

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

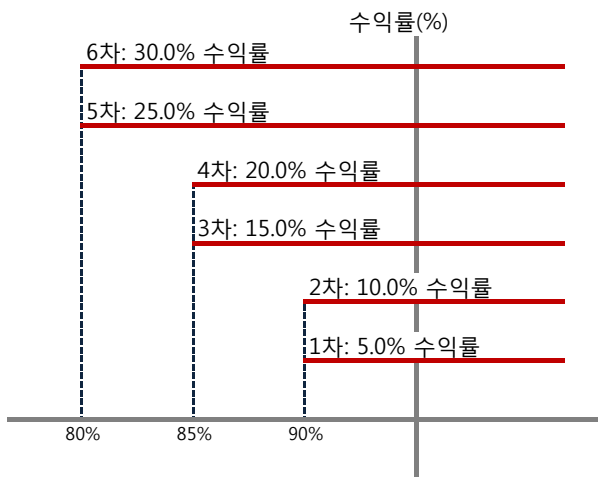
1. 계약금액

단위(백만원)

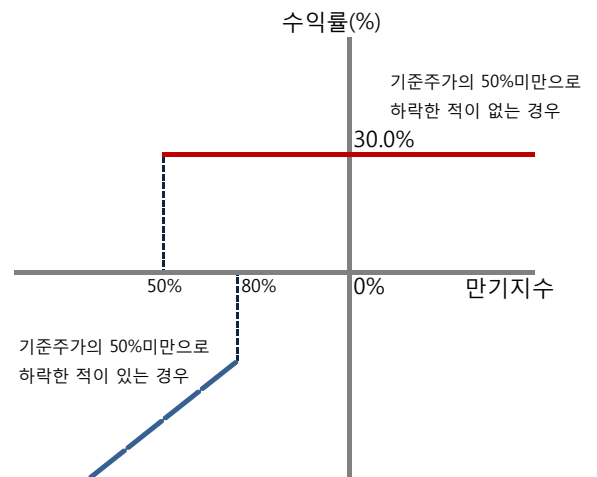
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 4,538 | 0 | 4,538 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,538 | 0 | 4,538 | 장외 |

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% | (504.47) | (504.74) | (505.00) | (505.27) | (505.53) | (505.80) | (506.06) |
| | 5.33% | (216.68) | (216.94) | (217.21) | (217.47) | (217.74) | (218.00) | (218.27) |
| | 2.67% | (48.26) | (48.52) | (48.79) | (49.05) | (49.32) | (49.58) | (49.85) |
| | 0.00% | 0.79 | 0.53 | 0.26 | 0.00 | (0.26) | (0.53) | (0.79) |
| | -2.67% | (69.52) | (69.79) | (70.05) | (70.32) | (70.58) | (70.85) | (71.11) |
| | -5.33% | (259.21) | (259.48) | (259.74) | (260.01) | (260.27) | (260.54) | (260.80) |
| | -8.00% | (568.28) | (568.54) | (568.81) | (569.07) | (569.33) | (569.60) | (569.86) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65523BH140 | 우리투자증권(ELS)4416 | 158.99 |
| KR6582383149 | 현대증권(ELS)2011-1698 | 135.61 |
| KR6592397147 | 미래에셋증권(ELS)2173 | 158.06 |
| KR6662374141 | 동양W(ELS)1004 | 117.21 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 569.86 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 157.24

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

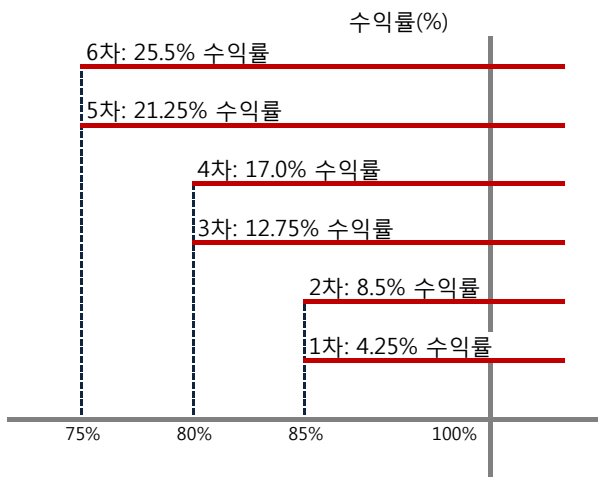
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 2,463 | 0 | 2,463 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,463 | 0 | 2,463 | 장외 |

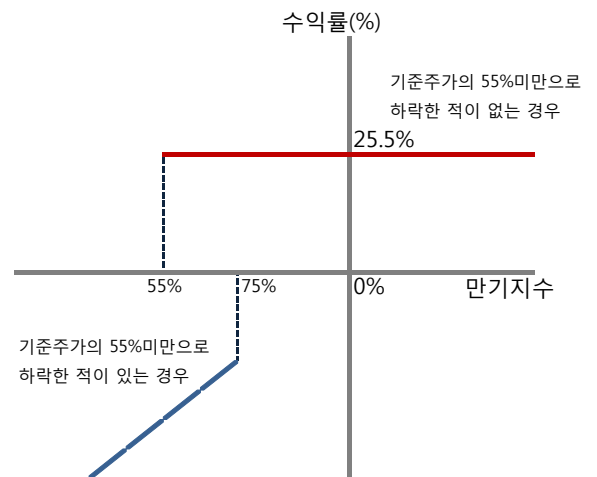
단위(백만원)

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 시나 리오 | 8.00% | 98.34 | 88.87 | 79.40 | 69.93 | 60.46 | 50.98 | 41.51 |
| | 5.33% | 82.46 | 72.99 | 63.52 | 54.05 | 44.58 | 35.11 | 25.64 |
| | 2.67% | 59.15 | 49.68 | 40.21 | 30.74 | 21.27 | 11.80 | 2.33 |
| | 0.00% | 28.41 | 18.94 | 9.47 | 0.00 | (9.47) | (18.94) | (28.41) |
| | -2.67% | (9.76) | (19.23) | (28.70) | (38.17) | (47.64) | (57.12) | (66.59) |
| | -5.33% | (55.37) | (64.84) | (74.31) | (83.78) | (93.25) | (102.72) | (112.19) |
| | -8.00% | (108.41) | (117.88) | (127.35) | (136.82) | (146.29) | (155.76) | (165.23) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65223A1316 | 대우증권(ELS)8666 | 42.30 |
| KR6542329315 | 신영증권플랜업(ELS)3238 | 42.51 |
| KR6582364313 | 현대증권(ELS)2013-2624 | 38.03 |
| KR6592374310 | 미래에셋증권(ELS)4281 | 42.39 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 165.23 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 153.53

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

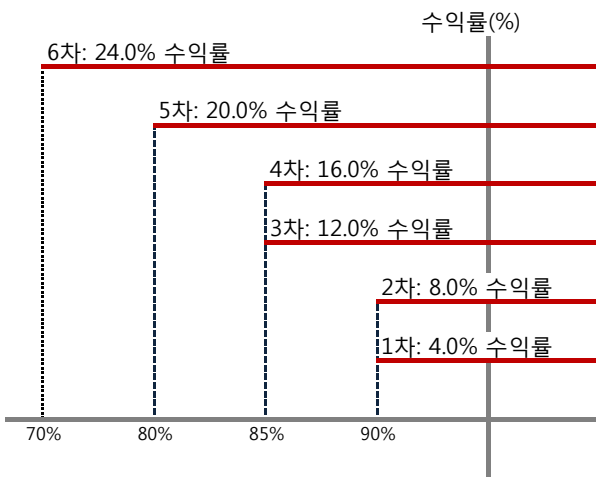
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 5,234 | 0 | 5,234 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,234 | 0 | 5,234 | 장외 |

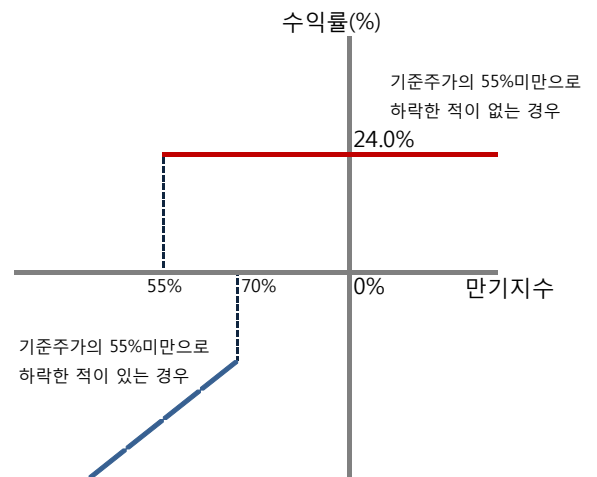
단위(백만원)

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 시나 리오 | 8.00% | 287.40 | 260.44 | 233.47 | 206.51 | 179.55 | 152.59 | 125.63 |
| | 5.33% | 228.60 | 201.64 | 174.68 | 147.72 | 120.76 | 93.79 | 66.83 |
| | 2.67% | 159.76 | 132.80 | 105.84 | 78.88 | 51.92 | 24.96 | (2.00) |
| | 0.00% | 80.88 | 53.92 | 26.96 | 0.00 | (26.96) | (53.92) | (80.88) |
| | -2.67% | (8.04) | (35.00) | (61.96) | (88.92) | (115.88) | (142.84) | (169.80) |
| | -5.33% | (107.00) | (133.96) | (160.92) | (187.88) | (214.84) | (241.80) | (268.76) |
| | -8.00% | (216.00) | (242.96) | (269.92) | (296.88) | (323.84) | (350.81) | (377.77) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|---------------|
| KR65023A1334 | 신한투자(ELS)6492 | 94.47 |
| KR6522385337 | 대우증권(ELS)8895 | 94.38 |
| KR6621330333 | 교보증권(ELS)10066 | 94.82 |
| KR6772315331 | KB STAR(ELS)395 | 94.10 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 377.77 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 338.84

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

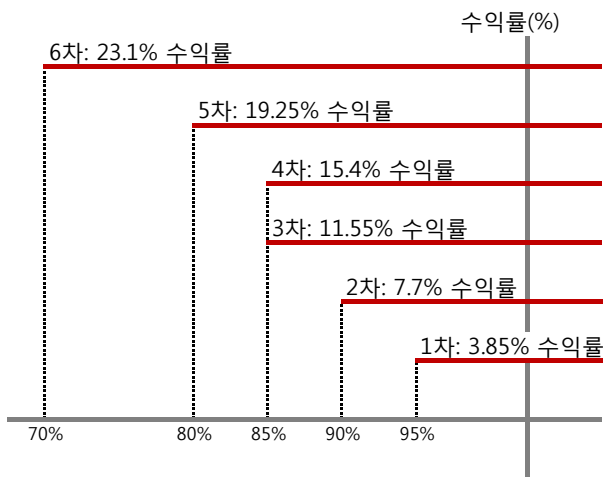
1. 계약금액

| 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 |

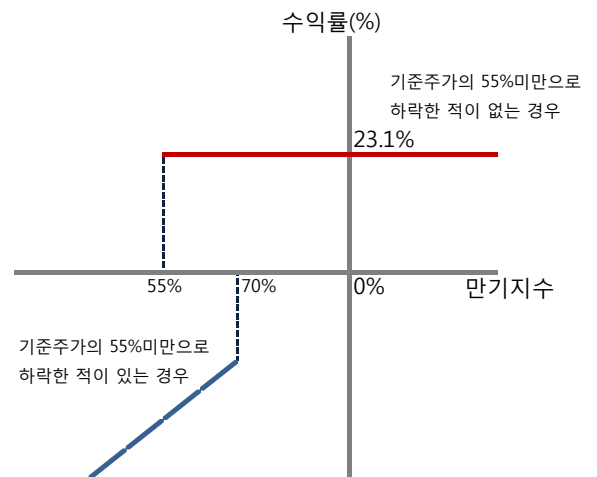
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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% | 35.81 | 31.62 | 27.43 | 23.24 | 19.05 | 14.86 | 10.67 |
| | 5.33% | 30.29 | 26.10 | 21.91 | 17.72 | 13.53 | 9.34 | 5.15 |
| | 2.67% | 22.54 | 18.35 | 14.16 | 9.97 | 5.78 | 1.59 | (2.59) |
| | 0.00% | 12.57 | 8.38 | 4.19 | 0.00 | (4.19) | (8.38) | (12.57) |
| | -2.67% | 0.37 | (3.82) | (8.01) | (12.20) | (16.39) | (20.58) | (24.77) |
| | -5.33% | (14.06) | (18.25) | (22.44) | (26.63) | (30.82) | (35.01) | (39.19) |
| | -8.00% | (30.71) | (34.90) | (39.09) | (43.28) | (47.47) | (51.66) | (55.85) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------|
| KR6512307374 | 대신증권(ELS)3488 | 13.95 |
| KR6572310375 | 한국투자증권(ELS)3381 | 13.84 |
| KR6582311371 | 현대증권(ELS)2013-2962 | 13.88 |
| KR6772302370 | KB STAR(ELS)480 | 14.17 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 55.85 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 61.33

메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

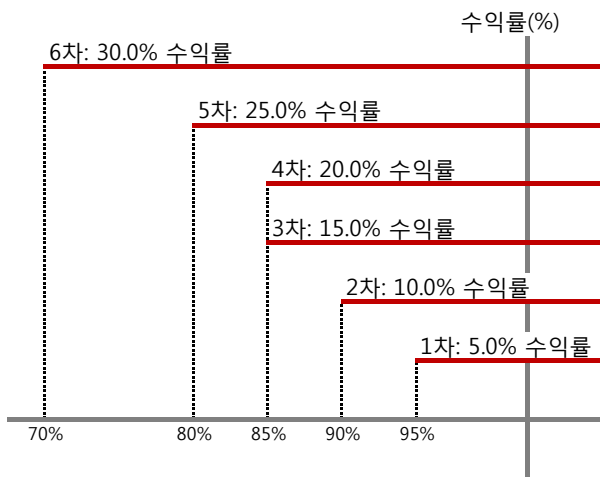
1. 계약금액

| 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 |

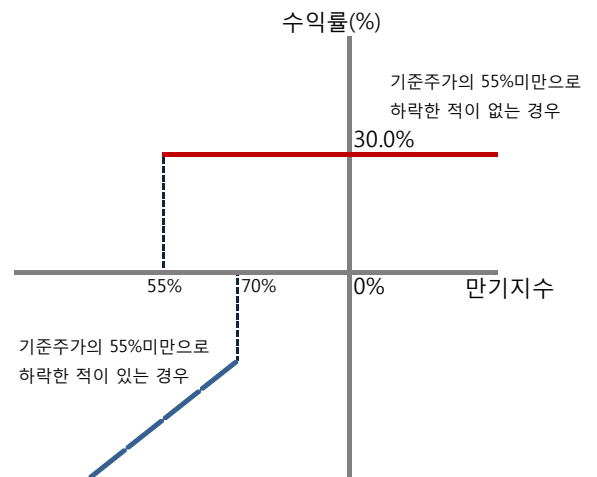
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|----------------------|----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | 87.54 | 76.31 | 65.08 | 53.86 | 42.63 | 31.40 | 20.18 |
| | 5.33% | 71.68 | 60.45 | 49.23 | 38.00 | 26.77 | 15.55 | 4.32 |
| | 2.67% | 53.73 | 42.50 | 31.28 | 20.05 | 8.82 | (2.40) | (13.63) |
| | 0.00% | 33.68 | 22.45 | 11.23 | 0.00 | (11.23) | (22.45) | (33.68) |
| | -2.67% | 11.54 | 0.31 | (10.92) | (22.15) | (33.37) | (44.60) | (55.83) |
| | -5.33% | (12.71) | (23.93) | (35.16) | (46.39) | (57.61) | (68.84) | (80.07) |
| | -8.00% | (39.05) | (50.27) | (61.50) | (72.73) | (83.95) | (95.18) | (106.41) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR6512323389 | 대신증권(ELS)3554 | 26.59 |
| KR6572337386 | 한국투자증권(ELS)3430 | 26.50 |
| KR6582335388 | 현대증권(ELS)2013-3009 | 26.54 |
| KR6771313386 | KB STAR(ELS)503 | 26.78 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 106.41 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 107.22

메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

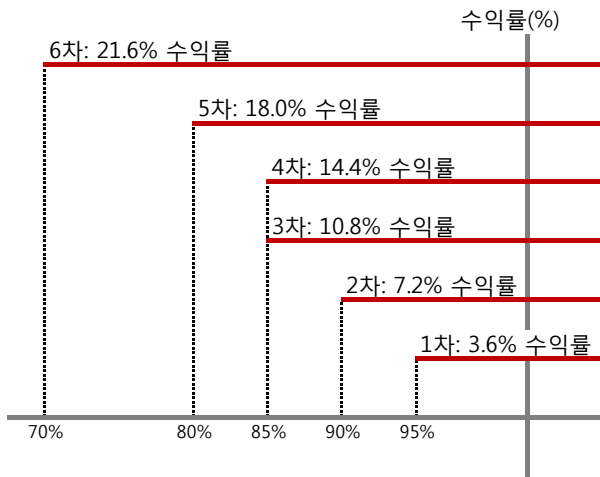
1. 계약금액

| 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 |

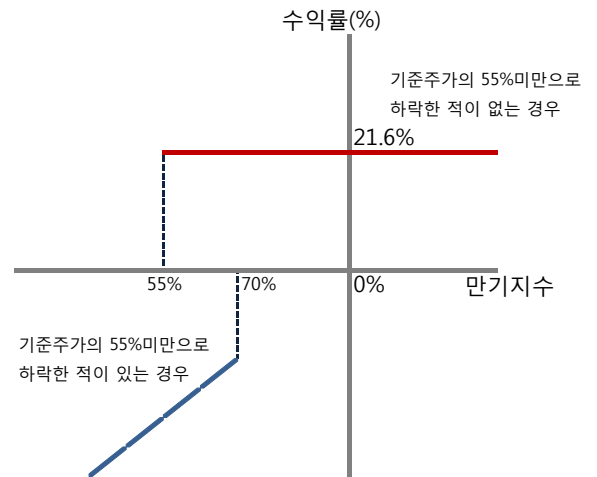
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

| 구분 | 변동성 시나리오 | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|------------|----------|----------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초 자산 시나리오 | 8.00% | 179.14 | 152.17 | 125.20 | 98.23 | 71.26 | 44.29 | 17.32 |
| | 5.33% | 148.07 | 121.10 | 94.13 | 67.17 | 40.20 | 13.23 | (13.74) |
| | 2.67% | 115.33 | 88.36 | 61.39 | 34.42 | 7.45 | (19.52) | (46.48) |
| | 0.00% | 80.91 | 53.94 | 26.97 | 0.00 | (26.97) | (53.94) | (80.91) |
| | -2.67% | 44.80 | 17.84 | (9.13) | (36.10) | (63.07) | (90.04) | (117.01) |
| | -5.33% | 7.02 | (19.94) | (46.91) | (73.88) | (100.85) | (127.82) | (154.79) |
| | -8.00% | (32.44) | (59.40) | (86.37) | (113.34) | (140.31) | (167.28) | (194.25) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|---------------|
| KR65123A0392 | 대신증권(ELS)3674 | 26.78 |
| KR6572385393 | 한국투자증권(ELS)3470 | 48.56 |
| KR6582382398 | 현대증권(ELS)2013-3080 | 48.58 |
| KR6652340391 | 한화스마트(ELS)2562 | 48.57 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 172.49 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 230.10

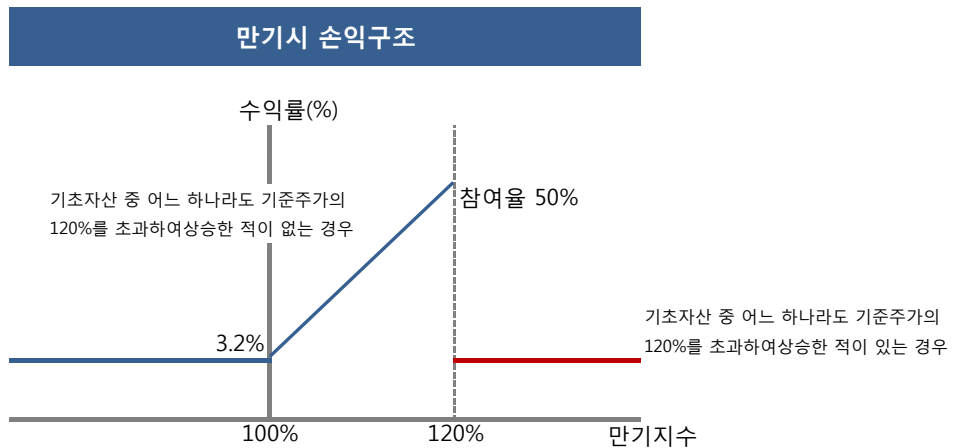
메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

1. 계약금액

| | | | | | | 단위(백만원) |
|----|------|------|-------|-------|-----------|---------|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 신규 | 유가증권 | ELS | 6,550 | 0 | 6,550 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,550 | 0 | 6,550 | 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 자산 시나 리오 | 8.00% | 0.05 | (0.05) | (0.16) | (0.27) | (0.37) | (0.48) | (0.58) |
| | 5.33% | 0.20 | 0.09 | (0.02) | (0.12) | (0.23) | (0.33) | (0.44) |
| | 2.67% | 0.29 | 0.18 | 0.07 | (0.03) | (0.14) | (0.24) | (0.35) |
| | 0.00% | 0.32 | 0.21 | 0.11 | 0.00 | (0.11) | (0.21) | (0.32) |
| | -2.67% | 0.30 | 0.19 | 0.08 | (0.02) | (0.13) | (0.24) | (0.34) |
| | -5.33% | 0.22 | 0.11 | 0.00 | (0.10) | (0.21) | (0.31) | (0.42) |
| | -8.00% | 0.08 | (0.02) | (0.13) | (0.24) | (0.34) | (0.45) | (0.55) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR65233DT410 | 대우증권(ELS)10589 | 0.15 |
| KR65533C9411 | 우리투자증권(ELS)8477 | 0.15 |
| KR65833AC419 | 현대증권(ELS)2014-3295 | 0.15 |
| KR6693362412 | NH농협증권(ELS)1293 | 0.15 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 0.58 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 1.40 |
|-----|------|

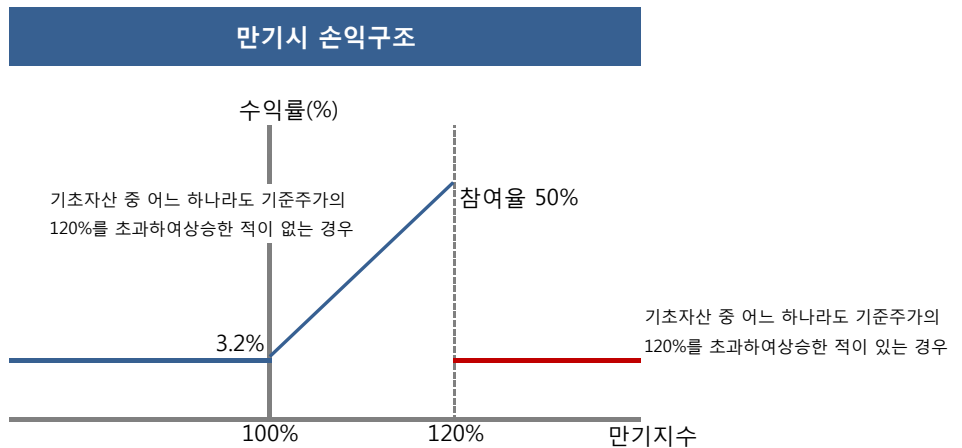
메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제28호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

1. 계약금액

| | | | | | | 단위(백만원) |
|----|------|------|--------|-------|-----------|---------|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
| 신규 | 유가증권 | ELS | 10,838 | 0 | 10,838 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,838 | 0 | 10,838 | 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 자산 시나 리오 | 8.00% | (1.15) | (1.28) | (1.41) | (1.54) | (1.67) | (1.81) | (1.94) |
| | 5.33% | (0.49) | (0.62) | (0.75) | (0.89) | (1.02) | (1.15) | (1.28) |
| | 2.67% | 0.02 | (0.11) | (0.24) | (0.37) | (0.50) | (0.64) | (0.77) |
| | 0.00% | 0.40 | 0.26 | 0.13 | 0.00 | (0.13) | (0.26) | (0.40) |
| | -2.67% | 0.63 | 0.49 | 0.36 | 0.23 | 0.10 | (0.03) | (0.17) |
| | -5.33% | 0.71 | 0.58 | 0.45 | 0.32 | 0.19 | 0.05 | (0.08) |
| | -8.00% | 0.66 | 0.53 | 0.39 | 0.26 | 0.13 | (0.00) | (0.13) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|--------------------|-------------|
| KR6523368423 | 대우증권(ELS)10777 | 0.49 |
| KR6553377427 | 우리투자증권(ELS)8498 | 0.49 |
| KR6583336427 | 현대증권(ELS)2014-3321 | 0.48 |
| KR6693322424 | NH농협증권(ELS)1298 | 0.48 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 1.94 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.86 |
|-----|------|

메리트 2스타주가연동증권 KH-2호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

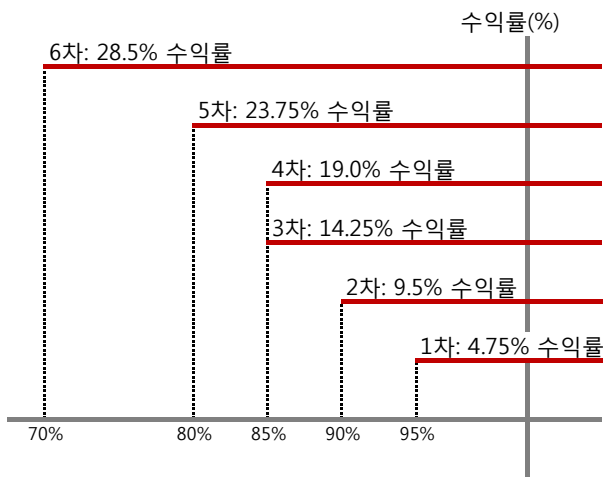
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 649 | 0 | 649 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 649 | 0 | 649 | 장외 |

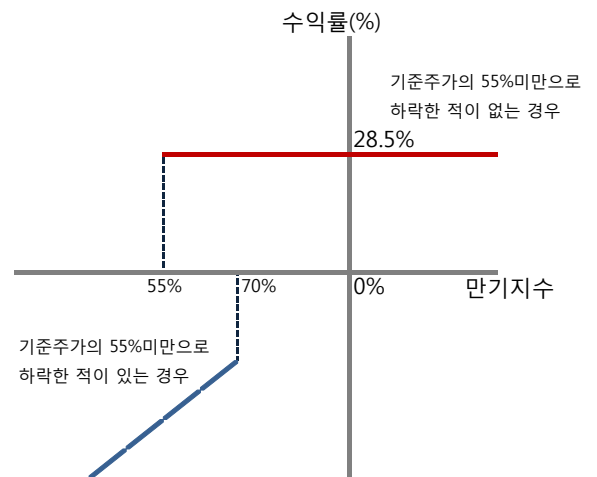
단위(백만원)

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% | 27.66 | 23.19 | 18.72 | 14.24 | 9.77 | 5.29 | 0.82 |
| | 5.33% | 23.56 | 19.09 | 14.61 | 10.14 | 5.66 | 1.19 | (3.29) |
| | 2.67% | 18.81 | 14.34 | 9.86 | 5.39 | 0.92 | (3.56) | (8.03) |
| | 0.00% | 13.42 | 8.95 | 4.47 | 0.00 | (4.47) | (8.95) | (13.42) |
| | -2.67% | 7.39 | 2.92 | (1.56) | (6.03) | (10.51) | (14.98) | (19.46) |
| | -5.33% | 0.71 | (3.76) | (8.24) | (12.71) | (17.18) | (21.66) | (26.13) |
| | -8.00% | (6.61) | (11.08) | (15.55) | (20.03) | (24.50) | (28.98) | (33.45) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|------------------|--------------|
| KR6542310430 | 신영증권플랜업(ELS)3990 | 8.36 |
| KR6552335434 | 우리투자증권(ELS)8653 | 8.32 |
| KR6572308437 | 한국투자증권(ELS)3834 | 8.34 |
| KR6772307437 | KB STAR(ELS)613 | 8.43 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 33.45 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 31.71

메리트 주가지수연계증권 HE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

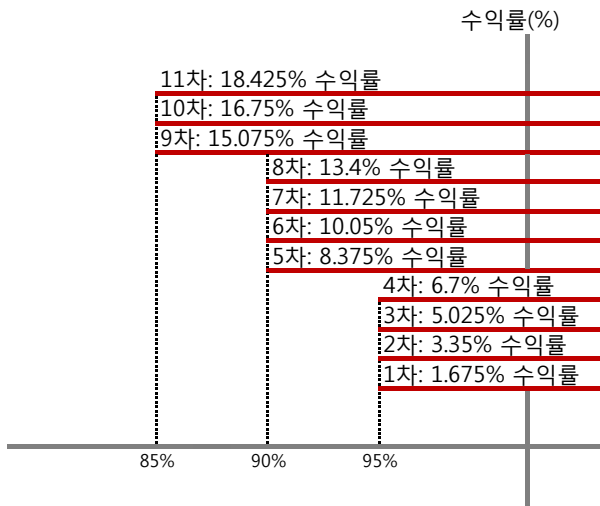
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 783 | 0 | 783 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 783 | 0 | 783 | 장외 |

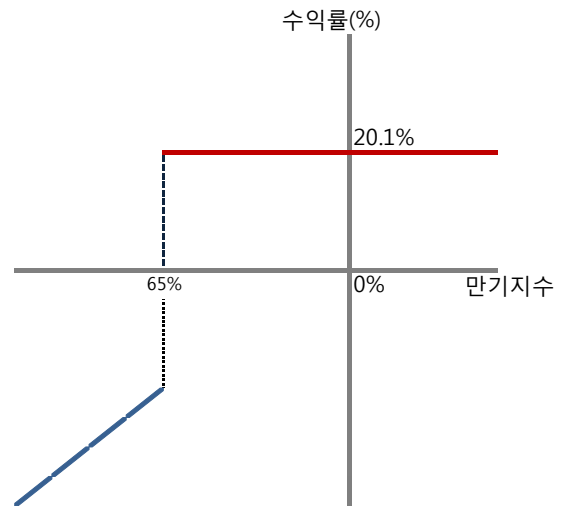
단위(백만원)

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 시나 리오 | 8.00% | 36.23 | 32.36 | 28.50 | 24.63 | 20.76 | 16.89 | 13.02 |
| | 5.33% | 29.50 | 25.64 | 21.77 | 17.90 | 14.03 | 10.16 | 6.29 |
| | 2.67% | 21.29 | 17.43 | 13.56 | 9.69 | 5.82 | 1.95 | (1.92) |
| | 0.00% | 11.60 | 7.74 | 3.87 | 0.00 | (3.87) | (7.74) | (11.60) |
| | -2.67% | 0.43 | (3.43) | (7.30) | (11.17) | (15.04) | (18.91) | (22.78) |
| | -5.33% | (12.22) | (16.08) | (19.95) | (23.82) | (27.69) | (31.56) | (35.43) |
| | -8.00% | (26.35) | (30.22) | (34.08) | (37.95) | (41.82) | (45.69) | (49.56) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6513317430 | 대신증권(ELS)4203 | 12.43 |
| KR6523335430 | 대우증권(ELS)10783 | 12.33 |
| KR6573302439 | 한국투자증권(ELS)3821 | 12.36 |
| KR6703309437 | H&D증권(ELS)4174 | 12.44 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 49.56 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 47.75

메리트 주가지수연계증권 KHE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-13

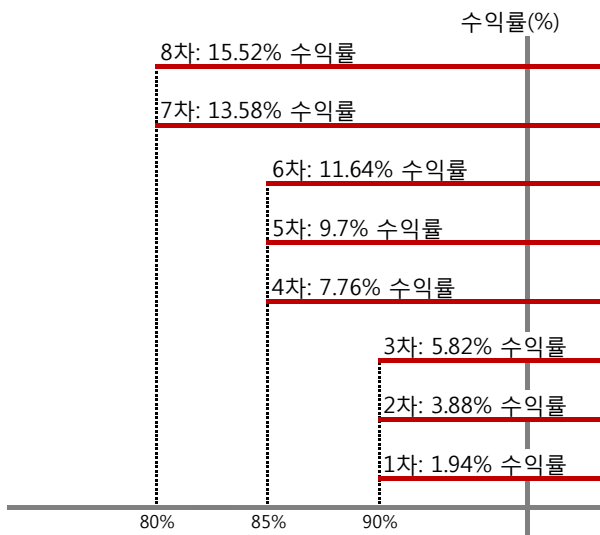
1. 계약금액

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 822 | 0 | 822 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 822 | 0 | 822 | 장외 |

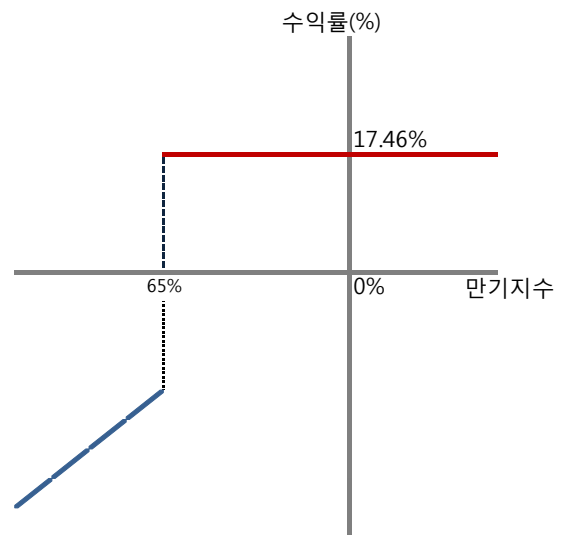
단위(백만원)

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% | 27.85 | 24.71 | 21.57 | 18.42 | 15.28 | 12.14 | 9.00 |
| 자산 | 5.33% | 23.68 | 20.54 | 17.40 | 14.26 | 11.12 | 7.98 | 4.84 |
| 시나 | 2.67% | 17.54 | 14.40 | 11.26 | 8.12 | 4.98 | 1.84 | (1.30) |
| 리오 | 0.00% | 9.42 | 6.28 | 3.14 | 0.00 | (3.14) | (6.28) | (9.42) |
| | -2.67% | (0.67) | (3.81) | (6.95) | (10.09) | (13.23) | (16.38) | (19.52) |
| | -5.33% | (12.74) | (15.88) | (19.02) | (22.16) | (25.30) | (28.45) | (31.59) |
| | -8.00% | (26.79) | (29.93) | (33.07) | (36.21) | (39.35) | (42.49) | (45.63) |

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

| | | |
|--------------------|-----------------|--------------|
| KR6513315434 | 대신증권(ELS)4200 | 11.43 |
| KR6573303437 | 한국투자증권(ELS)3822 | 11.37 |
| KR6593329438 | 미래에셋증권(ELS)5768 | 11.39 |
| KR6703310435 | 하나대투증권(ELS)4176 | 11.44 |
| 총 최대손실 예상금액 | | 45.63 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 44.26