

**파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시**

# 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

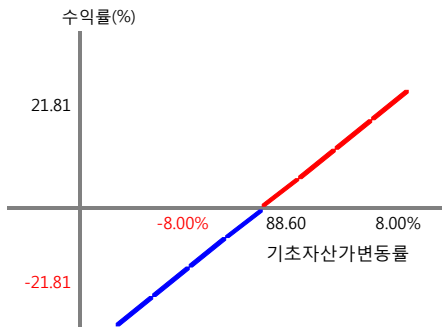
공시일: 2011-01-27

## 1. 계약금액

단위(백만원)

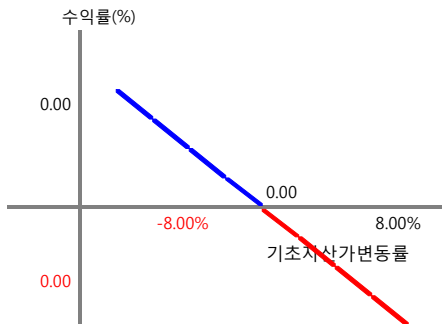
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

## 2. 만기시점의 손익구조



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

CLG1 WTI CRUDE FUTURE FEB 11 Long



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

## 3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLG1 WTI CRUDE FUTURE FEB 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나 리오	8.00%	21.81
	5.33%	14.53
	2.67%	7.28
	0.00%	0.00
	-2.67%	-7.28
	-5.33%	-14.53
	-8.00%	-21.81

### 최대손실 시나리오

위험액	-21.81
-----	--------

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	88.35
-----	-------

# 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

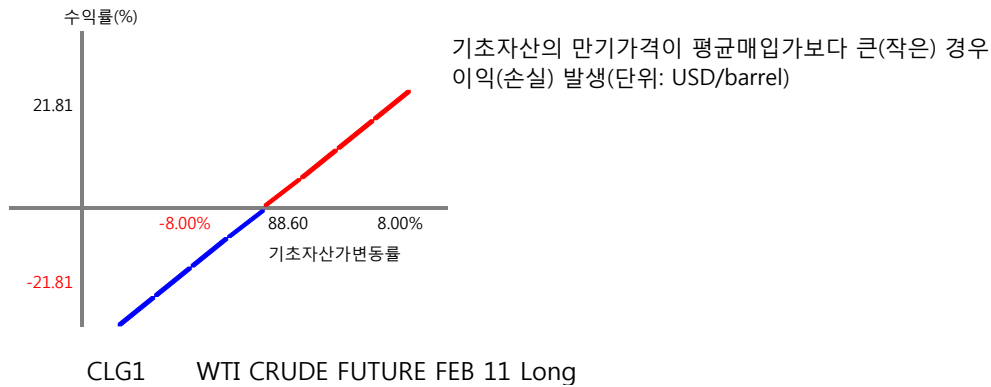
공시일: 2011-01-27

## 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))

CLG1 WTI CRUDE FUTURE FEB 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	43.61
	5.33%	29.06
	2.67%	14.56
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-14.56
	-5.33%	-29.06
	-8.00%	-43.61

최대손실 시나리오	
위험액	-43.61

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	115.86
-----	--------

# 메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

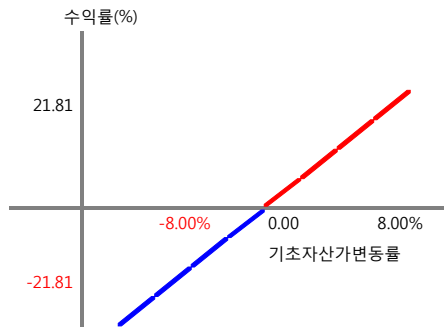
공시일: 2011-01-27

## 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)

ECG1 E-MINI CRUDE OIL FEB11 Long

# 메리츠PremiumCommodity특별자산1

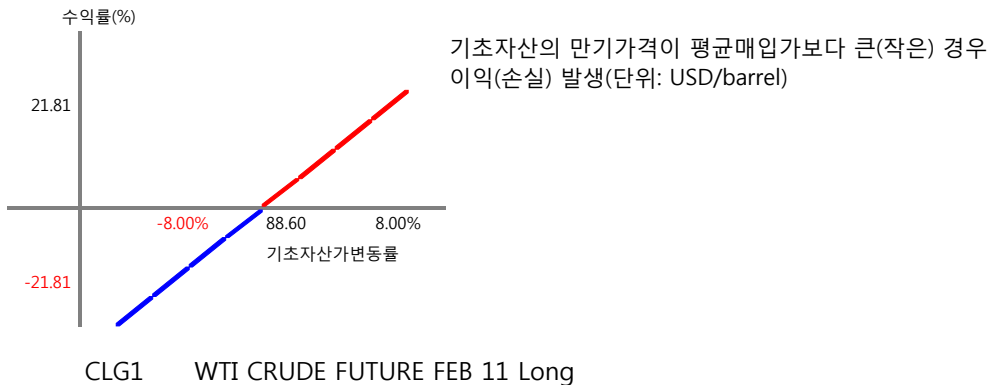
공시일: 2011-01-27

## 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))

CLG1 WTI CRUDE FUTURE FEB 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	271.25
	5.33%	180.72
	2.67%	90.53
	0.00%	0.00
시나리오	-2.67%	-90.53
	-5.33%	-180.72
	-8.00%	-271.25

최대손실 시나리오

위험액	-271.25
-----	---------

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,079.26
-----	----------

# 메리츠PremiumCommodity특별자산1

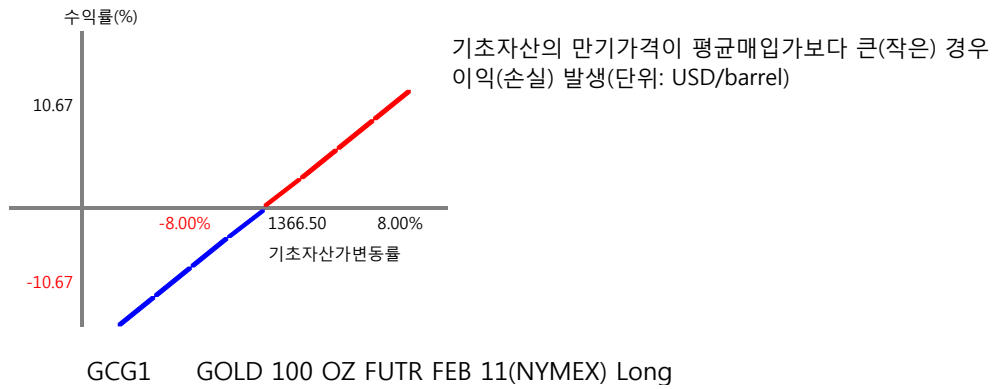
공시일: 2011-01-27

## 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

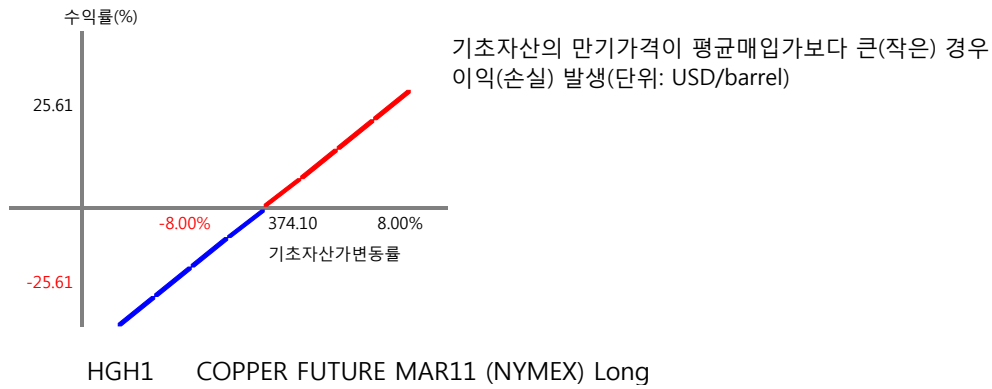
공시일: 2011-01-27

## 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

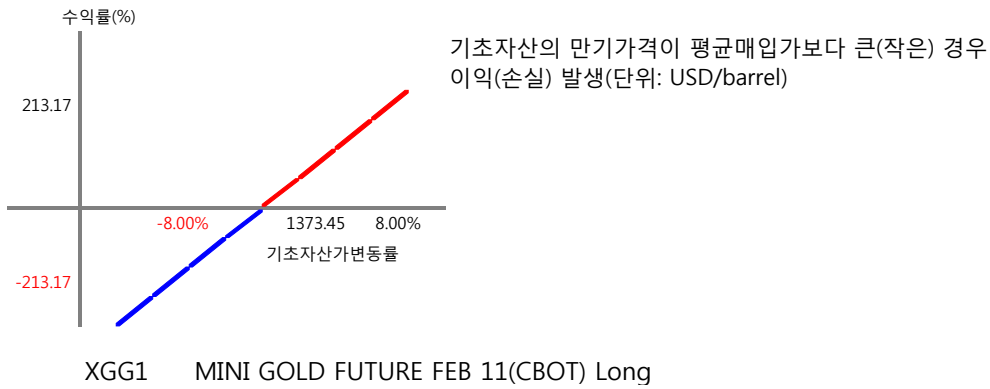
공시일: 2011-01-27

## 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]

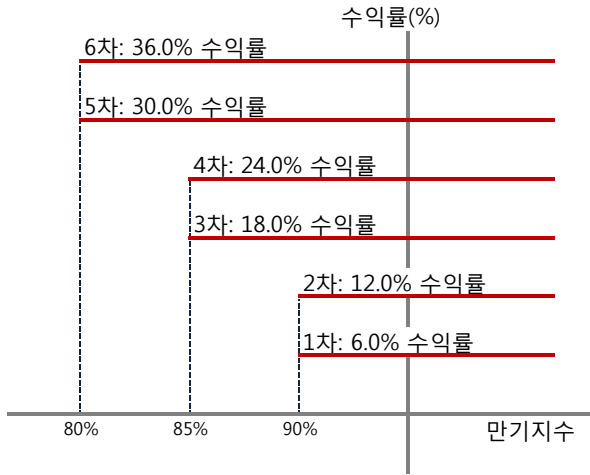
공시일: 2011-01-27

## 1. 계약금액

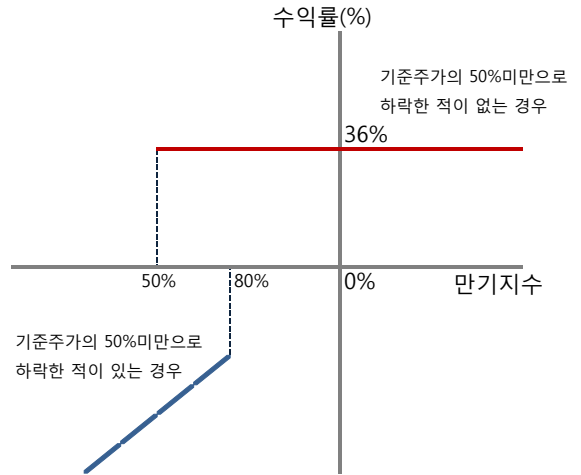
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장외

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	5.33%	2.67%	0.00%	-2.67%	-5.33%	-8.00%	
	62.10	54.93	43.27	27.14	6.51	(18.59)	(48.18)	
	53.06	45.88	34.23	18.09	(2.53)	(27.64)	(57.23)	
	44.01	36.84	25.18	9.05	(11.58)	(36.68)	(66.27)	
	34.97	27.79	16.14	0.00	(20.62)	(45.73)	(75.32)	
	25.92	18.75	7.09	(9.05)	(29.67)	(54.77)	(84.36)	
	16.88	9.70	(1.95)	(18.09)	(38.71)	(63.82)	(93.41)	
	7.83	0.66	(11.00)	(27.14)	(47.76)	(72.86)	(102.45)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	102.45
총 최대손실 예상금액		102.45

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	100.28
-----	--------

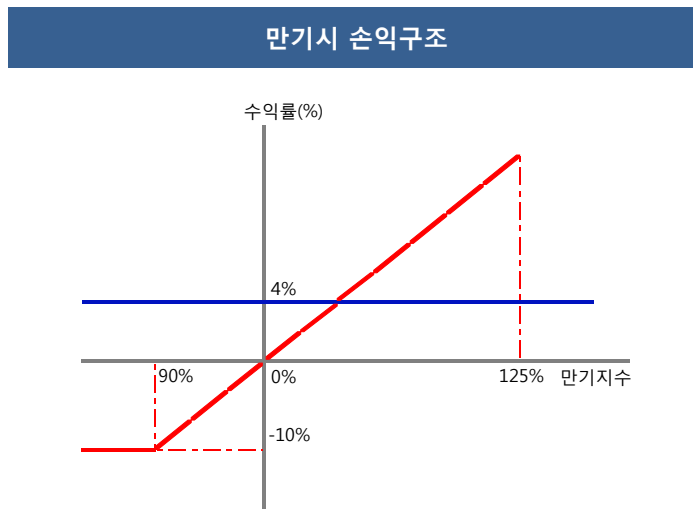
# 메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

## 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 자산 시나 리오	8.00%	(34.38)	(35.53)	(36.68)	(37.82)	(38.97)	(40.12)	(41.27)
	5.33%	(20.23)	(21.38)	(22.52)	(23.67)	(24.82)	(25.97)	(27.12)
	2.67%	(7.62)	(8.77)	(9.92)	(11.06)	(12.21)	(13.36)	(14.51)
	0.00%	3.44	2.30	1.15	0.00	(1.15)	(2.30)	(3.44)
	-2.67%	12.96	11.82	10.67	9.52	8.37	7.22	6.08
	-5.33%	20.94	19.79	18.65	17.50	16.35	15.20	14.05
	-8.00%	27.37	26.23	25.08	23.93	22.78	21.63	20.49

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503339048	신한투자(ELS)1447	41.27
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>41.27</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	42.29
-----	-------

# 메리츠한증지수연계증권제9호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

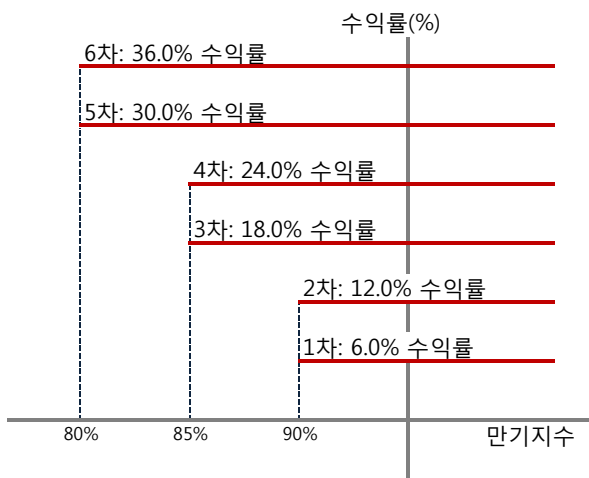
## 1. 계약금액

단위(백만원)

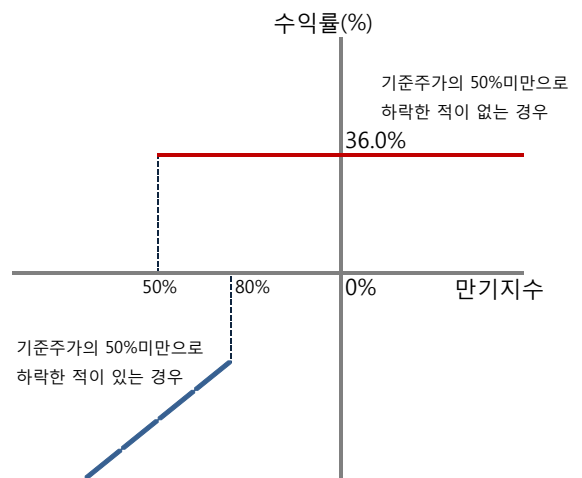
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외
누계	유가증권	선물	2,686	0	2,686	장외

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	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)

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: 2011-01-27

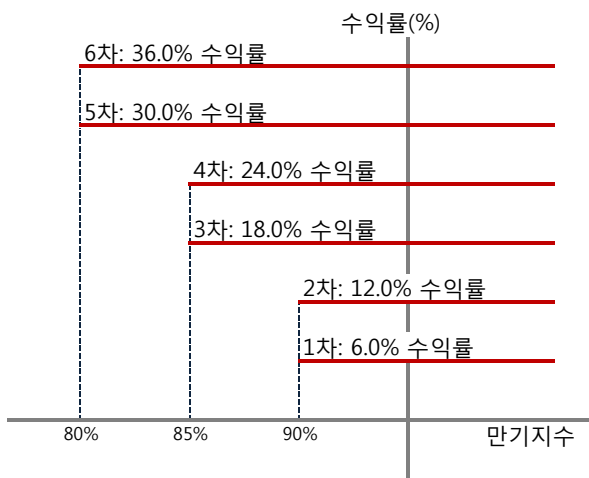
## 1. 계약금액

단위(백만원)

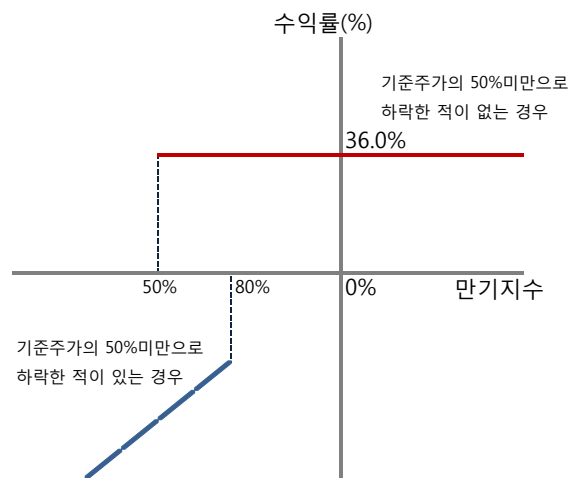
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	512	0	512	장외
누계	유가증권	선물	512	0	512	장외

## 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	23.80	22.25	20.70	19.15	17.60	16.05	14.50	
자산	17.94	16.39	14.84	13.29	11.74	10.19	8.64	
시나	11.56	10.01	8.46	6.91	5.36	3.80	2.25	
리오	0.00%	4.65	3.10	1.55	0.00	(1.55)	(3.10)	(4.65)
	-2.67%	(2.78)	(4.33)	(5.88)	(7.43)	(8.98)	(10.53)	(12.08)
	-5.33%	(10.73)	(12.28)	(13.83)	(15.38)	(16.93)	(18.48)	(20.03)
	-8.00%	(19.20)	(20.75)	(22.30)	(23.85)	(25.41)	(26.96)	(28.51)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293A8084	대우증권(ELS)4375	28.51
총 최대손실 예상금액		28.51

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 32.67

# 메리츠2Star증권LESF-12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

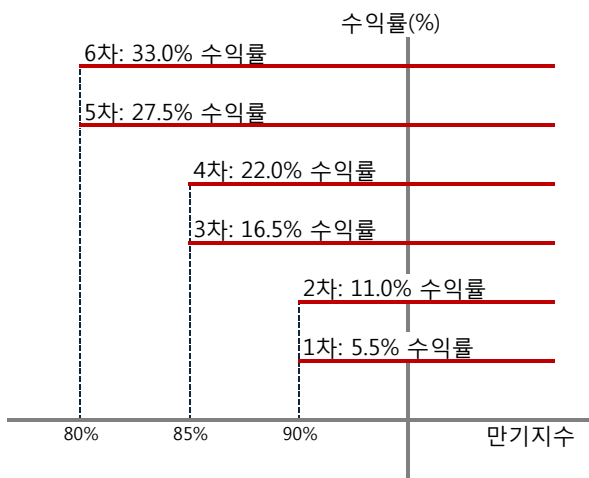
## 1. 계약금액

단위(백만원)

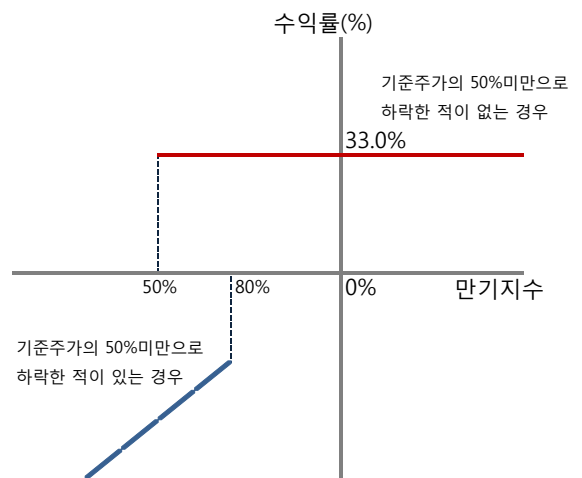
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	851	0	851	장외
누계	유가증권	선물	851	0	851	장외

## 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%	(1.82)	(2.56)	(3.30)	(4.04)	(4.78)	(5.52)	(6.26)
자산	5.33%	1.56	0.82	0.08	(0.66)	(1.40)	(2.14)	(2.88)
시나	2.67%	2.91	2.17	1.43	0.69	(0.05)	(0.80)	(1.54)
리오	0.00%	2.22	1.48	0.74	0.00	(0.74)	(1.48)	(2.22)
	-2.67%	(0.50)	(1.24)	(1.98)	(2.72)	(3.46)	(4.20)	(4.94)
	-5.33%	(5.24)	(5.98)	(6.73)	(7.47)	(8.21)	(8.95)	(9.69)
	-8.00%	(12.02)	(12.77)	(13.51)	(14.25)	(14.99)	(15.73)	(16.47)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6542302098	신영증권(ELS)1714	16.47
총 최대손실 예상금액		16.47

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 16.47

# 메리츠2Star증권LESF-13호 [ELS-파생형]

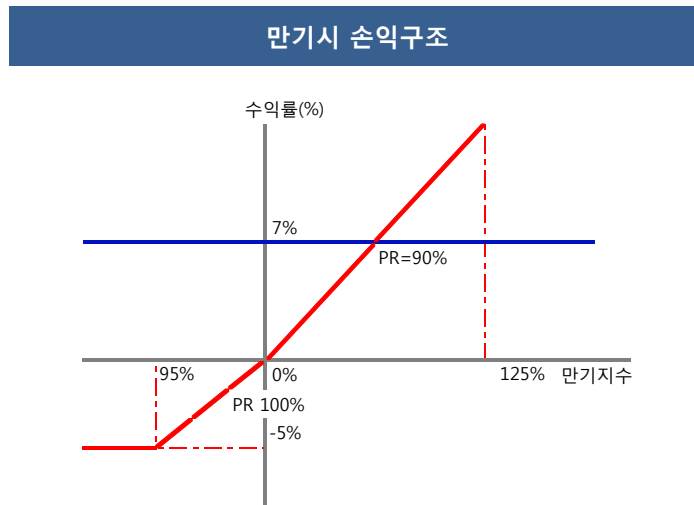
공시일: 2011-01-27

## 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%	(1.64)	(2.99)	(4.35)	(5.71)	(7.06)	(8.42)	(9.78)
	5.33%	1.22	(0.14)	(1.50)	(2.85)	(4.21)	(5.57)	(6.92)
	2.67%	3.12	1.76	0.41	(0.95)	(2.31)	(3.66)	(5.02)
	0.00%	4.07	2.71	1.36	0.00	(1.36)	(2.71)	(4.07)
	-2.67%	4.07	2.71	1.35	(0.00)	(1.36)	(2.72)	(4.07)
	-5.33%	3.11	1.75	0.40	(0.96)	(2.32)	(3.67)	(5.03)
	-8.00%	1.20	(0.16)	(1.51)	(2.87)	(4.23)	(5.58)	(6.94)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503337091	신한투자(ELS)1781	9.78
총 최대손실 예상금액		9.78

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.59
-----	------

# 메리츠2Star증권LESF-14호 [ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

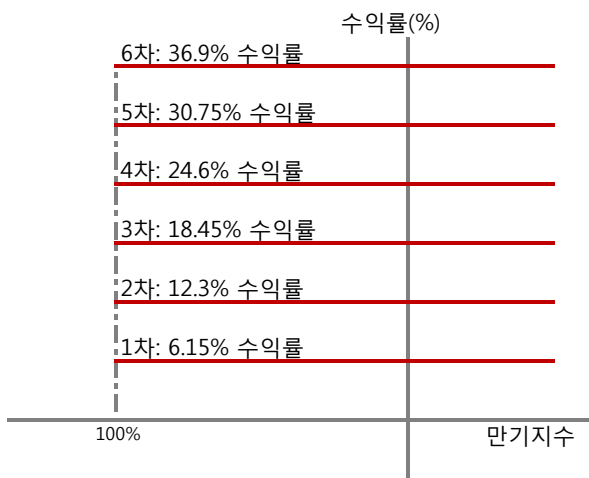
## 1. 계약금액

단위(백만원)

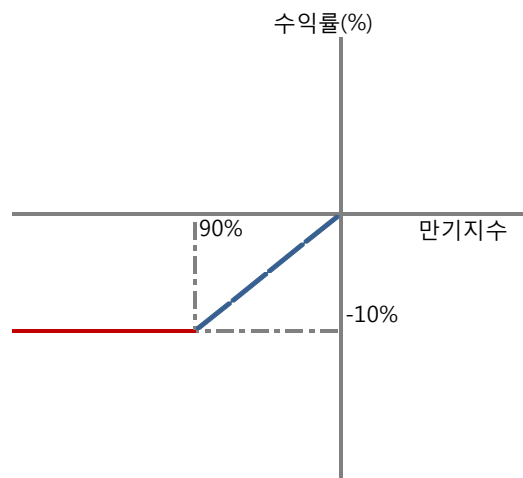
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,271	0	1,271	장외
누계	유가증권	선물	1,271	0	1,271	장외

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	59.26	56.65	54.05	51.44	48.84	46.23	43.62
	5.33%	44.37	41.77	39.16	36.56	33.95	31.35	28.74
	2.67%	27.23	24.62	22.02	19.41	16.81	14.20	11.60
	0.00%	7.82	5.21	2.61	0.00	(2.61)	(5.21)	(7.82)
	-2.67%	(13.86)	(16.46)	(19.07)	(21.68)	(24.28)	(26.89)	(29.49)
	-5.33%	(37.80)	(40.40)	(43.01)	(45.61)	(48.22)	(50.83)	(53.43)
	-8.00%	(64.00)	(66.61)	(69.21)	(71.82)	(74.42)	(77.03)	(79.63)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293160A1	대우증권ELS4537	79.63
총 최대손실 예상금액		79.63

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 105.23

# 메리츠2Star증권SEPO-5호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

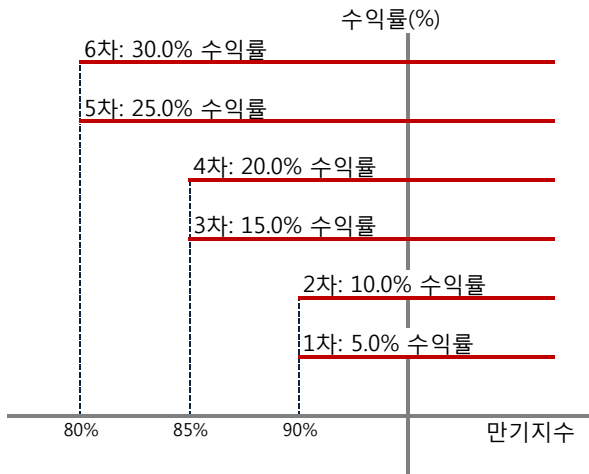
## 1. 계약금액

단위(백만원)

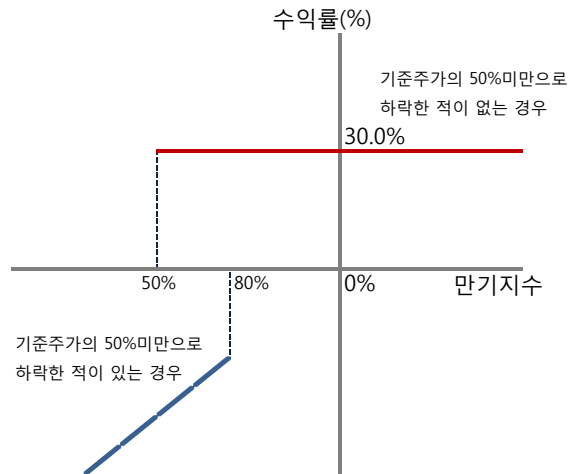
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장외
누계	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장외

## 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	32.34	27.92	23.51	19.09	14.68	10.27	5.85	
자산	29.07	24.66	20.24	15.83	11.41	7.00	2.59	
시나	22.70	18.29	13.88	9.46	5.05	0.64	(3.78)	
리오	0.00%	8.83	4.41	0.00	(4.41)	(8.83)	(13.24)	
	-2.67%	(3.73)	(8.15)	(12.56)	(16.98)	(21.39)	(25.80)	
	-5.33%	(14.98)	(19.39)	(23.81)	(28.22)	(32.64)	(37.05)	
	-8.00%	(33.74)	(38.15)	(42.57)	(46.98)	(51.40)	(55.81)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023590A6	신한투자(ELS)1851	60.22
총 최대손실 예상금액		60.22

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 64.17



# 메리츠한증지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

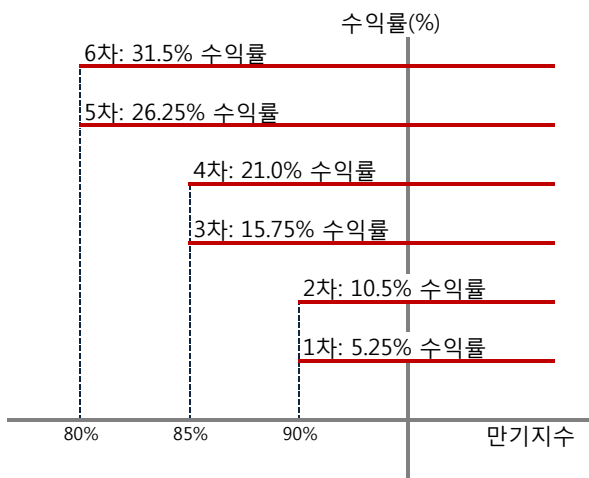
## 1. 계약금액

단위(백만원)

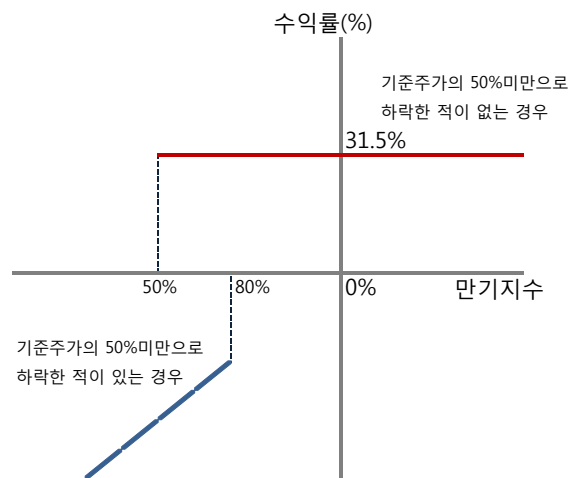
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,417	0	1,417	장외
누계	유가증권	선물	1,417	0	1,417	장외

## 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 자산 시나리오	8.00%	8.78	6.88	4.98	3.07	1.17	(0.73)	(2.63)
	5.33%	9.40	7.50	5.59	3.69	1.79	(0.11)	(2.01)
	2.67%	8.37	6.47	4.57	2.67	0.77	(1.14)	(3.04)
	0.00%	5.71	3.80	1.90	0.00	(1.90)	(3.80)	(5.71)
	-2.67%	1.39	(0.51)	(2.41)	(4.31)	(6.21)	(8.11)	(10.02)
	-5.33%	(4.56)	(6.46)	(8.36)	(10.26)	(12.17)	(14.07)	(15.97)
	-8.00%	(12.15)	(14.06)	(15.96)	(17.86)	(19.76)	(21.66)	(23.56)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65533190B6	우리투자증권(ELS)3658	23.56
총 최대손실 예상금액		23.56

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 23.69

# 메리츠주가지수연계증권제6호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

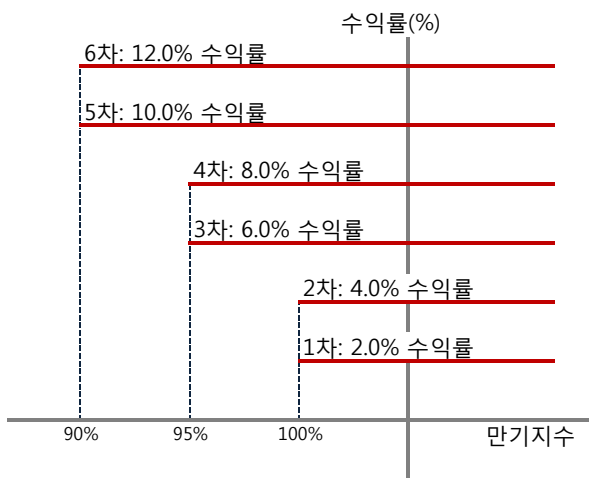
## 1. 계약금액

단위(백만원)

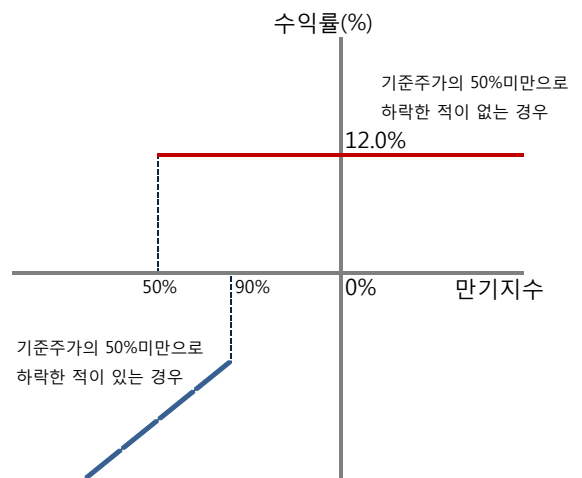
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

## 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)

KR65233210B5	대우증권ELS4682	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

# 메리츠한증지수연계증권제11호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

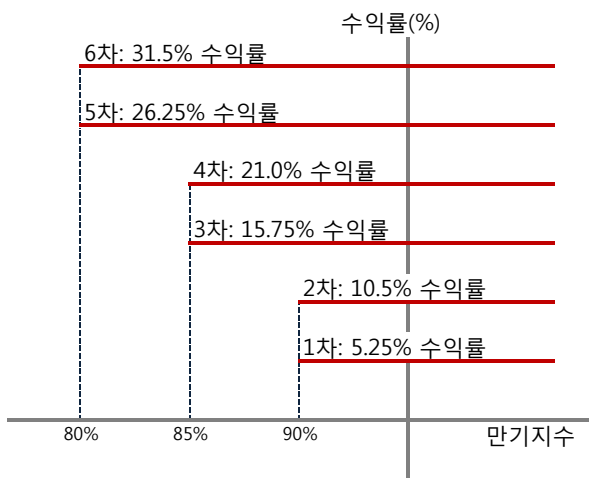
## 1. 계약금액

단위(백만원)

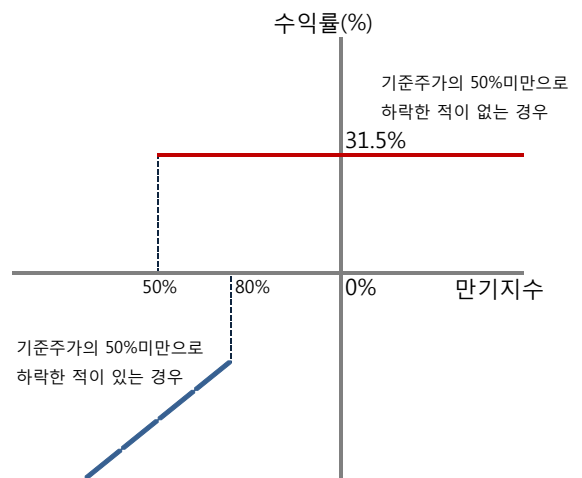
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,298	0	1,298	장외
누계	유가증권	선물	1,298	0	1,298	장외

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	8.67	6.40	4.13	1.86	(0.41)	(2.67)	(4.94)
	5.33%	10.00	7.73	5.46	3.19	0.93	(1.34)	(3.61)
	2.67%	9.38	7.11	4.84	2.57	0.30	(1.96)	(4.23)
	0.00%	6.81	4.54	2.27	0.00	(2.27)	(4.54)	(6.81)
	-2.67%	2.28	0.01	(2.26)	(4.53)	(6.79)	(9.06)	(11.33)
	-5.33%	(4.20)	(6.47)	(8.73)	(11.00)	(13.27)	(15.54)	(17.81)
	-8.00%	(12.63)	(14.90)	(17.17)	(19.43)	(21.70)	(23.97)	(26.24)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033630B6	신한투자(ELS)1958	26.24
총 최대손실 예상금액		26.24

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 28.03

# 메리츠한증지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

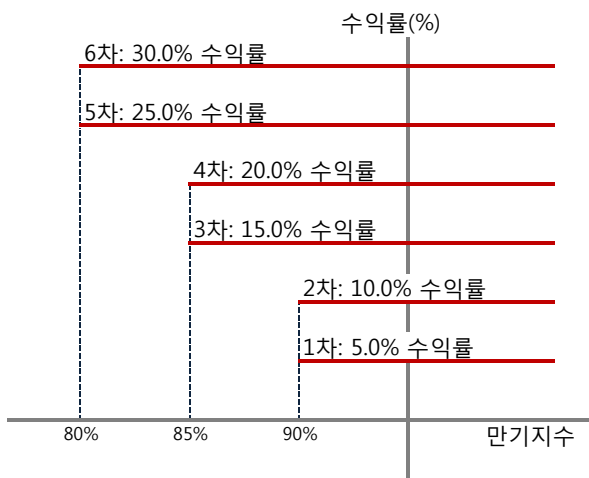
## 1. 계약금액

단위(백만원)

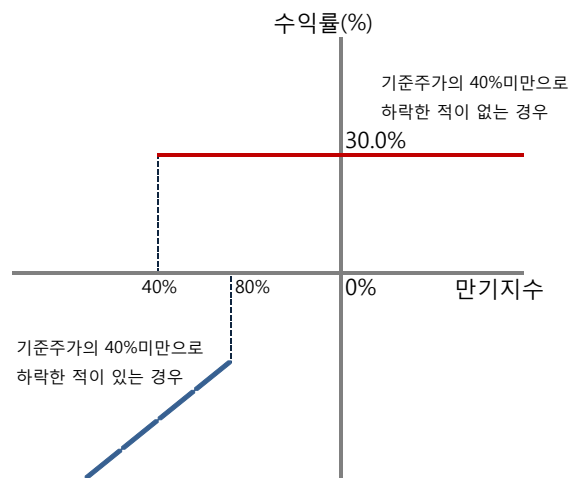
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,635	0	1,635	장외
누계	유가증권	선물	1,635	0	1,635	장외

## 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%	5.33%	2.67%	0.00%	-2.67%	-5.33%	-8.00%	
자산	(4.00)	(2.10)	(0.08)	2.04	4.28	6.64	9.10	
시나	(4.68)	(2.78)	(0.76)	1.36	3.60	5.95	8.42	
리오	(5.37)	(3.46)	(1.45)	0.68	2.92	5.27	7.74	
	(6.05)	(4.14)	(2.13)	0.00	2.24	4.59	7.05	
	(6.73)	(4.83)	(2.81)	(0.68)	1.56	3.91	6.37	
	(7.41)	(5.51)	(3.49)	(1.36)	0.88	3.23	5.69	
	(8.09)	(6.19)	(4.17)	(2.04)	0.19	2.55	5.01	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65433540B3	신영증권(ELS)1854	8.09
총 최대손실 예상금액		8.09

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 7.09

# 메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

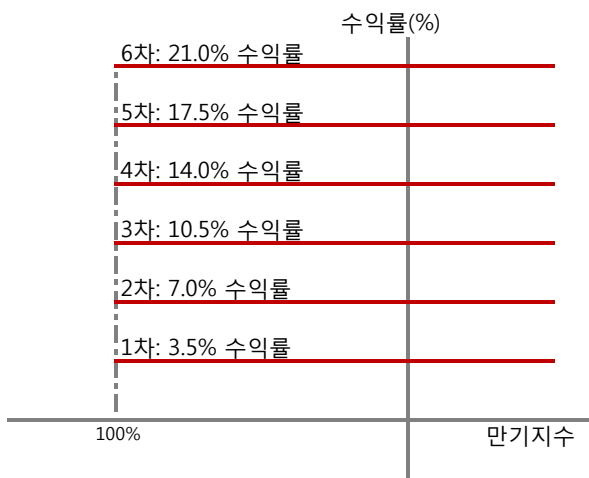
## 1. 계약금액

단위(백만원)

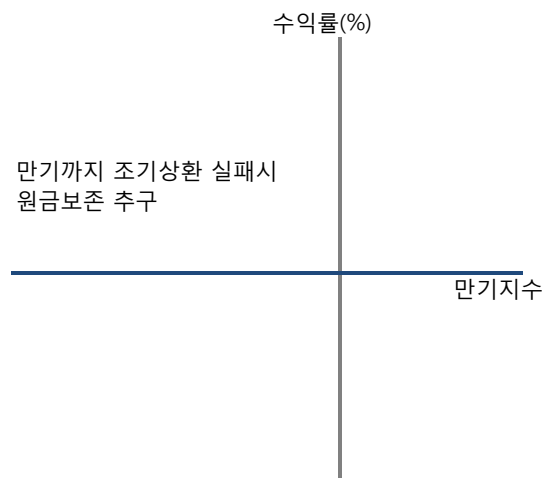
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	881	0	881	장외
누계	유가증권	선물	881	0	881	장외

## 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	26.43	25.39	24.36	23.33	22.30	21.27	20.23	
자산	18.93	17.90	16.87	15.84	14.81	13.77	12.74	
시나	11.16	10.13	9.09	8.06	7.03	6.00	4.97	
리오	0.00%	3.10	2.06	1.03	0.00	(1.03)	(2.06)	(3.10)
	-2.67%	(5.25)	(6.28)	(7.31)	(8.35)	(9.38)	(10.41)	(11.44)
	-5.33%	(13.88)	(14.91)	(15.95)	(16.98)	(18.01)	(19.04)	(20.08)
	-8.00%	(22.80)	(23.83)	(24.86)	(25.90)	(26.93)	(27.96)	(28.99)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	28.99
총 최대손실 예상금액		28.99

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 35.91

# 메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

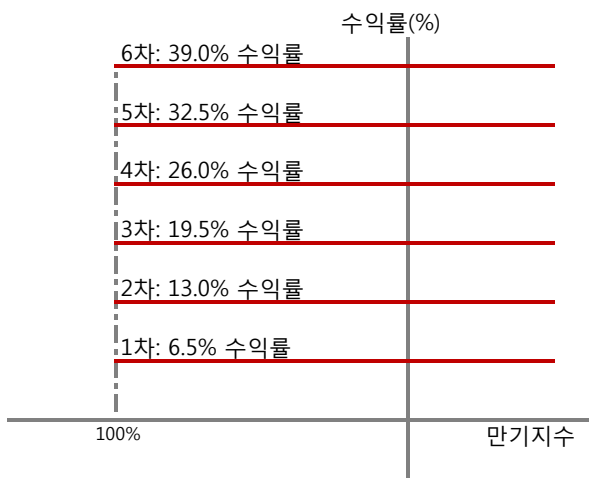
## 1. 계약금액

단위(백만원)

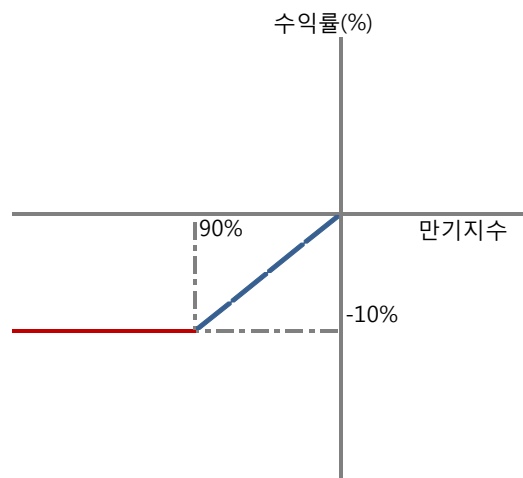
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	864	0	864	장외
누계	유가증권	선물	864	0	864	장외

## 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%	42.25	40.29	38.32	36.35	34.39	32.42	30.46
	5.33%	30.89	28.92	26.96	24.99	23.03	21.06	19.09
	2.67%	18.77	16.81	14.84	12.87	10.91	8.94	6.98
	0.00%	5.90	3.93	1.97	0.00	(1.97)	(3.93)	(5.90)
	-2.67%	(7.73)	(9.70)	(11.66)	(13.63)	(15.59)	(17.56)	(19.53)
	-5.33%	(22.12)	(24.08)	(26.05)	(28.01)	(29.98)	(31.94)	(33.91)
	-8.00%	(37.25)	(39.22)	(41.19)	(43.15)	(45.12)	(47.08)	(49.05)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	49.05
총 최대손실 예상금액		49.05

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 62.08

# 메리츠2Star증권SEST-44호 [ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

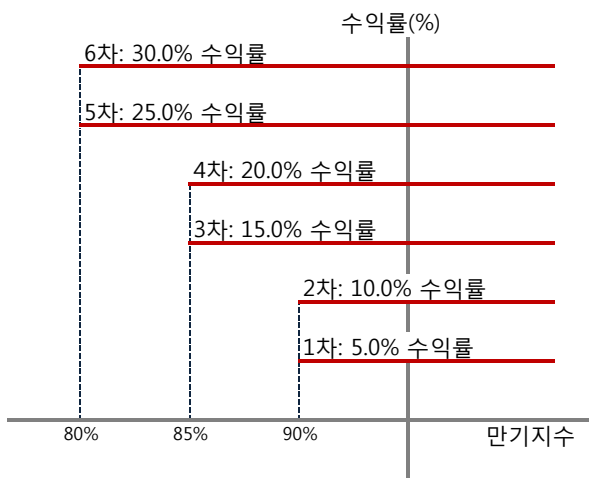
## 1. 계약금액

단위(백만원)

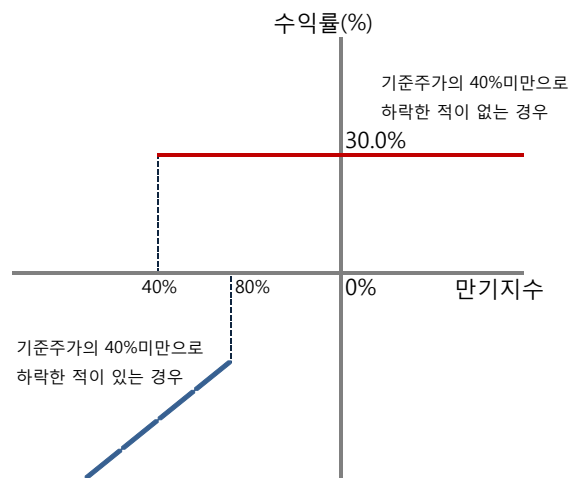
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외

## 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%	(1.33)	(1.71)	(2.09)	(2.47)	(2.85)	(3.23)	(3.61)
자산	5.33%	(0.66)	(1.04)	(1.42)	(1.80)	(2.19)	(2.57)	(2.95)
시나	2.67%	0.16	(0.22)	(0.60)	(0.98)	(1.36)	(1.74)	(2.12)
리오	0.00%	1.14	0.76	0.38	0.00	(0.38)	(0.76)	(1.14)
	-2.67%	2.28	1.90	1.52	1.14	0.76	0.38	(0.00)
	-5.33%	3.58	3.20	2.82	2.44	2.06	1.68	1.30
	-8.00%	5.04	4.66	4.28	3.90	3.51	3.13	2.75

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033AD0C3	신한투자(ELS)2106	3.61
총 최대손실 예상금액		3.61

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 5.55

# 메리츠2Star증권SEST-47호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

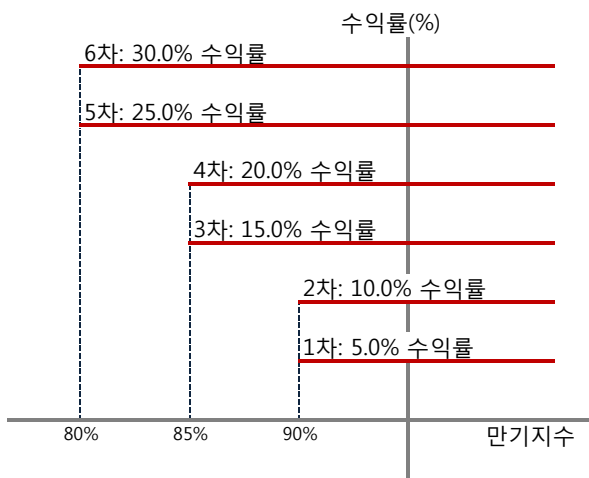
## 1. 계약금액

단위(백만원)

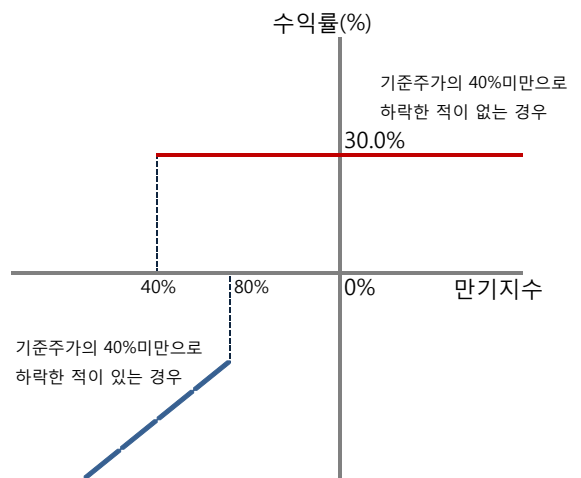
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외

## 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%	(1.33)	(1.71)	(2.09)	(2.47)	(2.85)	(3.23)	(3.61)
자산	5.33%	(0.66)	(1.04)	(1.42)	(1.80)	(2.19)	(2.57)	(2.95)
시나	2.67%	0.16	(0.22)	(0.60)	(0.98)	(1.36)	(1.74)	(2.12)
리오	0.00%	1.14	0.76	0.38	0.00	(0.38)	(0.76)	(1.14)
	-2.67%	2.28	1.90	1.52	1.14	0.76	0.38	(0.00)
	-5.33%	3.58	3.20	2.82	2.44	2.06	1.68	1.30
	-8.00%	5.04	4.66	4.28	3.90	3.51	3.13	2.75

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033AD0C3	신한투자(ELS)2106	3.61
총 최대손실 예상금액		3.61

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 5.55



# 메리츠2Star증권SEST-51호 [ELS-파생형]

공시일: 2011-01-27

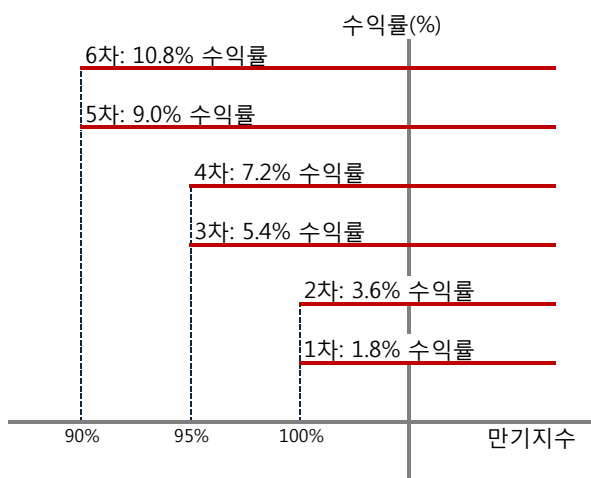
## 1. 계약금액

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

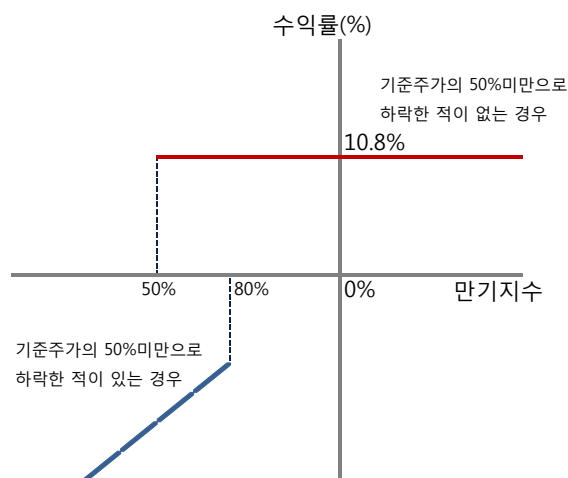
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	3.62	3.85	4.08	4.31	4.55	4.78	5.01
자산	5.33%	(2.41)	(2.18)	(1.95)	(1.72)	(1.49)	(1.26)	(1.02)
시나	2.67%	(3.85)	(3.62)	(3.39)	(3.16)	(2.93)	(2.69)	(2.46)
리오	0.00%	(0.69)	(0.46)	(0.23)	0.00	0.23	0.46	0.69
	-2.67%	7.06	7.29	7.52	7.75	7.98	8.21	8.45
	-5.33%	19.40	19.64	19.87	20.10	20.33	20.56	20.79
	-8.00%	36.35	36.58	36.81	37.04	37.27	37.50	37.73

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65233AF0C9	대우증권ELS4907	3.85
총 최대손실 예상금액		3.85

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.47
-----	-------