

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

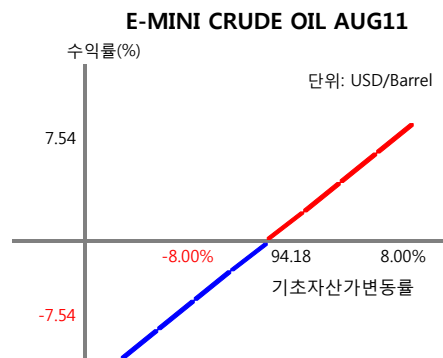
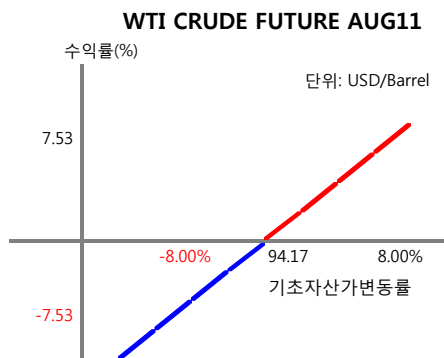
공시일: 2011-06-22

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------------------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | WTI Crude Oil | 선물 | 102 | 0 | 102 | 장내 |
| 신규 | E-MINI Crude Oil | 선물 | 51 | 0 | 51 | 장내 |
| 누계 | | 선물 | 153 | 0 | 153 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

| 구분 | WTI CRUDE F | E-MINI CRUD | TOTAL | |
|----------------------|-------------|-------------|-------|--------|
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | 8.15 | 4.08 | 12.23 |
| | 5.33% | 5.43 | 2.72 | 8.15 |
| | 2.67% | 2.72 | 1.36 | 4.08 |
| | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | -2.72 | -1.36 | -4.08 |
| | -5.33% | -5.43 | -2.72 | -8.15 |
| | -8.00% | -8.15 | -4.08 | -12.23 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| | |
|------------------------|--------------|
| WTI CRUDE FUTURE AUG11 | 8.15 |
| E-MINI CRUDE OIL AUG11 | 4.08 |
| 총 최대손실 예상금액 | 12.23 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 39.73 |
|-----|-------|

메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

공시일: 2011-06-22

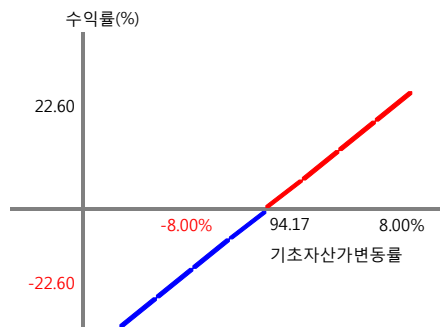
1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|---------------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | WTI Crude Oil | 선물 | 306 | 0 | 306 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | | 306 | 0 | 306 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

WTI CRUDE FUTURE AUG11



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

| 구분 | WTI CRUDE F |
|--------|-------------|
| 8.00% | 24.45 |
| 5.33% | 16.29 |
| 2.67% | 8.16 |
| 0.00% | 0.00 |
| -2.67% | -8.16 |
| -5.33% | -16.29 |
| -8.00% | -24.45 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| | |
|------------------------|-------|
| WTI CRUDE FUTURE AUG11 | 24.45 |
|------------------------|-------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 79.45 |
|-----|-------|

메리츠PremiumCommodity특별자산1

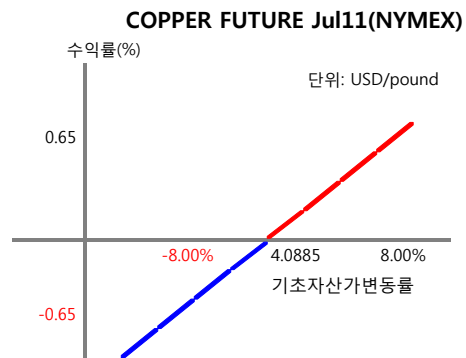
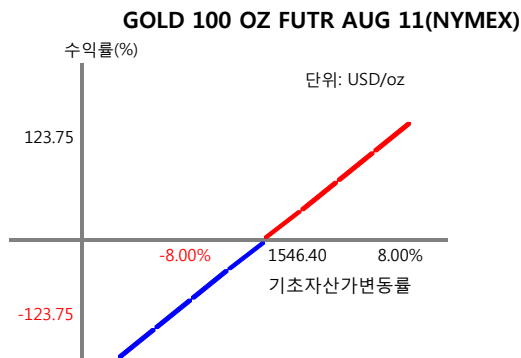
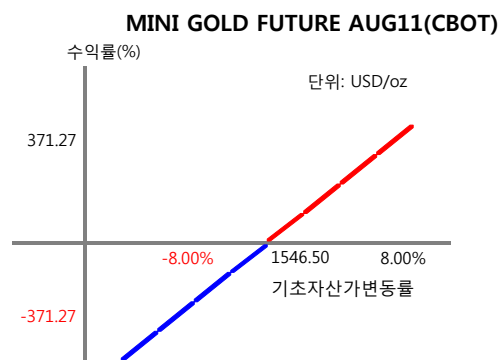
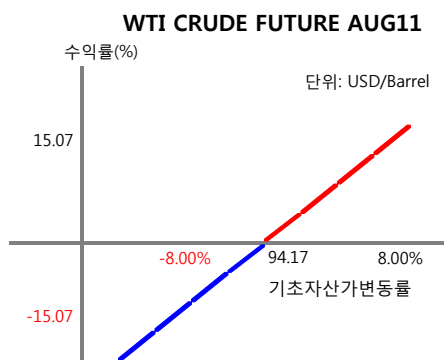
공시일: 2011-06-22

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|---------------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | WTI CRUDE Oil | 선물 | 204 | 0 | 204 | 장내 |
| 신규 | MINI GOLD | 선물 | 251 | 0 | 251 | 장내 |
| 신규 | GOLD 100OZ | 선물 | 167 | 0 | 167 | 장내 |
| 신규 | COPPER | 선물 | 221 | 0 | 221 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 843 | 0 | 843 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

| 구분 | WTI CRUDE F | MINI GOLD F | GOLD 100 OZ | COPPER FUT | TOTAL | |
|----------------------|-------------|-------------|-------------|------------|--------|--------|
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | 16.30 | 20.08 | 13.39 | 17.69 | 67.46 |
| | 5.33% | 10.86 | 13.38 | 8.92 | 11.79 | 44.95 |
| | 2.67% | 5.44 | 6.70 | 4.47 | 5.91 | 22.51 |
| | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | -5.44 | -6.70 | -4.47 | -5.91 | -22.51 |
| | -5.33% | -10.86 | -13.38 | -8.92 | -11.79 | -44.95 |
| | -8.00% | -16.30 | -20.08 | -13.39 | -17.69 | -67.46 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| | |
|--------------------------------|--------------|
| WTI CRUDE FUTURE AUG11 | 16.30 |
| MINI GOLD FUTURE AUG11(CBOT) | 20.08 |
| GOLD 100 OZ FUTR AUG 11(NYMEX) | 13.39 |
| COPPER FUTURE Jul11(NYMEX) | 17.69 |
| 총 최대손실 예상금액 | 67.46 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 219.19

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

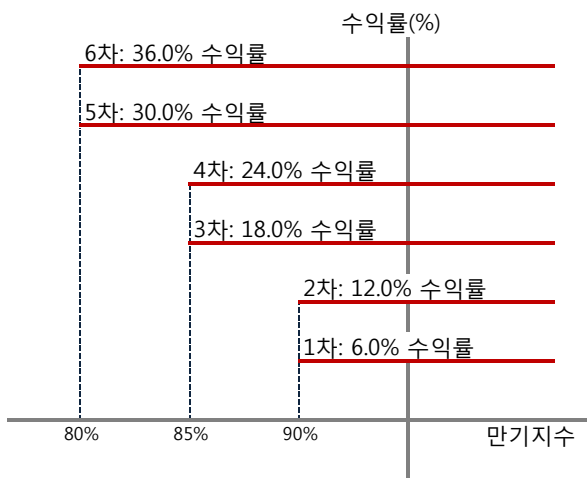
1. 계약금액

단위(백만원)

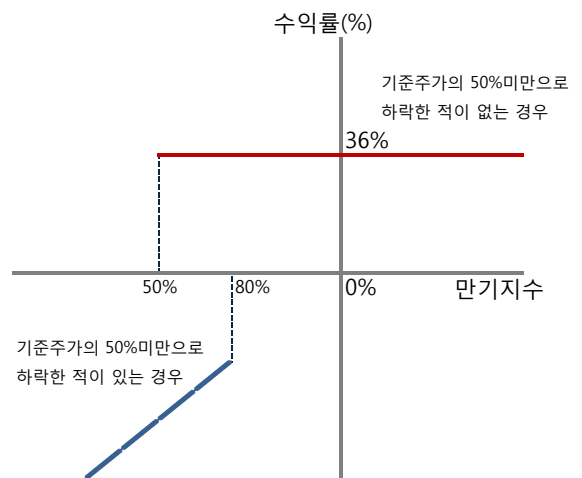
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 6,153 | 0 | 6,153 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,153 | 0 | 6,153 | 장외 |

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 | 240.60 | 206.49 | 172.39 | 138.28 | 104.17 | 70.07 | 35.96 | |
| 자산 | 5.33% | 218.36 | 184.25 | 150.14 | 116.04 | 81.93 | 47.83 | |
| 자 | 2.67% | 172.26 | 138.16 | 104.05 | 69.94 | 35.84 | 1.73 | |
| 사 | 0.00% | 102.32 | 68.21 | 34.11 | 0.00 | (34.11) | (68.21) | |
| 나 | -2.67% | 8.52 | (25.58) | (59.69) | (93.80) | (127.90) | (162.01) | |
| 리 | -5.33% | (109.13) | (143.23) | (177.34) | (211.45) | (245.55) | (279.66) | |
| 오 | -8.00% | (250.63) | (284.73) | (318.84) | (352.95) | (387.05) | (421.16) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR6502348032 | 신한투자(ELS)1408 | 112.53 |
| KR6582353035 | 현대증권(ELS)2010-1232 | 114.62 |
| KR6661350035 | 동양(ELS)520 | 114.27 |
| KR6702358039 | H&D증권(ELS)545 | 113.85 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 455.27 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 426.41 |
|-----|--------|

메리츠2Star증권KIKG-1[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

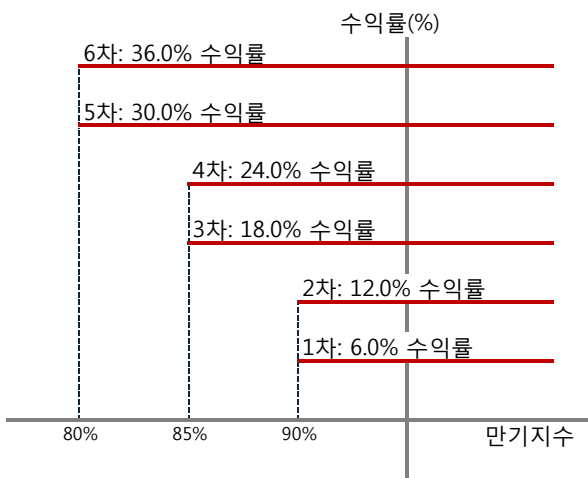
1. 계약금액

단위(백만원)

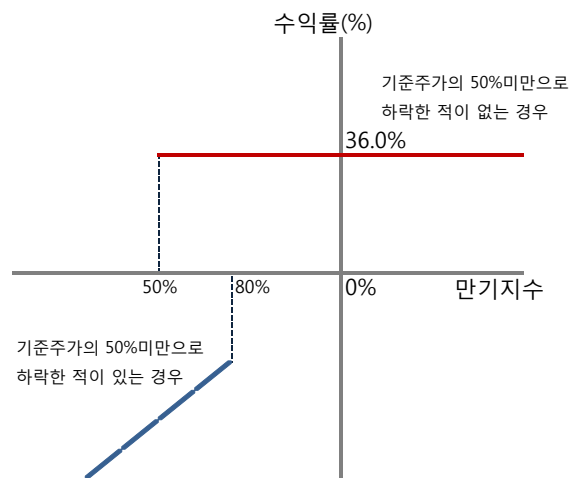
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 2,046 | 0 | 2,046 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,046 | 0 | 2,046 | 장외 |

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 | 42.06 | 38.97 | 35.88 | 32.78 | 29.69 | 26.60 | 23.51 | |
| 자산 | 5.33% | 35.52 | 32.43 | 29.34 | 26.25 | 23.16 | 20.07 | |
| 시나 | 2.67% | 24.59 | 21.50 | 18.41 | 15.32 | 12.23 | 9.14 | |
| 리오 | 0.00% | 9.27 | 6.18 | 3.09 | 0.00 | (3.09) | (6.18) | |
| | -2.67% | (10.44) | (13.53) | (16.62) | (19.71) | (22.80) | (25.90) | |
| | -5.33% | (34.55) | (37.64) | (40.73) | (43.82) | (46.91) | (50.00) | |
| | -8.00% | (63.04) | (66.14) | (69.23) | (72.32) | (75.41) | (78.50) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR65293A8084 | 대우증권(ELS)4375 | 20.30 |
| KR6542326089 | 신영증권(ELS)1694 | 20.24 |
| KR6559370087 | 우리투자증권(ELS)3447 | 20.25 |
| KR6669350086 | 동양W(ELS)914 | 20.80 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 81.59 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 97.00

메리츠주가지수연계증권제4호[ELS-파생형]

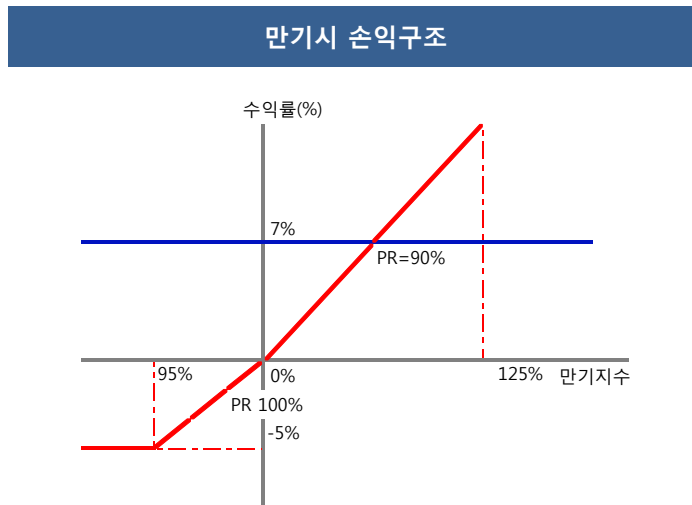
공시일: 2011-06-22

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% | 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: 2011-06-22

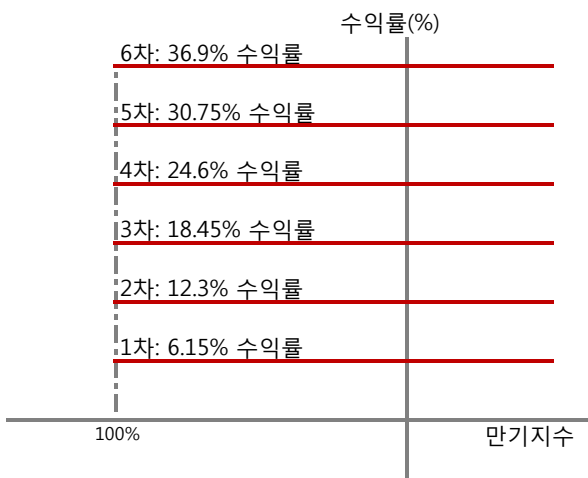
1. 계약금액

단위(백만원)

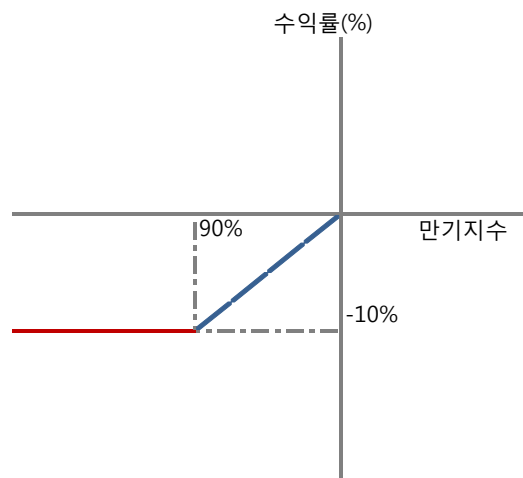
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,082 | 0 | 5,082 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,082 | 0 | 5,082 | 장외 |

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 | 389.97 | 377.26 | 364.55 | 351.85 | 339.14 | 326.43 | 313.73 | |
| 자산 | 267.18 | 254.47 | 241.76 | 229.06 | 216.35 | 203.64 | 190.94 | |
| 시나 | 149.89 | 137.19 | 124.48 | 111.77 | 99.07 | 86.36 | 73.66 | |
| 리오 | 0.00% | 38.12 | 25.41 | 12.71 | 0.00 | (12.71) | (25.41) | (38.12) |
| | -2.67% | (68.15) | (80.85) | (93.56) | (106.27) | (118.97) | (131.68) | (144.39) |
| | -5.33% | (168.91) | (181.61) | (194.32) | (207.03) | (219.73) | (232.44) | (245.15) |
| | -8.00% | (264.16) | (276.87) | (289.57) | (302.28) | (314.98) | (327.69) | (340.40) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 84.40 |
| KR65593110A3 | 우리투자증권(ELS)3541 | 84.25 |
| KR65893090A4 | 현대증권(ELS)2010-1453 | 86.17 |
| KR66693120A9 | 동양W(ELS)927 | 85.58 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 340.40 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 354.84

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

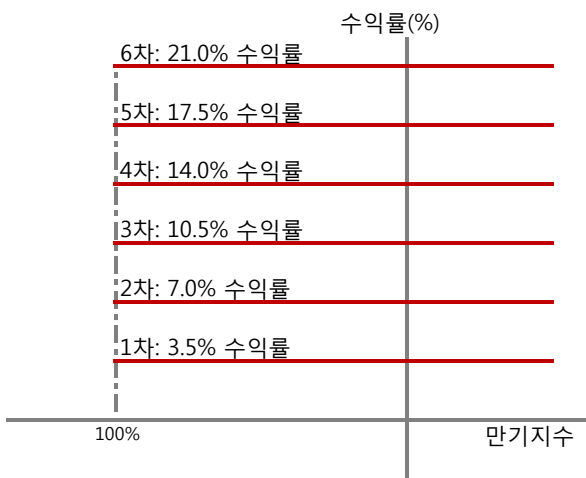
1. 계약금액

단위(백만원)

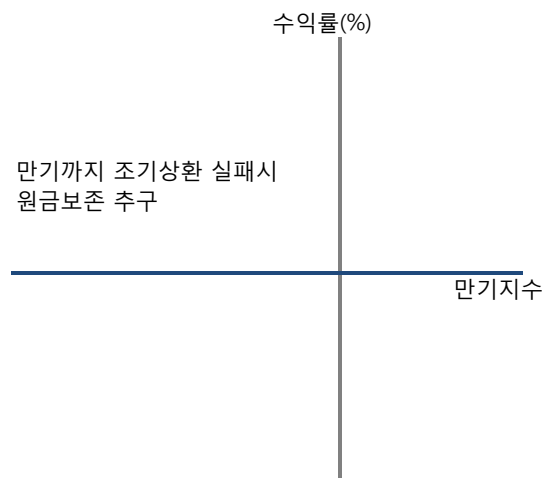
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,524 | 0 | 3,524 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,524 | 0 | 3,524 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|----------------------|----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | 72.39 | 69.49 | 66.58 | 63.68 | 60.78 | 57.88 | 54.97 |
| | 5.33% | 50.46 | 47.56 | 44.66 | 41.76 | 38.85 | 35.95 | 33.05 |
| | 2.67% | 29.24 | 26.33 | 23.43 | 20.53 | 17.63 | 14.72 | 11.82 |
| | 0.00% | 8.71 | 5.81 | 2.90 | 0.00 | (2.90) | (5.81) | (8.71) |
| | -2.67% | (11.12) | (14.02) | (16.93) | (19.83) | (22.73) | (25.64) | (28.54) |
| | -5.33% | (30.25) | (33.15) | (36.06) | (38.96) | (41.86) | (44.77) | (47.67) |
| | -8.00% | (48.68) | (51.59) | (54.49) | (57.39) | (60.29) | (63.20) | (66.10) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR65523460C3 | 우리투자증권(ELS)3756 | 16.21 |
| KR65823220C8 | 현대증권(ELS)2010-1534 | 16.82 |
| KR65923520C0 | 미래에셋증권(ELS)1637 | 16.38 |
| KR66623360C2 | 동양W(ELS)950 | 16.68 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 66.10 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

65.87

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

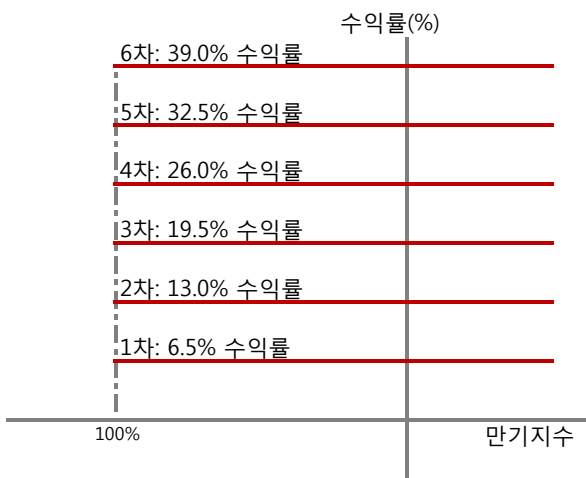
1. 계약금액

단위(백만원)

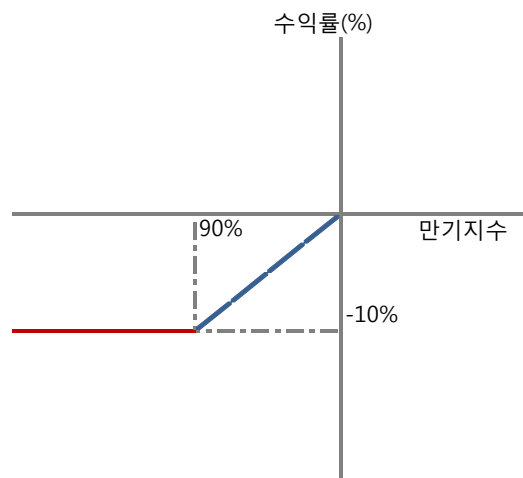
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,455 | 0 | 3,455 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,455 | 0 | 3,455 | 장외 |

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 | 139.94 | 133.90 | 127.85 | 121.81 | 115.76 | 109.72 | 103.67 | |
| 자산 | 98.27 | 92.22 | 86.18 | 80.13 | 74.09 | 68.04 | 62.00 | |
| 시나 | 57.66 | 51.62 | 45.58 | 39.53 | 33.49 | 27.44 | 21.40 | |
| 리오 | 18.13 | 12.09 | 6.04 | 0.00 | (6.04) | (12.09) | (18.13) | |
| | (20.33) | (26.37) | (32.41) | (38.46) | (44.50) | (50.55) | (56.59) | |
| | (57.71) | (63.76) | (69.80) | (75.85) | (81.89) | (87.94) | (93.98) | |
| | (94.03) | (100.07) | (106.12) | (112.16) | (118.21) | (124.25) | (130.30) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523450C4 | 우리투자증권(ELS)3755 | 32.33 |
| KR65823210C9 | 현대증권(ELS)2010-1533 | 32.79 |
| KR65923510C1 | 미래에셋증권(ELS)1636 | 32.46 |
| KR66623340C4 | 동양W(ELS)949 | 32.70 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 130.30 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 129.02

메리츠한증지수연계증권제13호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

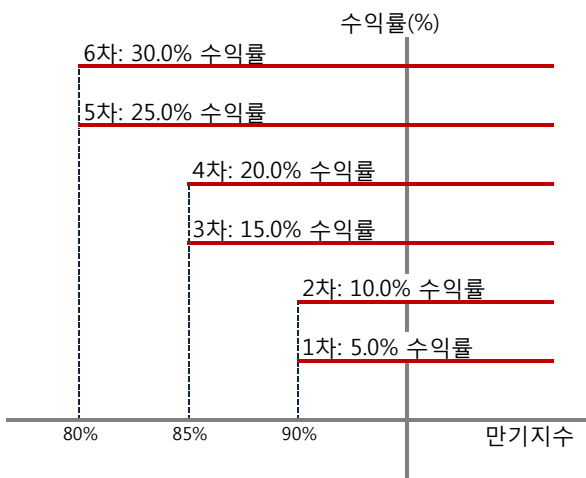
1. 계약금액

단위(백만원)

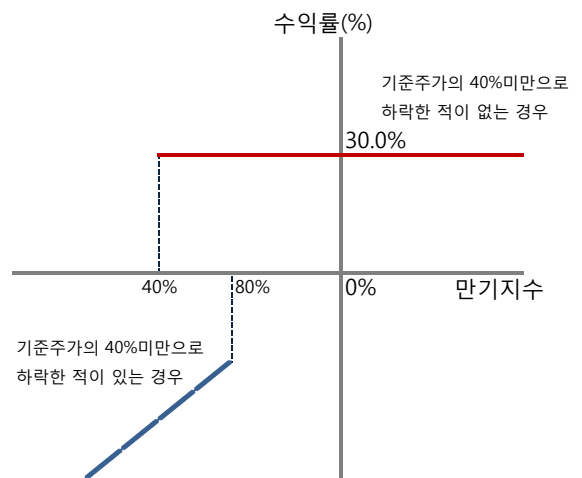
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,429 | 0 | 5,429 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,429 | 0 | 5,429 | 장외 |

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 | 8.00% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 자산 | 5.33% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 시나 | 2.67% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 리오 | 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)

| | | |
|--------------------|-----------------|-------------|
| KR65033AD0C3 | 신한투자(ELS)2106 | 0.00 |
| KR65431510C6 | 신영증권(ELS)1904 | 0.00 |
| KR65933AG0C1 | 미래에셋증권(ELS)1700 | 0.00 |
| KR66633730C4 | 동양W(ELS)956 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.00 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠주가지수연계증권투자신탁제7호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

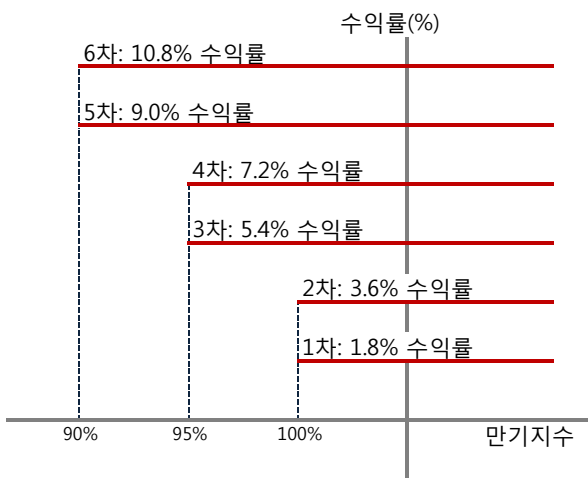
1. 계약금액

단위(백만원)

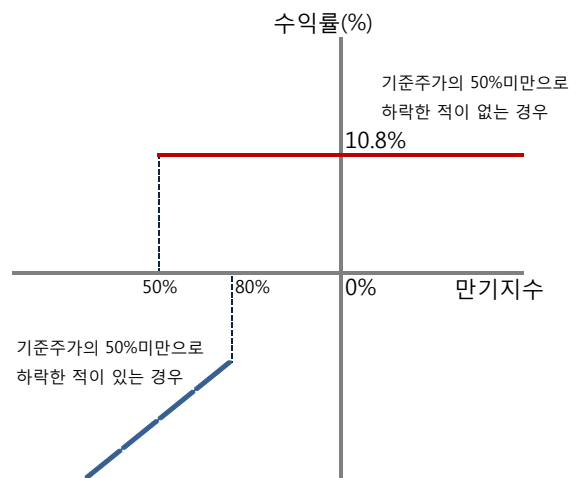
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | 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)

| | | |
|--------------------|-----------------|-------------|
| KR65233AF0C9 | 대우증권ELS4907 | 0.00 |
| KR65533A90C2 | 우리투자증권(ELS)3859 | 0.00 |
| KR66633740C3 | 동양W(ELS)961 | 0.00 |
| KR66733310C4 | 동부증권(ELS)462 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.00 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

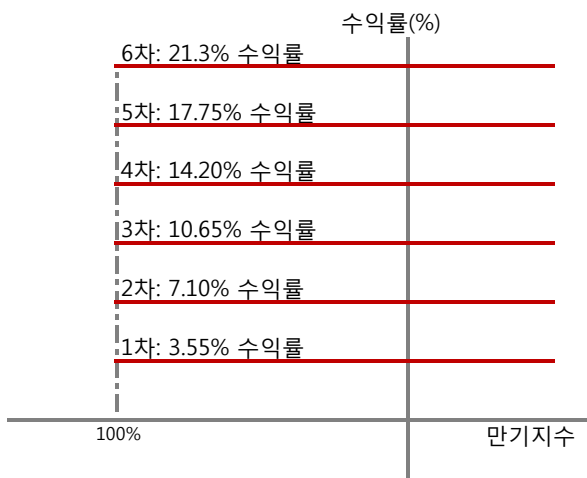
1. 계약금액

단위(백만원)

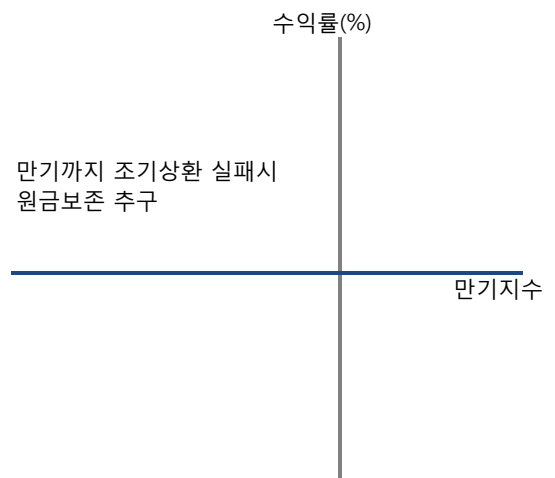
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,212 | 0 | 1,212 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,212 | 0 | 1,212 | 장외 |

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 | 15.34 | 13.71 | 12.08 | 10.46 | 8.83 | 7.21 | 5.58 | |
| 자산 | 11.85 | 10.23 | 8.60 | 6.98 | 5.35 | 3.73 | 2.10 | |
| 시나리오 | 8.37 | 6.74 | 5.12 | 3.49 | 1.87 | 0.24 | (1.39) | |
| | 4.88 | 3.25 | 1.63 | 0.00 | (1.63) | (3.25) | (4.88) | |
| | 1.38 | (0.24) | (1.87) | (3.50) | (5.12) | (6.75) | (8.37) | |
| | (2.12) | (3.75) | (5.37) | (7.00) | (8.62) | (10.25) | (11.88) | |
| | (5.63) | (7.25) | (8.88) | (10.50) | (12.13) | (13.76) | (15.38) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|--------------|
| KR6552345128 | 우리투자증권(ELS)3989 | 3.76 |
| KR6582317121 | 현대증권(ELS)2011-1588 | 3.91 |
| KR6592350120 | 미래에셋증권(ELS)1896 | 3.81 |
| KR6662316126 | 동양W(ELS)974 | 3.90 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 15.38 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 12.64 |
|-----|-------|

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

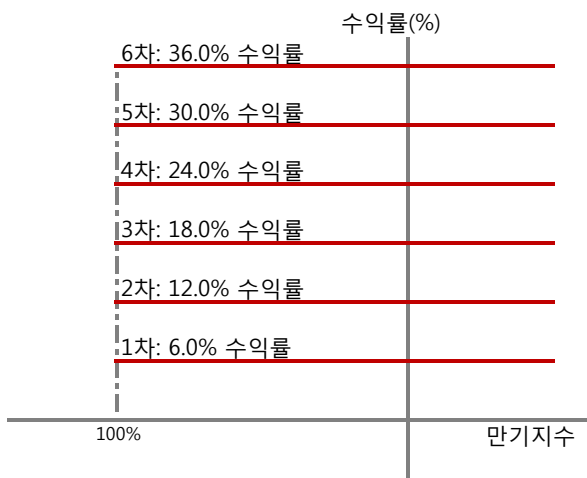
1. 계약금액

단위(백만원)

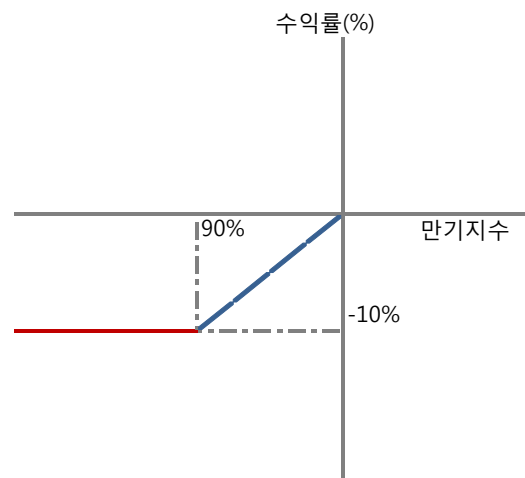
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 741 | 0 | 741 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 741 | 0 | 741 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|------------|----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00% | 38.91 | 35.31 | 31.71 | 28.11 | 24.51 | 20.91 | 17.31 |
| | 5.33% | 29.18 | 25.58 | 21.99 | 18.39 | 14.79 | 11.19 | 7.59 |
| | 2.67% | 19.81 | 16.21 | 12.62 | 9.02 | 5.42 | 1.82 | (1.78) |
| | 0.00% | 10.80 | 7.20 | 3.60 | 0.00 | (3.60) | (7.20) | (10.80) |
| | -2.67% | 2.14 | (1.46) | (5.06) | (8.66) | (12.26) | (15.86) | (19.46) |
| | -5.33% | (6.17) | (9.77) | (13.37) | (16.97) | (20.57) | (24.17) | (27.77) |
| | -8.00% | (14.13) | (17.72) | (21.32) | (24.92) | (28.52) | (32.12) | (35.72) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6502331129 | 신한투자(ELS)2235 | 8.84 |
| KR6552343123 | 우리투자증권(ELS)3988 | 8.83 |
| KR6582319127 | 현대증권(ELS)2011-1589 | 9.04 |
| KR6662317124 | 동양W(ELS)975 | 9.02 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 35.72 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 36.04

메리츠주가지수연계증권제9호[ELS-파생형]

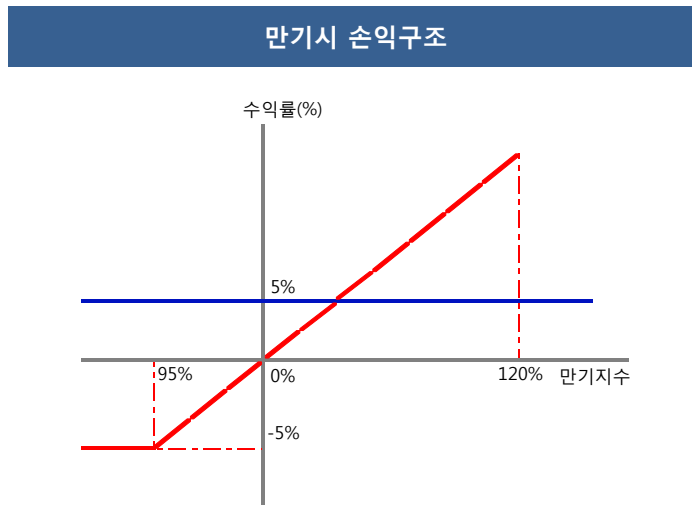
공시일: 2011-06-22

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 | 19.87 | 19.09 | 18.31 | 17.53 | 16.75 | 15.96 | 15.18 | |
| 자산 | 14.43 | 13.65 | 12.86 | 12.08 | 11.30 | 10.52 | 9.74 | |
| 시나리오 | 8.59 | 7.80 | 7.02 | 6.24 | 5.46 | 4.68 | 3.90 | |
| | 2.35 | 1.56 | 0.78 | 0.00 | (0.78) | (1.56) | (2.35) | |
| | (4.29) | (5.08) | (5.86) | (6.64) | (7.42) | (8.20) | (8.98) | |
| | (11.33) | (12.11) | (12.89) | (13.68) | (14.46) | (15.24) | (16.02) | |
| | (18.76) | (19.55) | (20.33) | (21.11) | (21.89) | (22.67) | (23.46) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|--------------|
| KR6503330120 | 신한투자(ELS)2234 | 5.87 |
| KR6553344120 | 우리투자증권(ELS)3990 | 5.87 |
| KR6583318128 | 현대증권(ELS)2011-1587 | 5.86 |
| KR6663314120 | 동양W(ELS)973 | 5.86 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 23.46 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 25.43 |
|-----|-------|

메리츠한증지수연계증권제14호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

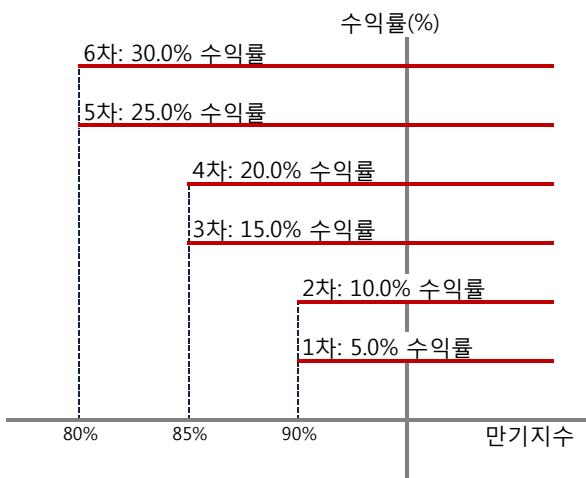
1. 계약금액

단위(백만원)

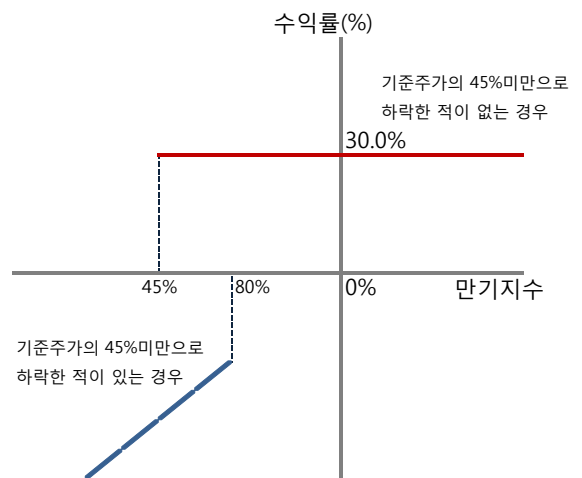
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 12,045 | 0 | 12,045 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 12,045 | 0 | 12,045 | 장외 |

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 | 53.59 | 53.09 | 52.59 | 52.10 | 51.60 | 51.11 | 50.61 | |
| 자산 | 19.31 | 18.81 | 18.32 | 17.82 | 17.33 | 16.83 | 16.33 | |
| 시나리오 | 1.94 | 1.45 | 0.95 | 0.46 | (0.04) | (0.54) | (1.03) | |
| | 1.49 | 0.99 | 0.50 | 0.00 | (0.50) | (0.99) | (1.49) | |
| | 17.94 | 17.45 | 16.95 | 16.46 | 15.96 | 15.46 | 14.97 | |
| | 51.31 | 50.81 | 50.32 | 49.82 | 49.33 | 48.83 | 48.33 | |
| | 101.59 | 101.09 | 100.59 | 100.10 | 99.60 | 99.11 | 98.61 | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|-------------|
| KR6503347124 | 신한투자(ELS)2253 | 0.35 |
| KR6553362122 | 우리투자증권(ELS)4082 | 0.35 |
| KR6593357124 | 미래에셋증권(ELS)1913 | 0.37 |
| KR6663329128 | 동양W(ELS)977 | 0.41 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 1.49 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 67.66

메리츠2Star증권HISE-2호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

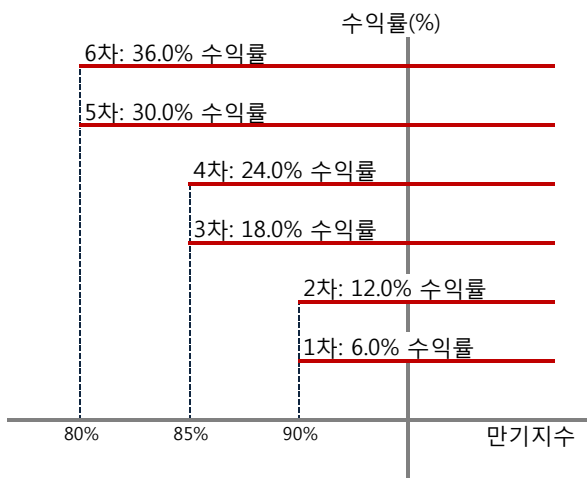
1. 계약금액

단위(백만원)

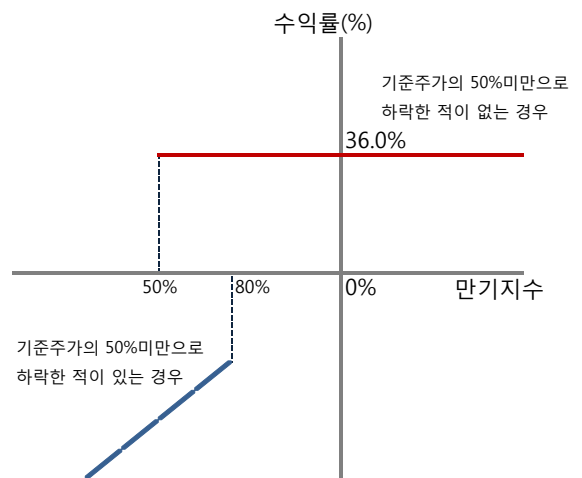
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,775 | 0 | 3,775 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,775 | 0 | 3,775 | 장외 |

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 | 150.64 | 125.93 | 101.23 | 76.52 | 51.81 | 27.11 | 2.40 | |
| 자산 | 5.33% | 132.23 | 107.53 | 82.82 | 58.11 | 33.41 | (16.00) | |
| 사 | 2.67% | 106.73 | 82.02 | 57.31 | 32.61 | 7.90 | (41.51) | |
| 나 | 0.00% | 74.12 | 49.41 | 24.71 | 0.00 | (24.71) | (74.12) | |
| 리 | -2.67% | 34.41 | 9.70 | (15.00) | (39.71) | (64.41) | (113.83) | |
| 오 | -5.33% | (12.40) | (37.10) | (61.81) | (86.52) | (111.22) | (160.64) | |
| 시 | -8.00% | (66.31) | (91.01) | (115.72) | (140.43) | (165.13) | (214.55) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6542312139 | 신영증권(ELS)2005 | 53.11 |
| KR6559350139 | 우리투자증권(ELS)4170 | 53.14 |
| KR6589319138 | 현대증권(ELS)2011-1617 | 54.73 |
| KR6622306134 | 교보증권(ELS)761 | 53.56 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 214.55 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 197.47

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

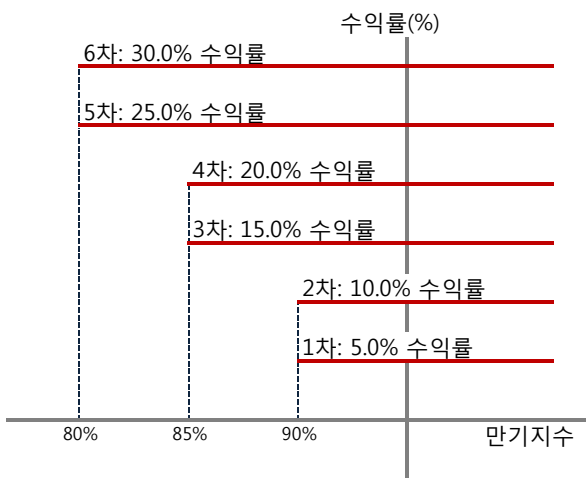
1. 계약금액

단위(백만원)

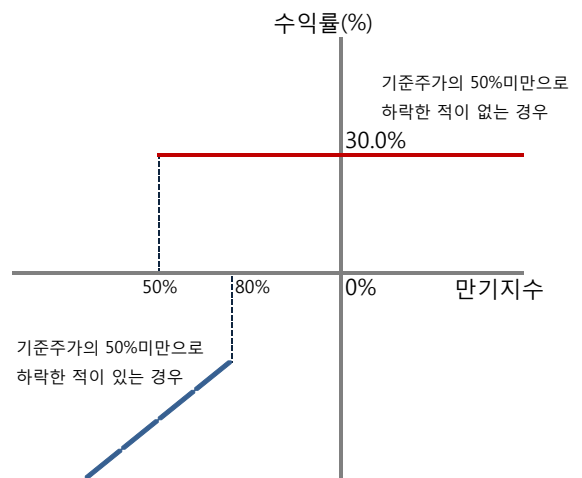
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 8,597 | 0 | 8,597 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,597 | 0 | 8,597 | 장외 |

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 | 310.66 | 268.32 | 225.97 | 183.63 | 141.28 | 98.94 | 56.59 | |
| 자산 | 261.14 | 218.79 | 176.45 | 134.10 | 91.75 | 49.41 | 7.06 | |
| 시나리오 | 199.93 | 157.58 | 115.24 | 72.89 | 30.55 | (11.80) | (54.14) | |
| | 127.04 | 84.69 | 42.35 | 0.00 | (42.35) | (84.69) | (127.04) | |
| | 42.46 | 0.12 | (42.23) | (84.57) | (126.92) | (169.26) | (211.61) | |
| | (53.79) | (96.14) | (138.49) | (180.83) | (223.18) | (265.52) | (307.87) | |
| | (161.73) | (204.08) | (246.42) | (288.77) | (331.12) | (373.46) | (415.81) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140 | 우리투자증권(ELS)4416 | 113.80 |
| KR6582383149 | 현대증권(ELS)2011-1698 | 115.30 |
| KR6592397147 | 미래에셋증권(ELS)2173 | 114.23 |
| KR6662374141 | 동양W(ELS)1004 | 72.48 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 415.81 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

419.25

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

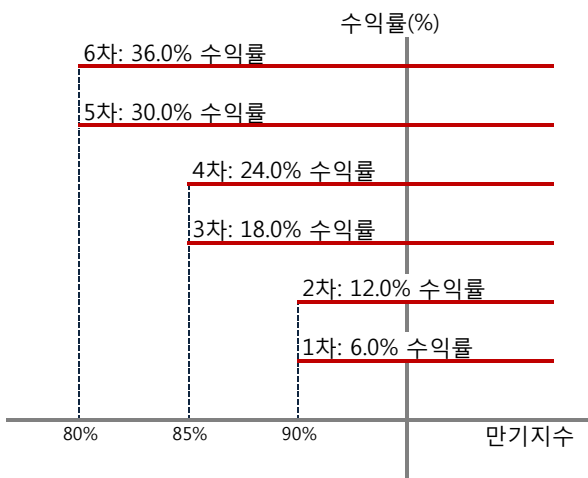
1. 계약금액

단위(백만원)

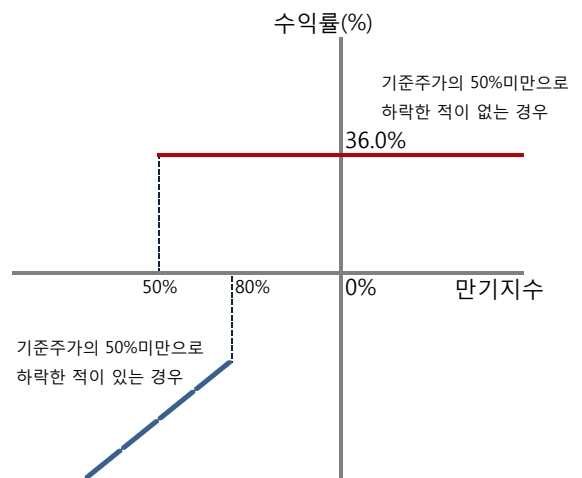
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,001 | 0 | 20,001 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,001 | 0 | 20,001 | 장외 |

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 | 8.00% | 5.33% | 2.67% | 0.00% | -2.67% | -5.33% | -8.00% | |
| 자산 | (228.84) | (145.88) | (72.76) | (9.49) | 43.93 | 87.50 | 121.23 | |
| 시나 | (225.67) | (142.71) | (69.60) | (6.33) | 47.09 | 90.67 | 124.39 | |
| 리오 | (222.51) | (139.55) | (66.43) | (3.16) | 50.26 | 93.83 | 127.56 | |
| | (219.34) | (136.38) | (63.27) | 0.00 | 53.42 | 96.99 | 130.72 | |
| | (216.18) | (133.22) | (60.10) | 3.16 | 56.59 | 100.16 | 133.89 | |
| | (213.01) | (130.05) | (56.94) | 6.33 | 59.75 | 103.32 | 137.05 | |
| | (209.85) | (126.89) | (53.77) | 9.49 | 62.91 | 106.49 | 140.22 | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR6553331150 | 우리투자증권(ELS)4448 | 62.33 |
| KR6573333152 | 한국투자증권(ELS)2106 | 51.48 |
| KR6663329151 | 동양W(ELS)1018 | 56.68 |
| KR6673309151 | 해피플러스(ELS)529 | 58.34 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 228.84 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 138.66 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

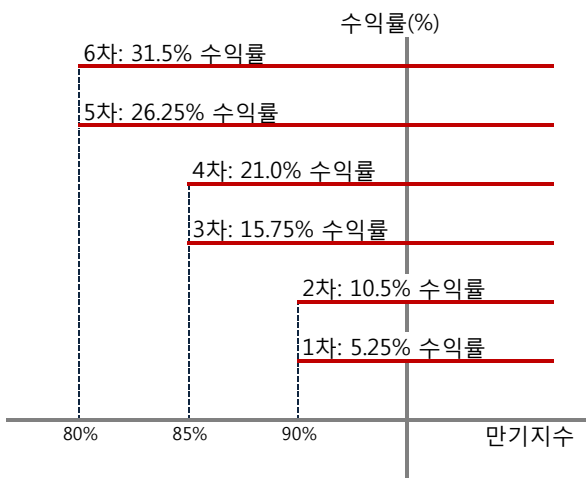
1. 계약금액

단위(백만원)

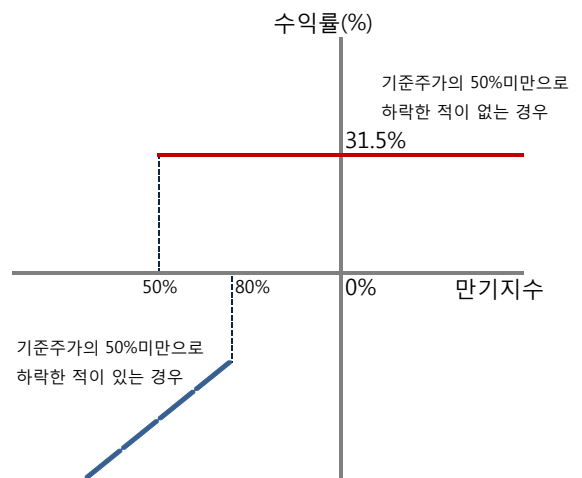
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 4,938 | 0 | 4,938 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,938 | 0 | 4,938 | 장외 |

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% | 23.65 | 12.91 | 2.16 | (8.59) | (19.34) | (30.08) | (40.83) |
| | 5.33% | 31.22 | 20.48 | 9.73 | (1.02) | (11.77) | (22.51) | (33.26) |
| | 2.67% | 34.09 | 23.34 | 12.59 | 1.84 | (8.90) | (19.65) | (30.40) |
| | 0.00% | 32.24 | 21.50 | 10.75 | 0.00 | (10.75) | (21.50) | (32.24) |
| | -2.67% | 25.69 | 14.94 | 4.20 | (6.55) | (17.30) | (28.05) | (38.79) |
| | -5.33% | 14.43 | 3.68 | (7.06) | (17.81) | (28.56) | (39.31) | (50.05) |
| | -8.00% | (1.54) | (12.28) | (23.03) | (33.78) | (44.53) | (55.27) | (66.02) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|--------------|
| KR6553363153 | 우리투자증권(ELS)4485 | 15.40 |
| KR6573353150 | 한국투자증권(ELS)2116 | 17.54 |
| KR6593354154 | 미래에셋증권(ELS)2235 | 16.07 |
| KR6663346155 | 동양W(ELS)1009 | 17.02 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 66.02 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 51.62 |
|-----|-------|

메리츠주가지수연계증권제13호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

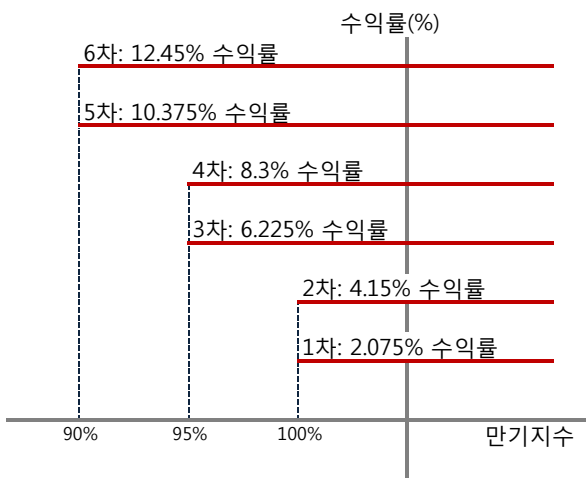
1. 계약금액

단위(백만원)

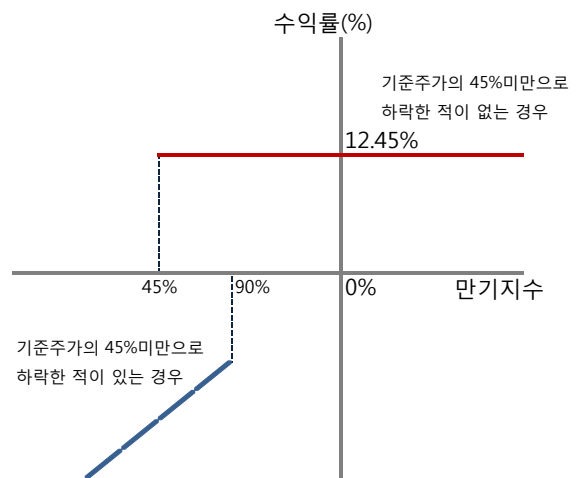
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 30,001 | 0 | 30,001 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 30,001 | 0 | 30,001 | 장외 |

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% | (904.72) | (894.89) | (885.06) | (875.23) | (865.41) | (855.58) | (845.75) |
| | 5.33% | (571.17) | (561.35) | (551.52) | (541.69) | (531.86) | (522.03) | (512.21) |
| | 2.67% | (279.43) | (269.60) | (259.77) | (249.95) | (240.12) | (230.29) | (220.46) |
| | 0.00% | (29.48) | (19.66) | (9.83) | 0.00 | 9.83 | 19.66 | 29.48 |
| | -2.67% | 178.66 | 188.49 | 198.32 | 208.15 | 217.97 | 227.80 | 237.63 |
| | -5.33% | 345.01 | 354.84 | 364.67 | 374.49 | 384.32 | 394.15 | 403.98 |
| | -8.00% | 469.56 | 479.39 | 489.21 | 499.04 | 508.87 | 518.70 | 528.53 |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR6543310157 | 신영증권(ELS)2096 | 241.38 |
| KR6573352152 | 한국투자증권(ELS)2117 | 211.12 |
| KR6663348151 | 동양W(ELS)1017 | 224.31 |
| KR6673311157 | 해피플러스(ELS)539 | 227.90 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 904.72 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 612.22 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

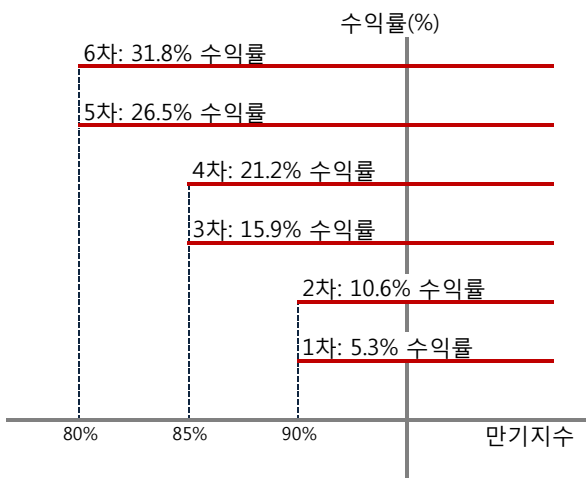
1. 계약금액

단위(백만원)

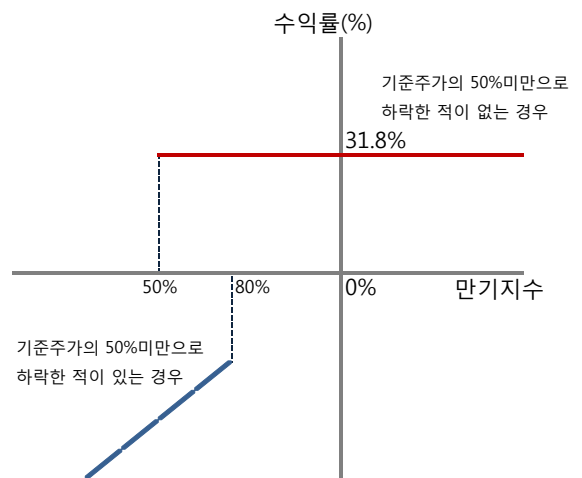
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 7,070 | 0 | 7,070 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 7,070 | 0 | 7,070 | 장외 |

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 | 28.78 | 10.10 | (8.58) | (27.26) | (45.94) | (64.62) | (83.30) | |
| 자산 | 47.25 | 28.57 | 9.89 | (8.79) | (27.47) | (46.15) | (64.83) | |
| 시나 | 56.34 | 37.66 | 18.98 | 0.30 | (18.38) | (37.06) | (55.74) | |
| 리오 | 0.00% | 56.04 | 37.36 | 18.68 | 0.00 | (18.68) | (37.36) | |
| | -2.67% | 46.35 | 27.67 | 8.99 | (9.69) | (28.37) | (47.05) | |
| | -5.33% | 27.28 | 8.60 | (10.08) | (28.76) | (47.44) | (66.12) | |
| | -8.00% | (1.18) | (19.86) | (38.54) | (57.22) | (75.90) | (94.58) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65533C6151 | 우리투자증권(ELS)4595 | 27.24 |
| KR65933AH150 | 미래에셋증권(ELS)2299 | 28.30 |
| KR66633AV156 | 동양W(ELS)1019 | 29.79 |
| KR67033A2153 | H&D증권(ELS)1724 | 27.94 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 113.26 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 111.31

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2011-06-22

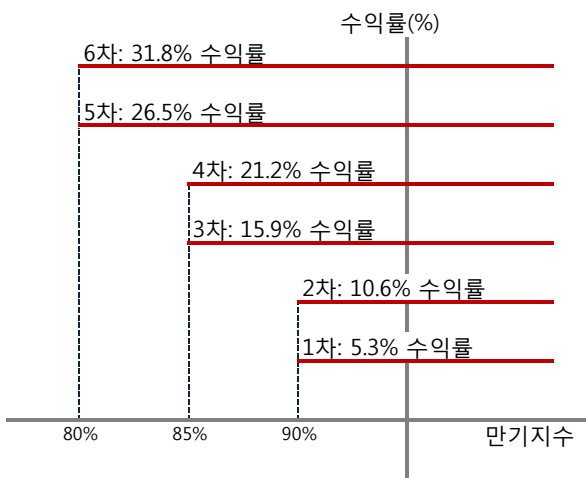
1. 계약금액

단위(백만원)

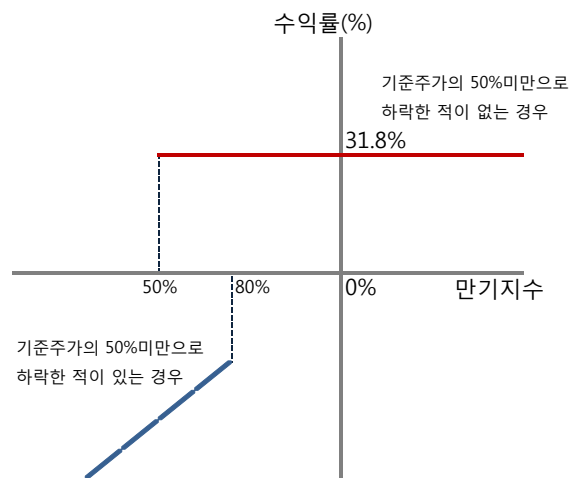
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,480 | 0 | 5,480 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,480 | 0 | 5,480 | 장외 |

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% | 28.61 | 16.67 | 4.73 | (7.21) | (19.16) | (31.10) | (43.04) |
| | 5.33% | 35.63 | 23.69 | 11.75 | (0.19) | (12.14) | (24.08) | (36.02) |
| | 2.67% | 38.04 | 26.09 | 14.15 | 2.21 | (9.73) | (21.67) | (33.62) |
| | 0.00% | 35.83 | 23.88 | 11.94 | 0.00 | (11.94) | (23.88) | (35.83) |
| | -2.67% | 29.00 | 17.06 | 5.12 | (6.83) | (18.77) | (30.71) | (42.65) |
| | -5.33% | 17.56 | 5.62 | (6.32) | (18.27) | (30.21) | (42.15) | (54.09) |
| | -8.00% | 1.50 | (10.44) | (22.38) | (34.32) | (46.26) | (58.21) | (70.15) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|--------------|
| KR6503341168 | 신한투자(ELS)2834 | 16.51 |
| KR6553344161 | 우리투자증권(ELS)4621 | 16.39 |
| KR6583319167 | 현대증권(ELS)2011-1768 | 19.04 |
| KR6663324160 | 동양W(ELS)1028 | 18.20 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 70.15 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 52.76 |
|-----|-------|