

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

# 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

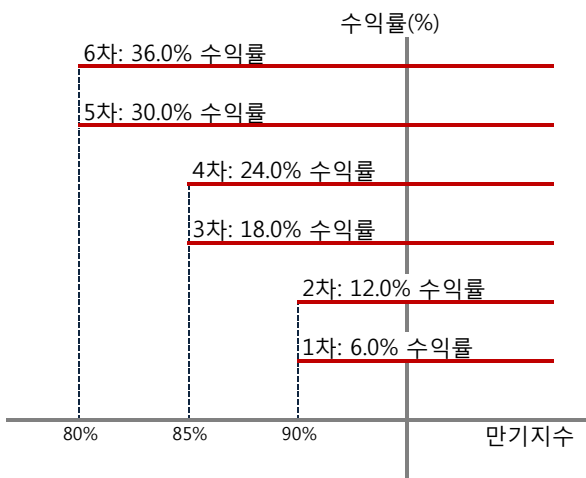
## 1. 계약금액

단위(백만원)

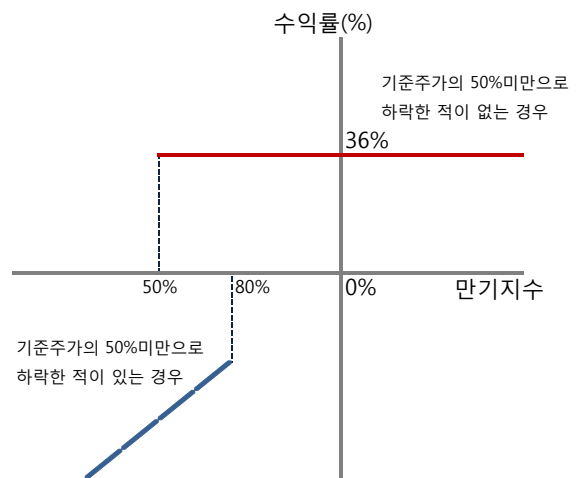
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,255	0	5,255	장외
누계	유가증권	ELS	5,255	0	5,255	장외

## 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	108.67	98.29	87.91	77.53	67.15	56.77	46.40	
자산	128.21	117.83	107.45	97.07	86.69	76.31	65.93	
시나리오	102.36	91.98	81.60	71.22	60.84	50.47	40.09	
	31.14	20.76	10.38	0.00	(10.38)	(20.76)	(31.14)	
	(85.47)	(95.84)	(106.22)	(116.60)	(126.98)	(137.36)	(147.74)	
	(247.45)	(257.83)	(268.21)	(278.59)	(288.97)	(299.34)	(309.72)	
	(454.81)	(465.19)	(475.57)	(485.95)	(496.33)	(506.71)	(517.09)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	61.92
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	151.77
KR6661350035	동양(ELS)520	151.56
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	151.83
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>517.09</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	474.00
-----	--------

# 메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

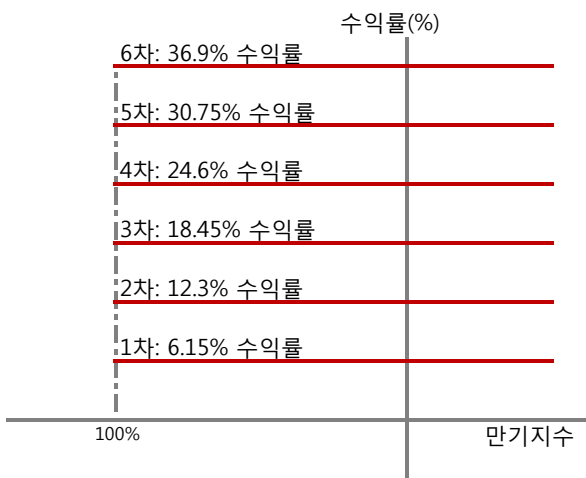
## 1. 계약금액

단위(백만원)

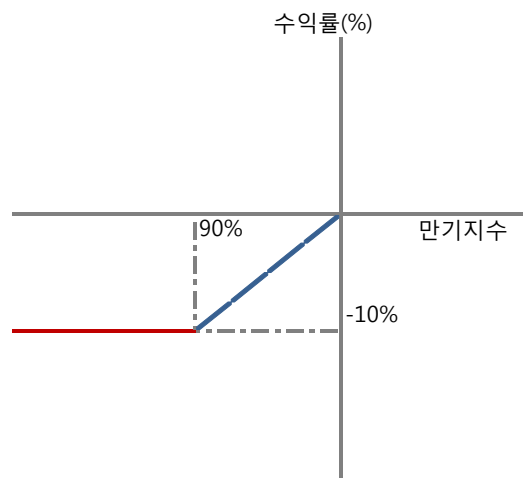
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,011	0	5,011	장외
누계	유가증권	ELS	5,011	0	5,011	장외

## 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	360.07	350.17	340.27	330.37	320.47	310.57	300.67	
자산	237.18	227.28	217.38	207.48	197.57	187.67	177.77	
시나	127.06	117.15	107.25	97.35	87.45	77.55	67.65	
리오	0.00%	19.80	9.90	0.00	(9.90)	(19.80)	(29.70)	
	-2.67%	(64.78)	(74.68)	(84.58)	(94.48)	(104.38)	(114.28)	
	-5.33%	(126.69)	(136.59)	(146.49)	(156.39)	(166.29)	(176.19)	
	-8.00%	(185.73)	(195.63)	(205.53)	(215.43)	(225.33)	(235.23)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293160A1	대우증권ELS4537	62.03
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	58.55
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	62.17
KR66693120A9	동양W(ELS)927	62.38
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>245.13</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	192.80
-----	--------

# 메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

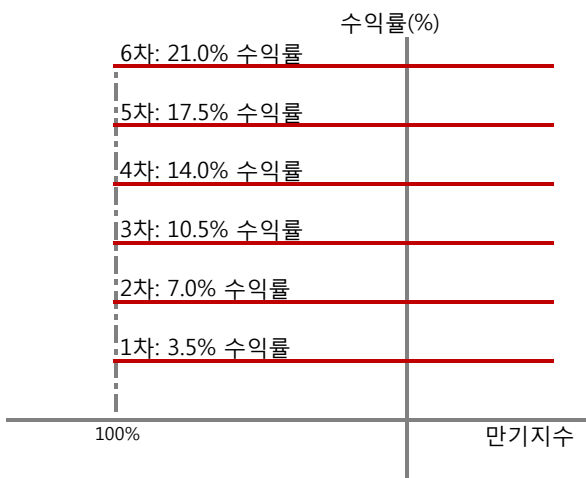
## 1. 계약금액

단위(백만원)

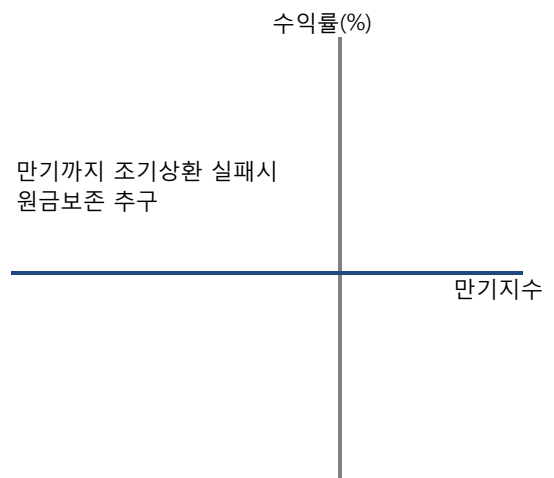
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외
누계	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외

## 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	112.90	108.67	104.45	100.22	95.99	91.77	87.54	
자산	76.86	72.63	68.41	64.18	59.95	55.73	51.50	
시나	43.45	39.23	35.00	30.77	26.55	22.32	18.09	
리오	12.68	8.45	4.23	0.00	(4.23)	(8.45)	(12.68)	
	(15.46)	(19.69)	(23.91)	(28.14)	(32.37)	(36.59)	(40.82)	
	(40.97)	(45.19)	(49.42)	(53.65)	(57.87)	(62.10)	(66.33)	
	(63.84)	(68.07)	(72.29)	(76.52)	(80.75)	(84.97)	(89.20)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	22.73
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	22.95
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	22.91
KR66623360C2	동양W(ELS)950	20.60
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>89.20</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 90.75

# 메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

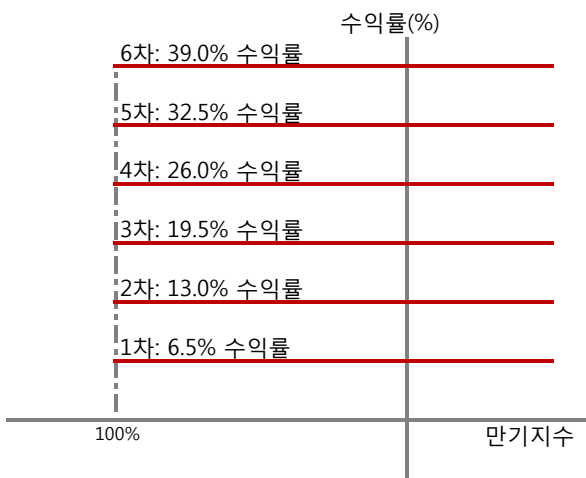
## 1. 계약금액

단위(백만원)

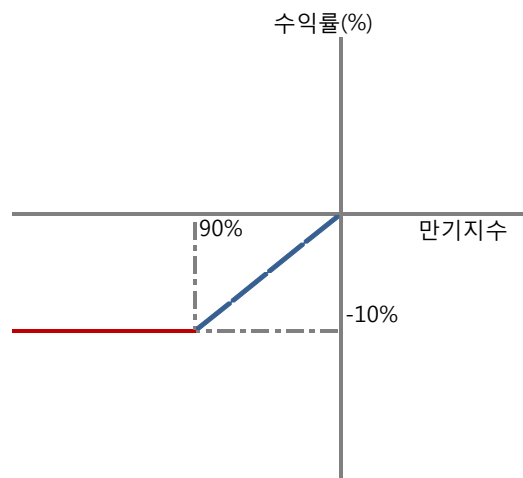
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,293	0	3,293	장외
누계	유가증권	ELS	3,293	0	3,293	장외

## 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 시나 리오	8.00%	243.19	233.67	224.15	214.63	205.11	195.59	186.06
	5.33%	166.32	156.80	147.28	137.76	128.24	118.72	109.20
	2.67%	94.78	85.26	75.74	66.22	56.70	47.18	37.66
	0.00%	28.56	19.04	9.52	0.00	(9.52)	(19.04)	(28.56)
	-2.67%	(32.33)	(41.85)	(51.37)	(60.89)	(70.41)	(79.93)	(89.45)
	-5.33%	(87.89)	(97.41)	(106.93)	(116.45)	(125.97)	(135.49)	(145.01)
	-8.00%	(138.13)	(147.65)	(157.17)	(166.69)	(176.21)	(185.73)	(195.25)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	51.06
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	51.20
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	51.18
KR66623340C4	동양W(ELS)949	41.81
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>195.25</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 199.80

# 메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

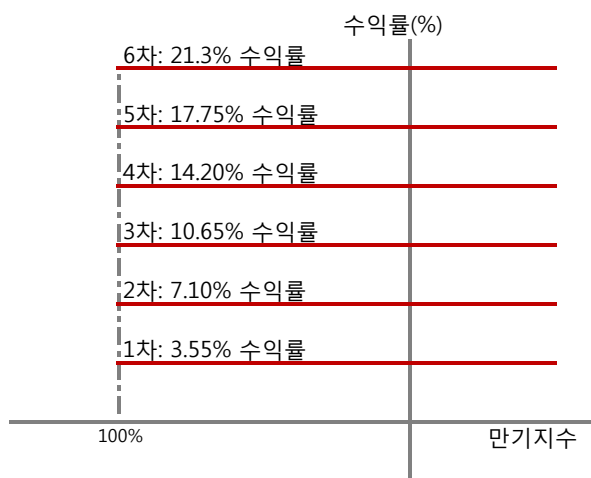
## 1. 계약금액

단위(백만원)

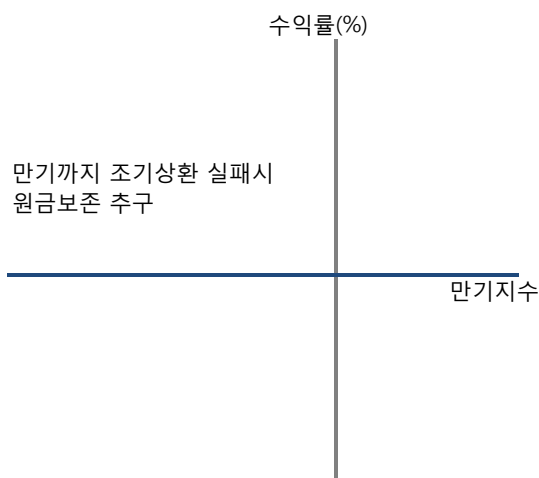
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,092	0	1,092	장외
누계	유가증권	ELS	1,092	0	1,092	장외

## 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	4.67	4.30	3.94	3.58	3.22	2.86	2.50	
자산	3.39	3.03	2.66	2.30	1.94	1.58	1.22	
시나리오	2.19	1.83	1.47	1.11	0.75	0.39	0.02	
	0.00%	0.72	0.36	0.00	(0.36)	(0.72)	(1.09)	
	-2.67%	0.06	(0.30)	(0.66)	(1.02)	(1.39)	(2.11)	
	-5.33%	(0.88)	(1.24)	(1.60)	(1.96)	(2.32)	(3.05)	
	-8.00%	(1.73)	(2.09)	(2.46)	(2.82)	(3.18)	(3.90)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	1.08
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	1.08
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.65
KR6662316126	동양W(ELS)974	1.08
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>3.90</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 4.77

# 메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

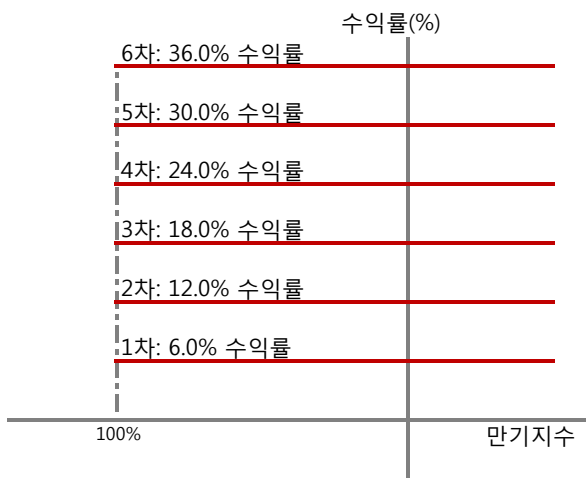
## 1. 계약금액

단위(백만원)

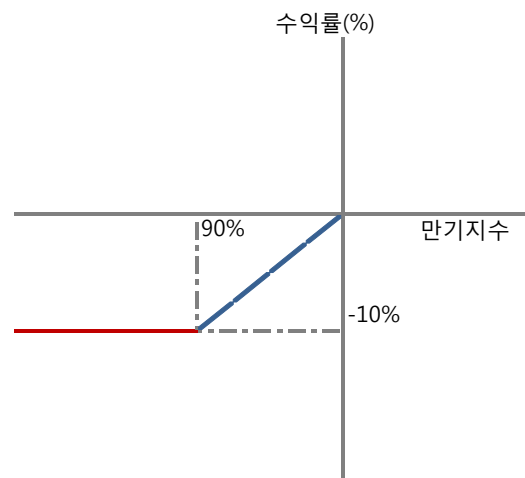
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	711	0	711	장외
누계	유가증권	ELS	711	0	711	장외

## 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	12.85	11.89	10.93	9.97	9.00	8.04	7.08	
자산	9.29	8.33	7.37	6.40	5.44	4.48	3.52	
시나리오	5.97	5.01	4.04	3.08	2.12	1.16	0.19	
	0.00%	2.89	1.93	0.96	0.00	(0.96)	(1.93)	(2.89)
	-2.67%	0.05	(0.92)	(1.88)	(2.84)	(3.80)	(4.77)	(5.73)
	-5.33%	(2.55)	(3.52)	(4.48)	(5.44)	(6.41)	(7.37)	(8.33)
	-8.00%	(4.92)	(5.88)	(6.84)	(7.80)	(8.77)	(9.73)	(10.69)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	2.79
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	2.34
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	2.79
KR6662317124	동양W(ELS)975	2.78
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>10.69</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 12.95

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

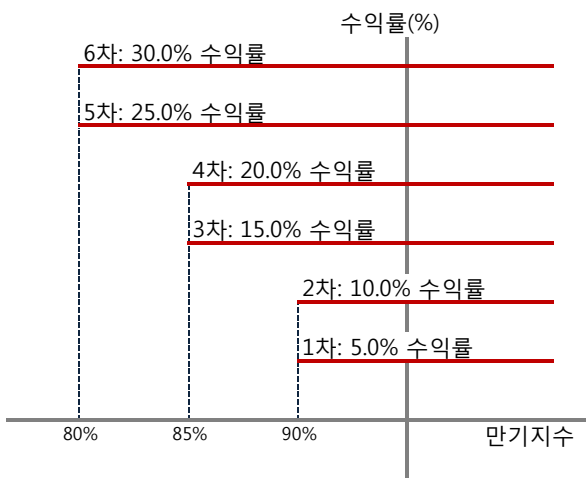
## 1. 계약금액

단위(백만원)

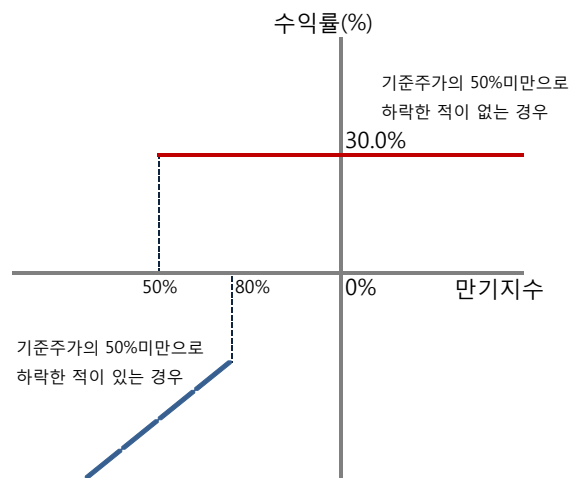
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,452	0	8,452	장외
누계	유가증권	ELS	8,452	0	8,452	장외

## 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	377.58	346.34	315.09	283.85	252.61	221.37	190.12	
자산	314.75	283.50	252.26	221.02	189.78	158.53	127.29	
시나리오	220.13	188.89	157.64	126.40	95.16	63.92	32.68	
	93.73	62.48	31.24	0.00	(31.24)	(62.48)	(93.73)	
	(64.46)	(95.70)	(126.95)	(158.19)	(189.43)	(220.67)	(251.91)	
	(254.43)	(285.68)	(316.92)	(348.16)	(379.40)	(410.65)	(441.89)	
	(476.19)	(507.43)	(538.68)	(569.92)	(601.16)	(632.40)	(663.65)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	176.35
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	176.86
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	164.86
KR6662374141	동양W(ELS)1004	145.57
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>663.65</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	779.82
-----	--------



# 메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

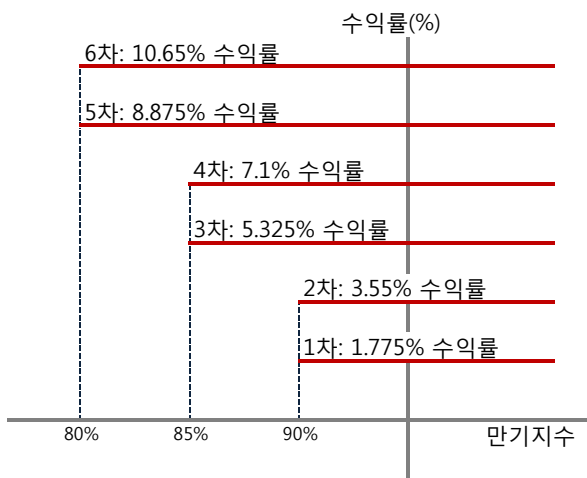
## 1. 계약금액

단위(백만원)

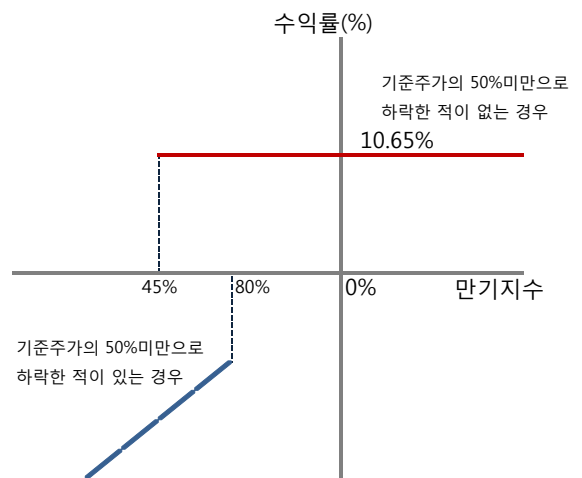
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외
누계	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외

## 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)

KR6553331150	우리투자증권(ELS)4448	0.00
KR6573333152	한국투자증권(ELS)2106	0.00
KR6663329151	동양W(ELS)1018	0.00
KR6673309151	해피플러스(ELS)529	0.00
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>0.00</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

# 메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

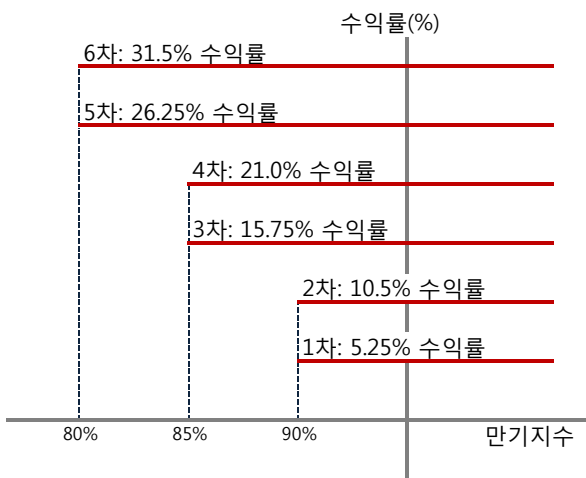
## 1. 계약금액

단위(백만원)

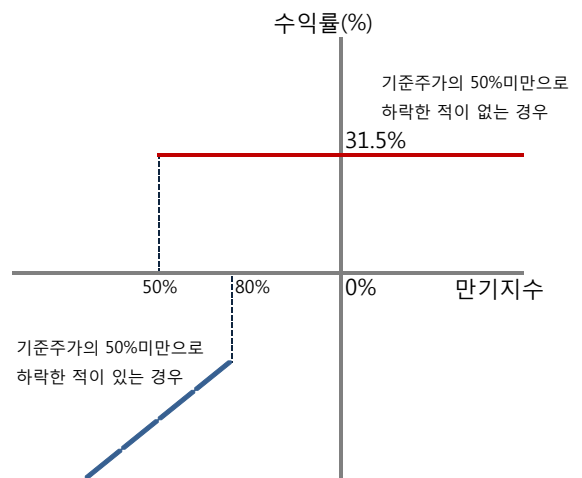
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,921	0	4,921	장외
누계	유가증권	ELS	4,921	0	4,921	장외

## 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	475.91	429.76	383.61	337.45	291.30	245.15	199.00	
자산	375.35	329.20	283.05	236.90	190.75	144.60	98.45	
시나리오	262.87	216.71	170.56	124.41	78.26	32.11	(14.04)	
	138.45	92.30	46.15	0.00	(46.15)	(92.30)	(138.45)	
	2.11	(44.04)	(90.19)	(136.34)	(182.49)	(228.64)	(274.79)	
	(146.16)	(192.31)	(238.46)	(284.61)	(330.76)	(376.91)	(423.06)	
	(306.36)	(352.51)	(398.66)	(444.81)	(490.96)	(537.11)	(583.26)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	146.34
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	146.35
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	146.31
KR6663346155	동양W(ELS)1009	144.27
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>583.26</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	566.89
-----	--------

# 메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

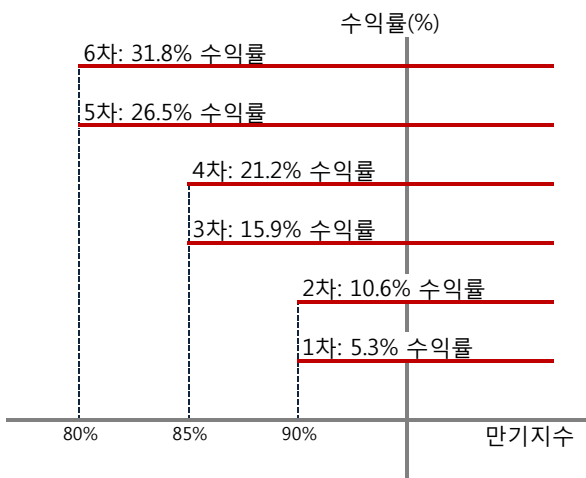
## 1. 계약금액

단위(백만원)

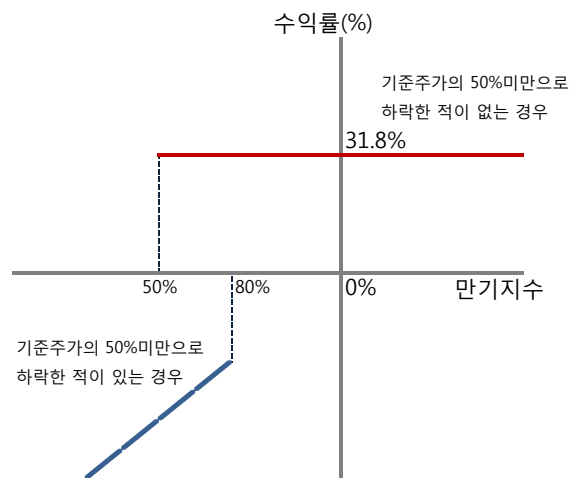
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,939	0	6,939	장외
누계	유가증권	ELS	6,939	0	6,939	장외

## 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	709.46	642.27	575.07	507.88	440.68	373.49	306.30	
자산	554.62	487.43	420.23	353.04	285.85	218.65	151.46	
시나리오	2.67%	385.33	318.14	250.94	183.75	116.55	49.36	
	0.00%	201.58	134.39	67.19	0.00	(67.19)	(134.39)	
	-2.67%	3.38	(63.81)	(131.01)	(198.20)	(265.40)	(332.59)	
	-5.33%	(209.28)	(276.47)	(343.66)	(410.86)	(478.05)	(545.25)	
	-8.00%	(436.39)	(503.58)	(570.78)	(637.97)	(705.16)	(772.36)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	198.02
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	213.88
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	213.76
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	213.89
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>839.55</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	844.55
-----	--------

# 메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

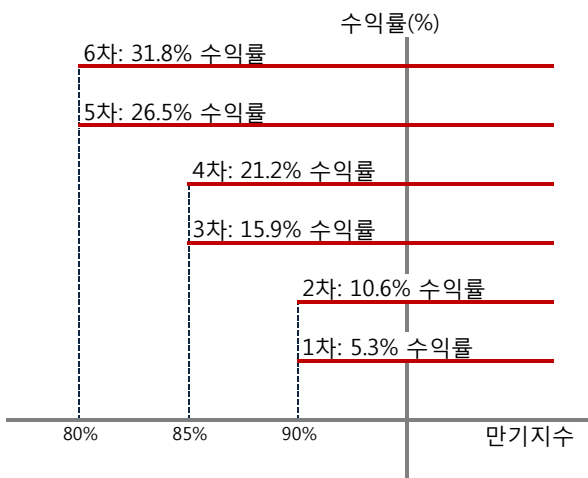
## 1. 계약금액

단위(백만원)

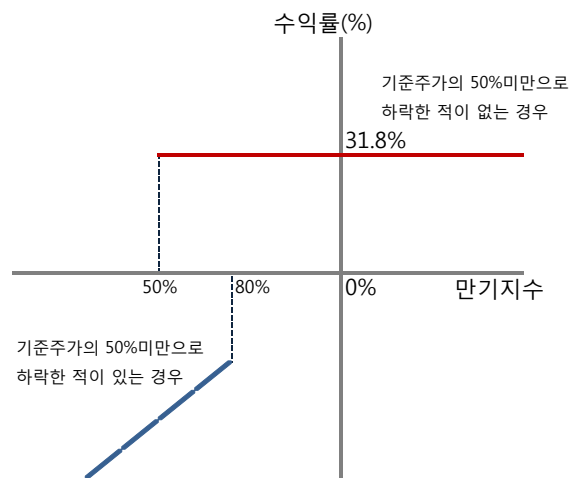
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,436	0	5,436	장외
누계	유가증권	ELS	5,436	0	5,436	장외

## 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	521.86	470.63	419.41	368.19	316.96	265.74	214.52	
자산	411.34	360.12	308.89	257.67	206.45	155.22	104.00	
시나리오	288.61	237.39	186.16	134.94	83.72	32.49	(18.73)	
	153.67	102.45	51.22	0.00	(51.22)	(102.45)	(153.67)	
	6.52	(44.71)	(95.93)	(147.15)	(198.38)	(249.60)	(300.82)	
	(152.85)	(204.07)	(255.30)	(306.52)	(357.74)	(408.97)	(460.19)	
	(324.43)	(375.65)	(426.87)	(478.10)	(529.32)	(580.54)	(631.77)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	159.21
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	154.08
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	159.22
KR6663324160	동양W(ELS)1028	159.26
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>631.77</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

605.59

# 메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

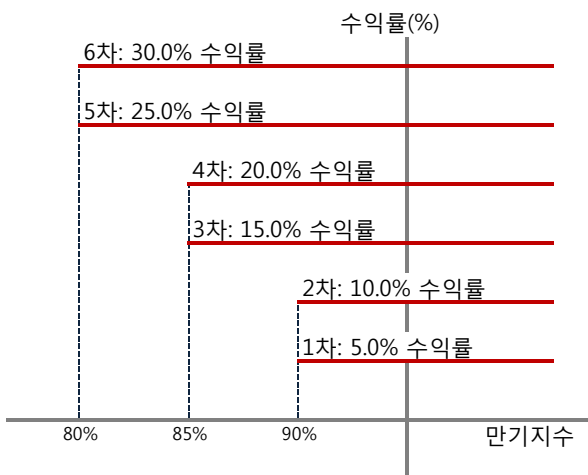
## 1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,898	0	5,898	장외
누계	유가증권	ELS	5,898	0	5,898	장외

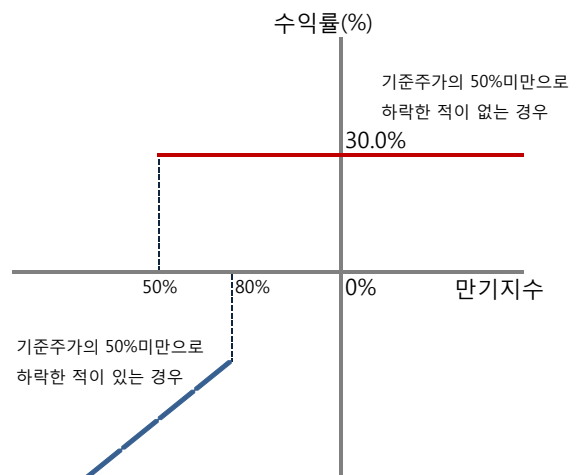
단위(백만원)

## 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	558.02	500.51	443.00	385.49	327.98	270.47	212.96	
시나리오	443.49	385.99	328.48	270.97	213.46	155.95	98.44	
	315.00	257.49	199.98	142.47	84.96	27.45	(30.06)	
	172.53	115.02	57.51	0.00	(57.51)	(115.02)	(172.53)	
	16.09	(41.42)	(98.93)	(156.44)	(213.95)	(271.46)	(328.97)	
	(154.33)	(211.84)	(269.35)	(326.86)	(384.37)	(441.88)	(499.39)	
	(338.72)	(396.23)	(453.74)	(511.25)	(568.76)	(626.27)	(683.78)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	예상금액
KR6503322176	신한투자(ELS)2982	171.35
KR6543311171	신영증권(ELS)2189	171.33
KR6553334170	우리투자증권(ELS)4750	169.87
KR6663322172	동양W(ELS)1040	171.23
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>683.78</b>

단위(백만원)

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 663.06

# 메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

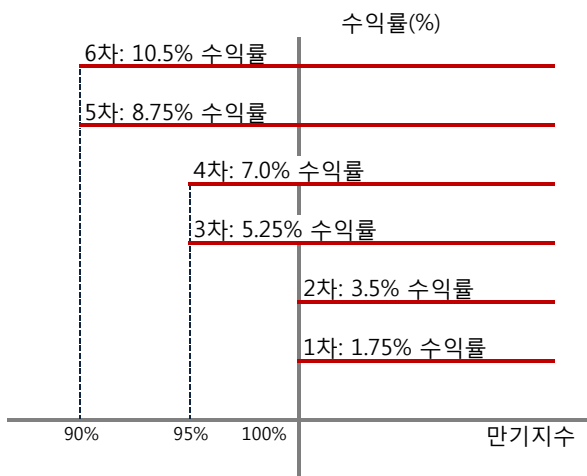
## 1. 계약금액

단위(백만원)

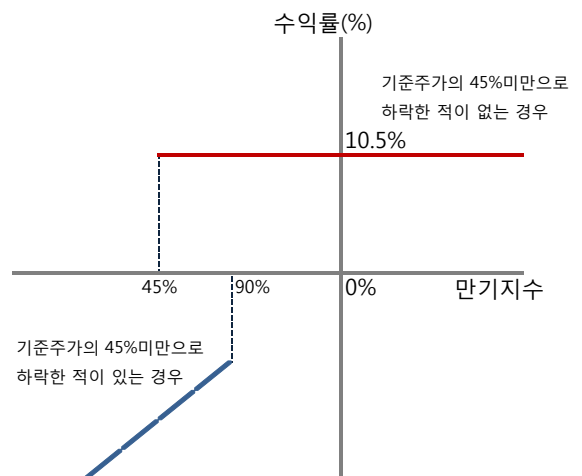
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

## 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 자산 시나리오	8.00%	(234.91)	(232.70)	(230.49)	(228.29)	(226.08)	(223.88)	(221.67)
	5.33%	(151.57)	(149.36)	(147.16)	(144.95)	(142.75)	(140.54)	(138.34)
	2.67%	(75.47)	(73.27)	(71.06)	(68.86)	(66.65)	(64.45)	(62.24)
	0.00%	(6.62)	(4.41)	(2.21)	0.00	2.21	4.41	6.62
리스크	-2.67%	55.00	57.20	59.41	61.62	63.82	66.03	68.23
	-5.33%	109.37	111.58	113.78	115.99	118.20	120.40	122.61
	-8.00%	156.51	158.71	160.92	163.12	165.33	167.54	169.74

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65033AL250	신한투자(ELS)4533	57.96
KR65233AT259	대우증권(ELS)7497	60.30
KR65533BV256	우리투자증권(ELS)6128	59.94
KR6703394256	H&D증권(ELS)2764	56.70
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>234.91</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	223.51
-----	--------

# 메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제30호[ELS-파생형]

공시일: 2012-09-07

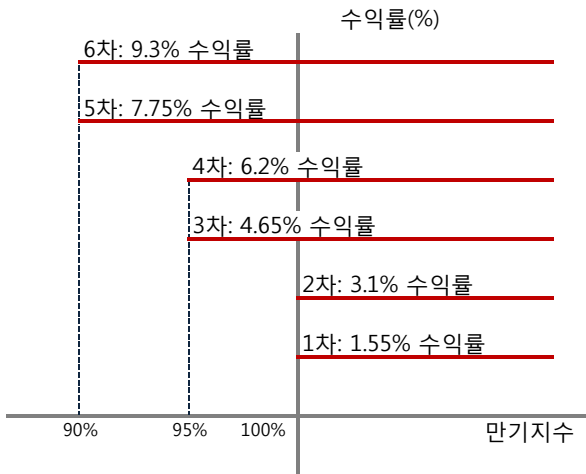
## 1. 계약금액

단위(백만원)

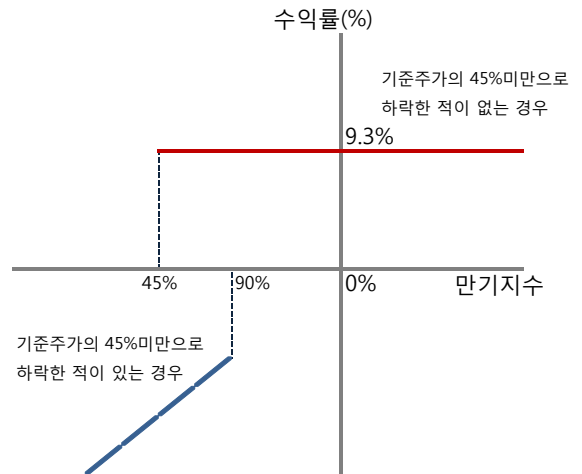
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

## 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 자산 시나리오	8.00%	(168.45)	(171.63)	(174.81)	(178.00)	(181.18)	(184.36)	(187.54)
	5.33%	(98.31)	(101.50)	(104.68)	(107.86)	(111.05)	(114.23)	(117.41)
	2.67%	(38.98)	(42.17)	(45.35)	(48.53)	(51.71)	(54.90)	(58.08)
	0.00%	9.55	6.37	3.18	0.00	(3.18)	(6.37)	(9.55)
	-2.67%	47.28	44.10	40.91	37.73	34.55	31.36	28.18
	-5.33%	74.21	71.02	67.84	64.66	61.47	58.29	55.11
	-8.00%	90.33	87.15	83.97	80.78	77.60	74.42	71.24

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233BT281	대우증권(ELS)8153	48.28
KR65533BB282	우리투자증권(ELS)6416	47.92
KR65733AY282	한국투자증권(ELS)2750	48.05
KR6583383288	현대증권(ELS)2012-2464	43.29
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>187.54</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 112.00