

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

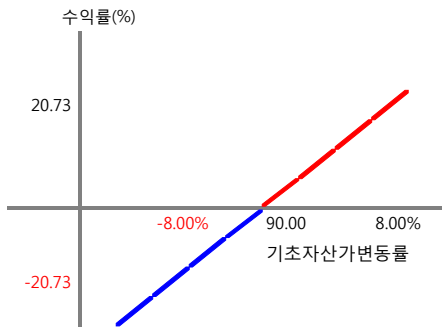
공시일: 2011-02-18

1. 계약금액

단위(백만원)

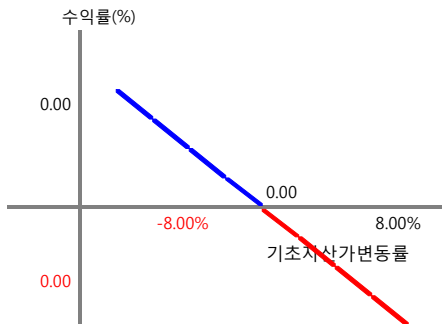
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

CLH1 WTI CRUDE FUTURE MAR 11 Long



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

3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLH1 WTI CRUDE FUTURE MAR 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나 리오	8.00%	20.73
	5.33%	13.81
	2.67%	6.92
	0.00%	0.00
	-2.67%	-6.92
	-5.33%	-13.81
	-8.00%	-20.73

최대손실 시나리오

위험액	-20.73
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	83.98
-----	-------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

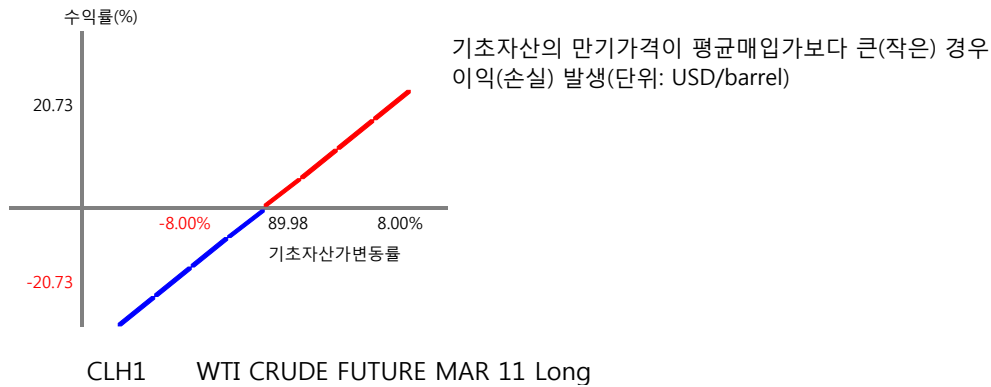
공시일: 2011-02-18

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))

CLH1 WTI CRUDE FUTURE MAR 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	41.45
	5.33%	27.62
	2.67%	13.84
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-13.84
	-5.33%	-27.62
	-8.00%	-41.45

최대손실 시나리오

위험액	-41.45
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	109.96
-----	--------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

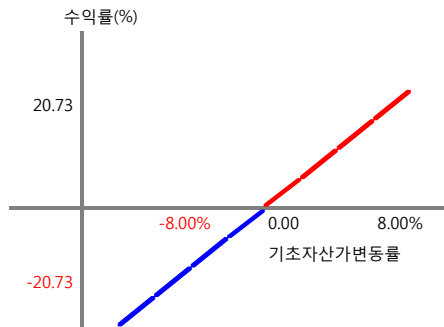
공시일: 2011-02-18

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)

ECH1 E-MINI CRUDE OIL MAR11 Long

메리츠PremiumCommodity특별자산1

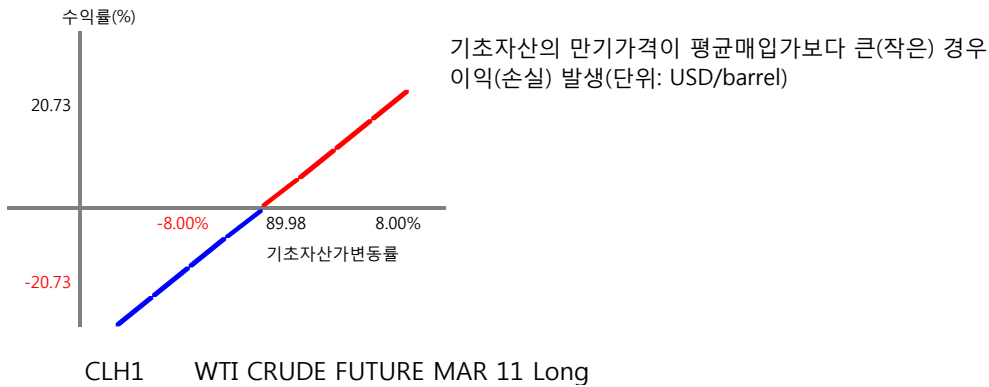
공시일: 2011-02-18

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))

CLH1 WTI CRUDE FUTURE MAR 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	278.86
	5.33%	185.79
	2.67%	93.07
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-93.07
	-5.33%	-185.79
	-8.00%	-278.86

최대손실 시나리오

위험액	-278.86
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,109.05
-----	----------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

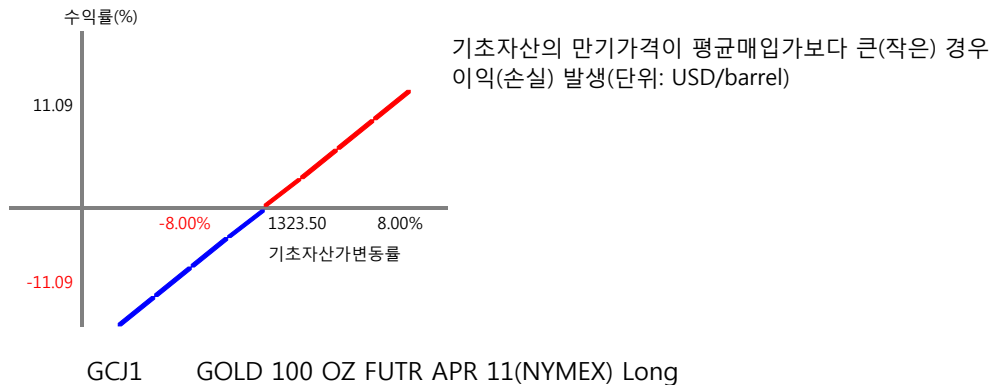
공시일: 2011-02-18

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

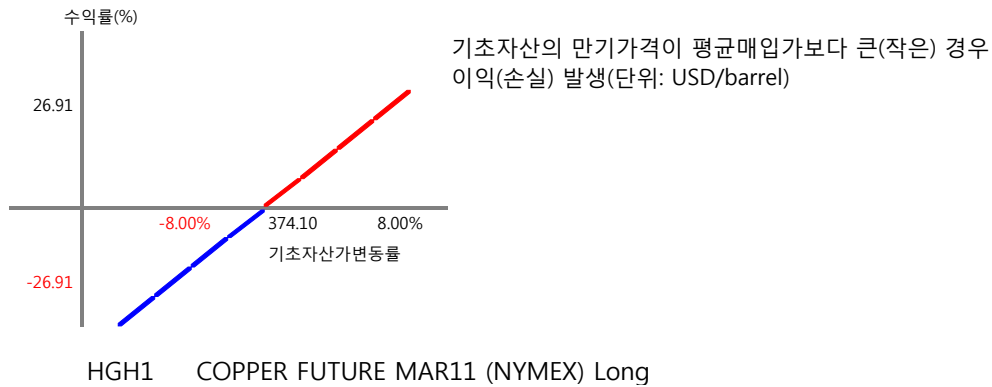
공시일: 2011-02-18

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

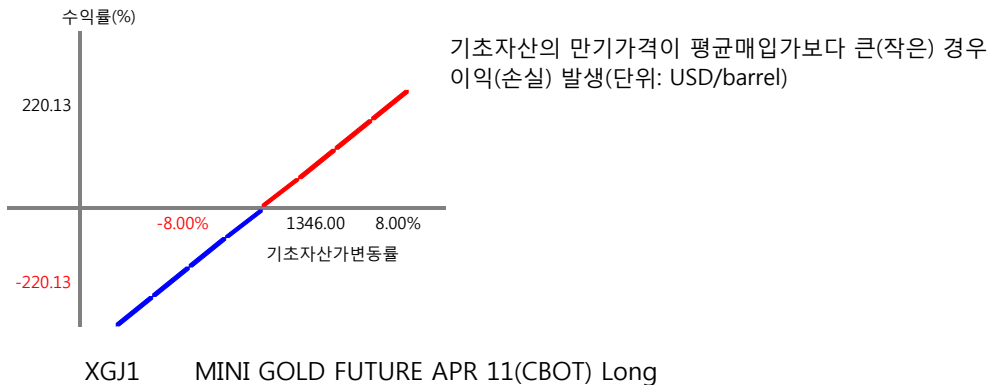
공시일: 2011-02-18

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]

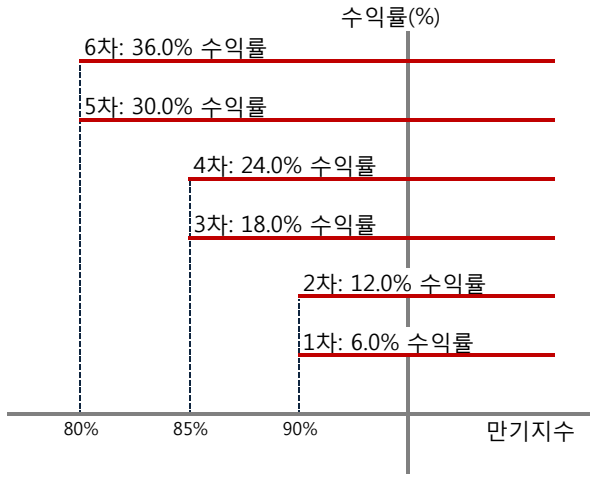
공시일: 2011-02-18

1. 계약금액

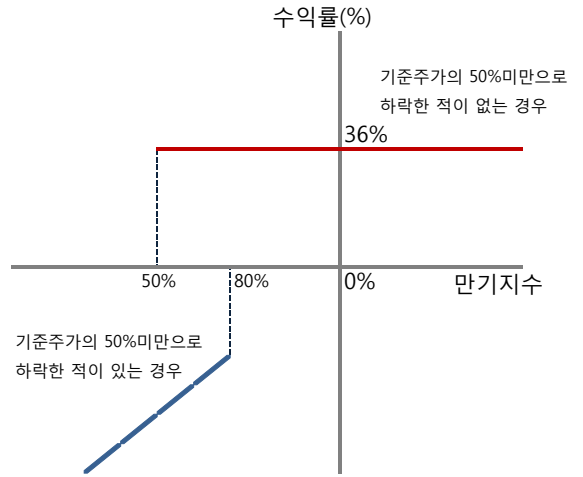
단위(백만원)						
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	37.13	30.80	24.46	18.13	11.79	5.46	(0.88)
	5.33%	35.79	29.45	23.12	16.78	10.45	4.11	(2.23)
	2.67%	29.74	23.41	17.07	10.74	4.40	(1.93)	(8.27)
	0.00%	19.01	12.67	6.34	0.00	(6.34)	(12.67)	(19.01)
	-2.67%	3.57	(2.76)	(9.10)	(15.43)	(21.77)	(28.11)	(34.44)
	-5.33%	(16.56)	(22.90)	(29.23)	(35.57)	(41.90)	(48.24)	(54.57)
	-8.00%	(41.39)	(47.72)	(54.06)	(60.39)	(66.73)	(73.07)	(79.40)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502348032	신한투자(ELS)1408	79.40
총 최대손실 예상금액		79.40

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	94.00
-----	-------

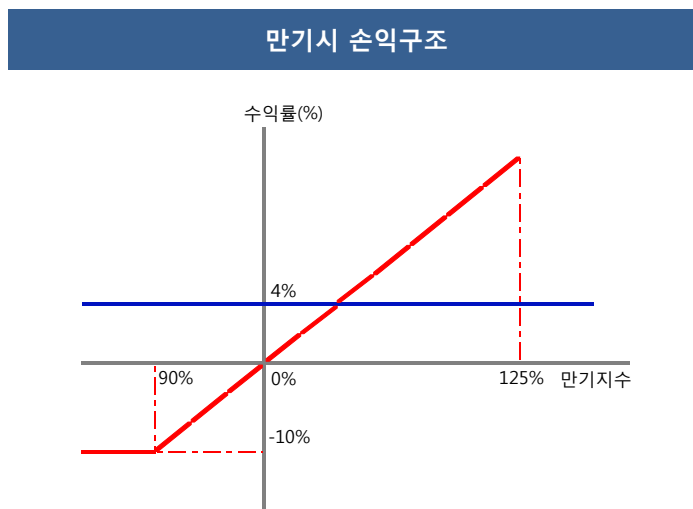
메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

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	8.00%	(29.92)	(33.00)	(36.08)	(39.16)	(42.24)	(45.32)	(48.39)
자산	5.33%	(12.74)	(15.82)	(18.90)	(21.98)	(25.06)	(28.14)	(31.22)
시나	2.67%	0.31	(2.77)	(5.85)	(8.93)	(12.01)	(15.09)	(18.17)
리오	0.00%	9.24	6.16	3.08	0.00	(3.08)	(6.16)	(9.24)
	-2.67%	14.05	10.97	7.89	4.81	1.73	(1.35)	(4.43)
	-5.33%	14.73	11.65	8.58	5.50	2.42	(0.66)	(3.74)
	-8.00%	11.30	8.22	5.14	2.06	(1.02)	(4.10)	(7.18)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503339048	신한투자(ELS)1447	48.39
총 최대손실 예상금액		48.39

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	18.09
-----	-------

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

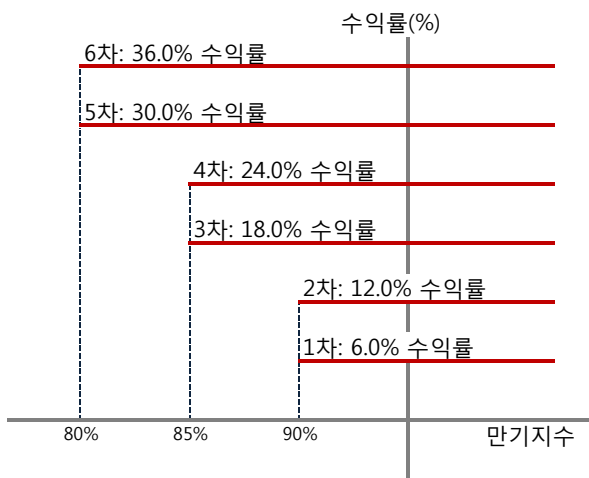
1. 계약금액

단위(백만원)

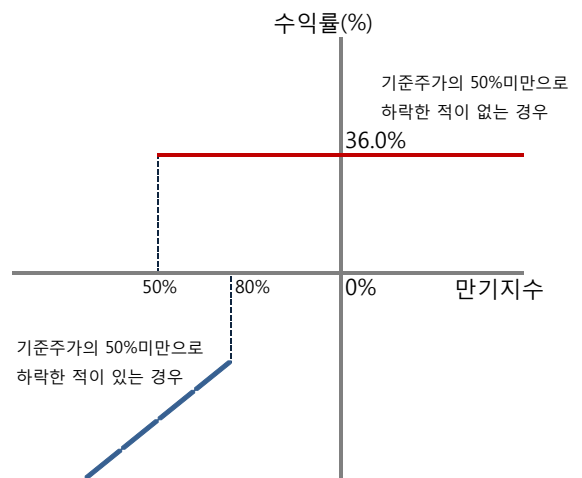
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	512	0	512	장외
누계	유가증권	선물	512	0	512	장외

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	25.32	23.53	21.75	19.96	18.17	16.39	14.60	
자산	18.81	17.03	15.24	13.45	11.66	9.88	8.09	
시나	12.16	10.37	8.58	6.80	5.01	3.22	1.43	
리오	0.00%	5.36	3.57	1.79	0.00	(1.79)	(3.57)	(5.36)
	-2.67%	(1.58)	(3.37)	(5.15)	(6.94)	(8.73)	(10.52)	(12.30)
	-5.33%	(8.66)	(10.45)	(12.24)	(14.03)	(15.81)	(17.60)	(19.39)
	-8.00%	(15.89)	(17.68)	(19.47)	(21.25)	(23.04)	(24.83)	(26.62)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293A8084	대우증권(ELS)4375	26.62
총 최대손실 예상금액		26.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 28.06

메리츠2Star증권LESF-12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

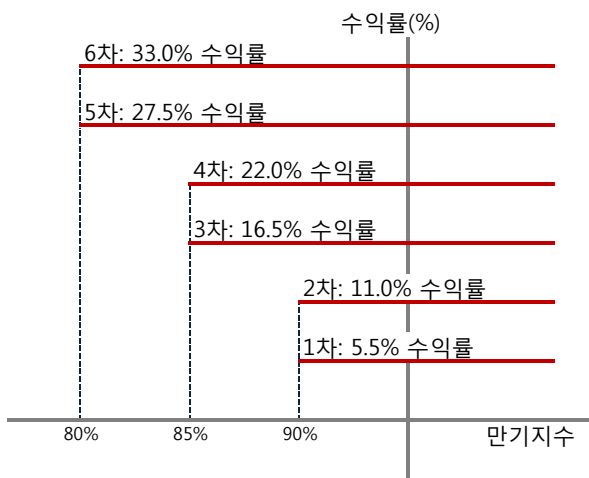
1. 계약금액

단위(백만원)

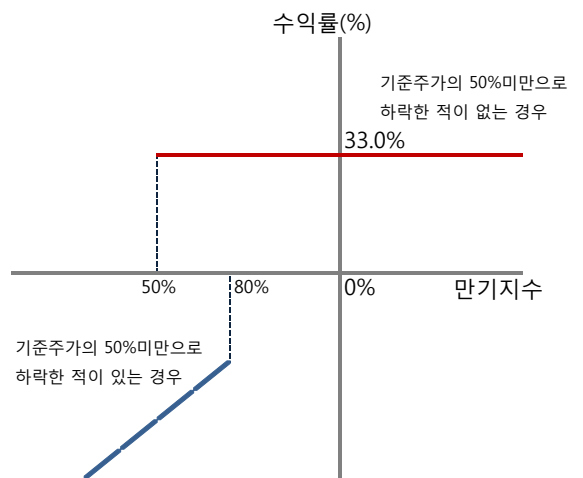
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	851	0	851	장외
누계	유가증권	선물	851	0	851	장외

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%	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)
자산	5.33%	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)
사	2.67%	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)
나	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
리	-2.67%	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)	(0.16)
오	-5.33%	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)	(0.62)
시	-8.00%	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)	(1.40)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6542302098	신영증권(ELS)1714	1.40
총 최대손실 예상금액		1.40

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권LESF-13호[ELS-파생형]

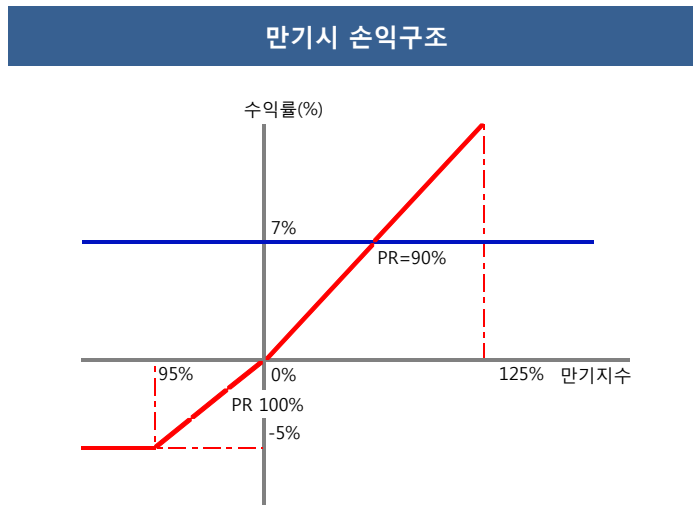
공시일: 2011-02-18

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%	8.35	6.75	5.15	3.55	1.95	0.36	(1.24)
	5.33%	8.03	6.44	4.84	3.24	1.64	0.04	(1.56)
	2.67%	6.85	5.25	3.65	2.05	0.46	(1.14)	(2.74)
	0.00%	4.80	3.20	1.60	0.00	(1.60)	(3.20)	(4.80)
	-2.67%	1.87	0.27	(1.33)	(2.93)	(4.52)	(6.12)	(7.72)
	-5.33%	(1.93)	(3.53)	(5.12)	(6.72)	(8.32)	(9.92)	(11.52)
	-8.00%	(6.59)	(8.19)	(9.79)	(11.39)	(12.99)	(14.59)	(16.19)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503337091	신한투자(ELS)1781	16.19
총 최대손실 예상금액		16.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.43
-----	-------

메리츠2Star증권LESF-14호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

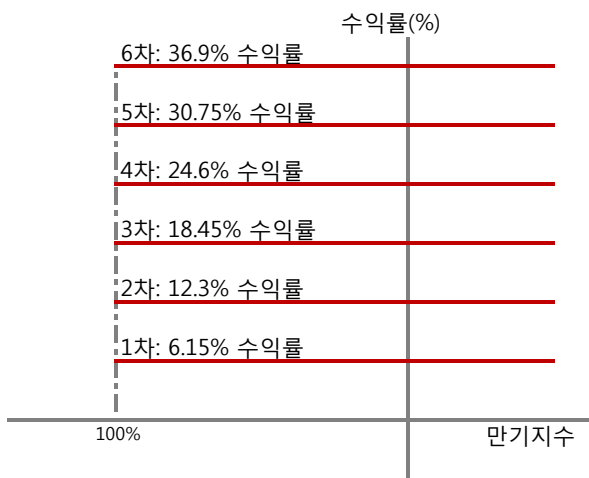
1. 계약금액

단위(백만원)

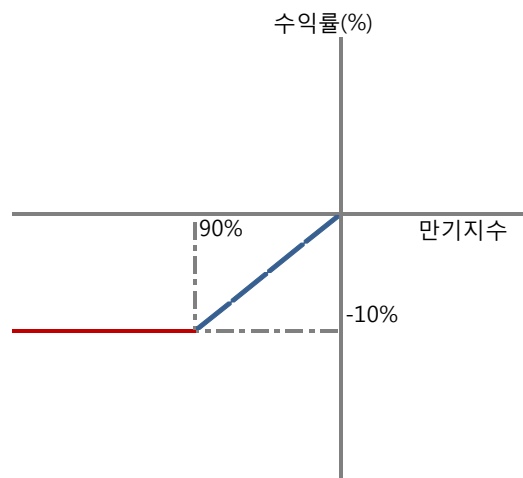
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,271	0	1,271	장외
누계	유가증권	선물	1,271	0	1,271	장외

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	111.42	107.73	104.04	100.34	96.65	92.96	89.26	
자산	75.54	71.85	68.16	64.46	60.77	57.08	53.38	
시나	42.10	38.40	34.71	31.02	27.32	23.63	19.93	
리오	11.08	7.39	3.69	0.00	(3.69)	(7.39)	(11.08)	
	(17.50)	(21.20)	(24.89)	(28.58)	(32.28)	(35.97)	(39.66)	
	(43.65)	(47.35)	(51.04)	(54.73)	(58.43)	(62.12)	(65.81)	
	(67.37)	(71.06)	(74.76)	(78.45)	(82.14)	(85.84)	(89.53)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293160A1	대우증권ELS4537	89.53
총 최대손실 예상금액		89.53

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 91.84

메리츠2Star증권SEPO-5호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

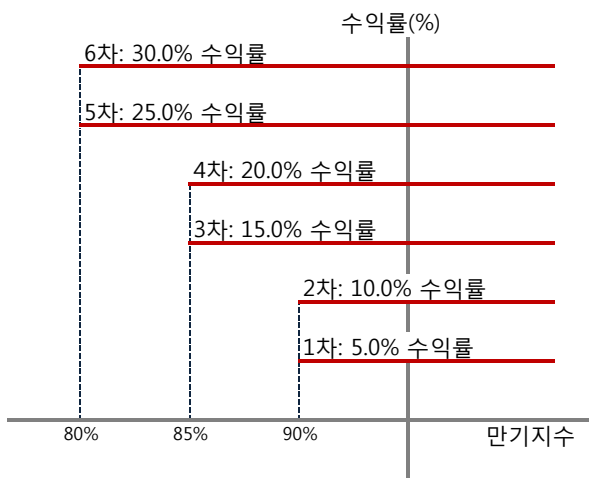
1. 계약금액

단위(백만원)

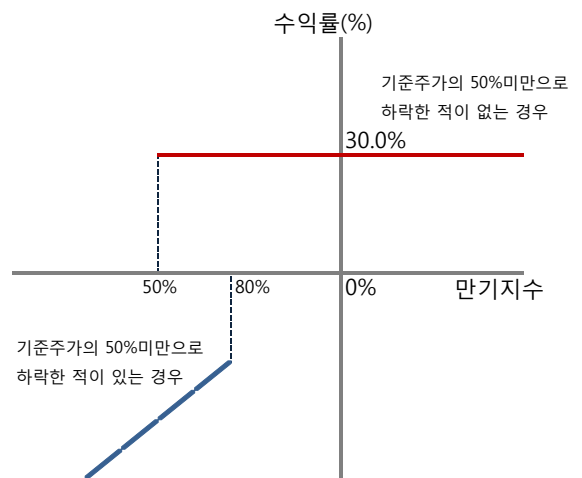
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장외
누계	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장외

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	4.13	2.04	(0.05)	(2.14)	(4.23)	(6.32)	(8.41)	
자산	7.94	5.85	3.76	1.67	(0.42)	(2.51)	(4.60)	
시나	8.66	6.57	4.47	2.38	0.29	(1.80)	(3.89)	
리오	0.00%	6.27	4.18	2.09	0.00	(2.09)	(4.18)	
	-2.67%	0.79	(1.30)	(3.39)	(5.48)	(7.57)	(9.66)	
	-5.33%	(7.79)	(9.88)	(11.97)	(14.06)	(16.15)	(18.24)	
	-8.00%	(19.46)	(21.55)	(23.64)	(25.73)	(27.82)	(29.91)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023590A6	신한투자(ELS)1851	32.00
총 최대손실 예상금액		32.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 31.06

메리츠한증지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

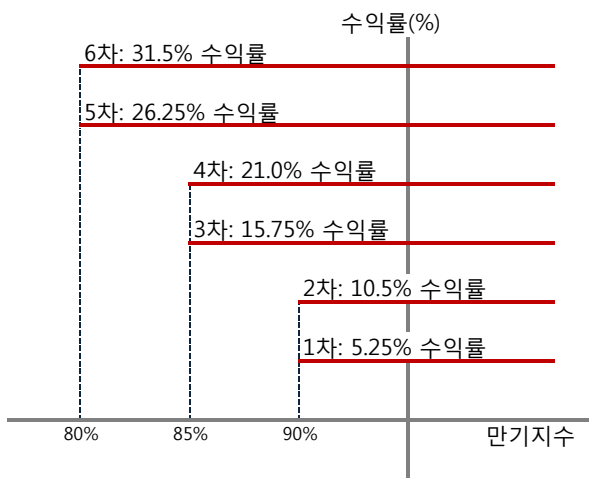
1. 계약금액

단위(백만원)

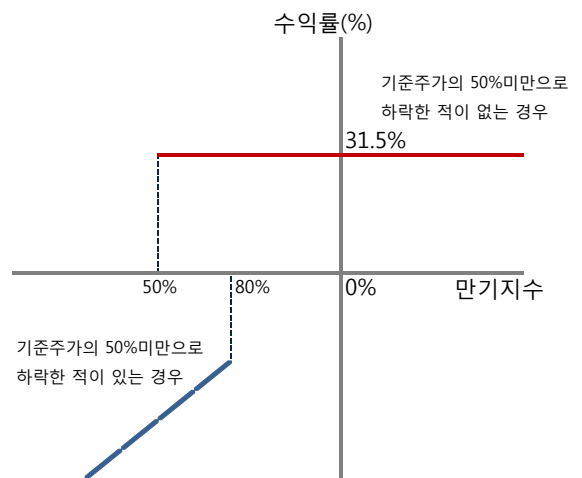
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,417	0	1,417	장외
누계	유가증권	선물	1,417	0	1,417	장외

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	8.00%	(2.22)	(3.51)	(4.81)	(6.10)	(7.39)	(8.69)	(9.98)
자산	5.33%	0.47	(0.82)	(2.11)	(3.41)	(4.70)	(5.99)	(7.29)
사	2.67%	2.51	1.21	(0.08)	(1.37)	(2.67)	(3.96)	(5.25)
나	0.00%	3.88	2.59	1.29	0.00	(1.29)	(2.59)	(3.88)
리	-2.67%	4.59	3.30	2.01	0.71	(0.58)	(1.87)	(3.16)
오	-5.33%	4.65	3.36	2.06	0.77	(0.52)	(1.82)	(3.11)
시	-8.00%	4.05	2.75	1.46	0.17	(1.13)	(2.42)	(3.71)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65533190B6	우리투자증권(ELS)3658	9.98
총 최대손실 예상금액		9.98

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 9.25

메리츠한증지수연계증권제11호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

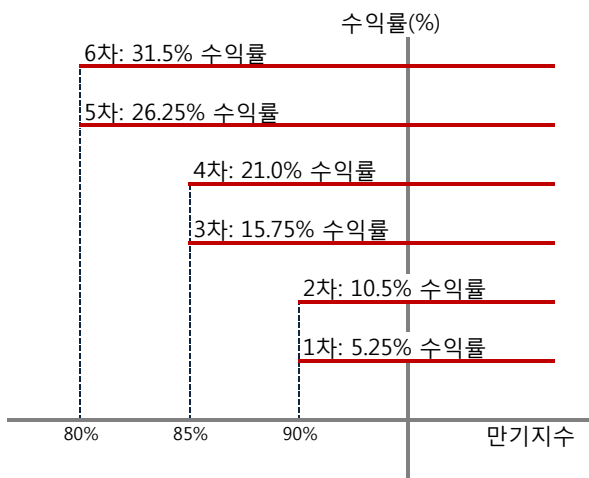
1. 계약금액

단위(백만원)

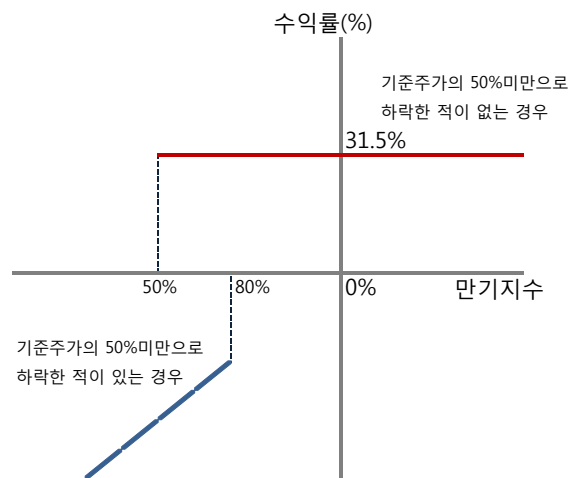
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,298	0	1,298	장외
누계	유가증권	선물	1,298	0	1,298	장외

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	8.00%	(0.09)	(1.78)	(3.48)	(5.18)	(6.88)	(8.58)	(10.27)
자산	5.33%	2.53	0.83	(0.87)	(2.57)	(4.27)	(5.96)	(7.66)
사	2.67%	4.25	2.55	0.86	(0.84)	(2.54)	(4.24)	(5.94)
나	0.00%	5.09	3.40	1.70	0.00	(1.70)	(3.40)	(5.09)
리	-2.67%	5.05	3.35	1.66	(0.04)	(1.74)	(3.44)	(5.14)
오	-5.33%	4.12	2.43	0.73	(0.97)	(2.67)	(4.37)	(6.07)
시	-8.00%	2.31	0.61	(1.09)	(2.78)	(4.48)	(6.18)	(7.88)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033630B6	신한투자(ELS)1958	10.27
총 최대손실 예상금액		10.27

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 4.97

메리츠한증지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

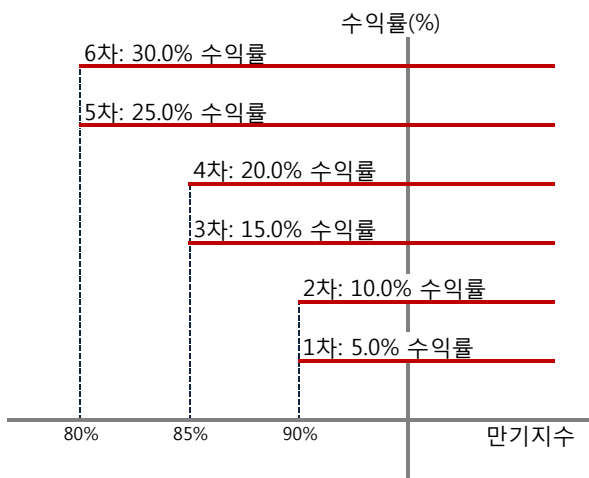
1. 계약금액

단위(백만원)

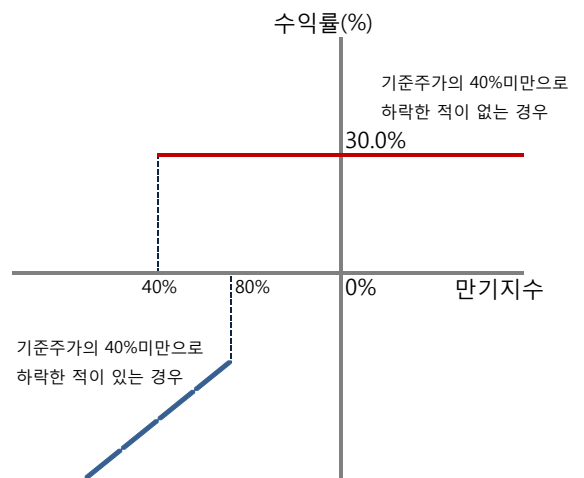
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,635	0	1,635	장외
누계	유가증권	선물	1,635	0	1,635	장외

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%	(3.08)	(3.04)	(3.01)	(2.97)	(2.93)	(2.90)	(2.86)
자산	5.33%	(3.81)	(3.78)	(3.74)	(3.70)	(3.67)	(3.63)	(3.59)
시나	2.67%	(2.82)	(2.79)	(2.75)	(2.71)	(2.68)	(2.64)	(2.60)
리오	0.00%	(0.11)	(0.07)	(0.04)	0.00	0.04	0.07	0.11
	-2.67%	4.32	4.36	4.40	4.43	4.47	4.51	4.55
	-5.33%	10.48	10.52	10.55	10.59	10.63	10.66	10.70
	-8.00%	18.36	18.39	18.43	18.47	18.51	18.54	18.58

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65433540B3	신영증권(ELS)1854	3.81
총 최대손실 예상금액		3.81

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 18.07

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

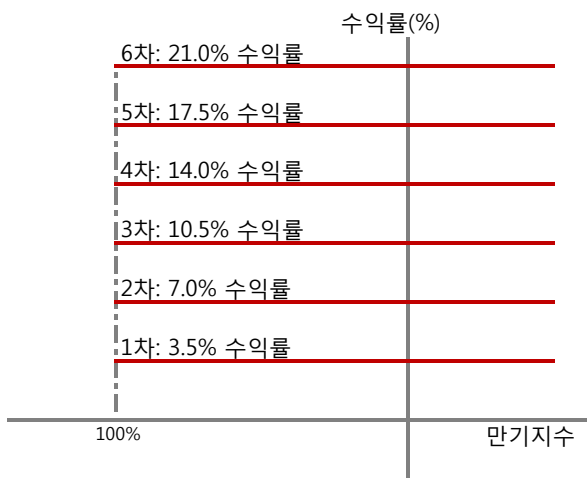
1. 계약금액

단위(백만원)

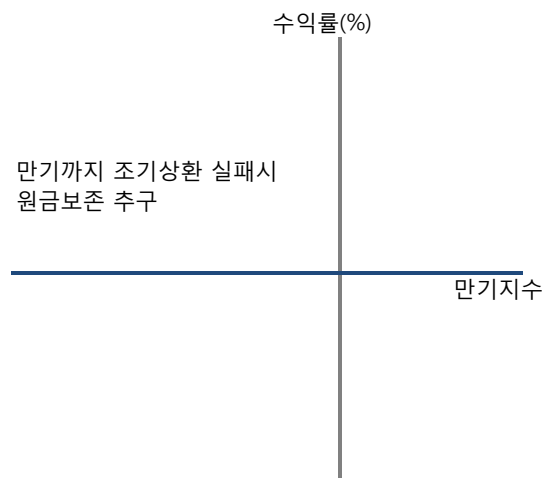
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	881	0	881	장외
누계	유가증권	선물	881	0	881	장외

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	32.06	30.92	29.77	28.63	27.48	26.34	25.19	
자산	21.83	20.68	19.54	18.40	17.25	16.11	14.96	
시나리오	12.29	11.14	10.00	8.85	7.71	6.57	5.42	
	0.00%	3.43	2.29	1.14	0.00	(1.14)	(2.29)	(3.43)
	-2.67%	(4.73)	(5.88)	(7.02)	(8.16)	(9.31)	(10.45)	(11.60)
	-5.33%	(12.21)	(13.35)	(14.50)	(15.64)	(16.78)	(17.93)	(19.07)
	-8.00%	(18.99)	(20.14)	(21.28)	(22.43)	(23.57)	(24.72)	(25.86)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	25.86
총 최대손실 예상금액		25.86

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 30.20

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

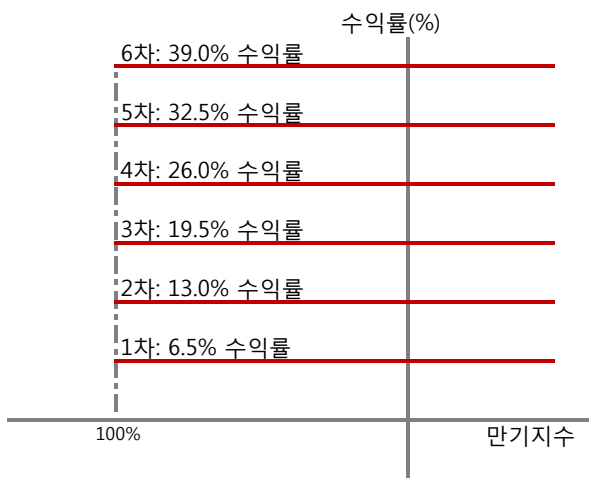
1. 계약금액

단위(백만원)

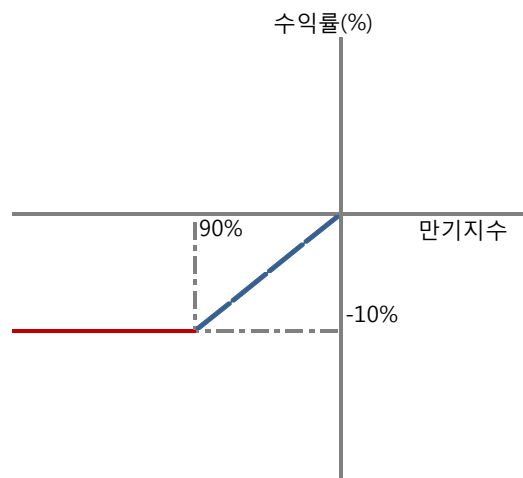
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	864	0	864	장외
누계	유가증권	선물	864	0	864	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	54.51	52.25	49.98	47.72	45.45	43.18	40.92
	5.33%	37.73	35.46	33.20	30.93	28.67	26.40	24.13
	2.67%	21.82	19.56	17.29	15.03	12.76	10.49	8.23
	0.00%	6.80	4.53	2.27	0.00	(2.27)	(4.53)	(6.80)
	-2.67%	(7.35)	(9.62)	(11.88)	(14.15)	(16.41)	(18.68)	(20.95)
	-5.33%	(20.62)	(22.89)	(25.15)	(27.42)	(29.68)	(31.95)	(34.21)
	-8.00%	(33.01)	(35.28)	(37.54)	(39.81)	(42.07)	(44.34)	(46.61)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	46.61
총 최대손실 예상금액		46.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 54.65

메리츠2Star증권SEST-44호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

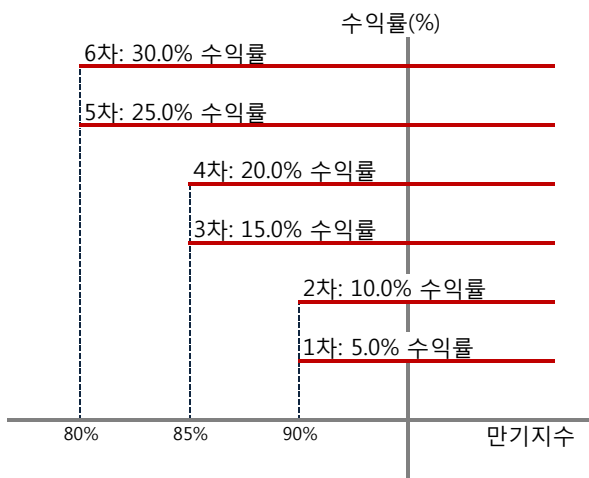
1. 계약금액

단위(백만원)

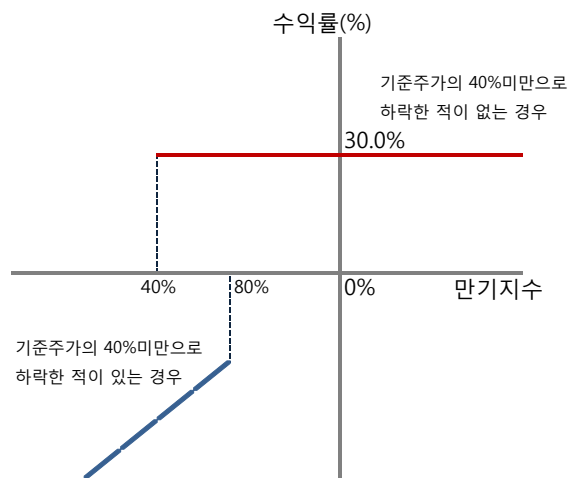
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외

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%	0.61	0.89	1.17	1.45	1.73	2.01	2.29
자산	5.33%	(1.73)	(1.45)	(1.16)	(0.88)	(0.60)	(0.32)	(0.04)
시나	2.67%	(2.21)	(1.93)	(1.65)	(1.37)	(1.09)	(0.81)	(0.52)
리오	0.00%	(0.84)	(0.56)	(0.28)	0.00	0.28	0.56	0.84
	-2.67%	2.37	2.66	2.94	3.22	3.50	3.78	4.06
	-5.33%	7.44	7.72	8.00	8.28	8.56	8.85	9.13
	-8.00%	14.36	14.64	14.92	15.20	15.48	15.76	16.04

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033AD0C3	신한투자(ELS)2106	2.21
총 최대손실 예상금액		2.21

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 13.83

메리츠2Star증권SEST-47호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

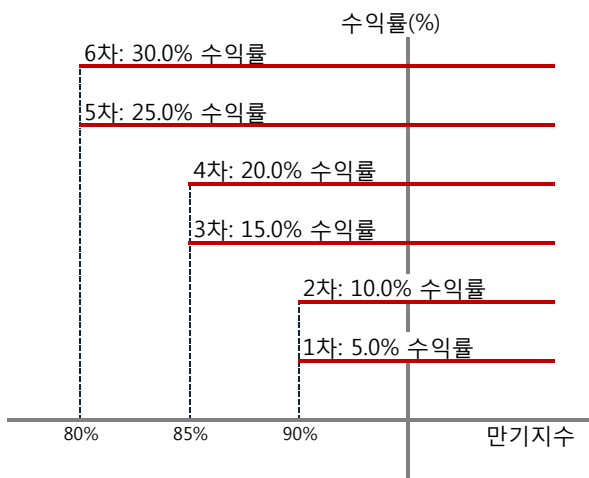
1. 계약금액

단위(백만원)

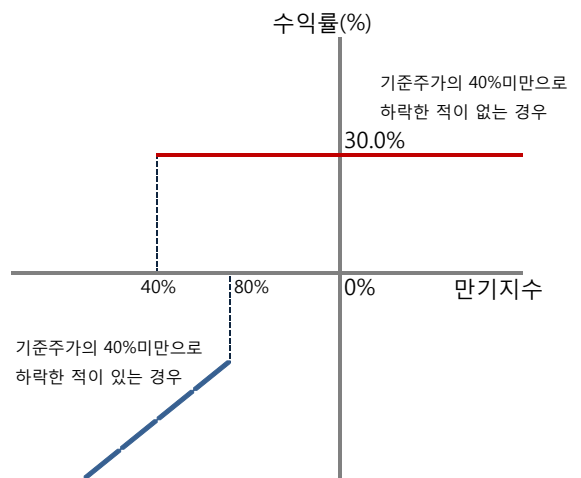
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장외

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%	0.61	0.89	1.17	1.45	1.73	2.01	2.29
자산	5.33%	(1.73)	(1.45)	(1.16)	(0.88)	(0.60)	(0.32)	(0.04)
시나	2.67%	(2.21)	(1.93)	(1.65)	(1.37)	(1.09)	(0.81)	(0.52)
리오	0.00%	(0.84)	(0.56)	(0.28)	0.00	0.28	0.56	0.84
	-2.67%	2.37	2.66	2.94	3.22	3.50	3.78	4.06
	-5.33%	7.44	7.72	8.00	8.28	8.56	8.85	9.13
	-8.00%	14.36	14.64	14.92	15.20	15.48	15.76	16.04

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033AD0C3	신한투자(ELS)2106	2.21
총 최대손실 예상금액		2.21

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 13.83

메리츠2Star증권SEST-51호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

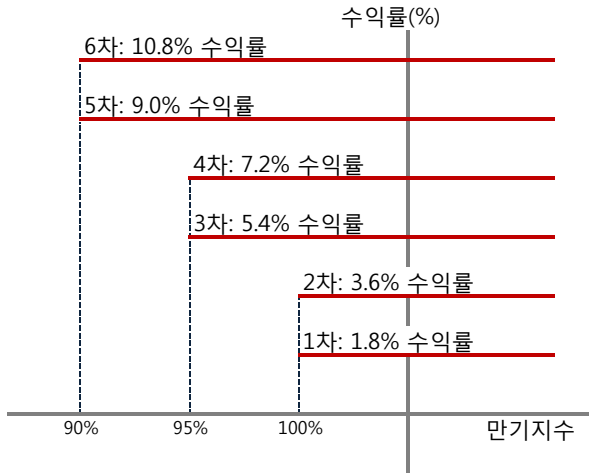
1. 계약금액

단위(백만원)

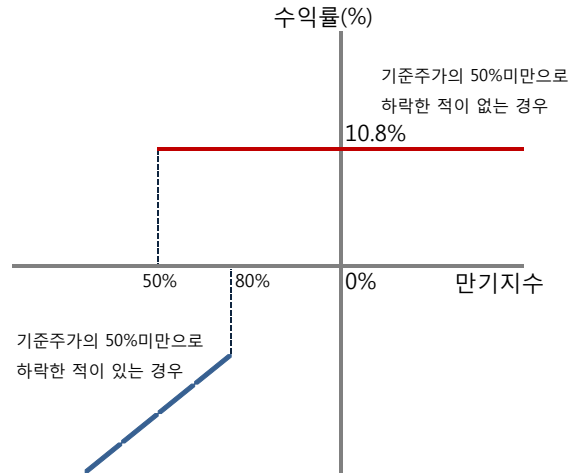
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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 자산 시나리오	8.00%	(76.77)	(75.81)	(74.86)	(73.91)	(72.96)	(72.01)	(71.05)
	5.33%	(50.32)	(49.36)	(48.41)	(47.46)	(46.51)	(45.56)	(44.60)
	2.67%	(25.68)	(24.73)	(23.77)	(22.82)	(21.87)	(20.92)	(19.97)
	0.00%	(2.86)	(1.90)	(0.95)	0.00	0.95	1.90	2.86
	-2.67%	18.15	19.10	20.06	21.01	21.96	22.91	23.86
	-5.33%	37.35	38.30	39.25	40.20	41.16	42.11	43.06
	-8.00%	54.73	55.68	56.63	57.58	58.54	59.49	60.44

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233AF0C9	대우증권ELS4907	76.77
총 최대손실 예상금액		76.77

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

92.48

메리츠주가지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

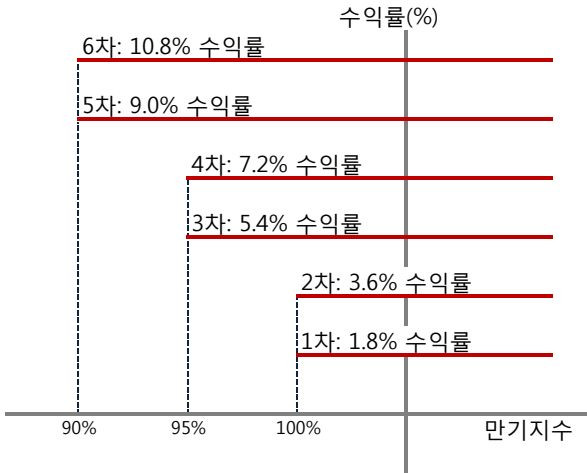
1. 계약금액

단위(백만원)

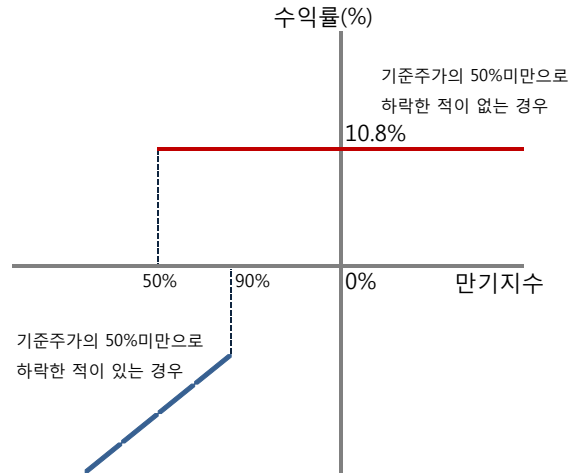
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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 자산 시나리오	8.00%	(79.61)	(78.56)	(77.51)	(76.45)	(75.40)	(74.35)	(73.29)
	5.33%	(51.02)	(49.96)	(48.91)	(47.86)	(46.80)	(45.75)	(44.70)
	2.67%	(25.53)	(24.48)	(23.42)	(22.37)	(21.32)	(20.26)	(19.21)
	0.00%	(3.16)	(2.11)	(1.05)	0.00	1.05	2.11	3.16
	-2.67%	16.10	17.15	18.20	19.26	20.31	21.36	22.42
	-5.33%	32.24	33.29	34.35	35.40	36.45	37.51	38.56
	-8.00%	45.27	46.32	47.38	48.43	49.48	50.54	51.59

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503371116	신한투자(ELS)2186	79.61
총 최대손실 예상금액		79.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	59.69
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2011-02-18

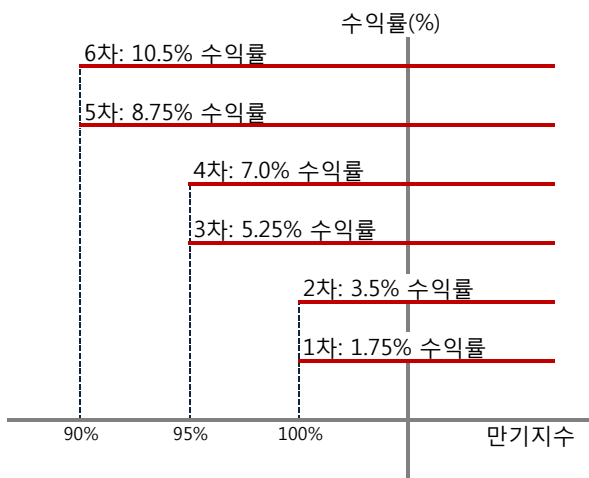
1. 계약금액

단위(백만원)

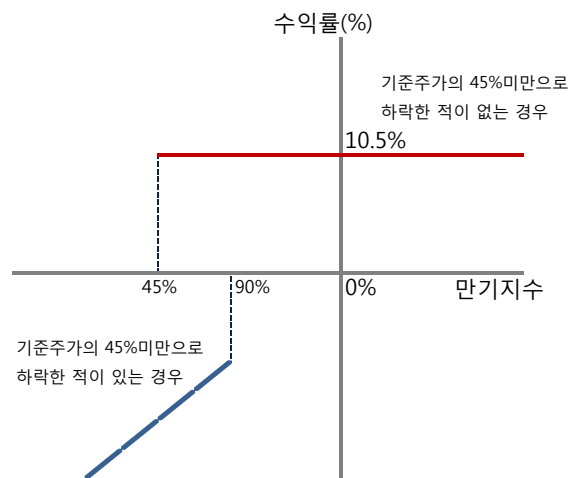
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,001	0	5,001	장외
누계	유가증권	선물	5,001	0	5,001	장외

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%	(63.25)	(62.24)	(61.22)	(60.20)	(59.18)	(58.17)	(57.15)
자산	5.33%	(41.50)	(40.48)	(39.46)	(38.45)	(37.43)	(36.41)	(35.39)
사	2.67%	(21.43)	(20.41)	(19.40)	(18.38)	(17.36)	(16.34)	(15.33)
나	0.00%	(3.05)	(2.03)	(1.02)	0.00	1.02	2.03	3.05
리	-2.67%	13.64	14.66	15.67	16.69	17.71	18.72	19.74
오	-5.33%	28.64	29.66	30.67	31.69	32.71	33.73	34.74
시	-8.00%	41.95	42.97	43.99	45.00	46.02	47.04	48.06

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553310121	우리투자증권(ELS)3970	63.25
총 최대손실 예상금액		63.25

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 58.31