

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

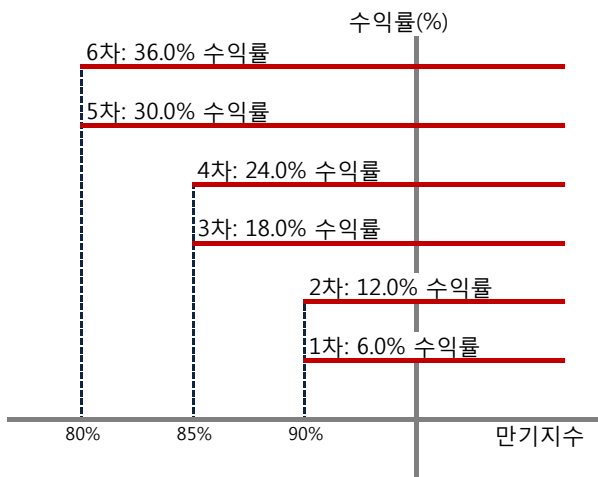
1. 계약금액

단위(백만원)

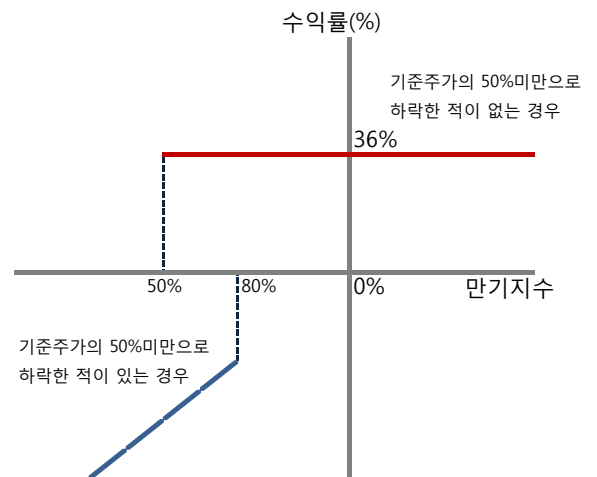
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,393	0	5,393	장외
누계	유가증권	ELS	5,393	0	5,393	장외

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%	538.00	503.43	468.86	434.29	399.73	365.16	330.59
	5.33%	426.22	391.65	357.08	322.51	287.94	253.38	218.81
	2.67%	281.45	246.88	212.32	177.75	143.18	108.61	74.04
	0.00%	103.70	69.14	34.57	0.00	(34.57)	(69.14)	(103.70)
	-2.67%	(107.03)	(141.59)	(176.16)	(210.73)	(245.30)	(279.87)	(314.43)
	-5.33%	(350.74)	(385.31)	(419.87)	(454.44)	(489.01)	(523.58)	(558.15)
	-8.00%	(627.43)	(662.00)	(696.57)	(731.14)	(765.71)	(800.27)	(834.84)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502348032	신한투자(ELS)1408	118.75
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	238.76
KR6661350035	동양(ELS)520	238.41
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	238.92
총 최대손실 예상금액		834.84

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 894.60

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

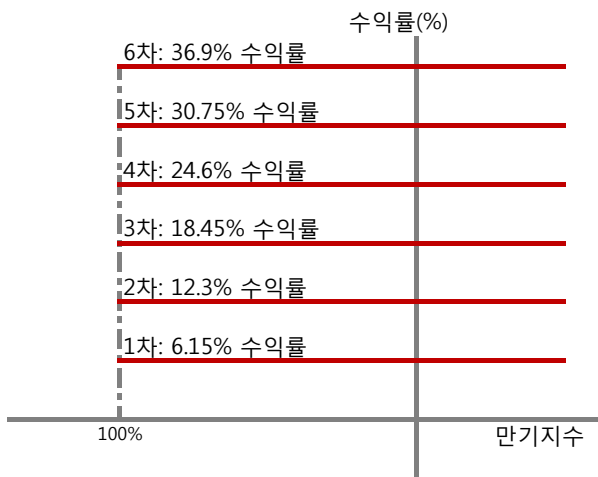
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,022	0	5,022	장외
누계	유가증권	ELS	5,022	0	5,022	장외

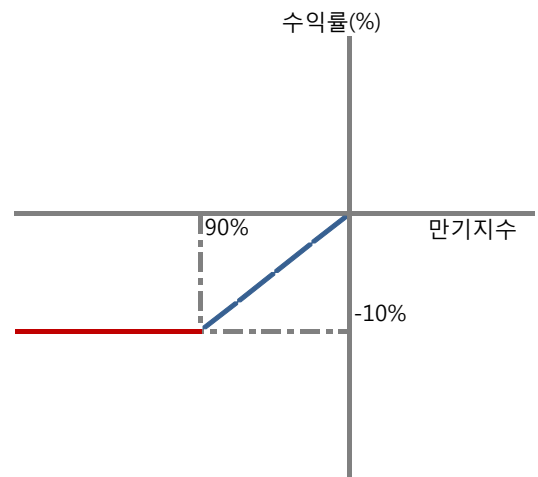
단위(백만원)

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%	225.44	216.20	206.97	197.74	188.51	179.27	170.04
	5.33%	154.27	145.04	135.81	126.57	117.34	108.11	98.88
	2.67%	88.36	79.13	69.89	60.66	51.43	42.20	32.96
	0.00%	27.70	18.46	9.23	0.00	(9.23)	(18.46)	(27.70)
	-2.67%	(27.71)	(36.94)	(46.18)	(55.41)	(64.64)	(73.87)	(83.11)
	-5.33%	(77.87)	(87.10)	(96.33)	(105.57)	(114.80)	(124.03)	(133.26)
	-8.00%	(122.78)	(132.01)	(141.24)	(150.47)	(159.71)	(168.94)	(178.17)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293160A1	대우증권ELS4537	45.01
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	42.89
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	45.11
KR66693120A9	동양W(ELS)927	45.16
총 최대손실 예상금액		178.17

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	168.73
-----	--------

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

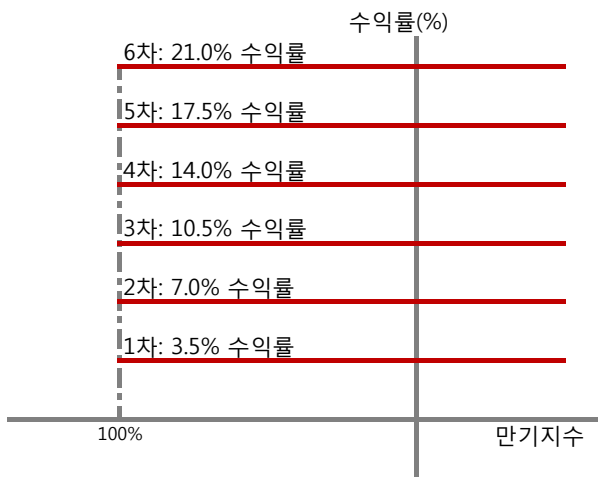
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,424	-100	3,524	장외
누계	유가증권	ELS	3,424	-100	3,524	장외

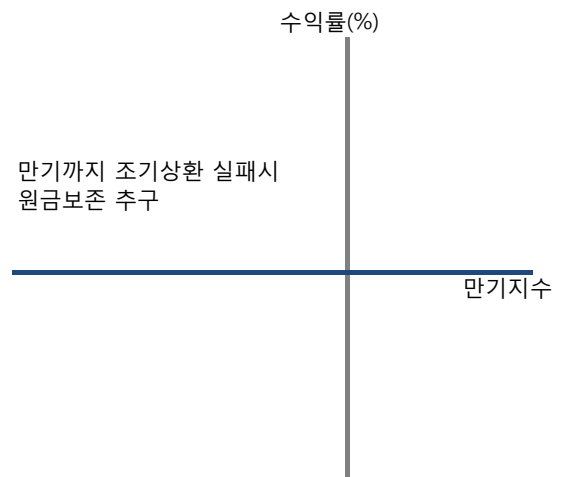
단위(백만원)

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%	81.15	77.70	74.26	70.82	67.38	63.93	60.49
	5.33%	55.61	52.16	48.72	45.28	41.84	38.39	34.95
	2.67%	32.00	28.56	25.11	21.67	18.23	14.79	11.34
	0.00%	10.33	6.89	3.44	0.00	(3.44)	(6.89)	(10.33)
	-2.67%	(9.41)	(12.85)	(16.30)	(19.74)	(23.18)	(26.62)	(30.07)
	-5.33%	(27.21)	(30.66)	(34.10)	(37.54)	(40.98)	(44.43)	(47.87)
	-8.00%	(43.08)	(46.53)	(49.97)	(53.41)	(56.85)	(60.30)	(63.74)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	16.28
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	16.41
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	16.38
KR66623360C2	동양W(ELS)950	14.66
총 최대손실 예상금액		63.74

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	65.84
-----	-------

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

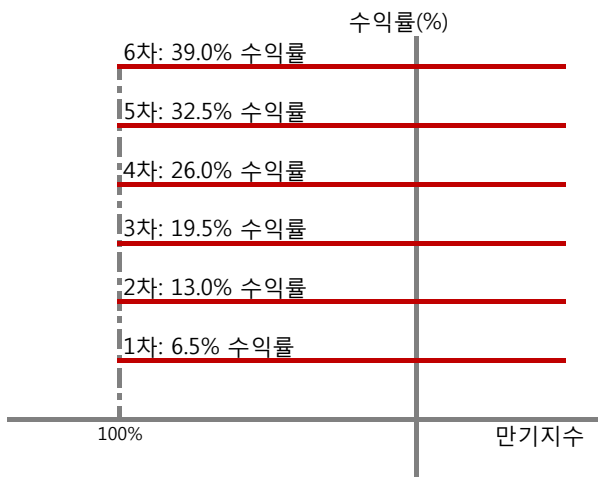
1. 계약금액

단위(백만원)

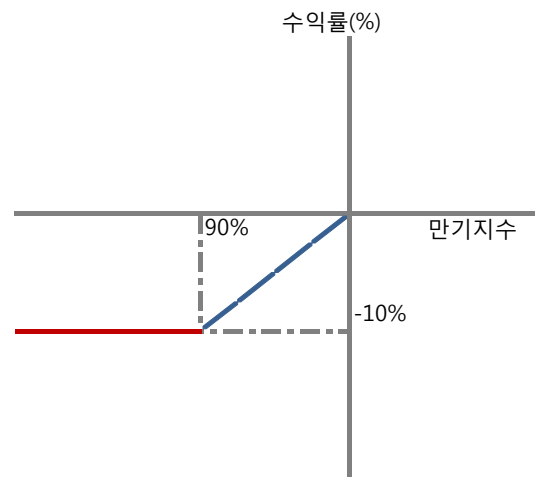
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,368	-86	3,455	장외
누계	유가증권	ELS	3,455	0	3,455	장외

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%	178.55	170.59	162.63	154.67	146.70	138.74	130.78
	5.33%	123.02	115.06	107.09	99.13	91.17	83.21	75.25
	2.67%	71.46	63.50	55.54	47.58	39.61	31.65	23.69
	0.00%	23.89	15.92	7.96	0.00	(7.96)	(15.92)	(23.89)
	-2.67%	(19.71)	(27.67)	(35.64)	(43.60)	(51.56)	(59.52)	(67.48)
	-5.33%	(59.33)	(67.29)	(75.25)	(83.22)	(91.18)	(99.14)	(107.10)
	-8.00%	(94.97)	(102.93)	(110.89)	(118.86)	(126.82)	(134.78)	(142.74)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	36.50
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	36.65
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	36.55
KR66623340C4	동양W(ELS)949	33.04
총 최대손실 예상금액		142.74

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 146.64

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

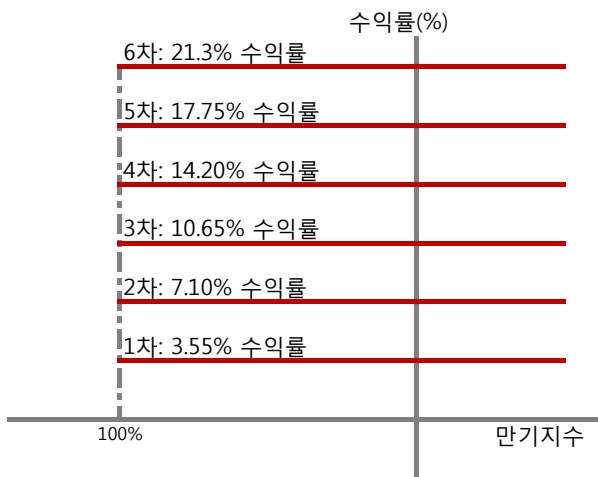
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,092	-120	1,212	장외
누계	유가증권	ELS	1,212	0	1,212	장외

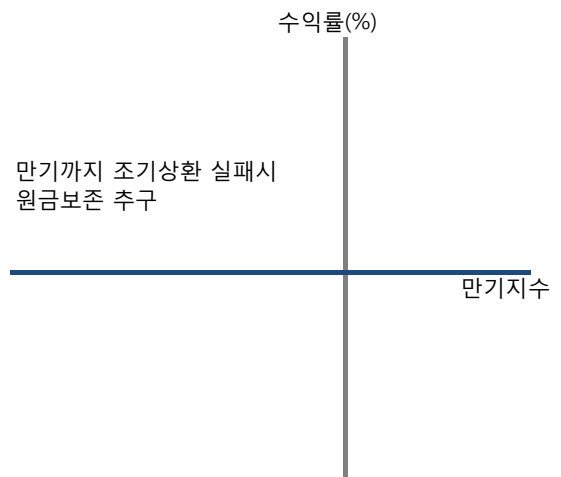
단위(백만원)

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%	2.03	1.87	1.71	1.54	1.38	1.22	1.06
	5.33%	1.48	1.31	1.15	0.99	0.83	0.67	0.50
	2.67%	0.96	0.80	0.64	0.48	0.31	0.15	(0.01)
	0.00%	0.49	0.32	0.16	0.00	(0.16)	(0.32)	(0.49)
	-2.67%	0.05	(0.11)	(0.27)	(0.44)	(0.60)	(0.76)	(0.92)
	-5.33%	(0.35)	(0.51)	(0.67)	(0.83)	(0.99)	(1.16)	(1.32)
	-8.00%	(0.70)	(0.86)	(1.03)	(1.19)	(1.35)	(1.51)	(1.68)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.46
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.46
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.28
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.47
총 최대손실 예상금액		1.68

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.27
-----	------

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

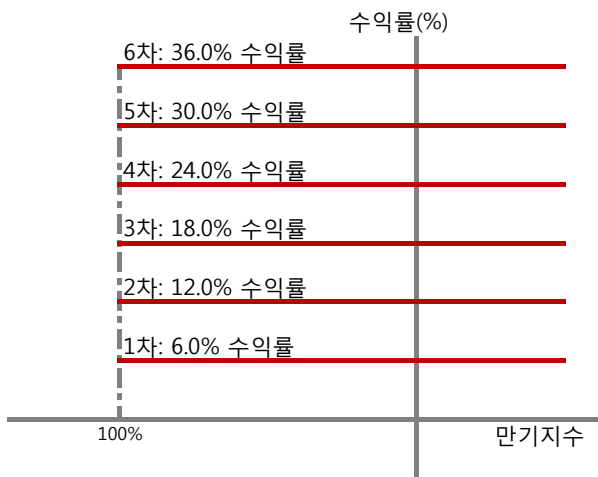
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	741	0	741	장외
누계	유가증권	ELS	741	0	741	장외

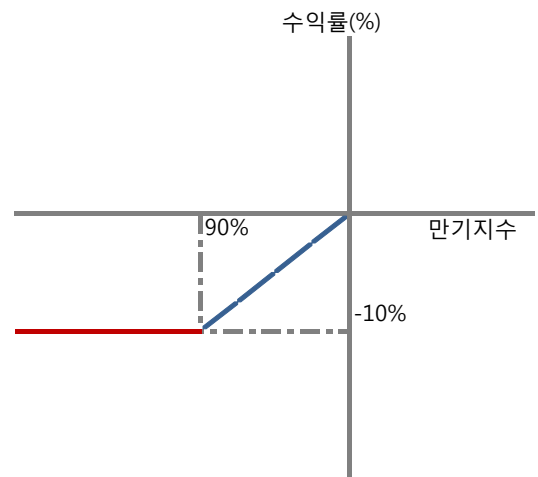
단위(백만원)

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%	16.26	14.79	13.32	11.85	10.38	8.91	7.45
	5.33%	12.12	10.65	9.18	7.71	6.24	4.77	3.30
	2.67%	8.17	6.70	5.23	3.76	2.29	0.82	(0.65)
	0.00%	4.41	2.94	1.47	0.00	(1.47)	(2.94)	(4.41)
	-2.67%	0.84	(0.63)	(2.10)	(3.57)	(5.04)	(6.51)	(7.98)
	-5.33%	(2.54)	(4.01)	(5.48)	(6.95)	(8.42)	(9.88)	(11.35)
	-8.00%	(5.73)	(7.20)	(8.67)	(10.13)	(11.60)	(13.07)	(14.54)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	3.79
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	3.17
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	3.79
KR6662317124	동양W(ELS)975	3.80
총 최대손실 예상금액		14.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	12.99
-----	-------

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

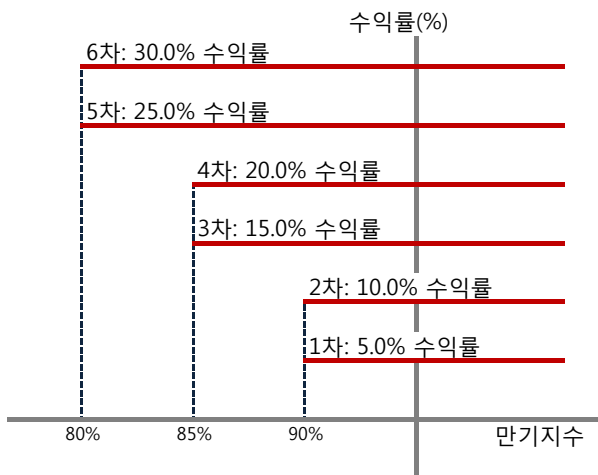
1. 계약금액

단위(백만원)

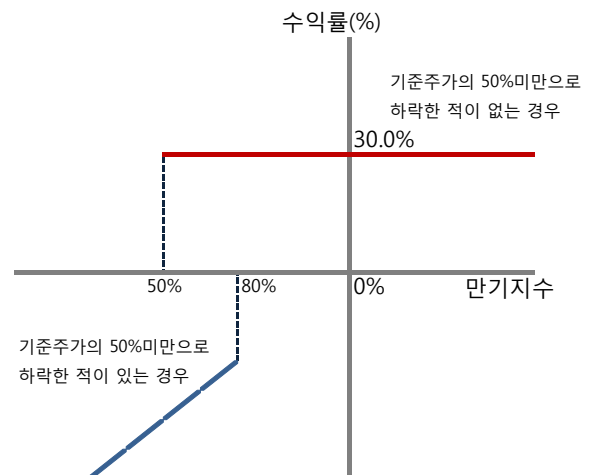
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,597	0	8,597	장외
누계	유가증권	ELS	8,597	0	8,597	장외

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%	336.05	300.82	265.60	230.37	195.15	159.92	124.70
	5.33%	286.18	250.96	215.73	180.51	145.28	110.06	74.83
	2.67%	209.39	174.17	138.94	103.72	68.49	33.27	(1.96)
	0.00%	105.68	70.45	35.23	0.00	(35.23)	(70.45)	(105.68)
	-2.67%	(24.96)	(60.19)	(95.42)	(130.64)	(165.87)	(201.09)	(236.32)
	-5.33%	(182.53)	(217.76)	(252.98)	(288.21)	(323.43)	(358.66)	(393.88)
	-8.00%	(367.02)	(402.24)	(437.47)	(472.70)	(507.92)	(543.15)	(578.37)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	152.97
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	154.03
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	151.46
KR6662374141	동양W(ELS)1004	119.91
총 최대손실 예상금액		578.37

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 705.29

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

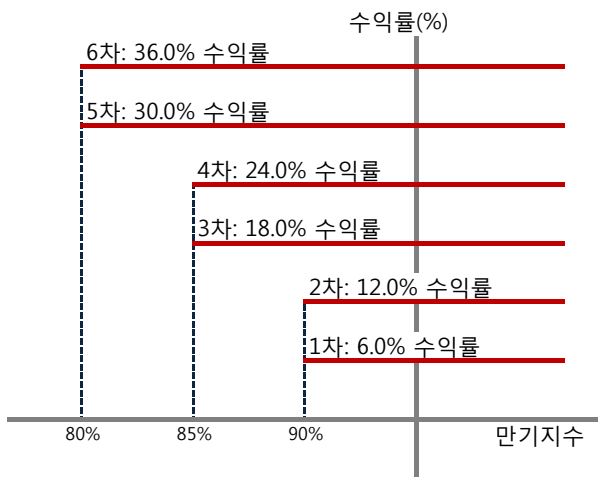
1. 계약금액

단위(백만원)

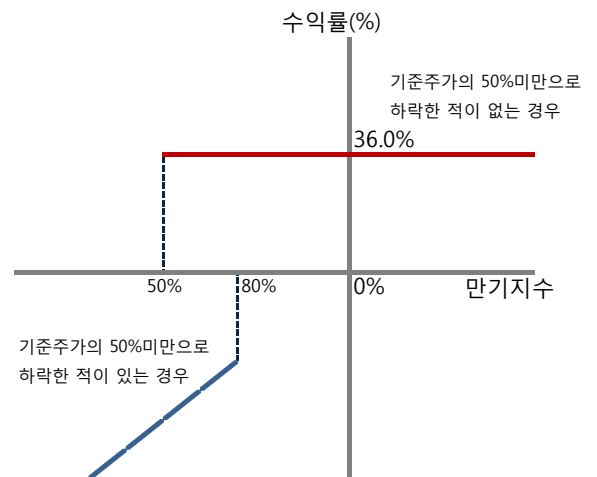
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	20,001	0	20,001	장외
누계	유가증권	ELS	20,001	0	20,001	장외

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%	(36.00)	(35.58)	(35.17)	(34.76)	(34.34)	(33.93)	(33.51)
	5.33%	(24.11)	(23.69)	(23.28)	(22.86)	(22.45)	(22.04)	(21.62)
	2.67%	(12.52)	(12.11)	(11.69)	(11.28)	(10.86)	(10.45)	(10.04)
	0.00%	(1.24)	(0.83)	(0.41)	0.00	0.41	0.83	1.24
	-2.67%	9.73	10.14	10.56	10.97	11.39	11.80	12.21
	-5.33%	20.39	20.81	21.22	21.64	22.05	22.47	22.88
	-8.00%	30.75	31.17	31.58	32.00	32.41	32.82	33.24

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553331150	우리투자증권(ELS)4448	10.20
KR6573333152	한국투자증권(ELS)2106	9.17
KR6663329151	동양W(ELS)1018	7.72
KR6673309151	해피플러스(ELS)529	8.91
총 최대손실 예상금액		36.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 37.25

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

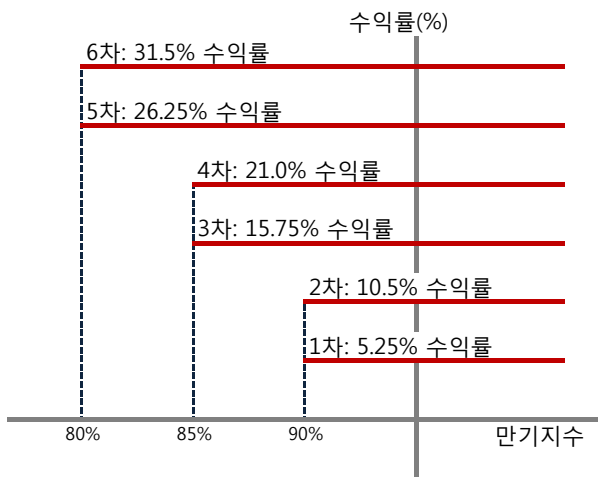
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,938	0	4,938	장외
누계	유가증권	ELS	4,938	0	4,938	장외

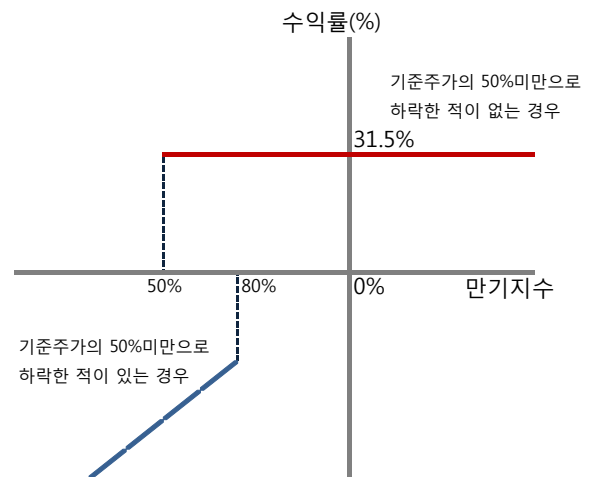
단위(백만원)

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%	249.10	216.65	184.21	151.77	119.33	86.89	54.45
	5.33%	209.67	177.23	144.78	112.34	79.90	47.46	15.02
	2.67%	159.08	126.63	94.19	61.75	29.31	(3.13)	(35.57)
	0.00%	97.32	64.88	32.44	0.00	(32.44)	(64.88)	(97.32)
	-2.67%	24.41	(8.03)	(40.47)	(72.91)	(105.36)	(137.80)	(170.24)
	-5.33%	(59.67)	(92.11)	(124.55)	(156.99)	(189.43)	(221.87)	(254.31)
	-8.00%	(154.91)	(187.35)	(219.79)	(252.23)	(284.67)	(317.11)	(349.55)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	87.22
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	87.45
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	87.54
KR6663346155	동양W(ELS)1009	87.35
총 최대손실 예상금액		349.55

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	346.11
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

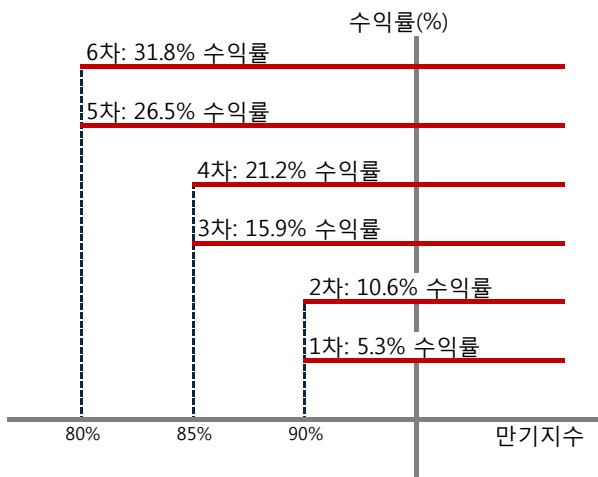
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	7,070	0	7,070	장외
누계	유가증권	ELS	7,070	0	7,070	장외

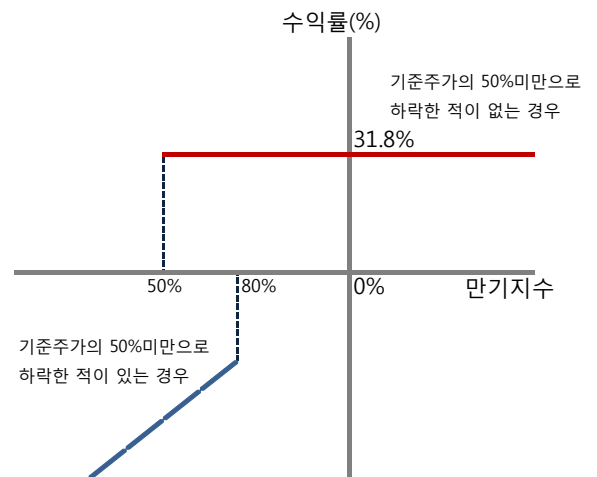
단위(백만원)

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%	458.63	409.93	361.23	312.53	263.84	215.14	166.44
	5.33%	364.11	315.41	266.71	218.01	169.31	120.62	71.92
	2.67%	259.93	211.23	162.53	113.83	65.14	16.44	(32.26)
	0.00%	146.09	97.40	48.70	0.00	(48.70)	(97.40)	(146.09)
	-2.67%	22.60	(26.10)	(74.79)	(123.49)	(172.19)	(220.89)	(269.59)
	-5.33%	(110.55)	(159.24)	(207.94)	(256.64)	(305.34)	(354.04)	(402.73)
	-8.00%	(253.35)	(302.05)	(350.75)	(399.44)	(448.14)	(496.84)	(545.54)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	129.43
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	138.21
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	139.92
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	137.97
총 최대손실 예상금액		545.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	491.63
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

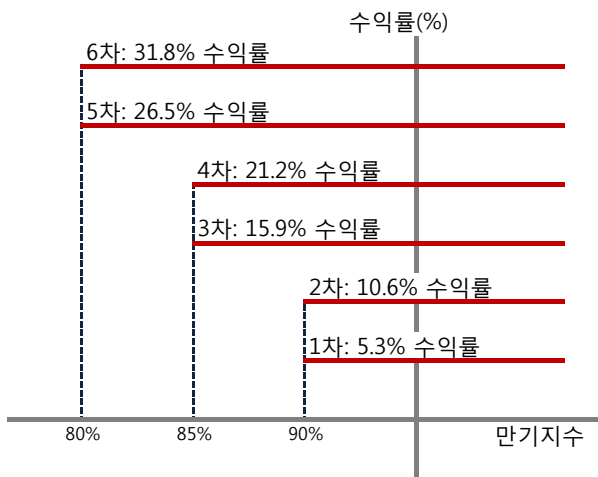
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,480	0	5,480	장외
누계	유가증권	ELS	5,480	0	5,480	장외

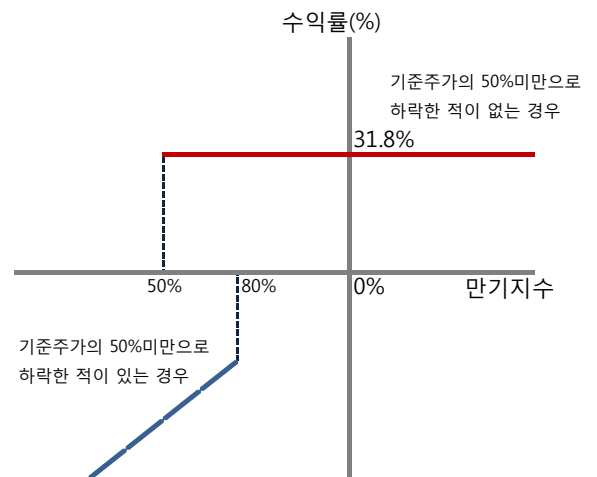
단위(백만원)

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%	338.78	302.39	266.01	229.62	193.23	156.85	120.46
	5.33%	270.45	234.06	197.67	161.29	124.90	88.51	52.13
	2.67%	193.91	157.52	121.13	84.75	48.36	11.97	(24.41)
	0.00%	109.16	72.77	36.39	0.00	(36.39)	(72.77)	(109.16)
	-2.67%	16.21	(20.18)	(56.57)	(92.95)	(129.34)	(165.73)	(202.11)
	-5.33%	(84.95)	(121.34)	(157.73)	(194.11)	(230.50)	(266.89)	(303.28)
	-8.00%	(194.32)	(230.71)	(267.10)	(303.48)	(339.87)	(376.26)	(412.64)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	103.32
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	99.94
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	104.01
KR6663324160	동양W(ELS)1028	105.36
총 최대손실 예상금액		412.64

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	400.61
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제21호[ELS-파생형]

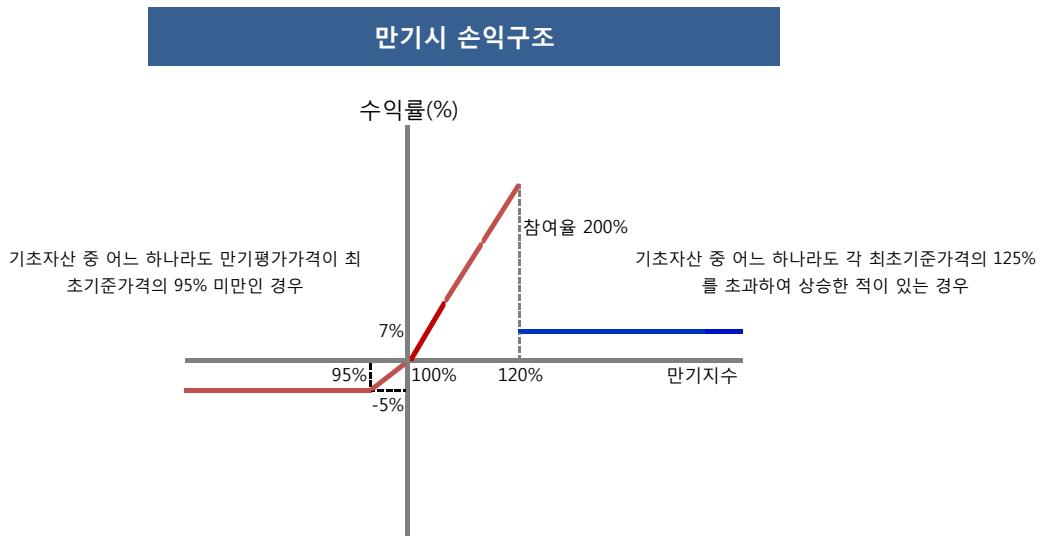
공시일: 2012-05-09

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	771	0	771	장외
누계	유가증권	ELS	771	0	771	장외

단위(백만원)

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%	16.22	16.14	16.06	15.99	15.91	15.83	15.75
	5.33%	10.05	9.97	9.89	9.81	9.73	9.66	9.58
	2.67%	4.72	4.64	4.56	4.48	4.40	4.33	4.25
	0.00%	0.23	0.16	0.08	0.00	(0.08)	(0.16)	(0.23)
	-2.67%	(3.40)	(3.48)	(3.56)	(3.64)	(3.71)	(3.79)	(3.87)
	-5.33%	(6.19)	(6.27)	(6.35)	(6.43)	(6.51)	(6.58)	(6.66)
	-8.00%	(8.14)	(8.22)	(8.29)	(8.37)	(8.45)	(8.53)	(8.61)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65033B3162	신한투자(ELS)2918	2.14
KR65233AN161	대우증권ELS5772	2.16
KR6663386169	동양W(ELS)1037	2.16
KR6773318169	KB STAR(ELS)29	2.16
총 최대손실 예상금액		8.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.77
-----	------

메리츠한증지수연계증권제23호[ELS-파생형]

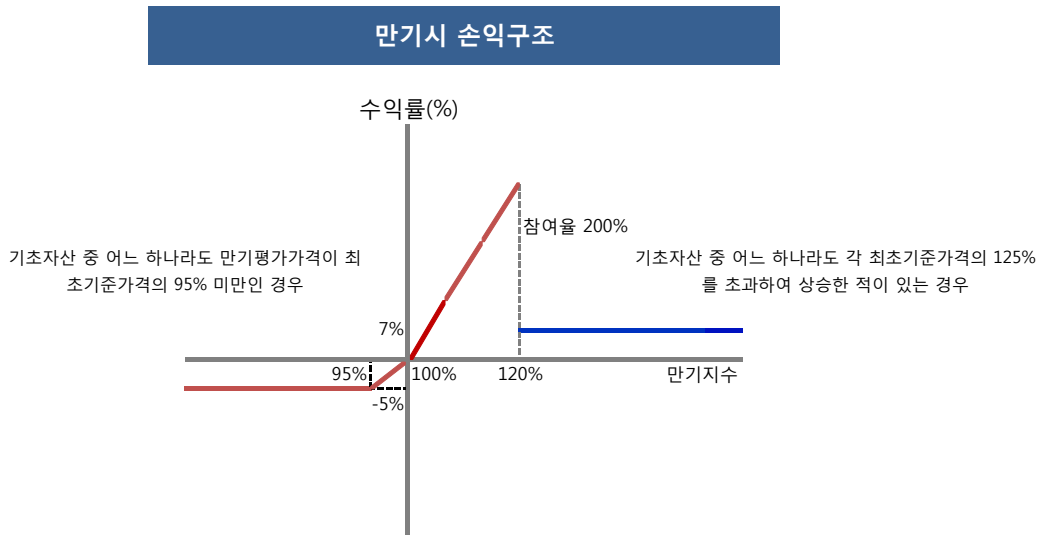
공시일: 2012-05-09

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,594	0	1,594	장외
누계	유가증권	ELS	1,594	0	1,594	장외

단위(백만원)

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%	23.84	23.73	23.63	23.52	23.41	23.31	23.20
	5.33%	14.69	14.58	14.48	14.37	14.26	14.16	14.05
	2.67%	6.85	6.74	6.64	6.53	6.42	6.32	6.21
	0.00%	0.32	0.21	0.11	0.00	(0.11)	(0.21)	(0.32)
	-2.67%	(4.90)	(5.01)	(5.11)	(5.22)	(5.33)	(5.43)	(5.54)
	-5.33%	(8.81)	(8.92)	(9.02)	(9.13)	(9.23)	(9.34)	(9.45)
	-8.00%	(11.41)	(11.51)	(11.62)	(11.73)	(11.83)	(11.94)	(12.05)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233BE168	대우증권ELS5786	2.98
KR66633A1169	동양W(ELS)1038	3.02
KR67033A0165	H&D증권(ELS)1809	3.02
KR6773321163	KB STAR(ELS)30	3.02
총 최대손실 예상금액		12.05

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.41
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

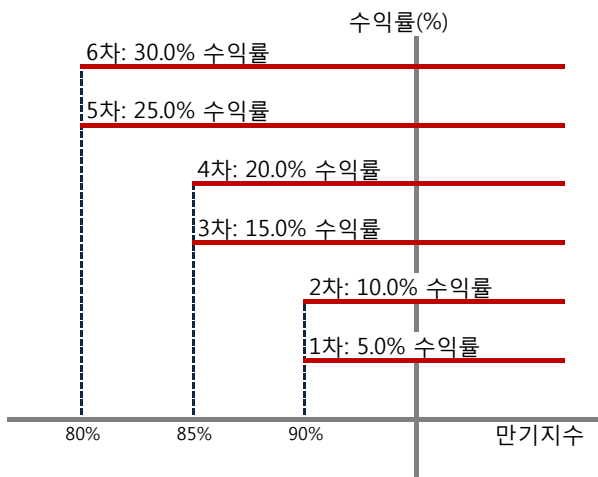
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,910	0	5,910	장외
누계	유가증권	ELS	5,910	0	5,910	장외

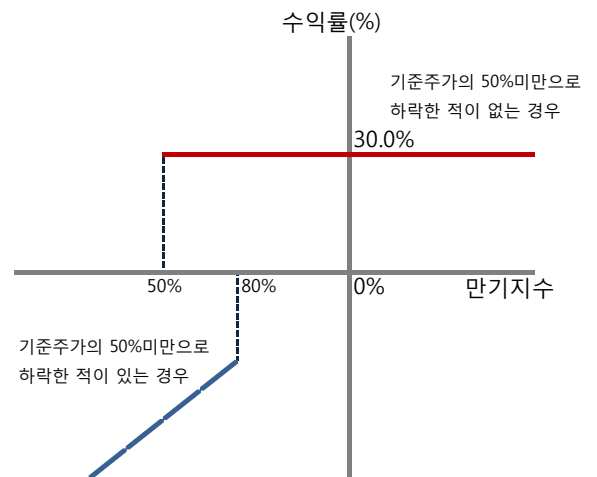
단위(백만원)

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%	338.79	297.31	255.83	214.35	172.87	131.39	89.91
	5.33%	279.93	238.45	196.97	155.49	114.01	72.53	31.05
	2.67%	208.48	167.00	125.52	84.04	42.56	1.08	(40.40)
	0.00%	124.44	82.96	41.48	0.00	(41.48)	(82.96)	(124.44)
	-2.67%	27.81	(13.67)	(55.15)	(96.63)	(138.11)	(179.59)	(221.07)
	-5.33%	(81.41)	(122.89)	(164.37)	(205.85)	(247.33)	(288.81)	(330.29)
	-8.00%	(203.23)	(244.71)	(286.19)	(327.67)	(369.15)	(410.63)	(452.11)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503322176	신한투자(ELS)2982	112.90
KR6543311171	신영증권(ELS)2189	112.86
KR6553334170	우리투자증권(ELS)4750	111.76
KR6663322172	동양W(ELS)1040	114.59
총 최대손실 예상금액		452.11

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	471.16
-----	--------

메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제23호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-09

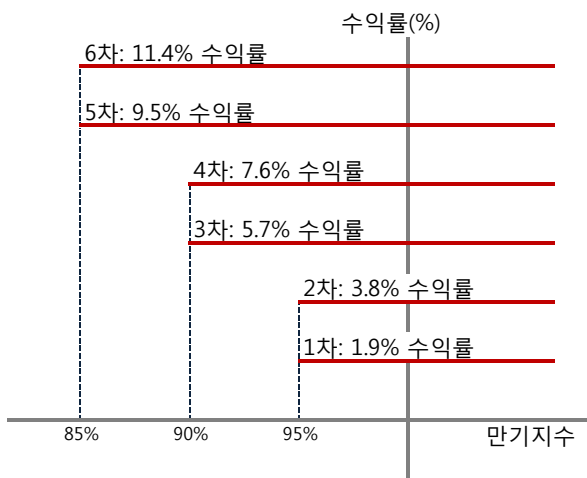
1. 계약금액

단위(백만원)

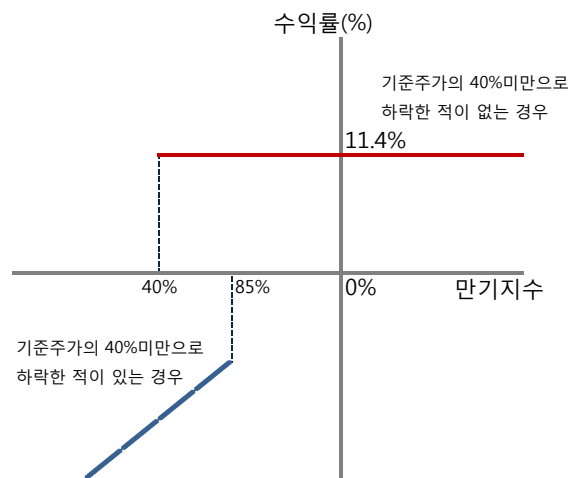
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	29,978	0	29,978	장외
누계	유가증권	ELS	29,978	0	29,978	장외

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	337.07	337.08	337.09	337.09	337.10	337.11	337.12	
자산	149.73	149.74	149.75	149.76	149.77	149.78	149.79	
시나	37.37	37.38	37.39	37.39	37.40	37.41	37.42	
리오	0.00%	(0.03)	(0.02)	(0.01)	0.00	0.01	0.02	
	-2.67%	37.55	37.56	37.57	37.58	37.58	37.59	
	-5.33%	150.09	150.10	150.11	150.12	150.13	150.14	
	-8.00%	337.61	337.62	337.63	337.64	337.64	337.65	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6543334223	신영증권(ELS)2512	0.01
KR6503386221	신한투자(ELS)3890	0.01
KR6553395221	우리투자증권(ELS)5573	0.01
KR65233AJ227	대우증권(ELS)6754	0.01
총 최대손실 예상금액		0.03

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 11.60