

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

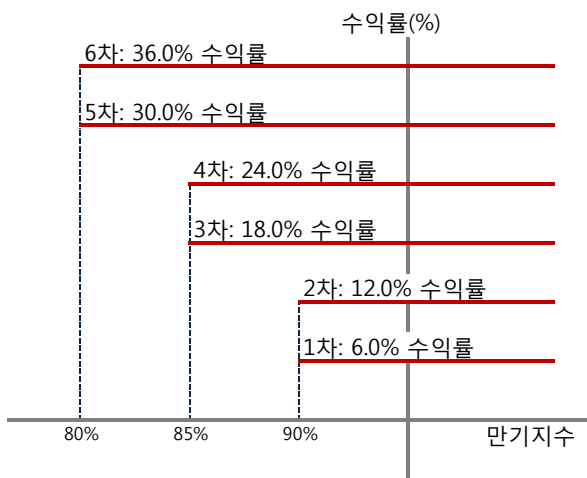
1. 계약금액

단위(백만원)

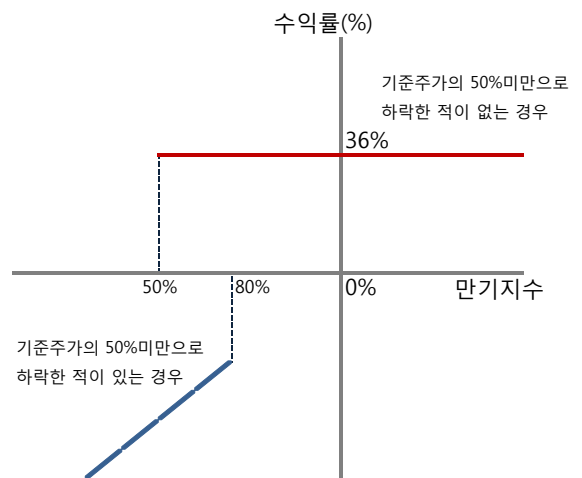
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,393	0	5,393	장외
누계	유가증권	ELS	5,393	0	5,393	장외

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	617.83	582.80	547.77	512.73	477.70	442.66	407.63	
자산	480.33	445.30	410.26	375.23	340.19	305.16	270.12	
시나	309.42	274.39	239.35	204.32	169.28	134.25	99.21	
리오	105.10	70.07	35.03	0.00	(35.03)	(70.07)	(105.10)	
	(132.62)	(167.66)	(202.69)	(237.72)	(272.76)	(307.79)	(342.83)	
	(403.75)	(438.78)	(473.82)	(508.85)	(543.89)	(578.92)	(613.96)	
	(708.29)	(743.32)	(778.35)	(813.39)	(848.42)	(883.46)	(918.49)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	130.65
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	262.67
KR6661350035	동양(ELS)520	262.30
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	262.86
총 최대손실 예상금액		918.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	976.75
-----	--------

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

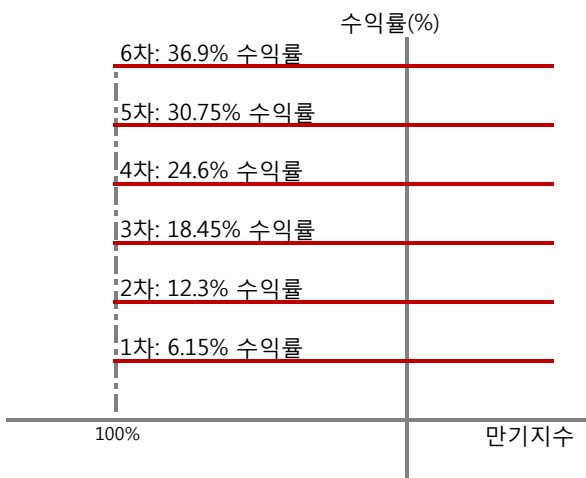
1. 계약금액

단위(백만원)

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

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	157.55	150.71	143.87	137.04	130.20	123.36	116.53	
자산	108.16	101.32	94.49	87.65	80.81	73.98	67.14	
시나	62.48	55.65	48.81	41.97	35.14	28.30	21.46	
리오	20.51	13.67	6.84	0.00	(6.84)	(13.67)	(20.51)	
	(17.76)	(24.59)	(31.43)	(38.27)	(45.10)	(51.94)	(58.78)	
	(52.32)	(59.15)	(65.99)	(72.83)	(79.66)	(86.50)	(93.34)	
	(83.17)	(90.01)	(96.84)	(103.68)	(110.52)	(117.35)	(124.19)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293160A1	대우증권ELS4537	31.41
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	29.93
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	31.42
KR66693120A9	동양W(ELS)927	31.43
총 최대손실 예상금액		124.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 152.24

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

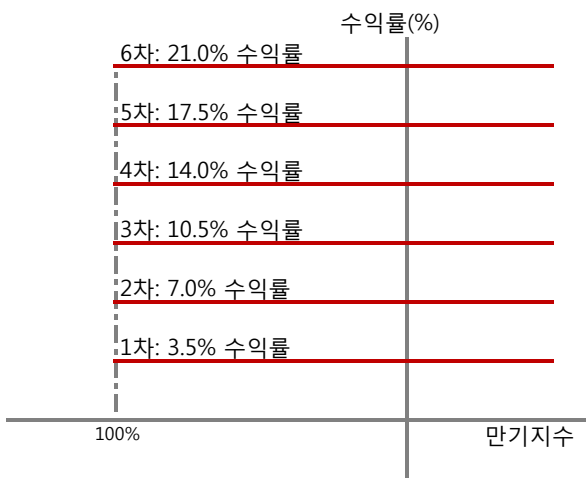
1. 계약금액

단위(백만원)

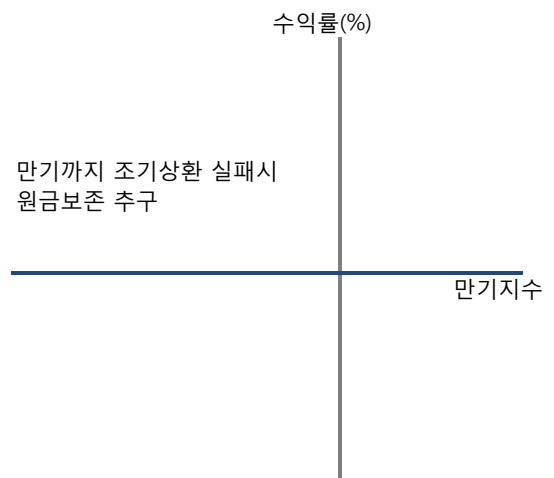
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,424	-100	3,524	장외
누계	유가증권	ELS	3,424	-100	3,524	장외

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%	56.10	53.50	50.91	48.31	45.71	43.11	40.51
	5.33%	38.62	36.02	33.42	30.82	28.22	25.62	23.02
	2.67%	22.51	19.92	17.32	14.72	12.12	9.52	6.92
	0.00%	7.80	5.20	2.60	0.00	(2.60)	(5.20)	(7.80)
	-2.67%	(5.54)	(8.14)	(10.73)	(13.33)	(15.93)	(18.53)	(21.13)
	-5.33%	(17.49)	(20.09)	(22.68)	(25.28)	(27.88)	(30.48)	(33.08)
	-8.00%	(28.05)	(30.65)	(33.25)	(35.85)	(38.45)	(41.04)	(43.64)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	11.17
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	11.24
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	11.22
KR66623360C2	동양W(ELS)950	10.01
총 최대손실 예상금액		43.64

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 42.94

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

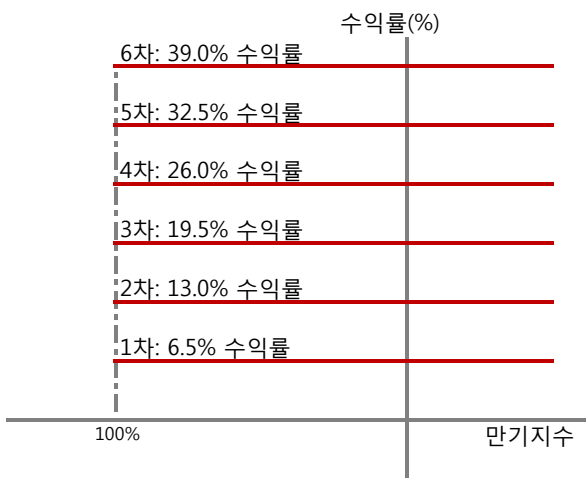
1. 계약금액

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	126.17	120.12	114.06	108.01	101.96	95.91	89.85	
자산	87.19	81.13	75.08	69.03	62.97	56.92	50.87	
시나리오	51.18	45.13	39.08	33.02	26.97	20.92	14.87	
	18.16	12.11	6.05	0.00	(6.05)	(12.11)	(18.16)	
	(11.89)	(17.94)	(23.99)	(30.04)	(36.10)	(42.15)	(48.20)	
	(38.95)	(45.00)	(51.06)	(57.11)	(63.16)	(69.21)	(75.27)	
	(63.04)	(69.09)	(75.14)	(81.19)	(87.25)	(93.30)	(99.35)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	25.46
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	25.48
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	25.47
KR66623340C4	동양W(ELS)949	22.94
총 최대손실 예상금액		99.35

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 98.05

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

1. 계약금액

단위(백만원)

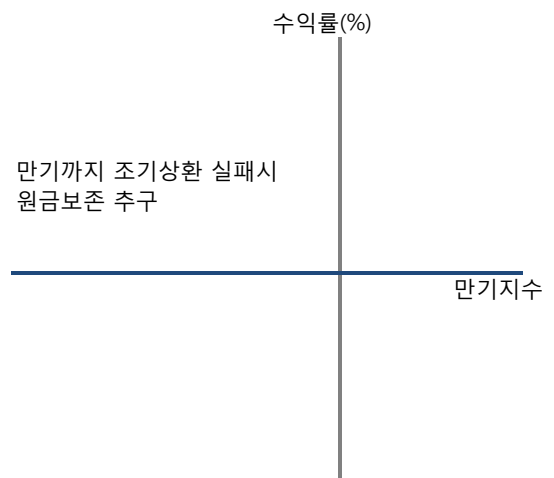
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,092	-120	1,212	장외
누계	유가증권	ELS	1,212	0	1,212	장외

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	1.35	1.21	1.08	0.94	0.81	0.67	0.53	
자산	1.03	0.89	0.75	0.62	0.48	0.35	0.21	
시나리오	0.71	0.58	0.44	0.31	0.17	0.04	(0.10)	
	0.41	0.27	0.14	0.00	(0.14)	(0.27)	(0.41)	
	0.11	(0.03)	(0.16)	(0.30)	(0.43)	(0.57)	(0.70)	
	(0.18)	(0.32)	(0.46)	(0.59)	(0.73)	(0.86)	(1.00)	
	(0.47)	(0.60)	(0.74)	(0.87)	(1.01)	(1.14)	(1.28)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.35
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.36
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.21
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.36
총 최대손실 예상금액		1.28

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.95

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

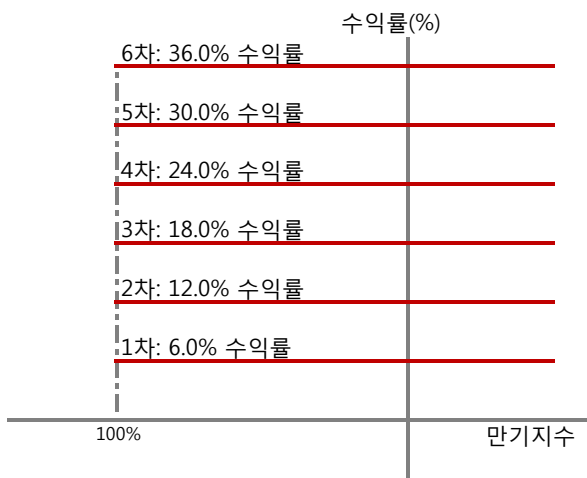
1. 계약금액

단위(백만원)

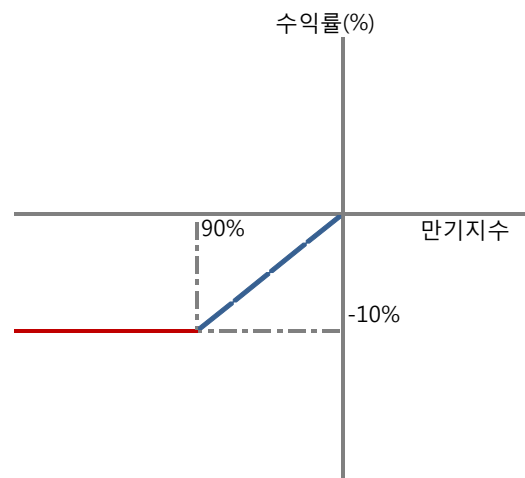
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	741	0	741	장외
누계	유가증권	ELS	741	0	741	장외

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	12.34	11.20	10.06	8.92	7.78	6.64	5.50	
자산	9.23	8.09	6.95	5.81	4.67	3.53	2.39	
시나리오	6.26	5.12	3.98	2.84	1.69	0.55	(0.59)	
	3.42	2.28	1.14	0.00	(1.14)	(2.28)	(3.42)	
	0.72	(0.42)	(1.56)	(2.70)	(3.84)	(4.98)	(6.12)	
	(1.84)	(2.98)	(4.12)	(5.26)	(6.40)	(7.54)	(8.68)	
	(4.26)	(5.40)	(6.54)	(7.68)	(8.82)	(9.96)	(11.10)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	2.89
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	2.43
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	2.89
KR6662317124	동양W(ELS)975	2.89
총 최대손실 예상금액		11.10

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 16.54

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

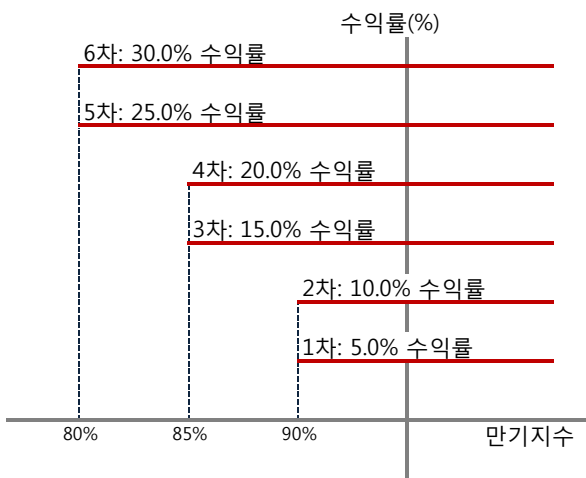
1. 계약금액

단위(백만원)

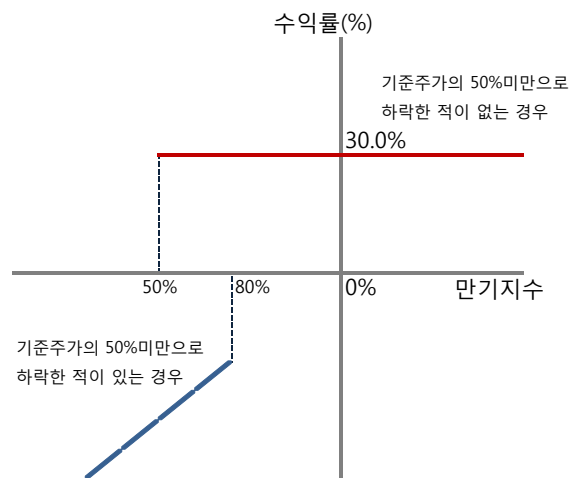
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,597	0	8,597	장외
누계	유가증권	ELS	8,597	0	8,597	장외

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	514.79	468.33	421.87	375.40	328.94	282.47	236.01	
자산	414.49	368.03	321.56	275.10	228.63	182.17	135.71	
시나	289.36	242.89	196.43	149.96	103.50	57.04	10.57	
리오	139.39	92.93	46.46	0.00	(46.46)	(92.93)	(139.39)	
	(35.40)	(81.87)	(128.33)	(174.79)	(221.26)	(267.72)	(314.19)	
	(235.03)	(281.49)	(327.95)	(374.42)	(420.88)	(467.35)	(513.81)	
	(459.48)	(505.94)	(552.41)	(598.87)	(645.34)	(691.80)	(738.26)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	196.54
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	197.03
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	193.82
KR6662374141	동양W(ELS)1004	150.87
총 최대손실 예상금액		738.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	732.85
-----	--------

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

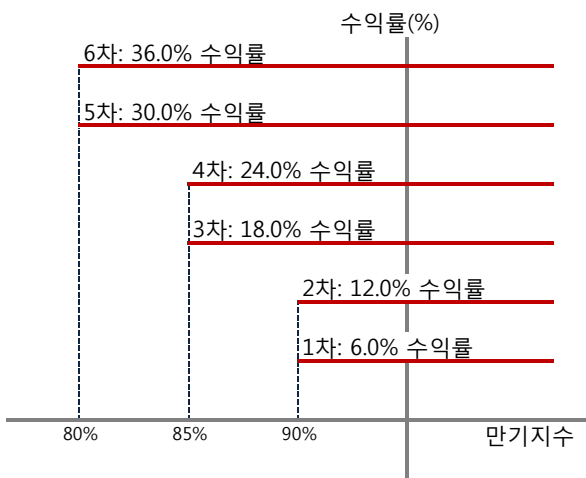
1. 계약금액

단위(백만원)

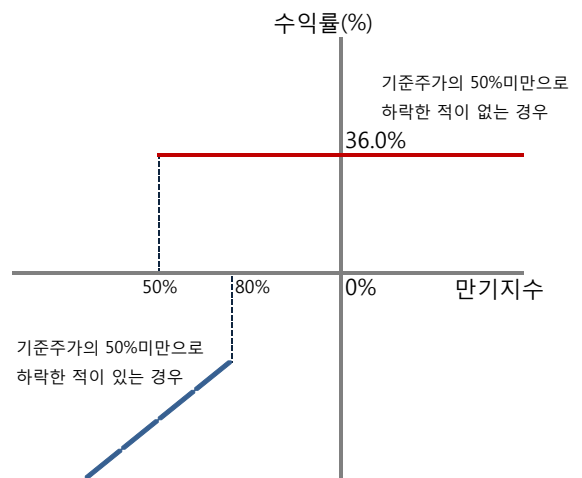
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	20,001	0	20,001	장외
누계	유가증권	ELS	20,001	0	20,001	장외

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	8.00%	(35.88)	(37.02)	(38.16)	(39.31)	(40.45)	(41.60)	(42.74)
자산	5.33%	(16.21)	(17.35)	(18.49)	(19.64)	(20.78)	(21.93)	(23.07)
시나	2.67%	(3.10)	(4.25)	(5.39)	(6.54)	(7.68)	(8.82)	(9.97)
리오	0.00%	3.43	2.29	1.14	0.00	(1.14)	(2.29)	(3.43)
	-2.67%	3.40	2.26	1.11	(0.03)	(1.17)	(2.32)	(3.46)
	-5.33%	(3.19)	(4.34)	(5.48)	(6.63)	(7.77)	(8.92)	(10.06)
	-8.00%	(16.36)	(17.50)	(18.65)	(19.79)	(20.93)	(22.08)	(23.22)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553331150	우리투자증권(ELS)4448	11.56
KR6573333152	한국투자증권(ELS)2106	10.84
KR6663329151	동양W(ELS)1018	9.74
KR6673309151	해피플러스(ELS)529	10.60
총 최대손실 예상금액		42.74

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

19.04

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

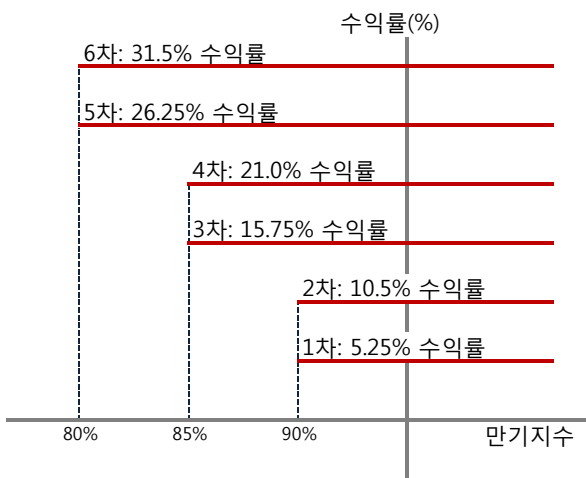
1. 계약금액

단위(백만원)

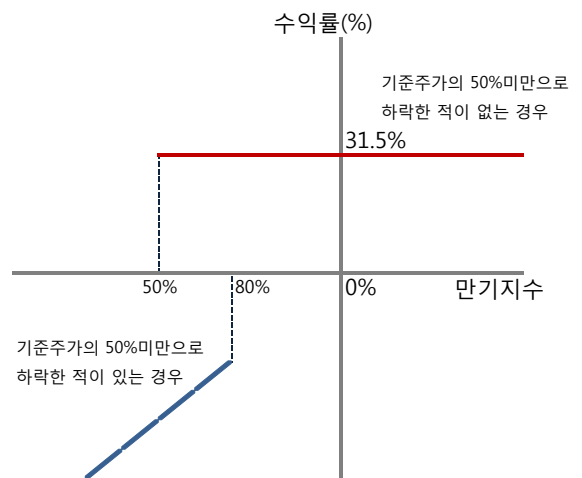
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,938	0	4,938	장외
누계	유가증권	ELS	4,938	0	4,938	장외

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	407.00	348.93	290.86	232.79	174.73	116.66	58.59	
자산	337.46	279.39	221.32	163.25	105.19	47.12	(10.95)	
시나	259.86	201.79	143.72	85.66	27.59	(30.48)	(88.55)	
리오	174.20	116.14	58.07	0.00	(58.07)	(116.14)	(174.20)	
	80.49	22.42	(35.65)	(93.72)	(151.78)	(209.85)	(267.92)	
	(21.29)	(79.35)	(137.42)	(195.49)	(253.56)	(311.63)	(369.69)	
	(131.12)	(189.19)	(247.25)	(305.32)	(363.39)	(421.46)	(479.53)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	120.21
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	120.13
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	120.14
KR6663346155	동양W(ELS)1009	119.05
총 최대손실 예상금액		479.53

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 460.47

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

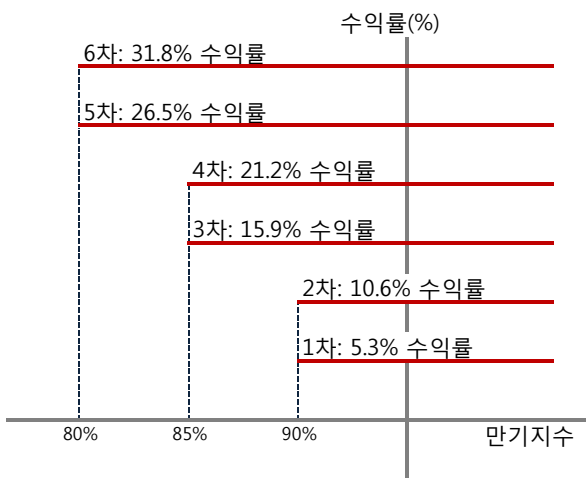
1. 계약금액

단위(백만원)

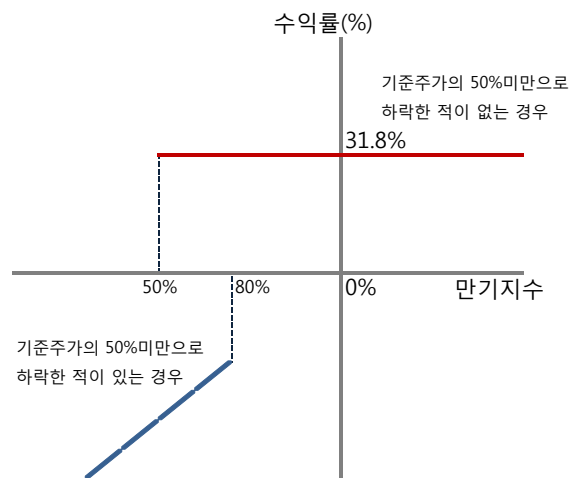
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	7,070	0	7,070	장외
누계	유가증권	ELS	7,070	0	7,070	장외

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	579.46	496.63	413.80	330.97	248.14	165.31	82.48	
자산	480.01	397.17	314.34	231.51	148.68	65.85	(16.98)	
시나리오	369.68	286.85	204.02	121.19	38.36	(44.47)	(127.30)	
	248.49	165.66	82.83	0.00	(82.83)	(165.66)	(248.49)	
	116.43	33.60	(49.23)	(132.06)	(214.89)	(297.72)	(380.55)	
	(26.49)	(109.33)	(192.16)	(274.99)	(357.82)	(440.65)	(523.48)	
	(180.29)	(263.12)	(345.95)	(428.78)	(511.61)	(594.44)	(677.27)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	162.14
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	171.76
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	171.61
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	171.76
총 최대손실 예상금액		677.27

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	624.70
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

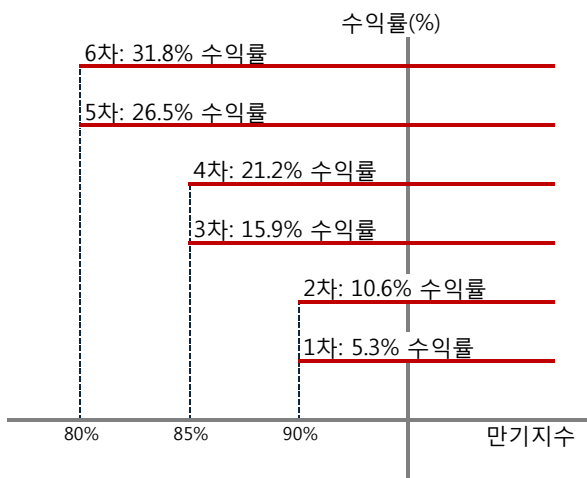
1. 계약금액

단위(백만원)

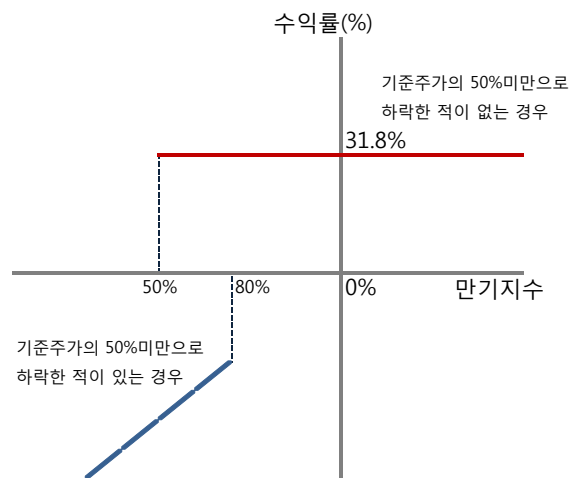
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,480	0	5,480	장외
누계	유가증권	ELS	5,480	0	5,480	장외

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	452.19	390.22	328.25	266.28	204.31	142.34	80.37	
자산	370.67	308.70	246.72	184.75	122.78	60.81	(1.16)	
시나	281.91	219.94	157.96	95.99	34.02	(27.95)	(89.92)	
리오	0.00%	185.91	123.94	61.97	0.00	(61.97)	(123.94)	(185.91)
	-2.67%	82.69	20.71	(41.26)	(103.23)	(165.20)	(227.17)	(289.14)
	-5.33%	(27.78)	(89.75)	(151.72)	(213.69)	(275.66)	(337.63)	(399.60)
	-8.00%	(145.47)	(207.44)	(269.41)	(331.38)	(393.35)	(455.32)	(517.29)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503341168	신한투자(ELS)2834	130.27
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	126.60
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	130.23
KR6663324160	동양W(ELS)1028	130.20
총 최대손실 예상금액		517.29

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	473.78
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제21호[ELS-파생형]

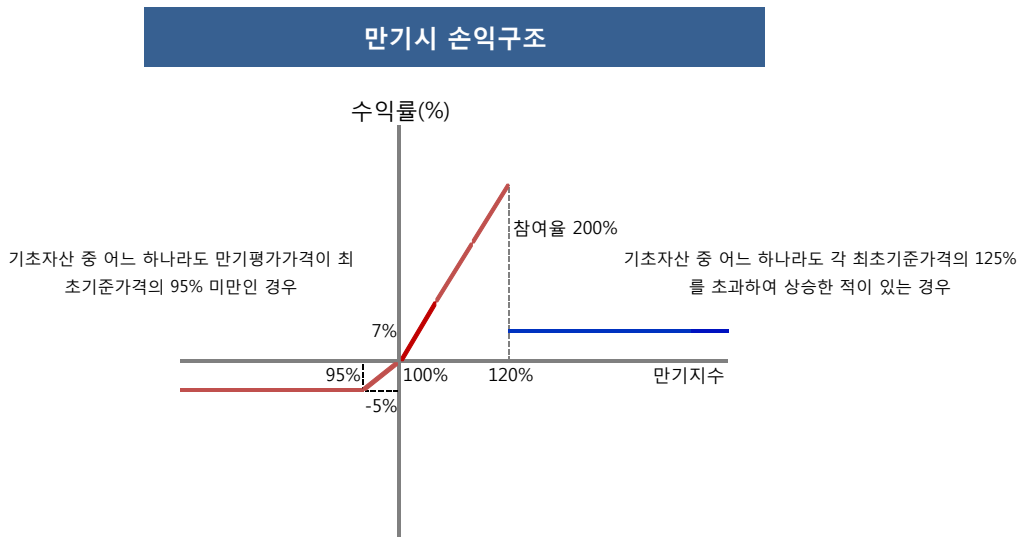
공시일: 2012-05-21

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%	1.79	1.78	1.77	1.77	1.76	1.75	1.74
	5.33%	1.10	1.09	1.09	1.08	1.07	1.06	1.05
	2.67%	0.51	0.51	0.50	0.49	0.48	0.47	0.46
	0.00%	0.03	0.02	0.01	0.00	(0.01)	(0.02)	(0.03)
	-2.67%	(0.36)	(0.37)	(0.38)	(0.39)	(0.40)	(0.41)	(0.41)
	-5.33%	(0.65)	(0.66)	(0.67)	(0.67)	(0.68)	(0.69)	(0.70)
	-8.00%	(0.83)	(0.84)	(0.85)	(0.86)	(0.87)	(0.88)	(0.89)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033B3162	신한투자(ELS)2918	0.22
KR65233AN161	대우증권ELS5772	0.22
KR6663386169	동양W(ELS)1037	0.22
KR6773318169	KB STAR(ELS)29	0.22
총 최대손실 예상금액		0.89

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.96

메리츠한증지수연계증권제23호[ELS-파생형]

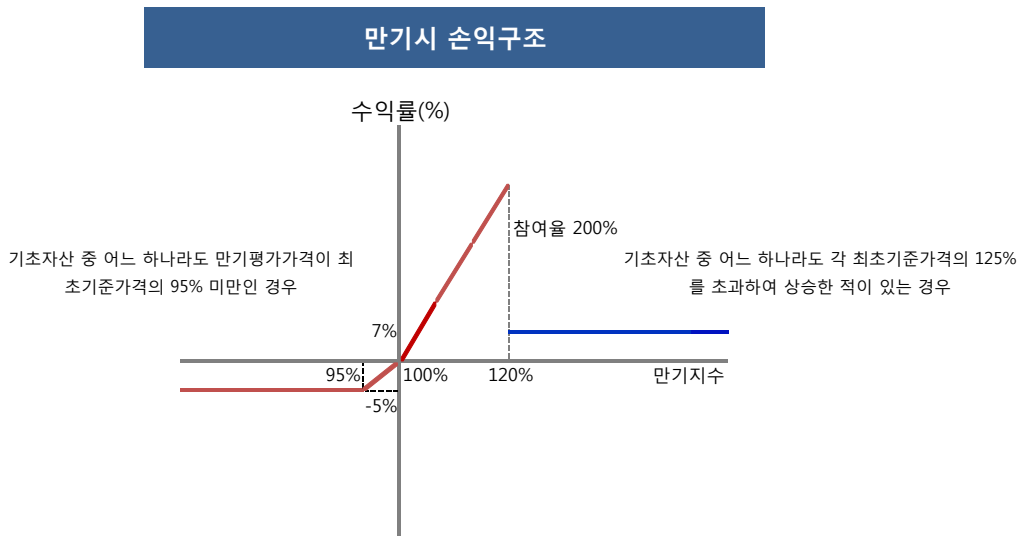
공시일: 2012-05-21

1. 계약금액

단위(백만원)

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

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%	2.57	2.55	2.54	2.53	2.52	2.51	2.49
	5.33%	1.57	1.56	1.55	1.53	1.52	1.51	1.50
	2.67%	0.73	0.72	0.70	0.69	0.68	0.67	0.65
	0.00%	0.04	0.02	0.01	0.00	(0.01)	(0.02)	(0.04)
	-2.67%	(0.50)	(0.52)	(0.53)	(0.54)	(0.55)	(0.56)	(0.58)
	-5.33%	(0.89)	(0.90)	(0.92)	(0.93)	(0.94)	(0.95)	(0.96)
	-8.00%	(1.13)	(1.14)	(1.15)	(1.16)	(1.18)	(1.19)	(1.20)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65233BE168	대우증권ELS5786	0.30
KR66633A1169	동양W(ELS)1038	0.30
KR67033A0165	H&D증권(ELS)1809	0.30
KR6773321163	KB STAR(ELS)30	0.30
총 최대손실 예상금액		1.20

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.29
-----	------

메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

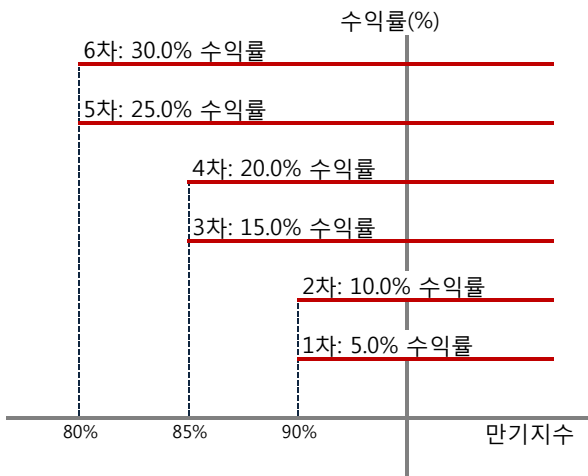
1. 계약금액

단위(백만원)

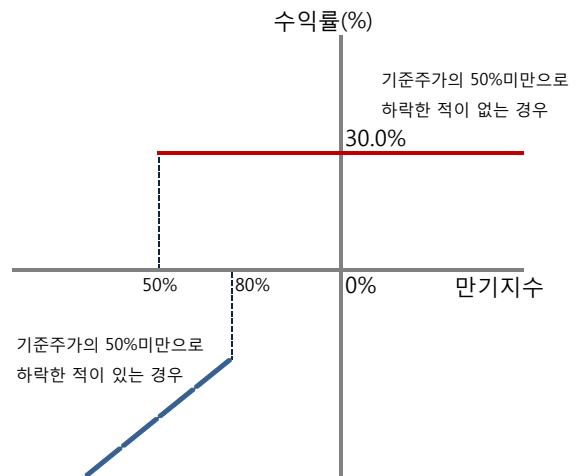
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,910	0	5,910	장외
누계	유가증권	ELS	5,910	0	5,910	장외

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%	507.34	439.80	372.27	304.73	237.20	169.66	102.12
	5.33%	411.87	344.33	276.79	209.26	141.72	74.18	6.65
	2.67%	310.29	242.75	175.22	107.68	40.14	(27.39)	(94.93)
	0.00%	202.61	135.07	67.54	0.00	(67.54)	(135.07)	(202.61)
	-2.67%	88.83	21.29	(46.25)	(113.78)	(181.32)	(248.86)	(316.39)
	-5.33%	(31.06)	(98.59)	(166.13)	(233.67)	(301.20)	(368.74)	(436.28)
	-8.00%	(157.05)	(224.58)	(292.12)	(359.66)	(427.19)	(494.73)	(562.26)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503322176	신한투자(ELS)2982	140.78
KR6543311171	신영증권(ELS)2189	140.80
KR6553334170	우리투자증권(ELS)4750	139.85
KR6663322172	동양W(ELS)1040	140.83
총 최대손실 예상금액		562.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

535.59

메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2012-05-21

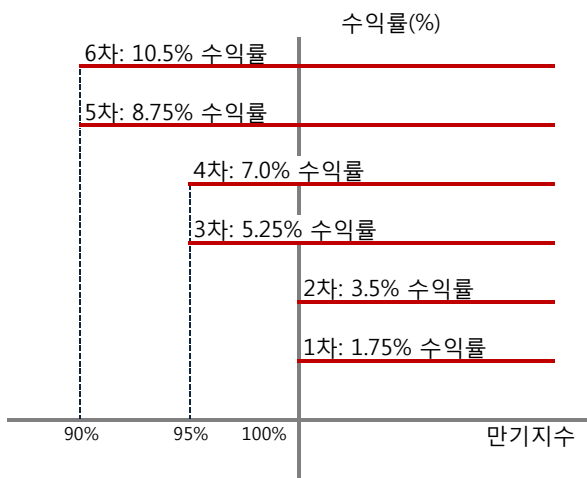
1. 계약금액

단위(백만원)

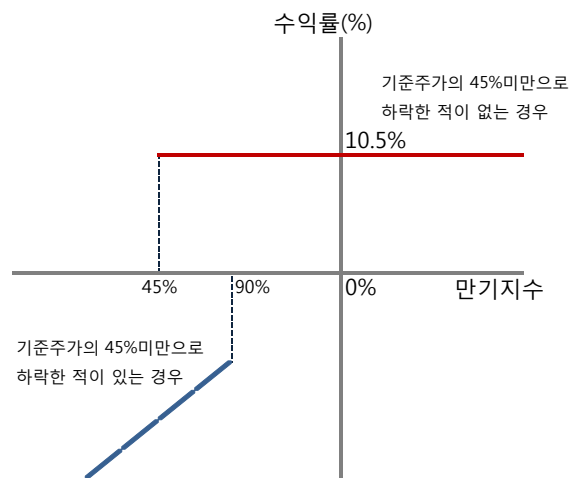
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

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	98.90	61.25	23.61	(14.03)	(51.67)	(89.31)	(126.96)	
자산	130.67	93.03	55.39	17.74	(19.90)	(57.54)	(95.18)	
시나	135.35	97.71	60.06	22.42	(15.22)	(52.86)	(90.51)	
리오	112.93	75.28	37.64	0.00	(37.64)	(75.28)	(112.93)	
	63.41	25.77	(11.88)	(49.52)	(87.16)	(124.80)	(162.45)	
	(13.21)	(50.85)	(88.49)	(126.14)	(163.78)	(201.42)	(239.06)	
	(116.93)	(154.57)	(192.21)	(229.85)	(267.49)	(305.14)	(342.78)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033AL250	신한투자(ELS)4533	86.76
KR65233AT259	대우증권(ELS)7497	83.93
KR65533BV256	우리투자증권(ELS)6128	84.43
KR6703394256	H&D증권(ELS)2764	87.66
총 최대손실 예상금액		342.78

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 259.34