

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,282 | 0 | 5,282 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,282 | 0 | 5,282 | 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 | 71.06 | 59.69 | 48.31 | 36.94 | 25.57 | 14.19 | 2.82 | |
| 자산 | 93.49 | 82.12 | 70.75 | 59.37 | 48.00 | 36.62 | 25.25 | |
| 시나리오 | 81.18 | 69.81 | 58.43 | 47.06 | 35.68 | 24.31 | 12.93 | |
| | 34.12 | 22.75 | 11.37 | 0.00 | (11.37) | (22.75) | (34.12) | |
| | (47.68) | (59.05) | (70.43) | (81.80) | (93.18) | (104.55) | (115.93) | |
| | (164.23) | (175.60) | (186.97) | (198.35) | (209.72) | (221.10) | (232.47) | |
| | (315.52) | (326.89) | (338.27) | (349.64) | (361.01) | (372.39) | (383.76) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR6502348032 | 신한투자(ELS)1408 | 47.63 |
| KR6582353035 | 현대증권(ELS)2010-1232 | 112.03 |
| KR6661350035 | 동양(ELS)520 | 112.08 |
| KR6702358039 | H&D증권(ELS)545 | 112.02 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 383.76 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 387.40

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,014 | 0 | 5,014 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,014 | 0 | 5,014 | 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 | 180.60 | 170.69 | 160.77 | 150.85 | 140.93 | 131.02 | 121.10 | |
| 자산 | 126.63 | 116.71 | 106.79 | 96.88 | 86.96 | 77.04 | 67.12 | |
| 시나리오 | 76.35 | 66.43 | 56.51 | 46.59 | 36.67 | 26.76 | 16.84 | |
| | 29.75 | 19.84 | 9.92 | 0.00 | (9.92) | (19.84) | (29.75) | |
| | (13.15) | (23.07) | (32.98) | (42.90) | (52.82) | (62.74) | (72.66) | |
| | (52.36) | (62.28) | (72.19) | (82.11) | (92.03) | (101.95) | (111.87) | |
| | (87.88) | (97.80) | (107.71) | (117.63) | (127.55) | (137.47) | (147.39) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 37.31 |
| KR65593110A3 | 우리투자증권(ELS)3541 | 35.30 |
| KR65893090A4 | 현대증권(ELS)2010-1453 | 37.36 |
| KR66693120A9 | 동양W(ELS)927 | 37.42 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 147.39 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 158.98

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

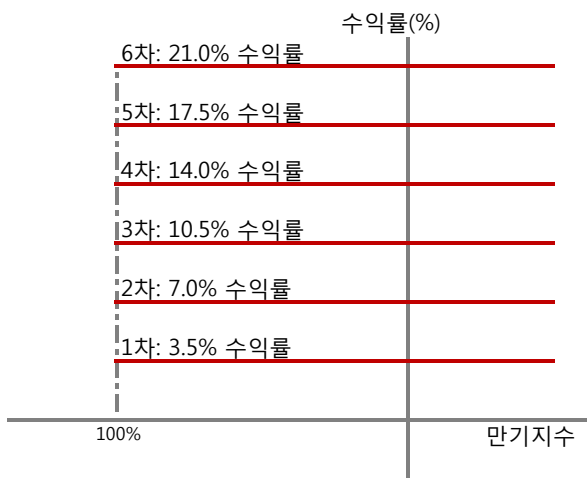
1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,424 | 0 | 3,424 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,424 | 0 | 3,424 | 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 | 77.60 | 72.96 | 68.33 | 63.69 | 59.06 | 54.42 | 49.78 | |
| 자산 | 55.09 | 50.45 | 45.82 | 41.18 | 36.54 | 31.91 | 27.27 | |
| 시나리오 | 33.86 | 29.22 | 24.59 | 19.95 | 15.31 | 10.68 | 6.04 | |
| | 13.91 | 9.27 | 4.64 | 0.00 | (4.64) | (9.27) | (13.91) | |
| | (4.76) | (9.40) | (14.03) | (18.67) | (23.31) | (27.94) | (32.58) | |
| | (22.15) | (26.79) | (31.42) | (36.06) | (40.69) | (45.33) | (49.97) | |
| | (38.26) | (42.89) | (47.53) | (52.17) | (56.80) | (61.44) | (66.08) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR65523460C3 | 우리투자증권(ELS)3756 | 16.86 |
| KR65823220C8 | 현대증권(ELS)2010-1534 | 17.01 |
| KR65923520C0 | 미래에셋증권(ELS)1637 | 16.98 |
| KR66623360C2 | 동양W(ELS)950 | 15.23 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 66.08 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 62.32

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,368 | 0 | 3,368 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,368 | 0 | 3,368 | 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% | 172.90 | 162.09 | 151.28 | 140.47 | 129.67 | 118.86 | 108.05 |
| | 5.33% | 123.41 | 112.61 | 101.80 | 90.99 | 80.18 | 69.38 | 58.57 |
| | 2.67% | 76.59 | 65.78 | 54.97 | 44.17 | 33.36 | 22.55 | 11.75 |
| | 0.00% | 32.42 | 21.61 | 10.81 | 0.00 | (10.81) | (21.61) | (32.42) |
| | -2.67% | (9.09) | (19.90) | (30.70) | (41.51) | (52.32) | (63.12) | (73.93) |
| | -5.33% | (47.94) | (58.75) | (69.55) | (80.36) | (91.17) | (101.98) | (112.78) |
| | -8.00% | (84.13) | (94.94) | (105.75) | (116.56) | (127.36) | (138.17) | (148.98) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523450C4 | 우리투자증권(ELS)3755 | 38.11 |
| KR65823210C9 | 현대증권(ELS)2010-1533 | 38.20 |
| KR65923510C1 | 미래에셋증권(ELS)1636 | 38.18 |
| KR66623340C4 | 동양W(ELS)949 | 34.48 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 148.98 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 141.26

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,092 | 0 | 1,092 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,092 | 0 | 1,092 | 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 | 2.50 | 2.25 | 2.01 | 1.76 | 1.51 | 1.27 | 1.02 | |
| 자산 | 1.89 | 1.64 | 1.40 | 1.15 | 0.91 | 0.66 | 0.41 | |
| 시나리오 | 1.30 | 1.06 | 0.81 | 0.57 | 0.32 | 0.07 | (0.17) | |
| | 0.74 | 0.49 | 0.25 | 0.00 | (0.25) | (0.49) | (0.74) | |
| | 0.19 | (0.05) | (0.30) | (0.55) | (0.79) | (1.04) | (1.28) | |
| | (0.33) | (0.58) | (0.83) | (1.07) | (1.32) | (1.57) | (1.81) | |
| | (0.84) | (1.09) | (1.33) | (1.58) | (1.83) | (2.07) | (2.32) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6552345128 | 우리투자증권(ELS)3989 | 0.64 |
| KR6582317121 | 현대증권(ELS)2011-1588 | 0.64 |
| KR6592350120 | 미래에셋증권(ELS)1896 | 0.39 |
| KR6662316126 | 동양W(ELS)974 | 0.64 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 2.32 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 2.73

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 711 | 0 | 711 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 711 | 0 | 711 | 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% | 7.07 | 6.49 | 5.91 | 5.34 | 4.76 | 4.18 | 3.61 |
| | 5.33% | 5.17 | 4.59 | 4.02 | 3.44 | 2.86 | 2.29 | 1.71 |
| | 2.67% | 3.39 | 2.81 | 2.24 | 1.66 | 1.09 | 0.51 | (0.07) |
| | 0.00% | 1.73 | 1.15 | 0.58 | 0.00 | (0.58) | (1.15) | (1.73) |
| | -2.67% | 0.18 | (0.39) | (0.97) | (1.54) | (2.12) | (2.70) | (3.27) |
| | -5.33% | (1.24) | (1.82) | (2.40) | (2.97) | (3.55) | (4.12) | (4.70) |
| | -8.00% | (2.55) | (3.13) | (3.71) | (4.28) | (4.86) | (5.43) | (6.01) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6502331129 | 신한투자(ELS)2235 | 1.57 |
| KR6552343123 | 우리투자증권(ELS)3988 | 1.31 |
| KR6582319127 | 현대증권(ELS)2011-1589 | 1.57 |
| KR6662317124 | 동양W(ELS)975 | 1.56 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 6.01 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 7.81

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

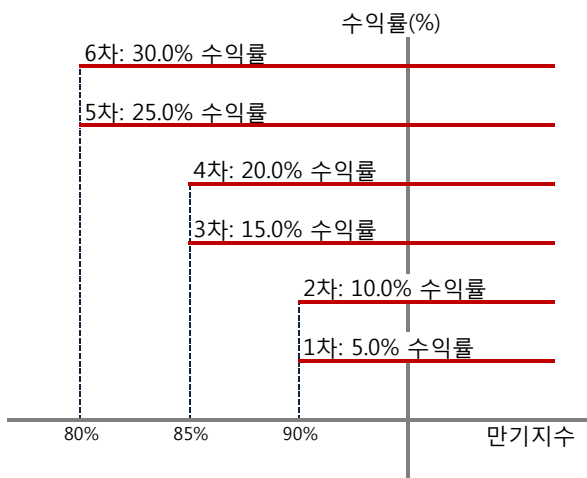
1. 계약금액

단위(백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 8,474 | 0 | 8,474 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,474 | 0 | 8,474 | 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 | 464.85 | 426.83 | 388.81 | 350.79 | 312.77 | 274.75 | 236.73 | |
| 자산 | 377.03 | 339.01 | 300.99 | 262.97 | 224.95 | 186.93 | 148.91 | |
| 시나리오 | 260.10 | 222.08 | 184.06 | 146.04 | 108.02 | 70.00 | 31.98 | |
| | 114.06 | 76.04 | 38.02 | 0.00 | (38.02) | (76.04) | (114.06) | |
| | (61.08) | (99.10) | (137.12) | (175.14) | (213.16) | (251.18) | (289.20) | |
| | (265.32) | (303.34) | (341.36) | (379.38) | (417.40) | (455.42) | (493.44) | |
| | (498.67) | (536.69) | (574.71) | (612.73) | (650.75) | (688.77) | (726.79) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140 | 우리투자증권(ELS)4416 | 193.65 |
| KR6582383149 | 현대증권(ELS)2011-1698 | 194.13 |
| KR6592397147 | 미래에셋증권(ELS)2173 | 182.98 |
| KR6662374141 | 동양W(ELS)1004 | 156.04 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 726.79 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

718.35

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

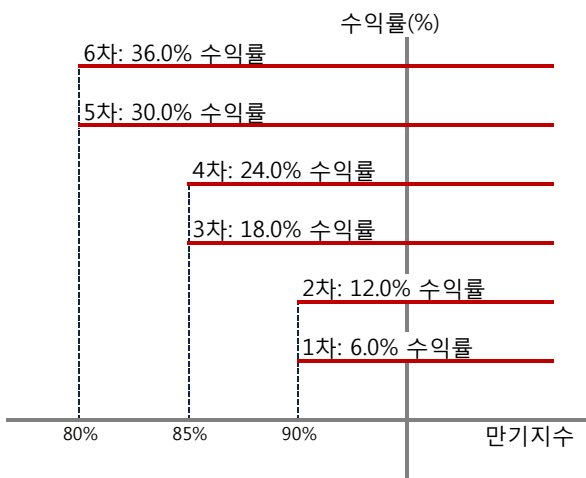
1. 계약금액

단위(백만원)

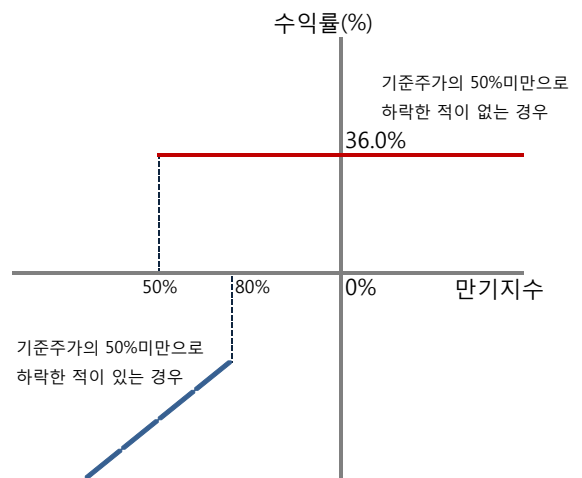
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 20,000 | 0 | 20,000 | 장외 |

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 | 8.00% | 5.33% | 2.67% | 0.00% | -2.67% | -5.33% | -8.00% | |
| 자산 | (9.27) | (5.49) | (2.40) | (2.40) | (2.40) | (2.40) | (2.40) | (2.40) |
| 시나 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 리오 | 1.72 | 1.72 | 1.72 | 1.72 | 1.72 | 1.72 | 1.72 | 1.72 |
| | 2.75 | 2.75 | 2.75 | 2.75 | 2.75 | 2.75 | 2.75 | 2.75 |
| | 3.09 | 3.09 | 3.09 | 3.09 | 3.09 | 3.09 | 3.09 | 3.09 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|-------------|
| KR6553331150 | 우리투자증권(ELS)4448 | 2.47 |
| KR6573333152 | 한국투자증권(ELS)2106 | 2.49 |
| KR6663329151 | 동양W(ELS)1018 | 2.05 |
| KR6673309151 | 해피플러스(ELS)529 | 2.25 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 9.27 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

0.05

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

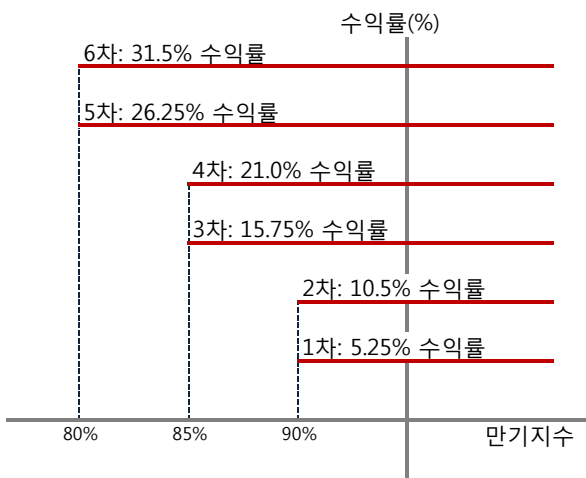
1. 계약금액

단위(백만원)

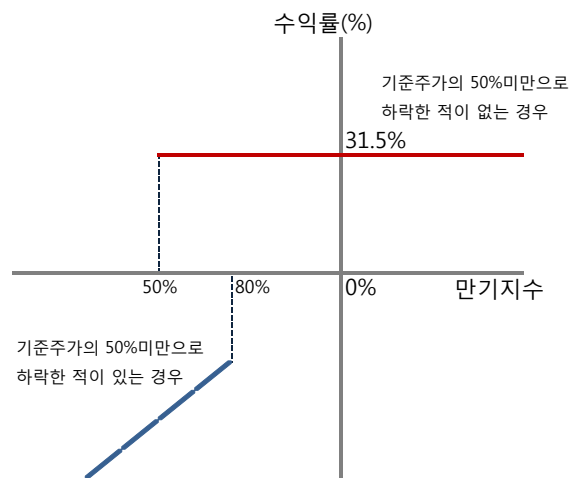
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 4,921 | 0 | 4,921 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,921 | 0 | 4,921 | 장외 |

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 | 419.43 | 377.51 | 335.58 | 293.66 | 251.74 | 209.81 | 167.89 | |
| 자산 | 334.40 | 292.48 | 250.55 | 208.63 | 166.71 | 124.78 | 82.86 | |
| 시나 | 236.52 | 194.59 | 152.67 | 110.74 | 68.82 | 26.89 | (15.03) | |
| 리오 | 0.00% | 83.85 | 41.92 | 0.00 | (41.92) | (83.85) | (125.77) | |
| | -2.67% | (39.75) | (81.68) | (123.60) | (165.52) | (207.45) | (249.37) | |
| | -5.33% | (134.28) | (176.21) | (218.13) | (260.06) | (301.98) | (385.83) | |
| | -8.00% | (283.60) | (325.52) | (367.44) | (409.37) | (451.29) | (535.14) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR6553363153 | 우리투자증권(ELS)4485 | 134.24 |
| KR6573353150 | 한국투자증권(ELS)2116 | 134.25 |
| KR6593354154 | 미래에셋증권(ELS)2235 | 134.25 |
| KR6663346155 | 동양W(ELS)1009 | 132.40 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 535.14 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 506.38

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

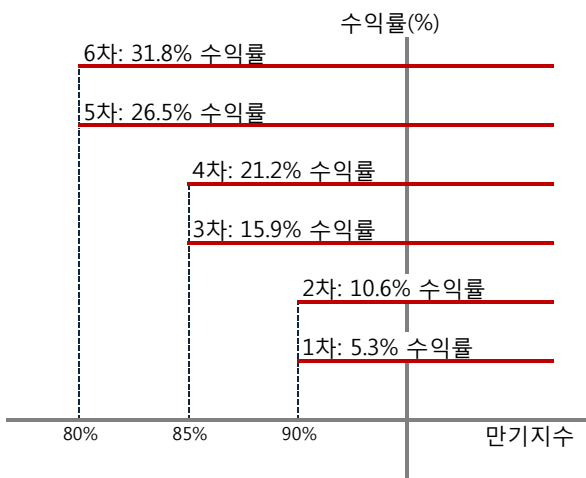
1. 계약금액

단위(백만원)

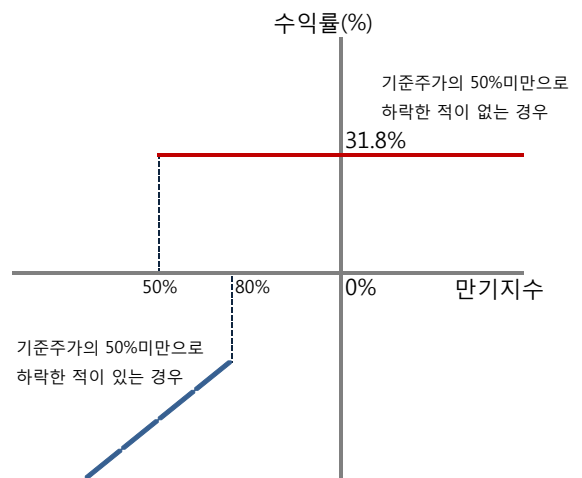
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 6,949 | 0 | 6,949 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,949 | 0 | 6,949 | 장외 |

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 | 623.79 | 562.15 | 500.51 | 438.86 | 377.22 | 315.58 | 253.94 | |
| 자산 | 495.33 | 433.69 | 372.04 | 310.40 | 248.76 | 187.12 | 125.47 | |
| 시나리오 | 349.04 | 287.40 | 225.76 | 164.11 | 102.47 | 40.83 | (20.81) | |
| | 184.93 | 123.28 | 61.64 | 0.00 | (61.64) | (123.28) | (184.93) | |
| | 2.99 | (58.65) | (120.30) | (181.94) | (243.58) | (305.22) | (366.86) | |
| | (196.77) | (258.42) | (320.06) | (381.70) | (443.34) | (504.98) | (566.63) | |
| | (414.36) | (476.00) | (537.65) | (599.29) | (660.93) | (722.57) | (784.21) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR65533C6151 | 우리투자증권(ELS)4595 | 185.81 |
| KR65933AH150 | 미래에셋증권(ELS)2299 | 199.50 |
| KR66633AV156 | 동양W(ELS)1019 | 199.41 |
| KR67033A2153 | H&D증권(ELS)1724 | 199.49 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 784.21 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 759.04 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

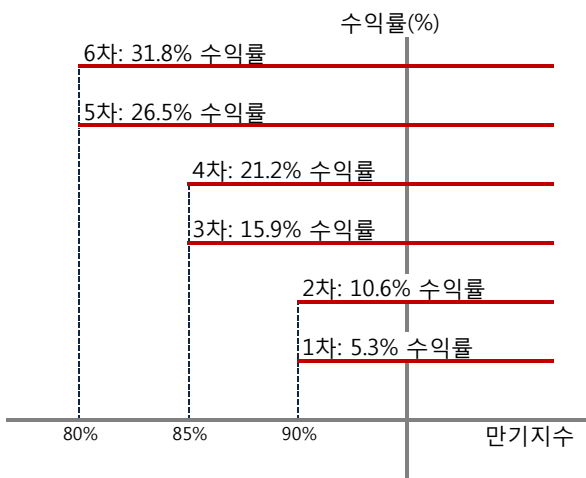
1. 계약금액

단위(백만원)

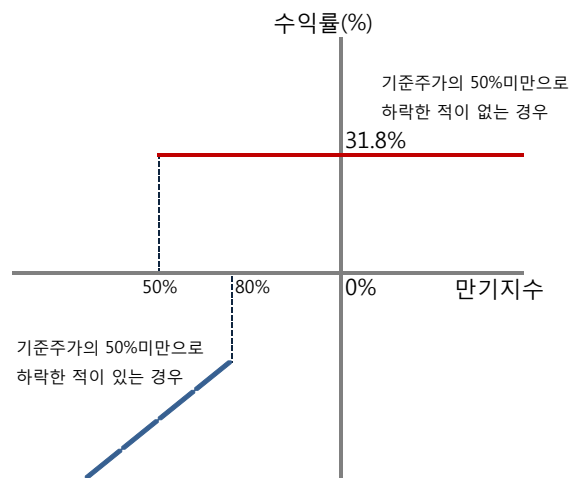
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,441 | 0 | 5,441 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,441 | 0 | 5,441 | 장외 |

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 | 479.82 | 431.25 | 382.67 | 334.10 | 285.53 | 236.95 | 188.38 | |
| 자산 | 381.48 | 332.90 | 284.33 | 235.76 | 187.18 | 138.61 | 90.03 | |
| 시나리오 | 270.11 | 221.54 | 172.96 | 124.39 | 75.82 | 27.24 | (21.33) | |
| | 145.72 | 97.15 | 48.57 | 0.00 | (48.57) | (97.15) | (145.72) | |
| | 8.31 | (40.26) | (88.84) | (137.41) | (185.99) | (234.56) | (283.13) | |
| | (142.13) | (190.70) | (239.27) | (287.85) | (336.42) | (385.00) | (433.57) | |
| | (305.58) | (354.16) | (402.73) | (451.31) | (499.88) | (548.45) | (597.03) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6503341168 | 신한투자(ELS)2834 | 150.32 |
| KR6553344161 | 우리투자증권(ELS)4621 | 146.04 |
| KR6583319167 | 현대증권(ELS)2011-1768 | 150.32 |
| KR6663324160 | 동양W(ELS)1028 | 150.35 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 597.03 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 605.76

메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

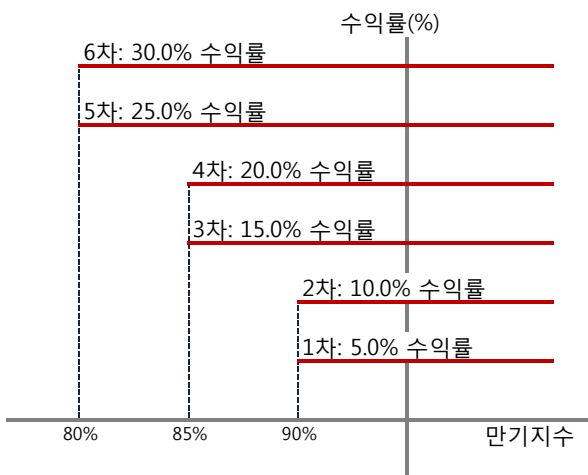
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,899 | 0 | 5,899 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,899 | 0 | 5,899 | 장외 |

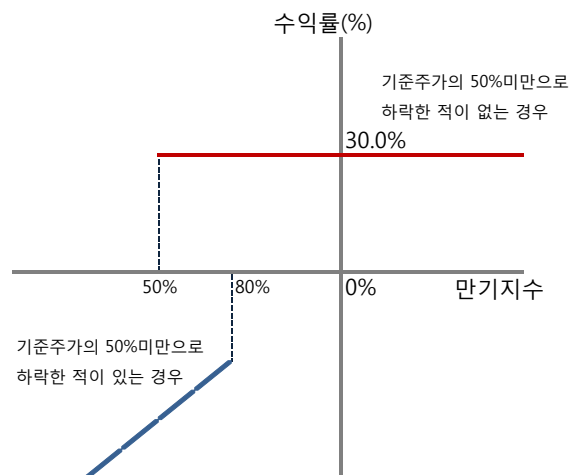
단위(백만원)

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% | 504.87 | 453.43 | 402.00 | 350.57 | 299.13 | 247.70 | 196.26 |
| 자산 | 5.33% | 402.80 | 351.37 | 299.94 | 248.50 | 197.07 | 145.63 | 94.20 |
| 사 | 2.67% | 285.95 | 234.51 | 183.08 | 131.65 | 80.21 | 28.78 | (22.66) |
| 나 | 0.00% | 154.30 | 102.87 | 51.43 | 0.00 | (51.43) | (102.87) | (154.30) |
| 리 | -2.67% | 7.87 | (43.57) | (95.00) | (146.44) | (197.87) | (249.30) | (300.74) |
| 오 | -5.33% | (153.36) | (204.79) | (256.23) | (307.66) | (359.10) | (410.53) | (461.97) |
| 요 | -8.00% | (329.38) | (380.81) | (432.25) | (483.68) | (535.12) | (586.55) | (637.98) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR6503322176 | 신한투자(ELS)2982 | 159.85 |
| KR6543311171 | 신영증권(ELS)2189 | 159.83 |
| KR6553334170 | 우리투자증권(ELS)4750 | 158.61 |
| KR6663322172 | 동양W(ELS)1040 | 159.70 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 637.98 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

615.40

메리츠한증지수연계증권제27호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

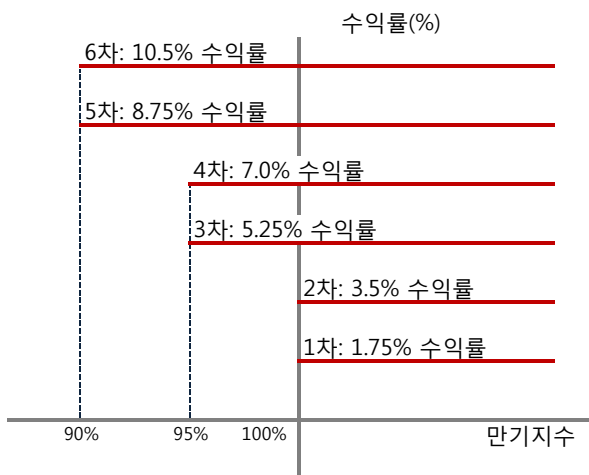
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 30,000 | 0 | 30,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 30,000 | 0 | 30,000 | 장외 |

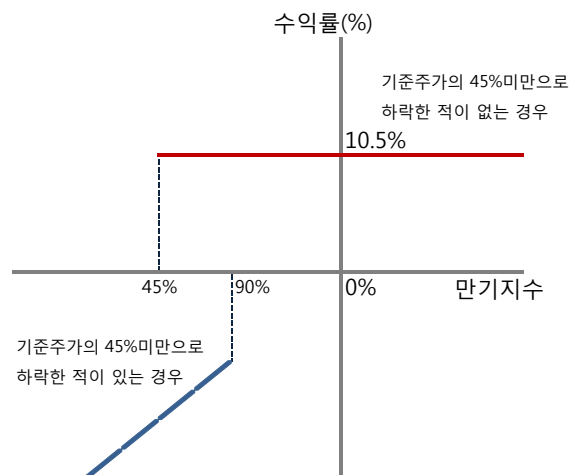
단위(백만원)

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% | (431.25) | (429.16) | (427.08) | (425.00) | (422.91) | (420.83) | (418.75) |
| | 5.33% | (262.92) | (260.83) | (258.75) | (256.67) | (254.58) | (252.50) | (250.42) |
| | 2.67% | (121.25) | (119.17) | (117.09) | (115.00) | (112.92) | (110.84) | (108.75) |
| | 0.00% | (6.25) | (4.17) | (2.08) | 0.00 | 2.08 | 4.17 | 6.25 |
| | -2.67% | 82.09 | 84.17 | 86.26 | 88.34 | 90.42 | 92.51 | 94.59 |
| | -5.33% | 143.77 | 145.85 | 147.93 | 150.02 | 152.10 | 154.18 | 156.27 |
| | -8.00% | 178.78 | 180.86 | 182.95 | 185.03 | 187.11 | 189.20 | 191.28 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65033AL250 | 신한투자(ELS)4533 | 106.30 |
| KR65233AT259 | 대우증권(ELS)7497 | 110.87 |
| KR65533BV256 | 우리투자증권(ELS)6128 | 110.18 |
| KR6703394256 | H&D증권(ELS)2764 | 103.90 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 431.25 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 211.48

메리츠한증지수연계증권제28호[ELS-파생형]

공시일: 2012-07-26

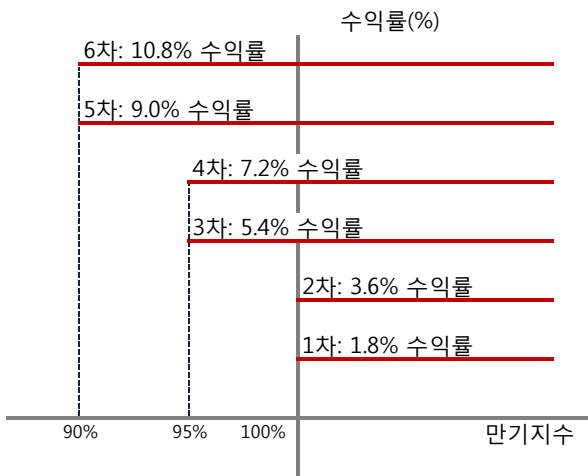
1. 계약금액

| 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 |

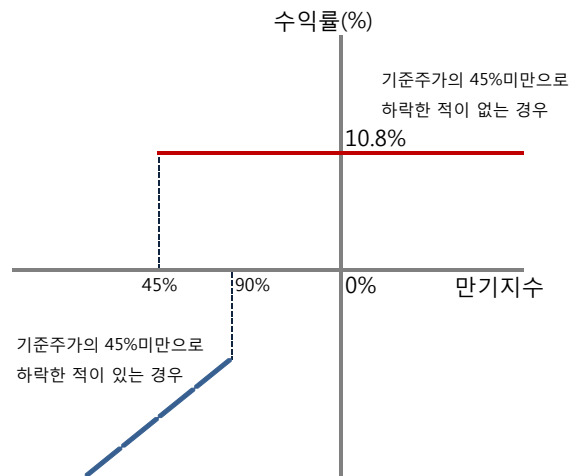
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | 단위(백만원) |
|------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00% | (350.99) | (347.38) | (343.78) | (340.17) | (336.56) | (332.96) | (329.35) |
| | 5.33% | (239.42) | (235.81) | (232.21) | (228.60) | (224.99) | (221.39) | (217.78) |
| | 2.67% | (126.03) | (122.42) | (118.82) | (115.21) | (111.60) | (108.00) | (104.39) |
| | 0.00% | (10.82) | (7.21) | (3.61) | 0.00 | 3.61 | 7.21 | 10.82 |
| | -2.67% | 106.21 | 109.82 | 113.42 | 117.03 | 120.64 | 124.24 | 127.85 |
| | -5.33% | 225.06 | 228.67 | 232.28 | 235.88 | 239.49 | 243.10 | 246.70 |
| | -8.00% | 345.74 | 349.34 | 352.95 | 356.56 | 360.16 | 363.77 | 367.38 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| 시나리오 | 자산 | 단위(백만원) |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65033D3251 | 신한투자(ELS)4637 | 86.68 |
| KR65233D7250 | 대우증권(ELS)7731 | 89.91 |
| KR65533CD252 | 우리투자증권(ELS)6116 | 89.41 |
| KR67033B6252 | H&D증권(ELS)2735 | 84.98 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 350.99 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 475.84