

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

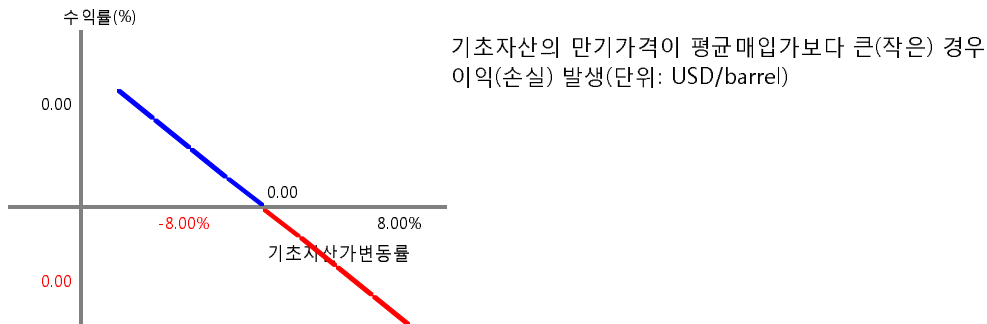
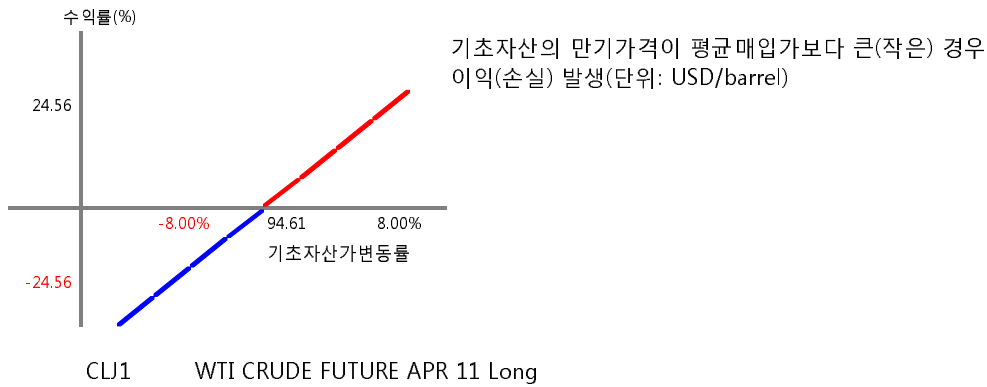
공시일: 2011-03-22

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))

CLJ1 WTI CRUDE FUTURE APR 11 Long

| 구분 | 시나리오 | |
|-------|--------|--------|
| 기초 자산 | 8.00% | 24.56 |
| | 5.33% | 16.36 |
| | 2.67% | 8.20 |
| 시나리오 | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -8.20 |
| | -5.33% | -16.36 |
| | -8.00% | -24.56 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|--------|
| 위험액 | -24.56 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 99.51 |
|-----|-------|

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

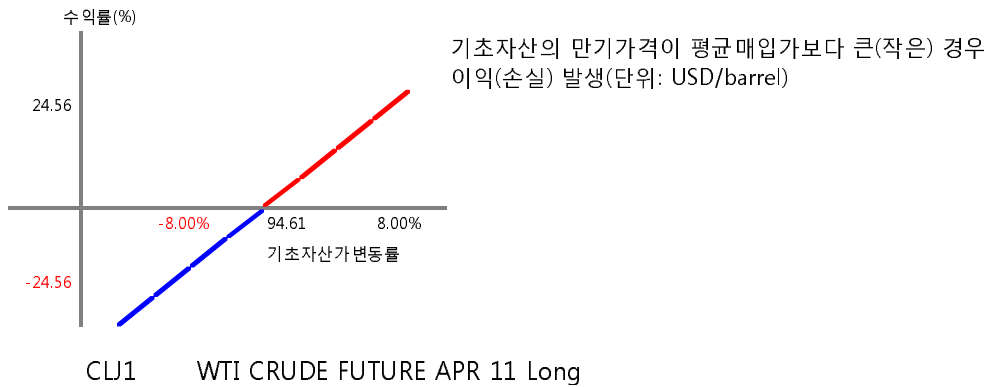
공시일: 2011-03-22

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))

CLJ1 WTI CRUDE FUTURE APR 11 Long

| 구분 | 시나리오 | |
|-------|--------|--------|
| 기초 자산 | 8.00% | 49.12 |
| | 5.33% | 32.73 |
| | 2.67% | 16.39 |
| 시나리오 | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -16.39 |
| | -5.33% | -32.73 |
| | -8.00% | -49.12 |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -49.12 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 97.72 |
|-----|-------|

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

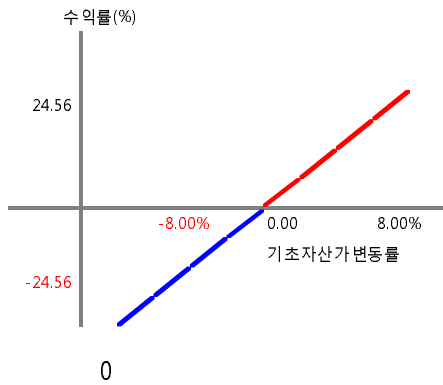
공시일: 2011-03-22

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

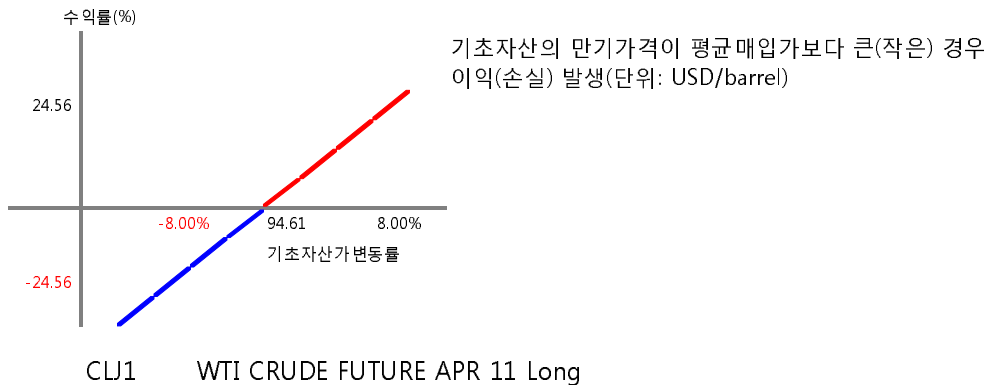
공시일: 2011-03-22

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))

CLJ1 WTI CRUDE FUTURE APR 11 Long

| 구분 | 시나리오 | |
|-------|--------|---------|
| 기초 자산 | 8.00% | 289.98 |
| | 5.33% | 193.20 |
| | 2.67% | 96.78 |
| 시나리오 | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -96.78 |
| | -5.33% | -193.20 |
| | -8.00% | -289.98 |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -289.98 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|----------|
| 위험액 | 1,153.61 |
|-----|----------|

메리츠PremiumCommodity특별자산1

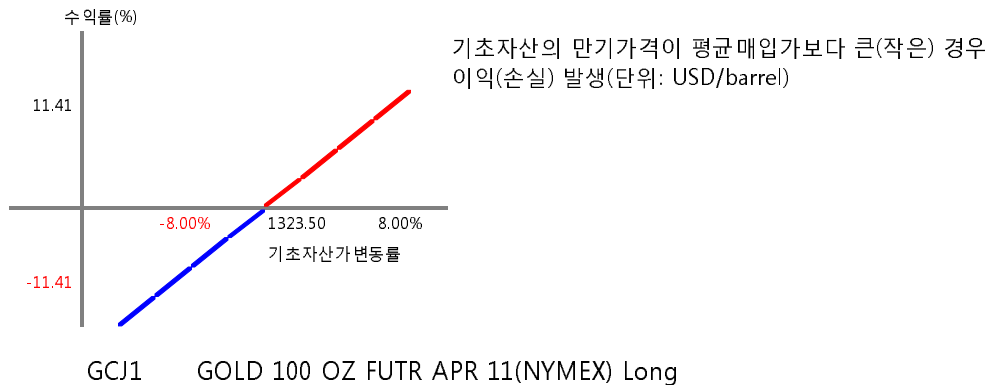
공시일: 2011-03-22

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

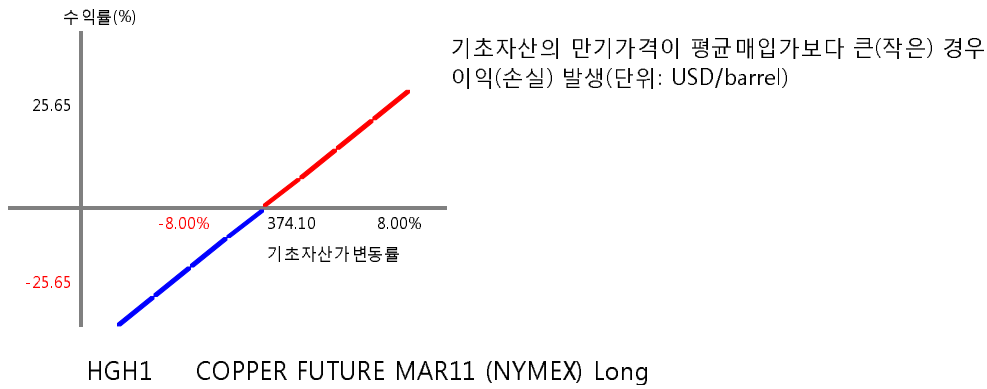
공시일: 2011-03-22

1. 계약금액

| 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 |

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

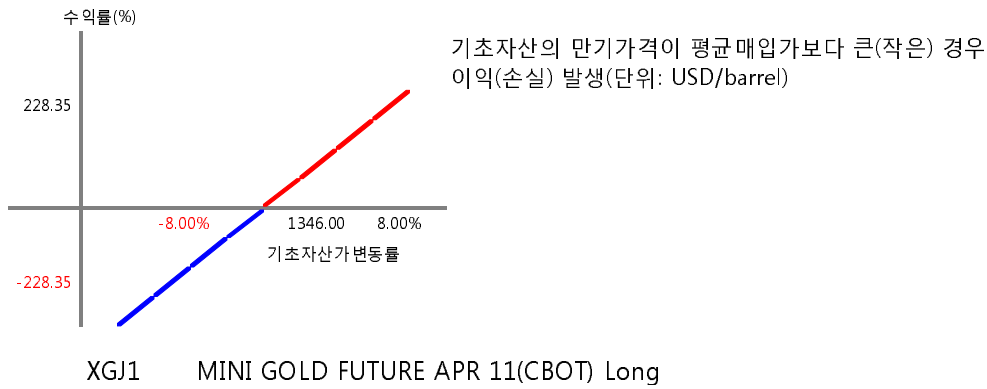
공시일: 2011-03-22

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: 2011-03-22

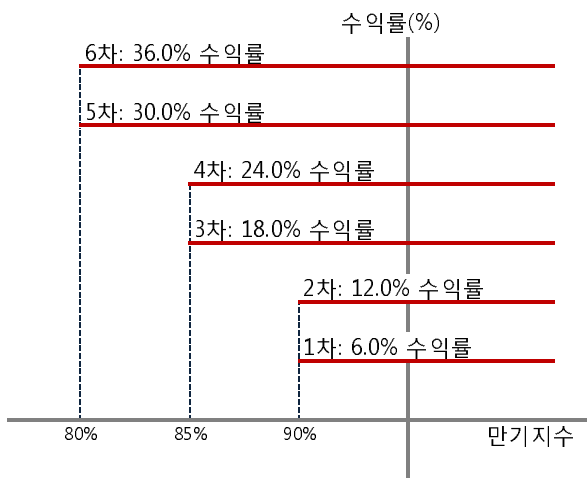
1. 계약금액

단위(백만원)

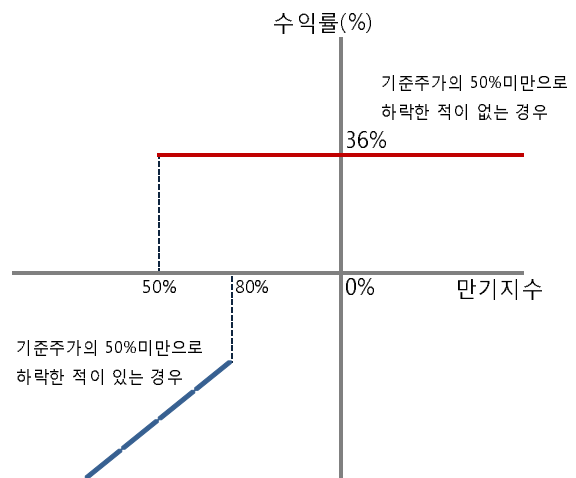
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 6,153 | 0 | 6,153 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,153 | 0 | 6,153 | 장외 |

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 | 306.40 | 256.13 | 205.87 | 155.60 | 105.33 | 55.07 | 4.80 | |
| 자산 | 282.53 | 232.26 | 182.00 | 131.73 | 81.47 | 31.20 | (19.07) | |
| 시나 | 230.66 | 180.40 | 130.13 | 79.86 | 29.60 | (20.67) | (70.93) | |
| 리오 | 150.80 | 100.53 | 50.27 | 0.00 | (50.27) | (100.53) | (150.80) | |
| | 42.93 | (7.33) | (57.60) | (107.86) | (158.13) | (208.39) | (258.66) | |
| | (92.93) | (143.19) | (193.46) | (243.72) | (293.99) | (344.25) | (394.52) | |
| | (256.78) | (307.05) | (357.31) | (407.58) | (457.85) | (508.11) | (558.38) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR6502348032 | 신한투자(ELS)1408 | 138.51 |
| KR6582353035 | 현대증권(ELS)2010-1232 | 139.95 |
| KR6661350035 | 동양(ELS)520 | 139.98 |
| KR6702358039 | H&D증권(ELS)545 | 139.95 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 558.38 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 719.40 |
|-----|--------|

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

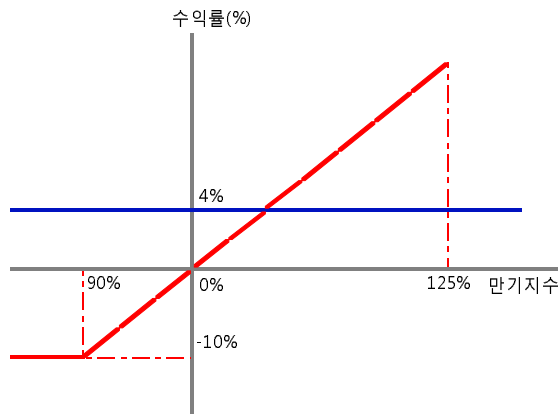
1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,773 | 0 | 1,773 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,773 | 0 | 1,773 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | (285.01) | (297.43) | (309.85) | (322.27) | (334.69) | (347.11) | (359.53) |
| | 5.33% | (146.31) | (158.73) | (171.15) | (183.57) | (195.99) | (208.41) | (220.84) |
| | 2.67% | (38.88) | (51.30) | (63.73) | (76.15) | (88.57) | (100.99) | (113.41) |
| | 0.00% | 37.26 | 24.84 | 12.42 | 0.00 | (12.42) | (24.84) | (37.26) |
| | -2.67% | 82.14 | 69.71 | 57.29 | 44.87 | 32.45 | 20.03 | 7.61 |
| | -5.33% | 95.73 | 83.31 | 70.89 | 58.47 | 46.05 | 33.62 | 21.20 |
| | -8.00% | 78.05 | 65.63 | 53.21 | 40.79 | 28.37 | 15.94 | 3.52 |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR6503339048 | 신한투자(ELS)1447 | 90.13 |
| KR6513136046 | 대신증권(ELS)1060 | 90.13 |
| KR6583371044 | 현대증권(ELS)2010-1268 | 90.13 |
| KR6703366049 | H&D증권(ELS)621 | 89.14 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 359.53 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 104.26 |
|-----|--------|

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

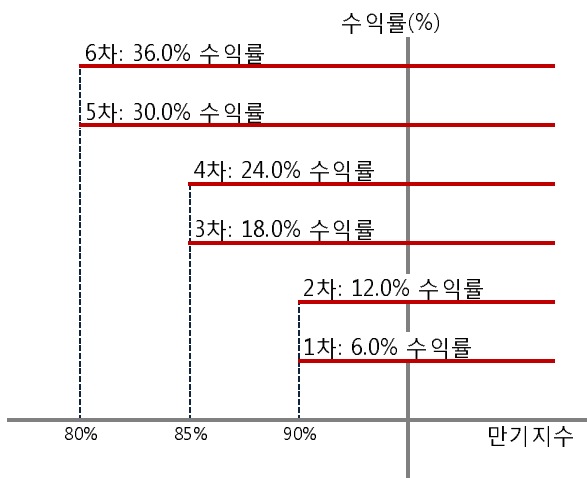
1. 계약금액

단위(백만원)

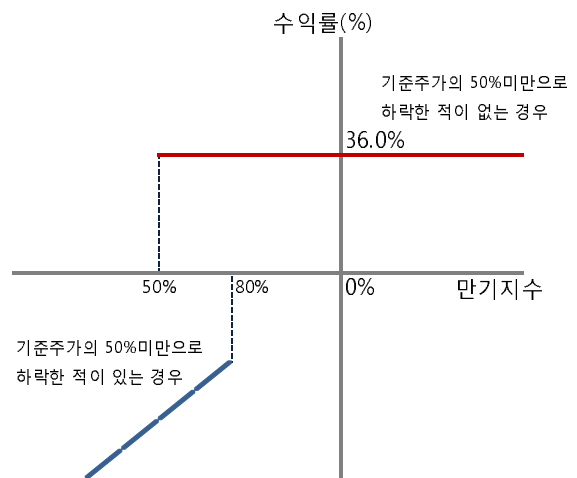
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 2,046 | 0 | 2,046 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,046 | 0 | 2,046 | 장외 |

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 | 76.47 | 69.03 | 61.59 | 54.15 | 46.71 | 39.27 | 31.83 | |
| 자산 | 58.97 | 51.53 | 44.08 | 36.64 | 29.20 | 21.76 | 14.32 | |
| 시나리오 | 40.92 | 33.48 | 26.04 | 18.60 | 11.16 | 3.71 | (3.73) | |
| | 22.32 | 14.88 | 7.44 | 0.00 | (7.44) | (14.88) | (22.32) | |
| | 3.18 | (4.26) | (11.70) | (19.14) | (26.58) | (34.02) | (41.46) | |
| | (16.51) | (23.95) | (31.39) | (38.83) | (46.27) | (53.71) | (61.15) | |
| | (36.74) | (44.18) | (51.62) | (59.06) | (66.50) | (73.94) | (81.38) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|--------------|
| KR65293A8084 | 대우증권(ELS)4375 | 20.35 |
| KR6542326089 | 신영증권(ELS)1694 | 20.35 |
| KR6559370087 | 우리투자증권(ELS)3447 | 20.35 |
| KR6669350086 | 동양W(ELS)914 | 20.35 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 81.38 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 73.21 |
|-----|-------|

메리츠주가지수연계증권제4호[ELS-파생형]

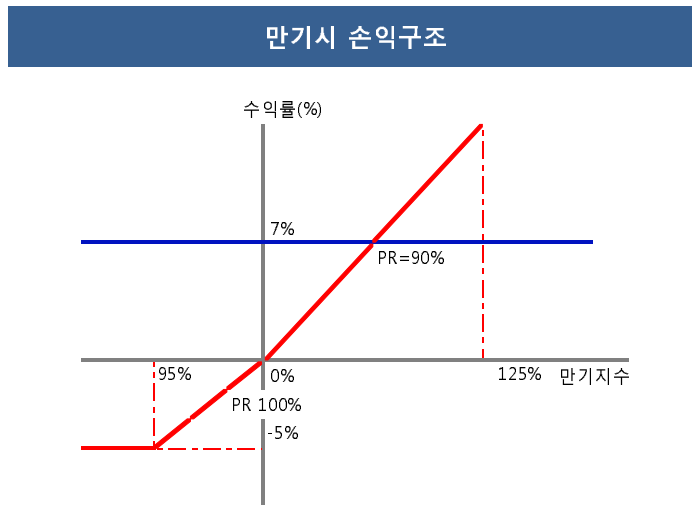
공시일: 2011-03-22

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% | 18.54 | 10.54 | 2.54 | (5.47) | (13.47) | (21.47) | (29.48) |
| | 5.33% | 25.57 | 17.56 | 9.56 | 1.56 | (6.44) | (14.45) | (22.45) |
| | 2.67% | 27.39 | 19.39 | 11.38 | 3.38 | (4.62) | (12.63) | (20.63) |
| | 0.00% | 24.01 | 16.01 | 8.00 | 0.00 | (8.00) | (16.01) | (24.01) |
| | -2.67% | 15.43 | 7.42 | (0.58) | (8.58) | (16.59) | (24.59) | (32.59) |
| | -5.33% | 1.64 | (6.36) | (14.37) | (22.37) | (30.37) | (38.38) | (46.38) |
| | -8.00% | (17.35) | (25.35) | (33.36) | (41.36) | (49.36) | (57.37) | (65.37) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|--------------|
| KR6503337091 | 신한투자(ELS)1781 | 16.34 |
| KR6543321097 | 신영증권(ELS)1729 | 16.34 |
| KR6553351091 | 우리투자증권(ELS)3513 | 16.34 |
| KR6663331090 | 동양W(ELS)912 | 16.34 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 65.37 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 69.21 |
|-----|-------|

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

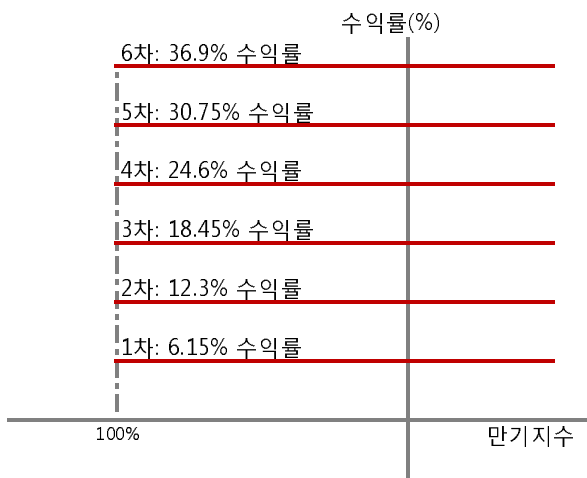
1. 계약금액

단위(백만원)

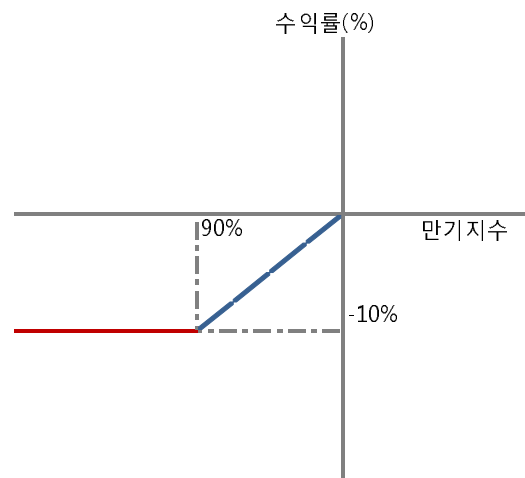
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,082 | 0 | 5,082 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,082 | 0 | 5,082 | 장외 |

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 | 226.09 | 208.08 | 190.07 | 172.07 | 154.06 | 136.05 | 118.04 | |
| 자산 | 171.57 | 153.56 | 135.55 | 117.54 | 99.53 | 81.53 | 63.52 | |
| 시나리오 | 114.21 | 96.20 | 78.20 | 60.19 | 42.18 | 24.17 | 6.16 | |
| | 54.03 | 36.02 | 18.01 | 0.00 | (18.01) | (36.02) | (54.03) | |
| | (8.99) | (27.00) | (45.01) | (63.02) | (81.03) | (99.04) | (117.04) | |
| | (74.85) | (92.85) | (110.86) | (128.87) | (146.88) | (164.89) | (182.90) | |
| | (143.53) | (161.54) | (179.55) | (197.56) | (215.56) | (233.57) | (251.58) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 62.88 |
| KR65593110A3 | 우리투자증권(ELS)3541 | 62.90 |
| KR65893090A4 | 현대증권(ELS)2010-1453 | 62.90 |
| KR66693120A9 | 동양W(ELS)927 | 62.90 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 251.58 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 266.37 |
|-----|--------|

메리츠2Star증권SEPO-5호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

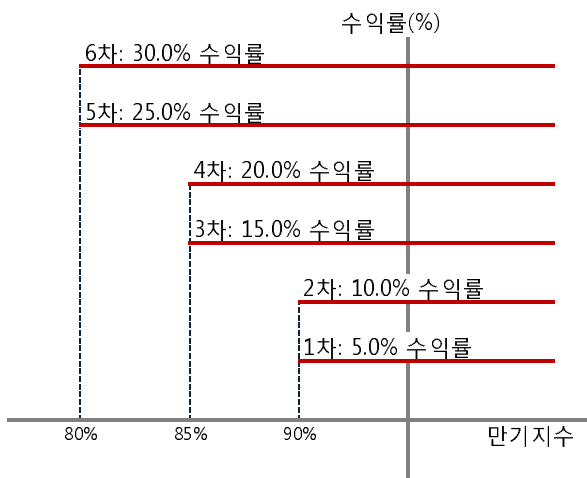
1. 계약금액

단위(백만원)

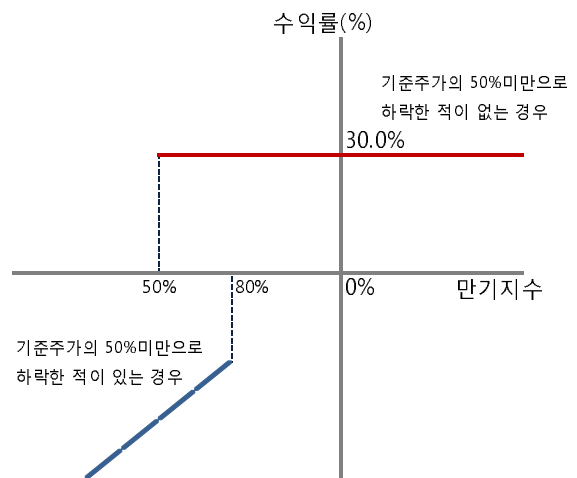
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 7,334 | 0 | 7,334 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 7,334 | 0 | 7,334 | 장외 |

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 | 4.63 | 4.02 | 3.40 | 2.79 | 2.18 | 1.57 | 0.95 | |
| 자산 | 2.79 | 2.17 | 1.56 | 0.95 | 0.34 | (0.28) | (0.89) | |
| 시나 | 1.86 | 1.24 | 0.63 | 0.02 | (0.59) | (1.21) | (1.82) | |
| 리오 | 0.00% | 1.84 | 1.23 | 0.61 | 0.00 | (0.61) | (1.23) | |
| | -2.67% | 2.73 | 2.12 | 1.51 | 0.89 | 0.28 | (0.33) | |
| | -5.33% | 4.53 | 3.92 | 3.31 | 2.70 | 2.08 | 1.47 | |
| | -8.00% | 7.25 | 6.64 | 6.02 | 5.41 | 4.80 | 4.19 | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|-------------|
| KR65023590A6 | 신한투자(ELS)1851 | 0.46 |
| KR65423360A0 | 신영증권(ELS)1774 | 0.46 |
| KR65523630A5 | 우리투자증권(ELS)3578 | 0.46 |
| KR66623500A7 | 동양W(ELS)925 | 0.46 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 1.84 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 36.86 |
|-----|-------|

메리츠한증지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

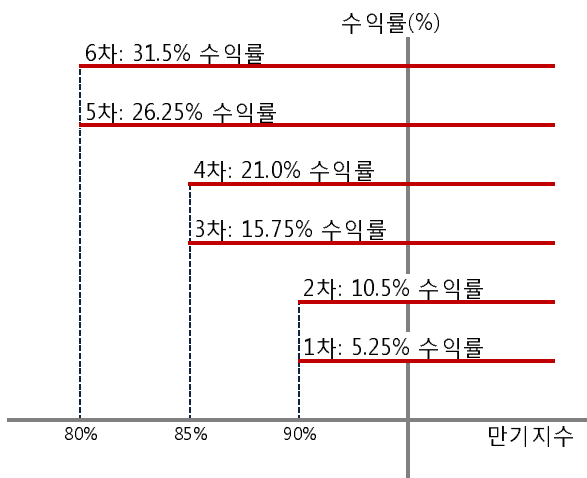
1. 계약금액

단위(백만원)

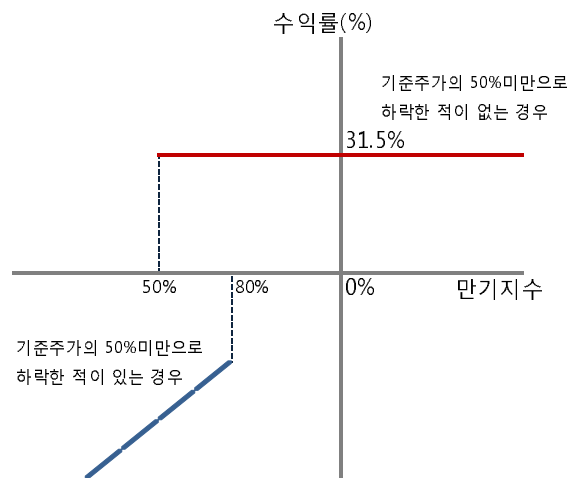
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,668 | 0 | 5,668 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,668 | 0 | 5,668 | 장외 |

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 | 68.10 | 68.33 | 68.56 | 68.79 | 69.02 | 69.25 | 69.48 | |
| 자산 | 14.20 | 14.43 | 14.66 | 14.89 | 15.12 | 15.35 | 15.58 | |
| 시나리오 | (8.72) | (8.50) | (8.27) | (8.04) | (7.81) | (7.58) | (7.35) | |
| | (0.69) | (0.46) | (0.23) | 0.00 | 0.23 | 0.46 | 0.69 | |
| | 38.32 | 38.55 | 38.78 | 39.00 | 39.23 | 39.46 | 39.69 | |
| | 108.29 | 108.52 | 108.75 | 108.98 | 109.20 | 109.43 | 109.66 | |
| | 209.23 | 209.45 | 209.68 | 209.91 | 210.14 | 210.37 | 210.60 | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|-------------|
| KR65533190B6 | 우리투자증권(ELS)3658 | 2.18 |
| KR65833160B6 | 현대증권(ELS)2010-1489 | 2.18 |
| KR65933190B2 | 미래에셋증권(ELS)1541 | 2.18 |
| KR66633200B0 | 동양W(ELS)930 | 2.18 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 8.72 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 197.64 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제11호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

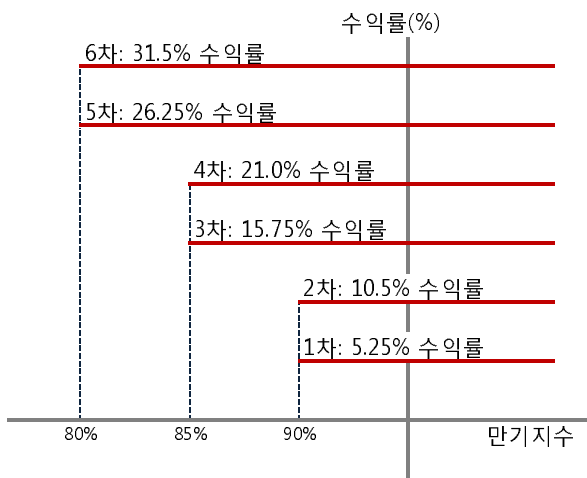
1. 계약금액

단위(백만원)

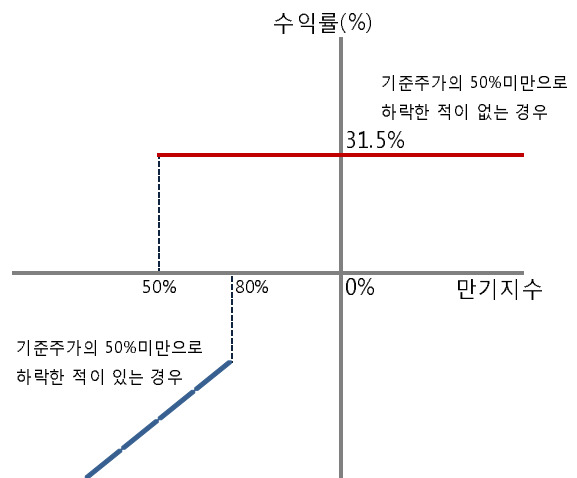
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,193 | 0 | 5,193 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,193 | 0 | 5,193 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|----|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| 기초 | 9.52 | 9.89 | 10.27 | 10.64 | 11.01 | 11.39 | 11.76 | |
| 자산 | (15.51) | (15.13) | (14.76) | (14.39) | (14.01) | (13.64) | (13.27) | |
| 시나 | (19.05) | (18.68) | (18.31) | (17.93) | (17.56) | (17.19) | (16.81) | |
| 리오 | (1.12) | (0.75) | (0.37) | 0.00 | 0.37 | 0.75 | 1.12 | |
| | 38.30 | 38.67 | 39.04 | 39.42 | 39.79 | 40.16 | 40.54 | |
| | 99.19 | 99.57 | 99.94 | 100.31 | 100.69 | 101.06 | 101.43 | |
| | 181.57 | 181.94 | 182.32 | 182.69 | 183.06 | 183.44 | 183.81 | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|--------------|
| KR65033630B6 | 신한투자(ELS)1958 | 4.76 |
| KR65833600B1 | 현대증권(ELS)2010-1518 | 4.76 |
| KR65933700B8 | 미래에셋증권(ELS)1604 | 4.76 |
| KR66633950B0 | 동양W(ELS)942 | 4.76 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 19.05 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 192.48 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

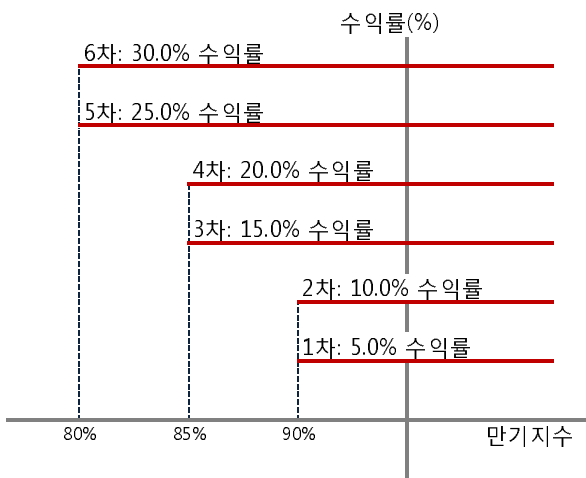
1. 계약금액

단위(백만원)

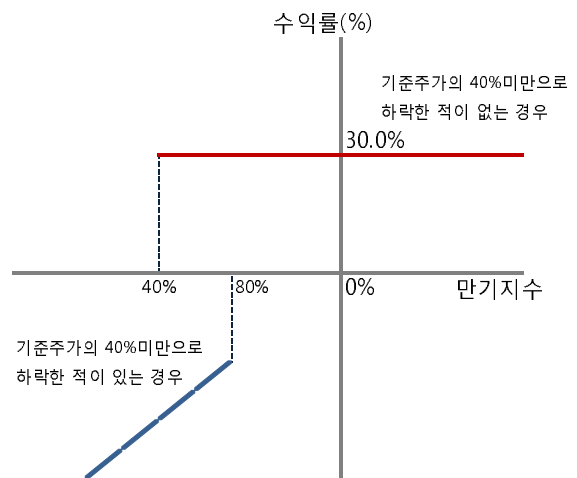
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 6,539 | 0 | 6,539 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,539 | 0 | 6,539 | 장외 |

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 | 57.17 | 59.64 | 62.10 | 64.57 | 67.04 | 69.50 | 71.97 | |
| 자산 | 4.71 | 7.18 | 9.64 | 12.11 | 14.58 | 17.04 | 19.51 | |
| 시나리오 | (16.82) | (14.35) | (11.88) | (9.41) | (6.95) | (4.48) | (2.01) | |
| | (7.40) | (4.93) | (2.47) | 0.00 | 2.47 | 4.93 | 7.40 | |
| | 32.95 | 35.42 | 37.88 | 40.35 | 42.82 | 45.29 | 47.75 | |
| | 104.24 | 106.71 | 109.17 | 111.64 | 114.11 | 116.58 | 119.04 | |
| | 206.47 | 208.93 | 211.40 | 213.87 | 216.34 | 218.80 | 221.27 | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR65433540B3 | 신영증권(ELS)1854 | 4.20 |
| KR65833780B1 | 현대증권(ELS)2010-1527 | 4.20 |
| KR65933840B2 | 미래에셋증권(ELS)1614 | 4.20 |
| KR66633AC0B8 | 동양W(ELS)946 | 4.20 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 16.82 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 181.06

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

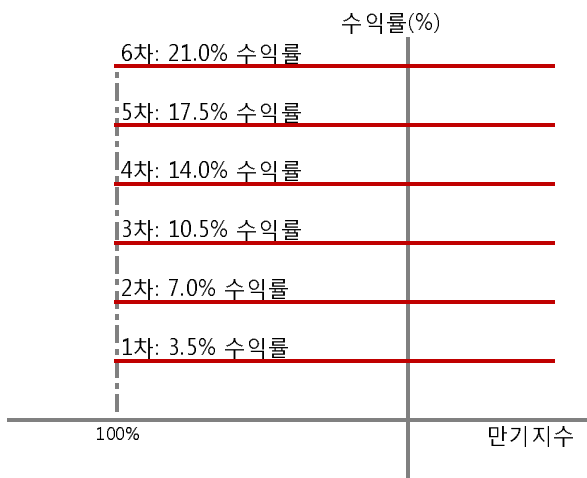
1. 계약금액

단위(백만원)

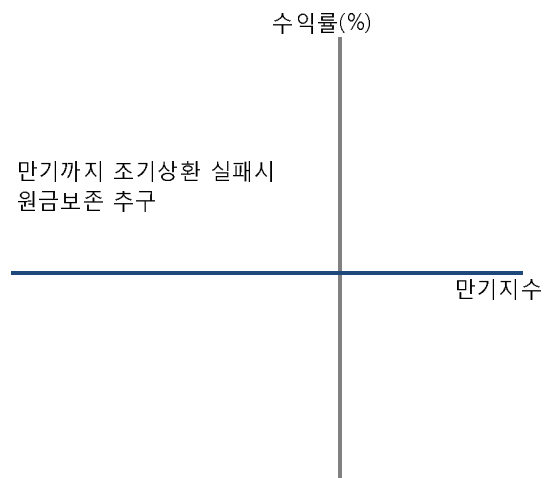
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,524 | 0 | 3,524 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,524 | 0 | 3,524 | 장외 |

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 | 29.95 | 26.56 | 23.16 | 19.77 | 16.37 | 12.98 | 9.58 | |
| 자산 | 24.17 | 20.77 | 17.38 | 13.98 | 10.59 | 7.19 | 3.80 | |
| 시나리오 | 17.58 | 14.18 | 10.79 | 7.39 | 4.00 | 0.60 | (2.79) | |
| | 10.19 | 6.79 | 3.40 | 0.00 | (3.40) | (6.79) | (10.19) | |
| | 1.99 | (1.41) | (4.80) | (8.20) | (11.59) | (14.99) | (18.39) | |
| | (7.02) | (10.41) | (13.81) | (17.20) | (20.60) | (24.00) | (27.39) | |
| | (16.83) | (20.22) | (23.62) | (27.01) | (30.41) | (33.81) | (37.20) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|--------------|
| KR65523460C3 | 우리투자증권(ELS)3756 | 9.30 |
| KR65823220C8 | 현대증권(ELS)2010-1534 | 9.30 |
| KR65923520C0 | 미래에셋증권(ELS)1637 | 9.30 |
| KR66623360C2 | 동양W(ELS)950 | 9.30 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 37.20 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 39.33 |
|-----|-------|

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

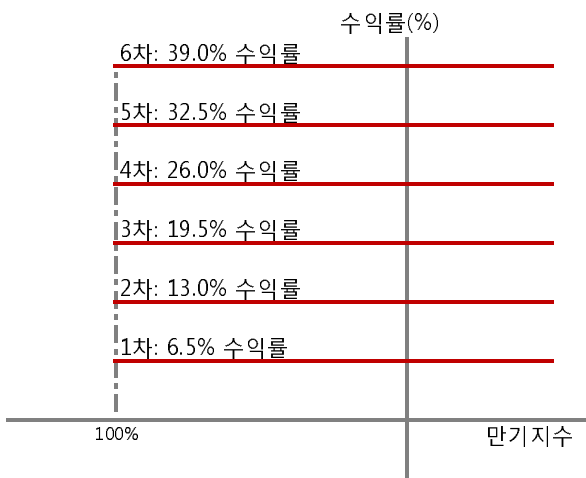
1. 계약금액

단위(백만원)

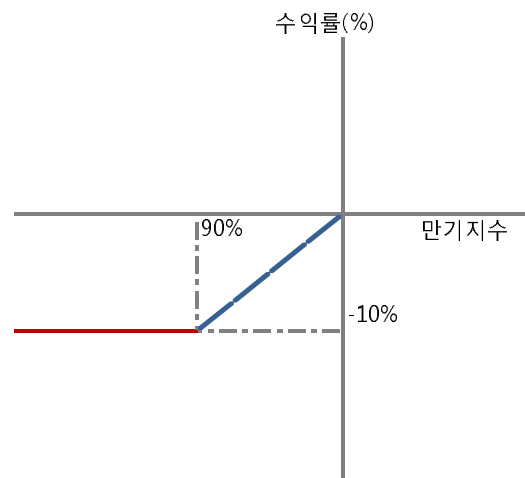
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,455 | 0 | 3,455 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,455 | 0 | 3,455 | 장외 |

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 | 127.75 | 118.71 | 109.66 | 100.62 | 91.58 | 82.53 | 73.49 | |
| 자산 | 93.93 | 84.88 | 75.84 | 66.80 | 57.75 | 48.71 | 39.66 | |
| 시나리오 | 60.39 | 51.34 | 42.30 | 33.26 | 24.21 | 15.17 | 6.12 | |
| | 27.13 | 18.09 | 9.04 | 0.00 | (9.04) | (18.09) | (27.13) | |
| | (5.84) | (14.88) | (23.93) | (32.97) | (42.01) | (51.06) | (60.10) | |
| | (38.53) | (47.57) | (56.61) | (65.66) | (74.70) | (83.74) | (92.79) | |
| | (70.93) | (79.97) | (89.02) | (98.06) | (107.10) | (116.15) | (125.19) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65523450C4 | 우리투자증권(ELS)3755 | 31.30 |
| KR65823210C9 | 현대증권(ELS)2010-1533 | 31.30 |
| KR65923510C1 | 미래에셋증권(ELS)1636 | 31.30 |
| KR66623340C4 | 동양W(ELS)949 | 31.30 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 125.19 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 133.78 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제13호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

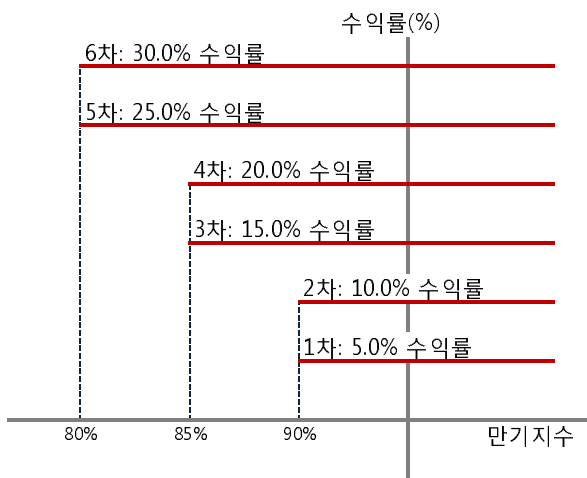
1. 계약금액

단위(백만원)

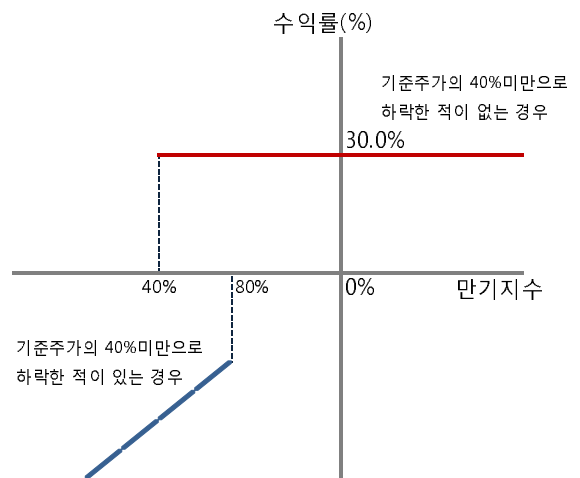
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,429 | 0 | 5,429 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,429 | 0 | 5,429 | 장외 |

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 | 33.78 | 35.65 | 37.53 | 39.40 | 41.27 | 43.15 | 45.02 | |
| 자산 | (0.67) | 1.20 | 3.07 | 4.95 | 6.82 | 8.69 | 10.57 | |
| 시나리오 | (13.81) | (11.93) | (10.06) | (8.19) | (6.31) | (4.44) | (2.57) | |
| | (5.62) | (3.75) | (1.87) | 0.00 | 1.87 | 3.75 | 5.62 | |
| | 23.89 | 25.76 | 27.64 | 29.51 | 31.38 | 33.25 | 35.13 | |
| | 74.72 | 76.59 | 78.46 | 80.34 | 82.21 | 84.08 | 85.96 | |
| | 146.87 | 148.74 | 150.61 | 152.49 | 154.36 | 156.23 | 158.11 | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|--------------|
| KR65033AD0C3 | 신한투자(ELS)2106 | 3.43 |
| KR65431510C6 | 신영증권(ELS)1904 | 3.43 |
| KR65933AG0C1 | 미래에셋증권(ELS)1700 | 3.53 |
| KR66633730C4 | 동양W(ELS)956 | 3.43 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 13.81 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 140.02 |
|-----|--------|

메리츠주가지수연계증권투자신탁제7호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

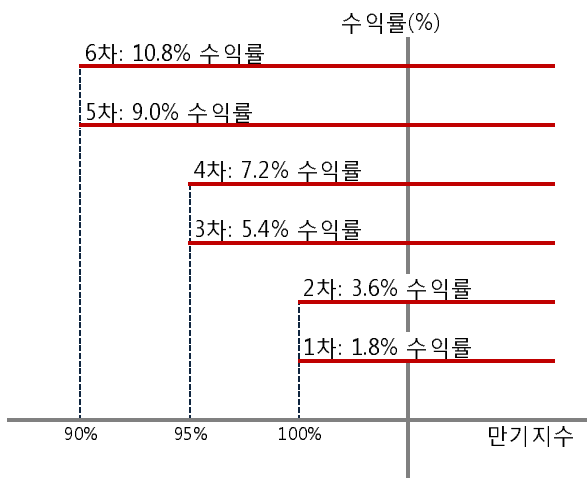
1. 계약금액

단위(백만원)

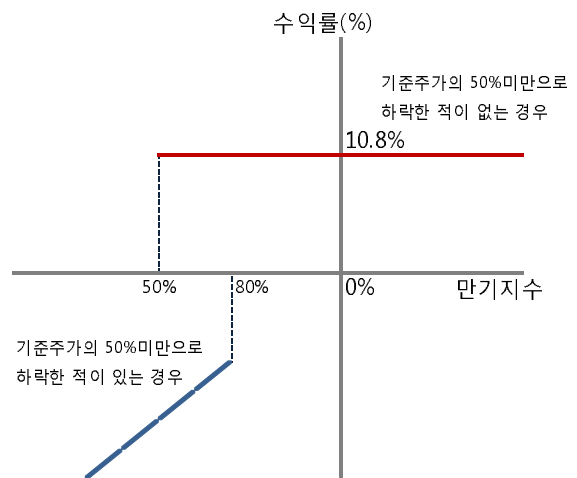
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |

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 자산 시나리오 | 8.00% | (973.77) | (965.55) | (957.33) | (949.12) | (940.90) | (932.69) | (924.47) |
| | 5.33% | (623.88) | (615.67) | (607.45) | (599.24) | (591.02) | (582.80) | (574.59) |
| | 2.67% | (307.51) | (299.30) | (291.08) | (282.86) | (274.65) | (266.43) | (258.21) |
| | 0.00% | (24.65) | (16.43) | (8.22) | 0.00 | 8.22 | 16.43 | 24.65 |
| | -2.67% | 224.70 | 232.92 | 241.14 | 249.35 | 257.57 | 265.79 | 274.00 |
| | -5.33% | 440.55 | 448.76 | 456.98 | 465.20 | 473.41 | 481.63 | 489.84 |
| | -8.00% | 622.88 | 631.10 | 639.31 | 647.53 | 655.75 | 663.96 | 672.18 |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR65233AF0C9 | 대우증권ELS4907 | 243.44 |
| KR65533A90C2 | 우리투자증권(ELS)3859 | 243.44 |
| KR66633740C3 | 동양W(ELS)961 | 243.44 |
| KR66733310C4 | 동부증권(ELS)462 | 243.44 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 973.77 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 515.95 |
|-----|--------|

메리츠주가지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

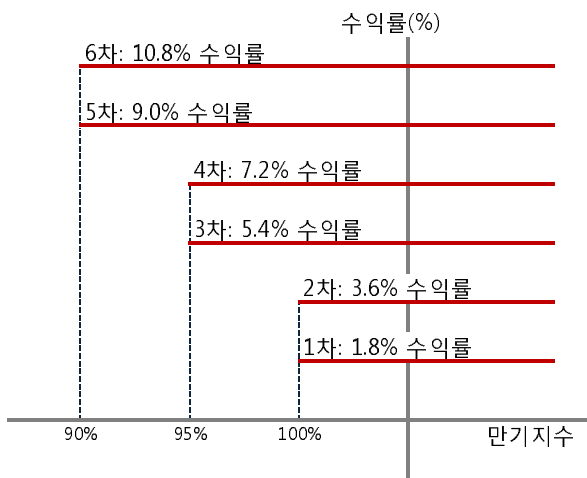
1. 계약금액

단위(백만원)

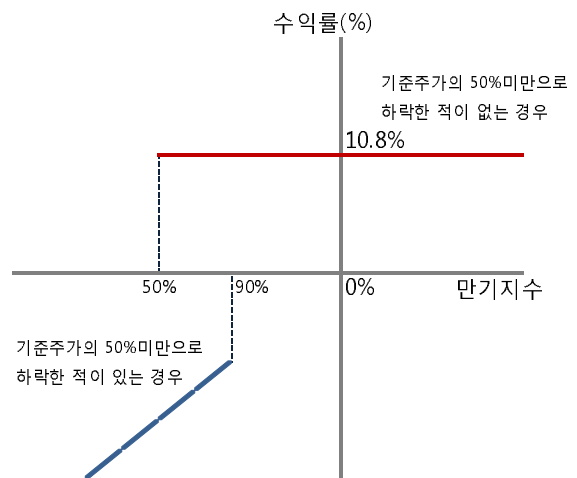
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |

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 자산 시나리오 | 8.00% | (991.33) | (980.81) | (970.30) | (959.78) | (949.27) | (938.75) | (928.24) |
| | 5.33% | (635.82) | (625.30) | (614.79) | (604.28) | (593.76) | (583.25) | (572.73) |
| | 2.67% | (315.89) | (305.38) | (294.86) | (284.35) | (273.83) | (263.32) | (252.81) |
| | 0.00% | (31.54) | (21.03) | (10.51) | 0.00 | 10.51 | 21.03 | 31.54 |
| | -2.67% | 217.23 | 227.74 | 238.25 | 248.77 | 259.28 | 269.80 | 280.31 |
| | -5.33% | 430.42 | 440.93 | 451.44 | 461.96 | 472.47 | 482.99 | 493.50 |
| | -8.00% | 608.03 | 618.54 | 629.05 | 639.57 | 650.08 | 660.60 | 671.11 |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|---------------|---------------|
| KR6503371116 | 신한투자(ELS)2186 | 247.83 |
| KR65233AF118 | 대우증권ELS5040 | 247.83 |
| KR6663358119 | 동양W(ELS)970 | 247.83 |
| KR6673314110 | 해피플러스(ELS)468 | 247.83 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 991.33 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 829.29 |
|-----|--------|

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

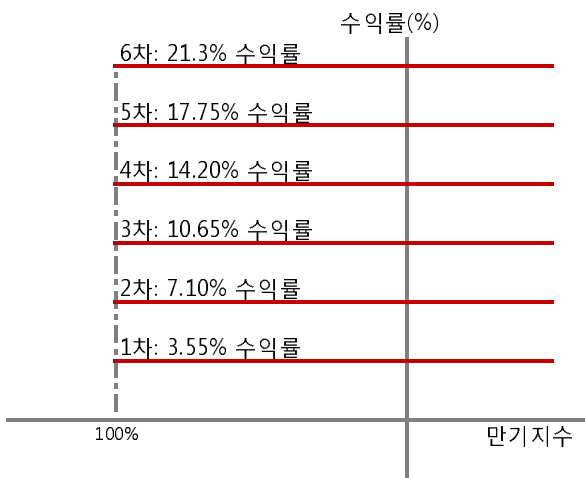
1. 계약금액

단위(백만원)

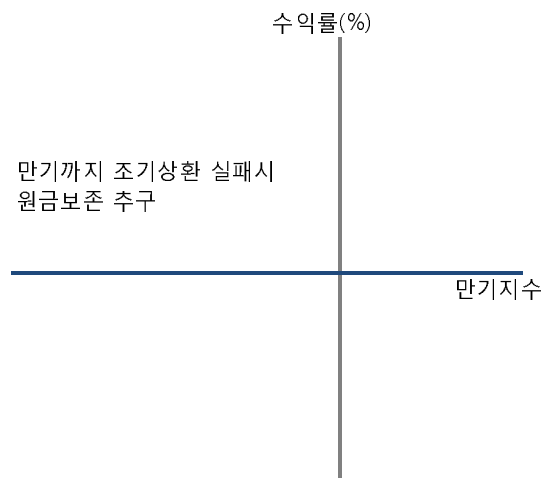
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,212 | 0 | 1,212 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,212 | 0 | 1,212 | 장외 |

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 | 8.78 | 7.62 | 6.46 | 5.30 | 4.14 | 2.98 | 1.82 | |
| 자산 | 5.33% | 7.25 | 6.09 | 4.93 | 3.77 | 2.61 | 0.29 | |
| 시나리오 | 2.67% | 5.48 | 4.32 | 3.16 | 2.00 | 0.84 | (1.48) | |
| | 0.00% | 3.48 | 2.32 | 1.16 | 0.00 | (1.16) | (3.48) | |
| | -2.67% | 1.24 | 0.08 | (1.07) | (2.23) | (3.39) | (5.71) | |
| | -5.33% | (1.22) | (2.38) | (3.54) | (4.70) | (5.86) | (8.18) | |
| | -8.00% | (3.93) | (5.09) | (6.25) | (7.41) | (8.57) | (10.89) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6552345128 | 우리투자증권(ELS)3989 | 2.72 |
| KR6582317121 | 현대증권(ELS)2011-1588 | 2.72 |
| KR6592350120 | 미래에셋증권(ELS)1896 | 2.72 |
| KR6662316126 | 동양W(ELS)974 | 2.72 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 10.89 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 12.47

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

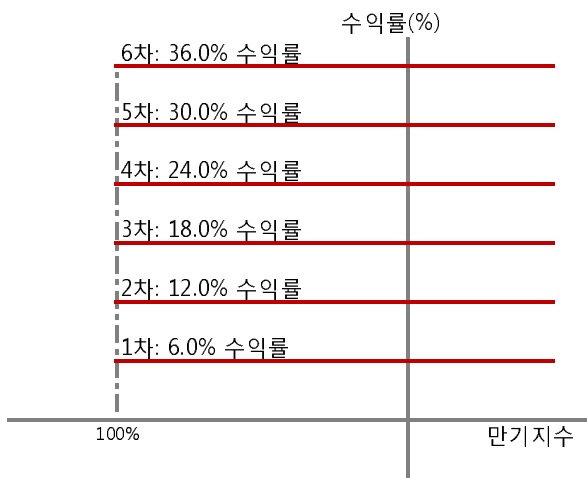
1. 계약금액

단위(백만원)

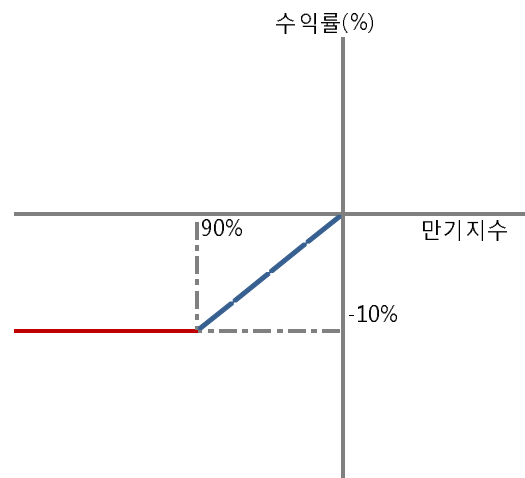
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 741 | 0 | 741 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 741 | 0 | 741 | 장외 |

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 자산 시나 리오 | 8.00% | 10.35 | 8.60 | 6.85 | 5.10 | 3.36 | 1.61 | (0.14) |
| | 5.33% | 9.02 | 7.27 | 5.53 | 3.78 | 2.03 | 0.28 | (1.47) |
| | 2.67% | 7.32 | 5.57 | 3.82 | 2.07 | 0.33 | (1.42) | (3.17) |
| | 0.00% | 5.25 | 3.50 | 1.75 | 0.00 | (1.75) | (3.50) | (5.25) |
| | -2.67% | 2.80 | 1.05 | (0.70) | (2.45) | (4.20) | (5.95) | (7.70) |
| | -5.33% | (0.02) | (1.77) | (3.52) | (5.27) | (7.02) | (8.77) | (10.52) |
| | -8.00% | (3.22) | (4.97) | (6.72) | (8.47) | (10.21) | (11.96) | (13.71) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6502331129 | 신한투자(ELS)2235 | 3.43 |
| KR6552343123 | 우리투자증권(ELS)3988 | 3.43 |
| KR6582319127 | 현대증권(ELS)2011-1589 | 3.43 |
| KR6662317124 | 동양W(ELS)975 | 3.43 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 13.71 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 14.81

메리츠주가지수연계증권제9호[ELS-파생형]

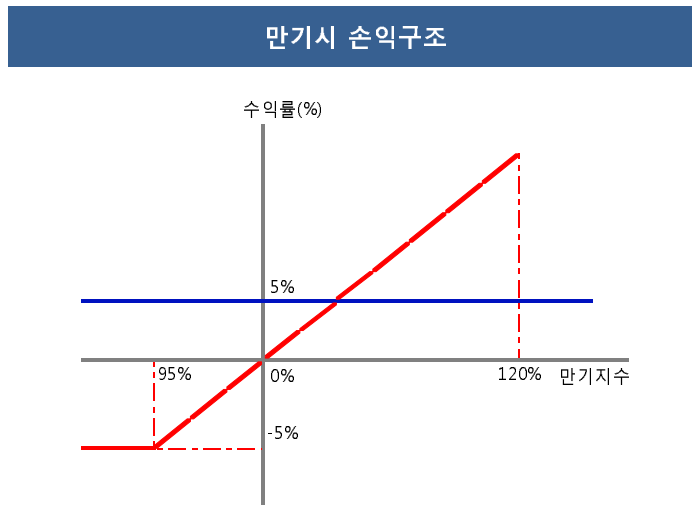
공시일: 2011-03-22

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 자산 시나 리오 | 8.00% | 9.40 | 7.26 | 5.13 | 3.00 | 0.86 | (1.27) | (3.41) |
| | 5.33% | 9.15 | 7.02 | 4.88 | 2.75 | 0.61 | (1.52) | (3.66) |
| | 2.67% | 8.15 | 6.02 | 3.88 | 1.75 | (0.39) | (2.52) | (4.66) |
| | 0.00% | 6.40 | 4.27 | 2.13 | 0.00 | (2.13) | (4.27) | (6.40) |
| | -2.67% | 3.91 | 1.77 | (0.36) | (2.50) | (4.63) | (6.77) | (8.90) |
| | -5.33% | 0.66 | (1.48) | (3.61) | (5.74) | (7.88) | (10.01) | (12.15) |
| | -8.00% | (3.34) | (5.47) | (7.61) | (9.74) | (11.88) | (14.01) | (16.14) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|--------------|
| KR6503330120 | 신한투자(ELS)2234 | 4.04 |
| KR6553344120 | 우리투자증권(ELS)3990 | 4.04 |
| KR6583318128 | 현대증권(ELS)2011-1587 | 4.04 |
| KR6663314120 | 동양W(ELS)973 | 4.04 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 16.14 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 18.26 |
|-----|-------|

메리츠주가지수연계증권제10호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

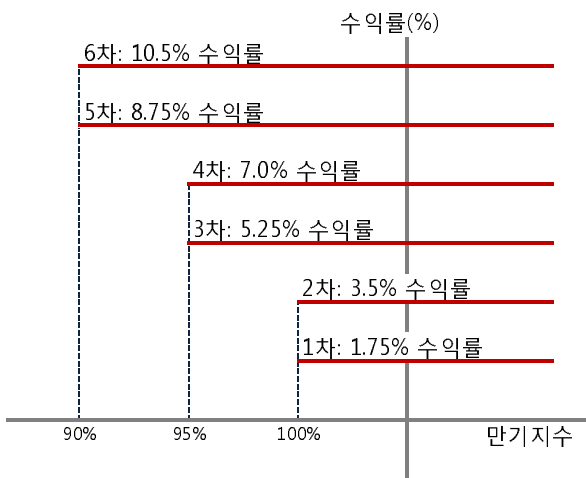
1. 계약금액

단위(백만원)

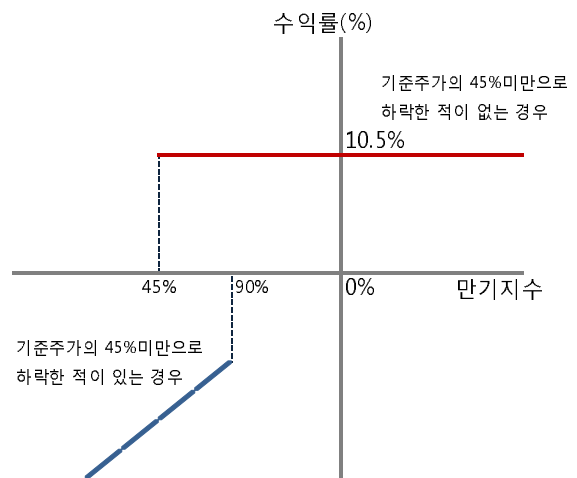
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,001 | 0 | 20,001 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,001 | 0 | 20,001 | 장외 |

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 자산 시나리오 | 8.00% | (746.48) | (736.30) | (726.13) | (715.96) | (705.79) | (695.62) | (685.45) |
| | 5.33% | (495.71) | (485.54) | (475.37) | (465.19) | (455.02) | (444.85) | (434.68) |
| | 2.67% | (257.05) | (246.88) | (236.71) | (226.54) | (216.37) | (206.20) | (196.02) |
| | 0.00% | (30.51) | (20.34) | (10.17) | 0.00 | 10.17 | 20.34 | 30.51 |
| | -2.67% | 183.91 | 194.08 | 204.25 | 214.43 | 224.60 | 234.77 | 244.94 |
| | -5.33% | 386.22 | 396.39 | 406.57 | 416.74 | 426.91 | 437.08 | 447.25 |
| | -8.00% | 576.42 | 586.59 | 596.76 | 606.93 | 617.11 | 627.28 | 637.45 |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR6553310121 | 우리투자증권(ELS)3970 | 186.63 |
| KR6663311126 | 동양W(ELS)976 | 186.61 |
| KR6673301125 | 해피플러스(ELS)479 | 186.61 |
| KR6703309122 | H&D증권(ELS)1426 | 186.61 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 746.48 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 844.49 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제14호[ELS-파생형]

공시일: 2011-03-22

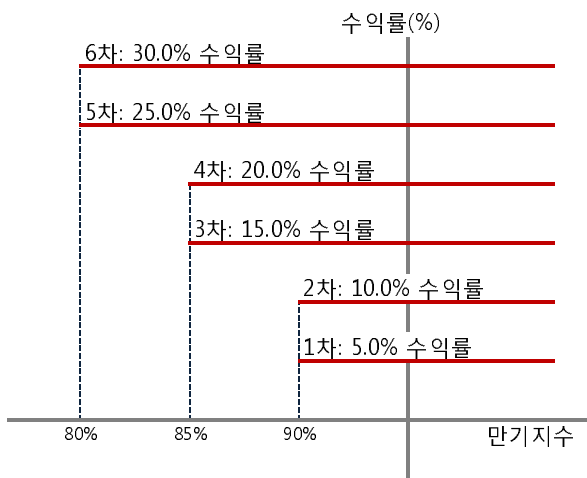
1. 계약금액

단위(백만원)

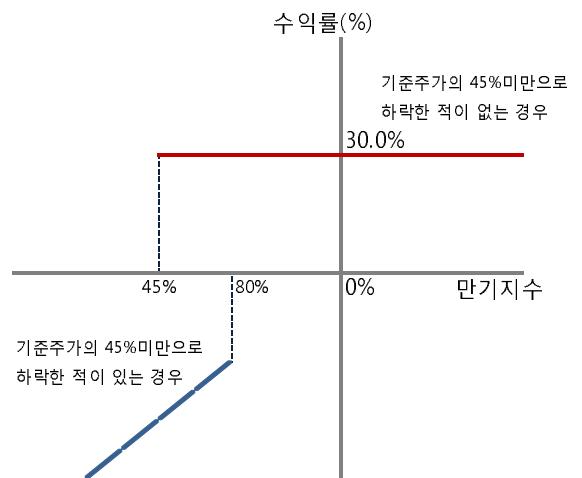
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 12,045 | 0 | 12,045 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 12,045 | 0 | 12,045 | 장외 |

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 | 18.04 | 21.08 | 24.12 | 27.16 | 30.21 | 33.25 | 36.29 | |
| 자산 | (19.08) | (16.04) | (13.00) | (9.95) | (6.91) | (3.87) | (0.83) | |
| 시나리오 | (28.14) | (25.10) | (22.05) | (19.01) | (15.97) | (12.92) | (9.88) | |
| | (9.13) | (6.09) | (3.04) | 0.00 | 3.04 | 6.09 | 9.13 | |
| | 37.95 | 40.99 | 44.03 | 47.07 | 50.12 | 53.16 | 56.20 | |
| | 113.08 | 116.13 | 119.17 | 122.21 | 125.26 | 128.30 | 131.34 | |
| | 216.29 | 219.33 | 222.37 | 225.42 | 228.46 | 231.50 | 234.54 | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6503347124 | 신한투자(ELS)2253 | 7.03 |
| KR6553362122 | 우리투자증권(ELS)4082 | 7.03 |
| KR6593357124 | 미래에셋증권(ELS)1913 | 7.03 |
| KR6663329128 | 동양W(ELS)977 | 7.03 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 28.14 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 184.81