

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

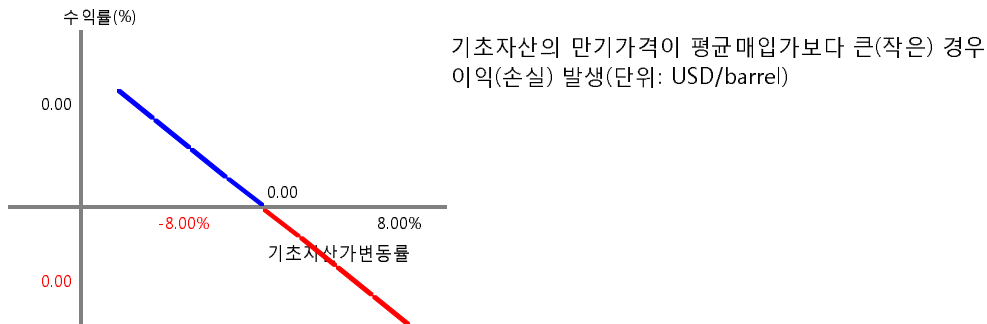
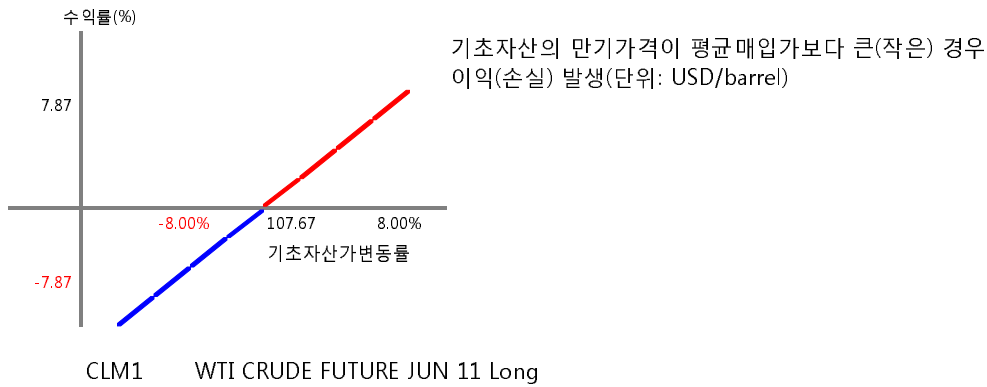
공시일: 2011-05-27

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



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLM1 WTI CRUDE FUTURE JUN 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	7.87
	5.33%	5.25
	2.67%	2.63
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-2.63
	-5.33%	-5.25
	-8.00%	-7.87

최대손실 시나리오	
위험액	-7.87

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.91
-----	-------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

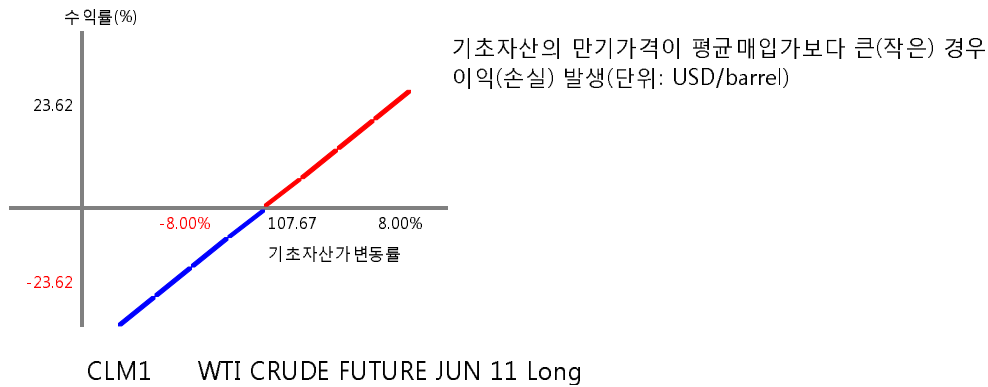
공시일: 2011-05-27

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))

CLM1 WTI CRUDE FUTURE JUN 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	47.25
	5.33%	31.48
	2.67%	15.77
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-15.77
	-5.33%	-31.48
	-8.00%	-47.25

최대손실 시나리오	
위험액	-47.25

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	94.01
-----	-------

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

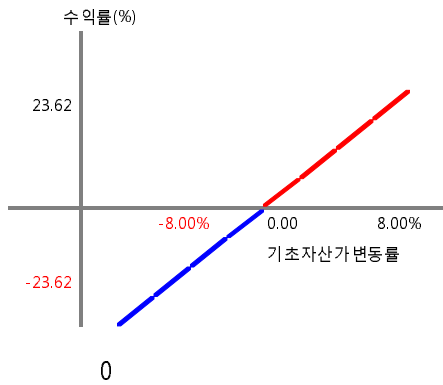
공시일: 2011-05-27

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	0	0	0	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

메리츠PremiumCommodity특별자산1

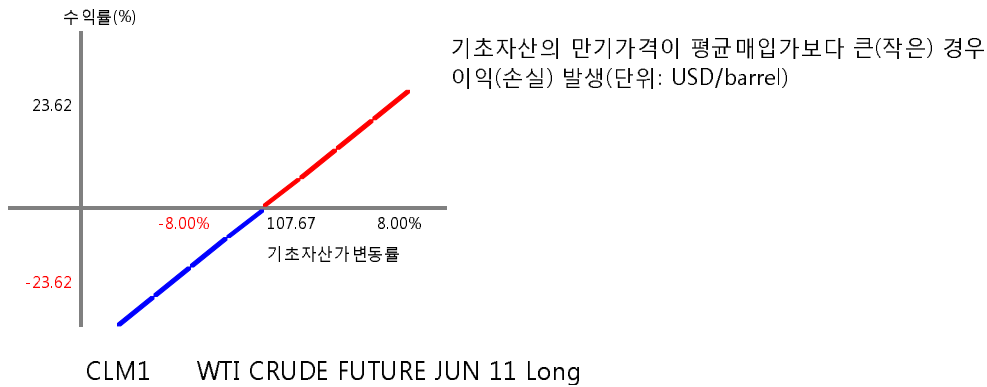
공시일: 2011-05-27

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))

CLM1 WTI CRUDE FUTURE JUN 11 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	304.23
	5.33%	202.69
	2.67%	101.54
	0.00%	0.00
시나리오	-2.67%	-101.54
	-5.33%	-202.69
	-8.00%	-304.23

최대손실 시나리오	
위험액	-304.23

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,210.35
-----	----------

메리츠PremiumCommodity특별자산1

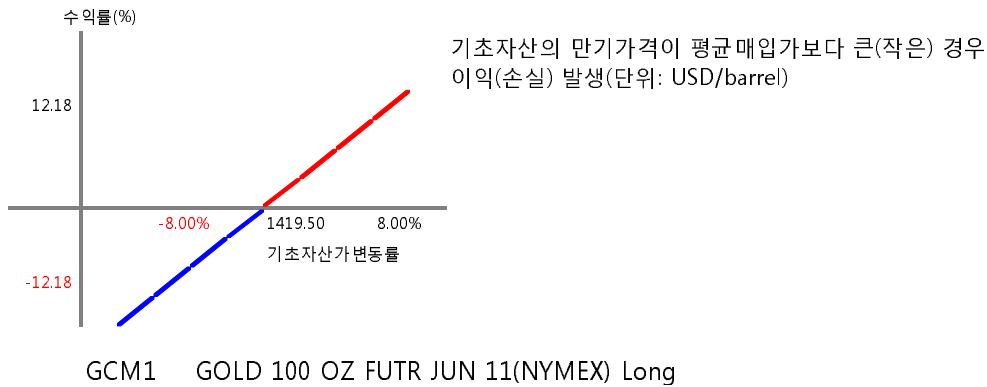
공시일: 2011-05-27

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

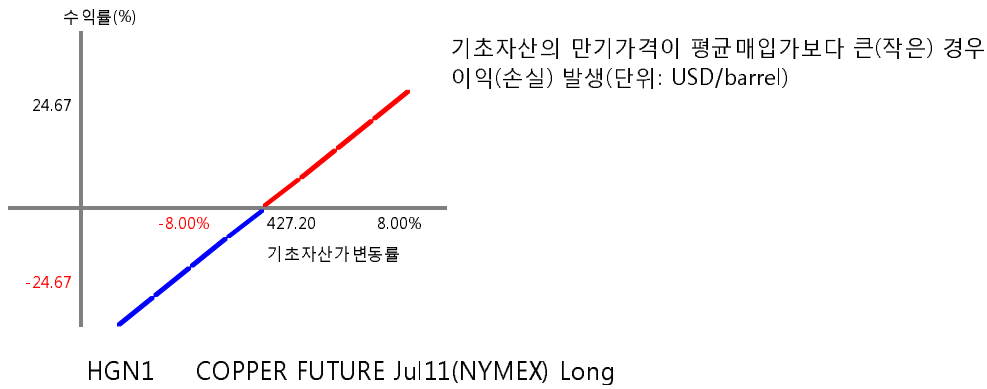
공시일: 2011-05-27

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

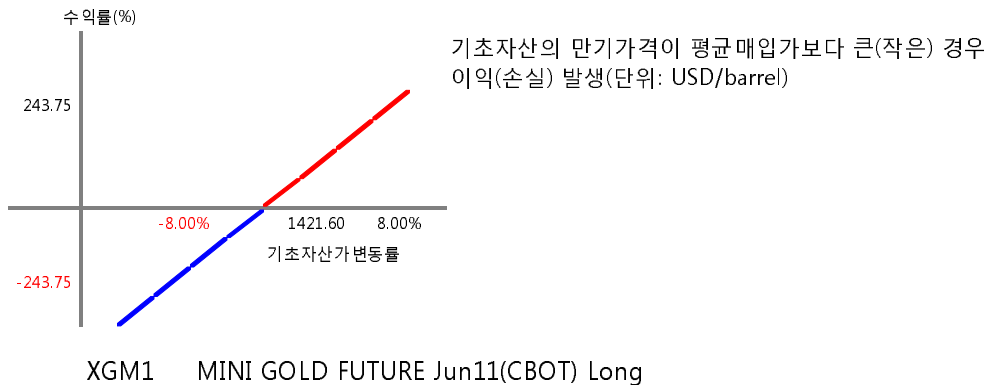
공시일: 2011-05-27

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: 2011-05-27

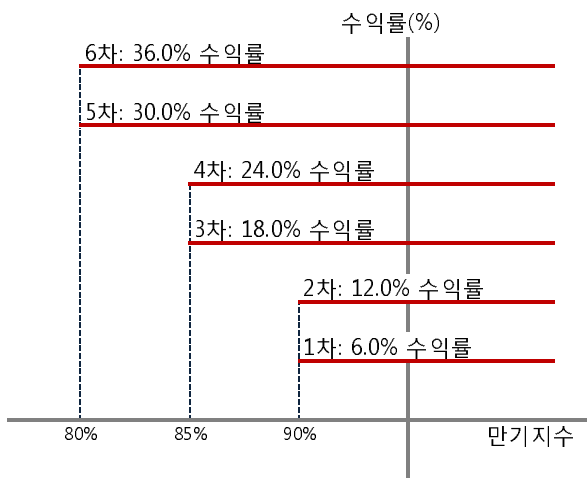
1. 계약금액

단위(백만원)

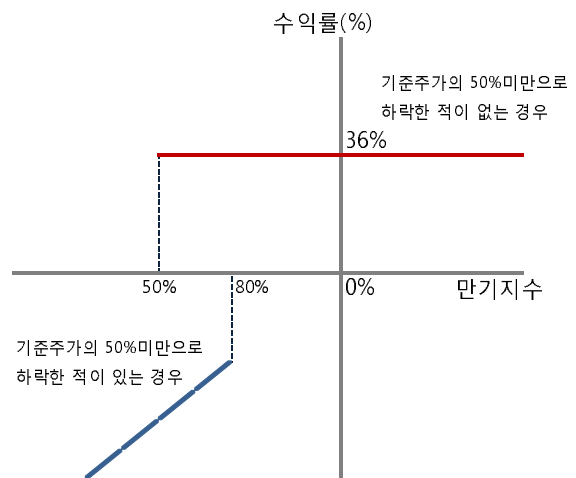
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,153	0	6,153	장외
누계	유가증권	ELS	6,153	0	6,153	장외

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	218.29	174.98	131.68	88.37	45.07	1.76	(41.54)	
자산	206.02	162.72	119.41	76.11	32.80	(10.50)	(53.80)	
시나리오	176.57	133.26	89.96	46.65	3.35	(39.96)	(83.26)	
	129.91	86.61	43.30	0.00	(43.30)	(86.61)	(129.91)	
	66.07	22.76	(20.54)	(63.85)	(107.15)	(150.46)	(193.76)	
	(14.97)	(58.28)	(101.58)	(144.89)	(188.19)	(231.50)	(274.80)	
	(113.21)	(156.51)	(199.82)	(243.12)	(286.42)	(329.73)	(373.03)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	91.91
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	94.65
KR6661350035	동양(ELS)520	93.32
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	93.16
총 최대손실 예상금액		373.03

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	337.12
-----	--------

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

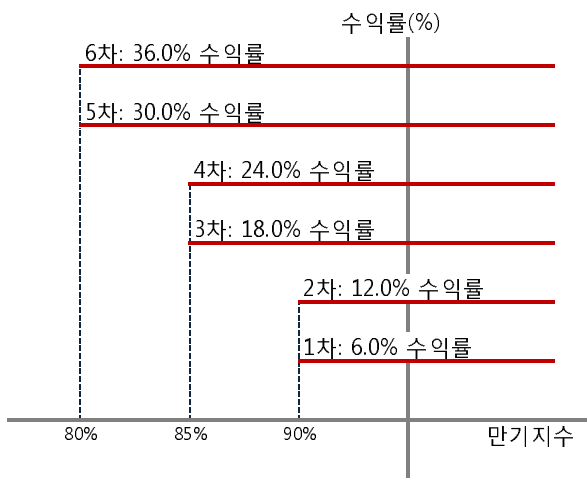
1. 계약금액

단위(백만원)

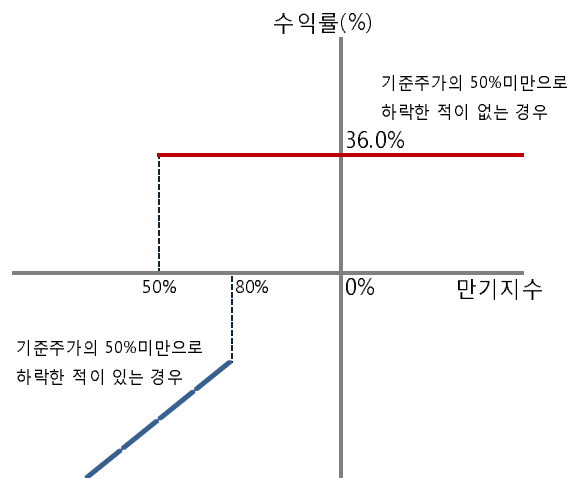
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,046	0	2,046	장외
누계	유가증권	ELS	2,046	0	2,046	장외

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	52.88	48.53	44.17	39.82	35.46	31.11	26.75	
자산	43.02	38.66	34.31	29.96	25.60	21.25	16.89	
시나리오	29.75	25.39	21.04	16.68	12.33	7.97	3.62	
	13.06	8.71	4.35	0.00	(4.35)	(8.71)	(13.06)	
	(7.03)	(11.38)	(15.74)	(20.09)	(24.45)	(28.80)	(33.16)	
	(30.54)	(34.89)	(39.24)	(43.60)	(47.95)	(52.31)	(56.66)	
	(57.45)	(61.81)	(66.16)	(70.52)	(74.87)	(79.22)	(83.58)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293A8084	대우증권(ELS)4375	20.87
KR6542326089	신영증권(ELS)1694	20.80
KR6559370087	우리투자증권(ELS)3447	20.82
KR6669350086	동양W(ELS)914	21.08
총 최대손실 예상금액		83.58

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	95.50
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제4호[ELS-파생형]

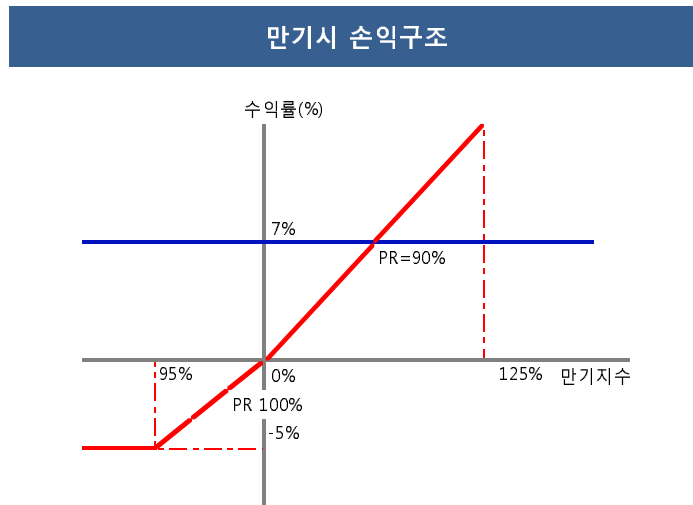
공시일: 2011-05-27

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,351	0	2,351	장외
누계	유가증권	ELS	2,351	0	2,351	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%	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)
KR6503337091	신한투자(ELS)1781	0.00
KR6543321097	신영증권(ELS)1729	0.00
KR6553351091	우리투자증권(ELS)3513	0.00
KR6663331090	동양W(ELS)912	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

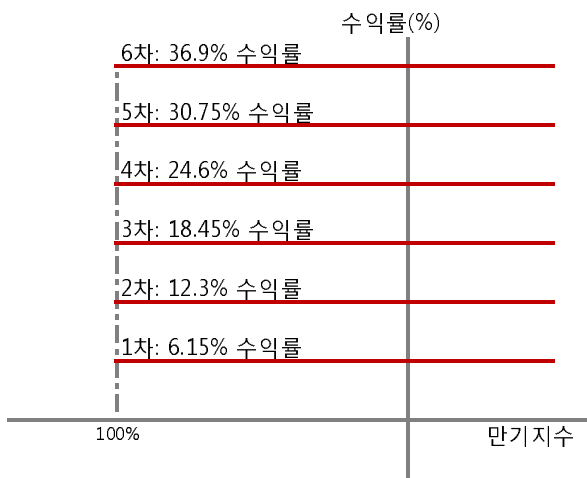
1. 계약금액

단위(백만원)

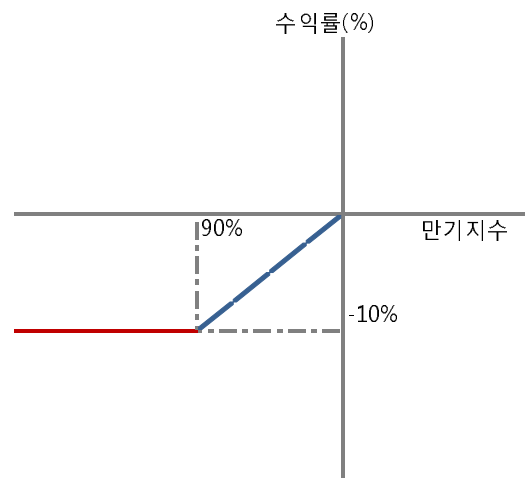
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,082	0	5,082	장외
누계	유가증권	ELS	5,082	0	5,082	장외

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	364.79	348.53	332.27	316.01	299.75	283.49	267.23	
자산	258.82	242.56	226.30	210.04	193.78	177.51	161.25	
시나리오	153.48	137.22	120.96	104.70	88.44	72.18	55.92	
	48.78	32.52	16.26	0.00	(16.26)	(32.52)	(48.78)	
	(55.28)	(71.54)	(87.80)	(104.06)	(120.32)	(136.59)	(152.85)	
	(158.71)	(174.97)	(191.23)	(207.49)	(223.75)	(240.01)	(256.27)	
	(261.50)	(277.76)	(294.02)	(310.28)	(326.54)	(342.80)	(359.07)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293160A1	대우증권ELS4537	89.10
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	88.94
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	91.19
KR66693120A9	동양W(ELS)927	89.84
총 최대손실 예상금액		359.07

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	394.02
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

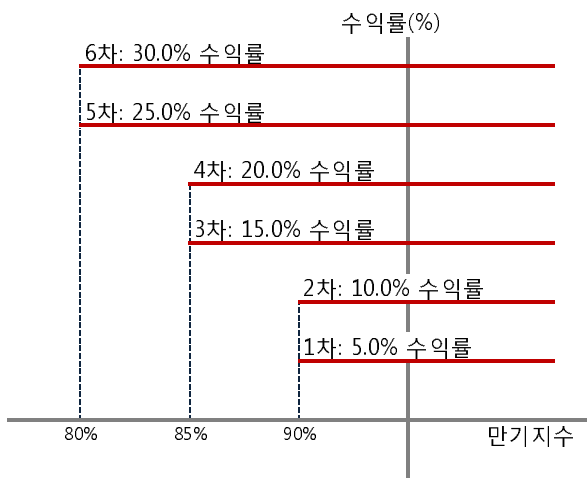
1. 계약금액

단위(백만원)

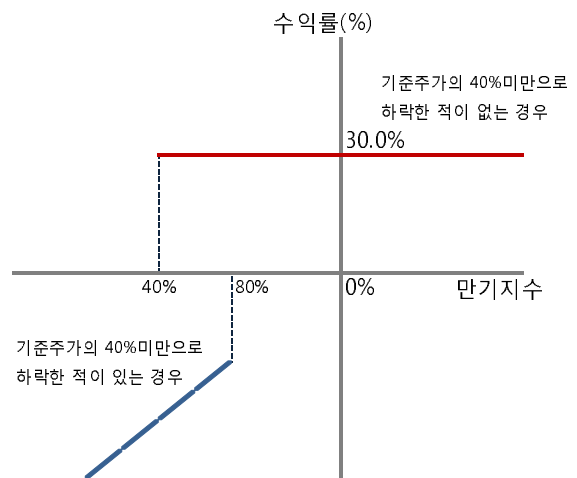
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,539	0	6,539	장외
누계	유가증권	ELS	6,539	0	6,539	장외

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%	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)

KR65433540B3	신영증권(ELS)1854	0.00
KR65833780B1	현대증권(ELS)2010-1527	0.00
KR65933840B2	미래에셋증권(ELS)1614	0.00
KR66633AC0B8	동양W(ELS)946	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

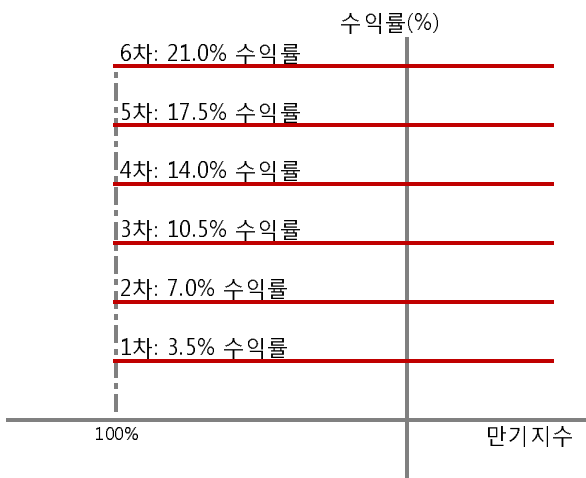
1. 계약금액

단위(백만원)

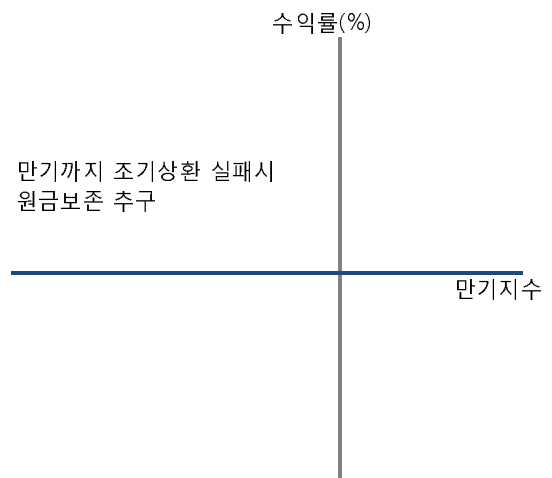
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,524	0	3,524	장외
누계	유가증권	ELS	3,524	0	3,524	장외

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	119.82	115.47	111.12	106.77	102.42	98.07	93.72	
자산	81.51	77.16	72.81	68.46	64.11	59.76	55.41	
시나리오	45.92	41.57	37.22	32.87	28.52	24.17	19.82	
	13.05	8.70	4.35	0.00	(4.35)	(8.70)	(13.05)	
	(17.09)	(21.44)	(25.79)	(30.14)	(34.49)	(38.84)	(43.19)	
	(44.51)	(48.86)	(53.21)	(57.56)	(61.91)	(66.26)	(70.61)	
	(69.21)	(73.56)	(77.91)	(82.26)	(86.61)	(90.96)	(95.31)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	23.30
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	24.52
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	23.64
KR66623360C2	동양W(ELS)950	23.85
총 최대손실 예상금액		95.31

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	97.99
-----	-------

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

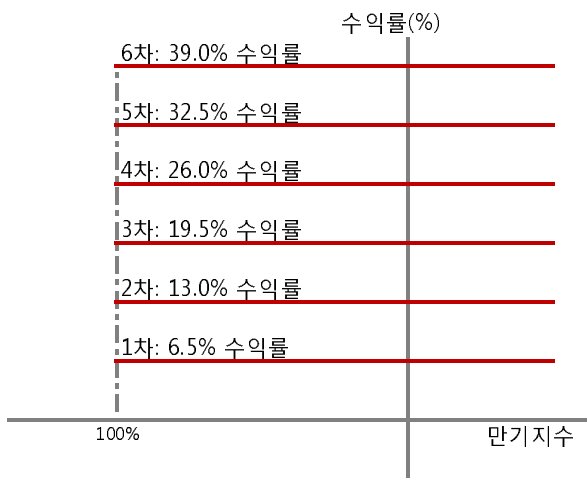
1. 계약금액

단위(백만원)

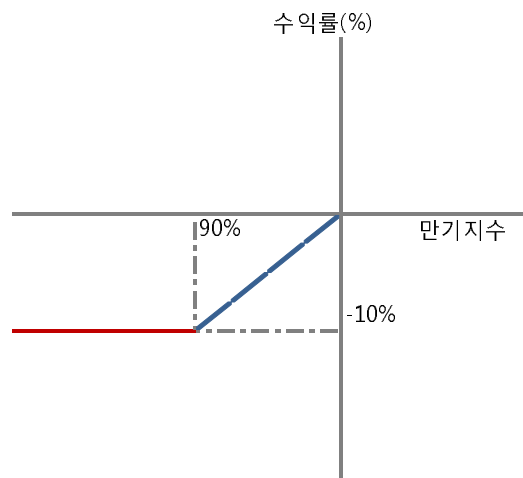
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,455	0	3,455	장외
누계	유가증권	ELS	3,455	0	3,455	장외

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	214.81	205.86	196.91	187.96	179.00	170.05	161.10	
자산	148.26	139.31	130.36	121.41	112.45	103.50	94.55	
시나리오	85.61	76.65	67.70	58.75	49.80	40.85	31.90	
	26.85	17.90	8.95	0.00	(8.95)	(17.90)	(26.85)	
	(28.00)	(36.95)	(45.90)	(54.85)	(63.81)	(72.76)	(81.71)	
	(78.96)	(87.91)	(96.86)	(105.81)	(114.76)	(123.71)	(132.66)	
	(126.02)	(134.97)	(143.92)	(152.87)	(161.82)	(170.77)	(179.72)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	44.49
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	45.50
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	44.77
KR66623340C4	동양W(ELS)949	44.96
총 최대손실 예상금액		179.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	188.20
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제13호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

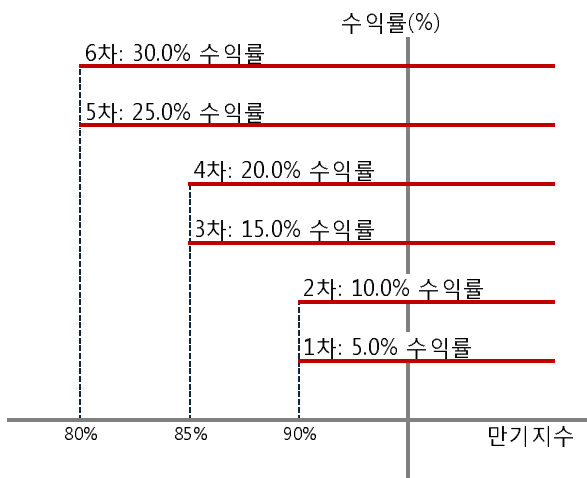
1. 계약금액

단위(백만원)

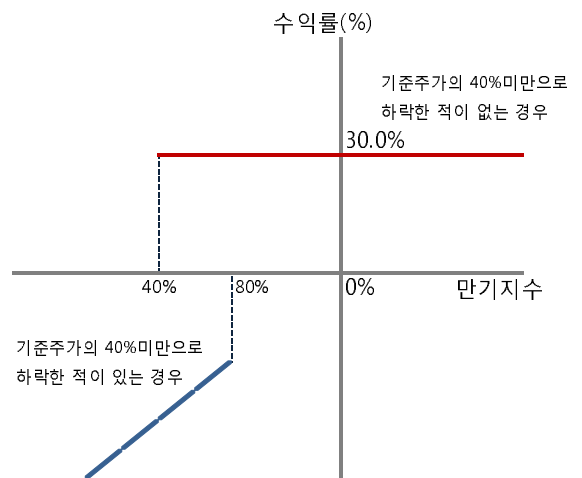
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,429	0	5,429	장외
누계	유가증권	ELS	5,429	0	5,429	장외

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	23.39	23.41	23.43	23.45	23.47	23.48	23.50	
자산	10.09	10.11	10.13	10.15	10.17	10.18	10.20	
시나리오	2.27	2.29	2.31	2.33	2.35	2.37	2.39	
	0.00%	(0.06)	(0.04)	(0.02)	0.00	0.02	0.04	
	-2.67%	3.10	3.12	3.14	3.15	3.17	3.19	
	-5.33%	11.74	11.75	11.77	11.79	11.81	11.83	
	-8.00%	25.86	25.88	25.90	25.92	25.94	25.96	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65033AD0C3	신한투자(ELS)2106	0.02
KR65431510C6	신영증권(ELS)1904	0.02
KR65933AG0C1	미래에셋증권(ELS)1700	0.01
KR66633730C4	동양W(ELS)956	0.01
총 최대손실 예상금액		0.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.78
-----	------

메리츠주가지수연계증권투자신탁제7호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

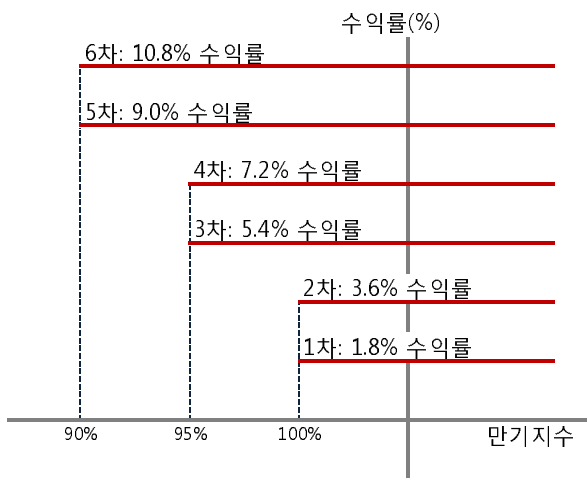
1. 계약금액

단위(백만원)

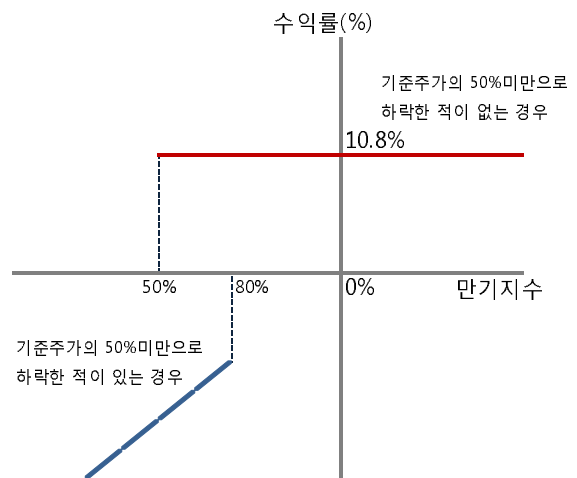
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외
누계	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외

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	39.14	39.89	40.65	41.40	42.15	42.91	43.66	
자산	5.94	6.69	7.44	8.20	8.95	9.70	10.46	
시나리오	(7.86)	(7.11)	(6.36)	(5.60)	(4.85)	(4.10)	(3.34)	
	(2.26)	(1.51)	(0.75)	0.00	0.75	1.51	2.26	
	22.74	23.50	24.25	25.01	25.76	26.51	27.27	
	67.15	67.91	68.66	69.41	70.17	70.92	71.67	
	130.96	131.72	132.47	133.22	133.98	134.73	135.48	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65233AF0C9	대우증권ELS4907	2.03
KR65533A90C2	우리투자증권(ELS)3859	2.03
KR66633740C3	동양W(ELS)961	1.95
KR66733310C4	동부증권(ELS)462	1.85
총 최대손실 예상금액		7.86

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	153.99
-----	--------

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

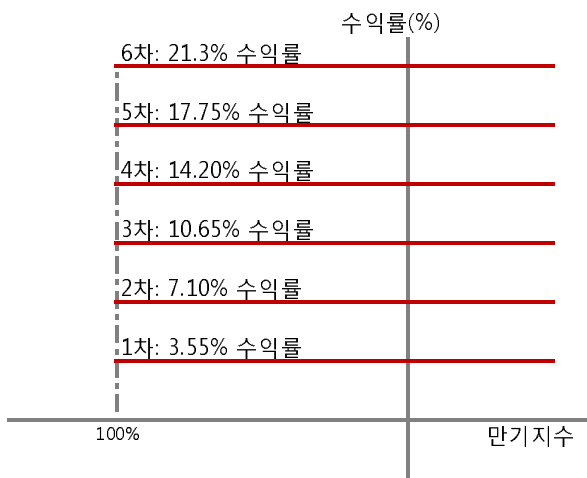
1. 계약금액

단위(백만원)

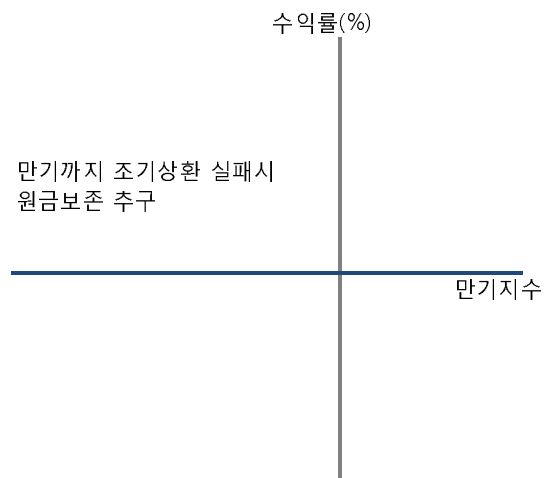
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,212	0	1,212	장외
누계	유가증권	ELS	1,212	0	1,212	장외

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	14.26	13.01	11.75	10.49	9.23	7.97	6.71
자산	10.86	9.60	8.34	7.09	5.83	4.57	3.31
시나리오	2.67%	7.37	6.11	4.85	3.59	2.33	(0.19)
	0.00%	3.78	2.52	1.26	0.00	(1.26)	(3.78)
	-2.67%	0.09	(1.17)	(2.43)	(3.68)	(4.94)	(7.46)
	-5.33%	(3.69)	(4.95)	(6.20)	(7.46)	(8.72)	(11.24)
	-8.00%	(7.56)	(8.82)	(10.08)	(11.34)	(12.59)	(15.11)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	3.70
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	3.86
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	3.76
KR6662316126	동양W(ELS)974	3.79
총 최대손실 예상금액		15.11

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 16.84

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

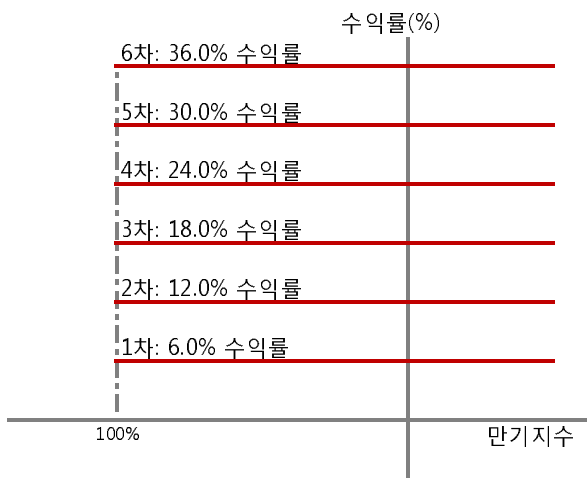
1. 계약금액

단위(백만원)

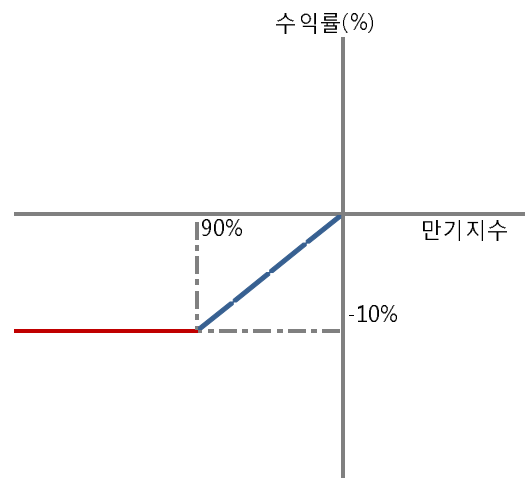
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	741	0	741	장외
누계	유가증권	ELS	741	0	741	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	19.16	16.83	14.49	12.16	9.82	7.49	5.15	
자산	15.37	13.03	10.70	8.36	6.03	3.69	1.36	
시나리오	2.67%	11.31	8.98	6.64	4.31	1.97	(0.36)	(2.69)
	0.00%	7.00	4.67	2.33	0.00	(2.33)	(4.67)	(7.00)
	-2.67%	2.44	0.10	(2.23)	(4.57)	(6.90)	(9.23)	(11.57)
	-5.33%	(2.38)	(4.72)	(7.05)	(9.39)	(11.72)	(14.06)	(16.39)
	-8.00%	(7.46)	(9.79)	(12.13)	(14.46)	(16.80)	(19.13)	(21.47)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502331129	신한투자(ELS)2235	5.33
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	5.32
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	5.43
KR6662317124	동양W(ELS)975	5.38
총 최대손실 예상금액		21.47

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.07
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제9호[ELS-파생형]

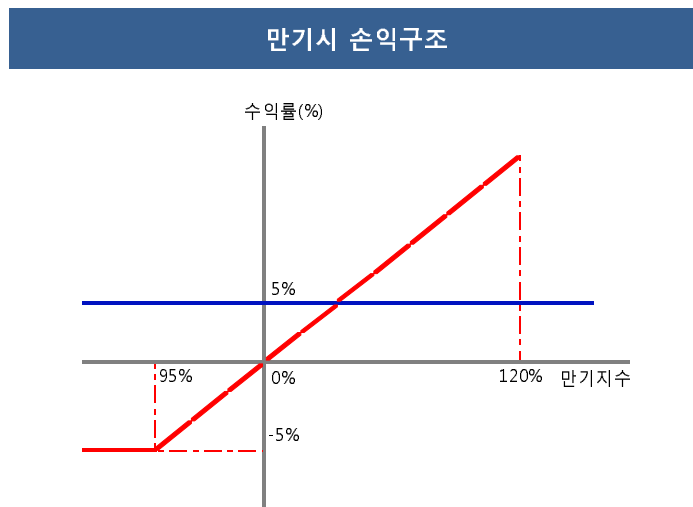
공시일: 2011-05-27

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,043	0	1,043	장외
누계	유가증권	ELS	1,043	0	1,043	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	18.50	17.34	16.18	15.02	13.86	12.70	11.54	
자산	14.09	12.93	11.77	10.61	9.45	8.29	7.13	
시나리오	9.08	7.92	6.76	5.60	4.44	3.28	2.12	
	3.48	2.32	1.16	0.00	(1.16)	(2.32)	(3.48)	
	(2.71)	(3.88)	(5.04)	(6.20)	(7.36)	(8.52)	(9.68)	
	(9.51)	(10.67)	(11.83)	(12.99)	(14.15)	(15.31)	(16.47)	
	(16.89)	(18.05)	(19.21)	(20.38)	(21.54)	(22.70)	(23.86)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503330120	신한투자(ELS)2234	5.97
KR6553344120	우리투자증권(ELS)3990	5.97
KR6583318128	현대증권(ELS)2011-1587	5.95
KR6663314120	동양W(ELS)973	5.97
총 최대손실 예상금액		23.86

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.90
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제14호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

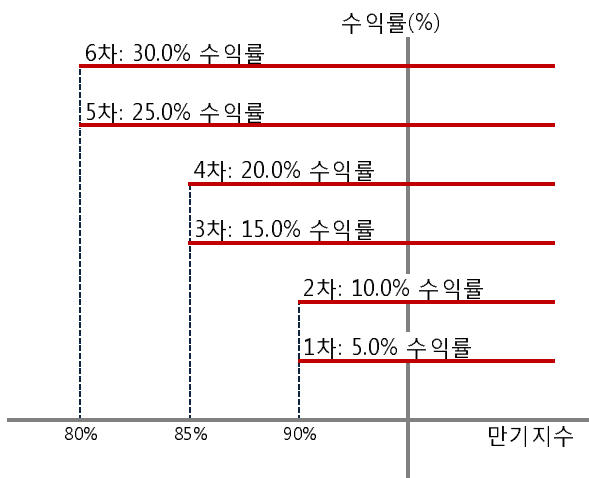
1. 계약금액

단위(백만원)

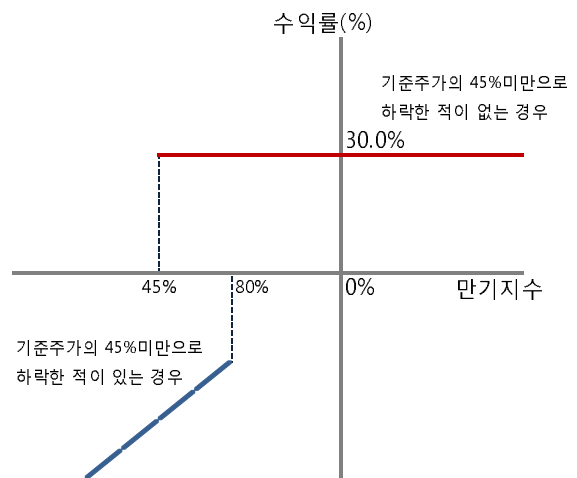
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	12,045	0	12,045	장외
누계	유가증권	ELS	12,045	0	12,045	장외

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	11.69	11.57	11.44	11.32	11.19	11.07	10.94	
자산	2.44	2.31	2.19	2.06	1.94	1.81	1.69	
시나리오	(1.33)	(1.46)	(1.58)	(1.71)	(1.83)	(1.96)	(2.08)	
	0.37	0.25	0.12	0.00	(0.12)	(0.25)	(0.37)	
	7.57	7.44	7.32	7.19	7.07	6.94	6.82	
	20.24	20.11	19.99	19.86	19.74	19.61	19.49	
	38.39	38.27	38.14	38.02	37.89	37.77	37.64	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503347124	신한투자(ELS)2253	0.52
KR6553362122	우리투자증권(ELS)4082	0.52
KR6593357124	미래에셋증권(ELS)1913	0.52
KR6663329128	동양W(ELS)977	0.52
총 최대손실 예상금액		2.08

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 33.07

메리츠2Star증권HISE-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

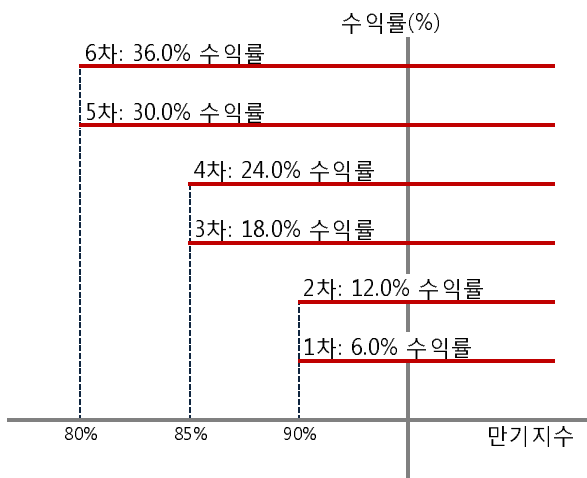
1. 계약금액

단위(백만원)

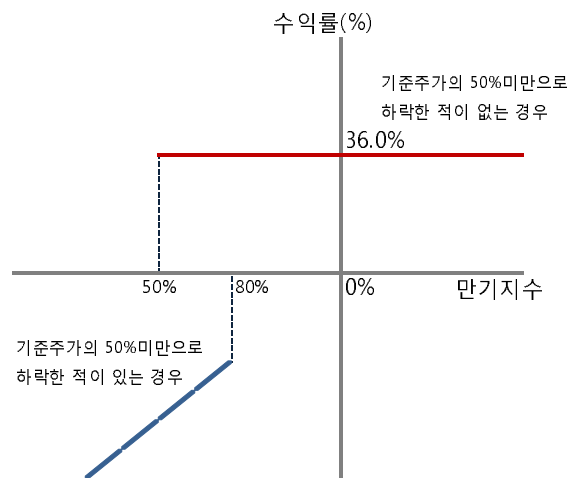
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	944	0	944	장외
누계	유가증권	ELS	944	0	944	장외

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%	82.72	67.45	52.18	36.91	21.64	6.37	(8.90)
	5.33%	76.20	60.93	45.66	30.38	15.11	(0.16)	(15.43)
	2.67%	63.90	48.62	33.35	18.08	2.81	(12.46)	(27.73)
	0.00%	45.81	30.54	15.27	0.00	(15.27)	(30.54)	(45.81)
	-2.67%	21.95	6.68	(8.59)	(23.86)	(39.13)	(54.40)	(69.67)
	-5.33%	(7.69)	(22.96)	(38.23)	(53.50)	(68.77)	(84.04)	(99.31)
	-8.00%	(43.10)	(58.38)	(73.65)	(88.92)	(104.19)	(119.46)	(134.73)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6542312139	신영증권(ELS)2005	33.23
KR6559350139	우리투자증권(ELS)4170	33.26
KR6589319138	현대증권(ELS)2011-1617	34.63
KR6622306134	교보증권(ELS)761	33.61
총 최대손실 예상금액		134.73

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	116.14
-----	--------

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

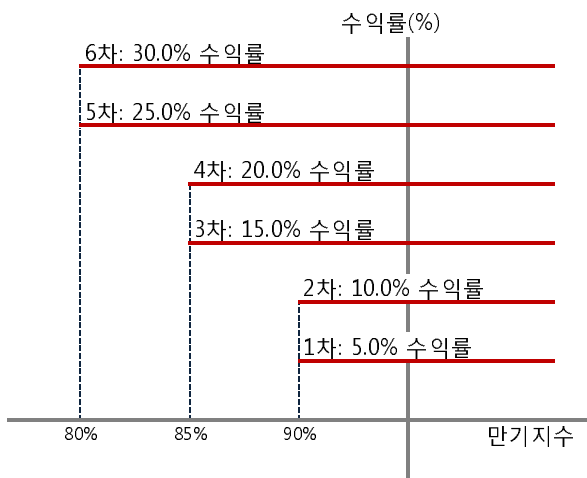
1. 계약금액

단위(백만원)

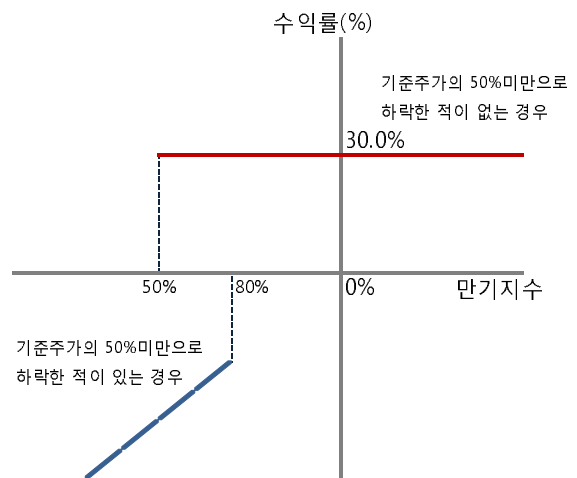
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,149	0	2,149	장외
누계	유가증권	ELS	2,149	0	2,149	장외

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	243.65	216.77	189.88	162.99	136.11	109.22	82.34	
자산	201.40	174.52	147.63	120.75	93.86	66.97	40.09	
시나리오	147.07	120.18	93.30	66.41	39.53	12.64	(14.24)	
	80.66	53.77	26.89	0.00	(26.89)	(53.77)	(80.66)	
	2.16	(24.73)	(51.61)	(78.50)	(105.38)	(132.27)	(159.15)	
	(88.42)	(115.30)	(142.19)	(169.07)	(195.96)	(222.85)	(249.73)	
	(191.08)	(217.97)	(244.85)	(271.74)	(298.62)	(325.51)	(352.39)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	93.97
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	96.00
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	94.55
KR6662374141	동양W(ELS)1004	67.87
총 최대손실 예상금액		352.39

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	371.37
-----	--------

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-05-27

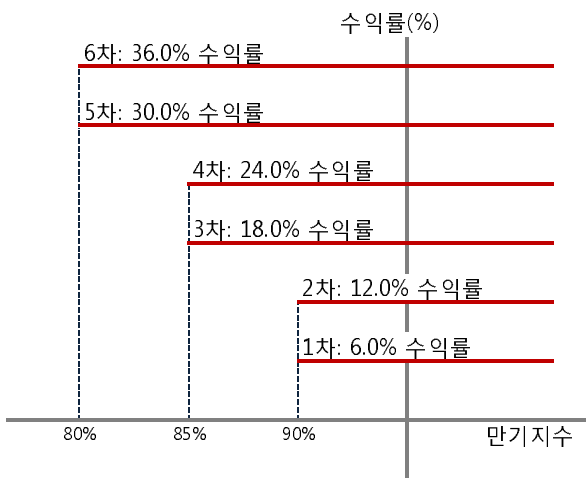
1. 계약금액

단위(백만원)

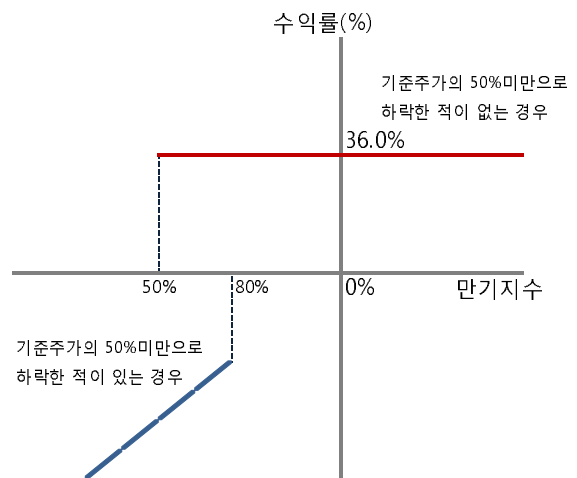
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	ELS	5,000	0	5,000	장외

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%	(222.83)	(219.49)	(216.14)	(212.79)	(209.44)	(206.10)	(202.75)
자산	5.33%	(145.27)	(141.92)	(138.57)	(135.22)	(131.88)	(128.53)	(125.18)
시나	2.67%	(74.34)	(70.99)	(67.64)	(64.29)	(60.95)	(57.60)	(54.25)
리오	0.00%	(10.04)	(6.70)	(3.35)	0.00	3.35	6.70	10.04
	-2.67%	47.61	50.96	54.31	57.66	61.00	64.35	67.70
	-5.33%	98.63	101.98	105.33	108.68	112.02	115.37	118.72
	-8.00%	143.01	146.36	149.71	153.06	156.41	159.75	163.10

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6553331150	우리투자증권(ELS)4448	59.57
KR6573333152	한국투자증권(ELS)2106	49.33
KR6663329151	동양W(ELS)1018	58.07
KR6673309151	해피플러스(ELS)529	55.87
총 최대손실 예상금액		222.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	188.48
-----	--------