

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,414 | 0 | 5,414 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,414 | 0 | 5,414 | 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 | 88.13 | 72.44 | 56.75 | 41.06 | 25.37 | 9.68 | (6.01) | |
| 자산 | 98.72 | 83.03 | 67.34 | 51.65 | 35.96 | 20.28 | 4.59 | |
| 시나 | 85.03 | 69.35 | 53.66 | 37.97 | 22.28 | 6.59 | (9.10) | |
| 리오 | 47.07 | 31.38 | 15.69 | 0.00 | (15.69) | (31.38) | (47.07) | |
| | (15.18) | (30.87) | (46.56) | (62.25) | (77.94) | (93.63) | (109.32) | |
| | (101.71) | (117.40) | (133.09) | (148.78) | (164.47) | (180.16) | (195.85) | |
| | (212.52) | (228.21) | (243.90) | (259.59) | (275.28) | (290.97) | (306.66) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6502348032 | 신한투자(ELS)1408 | 44.30 |
| KR6582353035 | 현대증권(ELS)2010-1232 | 87.60 |
| KR6661350035 | 동양(ELS)520 | 87.83 |
| KR6702358039 | H&D증권(ELS)545 | 86.92 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 306.66 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 261.40

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

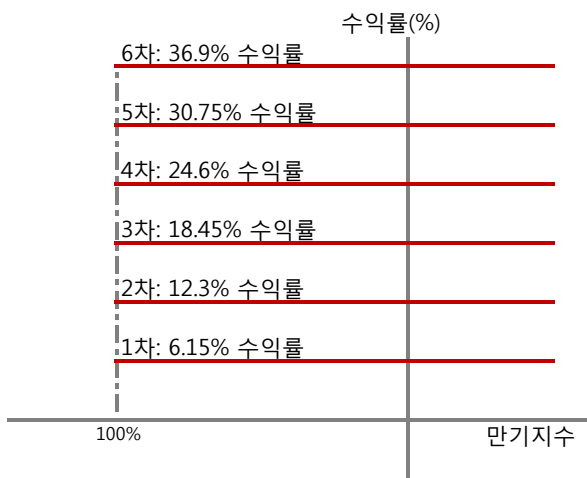
1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,022 | 0 | 5,022 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,022 | 0 | 5,022 | 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 | 228.50 | 214.82 | 201.15 | 187.47 | 173.80 | 160.12 | 146.45 | |
| 자산 | 162.53 | 148.86 | 135.18 | 121.51 | 107.83 | 94.16 | 80.48 | |
| 시나 | 100.04 | 86.37 | 72.69 | 59.02 | 45.34 | 31.66 | 17.99 | |
| 리오 | 41.03 | 27.35 | 13.68 | 0.00 | (13.68) | (27.35) | (41.03) | |
| | (14.51) | (28.19) | (41.86) | (55.54) | (69.22) | (82.89) | (96.57) | |
| | (66.58) | (80.25) | (93.93) | (107.61) | (121.28) | (134.96) | (148.63) | |
| | (115.17) | (128.84) | (142.52) | (156.20) | (169.87) | (183.55) | (197.22) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 49.53 |
| KR65593110A3 | 우리투자증권(ELS)3541 | 47.69 |
| KR65893090A4 | 현대증권(ELS)2010-1453 | 49.96 |
| KR66693120A9 | 동양W(ELS)927 | 50.04 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 197.22 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 189.87

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

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 | 8.00% | 64.33 | 59.30 | 54.28 | 49.26 | 44.23 | 39.21 | 34.19 |
| 자산 시나 리오 | 5.33% | 47.35 | 42.33 | 37.31 | 32.28 | 27.26 | 22.24 | 17.21 |
| | 2.67% | 30.93 | 25.91 | 20.89 | 15.86 | 10.84 | 5.82 | 0.79 |
| | 0.00% | 15.07 | 10.05 | 5.02 | 0.00 | (5.02) | (10.05) | (15.07) |
| | -2.67% | (0.24) | (5.26) | (10.29) | (15.31) | (20.33) | (25.35) | (30.38) |
| | -5.33% | (14.99) | (20.02) | (25.04) | (30.06) | (35.08) | (40.11) | (45.13) |
| | -8.00% | (29.19) | (34.21) | (39.24) | (44.26) | (49.28) | (54.31) | (59.33) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR65523460C3 | 우리투자증권(ELS)3756 | 14.66 |
| KR65823220C8 | 현대증권(ELS)2010-1534 | 14.91 |
| KR65923520C0 | 미래에셋증권(ELS)1637 | 14.78 |
| KR66623360C2 | 동양W(ELS)950 | 14.98 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 59.33 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 58.50

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,441 | -13 | 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 | 151.08 | 139.95 | 128.82 | 117.69 | 106.57 | 95.44 | 84.31 | |
| 자산 | 5.33% | 110.18 | 99.05 | 87.92 | 76.79 | 65.67 | 54.54 | |
| 시나 | 2.67% | 70.95 | 59.82 | 48.69 | 37.56 | 26.43 | 15.31 | |
| 리오 | 0.00% | 33.39 | 22.26 | 11.13 | 0.00 | (11.13) | (22.26) | |
| | -2.67% | (2.51) | (13.64) | (24.76) | (35.89) | (47.02) | (58.15) | |
| | -5.33% | (36.73) | (47.86) | (58.99) | (70.12) | (81.25) | (92.38) | |
| | -8.00% | (69.29) | (80.42) | (91.54) | (102.67) | (113.80) | (124.93) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65523450C4 | 우리투자증권(ELS)3755 | 31.99 |
| KR65823210C9 | 현대증권(ELS)2010-1533 | 36.25 |
| KR65923510C1 | 미래에셋증권(ELS)1636 | 32.06 |
| KR66623340C4 | 동양W(ELS)949 | 35.76 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 136.06 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 131.66 |
|-----|--------|

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,142 | -70 | 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 | 4.62 | 4.02 | 3.42 | 2.82 | 2.22 | 1.61 | 1.01 | |
| 자산 | 3.72 | 3.12 | 2.52 | 1.91 | 1.31 | 0.71 | 0.11 | |
| 시나리오 | 2.78 | 2.18 | 1.58 | 0.97 | 0.37 | (0.23) | (0.83) | |
| | 0.00% | 1.81 | 1.20 | 0.60 | 0.00 | (0.60) | (1.20) | |
| | -2.67% | 0.80 | 0.20 | (0.41) | (1.01) | (1.61) | (2.21) | |
| | -5.33% | (0.24) | (0.85) | (1.45) | (2.05) | (2.65) | (3.25) | |
| | -8.00% | (1.32) | (1.92) | (2.52) | (3.13) | (3.73) | (4.33) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6552345128 | 우리투자증권(ELS)3989 | 1.30 |
| KR6582317121 | 현대증권(ELS)2011-1588 | 1.31 |
| KR6592350120 | 미래에셋증권(ELS)1896 | 1.00 |
| KR6662316126 | 동양W(ELS)974 | 1.32 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 4.93 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 5.69

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

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 | 기초 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|----------------|--------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 자산 시나 리오 | 8.00% | 19.35 | 17.20 | 15.04 | 12.89 | 10.74 | 8.58 | 6.43 |
| | 5.33% | 15.04 | 12.89 | 10.73 | 8.58 | 6.43 | 4.27 | 2.12 |
| | 2.67% | 10.74 | 8.59 | 6.44 | 4.28 | 2.13 | (0.02) | (2.18) |
| | 0.00% | 6.46 | 4.31 | 2.15 | 0.00 | (2.15) | (4.31) | (6.46) |
| | -2.67% | 2.19 | 0.04 | (2.12) | (4.27) | (6.42) | (8.58) | (10.73) |
| | -5.33% | (2.07) | (4.22) | (6.37) | (8.53) | (10.68) | (12.83) | (14.99) |
| | -8.00% | (6.31) | (8.46) | (10.62) | (12.77) | (14.92) | (17.08) | (19.23) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6502331129 | 신한투자(ELS)2235 | 4.79 |
| KR6552343123 | 우리투자증권(ELS)3988 | 4.79 |
| KR6582319127 | 현대증권(ELS)2011-1589 | 4.81 |
| KR6662317124 | 동양W(ELS)975 | 4.84 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 19.23 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 22.14

메리츠주가지수연계증권제9호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

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 | 105.60 | 105.86 | 106.12 | 106.38 | 106.64 | 106.90 | 107.16 | |
| 자산 | 64.53 | 64.79 | 65.05 | 65.31 | 65.57 | 65.82 | 66.08 | |
| 시나리오 | 29.07 | 29.33 | 29.59 | 29.85 | 30.10 | 30.36 | 30.62 | |
| | 0.00% | (0.78) | (0.52) | (0.26) | 0.00 | 0.26 | 0.52 | 0.78 |
| | -2.67% | (25.01) | (24.75) | (24.49) | (24.23) | (23.97) | (23.71) | (23.45) |
| | -5.33% | (43.62) | (43.36) | (43.11) | (42.85) | (42.59) | (42.33) | (42.07) |
| | -8.00% | (56.62) | (56.37) | (56.11) | (55.85) | (55.59) | (55.33) | (55.07) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|--------------|
| KR6503330120 | 신한투자(ELS)2234 | 14.16 |
| KR6553344120 | 우리투자증권(ELS)3990 | 14.16 |
| KR6583318128 | 현대증권(ELS)2011-1587 | 14.16 |
| KR6663314120 | 동양W(ELS)973 | 14.16 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 56.62 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|------------|--------------|
| 위험액 | 82.52 |
|------------|--------------|

메리츠한증지수연계증권제14호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

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 | 8.00% | (274.05) | (275.15) | (276.25) | (277.35) | (278.45) | (279.55) | (280.65) |
| 자산 | 5.33% | (118.27) | (119.37) | (120.47) | (121.57) | (122.67) | (123.77) | (124.86) |
| 사 | 2.67% | (25.82) | (26.92) | (28.02) | (29.12) | (30.22) | (31.32) | (32.41) |
| 나 | 0.00% | 3.30 | 2.20 | 1.10 | 0.00 | (1.10) | (2.20) | (3.30) |
| 리 | -2.67% | (30.92) | (32.02) | (33.11) | (34.21) | (35.31) | (36.41) | (37.51) |
| 오 | -5.33% | (128.46) | (129.56) | (130.66) | (131.76) | (132.86) | (133.96) | (135.06) |
| 시 | -8.00% | (289.34) | (290.44) | (291.54) | (292.64) | (293.74) | (294.83) | (295.93) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR6503347124 | 신한투자(ELS)2253 | 72.42 |
| KR6553362122 | 우리투자증권(ELS)4082 | 70.87 |
| KR6593357124 | 미래에셋증권(ELS)1913 | 73.28 |
| KR6663329128 | 동양W(ELS)977 | 79.36 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 295.93 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 21.88 |
|-----|-------|

메리츠2Star증권HISE-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

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 | 167.78 | 149.77 | 131.75 | 113.74 | 95.73 | 77.72 | 59.71 | |
| 자산 | 139.65 | 121.64 | 103.63 | 85.61 | 67.60 | 49.59 | 31.58 | |
| 시나 | 101.74 | 83.72 | 65.71 | 47.70 | 29.69 | 11.68 | (6.34) | |
| 리오 | 54.04 | 36.02 | 18.01 | 0.00 | (18.01) | (36.02) | (54.04) | |
| | (3.45) | (21.46) | (39.47) | (57.49) | (75.50) | (93.51) | (111.52) | |
| | (70.72) | (88.74) | (106.75) | (124.76) | (142.77) | (160.78) | (178.80) | |
| | (147.78) | (165.80) | (183.81) | (201.82) | (219.83) | (237.84) | (255.86) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6542312139 | 신영증권(ELS)2005 | 63.39 |
| KR6559350139 | 우리투자증권(ELS)4170 | 62.98 |
| KR6589319138 | 현대증권(ELS)2011-1617 | 65.54 |
| KR6622306134 | 교보증권(ELS)761 | 63.94 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 255.86 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 244.62

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

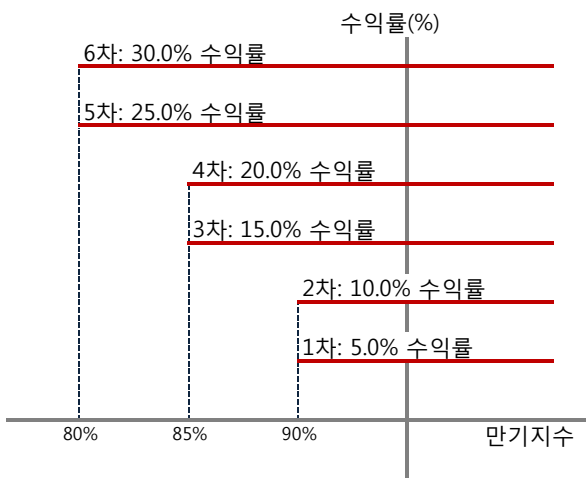
1. 계약금액

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 | 356.25 | 319.29 | 282.33 | 245.37 | 208.41 | 171.45 | 134.50 | |
| 자산 | 291.52 | 254.56 | 217.61 | 180.65 | 143.69 | 106.73 | 69.77 | |
| 시나 | 209.73 | 172.77 | 135.82 | 98.86 | 61.90 | 24.94 | (12.02) | |
| 리오 | 0.00% | 110.88 | 73.92 | 36.96 | 0.00 | (36.96) | (73.92) | (110.88) |
| | -2.67% | (5.05) | (42.00) | (78.96) | (115.92) | (152.88) | (189.84) | (226.80) |
| | -5.33% | (138.03) | (174.99) | (211.95) | (248.91) | (285.87) | (322.83) | (359.79) |
| | -8.00% | (288.09) | (325.05) | (362.00) | (398.96) | (435.92) | (472.88) | (509.84) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140 | 우리투자증권(ELS)4416 | 134.53 |
| KR6582383149 | 현대증권(ELS)2011-1698 | 138.10 |
| KR6592397147 | 미래에셋증권(ELS)2173 | 135.46 |
| KR6662374141 | 동양W(ELS)1004 | 101.74 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 509.84 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 631.91

메리츠한증지수연계증권제16호[ELS-파생형]

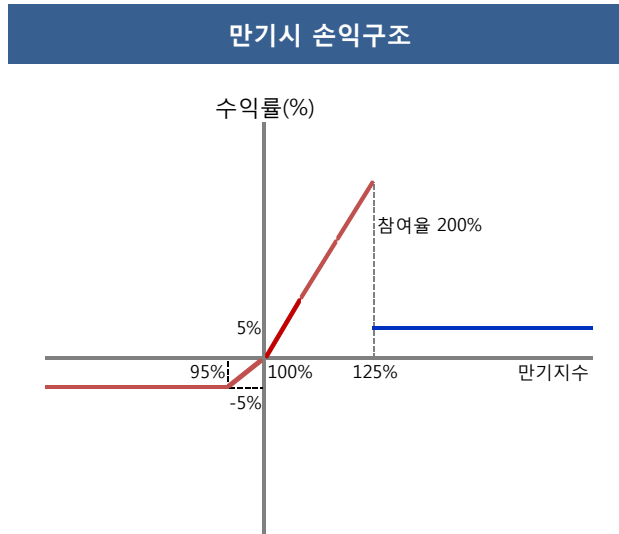
공시일: #REF!

1. 계약금액

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

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| 기초 | 8.00% | 16.49 | 16.13 | 15.77 | 15.40 | 15.04 | 14.68 | 14.32 |
| 자산 | 5.33% | 11.59 | 11.22 | 10.86 | 10.50 | 10.14 | 9.78 | 9.42 |
| 시나리오 | 2.67% | 6.45 | 6.09 | 5.73 | 5.37 | 5.00 | 4.64 | 4.28 |
| | 0.00% | 1.08 | 0.72 | 0.36 | 0.00 | (0.36) | (0.72) | (1.08) |
| | -2.67% | (4.51) | (4.87) | (5.24) | (5.60) | (5.96) | (6.32) | (6.68) |
| | -5.33% | (10.34) | (10.70) | (11.06) | (11.42) | (11.79) | (12.15) | (12.51) |
| | -8.00% | (16.40) | (16.76) | (17.12) | (17.48) | (17.84) | (18.21) | (18.57) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6543308151 | 신영증권(ELS)2093 | 4.32 |
| KR6583331154 | 현대증권(ELS)2011-1724 | 4.75 |
| KR6663340158 | 동양W(ELS)1007 | 4.75 |
| KR6703330151 | H&D증권(ELS)1663 | 4.75 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 18.57 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 15.54

메리츠한증지수연계증권제15호[ELS-파생형]

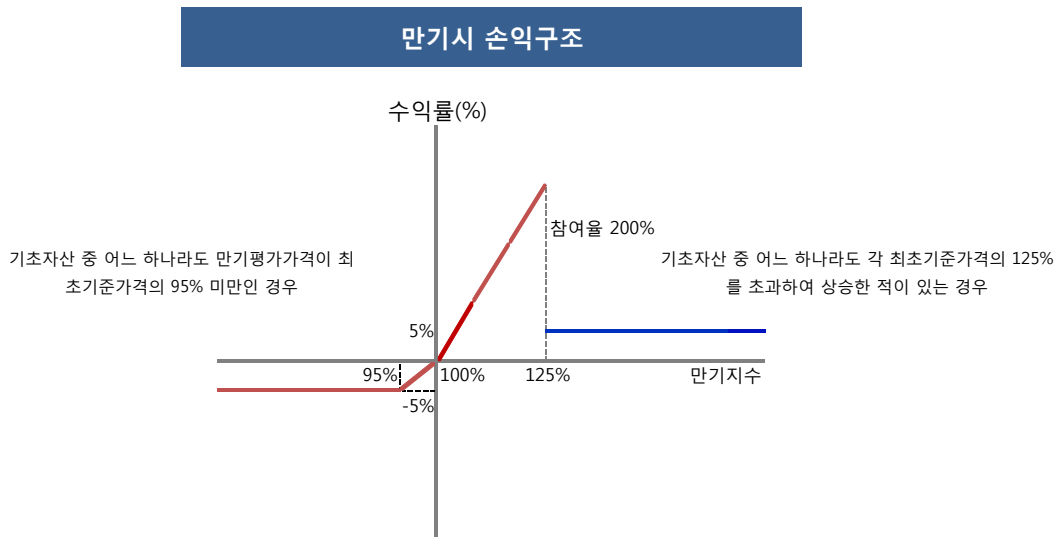
공시일: #REF!

1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 2,767 | 0 | 2,767 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,767 | 0 | 2,767 | 장외 |

단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 기초자산 시나리오 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|-----------|-----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초자산 시나리오 | 8.00% | 23.03 | 22.30 | 21.57 | 20.85 | 20.12 | 19.40 | 18.67 |
| | 5.33% | 16.58 | 15.85 | 15.13 | 14.40 | 13.68 | 12.95 | 12.23 |
| | 2.67% | 9.63 | 8.90 | 8.18 | 7.45 | 6.73 | 6.00 | 5.28 |
| | 0.00% | 2.18 | 1.45 | 0.73 | 0.00 | (0.73) | (1.45) | (2.18) |
| | -2.67% | (5.78) | (6.50) | (7.23) | (7.95) | (8.68) | (9.40) | (10.13) |
| | -5.33% | (14.23) | (14.96) | (15.68) | (16.41) | (17.14) | (17.86) | (18.59) |
| | -8.00% | (23.19) | (23.92) | (24.64) | (25.37) | (26.09) | (26.82) | (27.54) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6503316152 | 신한투자(ELS)2641 | 6.85 |
| KR6523330159 | 대우증권ELS5497 | 6.90 |
| KR6583327152 | 현대증권(ELS)2011-1720 | 6.89 |
| KR6663335158 | 동양W(ELS)1005 | 6.89 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 27.54 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 29.32

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

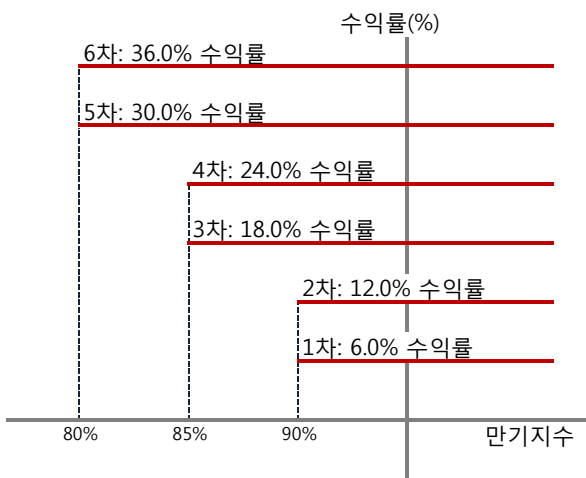
1. 계약금액

단위(백만원)

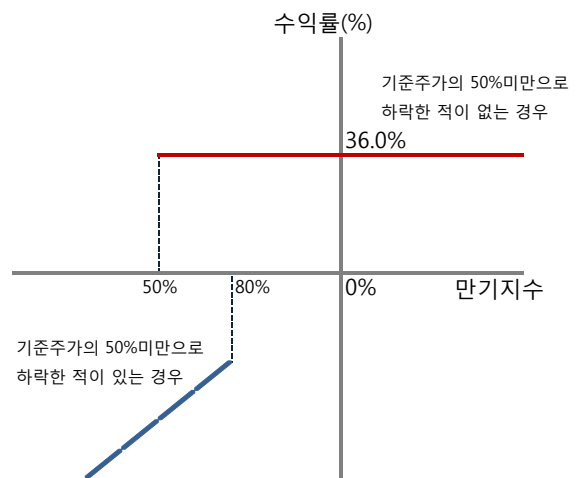
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,001 | 0 | 20,001 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,001 | 0 | 20,001 | 장외 |

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% | (42.90) | (43.98) | (45.06) | (46.14) | (47.22) | (48.30) | (49.38) |
| 자산 | 5.33% | (20.95) | (22.03) | (23.11) | (24.19) | (25.27) | (26.35) | (27.43) |
| 사 | 2.67% | (5.57) | (6.65) | (7.73) | (8.81) | (9.89) | (10.97) | (12.05) |
| 나 | 0.00% | 3.24 | 2.16 | 1.08 | 0.00 | (1.08) | (2.16) | (3.24) |
| 리 | -2.67% | 5.48 | 4.40 | 3.32 | 2.24 | 1.16 | 0.08 | (1.00) |
| 오 | -5.33% | 1.15 | 0.07 | (1.01) | (2.10) | (3.18) | (4.26) | (5.34) |
| 시 | -8.00% | (9.76) | (10.84) | (11.92) | (13.00) | (14.08) | (15.16) | (16.24) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6553331150 | 우리투자증권(ELS)4448 | 14.06 |
| KR6573333152 | 한국투자증권(ELS)2106 | 12.42 |
| KR6663329151 | 동양W(ELS)1018 | 10.63 |
| KR6673309151 | 해피플러스(ELS)529 | 12.27 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 49.38 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

11.75

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-02-08

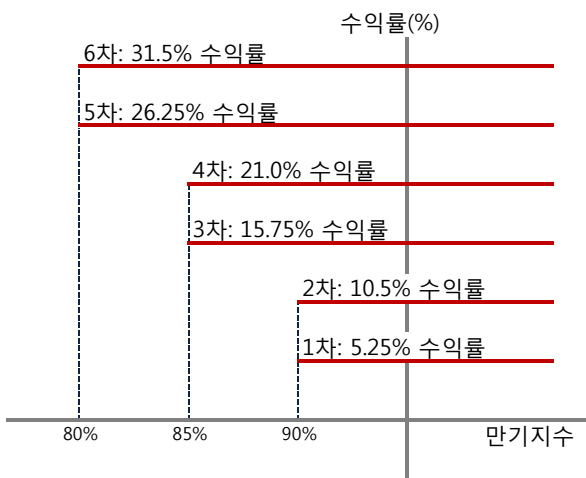
1. 계약금액

단위(백만원)

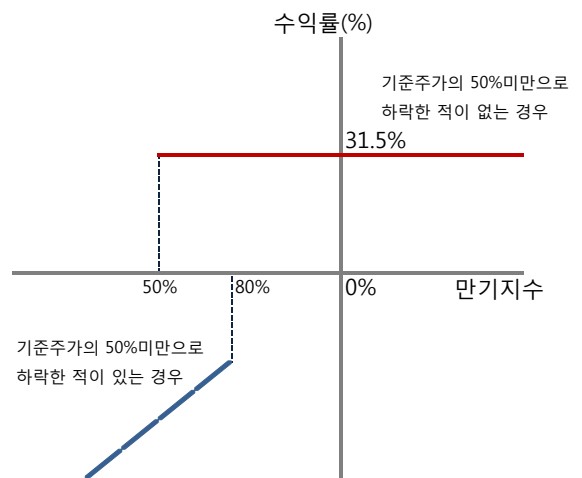
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 4,938 | 0 | 4,938 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,938 | 0 | 4,938 | 장외 |

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 | 193.66 | 163.65 | 133.65 | 103.65 | 73.65 | 43.65 | 13.64 | |
| 자산 | 5.33% | 169.84 | 139.83 | 109.83 | 79.83 | 49.83 | (10.18) | |
| 사 | 2.67% | 135.29 | 105.28 | 75.28 | 45.28 | 15.28 | (44.73) | |
| 나 | 0.00% | 90.01 | 60.00 | 30.00 | 0.00 | (30.00) | (90.01) | |
| 리 | -2.67% | 34.00 | 3.99 | (26.01) | (56.01) | (86.01) | (146.02) | |
| 오 | -5.33% | (32.75) | (62.75) | (92.75) | (122.75) | (152.75) | (212.76) | |
| 시 | -8.00% | (110.22) | (140.22) | (170.22) | (200.22) | (230.23) | (290.23) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR6553363153 | 우리투자증권(ELS)4485 | 72.05 |
| KR6573353150 | 한국투자증권(ELS)2116 | 72.56 |
| KR6593354154 | 미래에셋증권(ELS)2235 | 72.47 |
| KR6663346155 | 동양W(ELS)1009 | 73.16 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 290.23 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 276.09

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: #REF!

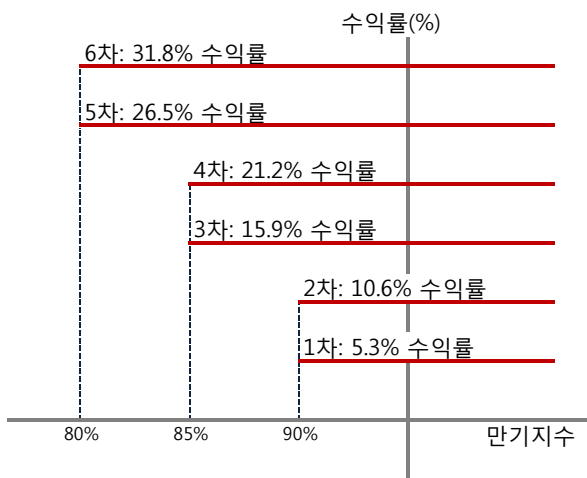
1. 계약금액

단위(백만원)

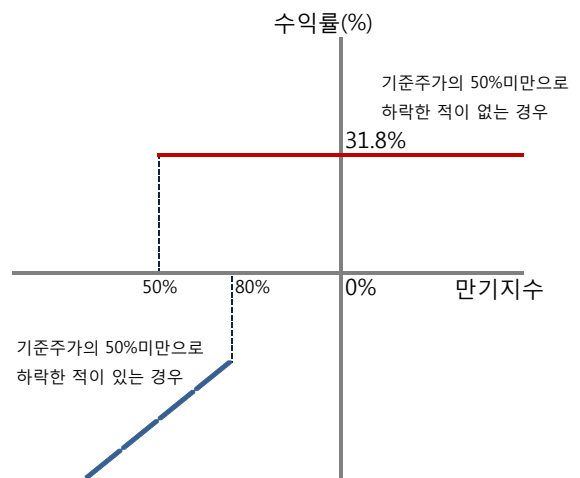
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 7,070 | 0 | 7,070 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 7,070 | 0 | 7,070 | 장외 |

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 | 334.31 | 286.09 | 237.87 | 189.65 | 141.43 | 93.21 | 44.98 | |
| 자산 | 283.35 | 235.13 | 186.91 | 138.69 | 90.46 | 42.24 | (5.98) | |
| 시나 | 220.13 | 171.91 | 123.69 | 75.47 | 27.25 | (20.97) | (69.20) | |
| 리오 | 144.67 | 96.44 | 48.22 | 0.00 | (48.22) | (96.44) | (144.67) | |
| | 56.94 | 8.72 | (39.50) | (87.72) | (135.94) | (184.17) | (232.39) | |
| | (43.03) | (91.25) | (139.48) | (187.70) | (235.92) | (284.14) | (332.36) | |
| | (155.26) | (203.48) | (251.70) | (299.93) | (348.15) | (396.37) | (444.59) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65533C6151 | 우리투자증권(ELS)4595 | 110.44 |
| KR65933AH150 | 미래에셋증권(ELS)2299 | 111.08 |
| KR66633AV156 | 동양W(ELS)1019 | 112.14 |
| KR67033A2153 | H&D증권(ELS)1724 | 110.93 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 444.59 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 462.62

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: #REF!

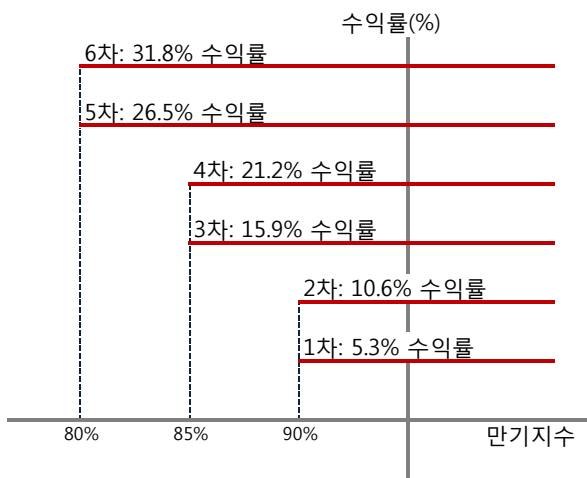
1. 계약금액

단위(백만원)

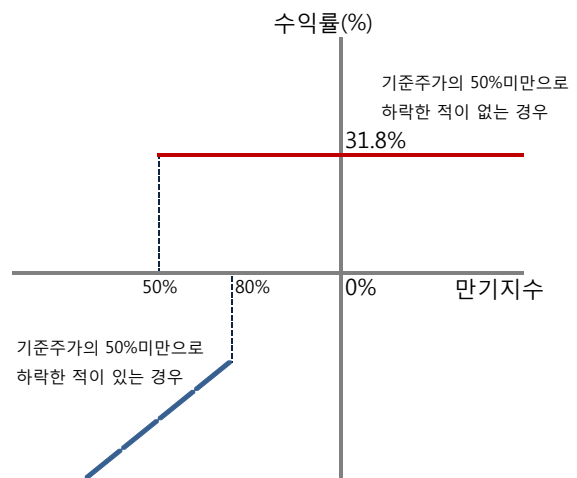
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,480 | 0 | 5,480 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,480 | 0 | 5,480 | 장외 |

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 | 226.68 | 191.61 | 156.55 | 121.49 | 86.43 | 51.37 | 16.30 | |
| 자산 | 5.33% | 196.33 | 161.27 | 126.21 | 91.15 | 21.02 | (14.04) | |
| 사 | 2.67% | 155.83 | 120.77 | 85.71 | 50.65 | (19.47) | (54.54) | |
| 나 | 0.00% | 105.19 | 70.12 | 35.06 | 0.00 | (35.06) | (105.19) | |
| 리 | -2.67% | 44.38 | 9.32 | (25.74) | (60.80) | (95.86) | (165.99) | |
| 오 | -5.33% | (26.57) | (61.63) | (96.69) | (131.75) | (166.81) | (236.94) | |
| | -8.00% | (107.67) | (142.73) | (177.80) | (212.86) | (247.92) | (318.04) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6503341168 | 신한투자(ELS)2834 | 79.70 |
| KR6553344161 | 우리투자증권(ELS)4621 | 77.32 |
| KR6583319167 | 현대증권(ELS)2011-1768 | 80.41 |
| KR6663324160 | 동양W(ELS)1028 | 80.62 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 318.04 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 290.07

메리츠한증지수연계증권제21호[ELS-파생형]

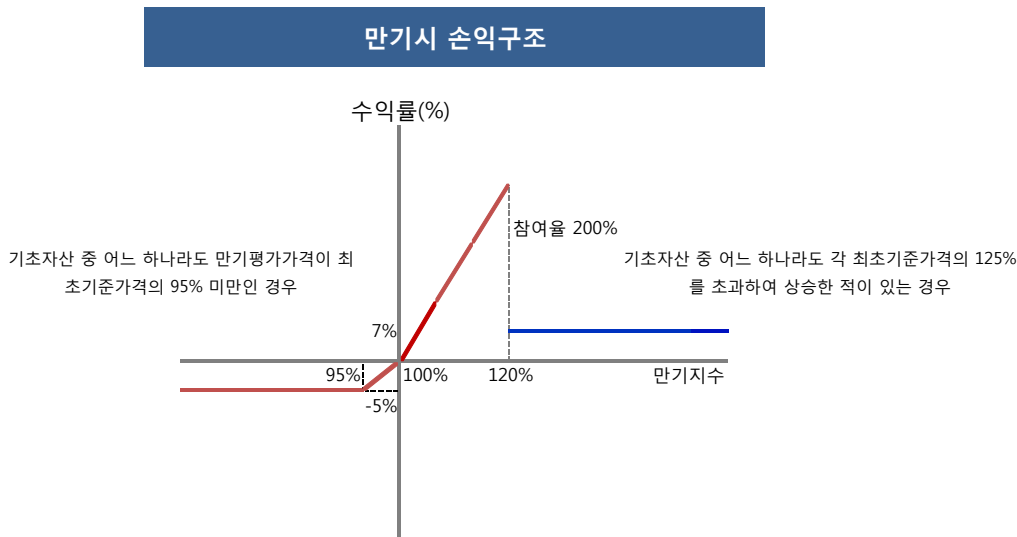
공시일: #REF!

1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 771 | 0 | 771 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 771 | 0 | 771 | 장외 |

단위(백만원)

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% | 9.55 | 9.03 | 8.51 | 7.99 | 7.47 | 6.95 | 6.43 |
| | 5.33% | 7.27 | 6.75 | 6.23 | 5.71 | 5.19 | 4.68 | 4.16 |
| | 2.67% | 4.61 | 4.09 | 3.57 | 3.05 | 2.53 | 2.01 | 1.49 |
| | 0.00% | 1.56 | 1.04 | 0.52 | 0.00 | (0.52) | (1.04) | (1.56) |
| | -2.67% | (1.88) | (2.40) | (2.92) | (3.44) | (3.96) | (4.48) | (4.99) |
| | -5.33% | (5.70) | (6.22) | (6.74) | (7.26) | (7.78) | (8.30) | (8.82) |
| | -8.00% | (9.90) | (10.42) | (10.94) | (11.46) | (11.98) | (12.50) | (13.02) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|----------------|--------------|
| KR65033B3162 | 신한투자(ELS)2918 | 3.26 |
| KR65233AN161 | 대우증권ELS5772 | 3.26 |
| KR6663386169 | 동양W(ELS)1037 | 3.25 |
| KR6773318169 | KB STAR(ELS)29 | 3.26 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 13.02 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 15.41

메리츠한증지수연계증권제23호[ELS-파생형]

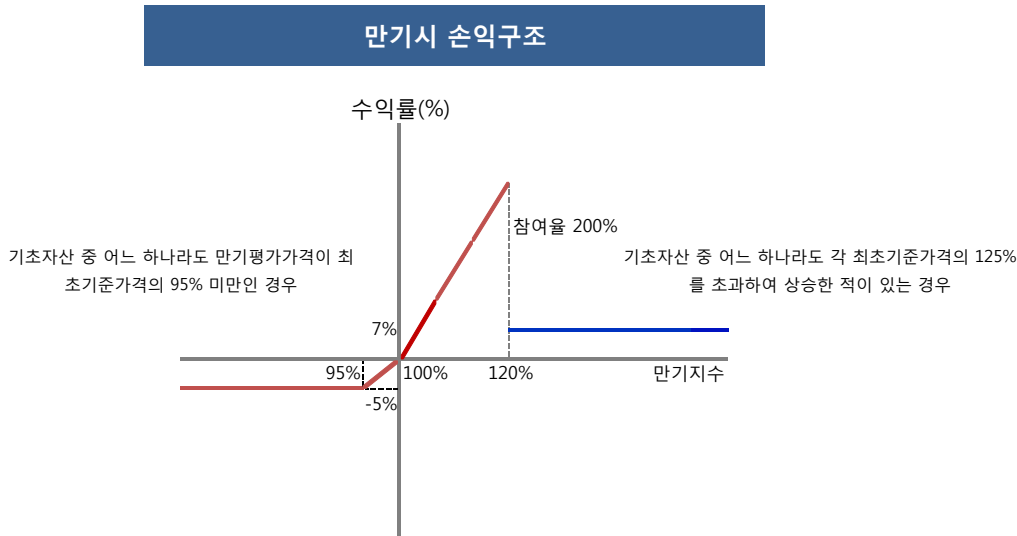
공시일: #REF!

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,594 | 0 | 1,594 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,594 | 0 | 1,594 | 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% | 17.44 | 16.55 | 15.67 | 14.78 | 13.89 | 13.01 | 12.12 |
| | 5.33% | 13.02 | 12.13 | 11.24 | 10.35 | 9.47 | 8.58 | 7.69 |
| | 2.67% | 8.09 | 7.20 | 6.32 | 5.43 | 4.54 | 3.65 | 2.77 |
| | 0.00% | 2.66 | 1.77 | 0.89 | 0.00 | (0.89) | (1.77) | (2.66) |
| | -2.67% | (3.27) | (4.16) | (5.04) | (5.93) | (6.82) | (7.70) | (8.59) |
| | -5.33% | (9.70) | (10.59) | (11.47) | (12.36) | (13.25) | (14.14) | (15.02) |
| | -8.00% | (16.63) | (17.52) | (18.41) | (19.29) | (20.18) | (21.07) | (21.95) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------|----------------|-------|
| KR65233BE168 | 대우증권ELS5786 | 5.44 |
| KR66633A1169 | 동양W(ELS)1038 | 5.50 |
| KR67033A0165 | H&D증권(ELS)1809 | 5.51 |
| KR6773321163 | KB STAR(ELS)30 | 5.51 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 21.95 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

25.73

메리츠주가지수연계증권제14호[ELS-파생형]

공시일: #REF!

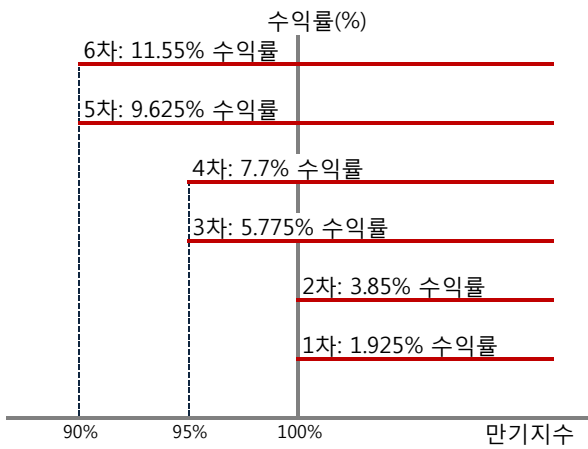
1. 계약금액

단위(백만원)

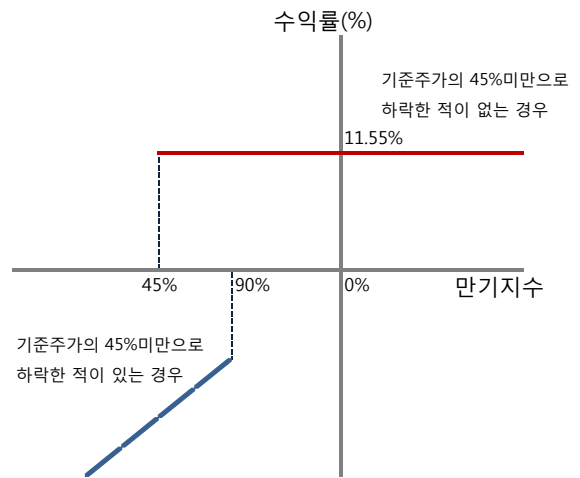
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |

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% | (88.52) | (87.83) | (87.14) | (86.45) | (85.76) | (85.07) | (84.38) |
| | 5.33% | (58.54) | (57.85) | (57.16) | (56.47) | (55.78) | (55.09) | (54.40) |
| | 2.67% | (29.73) | (29.04) | (28.35) | (27.65) | (26.96) | (26.27) | (25.58) |
| | 0.00% | (2.07) | (1.38) | (0.69) | 0.00 | 0.69 | 1.38 | 2.07 |
| | -2.67% | 24.42 | 25.11 | 25.80 | 26.49 | 27.18 | 27.87 | 28.57 |
| | -5.33% | 49.75 | 50.44 | 51.13 | 51.83 | 52.52 | 53.21 | 53.90 |
| | -8.00% | 73.92 | 74.61 | 75.30 | 76.00 | 76.69 | 77.38 | 78.07 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|---------------|--------------|
| KR65033BQ166 | 신한투자(ELS)2937 | 23.25 |
| KR65233BN169 | 대우증권ELS5795 | 24.60 |
| KR66633A3165 | 동양W(ELS)1044 | 19.12 |
| KR6673335164 | 해피플러스(ELS)611 | 21.54 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 88.52 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 103.09

메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: #REF!

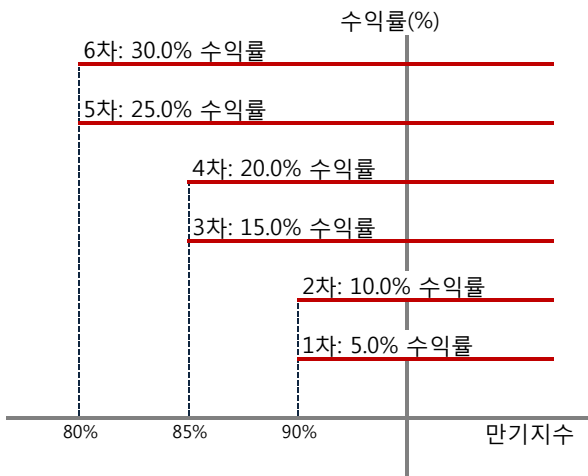
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,910 | 0 | 5,910 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,910 | 0 | 5,910 | 장외 |

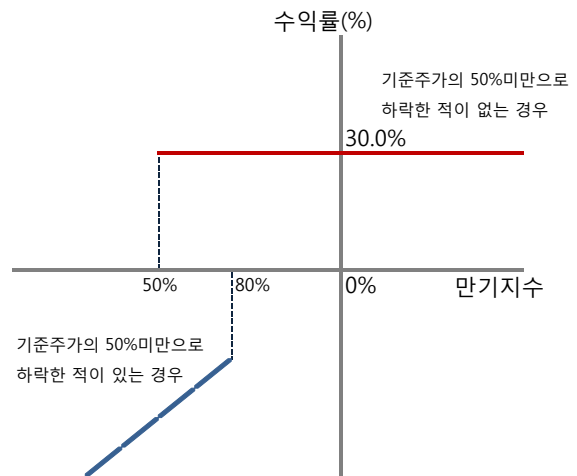
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|--|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00% | 5.33% | 2.67% | 0.00% | -2.67% | -5.33% | -8.00% | |
| | 270.56 | 231.61 | 182.61 | 123.54 | 54.41 | (24.78) | (114.04) | |
| | 229.38 | 190.43 | 141.43 | 82.36 | 13.23 | (65.96) | (155.22) | |
| | 188.20 | 149.25 | 100.25 | 41.18 | (27.95) | (107.14) | (196.40) | |
| | 147.02 | 108.07 | 59.07 | 0.00 | (69.13) | (148.32) | (237.58) | |
| | 105.84 | 66.89 | 17.89 | (41.18) | (110.31) | (189.50) | (278.76) | |
| | 64.66 | 25.71 | (23.29) | (82.36) | (151.49) | (230.68) | (319.94) | |
| | 23.48 | (15.47) | (64.47) | (123.54) | (192.67) | (271.86) | (361.12) | |

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| 시나리오 | 자산 | 최대손실 예상금액 |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR6503322176 | 신한투자(ELS)2982 | 90.28 |
| KR6543311171 | 신영증권(ELS)2189 | 90.28 |
| KR6553334170 | 우리투자증권(ELS)4750 | 89.49 |
| KR6663322172 | 동양W(ELS)1040 | 91.06 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 361.12 |

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 337.06