

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

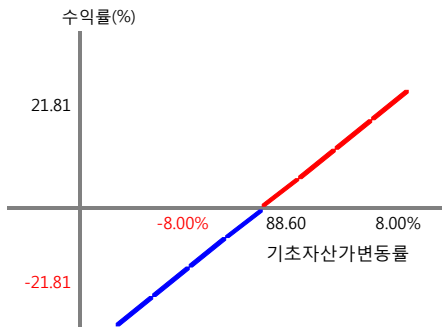
공시일: 2011-01-28

1. 계약금액

단위(백만원)

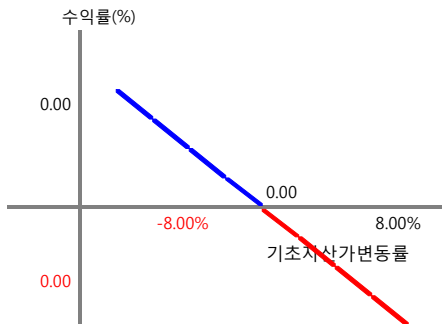
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3 | 0 | 3 | 장내 |

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]

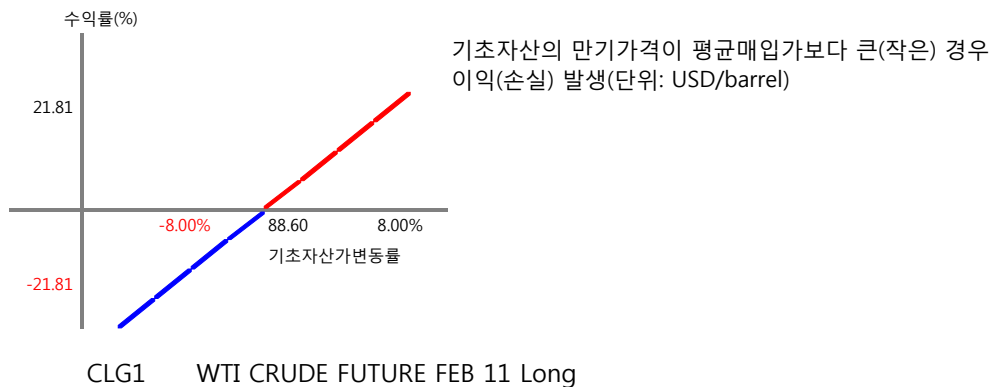
공시일: 2011-01-28

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]

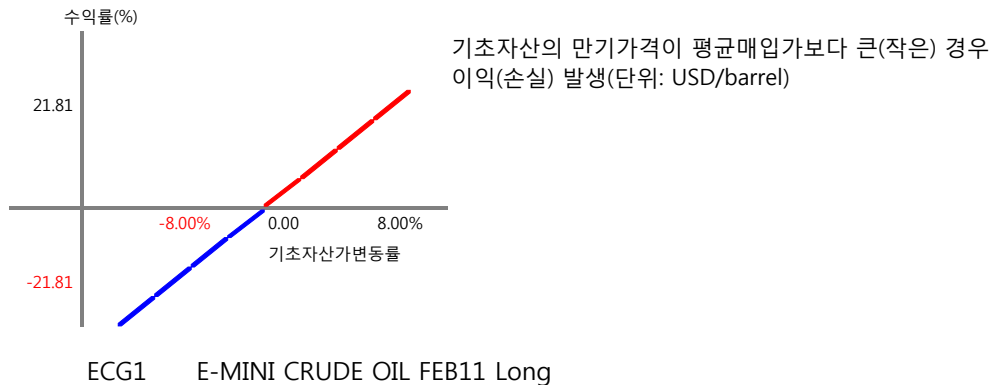
공시일: 2011-01-28

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

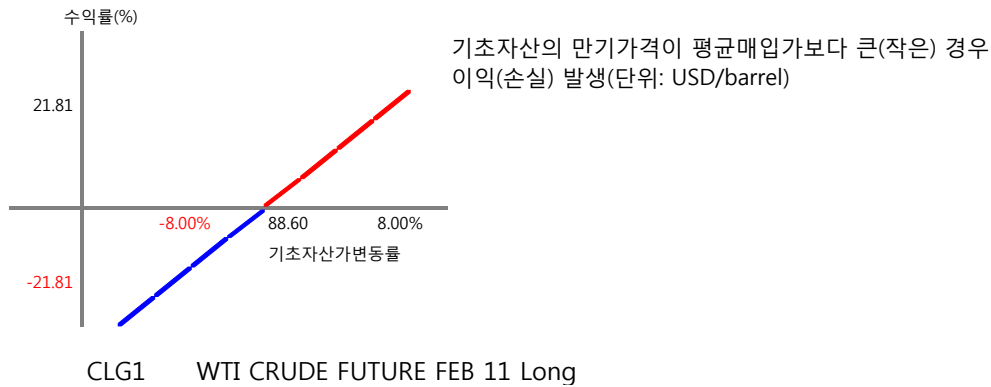
공시일: 2011-01-28

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% | 271.73 |
| | 5.33% | 181.04 |
| | 2.67% | 90.69 |
| 시나리오 | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -90.69 |
| | -5.33% | -181.04 |
| | -8.00% | -271.73 |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -271.73 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|----------|
| 위험액 | 1,081.14 |
|-----|----------|

메리츠PremiumCommodity특별자산1

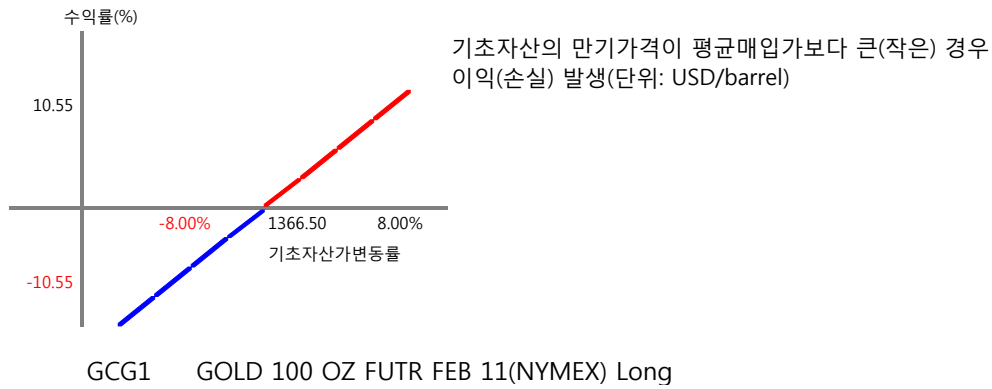
공시일: 2011-01-28

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

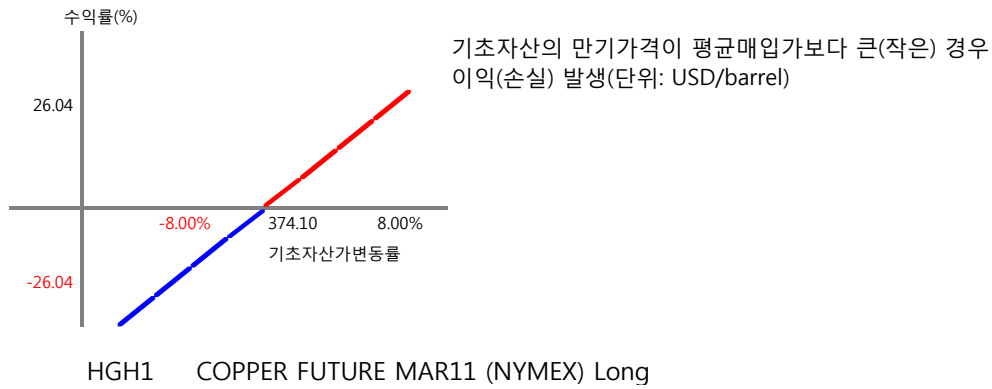
공시일: 2011-01-28

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

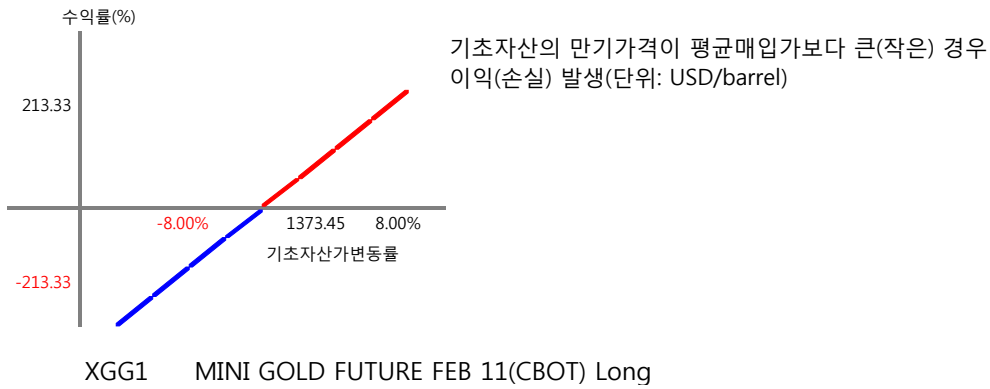
공시일: 2011-01-28

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]

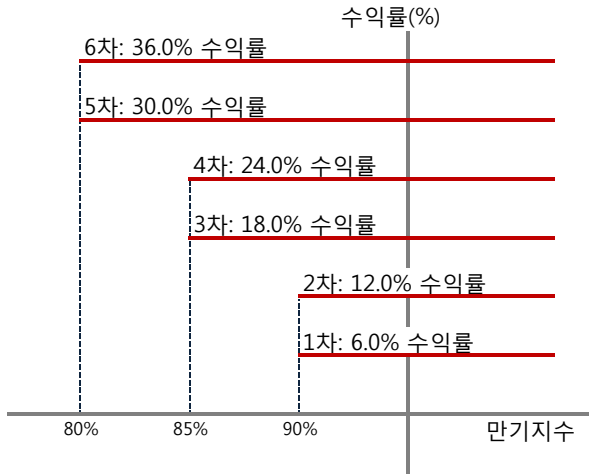
공시일: 2011-01-28

1. 계약금액

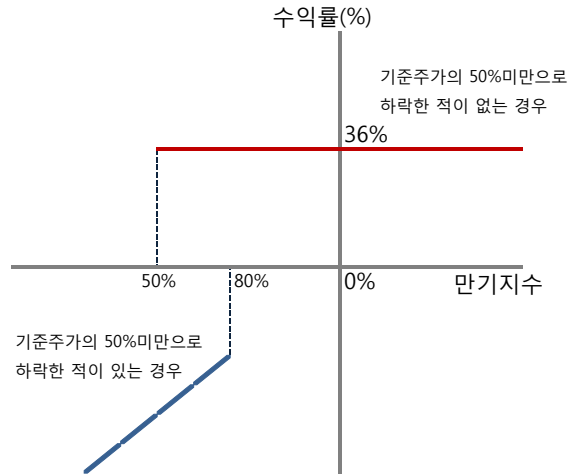
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,542 | 0 | 1,542 | 장외 |

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% | 60.95 | 52.81 | 44.67 | 36.53 | 28.39 | 20.25 | 12.11 |
| | 5.33% | 52.98 | 44.84 | 36.70 | 28.56 | 20.41 | 12.27 | 4.13 |
| | 2.67% | 40.80 | 32.66 | 24.52 | 16.38 | 8.24 | 0.10 | (8.04) |
| | 0.00% | 24.42 | 16.28 | 8.14 | 0.00 | (8.14) | (16.28) | (24.42) |
| | -2.67% | 3.84 | (4.30) | (12.44) | (20.58) | (28.72) | (36.86) | (45.00) |
| | -5.33% | (20.94) | (29.08) | (37.22) | (45.36) | (53.50) | (61.65) | (69.79) |
| | -8.00% | (49.92) | (58.07) | (66.21) | (74.35) | (82.49) | (90.63) | (98.77) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|---------------|---------|
| KR6502348032 | 신한투자(ELS)1408 | 98.77 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 98.77 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 99.19 |
|-----|-------|

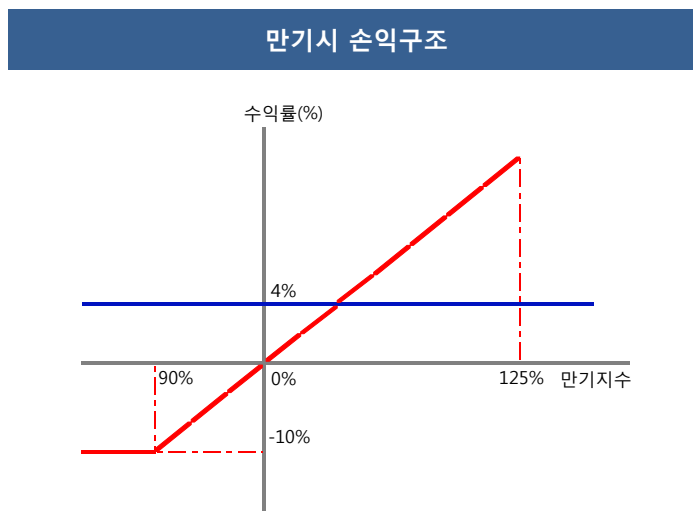
메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

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% | (34.55) | (35.63) | (36.71) | (37.79) | (38.87) | (39.95) | (41.04) |
| | 5.33% | (20.49) | (21.57) | (22.65) | (23.73) | (24.81) | (25.89) | (26.97) |
| | 2.67% | (7.89) | (8.97) | (10.05) | (11.13) | (12.21) | (13.29) | (14.38) |
| | 0.00% | 3.24 | 2.16 | 1.08 | 0.00 | (1.08) | (2.16) | (3.24) |
| | -2.67% | 12.91 | 11.83 | 10.75 | 9.67 | 8.59 | 7.51 | 6.42 |
| | -5.33% | 21.11 | 20.03 | 18.95 | 17.87 | 16.79 | 15.71 | 14.63 |
| | -8.00% | 27.85 | 26.77 | 25.69 | 24.61 | 23.53 | 22.44 | 21.36 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|---------------|--------------|
| KR6503339048 | 신한투자(ELS)1447 | 41.04 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 41.04 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 43.14 |
|-----|-------|

메리츠한증지수연계증권제9호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

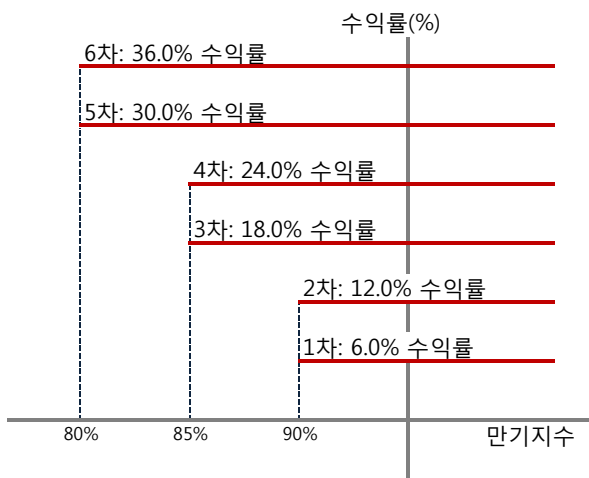
1. 계약금액

단위(백만원)

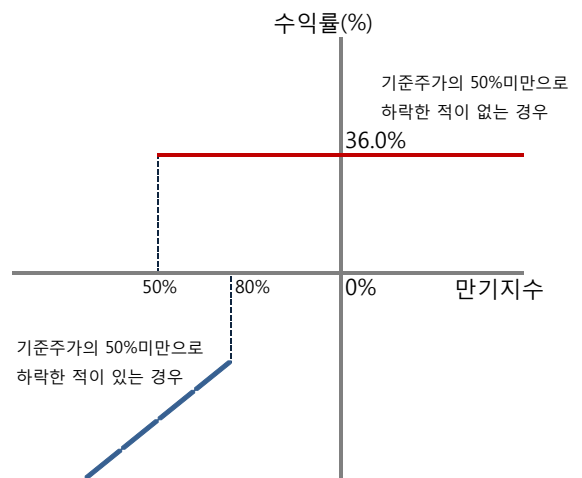
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 2,686 | 0 | 2,686 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,686 | 0 | 2,686 | 장외 |

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: 2011-01-28

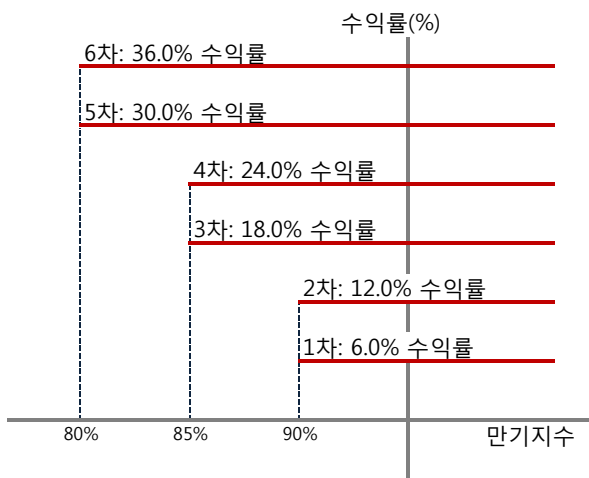
1. 계약금액

단위(백만원)

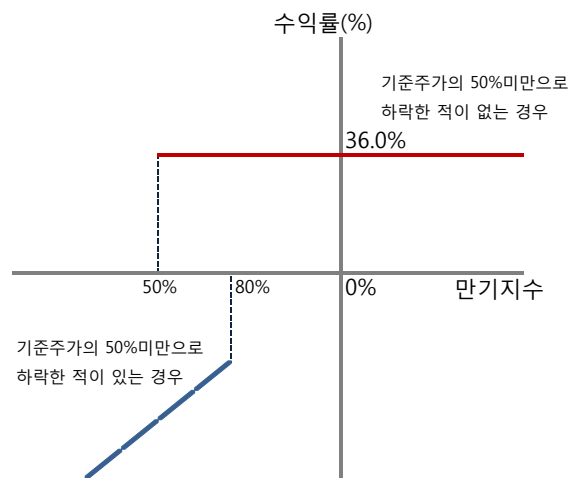
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 512 | 0 | 512 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 512 | 0 | 512 | 장외 |

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 | 27.41 | 25.90 | 24.40 | 22.90 | 21.40 | 19.90 | 18.40 | |
| 자산 | 19.95 | 18.45 | 16.95 | 15.45 | 13.95 | 12.45 | 10.95 | |
| 시나 | 12.32 | 10.82 | 9.32 | 7.82 | 6.31 | 4.81 | 3.31 | |
| 리오 | 0.00% | 3.00 | 1.50 | 0.00 | (1.50) | (3.00) | (4.50) | |
| | -2.67% | (3.49) | (4.99) | (6.50) | (8.00) | (9.50) | (11.00) | |
| | -5.33% | (11.67) | (13.17) | (14.67) | (16.17) | (17.68) | (19.18) | |
| | -8.00% | (20.03) | (21.53) | (23.03) | (24.53) | (26.04) | (27.54) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR65293A8084 | 대우증권(ELS)4375 | 29.04 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 29.04 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 38.25

메리츠2Star증권LESF-12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

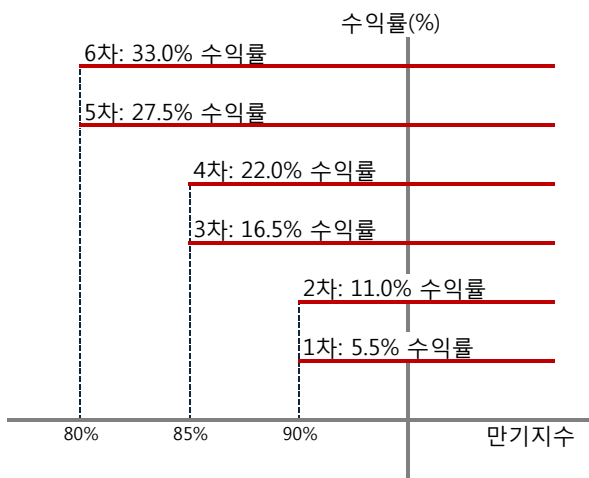
1. 계약금액

단위(백만원)

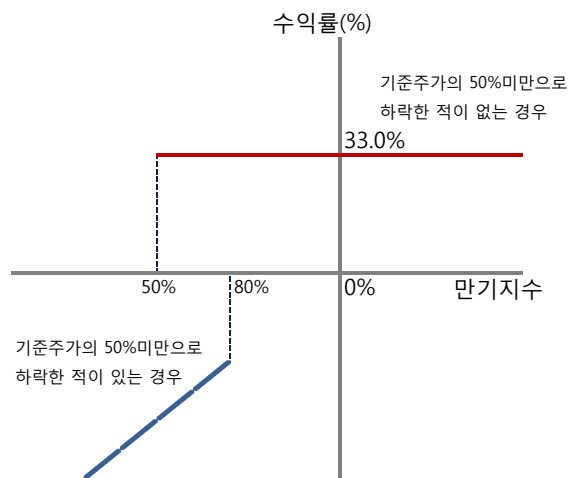
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 851 | 0 | 851 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 851 | 0 | 851 | 장외 |

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% | (2.24) | (3.00) | (3.76) | (4.52) | (5.27) | (6.03) | (6.79) |
| 자산 | 5.33% | 1.48 | 0.73 | (0.03) | (0.79) | (1.55) | (2.31) | (3.06) |
| 사 | 2.67% | 2.99 | 2.23 | 1.47 | 0.72 | (0.04) | (0.80) | (1.56) |
| 나 | 0.00% | 2.27 | 1.52 | 0.76 | 0.00 | (0.76) | (1.52) | (2.27) |
| 리 | -2.67% | (0.66) | (1.42) | (2.18) | (2.94) | (3.69) | (4.45) | (5.21) |
| 오 | -5.33% | (5.82) | (6.58) | (7.33) | (8.09) | (8.85) | (9.61) | (10.37) |
| 시 | -8.00% | (13.19) | (13.95) | (14.71) | (15.47) | (16.23) | (16.98) | (17.74) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR6542302098 | 신영증권(ELS)1714 | 17.74 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 17.74 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 9.46

메리츠2Star증권LESF-13호 [ELS-파생형]

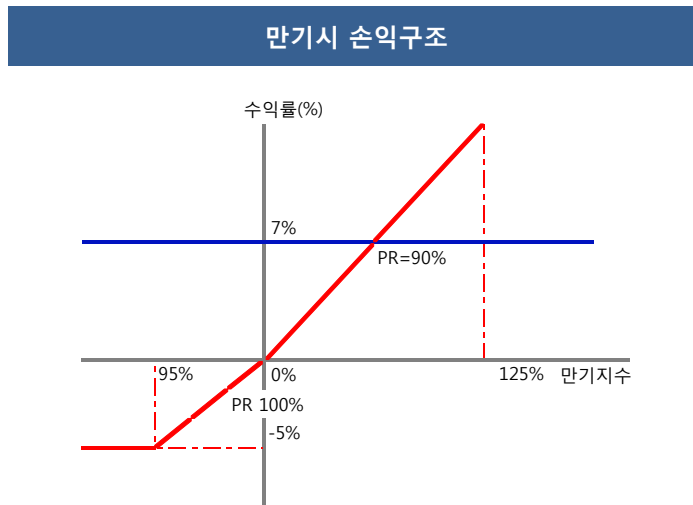
공시일: 2011-01-28

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% | (2.01) | (3.35) | (4.69) | (6.04) | (7.38) | (8.72) | (10.07) |
| | 5.33% | 0.96 | (0.38) | (1.73) | (3.07) | (4.41) | (5.76) | (7.10) |
| | 2.67% | 2.97 | 1.63 | 0.28 | (1.06) | (2.40) | (3.74) | (5.09) |
| | 0.00% | 4.03 | 2.69 | 1.34 | 0.00 | (1.34) | (2.69) | (4.03) |
| | -2.67% | 4.13 | 2.79 | 1.45 | 0.10 | (1.24) | (2.58) | (3.92) |
| | -5.33% | 3.28 | 1.94 | 0.59 | (0.75) | (2.09) | (3.43) | (4.78) |
| | -8.00% | 1.47 | 0.13 | (1.21) | (2.55) | (3.90) | (5.24) | (6.58) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|---------------|---------|
| KR6503337091 | 신한투자(ELS)1781 | 10.07 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 10.07 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 5.90 |
|-----|------|

메리츠2Star증권LESF-14호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

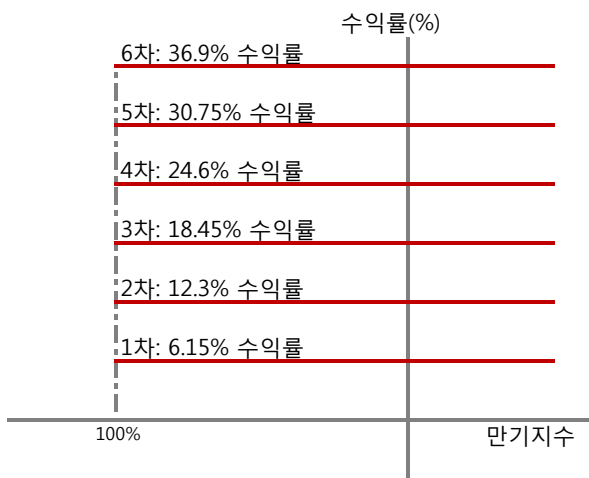
1. 계약금액

단위(백만원)

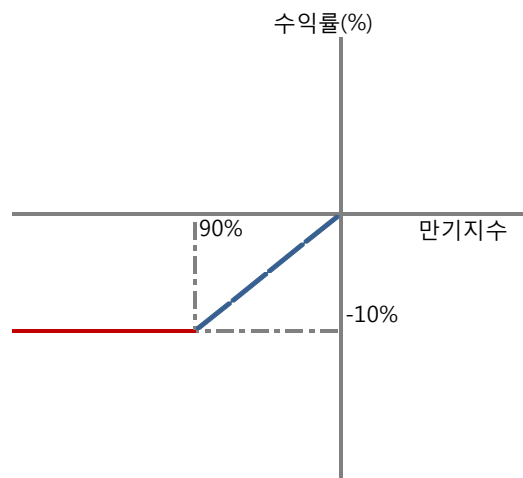
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,271 | 0 | 1,271 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,271 | 0 | 1,271 | 장외 |

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% | 60.07 | 57.37 | 54.66 | 51.95 | 49.25 | 46.54 | 43.83 |
| | 5.33% | 45.03 | 42.32 | 39.62 | 36.91 | 34.20 | 31.50 | 28.79 |
| | 2.67% | 27.71 | 25.01 | 22.30 | 19.59 | 16.89 | 14.18 | 11.47 |
| | 0.00% | 8.12 | 5.41 | 2.71 | 0.00 | (2.71) | (5.41) | (8.12) |
| | -2.67% | (13.75) | (16.45) | (19.16) | (21.87) | (24.57) | (27.28) | (29.99) |
| | -5.33% | (37.89) | (40.60) | (43.30) | (46.01) | (48.72) | (51.43) | (54.13) |
| | -8.00% | (64.31) | (67.02) | (69.72) | (72.43) | (75.14) | (77.84) | (80.55) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-------------|-------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 80.55 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 80.55 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 90.85

메리츠2Star증권SEPO-5호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

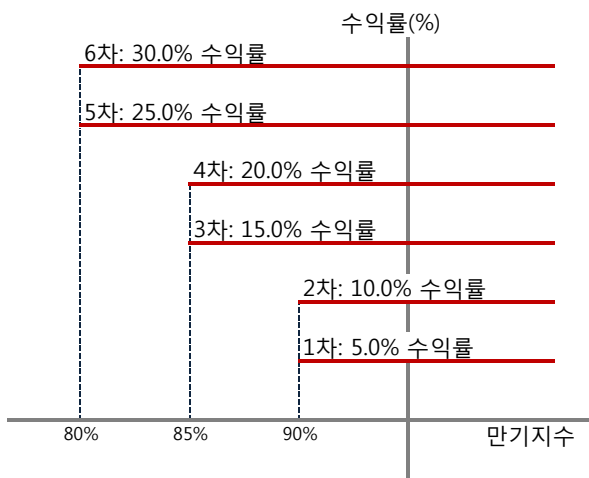
1. 계약금액

단위(백만원)

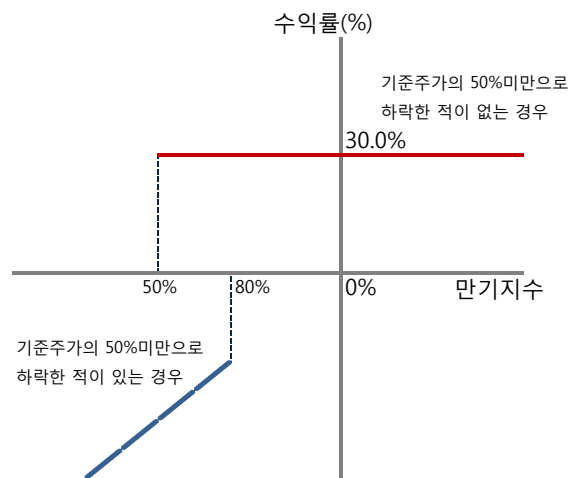
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,834 | 0 | 1,834 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,834 | 0 | 1,834 | 장외 |

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 | 32.81 | 27.93 | 23.04 | 18.16 | 13.27 | 8.39 | 3.50 | |
| 자산 | 29.93 | 25.04 | 20.16 | 15.27 | 10.38 | 5.50 | 0.61 | |
| 시나리오 | 23.87 | 18.99 | 14.10 | 9.22 | 4.33 | (0.55) | (5.44) | |
| 리오 | 14.66 | 9.77 | 4.89 | 0.00 | (4.89) | (9.77) | (14.66) | |
| | 2.27 | (2.61) | (7.50) | (12.38) | (17.27) | (22.15) | (27.04) | |
| | (13.27) | (18.16) | (23.04) | (27.93) | (32.81) | (37.70) | (42.59) | |
| | (31.98) | (36.87) | (41.75) | (46.64) | (51.53) | (56.41) | (61.30) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR65023590A6 | 신한투자(ELS)1851 | 61.30 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 61.30 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 95.89

메리츠한증지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

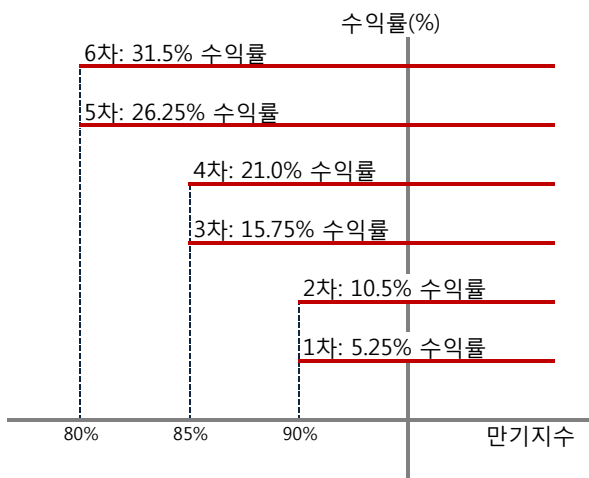
1. 계약금액

단위(백만원)

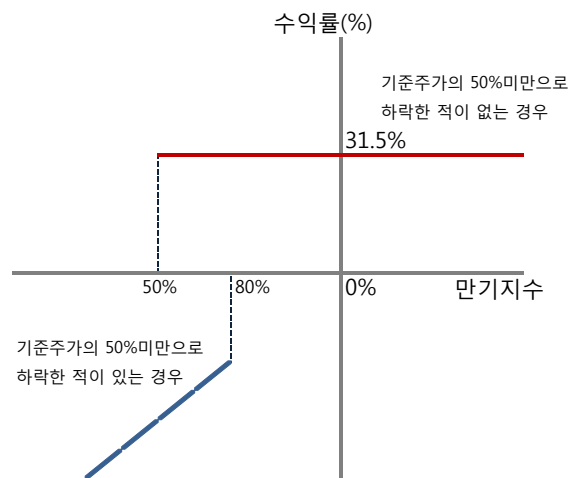
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,417 | 0 | 1,417 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,417 | 0 | 1,417 | 장외 |

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 | 8.53 | 6.70 | 4.88 | 3.05 | 1.22 | (0.61) | (2.44) | |
| 자산 | 9.28 | 7.45 | 5.62 | 3.80 | 1.97 | 0.14 | (1.69) | |
| 시나 | 8.27 | 6.44 | 4.61 | 2.78 | 0.95 | (0.88) | (2.71) | |
| 리오 | 0.00% | 5.49 | 3.66 | 1.83 | 0.00 | (1.83) | (3.66) | |
| | -2.67% | 0.94 | (0.89) | (2.71) | (4.54) | (6.37) | (8.20) | |
| | -5.33% | (5.36) | (7.19) | (9.02) | (10.85) | (12.68) | (14.51) | |
| | -8.00% | (13.43) | (15.26) | (17.09) | (18.92) | (20.75) | (22.58) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-----------------|-------|
| KR65533190B6 | 우리투자증권(ELS)3658 | 24.41 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 24.41 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 23.16

메리츠주가지수연계증권제6호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

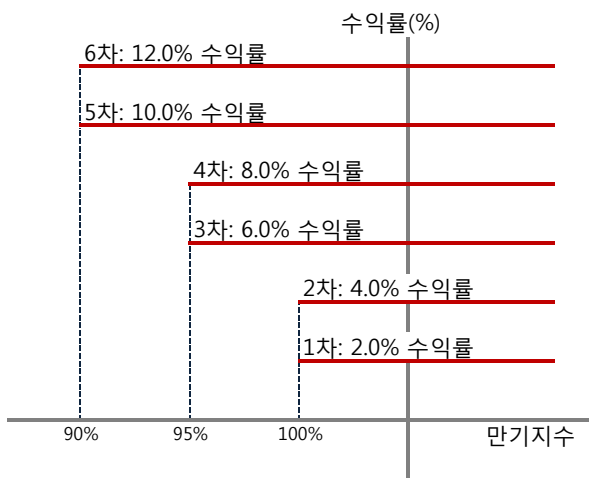
1. 계약금액

단위(백만원)

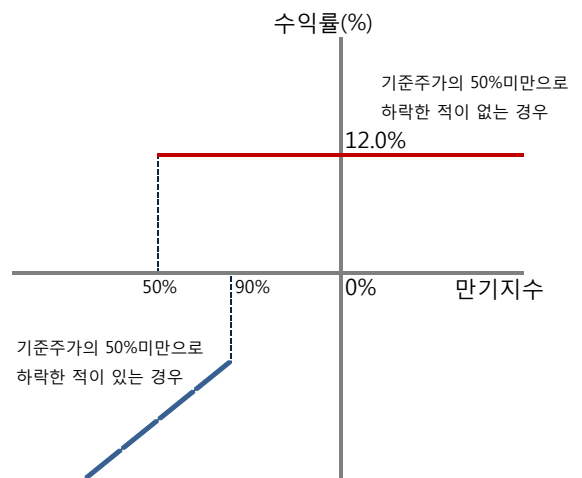
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |

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: 2011-01-28

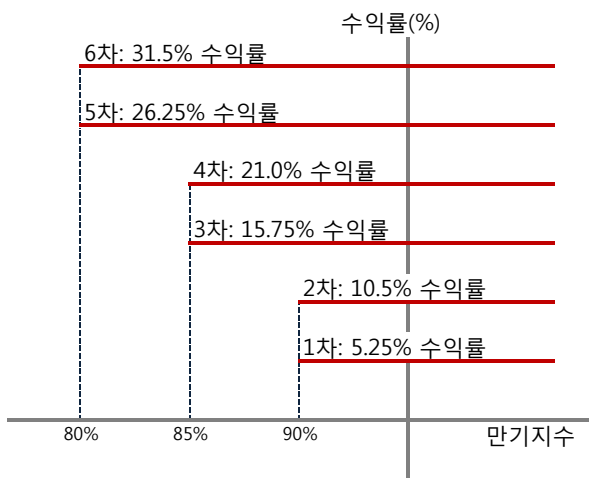
1. 계약금액

단위(백만원)

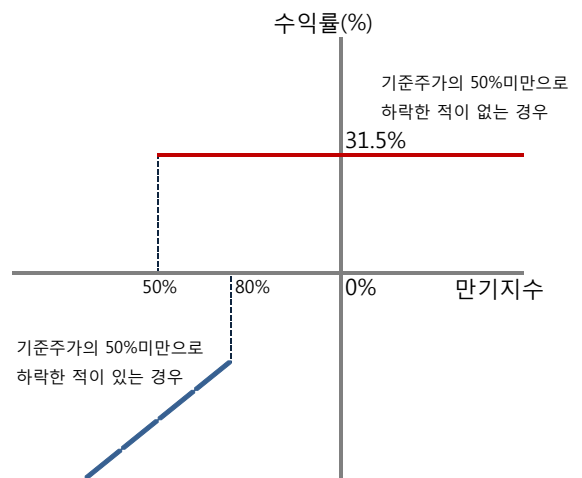
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,298 | 0 | 1,298 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,298 | 0 | 1,298 | 장외 |

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 | 11.13 | 9.14 | 7.15 | 5.16 | 3.17 | 1.18 | (0.80) | |
| 자산 | 10.97 | 8.99 | 7.00 | 5.01 | 3.02 | 1.03 | (0.96) | |
| 시나 | 9.25 | 7.27 | 5.28 | 3.29 | 1.30 | (0.69) | (2.68) | |
| 리오 | 0.00% | 3.98 | 1.99 | 0.00 | (1.99) | (3.98) | (5.97) | |
| | -2.67% | (0.88) | (2.87) | (4.86) | (6.84) | (8.83) | (10.82) | |
| | -5.33% | (5.31) | (7.30) | (9.29) | (11.28) | (13.27) | (15.26) | |
| | -8.00% | (13.30) | (15.29) | (17.28) | (19.27) | (21.26) | (23.25) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|-------|
| KR65033630B6 | 신한투자(ELS)1958 | 25.24 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 25.24 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 25.63

메리츠한증지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

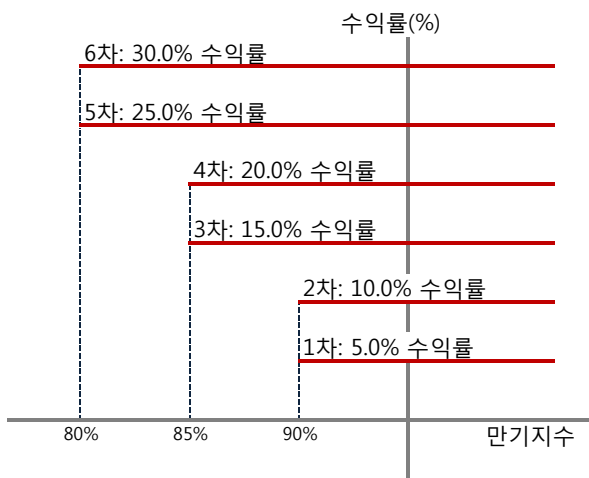
1. 계약금액

단위(백만원)

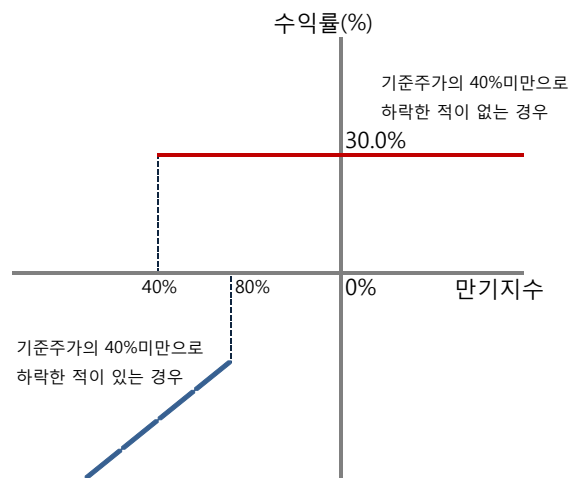
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,635 | 0 | 1,635 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,635 | 0 | 1,635 | 장외 |

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 | (4.22) | (2.55) | (0.71) | 1.32 | 3.54 | 5.94 | 8.53 | |
| 시나 | (4.66) | (3.00) | (1.15) | 0.88 | 3.10 | 5.50 | 8.09 | |
| 리오 | (5.10) | (3.44) | (1.59) | 0.44 | 2.66 | 5.06 | 7.65 | |
| | (5.54) | (3.88) | (2.03) | 0.00 | 2.22 | 4.62 | 7.21 | |
| | (5.98) | (4.32) | (2.47) | (0.44) | 1.78 | 4.18 | 6.77 | |
| | (6.42) | (4.76) | (2.91) | (0.88) | 1.33 | 3.74 | 6.33 | |
| | (6.86) | (5.20) | (3.36) | (1.32) | 0.89 | 3.30 | 5.88 | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|------|
| KR65433540B3 | 신영증권(ELS)1854 | 6.86 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 6.86 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 8.77

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

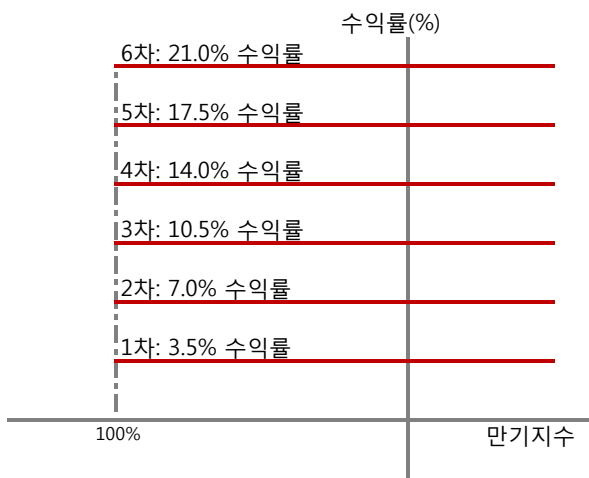
1. 계약금액

단위(백만원)

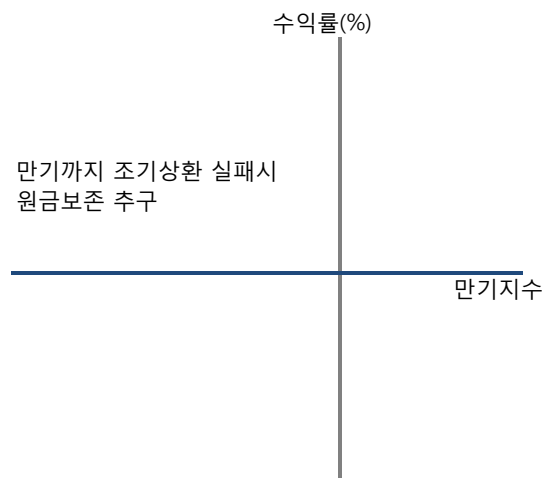
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 881 | 0 | 881 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 881 | 0 | 881 | 장외 |

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 | 28.44 | 27.36 | 26.28 | 25.20 | 24.12 | 23.04 | 21.96 | |
| 자산 | 20.12 | 19.04 | 17.95 | 16.87 | 15.79 | 14.71 | 13.63 | |
| 시나리오 | 11.72 | 10.64 | 9.55 | 8.47 | 7.39 | 6.31 | 5.23 | |
| | 0.00% | 3.24 | 2.16 | 1.08 | 0.00 | (1.08) | (2.16) | (3.24) |
| | -2.67% | (5.30) | (6.38) | (7.46) | (8.55) | (9.63) | (10.71) | (11.79) |
| | -5.33% | (13.92) | (15.00) | (16.08) | (17.16) | (18.24) | (19.32) | (20.41) |
| | -8.00% | (22.61) | (23.69) | (24.77) | (25.85) | (26.93) | (28.01) | (29.10) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-----------------|-------|
| KR65523460C3 | 우리투자증권(ELS)3756 | 29.10 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 29.10 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 31.04

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

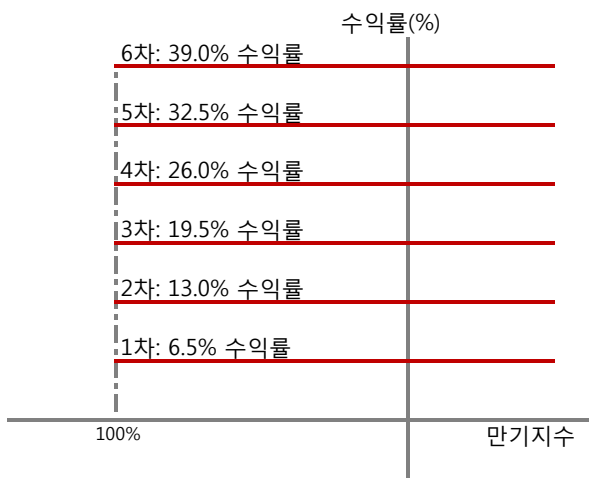
1. 계약금액

단위(백만원)

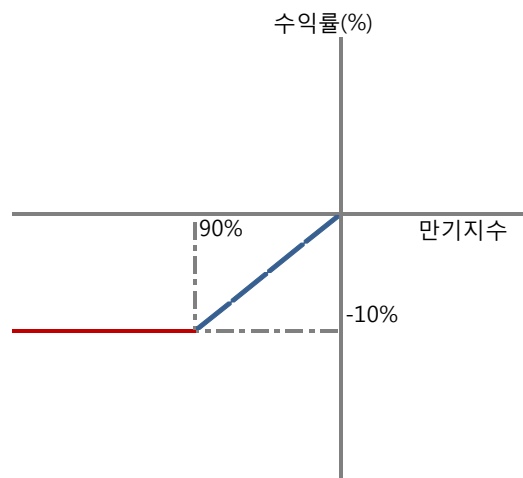
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 864 | 0 | 864 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 864 | 0 | 864 | 장외 |

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 | 45.80 | 43.72 | 41.65 | 39.57 | 37.50 | 35.42 | 33.35 | |
| 자산 | 33.00 | 30.93 | 28.85 | 26.78 | 24.70 | 22.63 | 20.56 | |
| 시나 | 19.81 | 17.74 | 15.66 | 13.59 | 11.51 | 9.44 | 7.37 | |
| 리오 | 0.00% | 4.15 | 2.07 | 0.00 | (2.07) | (4.15) | (6.22) | |
| | -2.67% | (7.76) | (9.84) | (11.91) | (13.99) | (16.06) | (18.14) | |
| | -5.33% | (22.15) | (24.22) | (26.30) | (28.37) | (30.45) | (32.52) | |
| | -8.00% | (36.93) | (39.01) | (41.08) | (43.16) | (45.23) | (47.30) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-----------------|-------|
| KR65523450C4 | 우리투자증권(ELS)3755 | 49.38 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 49.38 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 52.06

메리츠2Star증권SEST-44호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

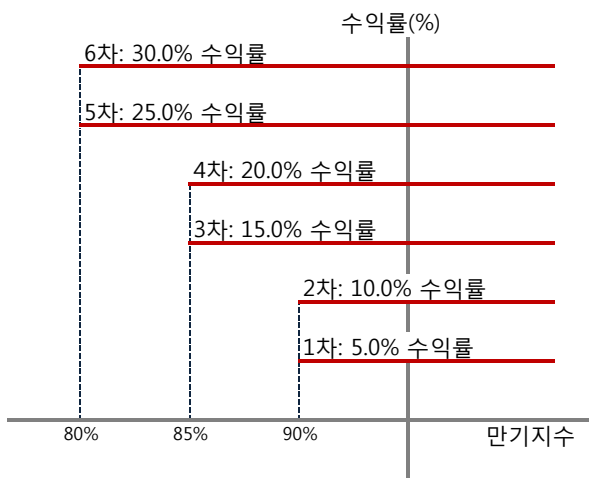
1. 계약금액

단위(백만원)

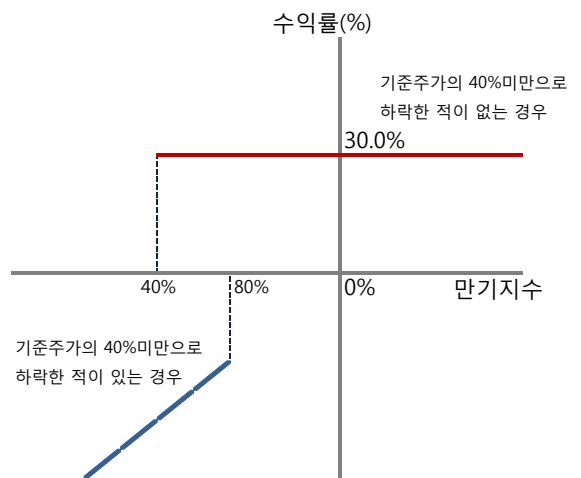
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,347 | 0 | 1,347 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,347 | 0 | 1,347 | 장외 |

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% | (2.95) | (3.33) | (3.72) | (4.10) | (4.49) | (4.87) | (5.25) |
| 자산 | 5.33% | (1.51) | (1.89) | (2.28) | (2.66) | (3.05) | (3.43) | (3.81) |
| 시나 | 2.67% | (0.14) | (0.53) | (0.91) | (1.29) | (1.68) | (2.06) | (2.45) |
| 리오 | 0.00% | 1.15 | 0.77 | 0.38 | 0.00 | (0.38) | (0.77) | (1.15) |
| | -2.67% | 2.37 | 1.99 | 1.61 | 1.22 | 0.84 | 0.45 | 0.07 |
| | -5.33% | 3.52 | 3.14 | 2.75 | 2.37 | 1.99 | 1.60 | 1.22 |
| | -8.00% | 4.60 | 4.21 | 3.83 | 3.45 | 3.06 | 2.68 | 2.29 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|------|
| KR65033AD0C3 | 신한투자(ELS)2106 | 5.25 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 5.25 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 7.80

메리츠2Star증권SEST-47호[ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

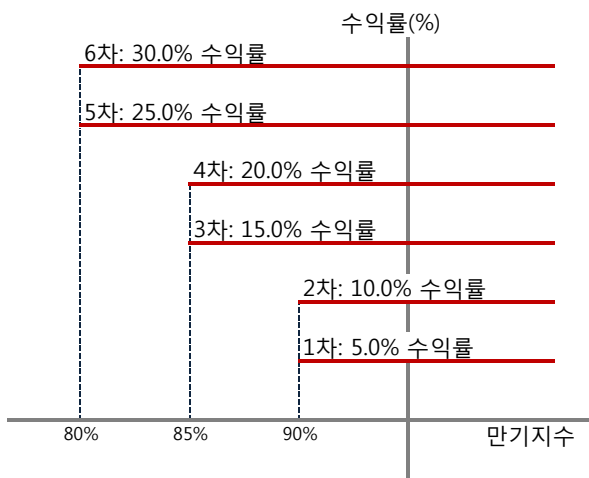
1. 계약금액

단위(백만원)

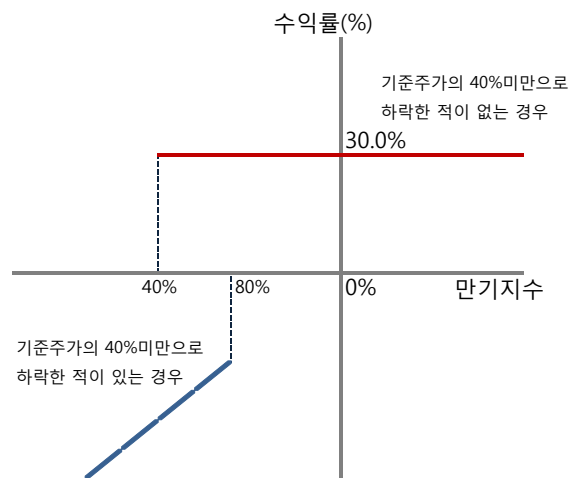
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,347 | 0 | 1,347 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,347 | 0 | 1,347 | 장외 |

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% | (2.95) | (3.33) | (3.72) | (4.10) | (4.49) | (4.87) | (5.25) |
| 자산 | 5.33% | (1.51) | (1.89) | (2.28) | (2.66) | (3.05) | (3.43) | (3.81) |
| 시나 | 2.67% | (0.14) | (0.53) | (0.91) | (1.29) | (1.68) | (2.06) | (2.45) |
| 리오 | 0.00% | 1.15 | 0.77 | 0.38 | 0.00 | (0.38) | (0.77) | (1.15) |
| | -2.67% | 2.37 | 1.99 | 1.61 | 1.22 | 0.84 | 0.45 | 0.07 |
| | -5.33% | 3.52 | 3.14 | 2.75 | 2.37 | 1.99 | 1.60 | 1.22 |
| | -8.00% | 4.60 | 4.21 | 3.83 | 3.45 | 3.06 | 2.68 | 2.29 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|---------------|------|
| KR65033AD0C3 | 신한투자(ELS)2106 | 5.25 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 5.25 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 7.80

메리츠2Star증권SEST-51호 [ELS-파생형]

공시일: 2011-01-28

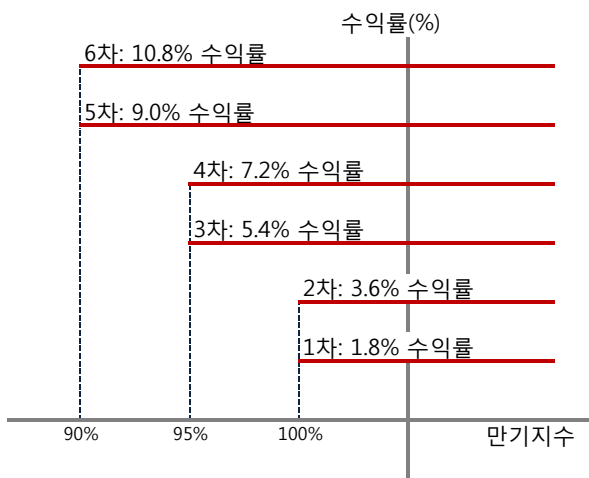
1. 계약금액

단위(백만원)

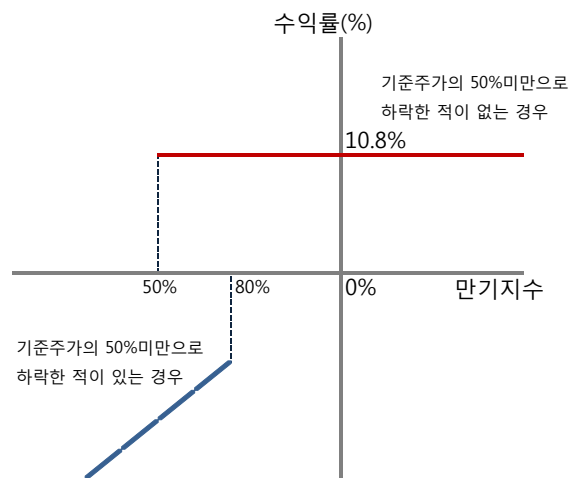
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,000 | 0 | 5,000 | 장외 |

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% | 6.29 | 6.51 | 6.73 | 6.96 | 7.18 | 7.40 | 7.63 |
| 자산 | 5.33% | (0.93) | (0.71) | (0.48) | (0.26) | (0.04) | 0.18 | 0.41 |
| 시나 | 2.67% | (3.25) | (3.02) | (2.80) | (2.58) | (2.36) | (2.13) | (1.91) |
| 리오 | 0.00% | (0.67) | (0.45) | (0.22) | 0.00 | 0.22 | 0.45 | 0.67 |
| | -2.67% | 6.81 | 7.03 | 7.26 | 7.48 | 7.70 | 7.92 | 8.15 |
| | -5.33% | 19.19 | 19.41 | 19.63 | 19.85 | 20.08 | 20.30 | 20.52 |
| | -8.00% | 36.46 | 36.68 | 36.91 | 37.13 | 37.35 | 37.57 | 37.80 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|-------------|------|
| KR65233AF0C9 | 대우증권ELS4907 | 3.25 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 3.25 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 38.40