

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

# 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

## 1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 5,393 | 0     | 5,393     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 5,393 | 0     | 5,393     | 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   | 666.95   | 633.48   | 600.02   | 566.55   | 533.09   | 499.62   | 466.16    |  |
| 자산   | 517.02   | 483.56   | 450.09   | 416.63   | 383.16   | 349.70   | 316.23    |  |
| 시나리오 | 328.17   | 294.71   | 261.24   | 227.78   | 194.31   | 160.85   | 127.38    |  |
| 리    | 100.40   | 66.93    | 33.47    | 0.00     | (33.47)  | (66.93)  | (100.40)  |  |
|      | (166.31) | (199.77) | (233.24) | (266.70) | (300.17) | (333.63) | (367.10)  |  |
|      | (471.93) | (505.40) | (538.86) | (572.33) | (605.79) | (639.26) | (672.72)  |  |
|      | (816.49) | (849.95) | (883.42) | (916.88) | (950.35) | (983.81) | (1017.28) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |                |
|--------------------|--------------------|----------------|
| KR6502348032       | 신한투자(ELS)1408      | 144.76         |
| KR6582353035       | 현대증권(ELS)2010-1232 | 290.97         |
| KR6661350035       | 동양(ELS)520         | 290.33         |
| KR6702358039       | H&D증권(ELS)545      | 291.22         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>1017.28</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1,016.69

# 메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

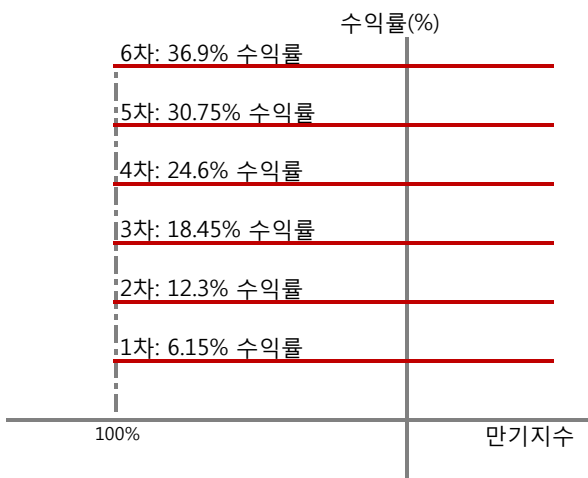
## 1. 계약금액

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 | 변동성 시나리오 |          |          |          |          |          |          |
|------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
|            |          | -25.00%  | -16.67%  | -8.33%   | 0.00%    | 8.33%    | 16.67%   | 25.00%   |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00%    | 232.56   | 223.60   | 214.64   | 205.68   | 196.72   | 187.76   | 178.80   |
|            | 5.33%    | 158.31   | 149.35   | 140.39   | 131.43   | 122.47   | 113.51   | 104.54   |
|            | 2.67%    | 89.75    | 80.79    | 71.83    | 62.87    | 53.91    | 44.95    | 35.98    |
|            | 0.00%    | 26.88    | 17.92    | 8.96     | 0.00     | (8.96)   | (17.92)  | (26.88)  |
|            | -2.67%   | (30.29)  | (39.25)  | (48.21)  | (57.18)  | (66.14)  | (75.10)  | (84.06)  |
|            | -5.33%   | (81.78)  | (90.74)  | (99.70)  | (108.66) | (117.62) | (126.58) | (135.54) |
|            | -8.00%   | (127.57) | (136.53) | (145.49) | (154.45) | (163.41) | (172.37) | (181.34) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |               |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65293160A1       | 대우증권ELS4537        | 45.82         |
| KR65593110A3       | 우리투자증권(ELS)3541    | 43.67         |
| KR65893090A4       | 현대증권(ELS)2010-1453 | 45.89         |
| KR66693120A9       | 동양W(ELS)927        | 45.96         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>181.34</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 196.99

# 메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

## 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<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%  | 76.15    | 72.99   | 69.82   | 66.66   | 63.50   | 60.34   | 57.17   |
|                      | 5.33%  | 51.97    | 48.81   | 45.65   | 42.49   | 39.32   | 36.16   | 33.00   |
|                      | 2.67%  | 29.75    | 26.59   | 23.43   | 20.27   | 17.10   | 13.94   | 10.78   |
|                      | 0.00%  | 9.49     | 6.32    | 3.16    | 0.00    | (3.16)  | (6.32)  | (9.49)  |
|                      | -2.67% | (8.82)   | (11.99) | (15.15) | (18.31) | (21.47) | (24.63) | (27.80) |
|                      | -5.33% | (25.18)  | (28.34) | (31.50) | (34.67) | (37.83) | (40.99) | (44.15) |
|                      | -8.00% | (39.58)  | (42.74) | (45.90) | (49.07) | (52.23) | (55.39) | (58.55) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |              |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR65523460C3       | 우리투자증권(ELS)3756    | 14.54        |
| KR65823220C8       | 현대증권(ELS)2010-1534 | 14.64        |
| KR65923520C0       | 미래에셋증권(ELS)1637    | 14.61        |
| KR66623360C2       | 동양W(ELS)950        | 14.77        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>58.55</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 62.09

# 메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

## 1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 3,396 | -58   | 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 | 165.89   | 158.73  | 151.57   | 144.41   | 137.25   | 130.10   | 122.94   |  |
| 자산 | 113.67   | 106.51  | 99.35    | 92.19    | 85.03    | 77.88    | 70.72    |  |
| 시나 | 65.53    | 58.37   | 51.21    | 44.06    | 36.90    | 29.74    | 22.58    |  |
| 리오 | 21.48    | 14.32   | 7.16     | 0.00     | (7.16)   | (14.32)  | (21.48)  |  |
|    | (18.50)  | (25.66) | (32.81)  | (39.97)  | (47.13)  | (54.29)  | (61.45)  |  |
|    | (54.39)  | (61.55) | (68.71)  | (75.86)  | (83.02)  | (90.18)  | (97.34)  |  |
|    | (86.20)  | (93.36) | (100.51) | (107.67) | (114.83) | (121.99) | (129.15) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |               |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523450C4       | 우리투자증권(ELS)3755    | 32.73         |
| KR65823210C9       | 현대증권(ELS)2010-1533 | 32.92         |
| KR65923510C1       | 미래에셋증권(ELS)1636    | 32.75         |
| KR66623340C4       | 동양W(ELS)949        | 30.75         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>129.15</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

137.77

# 메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

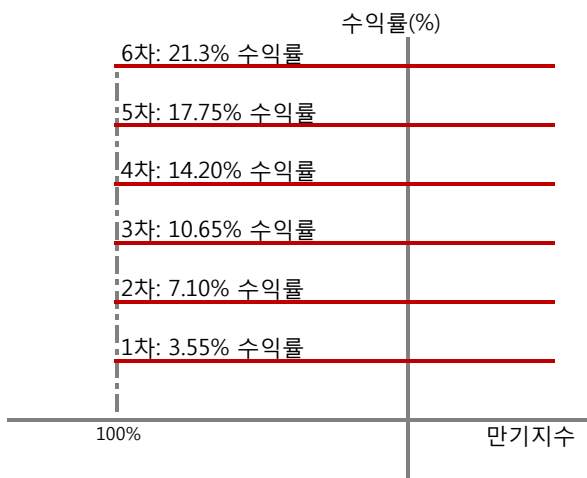
## 1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 1,092 | -120  | 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   | 1.64     | 1.39    | 1.14   | 0.88   | 0.63   | 0.38   | 0.12   |  |
| 자산   | 5.33%    | 1.37    | 1.12   | 0.87   | 0.61   | 0.36   | (0.15) |  |
| 시나리오 | 2.67%    | 1.08    | 0.83   | 0.57   | 0.32   | 0.07   | (0.19) |  |
|      | 0.00%    | 0.76    | 0.51   | 0.25   | 0.00   | (0.25) | (0.51) |  |
|      | -2.67%   | 0.41    | 0.16   | (0.09) | (0.35) | (0.60) | (0.85) |  |
|      | -5.33%   | 0.04    | (0.21) | (0.46) | (0.72) | (0.97) | (1.22) |  |
|      | -8.00%   | (0.35)  | (0.61) | (0.86) | (1.11) | (1.37) | (1.62) |  |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |                    | 단위(백만원)     |
|---------------------|--------------------|-------------|
| KR6552345128        | 우리투자증권(ELS)3989    | 0.52        |
| KR6582317121        | 현대증권(ELS)2011-1588 | 0.52        |
| KR6592350120        | 미래에셋증권(ELS)1896    | 0.31        |
| KR6662316126        | 동양W(ELS)974        | 0.52        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b>  |                    | <b>1.87</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |      |
|-----|------|
| 위험액 | 0.82 |
|-----|------|

# 메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

## 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%    | 16.28    | 14.62   | 12.97  | 11.31   | 9.66    | 8.00    | 6.35    |
|            | 5.33%    | 12.39    | 10.73   | 9.08   | 7.42    | 5.77    | 4.11    | 2.46    |
|            | 2.67%    | 8.62     | 6.96    | 5.31   | 3.65    | 2.00    | 0.34    | (1.31)  |
|            | 0.00%    | 4.97     | 3.31    | 1.66   | 0.00    | (1.66)  | (3.31)  | (4.97)  |
|            | -2.67%   | 1.43     | (0.22)  | (1.88) | (3.54)  | (5.19)  | (6.85)  | (8.50)  |
|            | -5.33%   | (1.99)   | (3.64)  | (5.30) | (6.95)  | (8.61)  | (10.26) | (11.92) |
|            | -8.00%   | (5.29)   | (6.94)  | (8.60) | (10.25) | (11.91) | (13.56) | (15.22) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |              |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6502331129       | 신한투자(ELS)2235      | 3.96         |
| KR6552343123       | 우리투자증권(ELS)3988    | 3.32         |
| KR6582319127       | 현대증권(ELS)2011-1589 | 3.96         |
| KR6662317124       | 동양W(ELS)975        | 3.98         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>15.22</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

14.59

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

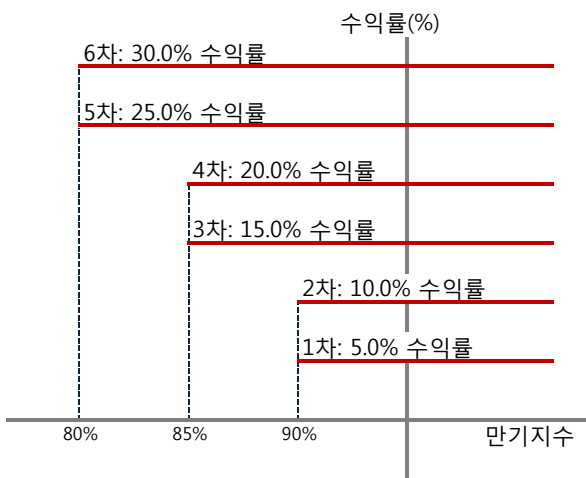
## 1. 계약금액

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 | 420.38   | 381.00   | 341.62   | 302.24   | 262.86   | 223.49   | 184.11   |  |
| 자산 | 340.27   | 300.89   | 261.51   | 222.13   | 182.76   | 143.38   | 104.00   |  |
| 시나 | 239.52   | 200.14   | 160.77   | 121.39   | 82.01    | 42.63    | 3.25     |  |
| 리오 | 0.00%    | 78.76    | 39.38    | 0.00     | (39.38)  | (78.76)  | (118.14) |  |
|    | -2.67%   | (23.89)  | (63.27)  | (102.65) | (142.03) | (181.40) | (220.78) |  |
|    | -5.33%   | (186.55) | (225.93) | (265.31) | (304.69) | (344.07) | (383.45) |  |
|    | -8.00%   | (369.85) | (409.23) | (448.61) | (487.99) | (527.37) | (566.75) |  |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |                    | 단위(백만원)       |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140        | 우리투자증권(ELS)4416    | 161.00        |
| KR6582383149        | 현대증권(ELS)2011-1698 | 161.79        |
| KR6592397147        | 미래에셋증권(ELS)2173    | 159.92        |
| KR6662374141        | 동양W(ELS)1004       | 123.42        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b>  |                    | <b>606.13</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 542.46



# 메리츠한증지수연계증권제16호[ELS-파생형]

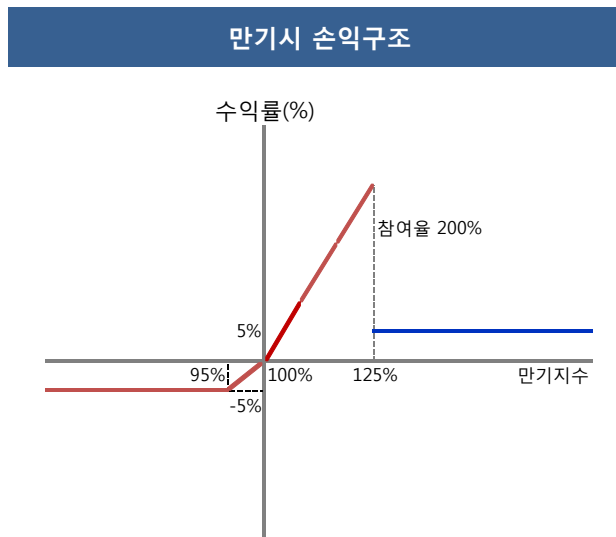
공시일: 2012-04-23

## 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   | 1.68     | 1.67    | 1.67   | 1.67   | 1.67   | 1.67   | 1.67   |
| 자산   | 1.00     | 1.00    | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 0.99   |
| 시나리오 | 0.44     | 0.44    | 0.44   | 0.44   | 0.44   | 0.44   | 0.44   |
| 리오   | 0.00     | 0.00    | 0.00   | 0.00   | (0.00) | (0.00) | (0.00) |
|      | (0.32)   | (0.32)  | (0.32) | (0.32) | (0.32) | (0.32) | (0.32) |
|      | (0.52)   | (0.52)  | (0.52) | (0.52) | (0.52) | (0.52) | (0.53) |
|      | (0.60)   | (0.61)  | (0.61) | (0.61) | (0.61) | (0.61) | (0.61) |

### 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |             |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6543308151       | 신영증권(ELS)2093      | 0.14        |
| KR6583331154       | 현대증권(ELS)2011-1724 | 0.16        |
| KR6663340158       | 동양W(ELS)1007       | 0.16        |
| KR6703330151       | H&D증권(ELS)1663     | 0.16        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>0.61</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.59

# 메리츠한증지수연계증권제15호[ELS-파생형]

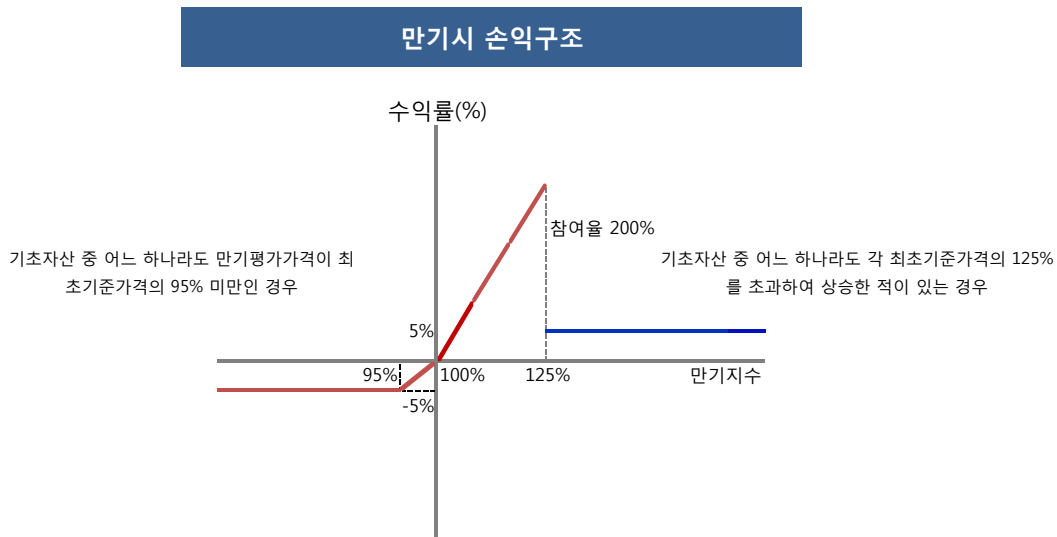
공시일: 2012-04-23

## 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                   | 변동성 시나리오 |         |        |        |        |        |        |        |
|----------------------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
|                      | -25.00%  | -16.67% | -8.33% | 0.00%  | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| 기초<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%    | 1.44    | 1.44   | 1.44   | 1.44   | 1.44   | 1.44   | 1.44   |
|                      | 5.33%    | 0.86    | 0.86   | 0.86   | 0.86   | 0.86   | 0.86   | 0.85   |
|                      | 2.67%    | 0.38    | 0.38   | 0.38   | 0.38   | 0.38   | 0.37   | 0.37   |
|                      | 0.00%    | 0.00    | 0.00   | 0.00   | 0.00   | (0.00) | (0.00) | (0.00) |
|                      | -2.67%   | (0.27)  | (0.27) | (0.27) | (0.27) | (0.27) | (0.27) | (0.27) |
|                      | -5.33%   | (0.44)  | (0.44) | (0.44) | (0.44) | (0.44) | (0.44) | (0.44) |
|                      | -8.00%   | (0.50)  | (0.50) | (0.50) | (0.50) | (0.50) | (0.50) | (0.50) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |             |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6503316152       | 신한투자(ELS)2641      | 0.12        |
| KR6523330159       | 대우증권ELS5497        | 0.13        |
| KR6583327152       | 현대증권(ELS)2011-1720 | 0.12        |
| KR6663335158       | 동양W(ELS)1005       | 0.12        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>0.50</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.45

# 메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

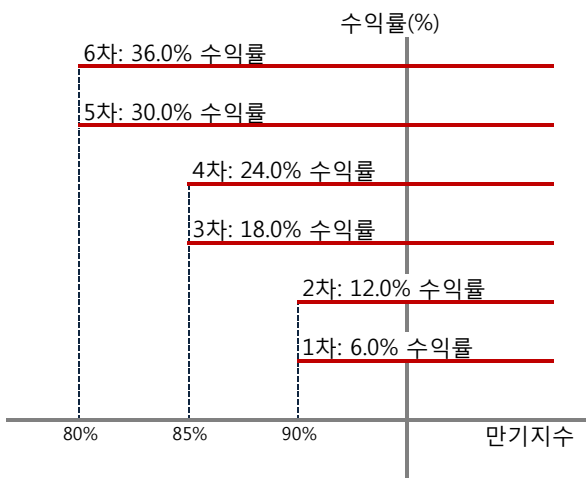
## 1. 계약금액

단위(백만원)

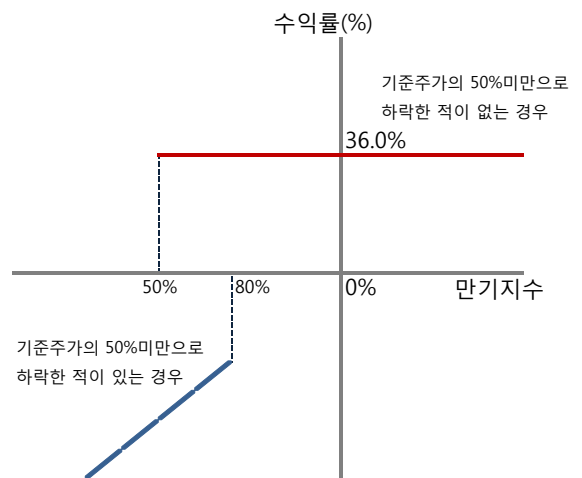
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 20,001 | 0     | 20,001    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 20,001 | 0     | 20,001    | 장외 |

## 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%    | (168.76) | (168.23) | (167.71) | (167.18) | (166.66) | (166.13) | (165.60) |
|            | 5.33%    | (102.81) | (102.28) | (101.76) | (101.23) | (100.70) | (100.18) | (99.65)  |
|            | 2.67%    | (47.08)  | (46.55)  | (46.03)  | (45.50)  | (44.98)  | (44.45)  | (43.93)  |
|            | 0.00%    | (1.58)   | (1.05)   | (0.53)   | 0.00     | 0.53     | 1.05     | 1.58     |
|            | -2.67%   | 33.70    | 34.23    | 34.75    | 35.28    | 35.80    | 36.33    | 36.86    |
|            | -5.33%   | 58.76    | 59.28    | 59.81    | 60.33    | 60.86    | 61.38    | 61.91    |
|            | -8.00%   | 73.59    | 74.11    | 74.64    | 75.16    | 75.69    | 76.21    | 76.74    |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |                 | 단위(백만원)       |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR6553331150        | 우리투자증권(ELS)4448 | 46.94         |
| KR6573333152        | 한국투자증권(ELS)2106 | 43.75         |
| KR6663329151        | 동양W(ELS)1018    | 36.56         |
| KR6673309151        | 해피플러스(ELS)529   | 41.50         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b>  |                 | <b>168.76</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |       |
|-----|-------|
| 위험액 | 67.50 |
|-----|-------|

# 메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

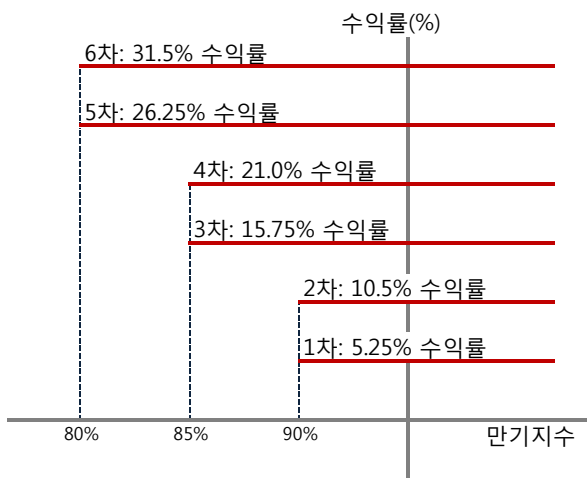
## 1. 계약금액

단위(백만원)

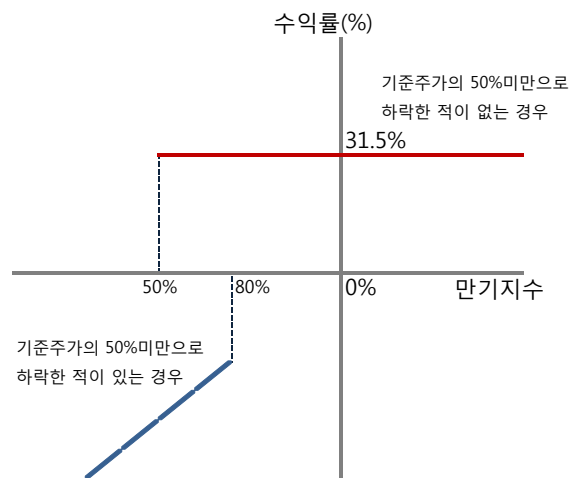
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 4,938 | 0     | 4,938     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 4,938 | 0     | 4,938     | 장외 |

## 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   | 263.02   | 237.21   | 211.41   | 185.61   | 159.80   | 134.00   | 108.19   |          |
| 자산   | 209.03   | 183.23   | 157.43   | 131.62   | 105.82   | 80.01    | 54.21    |          |
| 시나리오 | 147.17   | 121.36   | 95.56    | 69.75    | 43.95    | 18.14    | (7.66)   |          |
| 리오   | 0.00%    | 77.41    | 51.61    | 25.80    | 0.00     | (25.80)  | (51.61)  | (77.41)  |
|      | -2.67%   | (0.23)   | (26.03)  | (51.83)  | (77.64)  | (103.44) | (129.25) | (155.05) |
|      | -5.33%   | (85.75)  | (111.55) | (137.36) | (163.16) | (188.97) | (214.77) | (240.57) |
|      | -8.00%   | (179.16) | (204.96) | (230.77) | (256.57) | (282.37) | (308.18) | (333.98) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |                 | 단위(백만원)       |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR6553363153        | 우리투자증권(ELS)4485 | 82.31         |
| KR6573353150        | 한국투자증권(ELS)2116 | 83.27         |
| KR6593354154        | 미래에셋증권(ELS)2235 | 83.49         |
| KR6663346155        | 동양W(ELS)1009    | 84.92         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b>  |                 | <b>333.98</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |        |
|-----|--------|
| 위험액 | 344.66 |
|-----|--------|

# 메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

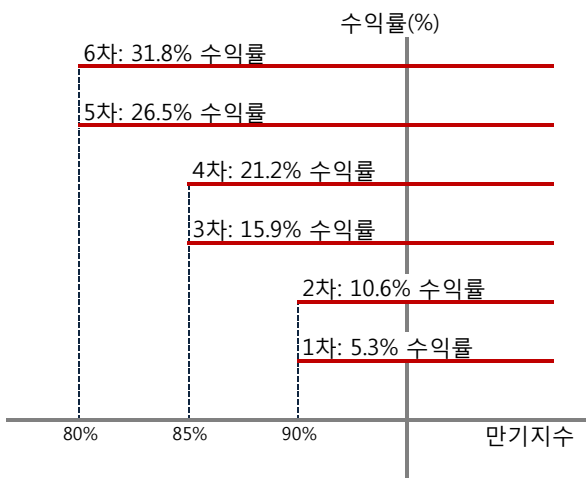
## 1. 계약금액

단위(백만원)

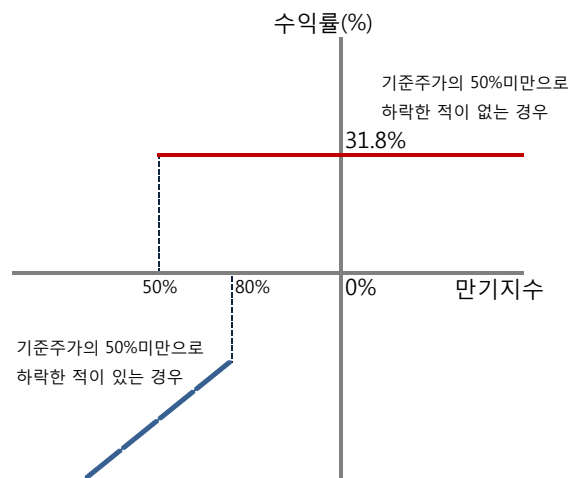
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 7,070 | 0     | 7,070     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 7,070 | 0     | 7,070     | 장외 |

## 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   | 333.80   | 296.55   | 259.29   | 222.04   | 184.78   | 147.53   | 110.27   |  |
| 자산   | 274.52   | 237.26   | 200.01   | 162.75   | 125.50   | 88.25    | 50.99    |  |
| 시나리오 | 200.51   | 163.25   | 126.00   | 88.74    | 51.49    | 14.23    | (23.02)  |  |
|      | 111.76   | 74.51    | 37.25    | 0.00     | (37.25)  | (74.51)  | (111.76) |  |
|      | 8.29     | (28.96)  | (66.22)  | (103.47) | (140.73) | (177.98) | (215.24) |  |
|      | (109.91) | (147.17) | (184.42) | (221.67) | (258.93) | (296.18) | (333.44) |  |
|      | (242.84) | (280.10) | (317.35) | (354.61) | (391.86) | (429.11) | (466.37) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                 |               |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65533C6151       | 우리투자증권(ELS)4595 | 110.12        |
| KR65933AH150       | 미래에셋증권(ELS)2299 | 118.06        |
| KR66633AV156       | 동양W(ELS)1019    | 120.44        |
| KR67033A2153       | H&D증권(ELS)1724  | 117.75        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                 | <b>466.37</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

463.74

# 메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

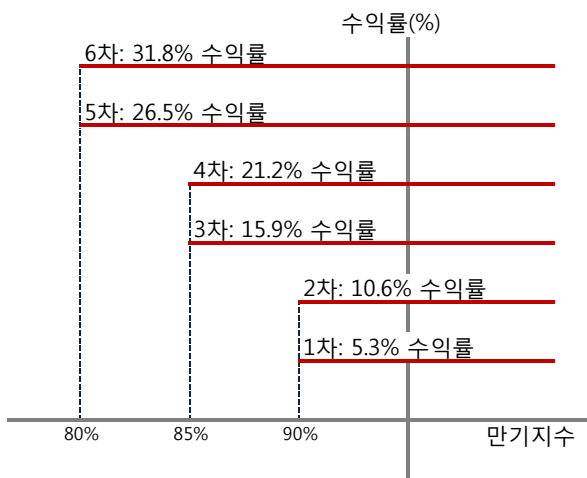
## 1. 계약금액

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   | 230.69   | 203.18   | 175.66   | 148.15   | 120.64   | 93.13    | 65.62    |  |
| 자산   | 192.96   | 165.45   | 137.93   | 110.42   | 82.91    | 55.40    | 27.88    |  |
| 시나리오 | 143.57   | 116.06   | 88.55    | 61.04    | 33.52    | 6.01     | (21.50)  |  |
|      | 82.54    | 55.02    | 27.51    | 0.00     | (27.51)  | (55.02)  | (82.54)  |  |
|      | 9.85     | (17.66)  | (45.18)  | (72.69)  | (100.20) | (127.71) | (155.23) |  |
|      | (74.49)  | (102.00) | (129.52) | (157.03) | (184.54) | (212.05) | (239.57) |  |
|      | (170.48) | (198.00) | (225.51) | (253.02) | (280.53) | (308.05) | (335.56) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |               |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6503341168       | 신한투자(ELS)2834      | 83.82         |
| KR6553344161       | 우리투자증권(ELS)4621    | 80.96         |
| KR6583319167       | 현대증권(ELS)2011-1768 | 84.60         |
| KR6663324160       | 동양W(ELS)1028       | 86.18         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>335.56</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

317.82

# 메리츠한증지수연계증권제21호[ELS-파생형]

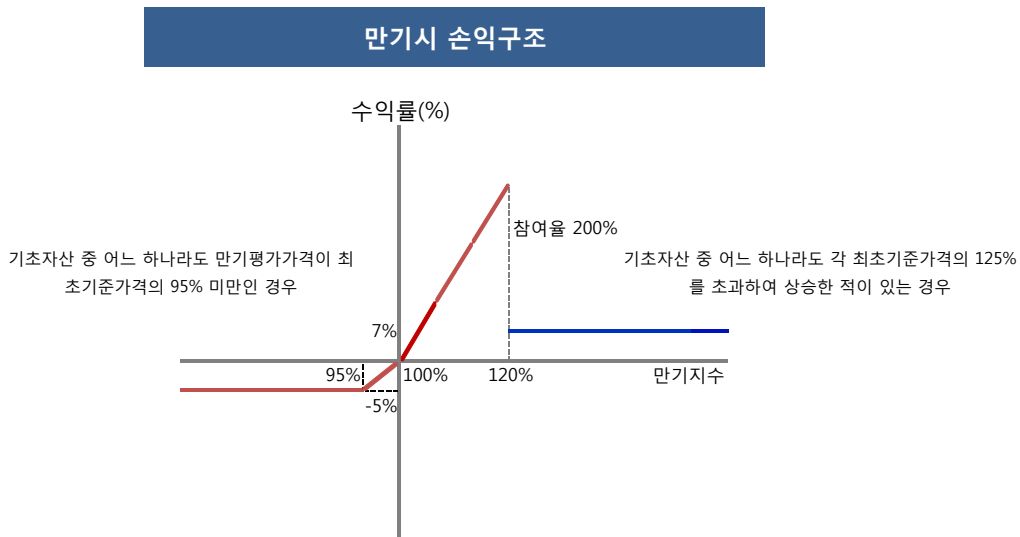
공시일: 2012-04-23

## 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<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%    | 16.84   | 16.65   | 16.45   | 16.26   | 16.07   | 15.87   | 15.68   |
|                      | 5.33%    | 11.04   | 10.85   | 10.66   | 10.47   | 10.27   | 10.08   | 9.89    |
|                      | 2.67%    | 5.62    | 5.43    | 5.24    | 5.05    | 4.85    | 4.66    | 4.47    |
|                      | 0.00%    | 0.58    | 0.39    | 0.19    | 0.00    | (0.19)  | (0.39)  | (0.58)  |
|                      | -2.67%   | (4.09)  | (4.28)  | (4.48)  | (4.67)  | (4.86)  | (5.06)  | (5.25)  |
|                      | -5.33%   | (8.39)  | (8.58)  | (8.77)  | (8.96)  | (9.16)  | (9.35)  | (9.54)  |
|                      | -8.00%   | (12.30) | (12.50) | (12.69) | (12.88) | (13.08) | (13.27) | (13.46) |

### 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                |              |
|--------------------|----------------|--------------|
| KR65033B3162       | 신한투자(ELS)2918  | 3.34         |
| KR65233AN161       | 대우증권ELS5772    | 3.38         |
| KR6663386169       | 동양W(ELS)1037   | 3.37         |
| KR6773318169       | KB STAR(ELS)29 | 3.37         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                | <b>13.46</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 15.75

# 메리츠한증지수연계증권제23호[ELS-파생형]

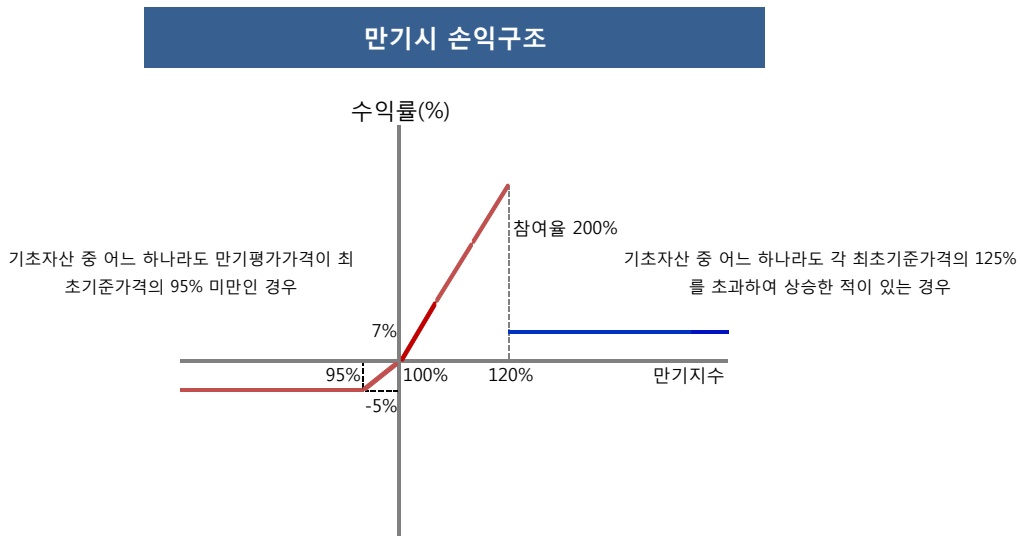
공시일: 2012-04-23

## 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<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%    | 27.76   | 27.47   | 27.19   | 26.91   | 26.63   | 26.35   | 26.06   |
|                      | 5.33%    | 17.96   | 17.68   | 17.40   | 17.12   | 16.84   | 16.55   | 16.27   |
|                      | 2.67%    | 8.99    | 8.71    | 8.43    | 8.15    | 7.87    | 7.58    | 7.30    |
|                      | 0.00%    | 0.85    | 0.56    | 0.28    | 0.00    | (0.28)  | (0.56)  | (0.85)  |
|                      | -2.67%   | (6.48)  | (6.76)  | (7.04)  | (7.33)  | (7.61)  | (7.89)  | (8.17)  |
|                      | -5.33%   | (12.98) | (13.27) | (13.55) | (13.83) | (14.11) | (14.39) | (14.68) |
|                      | -8.00%   | (18.67) | (18.95) | (19.23) | (19.51) | (19.79) | (20.08) | (20.36) |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |                | 단위(백만원)      |
|---------------------|----------------|--------------|
| KR65233BE168        | 대우증권ELS5786    | 5.04         |
| KR66633A1169        | 동양W(ELS)1038   | 5.10         |
| KR67033A0165        | H&D증권(ELS)1809 | 5.11         |
| KR6773321163        | KB STAR(ELS)30 | 5.11         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b>  |                | <b>20.36</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |       |
|-----|-------|
| 위험액 | 23.01 |
|-----|-------|



# 메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

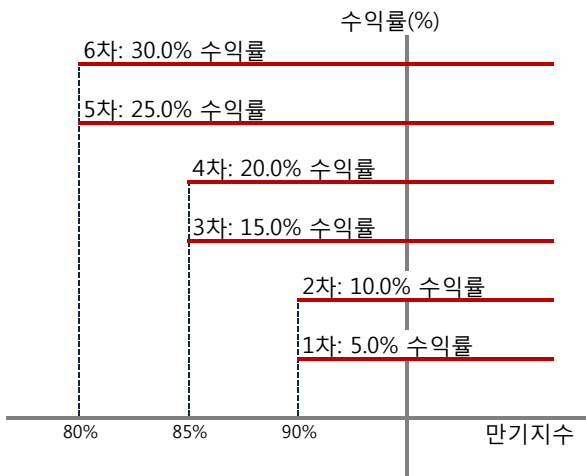
## 1. 계약금액

단위(백만원)

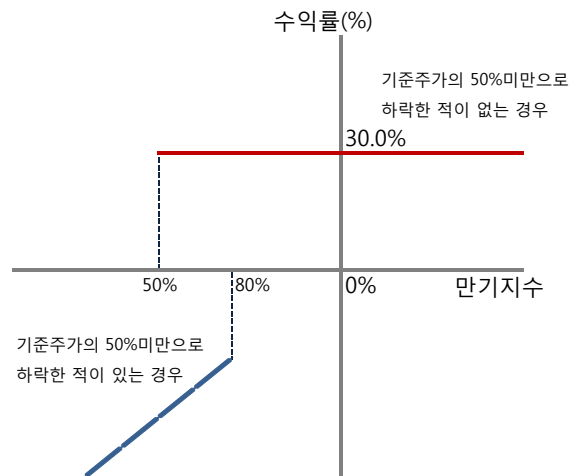
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 5,910 | 0     | 5,910     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 5,910 | 0     | 5,910     | 장외 |

## 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%    | 5.33%   | 2.67%   | 0.00%   | -2.67%   | -5.33%   | -8.00%   |  |
|            | 266.16   | 222.86  | 167.45  | 99.92   | 20.26    | (71.51)  | (175.40) |  |
|            | 232.85   | 189.56  | 134.14  | 66.61   | (13.04)  | (104.81) | (208.70) |  |
|            | 199.55   | 156.25  | 100.84  | 33.31   | (46.35)  | (138.12) | (242.01) |  |
|            | 166.24   | 122.95  | 67.53   | 0.00    | (79.65)  | (171.42) | (275.32) |  |
|            | 132.94   | 89.64   | 34.23   | (33.31) | (112.96) | (204.73) | (308.62) |  |
|            | 99.63    | 56.34   | 0.92    | (66.61) | (146.26) | (238.04) | (341.93) |  |
|            | 66.33    | 23.03   | (32.38) | (99.92) | (179.57) | (271.34) | (375.23) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                 |               |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR6503322176       | 신한투자(ELS)2982   | 93.62         |
| KR6543311171       | 신영증권(ELS)2189   | 93.57         |
| KR6553334170       | 우리투자증권(ELS)4750 | 92.62         |
| KR6663322172       | 동양W(ELS)1040    | 95.42         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                 | <b>375.23</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 349.03

# 메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제23호[ELS-파생형]

공시일: 2012-04-23

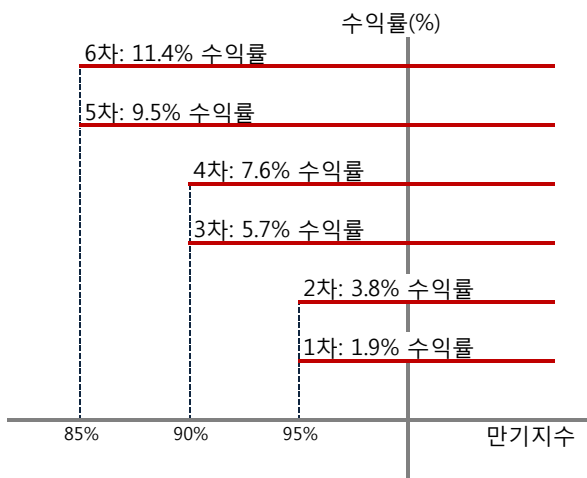
## 1. 계약금액

단위(백만원)

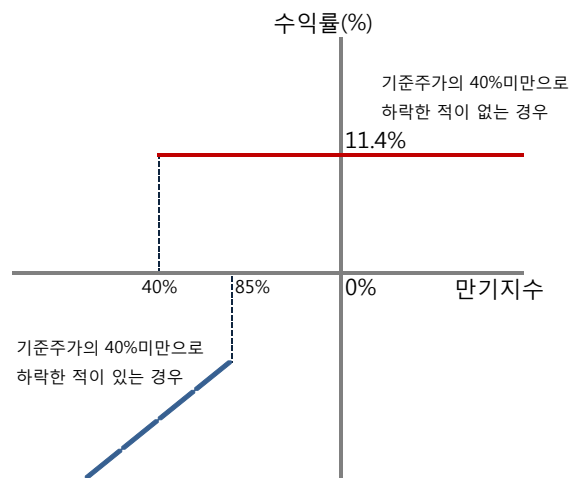
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 29,978 | 0     | 29,978    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 29,978 | 0     | 29,978    | 장외 |

## 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   | 67.09    | 68.36   | 69.62   | 70.89   | 72.16   | 73.43   | 74.69  |  |
| 자산   | 6.19     | 7.46    | 8.72    | 9.99    | 11.26   | 12.53   | 13.79  |  |
| 시나리오 | (17.44)  | (16.17) | (14.91) | (13.64) | (12.37) | (11.10) | (9.84) |  |
|      | (3.80)   | (2.54)  | (1.27)  | 0.00    | 1.27    | 2.54    | 3.80   |  |
|      | 47.11    | 48.37   | 49.64   | 50.91   | 52.18   | 53.44   | 54.71  |  |
|      | 135.28   | 136.55  | 137.82  | 139.08  | 140.35  | 141.62  | 142.89 |  |
|      | 260.73   | 262.00  | 263.26  | 264.53  | 265.80  | 267.07  | 268.33 |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                 |              |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6543334223       | 신영증권(ELS)2512   | 4.27         |
| KR6503386221       | 신한투자(ELS)3890   | 4.38         |
| KR6553395221       | 우리투자증권(ELS)5573 | 4.37         |
| KR65233AJ227       | 대우증권(ELS)6754   | 4.41         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                 | <b>17.44</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 256.44