

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

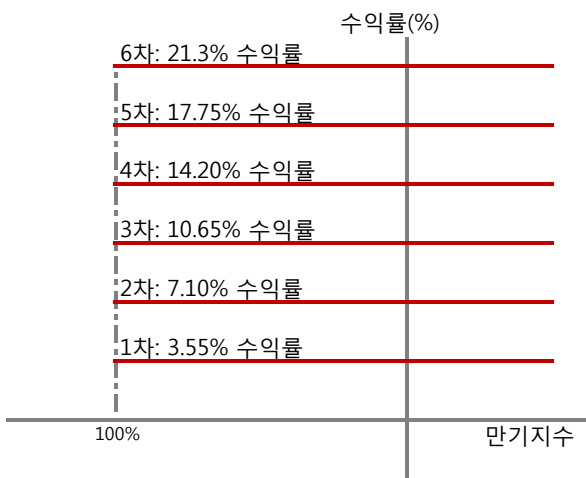
1. 계약금액

단위(백만원)

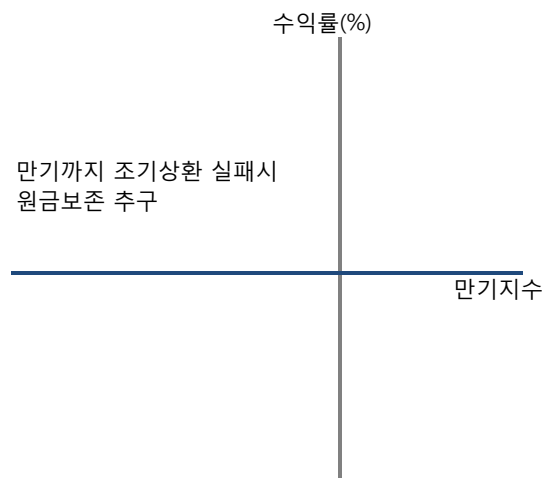
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,087 | 0 | 1,087 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,087 | 0 | 1,087 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|------------|----------|----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00% | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) |
| | 5.33% | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) |
| | 2.67% | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) |
| | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) |
| | -5.33% | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) |
| | -8.00% | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6552345128 | 우리투자증권(ELS)3989 | 0.00 |
| KR6582317121 | 현대증권(ELS)2011-1588 | 0.00 |
| KR6592350120 | 미래에셋증권(ELS)1896 | 0.00 |
| KR6662316126 | 동양W(ELS)974 | 0.00 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.00 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

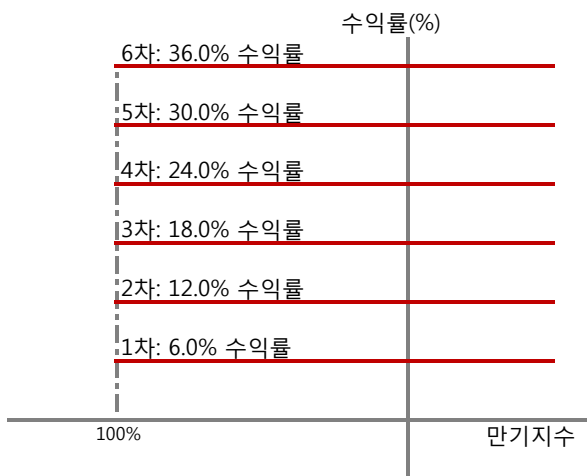
1. 계약금액

단위(백만원)

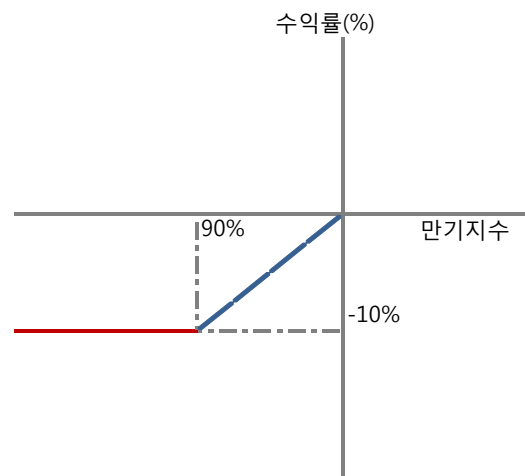
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 706 | 0 | 706 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 706 | 0 | 706 | 장외 |

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 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | |
| 자산 | 0.60 | 0.59 | 0.59 | 0.59 | 0.59 | 0.59 | 0.59 | |
| 시나리오 | 0.26 | 0.26 | 0.26 | 0.26 | 0.26 | 0.26 | 0.26 | |
| | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | (0.00) | (0.00) | (0.00) | |
| | (0.19) | (0.19) | (0.19) | (0.19) | (0.19) | (0.19) | (0.19) | |
| | (0.31) | (0.31) | (0.31) | (0.31) | (0.31) | (0.31) | (0.31) | |
| | (0.36) | (0.36) | (0.36) | (0.36) | (0.36) | (0.36) | (0.36) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6502331129 | 신한투자(ELS)2235 | 0.10 |
| KR6552343123 | 우리투자증권(ELS)3988 | 0.08 |
| KR6582319127 | 현대증권(ELS)2011-1589 | 0.10 |
| KR6662317124 | 동양W(ELS)975 | 0.09 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.36 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.74

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

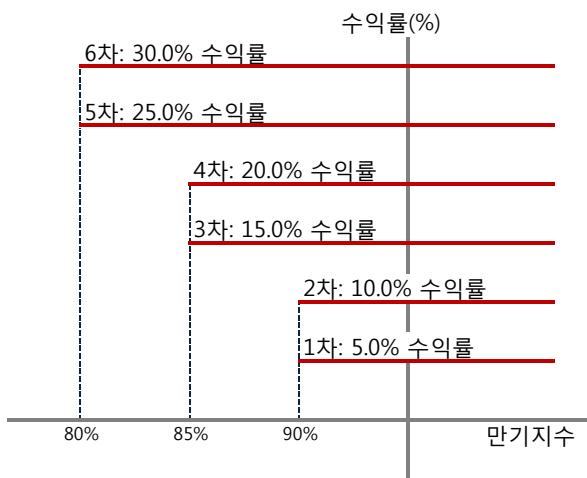
1. 계약금액

단위(백만원)

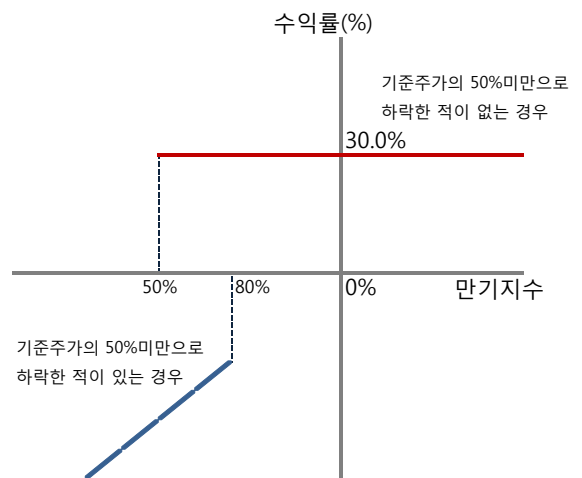
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,721 | 0 | 5,721 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,721 | 0 | 5,721 | 장외 |

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% | (58.39) | (59.18) | (59.96) | (60.75) | (61.54) | (62.33) | (63.12) |
| 자산 | 5.33% | (19.09) | (19.88) | (20.67) | (21.46) | (22.25) | (23.04) | (23.83) |
| 사 | 2.67% | 1.16 | 0.37 | (0.42) | (1.21) | (2.00) | (2.79) | (3.58) |
| 나 | 0.00% | 2.37 | 1.58 | 0.79 | 0.00 | (0.79) | (1.58) | (2.37) |
| 리 | -2.67% | (15.46) | (16.25) | (17.04) | (17.83) | (18.62) | (19.41) | (20.20) |
| 오 | -5.33% | (52.33) | (53.12) | (53.91) | (54.70) | (55.48) | (56.27) | (57.06) |
| 시 | -8.00% | (108.23) | (109.02) | (109.81) | (110.60) | (111.39) | (112.18) | (112.97) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140 | 우리투자증권(ELS)4416 | 33.75 |
| KR6582383149 | 현대증권(ELS)2011-1698 | 33.18 |
| KR6592397147 | 미래에셋증권(ELS)2173 | 27.77 |
| KR6662374141 | 동양W(ELS)1004 | 18.26 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 112.97 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

63.68

메리츠 2스타증권 KS-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

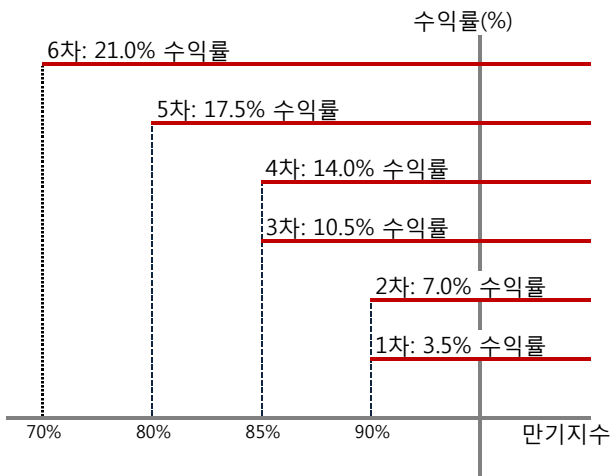
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 600 | 0 | 600 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 600 | 0 | 600 | 장외 |

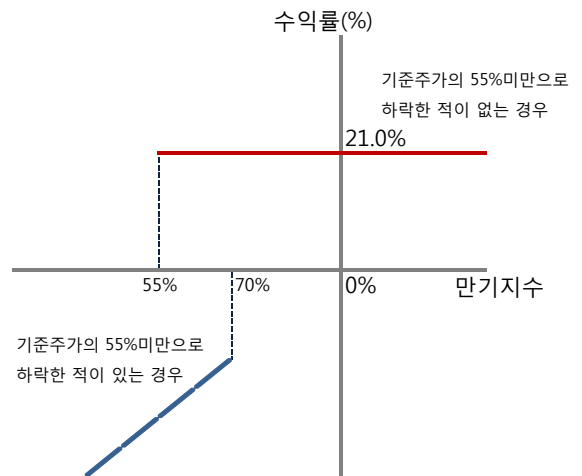
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

| 구분 | | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|------------|--------|----------|---------|--------|--------|--------|---------|---------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00% | (2.55) | (2.90) | (3.24) | (3.58) | (3.92) | (4.27) | (4.61) |
| | 5.33% | 0.11 | (0.23) | (0.58) | (0.92) | (1.26) | (1.60) | (1.95) |
| | 2.67% | 1.30 | 0.96 | 0.62 | 0.27 | (0.07) | (0.41) | (0.75) |
| | 0.00% | 1.03 | 0.69 | 0.34 | 0.00 | (0.34) | (0.69) | (1.03) |
| | -2.67% | (0.71) | (1.06) | (1.40) | (1.74) | (2.09) | (2.43) | (2.77) |
| | -5.33% | (3.93) | (4.27) | (4.61) | (4.95) | (5.30) | (5.64) | (5.98) |
| | -8.00% | (8.61) | (8.95) | (9.29) | (9.63) | (9.98) | (10.32) | (10.66) |

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| 시나리오 | 자산명 | 단위(백만원) |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6502366315 | 신한투자(ELS)6143 | 2.73 |
| KR6522359316 | 대우증권(ELS)8664 | 2.67 |
| KR6621312315 | 교보증권(ELS)10007 | 2.81 |
| KR6772307312 | KB STAR(ELS)334 | 2.45 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 10.66 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 11.64

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

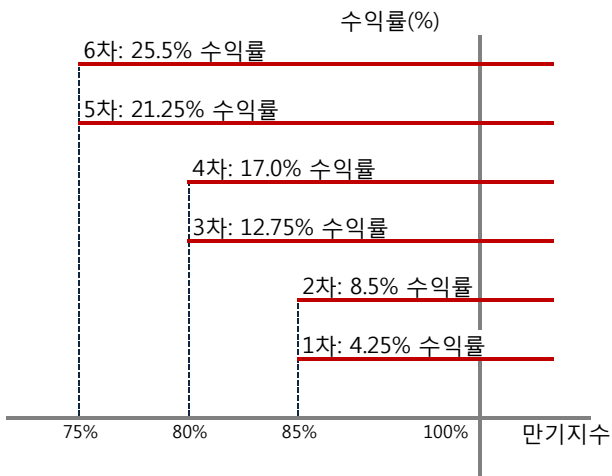
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 2,483 | 0 | 2,483 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,483 | 0 | 2,483 | 장외 |

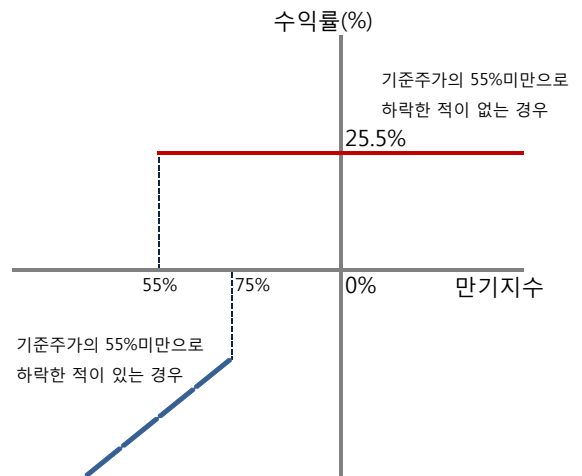
단위(백만원)

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% | 13.03 | 9.79 | 6.55 | 3.31 | 0.07 | (3.17) | (6.41) |
| | 5.33% | 20.62 | 17.38 | 14.14 | 10.90 | 7.66 | 4.42 | 1.18 |
| | 2.67% | 19.52 | 16.28 | 13.04 | 9.79 | 6.55 | 3.31 | 0.07 |
| | 0.00% | 9.72 | 6.48 | 3.24 | 0.00 | (3.24) | (6.48) | (9.72) |
| | -2.67% | (8.76) | (12.00) | (15.24) | (18.48) | (21.73) | (24.97) | (28.21) |
| | -5.33% | (35.94) | (39.18) | (42.42) | (45.66) | (48.90) | (52.14) | (55.38) |
| | -8.00% | (71.80) | (75.04) | (78.28) | (81.52) | (84.77) | (88.01) | (91.25) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR65223A1316 | 대우증권(ELS)8666 | 23.03 |
| KR6542329315 | 신영증권플랜업(ELS)3238 | 23.44 |
| KR6582364313 | 현대증권(ELS)2013-2624 | 21.57 |
| KR6592374310 | 미래에셋증권(ELS)4281 | 23.21 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 91.25 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

81.59

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

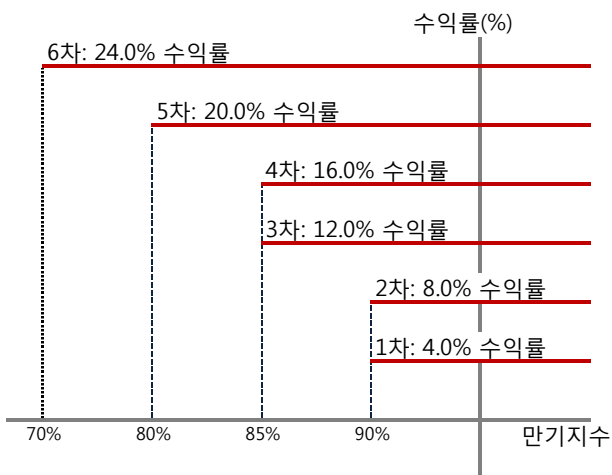
1. 계약금액

| 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 |

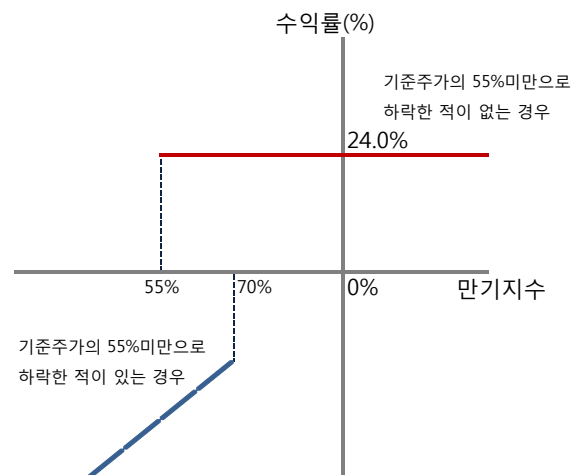
단위(백만원)

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% | 202.31 | 179.49 | 156.67 | 133.85 | 111.03 | 88.21 | 65.39 |
| 자산 | 5.33% | 167.11 | 144.29 | 121.47 | 98.65 | 75.82 | 53.00 | 30.18 |
| 시나 | 2.67% | 122.49 | 99.67 | 76.85 | 54.03 | 31.21 | 8.39 | (14.43) |
| 리오 | 0.00% | 68.46 | 45.64 | 22.82 | 0.00 | (22.82) | (45.64) | (68.46) |
| | -2.67% | 5.02 | (17.80) | (40.62) | (63.44) | (86.26) | (109.08) | (131.90) |
| | -5.33% | (67.82) | (90.64) | (113.46) | (136.28) | (159.10) | (181.92) | (204.75) |
| | -8.00% | (150.08) | (172.90) | (195.72) | (218.54) | (241.36) | (264.18) | (287.00) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65023A1334 | 신한투자(ELS)6492 | 71.50 |
| KR6522385337 | 대우증권(ELS)8895 | 70.97 |
| KR6621330333 | 교보증권(ELS)10066 | 72.27 |
| KR6772315331 | KB STAR(ELS)395 | 72.27 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 287.00 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 260.05

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

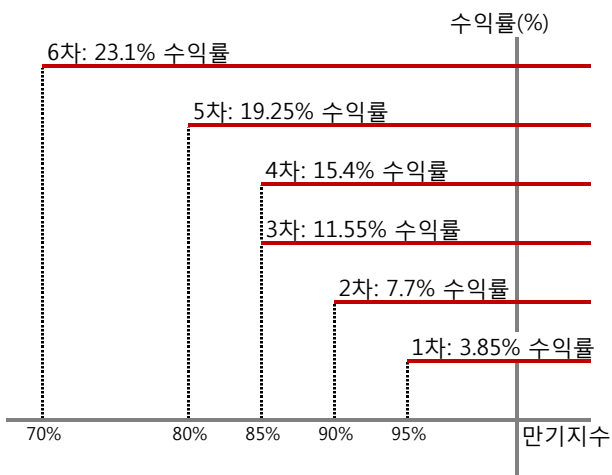
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,173 | 0 | 1,173 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,173 | 0 | 1,173 | 장외 |

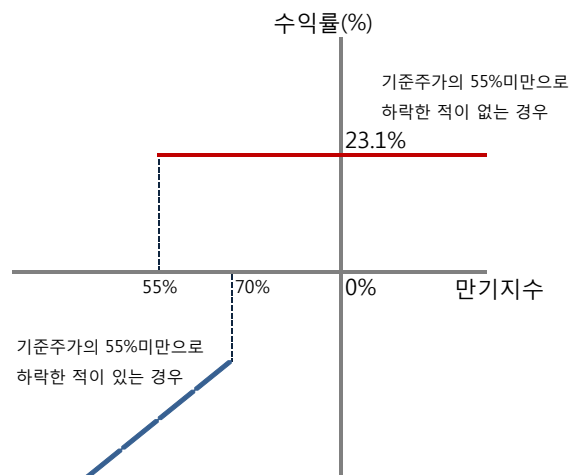
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

| 구분 | 변동성 시나리오 | | | | | | | |
|-------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| 기초 자산 | 8.00% | 6.26 | 4.81 | 3.36 | 1.91 | 0.46 | (0.99) | (2.44) |
| 시나리오 | 5.33% | 9.37 | 7.92 | 6.47 | 5.02 | 3.57 | 2.12 | 0.68 |
| | 2.67% | 8.73 | 7.28 | 5.83 | 4.38 | 2.94 | 1.49 | 0.04 |
| | 0.00% | 4.35 | 2.90 | 1.45 | 0.00 | (1.45) | (2.90) | (4.35) |
| | -2.67% | (3.79) | (5.23) | (6.68) | (8.13) | (9.58) | (11.03) | (12.48) |
| | -5.33% | (15.67) | (17.11) | (18.56) | (20.01) | (21.46) | (22.91) | (24.36) |
| | -8.00% | (31.29) | (32.74) | (34.19) | (35.64) | (37.09) | (38.54) | (39.99) |

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

| 시나리오 | 자산 | 최대손실 예상금액 |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6512307374 | 대신증권(ELS)3488 | 10.01 |
| KR6572310375 | 한국투자증권(ELS)3381 | 9.87 |
| KR6582311371 | 현대증권(ELS)2013-2962 | 9.92 |
| KR6772302370 | KB STAR(ELS)480 | 10.19 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 39.99 |

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 54.12

메리트 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

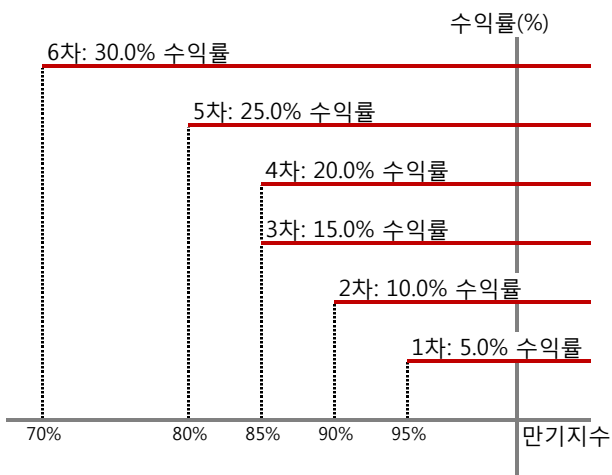
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 1,383 | 0 | 1,383 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,383 | 0 | 1,383 | 장외 |

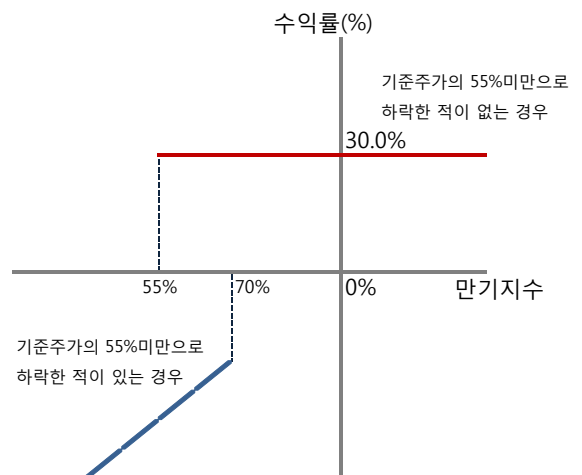
단위(백만원)

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 | 85.46 | 74.91 | 64.36 | 53.81 | 43.26 | 32.71 | 22.16 | |
| 시나리오 | 68.89 | 58.34 | 47.79 | 37.24 | 26.69 | 16.14 | 5.59 | |
| 리오 | 50.95 | 40.40 | 29.85 | 19.30 | 8.75 | (1.80) | (12.35) | |
| | 31.65 | 21.10 | 10.55 | 0.00 | (10.55) | (21.10) | (31.65) | |
| | 10.98 | 0.43 | (10.12) | (20.67) | (31.22) | (41.76) | (52.31) | |
| | (11.05) | (21.60) | (32.15) | (42.70) | (53.25) | (63.79) | (74.34) | |
| | (34.44) | (44.99) | (55.54) | (66.09) | (76.64) | (87.19) | (97.74) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6512323389 | 대신증권(ELS)3554 | 24.44 |
| KR6572337386 | 한국투자증권(ELS)3430 | 24.31 |
| KR6582335388 | 현대증권(ELS)2013-3009 | 24.37 |
| KR6771313386 | KB STAR(ELS)503 | 24.62 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 97.74 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 94.15

메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-12-02

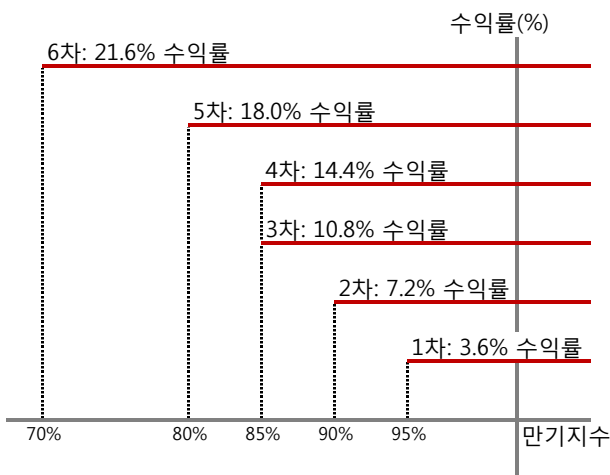
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 2,263 | 0 | 2,263 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,263 | 0 | 2,263 | 장외 |

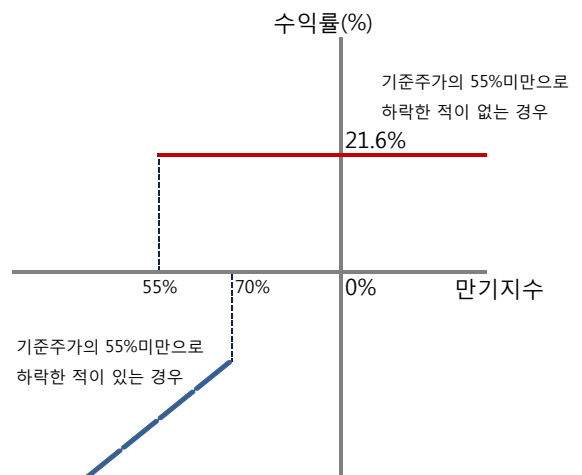
단위(백만원)

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 | 103.63 | 88.96 | 74.29 | 59.62 | 44.95 | 30.28 | 15.60 | |
| 시나리오 | 87.08 | 72.41 | 57.74 | 43.07 | 28.40 | 13.73 | (0.94) | |
| | 67.21 | 52.54 | 37.87 | 23.20 | 8.53 | (6.15) | (20.82) | |
| | 44.01 | 29.34 | 14.67 | 0.00 | (14.67) | (29.34) | (44.01) | |
| | 17.49 | 2.82 | (11.85) | (26.52) | (41.19) | (55.86) | (70.54) | |
| | (12.35) | (27.03) | (41.70) | (56.37) | (71.04) | (85.71) | (100.38) | |
| | (45.53) | (60.20) | (74.87) | (89.54) | (104.21) | (118.88) | (133.55) | |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65123A0392 | 대신증권(ELS)3674 | 24.62 |
| KR6572385393 | 한국투자증권(ELS)3470 | 33.37 |
| KR6582382398 | 현대증권(ELS)2013-3080 | 33.24 |
| KR6652340391 | 한화스마트(ELS)2562 | 33.28 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 124.52 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 113.25