

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

# 메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

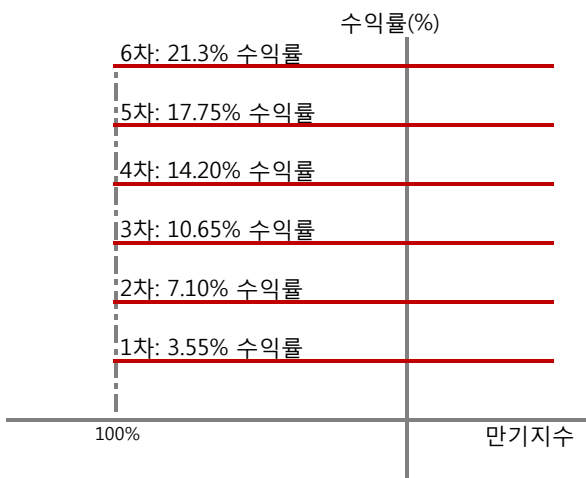
## 1. 계약금액

단위(백만원)

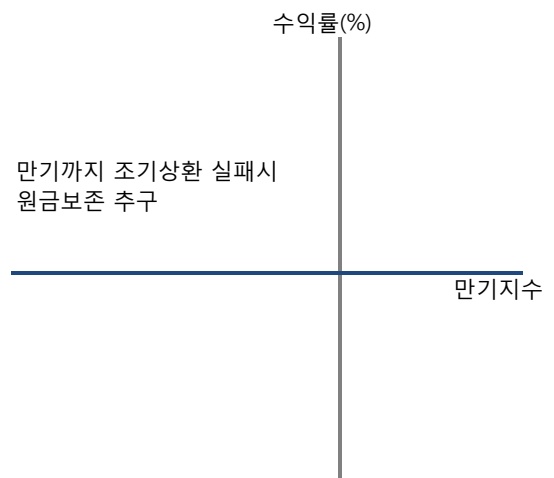
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 1,087 | 0     | 1,087     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 1,087 | 0     | 1,087     | 장외 |

## 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 | 8.00%    | 0.31    | 0.31   | 0.31   | 0.31   | 0.31   | 0.31   | 0.31   |
| 자산 | 5.33%    | 0.19    | 0.19   | 0.19   | 0.19   | 0.19   | 0.19   | 0.19   |
| 시나 | 2.67%    | 0.08    | 0.08   | 0.08   | 0.08   | 0.08   | 0.08   | 0.08   |
| 리오 | 0.00%    | 0.00    | 0.00   | 0.00   | 0.00   | 0.00   | 0.00   | 0.00   |
|    | -2.67%   | (0.06)  | (0.06) | (0.06) | (0.06) | (0.06) | (0.06) | (0.06) |
|    | -5.33%   | (0.10)  | (0.10) | (0.10) | (0.10) | (0.10) | (0.10) | (0.10) |
|    | -8.00%   | (0.12)  | (0.12) | (0.12) | (0.12) | (0.12) | (0.12) | (0.12) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |             |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6552345128       | 우리투자증권(ELS)3989    | 0.03        |
| KR6582317121       | 현대증권(ELS)2011-1588 | 0.03        |
| KR6592350120       | 미래에셋증권(ELS)1896    | 0.02        |
| KR6662316126       | 동양W(ELS)974        | 0.03        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>0.12</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.49

# 메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

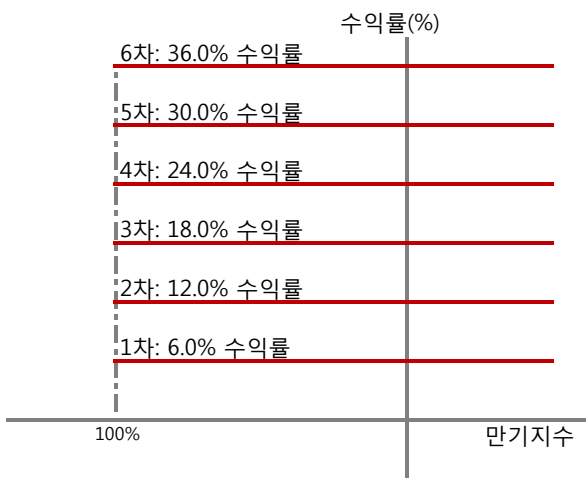
## 1. 계약금액

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   | 2.00     | 1.98    | 1.96   | 1.94   | 1.92   | 1.90   | 1.88   |  |
| 자산   | 1.24     | 1.22    | 1.19   | 1.17   | 1.15   | 1.13   | 1.11   |  |
| 시나리오 | 0.59     | 0.57    | 0.55   | 0.53   | 0.51   | 0.49   | 0.47   |  |
|      | 0.06     | 0.04    | 0.02   | 0.00   | (0.02) | (0.04) | (0.06) |  |
|      | (0.35)   | (0.37)  | (0.39) | (0.41) | (0.43) | (0.45) | (0.47) |  |
|      | (0.64)   | (0.66)  | (0.68) | (0.70) | (0.72) | (0.74) | (0.77) |  |
|      | (0.82)   | (0.84)  | (0.86) | (0.88) | (0.90) | (0.92) | (0.94) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |             |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6502331129       | 신한투자(ELS)2235      | 0.25        |
| KR6552343123       | 우리투자증권(ELS)3988    | 0.20        |
| KR6582319127       | 현대증권(ELS)2011-1589 | 0.25        |
| KR6662317124       | 동양W(ELS)975        | 0.25        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>0.94</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 2.32

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

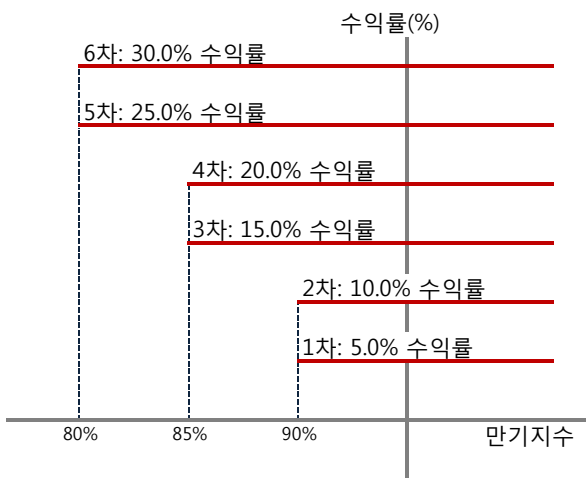
## 1. 계약금액

단위(백만원)

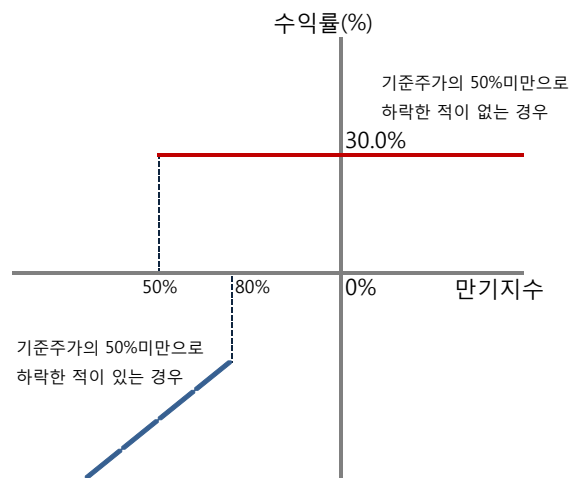
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 7,983 | 0     | 7,983     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 7,983 | 0     | 7,983     | 장외 |

## 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   | 48.39    | 40.46    | 32.52    | 24.59    | 16.66    | 8.72     | 0.79     |  |
| 자산   | 116.89   | 108.95   | 101.02   | 93.09    | 85.15    | 77.22    | 69.29    |  |
| 시나리오 | 108.69   | 100.76   | 92.82    | 84.89    | 76.96    | 69.02    | 61.09    |  |
|      | 23.80    | 15.87    | 7.93     | 0.00     | (7.93)   | (15.87)  | (23.80)  |  |
|      | (137.79) | (145.72) | (153.65) | (161.58) | (169.52) | (177.45) | (185.38) |  |
|      | (376.06) | (384.00) | (391.93) | (399.86) | (407.80) | (415.73) | (423.66) |  |
|      | (691.04) | (698.97) | (706.90) | (714.83) | (722.77) | (730.70) | (738.63) |  |

| 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액 |                    | 단위(백만원)       |
|---------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140        | 우리투자증권(ELS)4416    | 201.66        |
| KR6582383149        | 현대증권(ELS)2011-1698 | 201.50        |
| KR6592397147        | 미래에셋증권(ELS)2173    | 143.81        |
| KR6662374141        | 동양W(ELS)1004       | 191.66        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b>  |                    | <b>738.63</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

|     |        |
|-----|--------|
| 위험액 | 715.89 |
|-----|--------|

# 메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

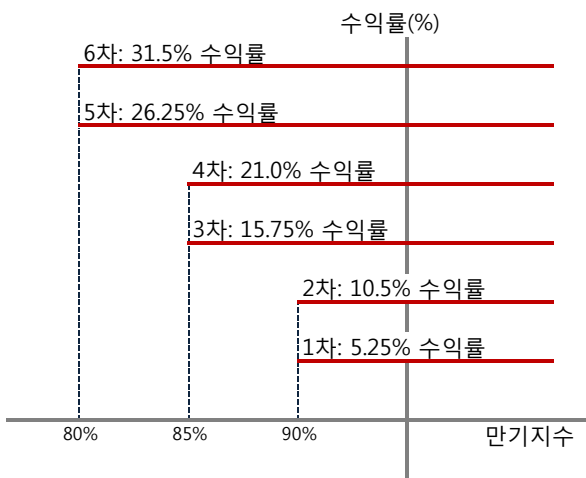
## 1. 계약금액

단위(백만원)

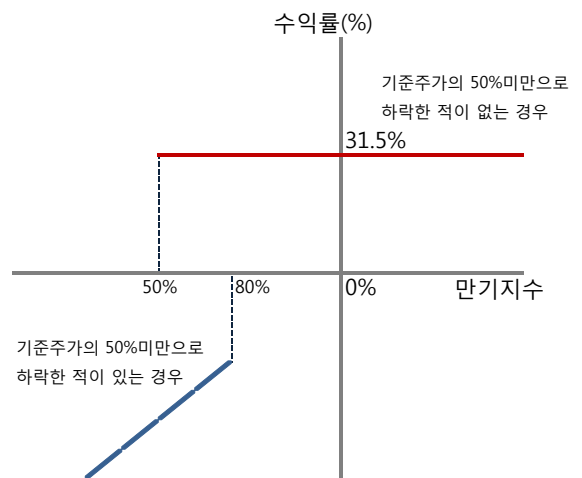
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 4,027 | 0     | 4,027     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 4,027 | 0     | 4,027     | 장외 |

## 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   | 107.27   | 95.06    | 82.84    | 70.62    | 58.40    | 46.19    | 33.97    |  |
| 자산   | 99.63    | 87.42    | 75.20    | 62.98    | 50.77    | 38.55    | 26.33    |  |
| 시나리오 | 76.09    | 63.88    | 51.66    | 39.44    | 27.23    | 15.01    | 2.79     |  |
| 리오   | 36.65    | 24.43    | 12.22    | 0.00     | (12.22)  | (24.43)  | (36.65)  |  |
|      | (18.70)  | (30.91)  | (43.13)  | (55.35)  | (67.56)  | (79.78)  | (92.00)  |  |
|      | (89.95)  | (102.16) | (114.38) | (126.60) | (138.81) | (151.03) | (163.25) |  |
|      | (177.10) | (189.32) | (201.54) | (213.75) | (225.97) | (238.19) | (250.40) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                 |               |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR6553363153       | 우리투자증권(ELS)4485 | 60.18         |
| KR6573353150       | 한국투자증권(ELS)2116 | 74.94         |
| KR6593354154       | 미래에셋증권(ELS)2235 | 74.88         |
| KR6663346155       | 동양W(ELS)1009    | 40.40         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                 | <b>250.40</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 238.04

# 메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

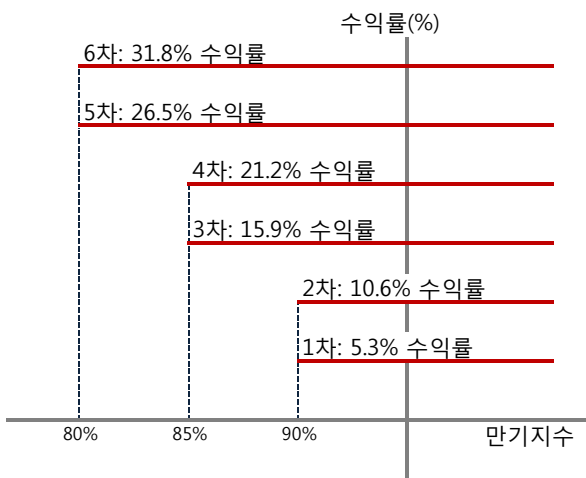
## 1. 계약금액

단위(백만원)

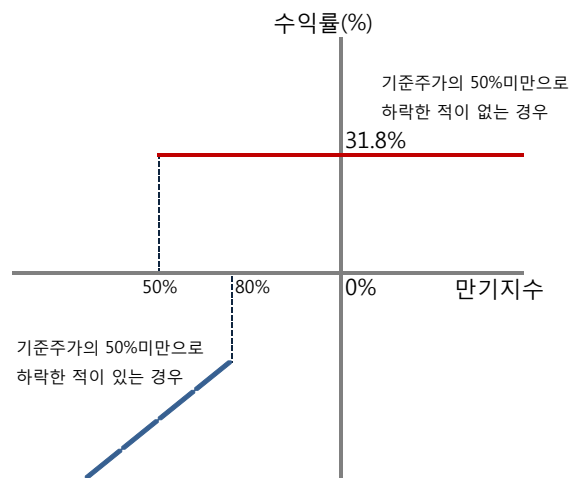
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 4,841 | 0     | 4,841     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 4,841 | 0     | 4,841     | 장외 |

## 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   | 156.67   | 140.52   | 124.37   | 108.22   | 92.07    | 75.91    | 59.76    |  |
| 자산   | 137.52   | 121.37   | 105.22   | 89.06    | 72.91    | 56.76    | 40.61    |  |
| 시나리오 | 101.45   | 85.30    | 69.14    | 52.99    | 36.84    | 20.69    | 4.54     |  |
| 리    | 0.00%    | 32.30    | 16.15    | 0.00     | (16.15)  | (32.30)  | (48.45)  |  |
|      | -2.67%   | (37.61)  | (53.76)  | (69.91)  | (86.06)  | (102.21) | (118.37) |  |
|      | -5.33%   | (108.29) | (124.44) | (140.59) | (156.74) | (172.90) | (189.05) |  |
|      | -8.00%   | (212.04) | (228.19) | (244.35) | (260.50) | (276.65) | (308.95) |  |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |               |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6503341168       | 신한투자(ELS)2834      | 87.37         |
| KR6553344161       | 우리투자증권(ELS)4621    | 55.53         |
| KR6583319167       | 현대증권(ELS)2011-1768 | 87.34         |
| KR6663324160       | 동양W(ELS)1028       | 78.71         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>308.95</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 291.35

# 메리츠 2스타증권 KS-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

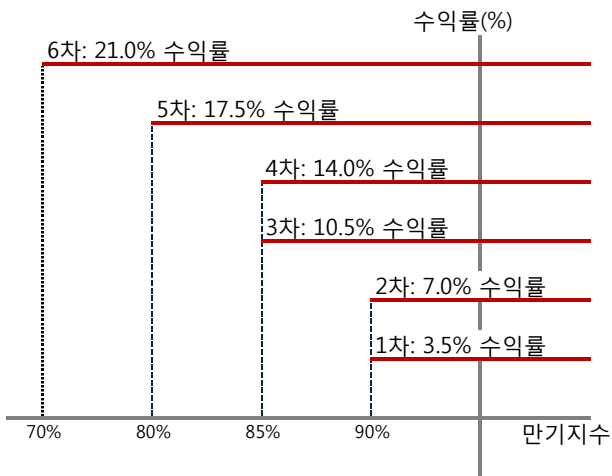
## 1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 621   | 0     | 621       | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 621   | 0     | 621       | 장외 |

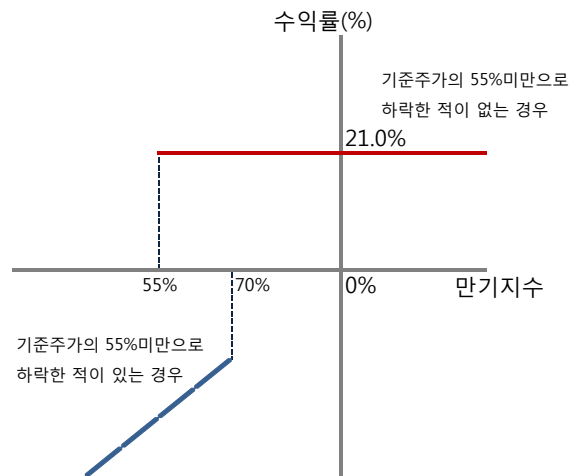
단위(백만원)

## 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<br>자산<br>시나<br>리오 | 8.00%  | 19.51    | 17.43   | 15.35   | 13.27   | 11.19   | 9.11    | 7.04    |         |
|                      | 5.33%  | 17.30    | 15.23   | 13.15   | 11.07   | 8.99    | 6.91    | 4.83    |         |
|                      | 2.67%  | 12.88    | 10.80   | 8.72    | 6.65    | 4.57    | 2.49    | 0.41    |         |
|                      | 0.00%  | 6.24     | 4.16    | 2.08    | 0.00    | (2.08)  | (4.16)  | (6.24)  |         |
|                      | -2.67% | (2.63)   | (4.71)  | (6.79)  | (8.87)  | (10.95) | (13.02) | (15.10) |         |
|                      | -5.33% | (13.72)  | (15.80) | (17.88) | (19.96) | (22.03) | (24.11) | (26.19) |         |
|                      | -8.00% | (27.03)  | (29.11) | (31.19) | (33.27) | (35.35) | (37.42) | (39.50) |         |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| 시나리오               | 자산              | 단위(백만원)      |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6502366315       | 신한투자(ELS)6143   | 9.13         |
| KR6522359316       | 대우증권(ELS)8664   | 10.44        |
| KR6621312315       | 교보증권(ELS)10007  | 9.26         |
| KR6772307312       | KB STAR(ELS)334 | 10.68        |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                 | <b>39.50</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 50.46

# 메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

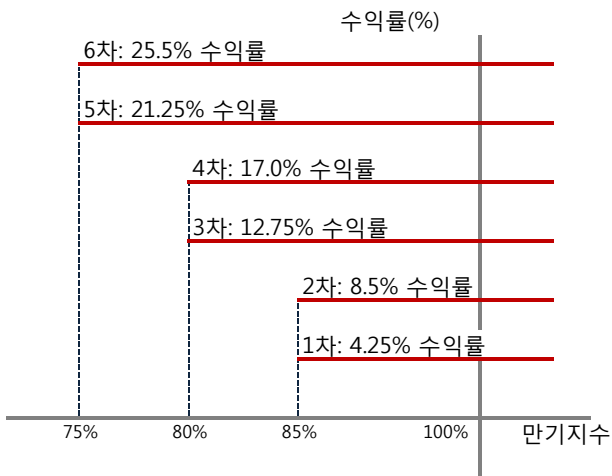
## 1. 계약금액

단위(백만원)

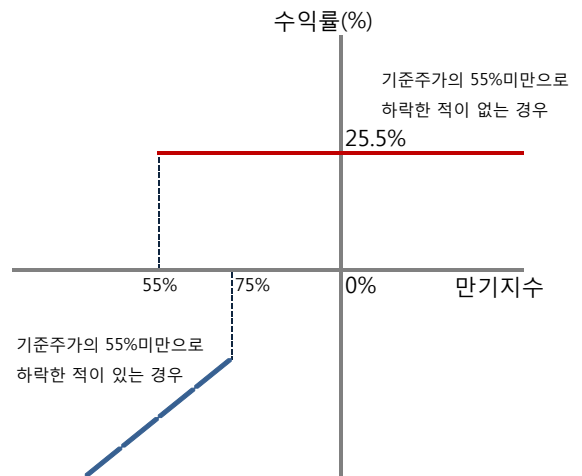
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 2,533 | 0     | 2,533     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 2,533 | 0     | 2,533     | 장외 |

## 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%    | 17.97    | 13.86    | 9.75     | 5.64     | 1.52     | (2.59)   | (6.70)   |
|            | 5.33%    | 32.02    | 27.91    | 23.79    | 19.68    | 15.57    | 11.46    | 7.35     |
|            | 2.67%    | 30.14    | 26.03    | 21.92    | 17.80    | 13.69    | 9.58     | 5.47     |
|            | 0.00%    | 12.34    | 8.22     | 4.11     | 0.00     | (4.11)   | (8.22)   | (12.34)  |
|            | -2.67%   | (21.39)  | (25.50)  | (29.62)  | (33.73)  | (37.84)  | (41.95)  | (46.06)  |
|            | -5.33%   | (71.05)  | (75.16)  | (79.27)  | (83.38)  | (87.49)  | (91.61)  | (95.72)  |
|            | -8.00%   | (136.62) | (140.74) | (144.85) | (148.96) | (153.07) | (157.18) | (161.30) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                    |               |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65223A1316       | 대우증권(ELS)8666      | 39.89         |
| KR6542329315       | 신영증권플랜업(ELS)3238   | 40.51         |
| KR6582364313       | 현대증권(ELS)2013-2624 | 40.49         |
| KR6592374310       | 미래에셋증권(ELS)4281    | 40.40         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                    | <b>161.30</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

153.67



# 메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

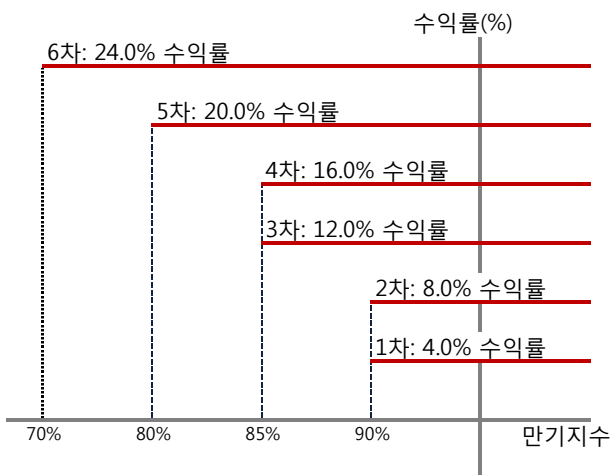
## 1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 5,244 | 0     | 5,244     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 5,244 | 0     | 5,244     | 장외 |

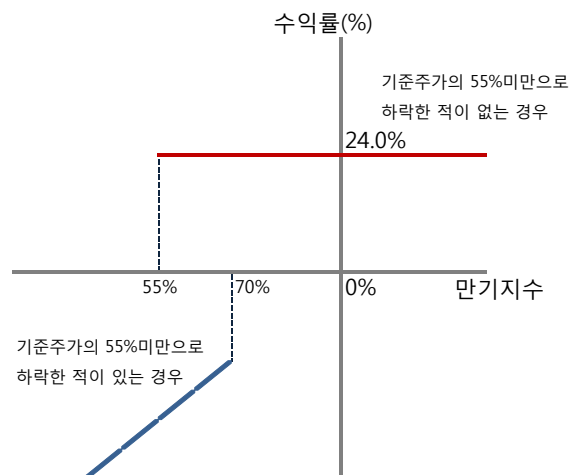
단위(백만원)

## 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%    | 176.15   | 155.34   | 134.53   | 113.72   | 92.90    | 72.09    | 51.28    |
| 자산   | 5.33%    | 147.27   | 126.46   | 105.65   | 84.84    | 64.03    | 43.22    | 22.41    |
| 시나리오 | 2.67%    | 109.37   | 88.56    | 67.75    | 46.94    | 26.13    | 5.32     | (15.50)  |
| 리오   | 0.00%    | 62.43    | 41.62    | 20.81    | 0.00     | (20.81)  | (41.62)  | (62.43)  |
|      | -2.67%   | 6.46     | (14.35)  | (35.16)  | (55.97)  | (76.78)  | (97.59)  | (118.40) |
|      | -5.33%   | (58.53)  | (79.35)  | (100.16) | (120.97) | (141.78) | (162.59) | (183.40) |
|      | -8.00%   | (132.56) | (153.38) | (174.19) | (195.00) | (215.81) | (236.62) | (257.43) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                 |               |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65023A1334       | 신한투자(ELS)6492   | 64.18         |
| KR6522385337       | 대우증권(ELS)8895   | 63.73         |
| KR6621330333       | 교보증권(ELS)10066  | 64.76         |
| KR6772315331       | KB STAR(ELS)395 | 64.76         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                 | <b>257.43</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 273.64

# 메리츠 2스타주가연동증권 LK-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-06-18

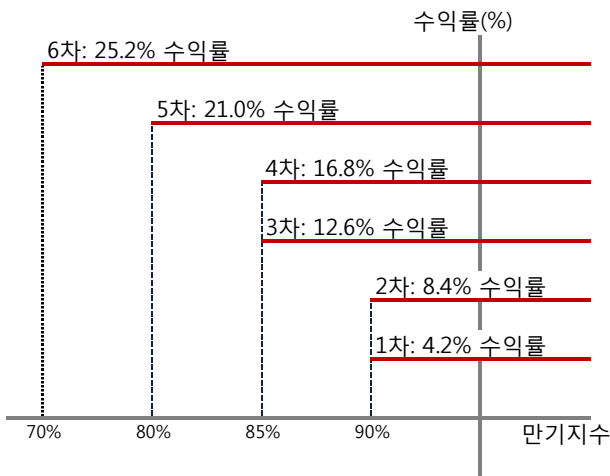
## 1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 2,793 | 0     | 2,793     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 2,793 | 0     | 2,793     | 장외 |

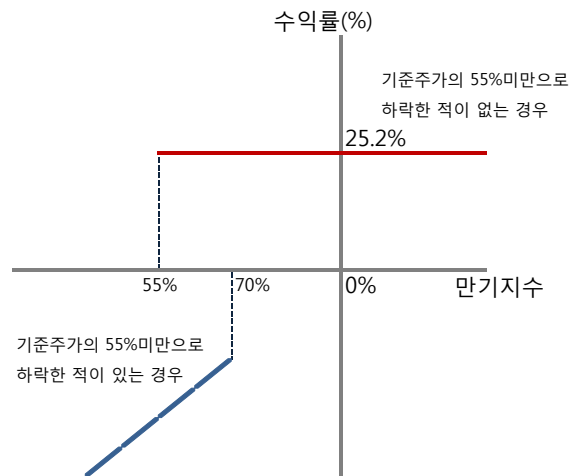
단위(백만원)

## 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%    | 119.68  | 106.03  | 92.37    | 78.72    | 65.07    | 51.41    | 37.76    |
| 자산 | 5.33%    | 98.15   | 84.49   | 70.84    | 57.19    | 43.53    | 29.88    | 16.23    |
| 시나 | 2.67%    | 71.91   | 58.25   | 44.60    | 30.95    | 17.29    | 3.64     | (10.01)  |
| 리오 | 0.00%    | 40.96   | 27.31   | 13.65    | 0.00     | (13.65)  | (27.31)  | (40.96)  |
|    | -2.67%   | 5.30    | (8.35)  | (22.00)  | (35.65)  | (49.31)  | (62.96)  | (76.61)  |
|    | -5.33%   | (35.06) | (48.71) | (62.36)  | (76.02)  | (89.67)  | (103.32) | (116.98) |
|    | -8.00%   | (80.13) | (93.78) | (107.43) | (121.09) | (134.74) | (148.39) | (162.05) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

|                    |                 |               |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65023A0336       | 신한투자(ELS)6492   | 40.54         |
| KR6522386335       | 대우증권(ELS)8895   | 40.22         |
| KR6572385336       | 교보증권(ELS)10066  | 40.34         |
| KR6772318335       | KB STAR(ELS)395 | 40.94         |
| <b>총 최대손실 예상금액</b> |                 | <b>162.05</b> |

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

185.55