

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

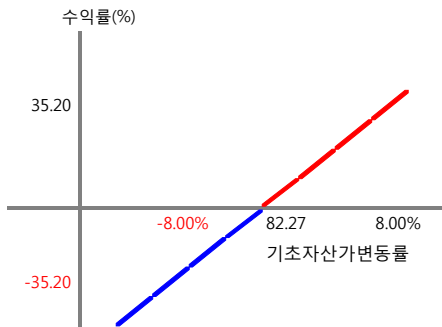
공시일: 2011-01-12

1. 계약금액

단위(백만원)

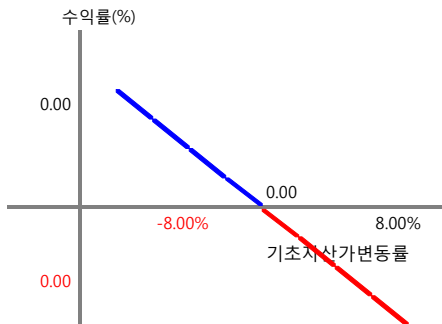
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5 | 0 | 5 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



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

CLF1 WTI CRUDE FUTURE JAN 11 Long



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

3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLF1 WTI CRUDE FUTURE JAN 11 Long

| 구분 | 시나리오 | |
|----------------------|--------|--------|
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | 35.20 |
| | 5.33% | 23.45 |
| | 2.67% | 11.75 |
| | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -11.75 |
| | -5.33% | -23.45 |
| | -8.00% | -35.20 |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -35.20 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 142.65 |
|-----|--------|

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

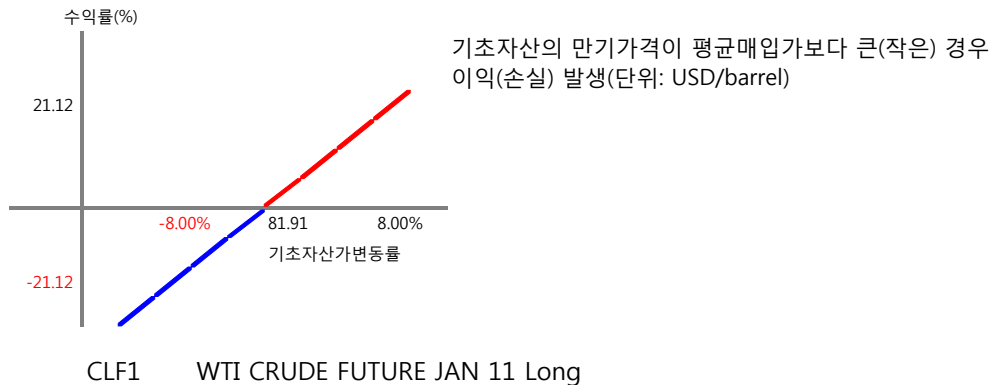
공시일: 2011-01-12

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% | 42.24 |
| | 5.33% | 28.14 |
| | 2.67% | 14.10 |
| 시나리오 | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -14.10 |
| | -5.33% | -28.14 |
| | -8.00% | -42.24 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|--------|
| 위험액 | -42.24 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 111.97 |
|-----|--------|

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

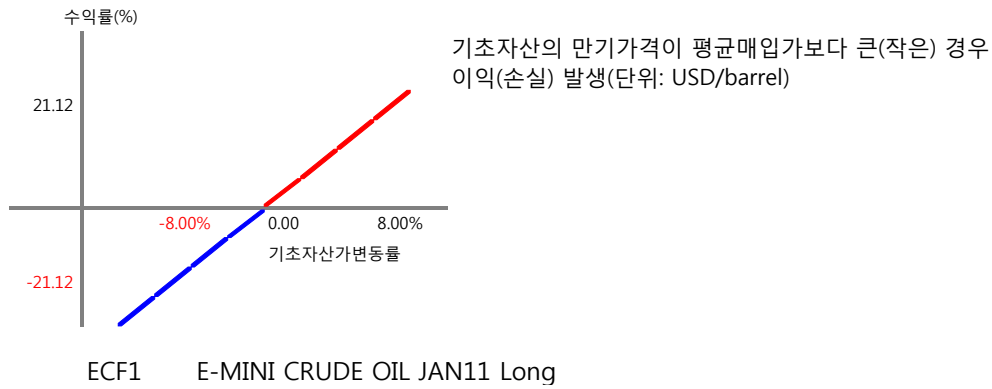
공시일: 2011-01-12

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

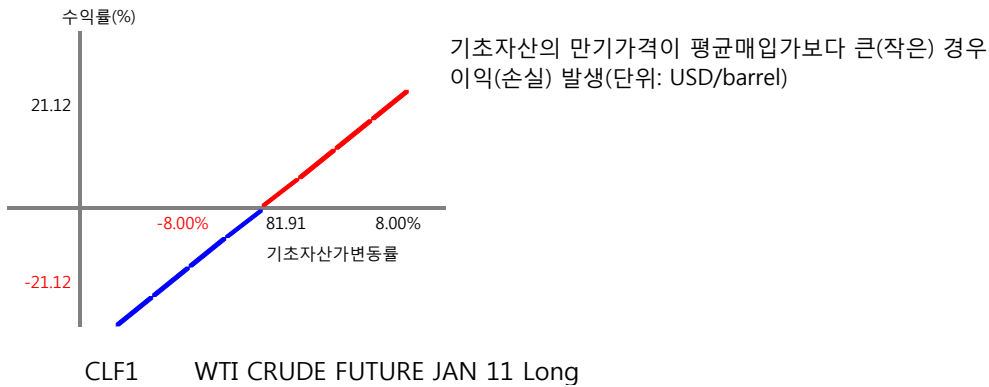
공시일: 2011-01-12

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% | 278.21 |
| | 5.33% | 185.36 |
| | 2.67% | 92.85 |
| 시나리오 | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -92.85 |
| | -5.33% | -185.36 |
| | -8.00% | -278.21 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|---------|
| 위험액 | -278.21 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|----------|
| 위험액 | 1,106.81 |
|-----|----------|

메리츠PremiumCommodity특별자산1

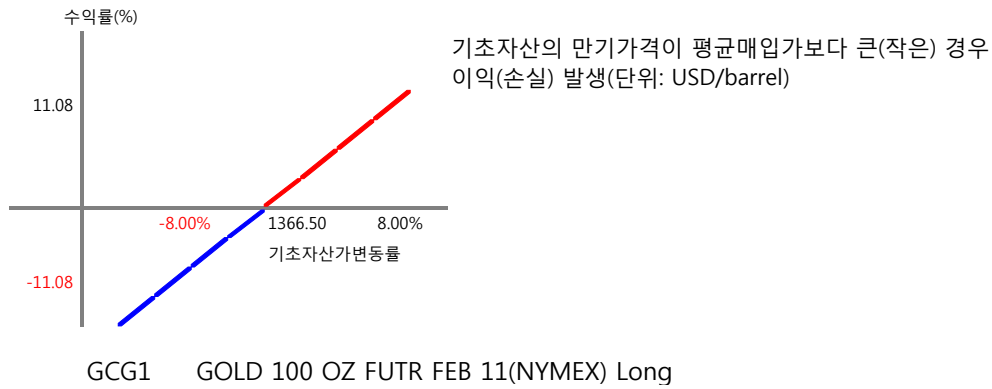
공시일: 2011-01-12

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

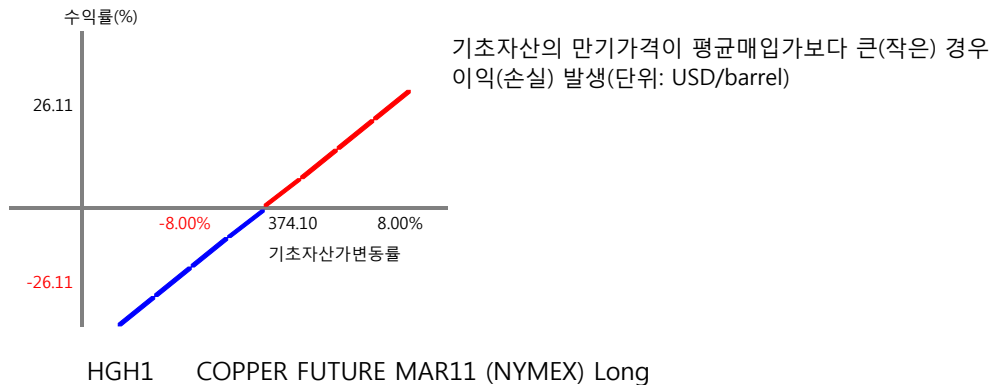
공시일: 2011-01-12

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

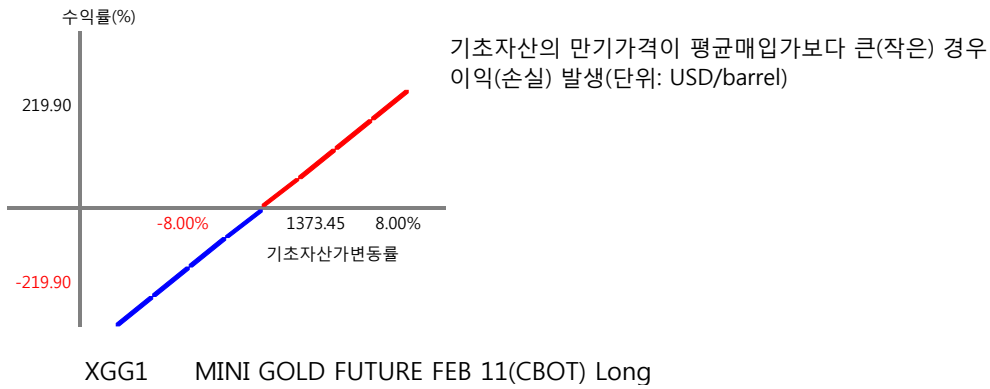
공시일: 2011-01-12

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]

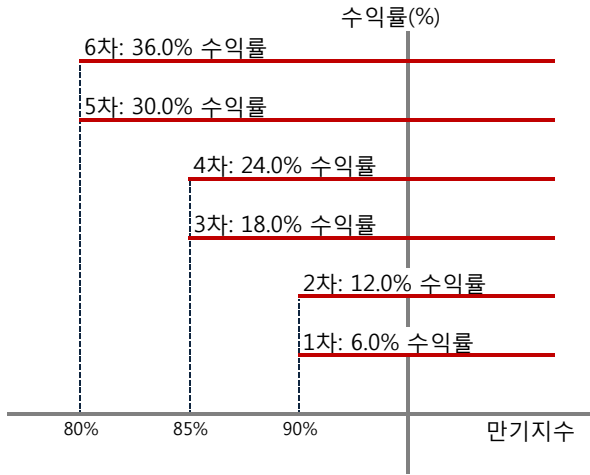
공시일: 2011-01-12

1. 계약금액

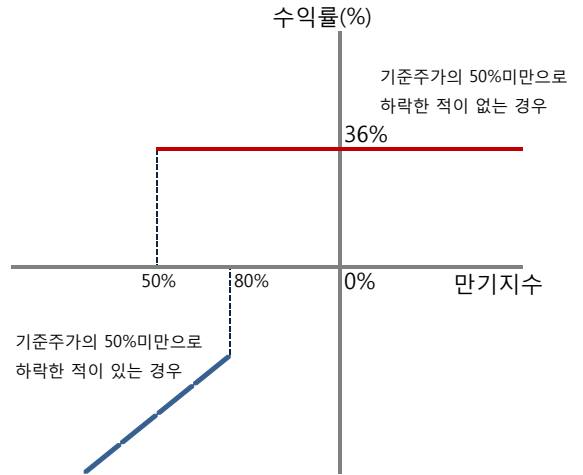
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,542 | 0 | 1,542 | 장외 |

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% | 80.19 | 70.53 | 60.87 | 51.22 | 41.56 | 31.90 | 22.24 |
| | 5.33% | 66.34 | 56.68 | 47.03 | 37.37 | 27.71 | 18.05 | 8.39 |
| | 2.67% | 49.27 | 39.61 | 29.95 | 20.30 | 10.64 | 0.98 | (8.68) |
| | 0.00% | 28.97 | 19.32 | 9.66 | 0.00 | (9.66) | (19.32) | (28.97) |
| | -2.67% | 5.45 | (4.20) | (13.86) | (23.52) | (33.18) | (42.84) | (52.50) |
| | -5.33% | (21.29) | (30.95) | (40.61) | (50.27) | (59.92) | (69.58) | (79.24) |
| | -8.00% | (51.26) | (60.92) | (70.58) | (80.24) | (89.89) | (99.55) | (109.21) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|---------------|---------|
| KR6502348032 | 신한투자(ELS)1408 | 109.21 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 109.21 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 123.80 |
|-----|--------|

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

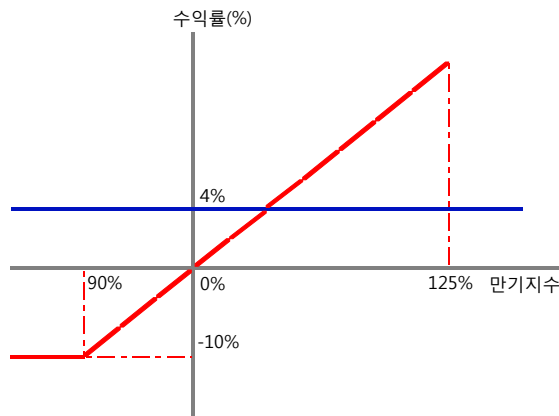
1. 계약금액

| 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% | (27.47) | (29.07) | (30.68) | (32.29) | (33.90) | (35.51) | (37.12) |
| | 5.33% | (14.85) | (16.46) | (18.07) | (19.68) | (21.29) | (22.90) | (24.51) |
| | 2.67% | (4.08) | (5.69) | (7.30) | (8.91) | (10.52) | (12.13) | (13.74) |
| | 0.00% | 4.83 | 3.22 | 1.61 | 0.00 | (1.61) | (3.22) | (4.83) |
| | -2.67% | 11.89 | 10.28 | 8.67 | 7.06 | 5.45 | 3.84 | 2.23 |
| | -5.33% | 17.09 | 15.48 | 13.88 | 12.27 | 10.66 | 9.05 | 7.44 |
| | -8.00% | 20.45 | 18.84 | 17.23 | 15.62 | 14.01 | 12.40 | 10.79 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR6503339048 | 신한투자(ELS)1447 | 37.12 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 37.12 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 30.66 |
|-----|-------|

메리츠한증지수연계증권제9호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

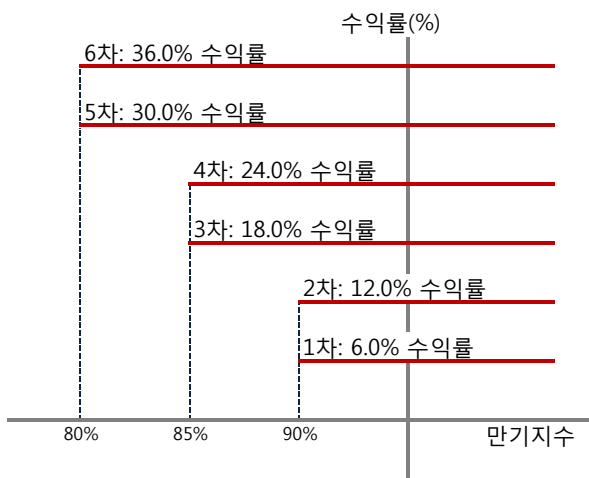
1. 계약금액

단위(백만원)

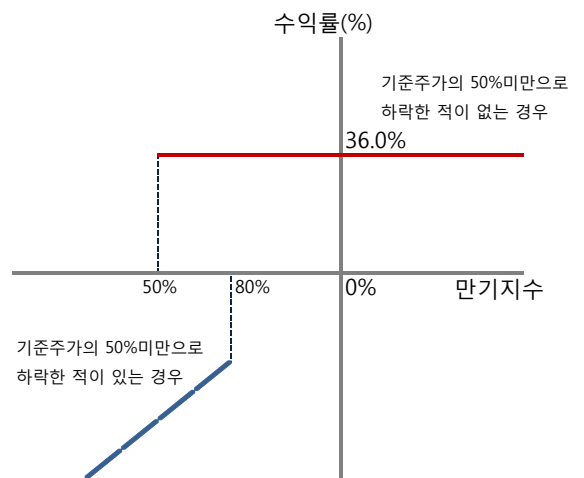
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 2,686 | 0 | 2,686 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,686 | 0 | 2,686 | 장외 |

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 | 8.00% | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 |
| 자산 | 5.33% | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 |
| 시나 | 2.67% | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 |
| 리오 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 |
| | -5.33% | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 | 0.05 |
| | -8.00% | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 | 0.12 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|------|
| KR6523315085 | 대우증권(ELS)4284 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.00 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

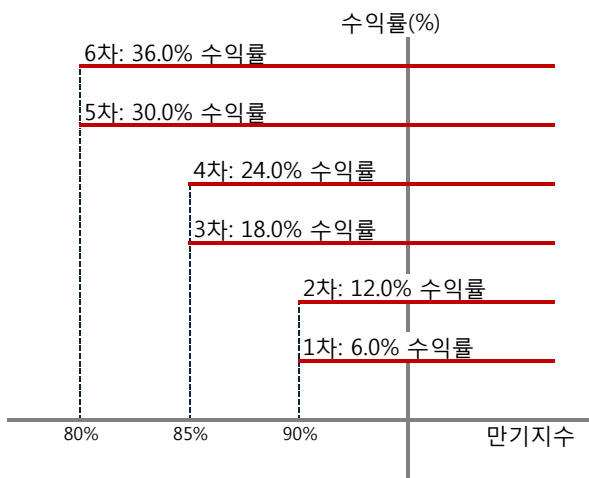
1. 계약금액

단위(백만원)

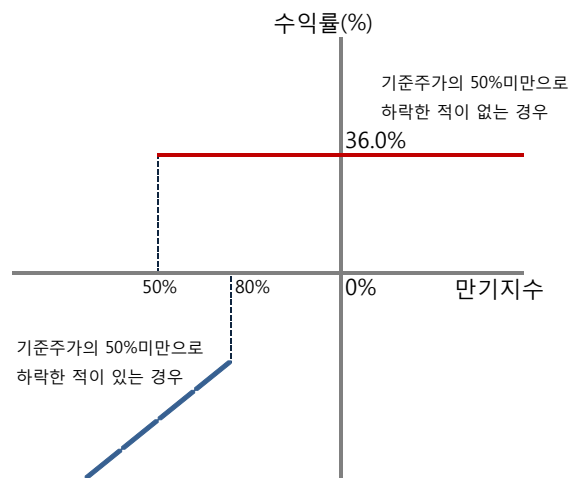
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 512 | 0 | 512 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 512 | 0 | 512 | 장외 |

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 | 9.29 | 8.39 | 7.49 | 6.59 | 5.69 | 4.79 | 3.89 | |
| 자산 | 8.38 | 7.48 | 6.58 | 5.68 | 4.78 | 3.88 | 2.98 | |
| 시나 | 6.18 | 5.28 | 4.39 | 3.49 | 2.59 | 1.69 | 0.79 | |
| 리오 | 0.00% | 1.80 | 0.90 | 0.00 | (0.90) | (1.80) | (2.70) | |
| | (2.67%) | (2.98) | (3.88) | (4.78) | (5.68) | (6.57) | (7.47) | |
| | (5.33%) | (9.04) | (9.94) | (10.84) | (11.74) | (12.64) | (13.54) | |
| | (8.00%) | (15.50) | (16.40) | (17.30) | (18.20) | (19.10) | (20.00) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR65293A8084 | 대우증권(ELS)4375 | 20.90 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 20.90 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 21.69

메리츠2Star증권LESF-12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

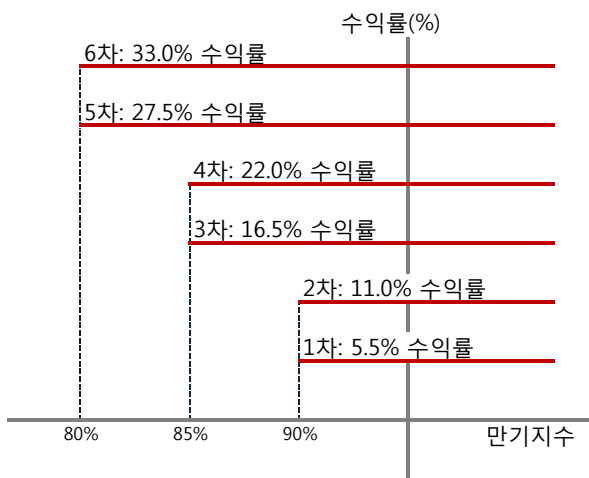
1. 계약금액

단위(백만원)

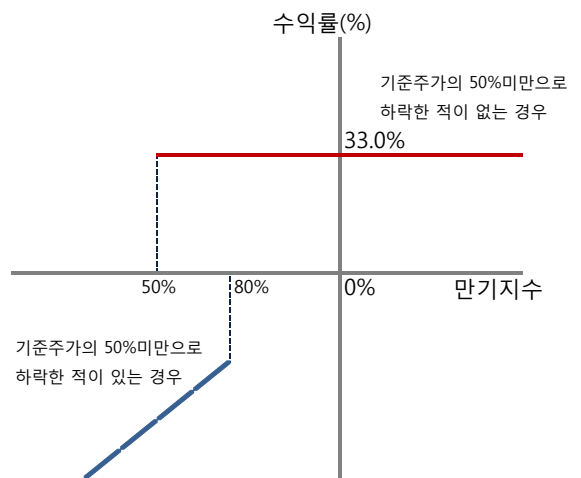
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 851 | 0 | 851 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 851 | 0 | 851 | 장외 |

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 | 8.00% | 5.33% | 2.67% | 0.00% | -2.67% | -5.33% | -8.00% | |
| 자산 | (0.76) | 1.73 | 2.70 | 2.15 | 0.06 | (3.55) | (8.68) | |
| 시나 | (1.48) | 1.02 | 1.99 | 1.43 | (0.65) | (4.26) | (9.40) | |
| 리오 | (2.19) | 0.30 | 1.27 | 0.72 | (1.37) | (4.98) | (10.11) | |
| | (2.91) | 0.41 | 0.56 | 0.00 | (2.08) | (5.69) | (10.83) | |
| | (3.62) | (1.13) | (0.16) | (0.72) | (2.80) | (6.41) | (11.54) | |
| | (4.34) | (1.84) | (0.87) | (1.43) | (3.51) | (7.12) | (12.26) | |
| | (5.05) | (2.56) | (1.59) | (2.15) | (4.23) | (7.84) | (12.98) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR6542302098 | 신영증권(ELS)1714 | 12.98 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 12.98 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 7.24

메리츠2Star증권LESF-13호[ELS-파생형]

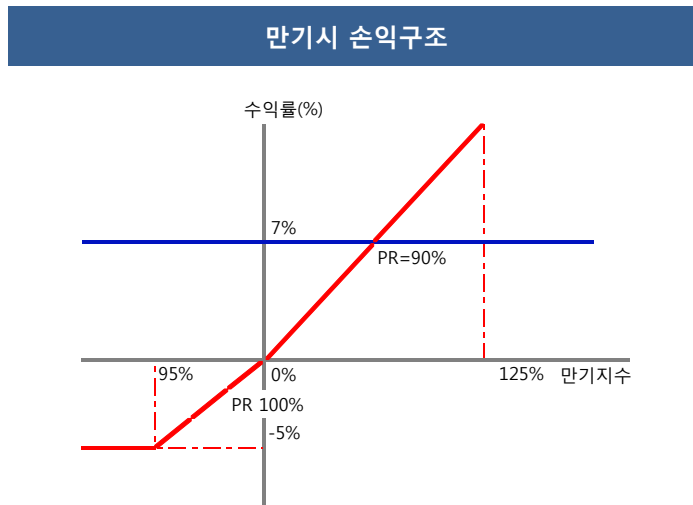
공시일: 2011-01-12

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% | 3.91 | 2.62 | 1.33 | 0.04 | (1.25) | (2.55) | (3.84) |
| | 5.33% | 4.69 | 3.39 | 2.10 | 0.81 | (0.48) | (1.77) | (3.07) |
| | 2.67% | 4.67 | 3.38 | 2.09 | 0.80 | (0.50) | (1.79) | (3.08) |
| | 0.00% | 3.88 | 2.58 | 1.29 | 0.00 | (1.29) | (2.58) | (3.88) |
| | -2.67% | 2.30 | 1.00 | (0.29) | (1.58) | (2.87) | (4.16) | (5.46) |
| | -5.33% | (0.07) | (1.36) | (2.65) | (3.94) | (5.24) | (6.53) | (7.82) |
| | -8.00% | (3.21) | (4.51) | (5.80) | (7.09) | (8.38) | (9.67) | (10.97) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR6503337091 | 신한투자(ELS)1781 | 10.97 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 10.97 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 10.85 |
|-----|-------|

메리츠2Star증권LESF-14호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

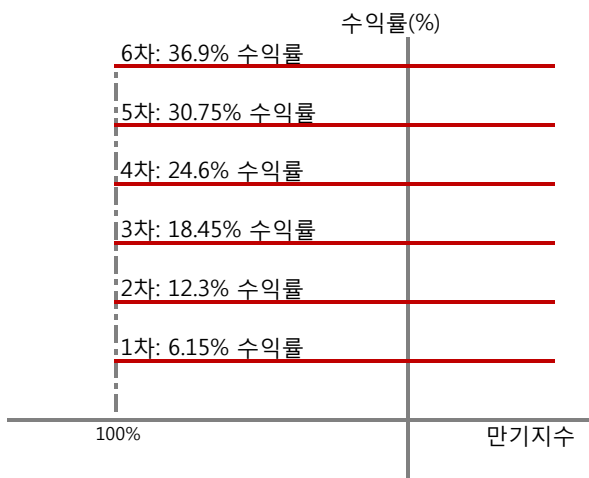
1. 계약금액

단위(백만원)

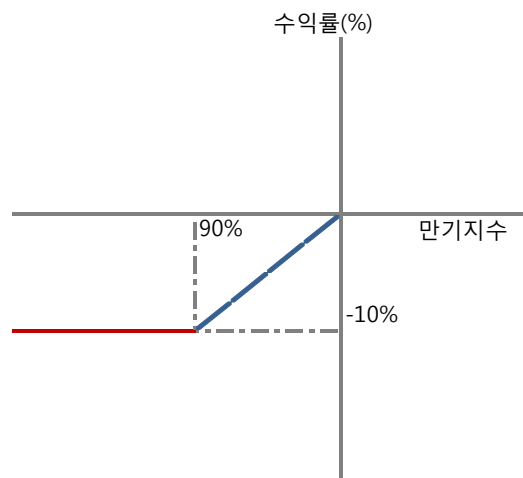
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,271 | 0 | 1,271 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,271 | 0 | 1,271 | 장외 |

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 자산 시나 리오 | 8.00% | 54.73 | 51.88 | 49.03 | 46.18 | 43.33 | 40.48 | 37.63 |
| | 5.33% | 41.80 | 38.95 | 36.11 | 33.26 | 30.41 | 27.56 | 24.71 |
| | 2.67% | 26.41 | 23.56 | 20.71 | 17.86 | 15.01 | 12.16 | 9.31 |
| | 0.00% | 8.55 | 5.70 | 2.85 | 0.00 | (2.85) | (5.70) | (8.55) |
| | -2.67% | (11.78) | (14.63) | (17.48) | (20.33) | (23.18) | (26.03) | (28.88) |
| | -5.33% | (34.58) | (37.43) | (40.28) | (43.13) | (45.98) | (48.83) | (51.68) |
| | -8.00% | (59.85) | (62.70) | (65.55) | (68.40) | (71.25) | (74.10) | (76.95) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-------------|-------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 76.95 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 76.95 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 91.77

메리츠2Star증권SEPO-5호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

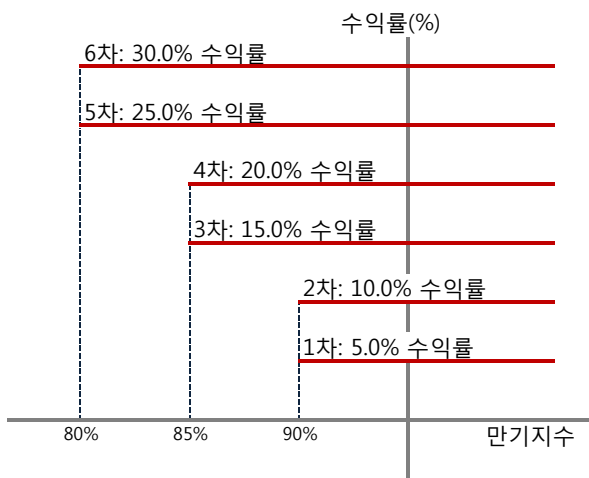
1. 계약금액

단위(백만원)

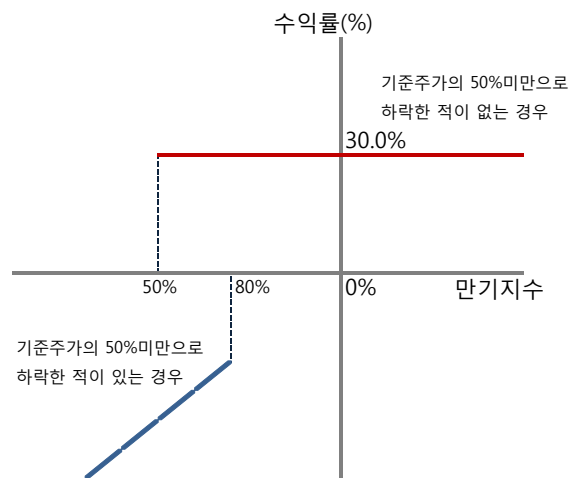
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,834 | 0 | 1,834 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,834 | 0 | 1,834 | 장외 |

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 | 27.25 | 23.32 | 19.40 | 15.47 | 11.54 | 7.61 | 3.69 | |
| 자산 | 24.73 | 20.81 | 16.88 | 12.95 | 9.03 | 5.10 | 1.17 | |
| 시나 | 19.58 | 15.65 | 11.72 | 7.80 | 3.87 | (0.06) | (3.98) | |
| 리오 | 0.00% | 11.78 | 7.85 | 3.93 | 0.00 | (3.93) | (7.85) | (11.78) |
| | -2.67% | 1.34 | (2.58) | (6.51) | (10.44) | (14.36) | (18.29) | (22.22) |
| | -5.33% | (11.73) | (15.66) | (19.59) | (23.52) | (27.44) | (31.37) | (35.30) |
| | -8.00% | (27.45) | (31.38) | (35.31) | (39.24) | (43.16) | (47.09) | (51.02) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR65023590A6 | 신한투자(ELS)1851 | 51.02 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 51.02 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 56.96

메리츠주가지수연계증권제5호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

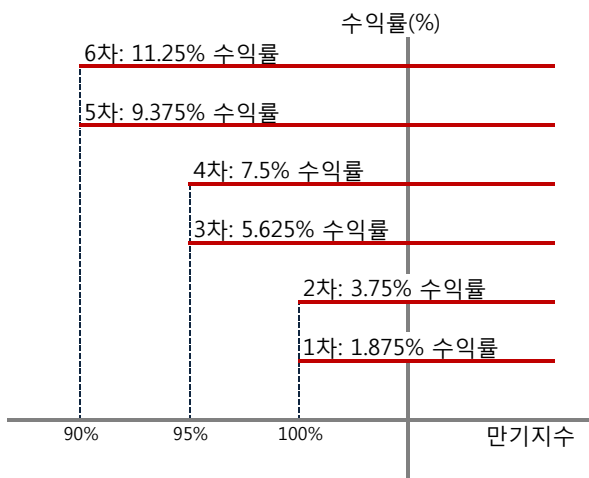
1. 계약금액

단위(백만원)

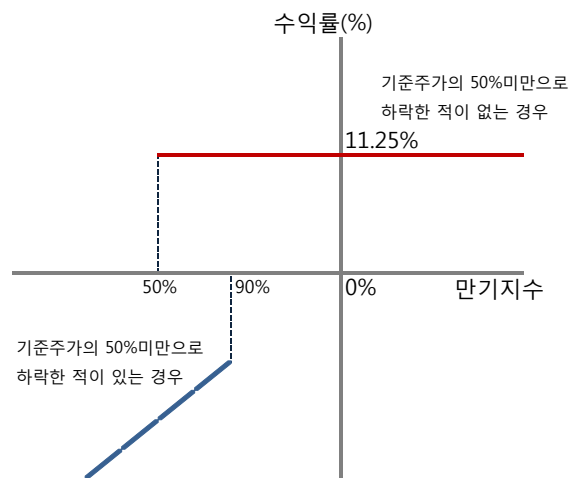
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |

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 시나 리오 | 8.00% | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 |
| | 5.33% | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 |
| | 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% | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 | 0.02 |
| | -8.00% | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 | 0.04 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-------------|------|
| KR65233960A7 | 대우증권ELS4586 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.00 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠한증지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

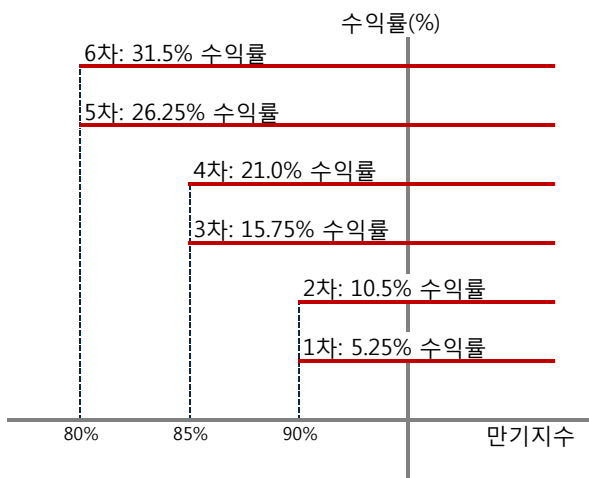
1. 계약금액

단위(백만원)

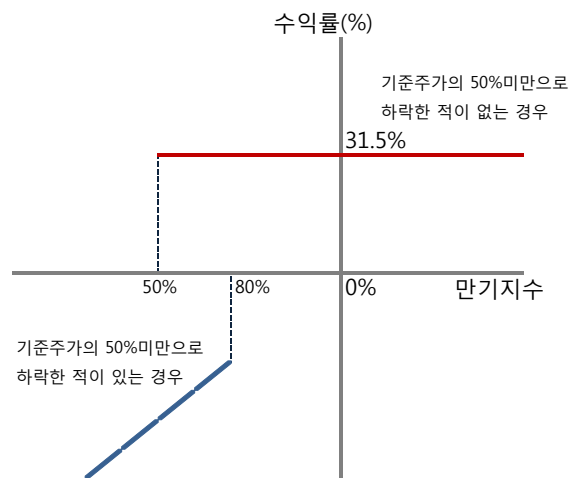
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,417 | 0 | 1,417 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,417 | 0 | 1,417 | 장외 |

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 | 7.06 | 5.15 | 3.24 | 1.34 | (0.57) | (2.48) | (4.39) | |
| 자산 | 8.26 | 6.35 | 4.45 | 2.54 | 0.63 | (1.28) | (3.18) | |
| 시나 | 7.81 | 5.91 | 4.00 | 2.09 | 0.19 | (1.72) | (3.63) | |
| 리오 | 0.00% | 5.72 | 3.81 | 1.91 | 0.00 | (1.91) | (3.81) | |
| | -2.67% | 1.98 | 0.07 | (1.84) | (3.74) | (5.65) | (7.56) | |
| | -5.33% | (3.41) | (5.32) | (7.23) | (9.13) | (11.04) | (12.95) | |
| | -8.00% | (10.45) | (12.36) | (14.26) | (16.17) | (18.08) | (19.98) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-----------------|-------|
| KR65533190B6 | 우리투자증권(ELS)3658 | 21.89 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 21.89 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 16.80

메리츠주가지수연계증권제6호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

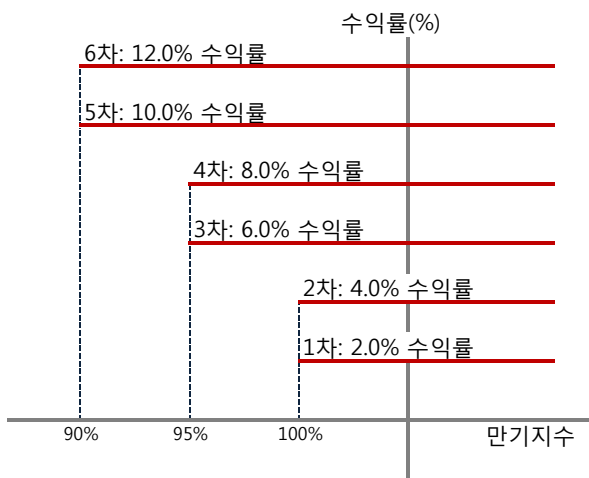
1. 계약금액

단위(백만원)

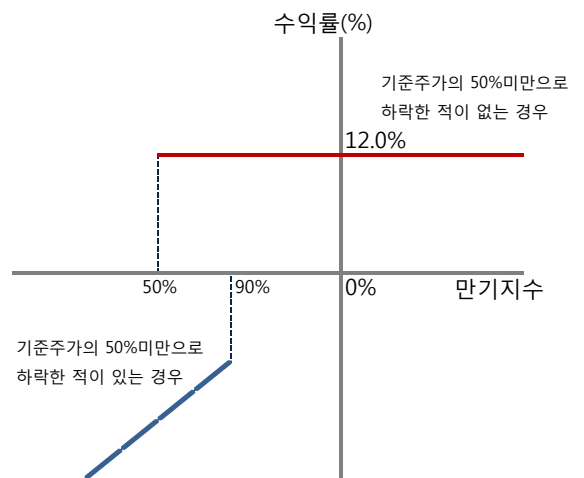
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |

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% | 4.82 | 4.82 | 4.82 | 4.82 | 4.82 | 4.82 | 4.82 |
| 자산 | 5.33% | 2.14 | 2.14 | 2.14 | 2.14 | 2.14 | 2.14 | 2.14 |
| 시나 | 2.67% | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 |
| 리오 | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 | 0.54 |
| | -5.33% | 2.15 | 2.15 | 2.15 | 2.15 | 2.15 | 2.15 | 2.15 |
| | -8.00% | 4.83 | 4.83 | 4.83 | 4.83 | 4.83 | 4.83 | 4.83 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-------------|------|
| KR65233210B5 | 대우증권ELS4682 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.00 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.03

메리츠한증지수연계증권제11호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

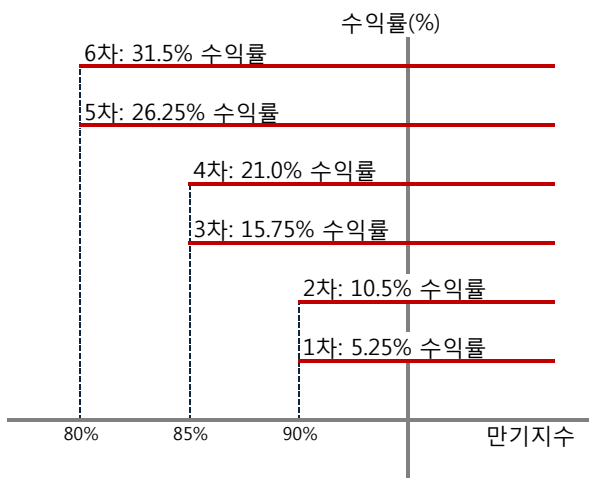
1. 계약금액

단위(백만원)

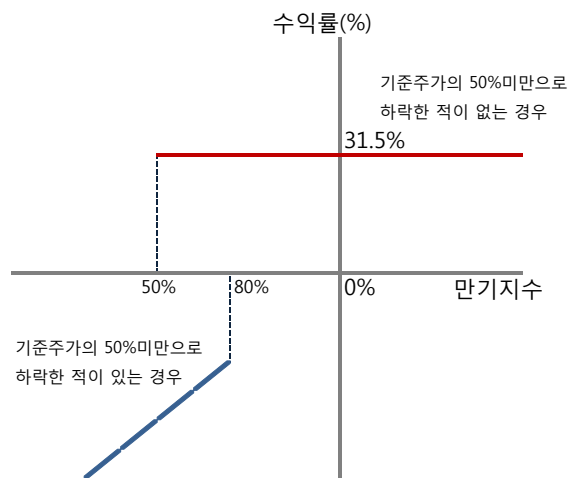
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,298 | 0 | 1,298 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,298 | 0 | 1,298 | 장외 |

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 | 8.40 | 6.42 | 4.44 | 2.45 | 0.47 | (1.51) | (3.49) | |
| 자산 | 9.15 | 7.17 | 5.18 | 3.20 | 1.22 | (0.76) | (2.74) | |
| 시나 | 8.33 | 6.35 | 4.37 | 2.38 | 0.40 | (1.58) | (3.56) | |
| 리오 | 0.00% | 5.95 | 3.96 | 1.98 | 0.00 | (1.98) | (3.96) | |
| | -2.67% | 2.00 | 0.01 | (1.97) | (3.95) | (5.93) | (7.91) | |
| | -5.33% | (3.52) | (5.50) | (7.48) | (9.47) | (11.45) | (13.43) | |
| | -8.00% | (10.60) | (12.58) | (14.57) | (16.55) | (18.53) | (20.51) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR65033630B6 | 신한투자(ELS)1958 | 22.49 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 22.49 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 20.21

메리츠한증지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

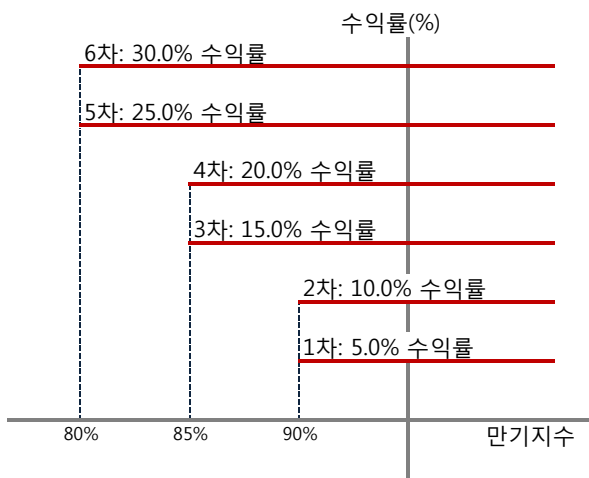
1. 계약금액

단위(백만원)

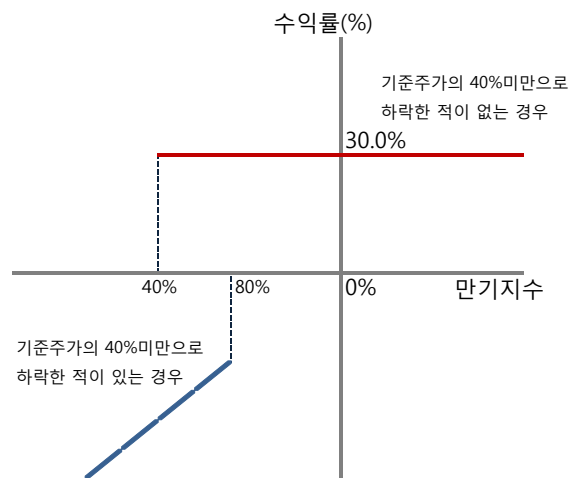
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,635 | 0 | 1,635 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,635 | 0 | 1,635 | 장외 |

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 | 8.00% | (2.64) | (3.39) | (4.13) | (4.87) | (5.62) | (6.36) | (7.11) |
| 자산 | 5.33% | (1.26) | (2.00) | (2.74) | (3.49) | (4.23) | (4.98) | (5.72) |
| 사 | 2.67% | 0.37 | (0.38) | (1.12) | (1.86) | (2.61) | (3.35) | (4.09) |
| 나 | 0.00% | 2.23 | 1.49 | 0.74 | 0.00 | (0.74) | (1.49) | (2.23) |
| 리 | -2.67% | 4.33 | 3.59 | 2.84 | 2.10 | 1.36 | 0.61 | (0.13) |
| 오 | -5.33% | 6.67 | 5.93 | 5.18 | 4.44 | 3.70 | 2.95 | 2.21 |
| 시 | -8.00% | 9.25 | 8.51 | 7.76 | 7.02 | 6.27 | 5.53 | 4.79 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|------|
| KR65433540B3 | 신영증권(ELS)1854 | 7.11 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 7.11 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 7.26

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

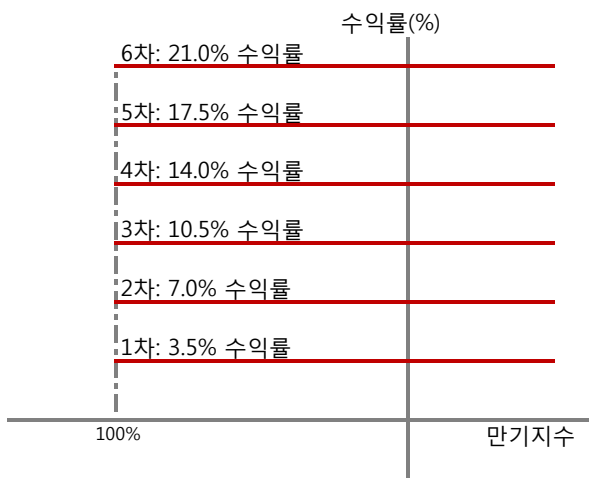
1. 계약금액

단위(백만원)

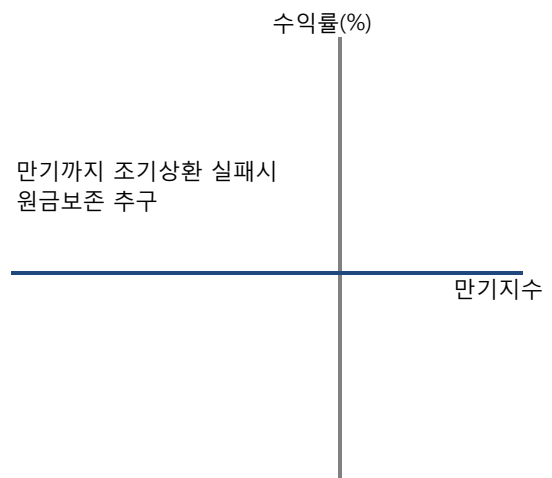
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 881 | 0 | 881 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 881 | 0 | 881 | 장외 |

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 | 21.34 | 20.21 | 19.08 | 17.95 | 16.82 | 15.69 | 14.56 | |
| 자산 | 15.64 | 14.51 | 13.38 | 12.25 | 11.13 | 10.00 | 8.87 | |
| 시나 | 9.66 | 8.53 | 7.40 | 6.27 | 5.14 | 4.01 | 2.88 | |
| 리오 | 0.00% | 3.39 | 2.26 | 1.13 | 0.00 | (1.13) | (2.26) | (3.39) |
| | -2.67% | (3.17) | (4.30) | (5.43) | (6.56) | (7.69) | (8.82) | (9.95) |
| | -5.33% | (10.02) | (11.15) | (12.28) | (13.41) | (14.54) | (15.67) | (16.80) |
| | -8.00% | (17.16) | (18.29) | (19.41) | (20.54) | (21.67) | (22.80) | (23.93) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-----------------|-------|
| KR65523460C3 | 우리투자증권(ELS)3756 | 23.93 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 23.93 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 23.58

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-12

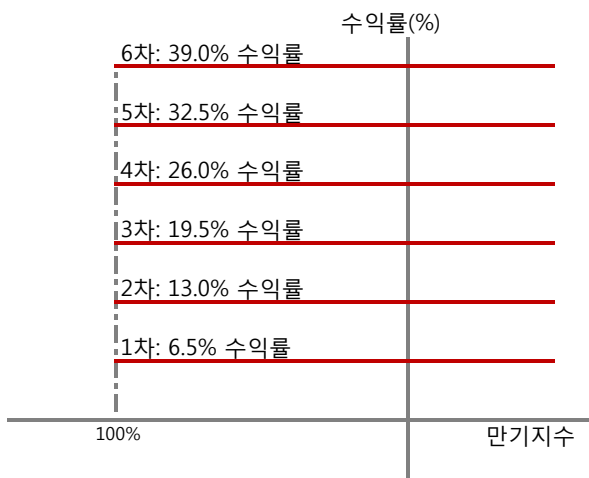
1. 계약금액

단위(백만원)

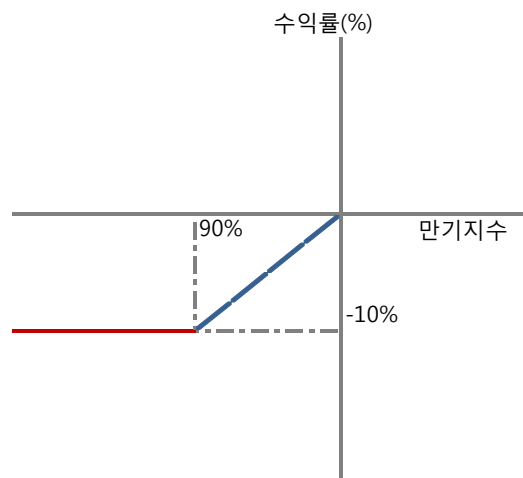
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 864 | 0 | 864 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 864 | 0 | 864 | 장외 |

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 자산 시나 리오 | 8.00% | 36.45 | 34.24 | 32.02 | 29.81 | 27.60 | 25.39 | 23.17 |
| | 5.33% | 27.16 | 24.95 | 22.73 | 20.52 | 18.31 | 16.10 | 13.88 |
| | 2.67% | 17.22 | 15.01 | 12.80 | 10.58 | 8.37 | 6.16 | 3.95 |
| | 0.00% | 6.64 | 4.43 | 2.21 | 0.00 | (2.21) | (4.43) | (6.64) |
| | -2.67% | (4.59) | (6.81) | (9.02) | (11.23) | (13.44) | (15.66) | (17.87) |
| | -5.33% | (16.47) | (18.69) | (20.90) | (23.11) | (25.32) | (27.54) | (29.75) |
| | -8.00% | (29.00) | (31.21) | (33.42) | (35.64) | (37.85) | (40.06) | (42.28) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-----------------|-------|
| KR65523450C4 | 우리투자증권(ELS)3755 | 42.28 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 42.28 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 41.11