

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

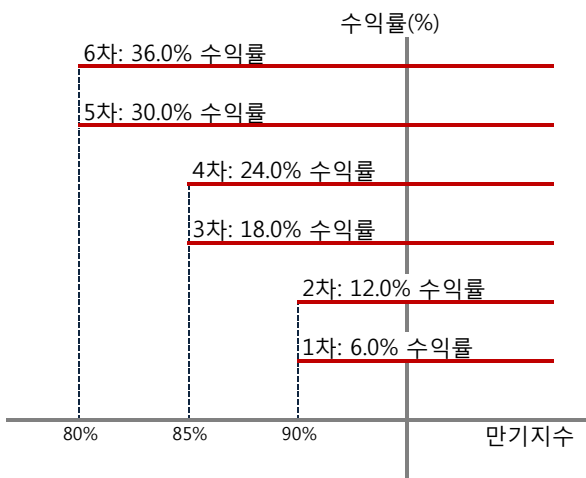
1. 계약금액

단위(백만원)

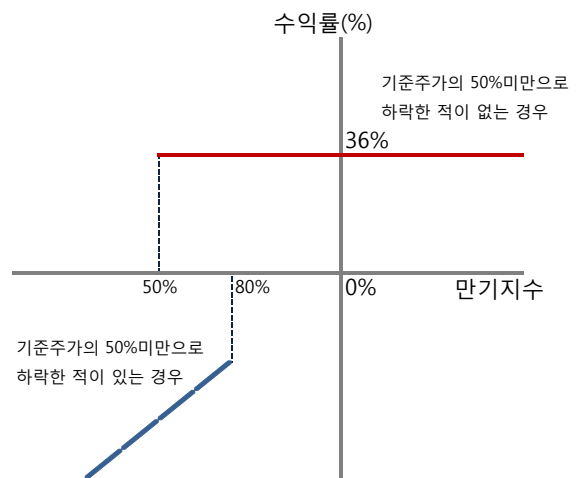
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 4,898 | 0 | 4,898 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,898 | 0 | 4,898 | 장외 |

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% | (1.76) | (1.87) | (1.97) | (2.08) | (2.18) | (2.29) | (2.39) |
| | 5.33% | (0.42) | (0.53) | (0.63) | (0.74) | (0.84) | (0.95) | (1.05) |
| | 2.67% | 0.27 | 0.16 | 0.06 | (0.04) | (0.15) | (0.25) | (0.36) |
| | 0.00% | 0.31 | 0.21 | 0.10 | 0.00 | (0.10) | (0.21) | (0.31) |
| | -2.67% | (0.29) | (0.39) | (0.50) | (0.60) | (0.71) | (0.81) | (0.92) |
| | -5.33% | (1.54) | (1.65) | (1.75) | (1.85) | (1.96) | (2.06) | (2.17) |
| | -8.00% | (3.44) | (3.54) | (3.65) | (3.75) | (3.86) | (3.96) | (4.07) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6502348032 | 신한투자(ELS)1408 | 0.43 |
| KR6582353035 | 현대증권(ELS)2010-1232 | 1.21 |
| KR6661350035 | 동양(ELS)520 | 1.21 |
| KR6702358039 | H&D증권(ELS)545 | 1.21 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 4.07 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 5.14

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

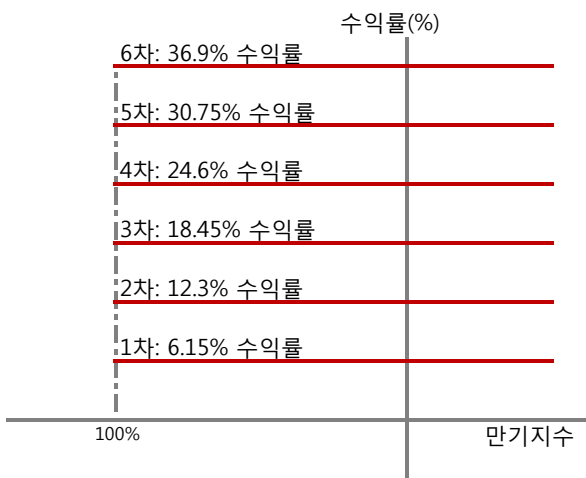
1. 계약금액

단위(백만원)

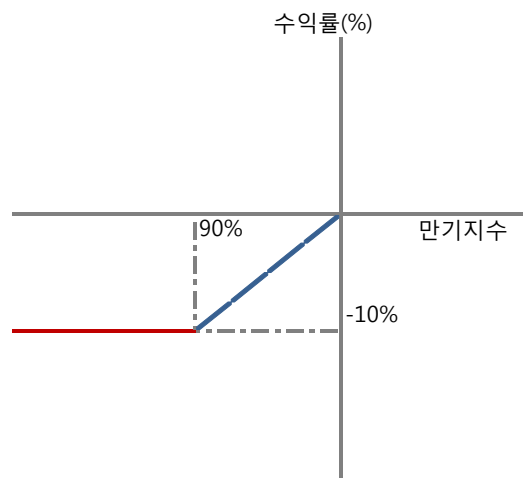
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 4,951 | 0 | 4,951 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,951 | 0 | 4,951 | 장외 |

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 | 474.31 | 465.88 | 457.45 | 449.03 | 440.60 | 432.18 | 423.75 | |
| 자산 | 310.74 | 302.31 | 293.89 | 285.46 | 277.03 | 268.61 | 260.18 | |
| 시나 | 161.06 | 152.64 | 144.21 | 135.78 | 127.36 | 118.93 | 110.51 | |
| 리오 | 0.00% | 16.85 | 8.43 | 0.00 | (8.43) | (16.85) | (25.28) | |
| | -2.67% | (96.61) | (105.04) | (113.46) | (121.89) | (130.32) | (147.17) | |
| | -5.33% | (204.61) | (213.04) | (221.46) | (229.89) | (238.31) | (255.17) | |
| | -8.00% | (298.72) | (307.14) | (315.57) | (323.99) | (332.42) | (349.27) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65293160A1 | 대우증권ELS4537 | 89.52 |
| KR65593110A3 | 우리투자증권(ELS)3541 | 80.27 |
| KR65893090A4 | 현대증권(ELS)2010-1453 | 89.61 |
| KR66693120A9 | 동양W(ELS)927 | 89.88 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 349.27 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 376.21

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

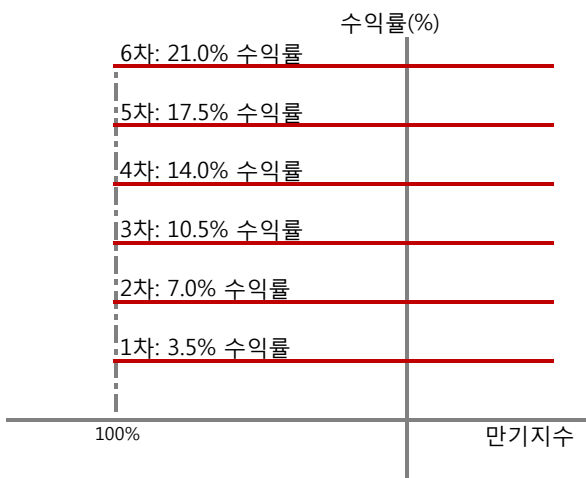
1. 계약금액

단위(백만원)

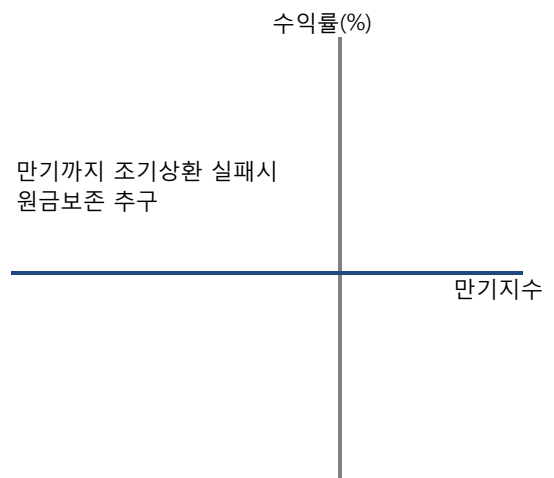
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,424 | 0 | 3,424 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,424 | 0 | 3,424 | 장외 |

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 | 140.75 | 137.05 | 133.36 | 129.66 | 125.97 | 122.27 | 118.58 | |
| 자산 | 93.94 | 90.25 | 86.55 | 82.86 | 79.16 | 75.46 | 71.77 | |
| 시나리오 | 50.72 | 47.03 | 43.33 | 39.63 | 35.94 | 32.24 | 28.55 | |
| | 11.09 | 7.39 | 3.70 | 0.00 | (3.70) | (7.39) | (11.09) | |
| | (24.96) | (28.66) | (32.35) | (36.05) | (39.74) | (43.44) | (47.14) | |
| | (57.42) | (61.12) | (64.81) | (68.51) | (72.21) | (75.90) | (79.60) | |
| | (86.30) | (89.99) | (93.69) | (97.38) | (101.08) | (104.78) | (108.47) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523460C3 | 우리투자증권(ELS)3756 | 27.79 |
| KR65823220C8 | 현대증권(ELS)2010-1534 | 27.86 |
| KR65923520C0 | 미래에셋증권(ELS)1637 | 27.88 |
| KR66623360C2 | 동양W(ELS)950 | 24.95 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 108.47 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 112.40

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

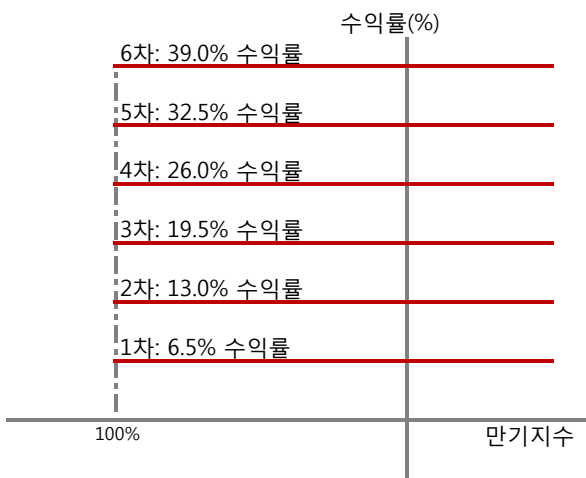
1. 계약금액

단위(백만원)

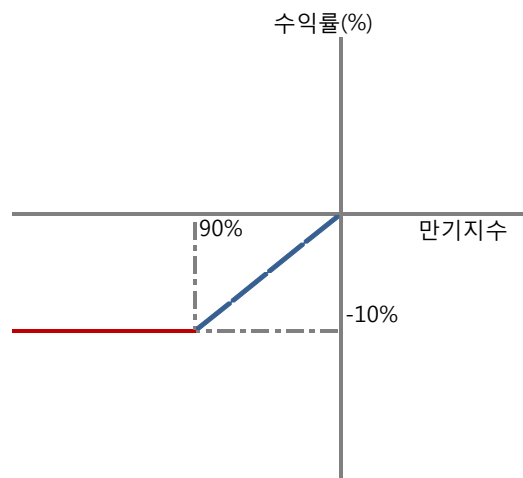
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 3,290 | 0 | 3,290 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,290 | 0 | 3,290 | 장외 |

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 | 308.13 | 299.61 | 291.09 | 282.56 | 274.04 | 265.52 | 257.00 | |
| 자산 | 206.69 | 198.17 | 189.65 | 181.13 | 172.61 | 164.09 | 155.56 | |
| 시나 | 112.51 | 103.98 | 95.46 | 86.94 | 78.42 | 69.90 | 61.38 | |
| 리오 | 0.00% | 17.04 | 8.52 | 0.00 | (8.52) | (17.04) | (25.56) | |
| | -2.67% | (54.13) | (62.65) | (71.17) | (79.69) | (88.21) | (105.26) | |
| | -5.33% | (126.57) | (135.09) | (143.62) | (152.14) | (160.66) | (177.70) | |
| | -8.00% | (191.77) | (200.29) | (208.81) | (217.34) | (225.86) | (242.90) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523450C4 | 우리투자증권(ELS)3755 | 63.71 |
| KR65823210C9 | 현대증권(ELS)2010-1533 | 63.73 |
| KR65923510C1 | 미래에셋증권(ELS)1636 | 63.74 |
| KR66623340C4 | 동양W(ELS)949 | 51.72 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 242.90 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 250.31

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

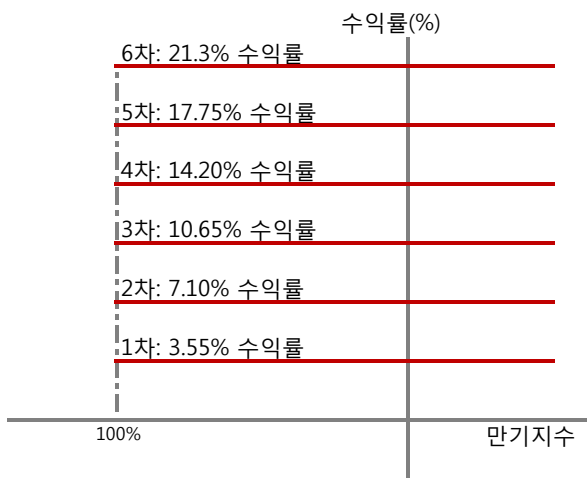
1. 계약금액

단위(백만원)

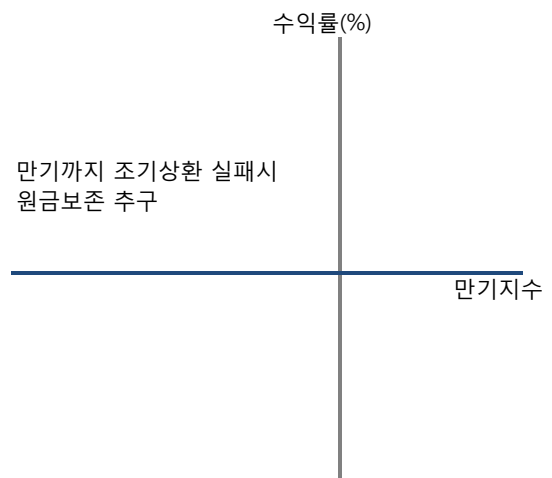
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,087 | 0 | 1,087 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,087 | 0 | 1,087 | 장외 |

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 | 4.65 | 4.47 | 4.30 | 4.12 | 3.95 | 3.77 | 3.59 | |
| 자산 | 3.13 | 2.96 | 2.78 | 2.60 | 2.43 | 2.25 | 2.08 | |
| 시나리오 | 1.76 | 1.58 | 1.41 | 1.23 | 1.06 | 0.88 | 0.70 | |
| | 0.53 | 0.35 | 0.18 | 0.00 | (0.18) | (0.35) | (0.53) | |
| | (0.56) | (0.74) | (0.91) | (1.09) | (1.26) | (1.44) | (1.62) | |
| | (1.51) | (1.68) | (1.86) | (2.03) | (2.21) | (2.39) | (2.56) | |
| | (2.31) | (2.48) | (2.66) | (2.84) | (3.01) | (3.19) | (3.36) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6552345128 | 우리투자증권(ELS)3989 | 0.94 |
| KR6582317121 | 현대증권(ELS)2011-1588 | 0.94 |
| KR6592350120 | 미래에셋증권(ELS)1896 | 0.55 |
| KR6662316126 | 동양W(ELS)974 | 0.94 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 3.36 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 3.81

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

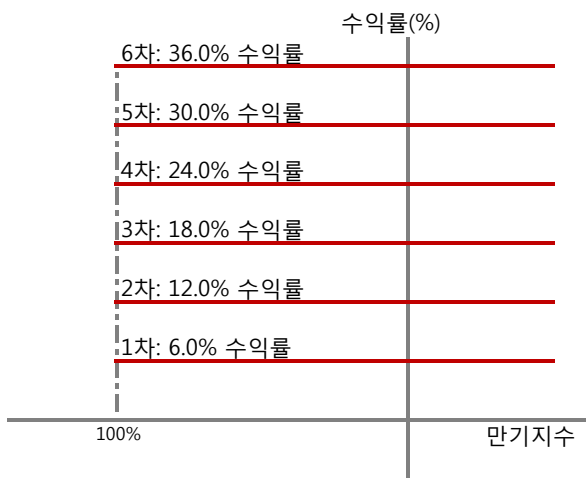
1. 계약금액

단위(백만원)

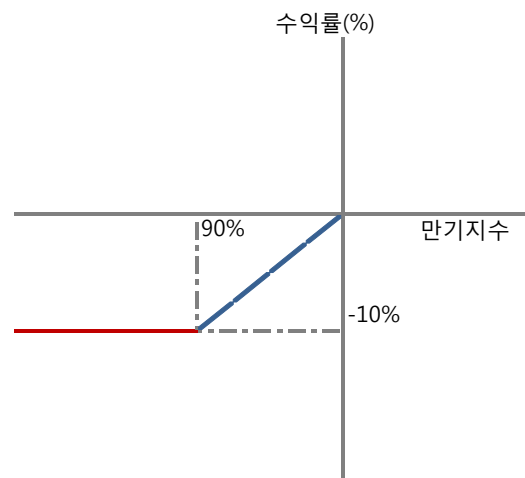
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 706 | 0 | 706 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 706 | 0 | 706 | 장외 |

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 | 8.80 | 8.41 | 8.01 | 7.61 | 7.22 | 6.82 | 6.42 | |
| 자산 | 6.03 | 5.63 | 5.24 | 4.84 | 4.44 | 4.05 | 3.65 | |
| 시나리오 | 3.49 | 3.10 | 2.70 | 2.30 | 1.91 | 1.51 | 1.11 | |
| | 0.00% | 0.79 | 0.40 | 0.00 | (0.40) | (0.79) | (1.19) | |
| | -2.67% | (0.88) | (1.28) | (1.67) | (2.07) | (2.47) | (2.86) | |
| | -5.33% | (2.71) | (3.11) | (3.51) | (3.90) | (4.30) | (4.70) | |
| | -8.00% | (4.31) | (4.71) | (5.11) | (5.50) | (5.90) | (6.30) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|-------------|
| KR6502331129 | 신한투자(ELS)2235 | 1.76 |
| KR6552343123 | 우리투자증권(ELS)3988 | 1.43 |
| KR6582319127 | 현대증권(ELS)2011-1589 | 1.76 |
| KR6662317124 | 동양W(ELS)975 | 1.75 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 6.69 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 6.05

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

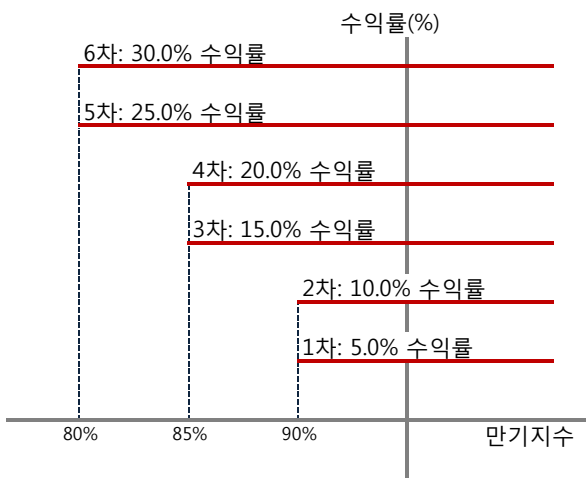
1. 계약금액

단위(백만원)

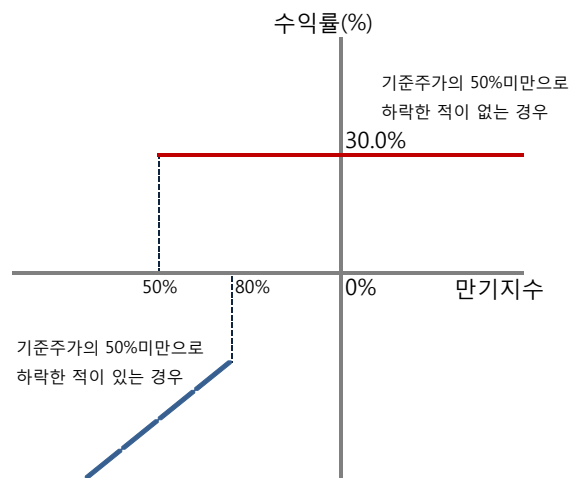
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 8,197 | 0 | 8,197 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,197 | 0 | 8,197 | 장외 |

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 | 246.59 | 223.42 | 200.26 | 177.09 | 153.93 | 130.76 | 107.60 | |
| 자산 | 219.88 | 196.72 | 173.55 | 150.39 | 127.22 | 104.06 | 80.89 | |
| 시나리오 | 160.85 | 137.69 | 114.52 | 91.36 | 68.19 | 45.03 | 21.86 | |
| | 69.50 | 46.33 | 23.17 | 0.00 | (23.17) | (46.33) | (69.50) | |
| | (54.19) | (77.35) | (100.52) | (123.68) | (146.85) | (170.01) | (193.18) | |
| | (210.19) | (233.36) | (256.52) | (279.69) | (302.85) | (326.02) | (349.18) | |
| | (398.53) | (421.69) | (444.86) | (468.02) | (491.19) | (514.35) | (537.52) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140 | 우리투자증권(ELS)4416 | 146.69 |
| KR6582383149 | 현대증권(ELS)2011-1698 | 147.09 |
| KR6592397147 | 미래에셋증권(ELS)2173 | 119.84 |
| KR6662374141 | 동양W(ELS)1004 | 123.89 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 537.52 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 563.29

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

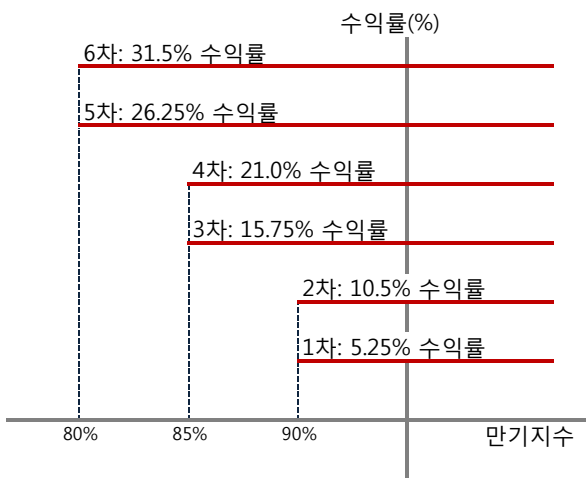
1. 계약금액

단위(백만원)

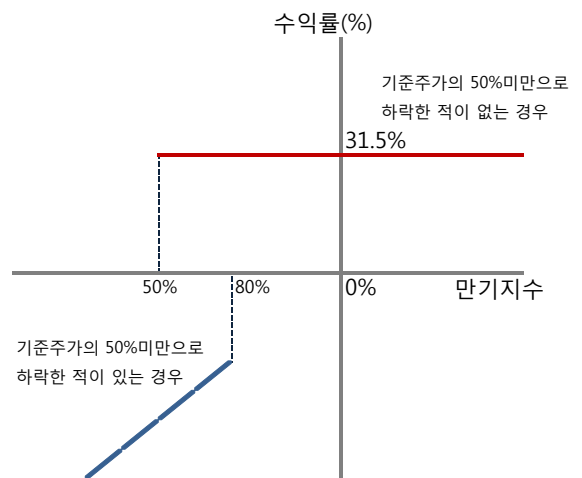
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 4,305 | 0 | 4,305 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,305 | 0 | 4,305 | 장외 |

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% | 42.26 | 34.23 | 26.20 | 18.17 | 10.14 | 2.11 | (5.92) |
| | 5.33% | 43.76 | 35.73 | 27.70 | 19.67 | 11.64 | 3.61 | (4.42) |
| | 2.67% | 37.71 | 29.68 | 21.65 | 13.62 | 5.59 | (2.45) | (10.48) |
| | 0.00% | 24.09 | 16.06 | 8.03 | 0.00 | (8.03) | (16.06) | (24.09) |
| | -2.67% | 2.92 | (5.11) | (13.14) | (21.17) | (29.21) | (37.24) | (45.27) |
| | -5.33% | (25.82) | (33.85) | (41.88) | (49.91) | (57.94) | (65.97) | (74.00) |
| | -8.00% | (62.11) | (70.14) | (78.17) | (86.20) | (94.23) | (102.26) | (110.29) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR6553363153 | 우리투자증권(ELS)4485 | 30.15 |
| KR6573353150 | 한국투자증권(ELS)2116 | 31.36 |
| KR6593354154 | 미래에셋증권(ELS)2235 | 31.67 |
| KR6663346155 | 동양W(ELS)1009 | 17.11 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 110.29 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 95.79

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

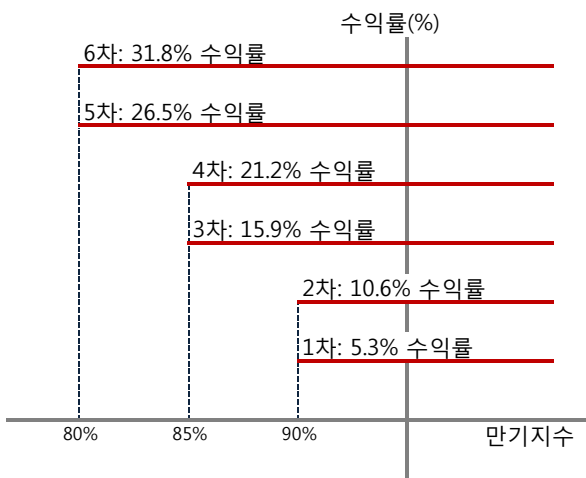
1. 계약금액

단위(백만원)

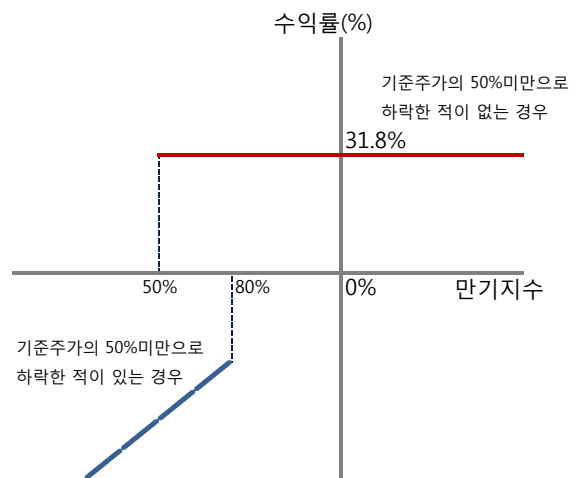
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 6,710 | 0 | 6,710 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,710 | 0 | 6,710 | 장외 |

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 | 85.04 | 71.26 | 57.48 | 43.71 | 29.93 | 16.16 | 2.38 | |
| 자산 | 82.88 | 69.10 | 55.33 | 41.55 | 27.78 | 14.00 | 0.22 | |
| 시나리오 | 68.31 | 54.53 | 40.76 | 26.98 | 13.21 | (0.57) | (14.34) | |
| | 41.33 | 27.55 | 13.78 | 0.00 | (13.78) | (27.55) | (41.33) | |
| | 1.93 | (11.84) | (25.62) | (39.39) | (53.17) | (66.95) | (80.72) | |
| | (49.88) | (63.65) | (77.43) | (91.20) | (104.98) | (118.75) | (132.53) | |
| | (114.10) | (127.87) | (141.65) | (155.42) | (169.20) | (182.97) | (196.75) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|-----------------|---------------|
| KR65533C6151 | 우리투자증권(ELS)4595 | 40.61 |
| KR65933AH150 | 미래에셋증권(ELS)2299 | 51.55 |
| KR66633AV156 | 동양W(ELS)1019 | 53.03 |
| KR67033A2153 | H&D증권(ELS)1724 | 51.55 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 196.75 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 167.02 |
|-----|--------|

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

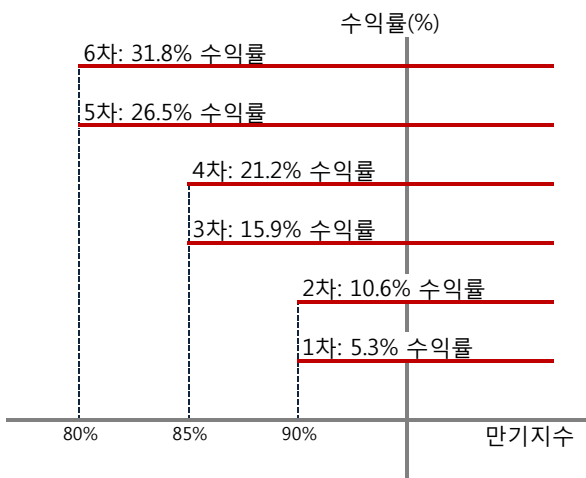
1. 계약금액

단위(백만원)

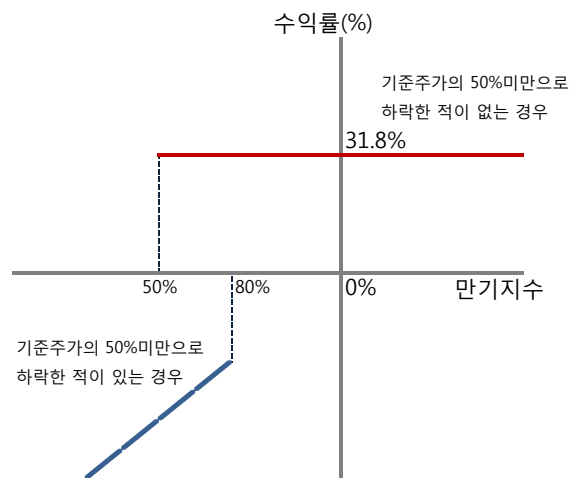
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,032 | 0 | 5,032 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,032 | 0 | 5,032 | 장외 |

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 | 65.36 | 55.37 | 45.37 | 35.38 | 25.39 | 15.39 | 5.40 | |
| 자산 | 61.40 | 51.41 | 41.41 | 31.42 | 21.43 | 11.43 | 1.44 | |
| 시나리오 | 49.61 | 39.61 | 29.62 | 19.63 | 9.63 | (0.36) | (10.35) | |
| | 29.98 | 19.99 | 9.99 | 0.00 | (9.99) | (19.99) | (29.98) | |
| | 2.52 | (7.47) | (17.47) | (27.46) | (37.45) | (47.45) | (57.44) | |
| | (32.78) | (42.77) | (52.76) | (62.76) | (72.75) | (82.74) | (92.74) | |
| | (75.91) | (85.90) | (95.89) | (105.89) | (115.88) | (125.87) | (135.87) | |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 | | 단위(백만원) |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR6503341168 | 신한투자(ELS)2834 | 36.72 |
| KR6553344161 | 우리투자증권(ELS)4621 | 24.53 |
| KR6583319167 | 현대증권(ELS)2011-1768 | 36.75 |
| KR6663324160 | 동양W(ELS)1028 | 37.87 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 135.87 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 129.40 |
|-----|--------|

메리츠주가지수연계증권제27호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

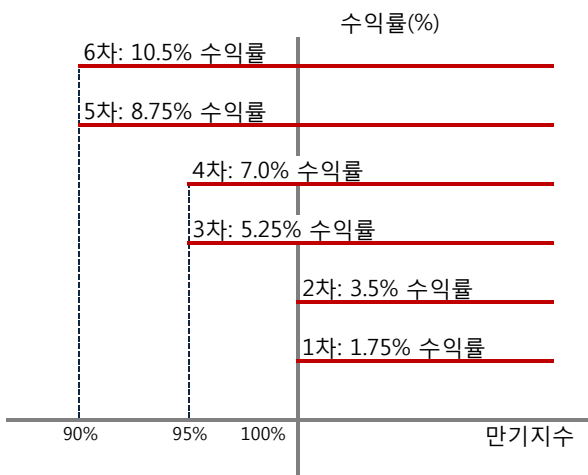
1. 계약금액

| 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 |

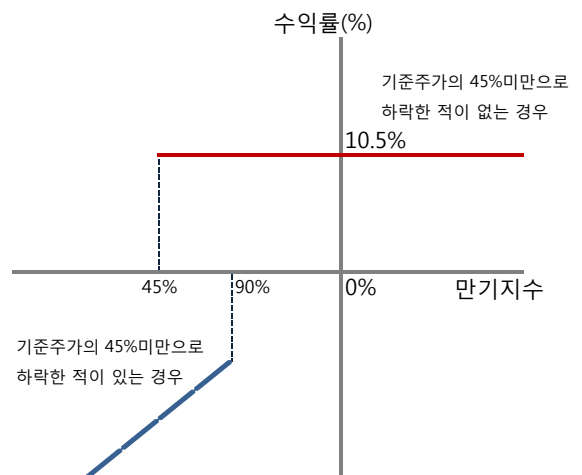
단위(백만원)

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 | 8.00% | 18.28 | 19.35 | 20.41 | 21.47 | 22.54 | 23.60 | 24.66 |
| 자산 | 5.33% | (8.17) | (7.11) | (6.05) | (4.98) | (3.92) | (2.86) | (1.79) |
| 시나 | 2.67% | (15.33) | (14.27) | (13.21) | (12.14) | (11.08) | (10.01) | (8.95) |
| 리오 | 0.00% | (3.19) | (2.13) | (1.06) | 0.00 | 1.06 | 2.13 | 3.19 |
| | -2.67% | 28.25 | 29.31 | 30.38 | 31.44 | 32.50 | 33.57 | 34.63 |
| | -5.33% | 78.99 | 80.05 | 81.12 | 82.18 | 83.24 | 84.31 | 85.37 |
| | -8.00% | 149.03 | 150.09 | 151.16 | 152.22 | 153.28 | 154.35 | 155.41 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR65033AL250 | 신한투자(ELS)4533 | 3.76 |
| KR65233AT259 | 대우증권(ELS)7497 | 3.95 |
| KR65533BV256 | 우리투자증권(ELS)6128 | 3.94 |
| KR6703394256 | H&D증권(ELS)2764 | 3.68 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 15.33 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 143.12

메리츠주가지수연계증권제30호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

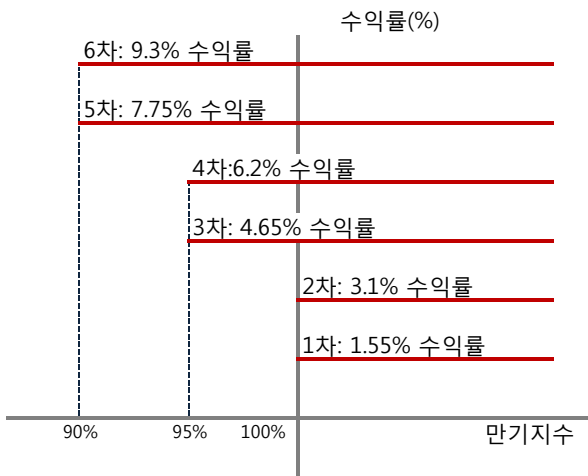
1. 계약금액

| 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 |

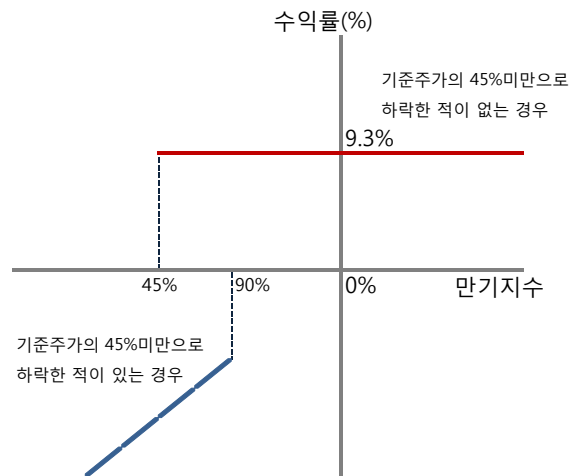
단위(백만원)

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% | (87.06) | (85.18) | (83.30) | (81.42) | (79.54) | (77.67) | (75.79) |
| | 5.33% | (69.82) | (67.95) | (66.07) | (64.19) | (62.31) | (60.43) | (58.55) |
| | 2.67% | (42.68) | (40.80) | (38.93) | (37.05) | (35.17) | (33.29) | (31.41) |
| | 0.00% | (5.64) | (3.76) | (1.88) | 0.00 | 1.88 | 3.76 | 5.64 |
| | -2.67% | 41.31 | 43.19 | 45.07 | 46.95 | 48.83 | 50.71 | 52.59 |
| | -5.33% | 98.17 | 100.05 | 101.93 | 103.81 | 105.69 | 107.57 | 109.45 |
| | -8.00% | 164.93 | 166.81 | 168.69 | 170.57 | 172.45 | 174.33 | 176.21 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR65233BT281 | 대우증권(ELS)8153 | 6.77 |
| KR65533BB282 | 우리투자증권(ELS)6416 | 10.58 |
| KR65733AY282 | 한국투자증권(ELS)2750 | 10.54 |
| KR6583383288 | 현대증권(ELS)2012-2464 | 10.36 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 87.06 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 199.32

메리츠주가지수연계증권제31호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-09

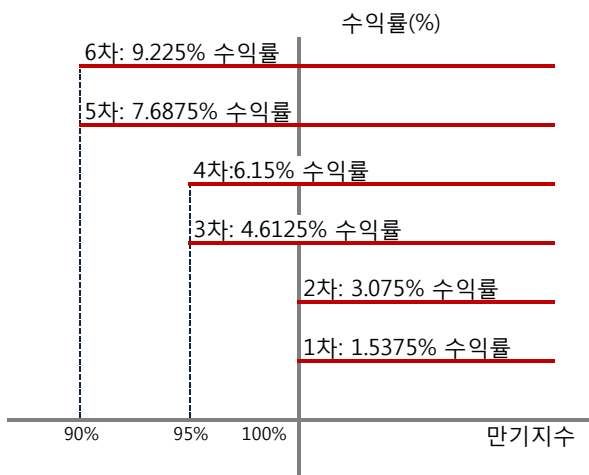
1. 계약금액

| 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 |

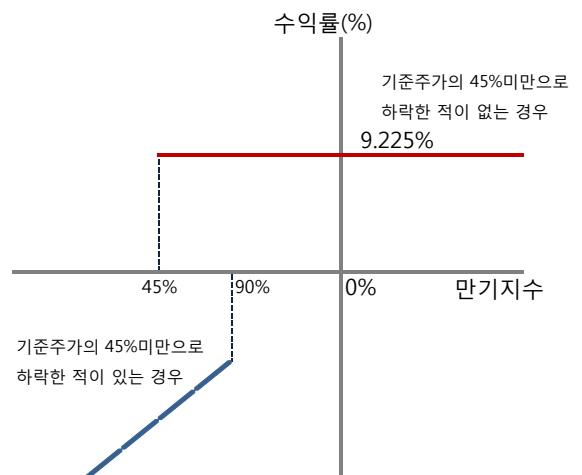
단위(백만원)

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% | (80.55) | (78.74) | (76.92) | (75.11) | (73.29) | (71.47) | (69.66) |
| | 5.33% | (64.28) | (62.47) | (60.65) | (58.83) | (57.02) | (55.20) | (53.39) |
| | 2.67% | (39.25) | (37.43) | (35.62) | (33.80) | (31.98) | (30.17) | (28.35) |
| | 0.00% | (5.45) | (3.63) | (1.82) | 0.00 | 1.82 | 3.63 | 5.45 |
| | -2.67% | 37.12 | 38.93 | 40.75 | 42.56 | 44.38 | 46.20 | 48.01 |
| | -5.33% | 88.44 | 90.26 | 92.08 | 93.89 | 95.71 | 97.52 | 99.34 |
| | -8.00% | 148.54 | 150.35 | 152.17 | 153.98 | 155.80 | 157.62 | 159.43 |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6523302299 | 대우증권(ELS)8158 | 0.00 |
| KR6553351299 | 우리투자증권(ELS)6537 | 0.00 |
| KR6573301290 | 한국투자증권(ELS)2749 | 0.00 |
| KR6593336292 | 미래에셋증권(ELS)3955 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 80.55 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 173.71