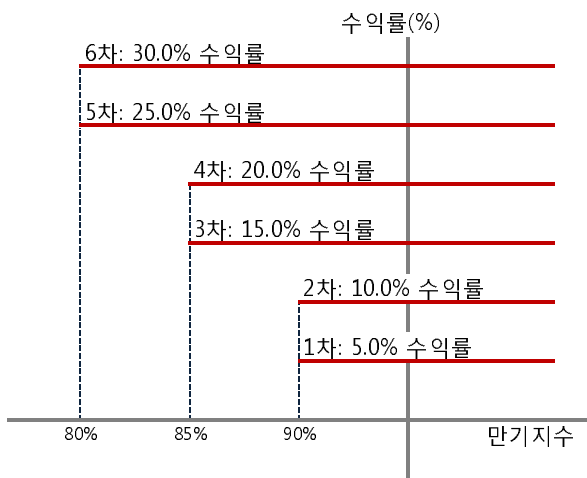
1. 계약금액

단위(백만원)

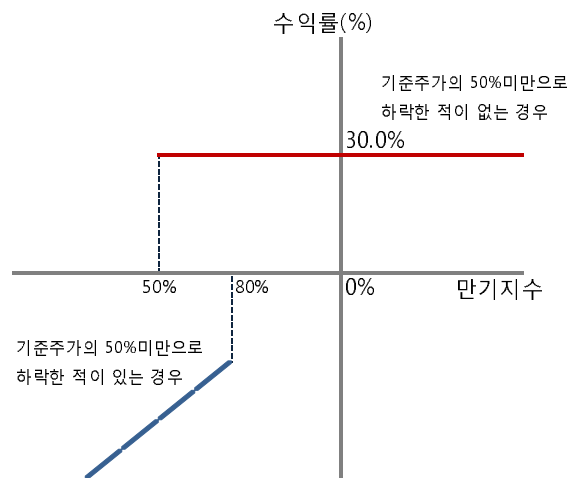
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장외
누계	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장외

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	29.08	24.39	19.69	14.99	10.30	5.60	0.91	
자산	27.12	22.43	17.73	13.04	8.34	3.64	(1.05)	
시나	22.12	17.43	12.73	8.04	3.34	(1.35)	(6.05)	
리오	14.09	9.39	4.70	0.00	(4.70)	(9.39)	(14.09)	
	3.01	(1.69)	(6.38)	(11.08)	(15.77)	(20.47)	(25.16)	
	(11.11)	(15.80)	(20.50)	(25.20)	(29.89)	(34.59)	(39.28)	
	(28.27)	(32.96)	(37.66)	(42.35)	(47.05)	(51.74)	(56.44)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023590A6	신한투자(ELS)1851	56.44
총 최대손실 예상금액		56.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 49.48

메리츠주가지수연계증권제5호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

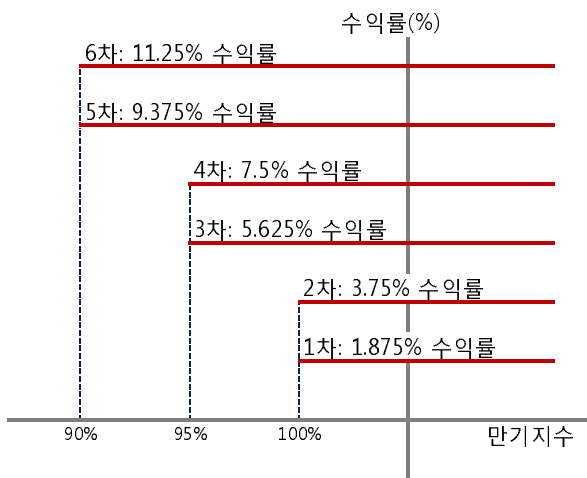
1. 계약금액

단위(백만원)

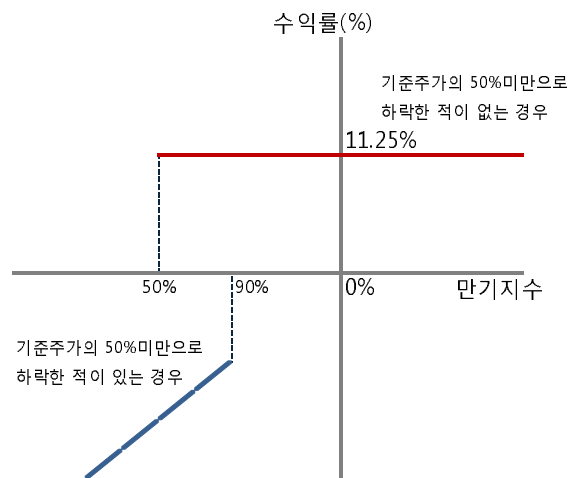
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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	8.00%	16.51	16.51	16.51	16.51	16.51	16.51	16.51
자산	5.33%	7.34	7.34	7.34	7.34	7.34	7.34	7.34
시나리오	2.67%	1.83	1.83	1.83	1.83	1.83	1.83	1.83
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	1.84	1.84	1.84	1.84	1.84	1.84	1.84
	-5.33%	7.36	7.36	7.36	7.36	7.36	7.36	7.36
	-8.00%	16.55	16.55	16.55	16.55	16.55	16.55	16.55

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65233960A7	대우증권ELS4586	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.14
-----	------

메리츠한증지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

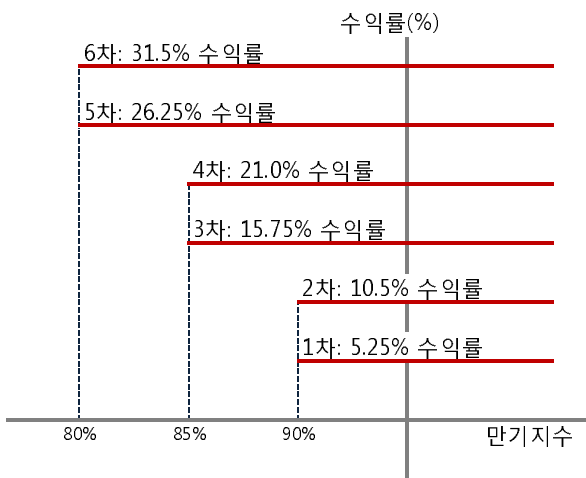
1. 계약금액

단위(백만원)

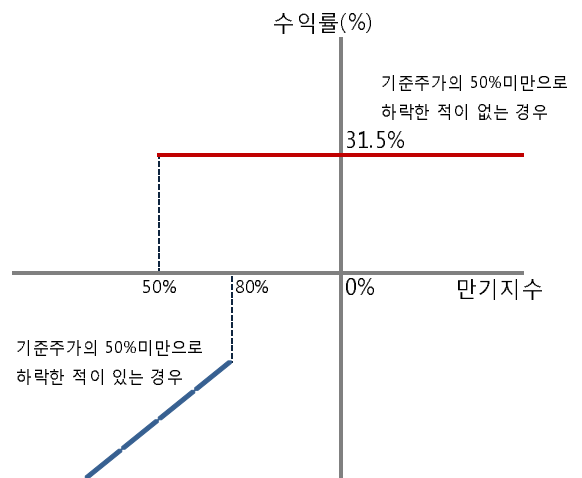
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,417	0	1,417	장외
누계	유가증권	선물	1,417	0	1,417	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	12.78	9.93	7.08	4.23	1.37	(1.48)	(4.33)	
자산	13.10	10.25	7.40	4.55	1.69	(1.16)	(4.01)	
시나	11.69	8.84	5.99	3.14	0.29	(2.57)	(5.42)	
리오	8.55	5.70	2.85	0.00	(2.85)	(5.70)	(8.55)	
	3.69	0.84	(2.01)	(4.87)	(7.72)	(10.57)	(13.42)	
	(2.91)	(5.76)	(8.61)	(11.46)	(14.31)	(17.16)	(20.02)	
	(11.23)	(14.08)	(16.93)	(19.78)	(22.64)	(25.49)	(28.34)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65533190B6	우리투자증권(ELS)3658	28.34
총 최대손실 예상금액		28.34

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 24.75

메리츠주가지수연계증권제6호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

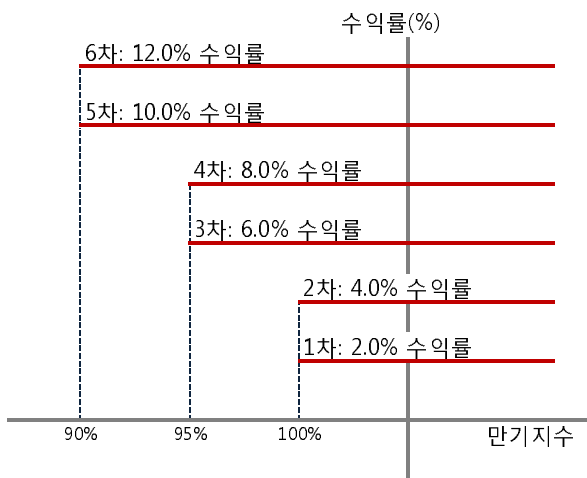
1. 계약금액

단위(백만원)

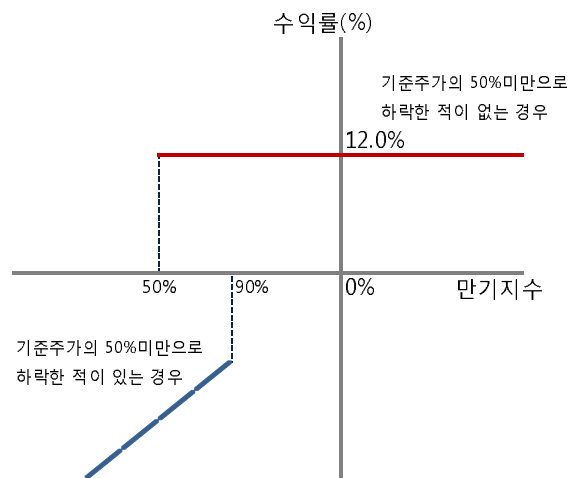
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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	8.00%	14.20	14.21	14.22	14.23	14.24	14.25	14.26
자산 시나 리오	5.33%	6.19	6.20	6.21	6.22	6.23	6.24	6.25
	2.67%	1.45	1.46	1.47	1.48	1.49	1.50	1.51
	0.00%	(0.03)	(0.02)	(0.01)	0.00	0.01	0.02	0.03
	-2.67%	1.75	1.76	1.77	1.78	1.79	1.80	1.81
	-5.33%	6.80	6.81	6.82	6.83	6.84	6.85	6.86
	-8.00%	15.11	15.12	15.13	15.14	15.15	15.16	15.17

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233210B5	대우증권ELS4682	0.03
총 최대손실 예상금액		0.03

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 2.77

메리츠한증지수연계증권제11호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

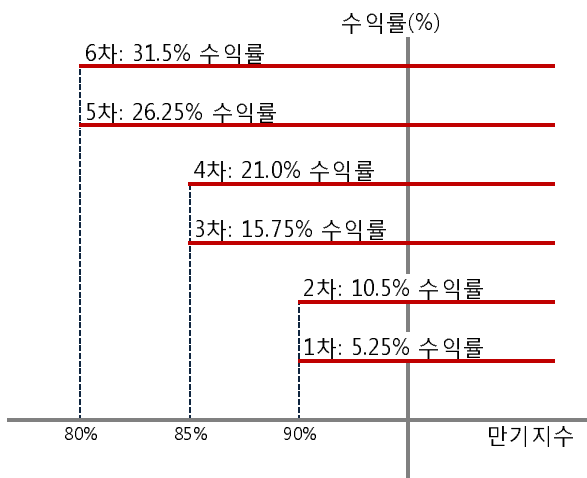
1. 계약금액

단위(백만원)

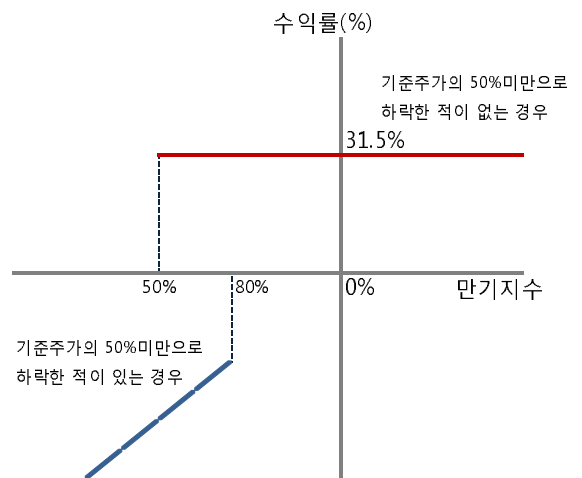
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,298	0	1,298	장외
누계	유가증권	선물	1,298	0	1,298	장외

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	15.90	12.65	9.39	6.13	2.87	(0.38)	(3.64)	
자산	15.56	12.31	9.05	5.79	2.54	(0.72)	(3.98)	
시나	13.52	10.26	7.01	3.75	0.49	(2.77)	(6.02)	
리오	9.77	6.51	3.26	0.00	(3.26)	(6.51)	(9.77)	
	4.32	1.06	(2.20)	(5.45)	(8.71)	(11.97)	(15.23)	
	(2.84)	(6.10)	(9.36)	(12.61)	(15.87)	(19.13)	(22.39)	
	(11.71)	(14.97)	(18.22)	(21.48)	(24.74)	(28.00)	(31.25)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033630B6	신한투자(ELS)1958	31.25
총 최대손실 예상금액		31.25

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 33.77

메리츠한증지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

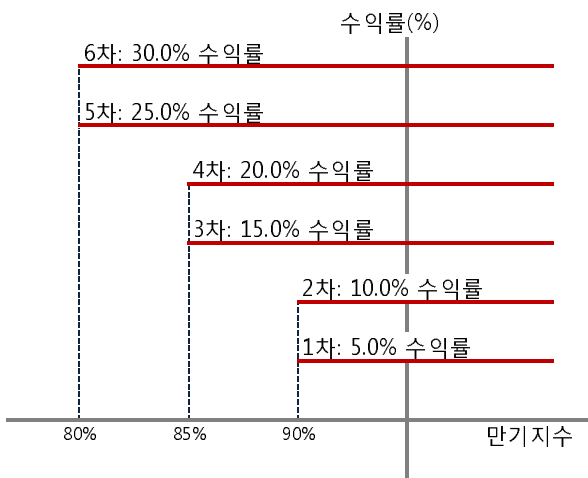
1. 계약금액

단위(백만원)

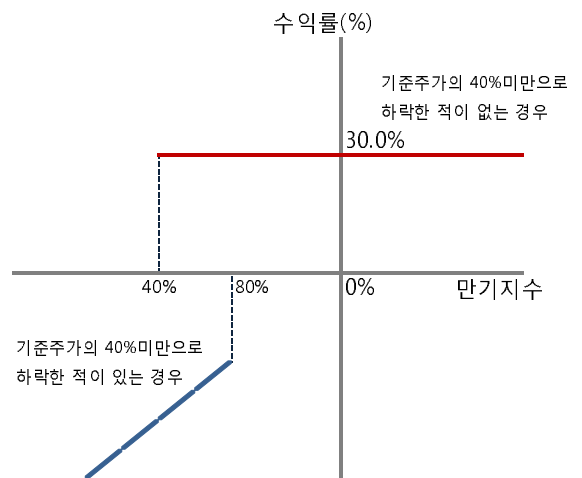
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,635	0	1,635	장외
누계	유가증권	선물	1,635	0	1,635	장외

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%	(3.95)	(4.93)	(5.91)	(6.89)	(7.87)	(8.84)	(9.82)
	5.33%	(1.59)	(2.57)	(3.55)	(4.53)	(5.51)	(6.49)	(7.47)
	2.67%	0.71	(0.27)	(1.25)	(2.23)	(3.21)	(4.19)	(5.17)
	0.00%	2.94	1.96	0.98	0.00	(0.98)	(1.96)	(2.94)
	-2.67%	5.11	4.13	3.15	2.17	1.19	0.21	(0.77)
	-5.33%	7.21	6.23	5.25	4.28	3.30	2.32	1.34
	-8.00%	9.26	8.28	7.30	6.32	5.34	4.36	3.38

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65433540B3	신영증권(ELS)1854	9.82
총 최대손실 예상금액		9.82

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 5.76

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

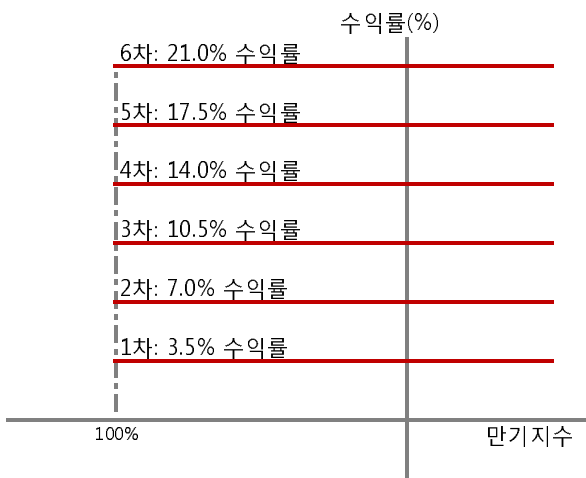
1. 계약금액

단위(백만원)

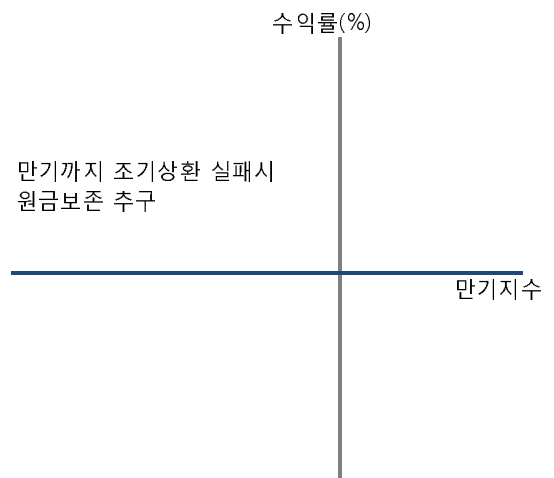
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	881	0	881	장외
누계	유가증권	선물	881	0	881	장외

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	19.10	18.06	17.02	15.98	14.94	13.90	12.86	
자산	14.27	13.23	12.19	11.15	10.11	9.07	8.03	
시나리오	8.94	7.90	6.86	5.82	4.78	3.74	2.70	
	3.12	2.08	1.04	0.00	(1.04)	(2.08)	(3.12)	
	(3.20)	(4.24)	(5.28)	(6.32)	(7.36)	(8.40)	(9.44)	
	(10.01)	(11.05)	(12.09)	(13.13)	(14.17)	(15.21)	(16.25)	
	(17.32)	(18.36)	(19.40)	(20.44)	(21.48)	(22.52)	(23.56)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	23.56
총 최대손실 예상금액		23.56

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 28.76

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2010-12-31

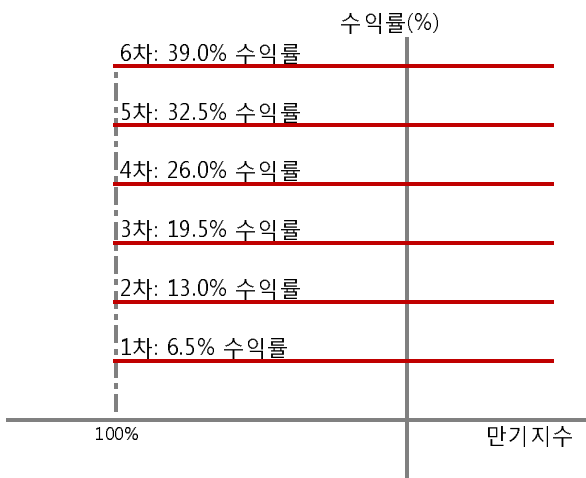
1. 계약금액

단위(백만원)

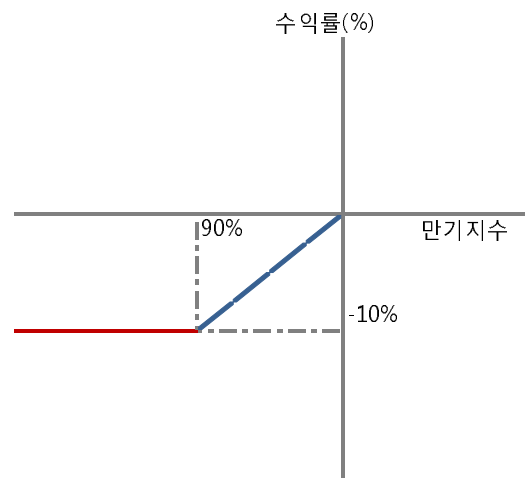
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	864	0	864	장외
누계	유가증권	선물	864	0	864	장외

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	32.80	30.76	28.72	26.68	24.64	22.61	20.57	
자산	24.88	22.84	20.80	18.77	16.73	14.69	12.65	
시나리오	15.99	13.95	11.91	9.87	7.83	5.80	3.76	
	0.00%	4.08	2.04	0.00	(2.04)	(4.08)	(6.12)	
	-2.67%	(4.74)	(6.77)	(8.81)	(10.85)	(12.89)	(14.93)	
	-5.33%	(16.56)	(18.60)	(20.64)	(22.68)	(24.72)	(26.76)	
	-8.00%	(29.37)	(31.41)	(33.45)	(35.49)	(37.53)	(39.56)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	41.60
총 최대손실 예상금액		41.60

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 51.19