

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,998	0	4,998	장외
누계	유가증권	ELS	4,998	0	4,998	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	27.89	23.01	18.13	13.25	8.37	3.49	(1.39)	
자산	39.45	34.57	29.69	24.81	19.93	15.05	10.17	
시나리오	35.04	30.16	25.28	20.40	15.51	10.63	5.75	
	14.64	9.76	4.88	0.00	(4.88)	(9.76)	(14.64)	
	(21.73)	(26.61)	(31.49)	(36.37)	(41.26)	(46.14)	(51.02)	
	(74.09)	(78.97)	(83.85)	(88.73)	(93.61)	(98.49)	(103.37)	
	(142.42)	(147.30)	(152.18)	(157.06)	(161.94)	(166.82)	(171.70)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	17.92
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	51.35
KR6661350035	동양(ELS)520	51.22
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	51.21
총 최대손실 예상금액		171.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	134.09
-----	--------

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,961	0	4,961	장외
누계	유가증권	ELS	4,961	0	4,961	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	345.83	336.49	327.14	317.79	308.44	299.09	289.74
자산	233.56	224.21	214.86	205.52	196.17	186.82	177.47
시나	127.63	118.28	108.94	99.59	90.24	80.89	71.54
리오	0.00%	18.70	9.35	0.00	(9.35)	(18.70)	(28.05)
	-2.67%	(74.55)	(83.90)	(93.24)	(102.59)	(111.94)	(121.29)
	-5.33%	(152.10)	(161.45)	(170.80)	(180.15)	(189.49)	(198.84)
	-8.00%	(232.66)	(242.01)	(251.36)	(260.70)	(270.05)	(279.40)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65293160A1	대우증권ELS4537	73.91
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	66.85
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	73.95
KR66693120A9	동양W(ELS)927	74.04
총 최대손실 예상금액		288.75

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 299.20

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

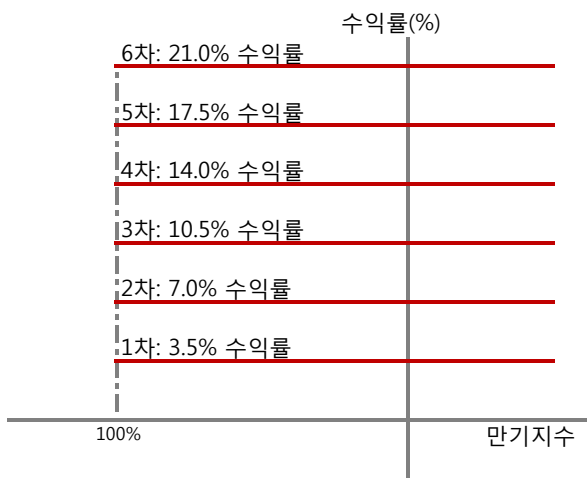
1. 계약금액

단위(백만원)

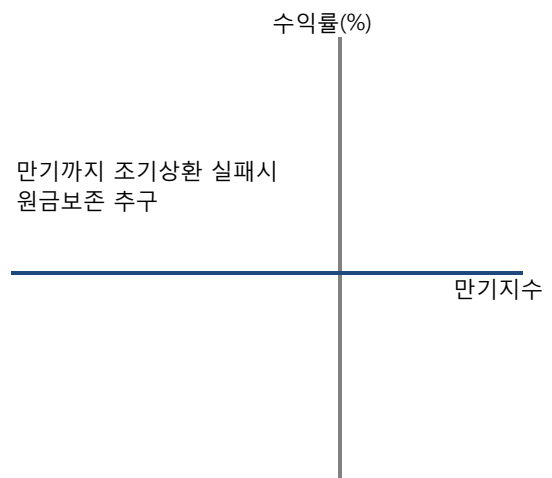
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외
누계	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외

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 자산 시나 리오	8.00%	178.90	175.12	171.34	167.56	163.78	160.00	156.22
	5.33%	116.90	113.12	109.34	105.56	101.78	97.99	94.21
	2.67%	61.04	57.26	53.48	49.70	45.92	42.14	38.36
	0.00%	11.34	7.56	3.78	0.00	(3.78)	(7.56)	(11.34)
	-2.67%	(32.21)	(35.99)	(39.77)	(43.55)	(47.33)	(51.11)	(54.89)
	-5.33%	(69.61)	(73.39)	(77.17)	(80.95)	(84.73)	(88.51)	(92.29)
	-8.00%	(100.86)	(104.64)	(108.42)	(112.20)	(115.98)	(119.76)	(123.54)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	31.48
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	31.75
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	31.77
KR66623360C2	동양W(ELS)950	28.55
총 최대손실 예상금액		123.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

126.18

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,290	0	3,290	장외
누계	유가증권	ELS	3,290	0	3,290	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	378.49	369.93	361.37	352.81	344.25	335.68	327.12	
자산	248.72	240.15	231.59	223.03	214.47	205.90	197.34	
시나리오	131.11	122.55	113.99	105.43	96.86	88.30	79.74	
	0.00%	17.12	8.56	0.00	(8.56)	(17.12)	(25.69)	
	-2.67%	(67.56)	(76.13)	(84.69)	(93.25)	(101.81)	(118.94)	
	-5.33%	(148.64)	(157.20)	(165.76)	(174.32)	(182.89)	(200.01)	
	-8.00%	(217.54)	(226.10)	(234.66)	(243.22)	(251.78)	(268.91)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	70.36
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	70.56
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	70.57
KR66623340C4	동양W(ELS)949	57.42
총 최대손실 예상금액		268.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 274.97

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

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	3.29	3.12	2.94	2.77	2.60	2.43	2.25	
자산	2.30	2.13	1.95	1.78	1.61	1.44	1.26	
시나리오	1.37	1.20	1.03	0.86	0.68	0.51	0.34	
	0.52	0.35	0.17	0.00	(0.17)	(0.35)	(0.52)	
	(0.27)	(0.44)	(0.62)	(0.79)	(0.96)	(1.13)	(1.31)	
	(1.00)	(1.17)	(1.34)	(1.51)	(1.69)	(1.86)	(2.03)	
	(1.65)	(1.82)	(2.00)	(2.17)	(2.34)	(2.51)	(2.69)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.75
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.75
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.45
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.75
총 최대손실 예상금액		2.69

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 3.17

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

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	기초	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
자산 시나 리오	8.00%	16.49	15.63	14.77	13.91	13.05	12.19	11.33
	5.33%	11.45	10.59	9.73	8.87	8.01	7.15	6.29
	2.67%	6.81	5.95	5.09	4.23	3.37	2.51	1.65
	0.00%	2.58	1.72	0.86	0.00	(0.86)	(1.72)	(2.58)
	-2.67%	(1.25)	(2.11)	(2.97)	(3.83)	(4.69)	(5.55)	(6.41)
	-5.33%	(4.67)	(5.53)	(6.39)	(7.25)	(8.11)	(8.97)	(9.83)
	-8.00%	(7.69)	(8.55)	(9.42)	(10.28)	(11.14)	(12.00)	(12.86)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	3.35
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	2.81
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	3.35
KR6662317124	동양W(ELS)975	3.35
총 최대손실 예상금액		12.86

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

12.08

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

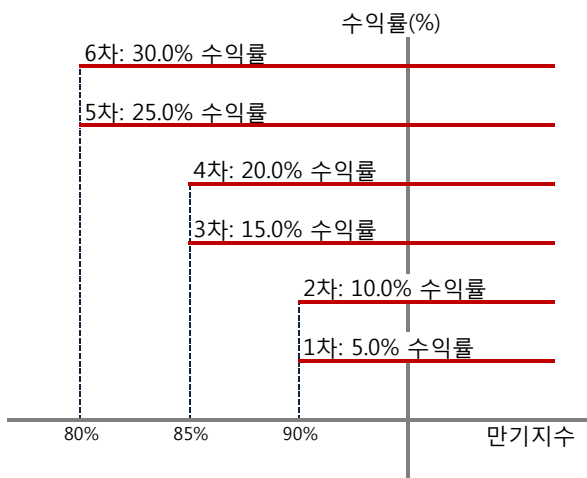
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,362	0	8,362	장외
누계	유가증권	ELS	8,362	0	8,362	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	209.12	191.03	172.93	154.83	136.74	118.64	100.54	
자산	194.20	176.10	158.01	139.91	121.81	103.72	85.62	
시나	142.59	124.49	106.40	88.30	70.20	52.11	34.01	
리오	54.29	36.19	18.10	0.00	(18.10)	(36.19)	(54.29)	
	(70.70)	(88.80)	(106.89)	(124.99)	(143.08)	(161.18)	(179.28)	
	(232.38)	(250.47)	(268.57)	(286.67)	(304.76)	(322.86)	(340.95)	
	(430.74)	(448.84)	(466.93)	(485.03)	(503.13)	(521.22)	(539.32)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	143.02
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	143.40
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	127.74
KR6662374141	동양W(ELS)1004	125.16
총 최대손실 예상금액		539.32

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 550.00

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

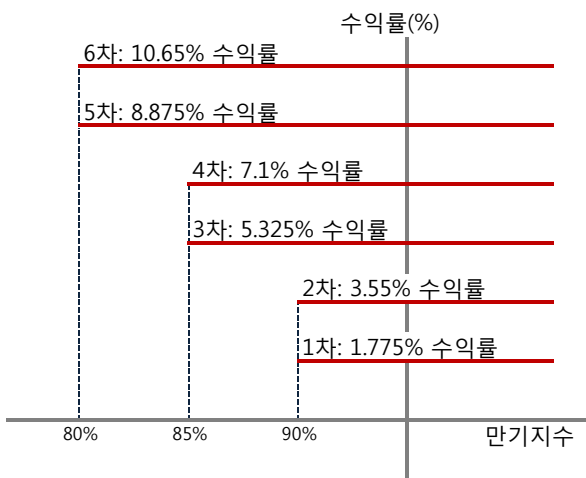
1. 계약금액

단위(백만원)

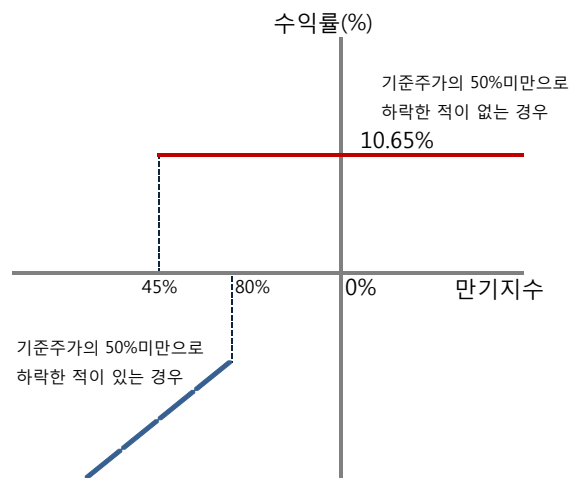
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외
누계	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외

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
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

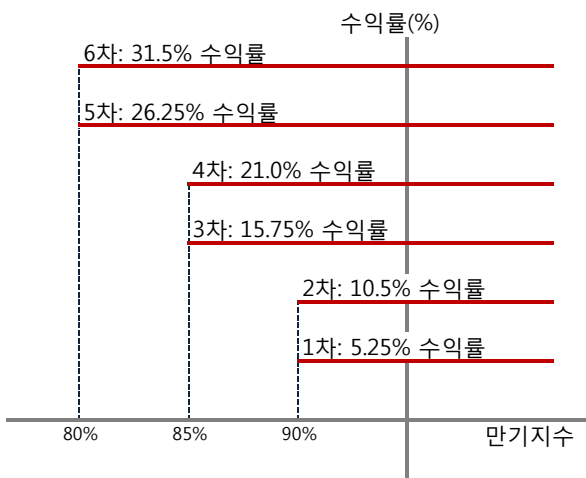
1. 계약금액

단위(백만원)

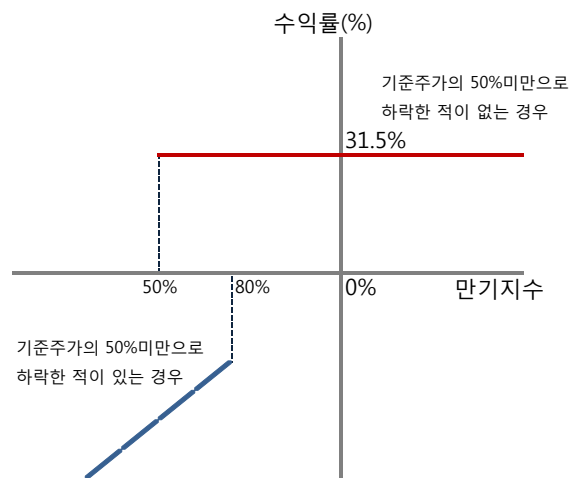
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,821	0	4,821	장외
누계	유가증권	ELS	4,821	0	4,821	장외

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%	(2.63)	(12.32)	(22.01)	(31.70)	(41.40)	(51.09)	(60.78)
자산	5.33%	25.41	15.71	6.02	(3.67)	(13.36)	(23.06)	(32.75)
사	2.67%	35.97	26.28	16.59	6.90	(2.80)	(12.49)	(22.18)
나	0.00%	29.08	19.39	9.69	0.00	(9.69)	(19.39)	(29.08)
리	-2.67%	4.72	(4.97)	(14.67)	(24.36)	(34.05)	(43.75)	(53.44)
오	-5.33%	(37.11)	(46.80)	(56.49)	(66.18)	(75.88)	(85.57)	(95.26)
시	-8.00%	(96.39)	(106.09)	(115.78)	(125.47)	(135.16)	(144.86)	(154.55)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	37.99
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	38.35
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	39.82
KR6663346155	동양W(ELS)1009	38.39
총 최대손실 예상금액		154.55

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

156.05

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

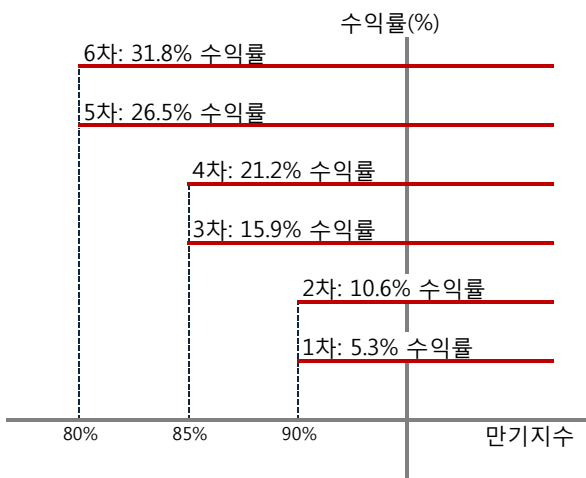
1. 계약금액

단위(백만원)

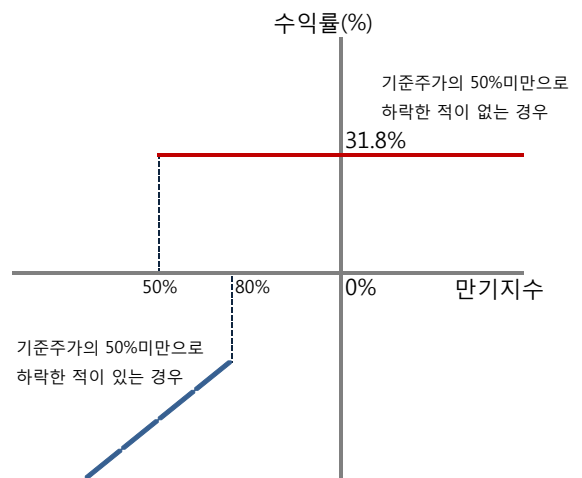
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,937	0	6,937	장외
누계	유가증권	ELS	6,937	0	6,937	장외

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	67.68	50.10	32.51	14.92	(2.67)	(20.26)	(37.84)	
자산	84.54	66.95	49.37	31.78	14.19	(3.40)	(20.98)	
시나	79.57	61.98	44.39	26.81	9.22	(8.37)	(25.96)	
리오	52.76	35.18	17.59	0.00	(17.59)	(35.18)	(52.76)	
	4.12	(13.46)	(31.05)	(48.64)	(66.23)	(83.81)	(101.40)	
	(66.35)	(83.94)	(101.52)	(119.11)	(136.70)	(154.29)	(171.87)	
	(158.65)	(176.24)	(193.83)	(211.42)	(229.00)	(246.59)	(264.18)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	60.16
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	67.11
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	69.97
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	66.93
총 최대손실 예상금액		264.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 242.11

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

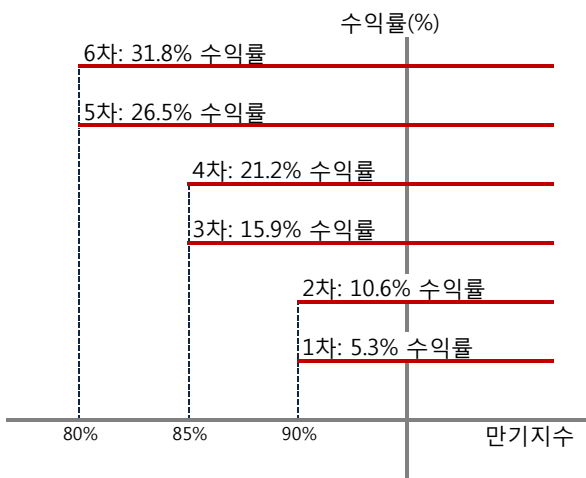
1. 계약금액

단위(백만원)

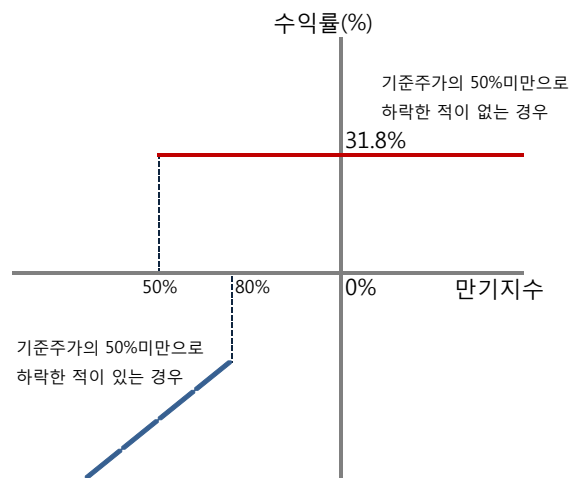
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,386	0	5,386	장외
누계	유가증권	ELS	5,386	0	5,386	장외

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%	40.86	27.57	14.28	1.00	(12.29)	(25.58)	(38.86)
	5.33%	56.11	42.83	29.54	16.25	2.96	(10.32)	(23.61)
	2.67%	55.78	42.49	29.21	15.92	2.63	(10.65)	(23.94)
	0.00%	39.86	26.57	13.29	0.00	(13.29)	(26.57)	(39.86)
	-2.67%	8.35	(4.93)	(18.22)	(31.51)	(44.79)	(58.08)	(71.37)
	-5.33%	(38.74)	(52.03)	(65.31)	(78.60)	(91.89)	(105.17)	(118.46)
	-8.00%	(101.42)	(114.70)	(127.99)	(141.28)	(154.57)	(167.85)	(181.14)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503341168	신한투자(ELS)2834	45.50
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	41.48
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	45.97
KR6663324160	동양W(ELS)1028	48.19
총 최대손실 예상금액		181.14

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	167.58
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

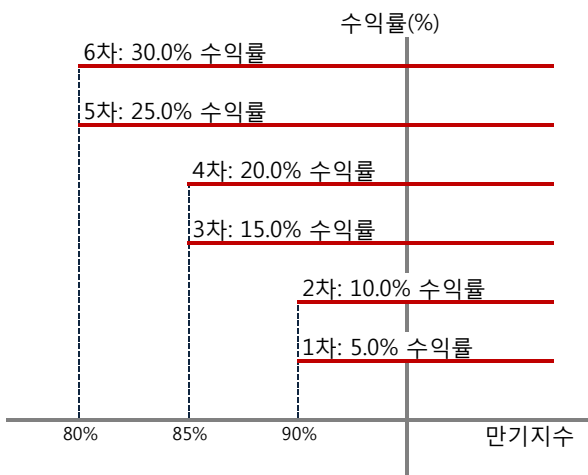
1. 계약금액

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

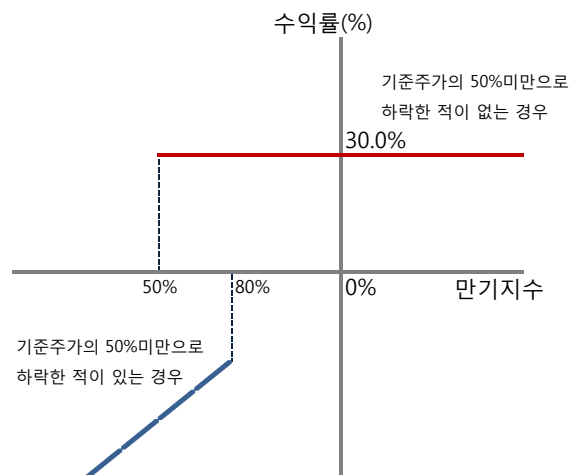
단위(백만원)

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 시나리오	8.00%	5.33%	2.67%	0.00%	-2.67%	-5.33%	-8.00%	
	94.14	94.45	78.78	47.13	(0.51)	(64.13)	(143.73)	
	78.43	78.74	63.07	31.42	(16.22)	(79.83)	(159.43)	
	62.72	63.03	47.36	15.71	(31.93)	(95.54)	(175.14)	
	47.01	47.32	31.65	0.00	(47.63)	(111.25)	(190.85)	
	31.30	31.61	15.94	(15.71)	(63.34)	(126.96)	(206.56)	
	15.59	15.91	0.24	(31.42)	(79.05)	(142.67)	(222.27)	
	(0.12)	0.20	(15.47)	(47.13)	(94.76)	(158.38)	(237.98)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR6503322176	신한투자(ELS)2982	59.18
KR6543311171	신영증권(ELS)2189	59.59
KR6553334170	우리투자증권(ELS)4750	57.89
KR6663322172	동양W(ELS)1040	61.32
총 최대손실 예상금액		237.98

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 216.00

메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

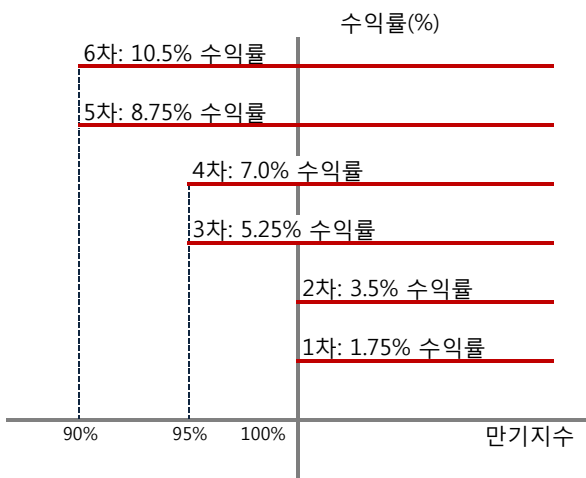
1. 계약금액

단위(백만원)

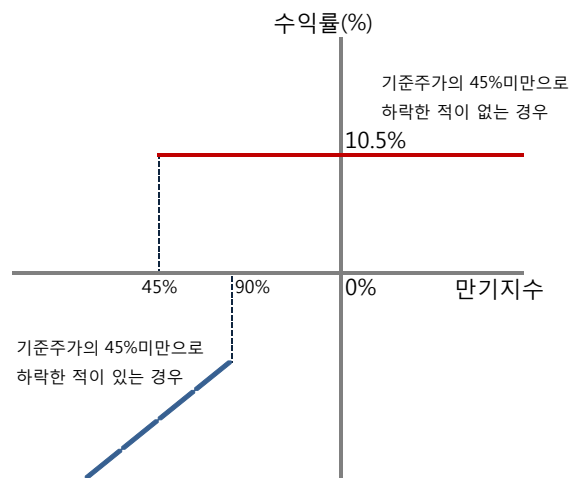
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

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	8.00%	(264.90)	(261.98)	(259.07)	(256.16)	(253.24)	(250.33)	(247.42)
자산	5.33%	(184.32)	(181.41)	(178.50)	(175.58)	(172.67)	(169.76)	(166.84)
사	2.67%	(98.94)	(96.02)	(93.11)	(90.20)	(87.28)	(84.37)	(81.46)
나	0.00%	(8.74)	(5.83)	(2.91)	0.00	2.91	5.83	8.74
리	-2.67%	86.27	89.18	92.10	95.01	97.92	100.84	103.75
오	-5.33%	186.09	189.01	191.92	194.83	197.75	200.66	203.57
시	-8.00%	290.73	293.64	296.56	299.47	302.38	305.30	308.21

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033AL250	신한투자(ELS)4533	64.96
KR65233AT259	대우증권(ELS)7497	68.28
KR65533BV256	우리투자증권(ELS)6128	68.08
KR6703394256	H&D증권(ELS)2764	63.57
총 최대손실 예상금액		264.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 389.04

메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제30호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

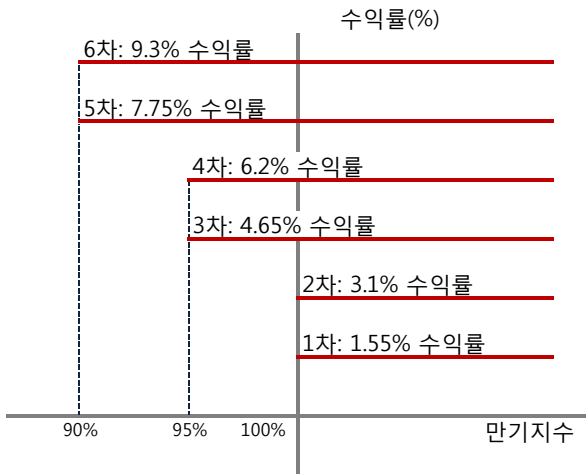
1. 계약금액

단위(백만원)

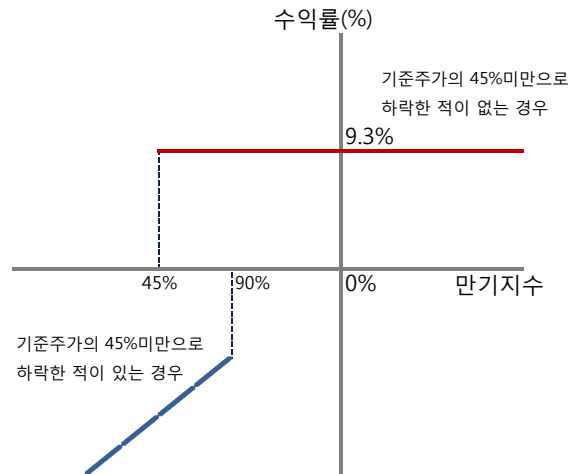
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

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	8.00%	(247.44)	(244.90)	(242.37)	(239.83)	(237.29)	(234.76)	(232.22)
	5.33%	(170.47)	(167.94)	(165.40)	(162.87)	(160.33)	(157.80)	(155.26)
	2.67%	(90.53)	(87.99)	(85.46)	(82.92)	(80.39)	(77.85)	(75.32)
자산 시나 리오	0.00%	(7.61)	(5.07)	(2.54)	0.00	2.54	5.07	7.61
	-2.67%	78.30	80.83	83.37	85.90	88.44	90.97	93.51
	-5.33%	167.18	169.71	172.25	174.78	177.32	179.85	182.39
	-8.00%	259.04	261.57	264.11	266.64	269.18	271.71	274.25

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233BT281	대우증권(ELS)8153	63.85
KR65533BB282	우리투자증권(ELS)6416	63.61
KR65733AY282	한국투자증권(ELS)2750	62.38
KR6583383288	현대증권(ELS)2012-2464	57.60
총 최대손실 예상금액		247.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

348.87

메리츠 주가지수연계 증권투자신탁 제31호[ELS-파생형]

공시일: 2012-10-23

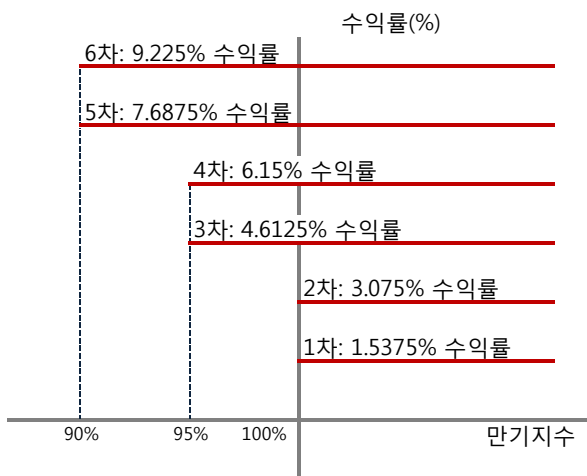
1. 계약금액

단위(백만원)

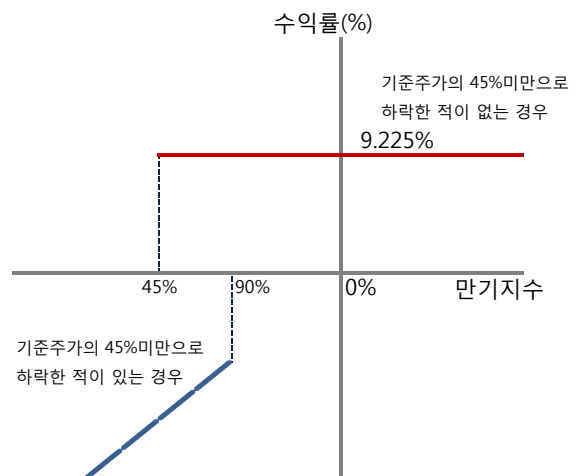
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

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	8.00%	(199.12)	(196.21)	(193.30)	(190.40)	(187.49)	(184.58)	(181.67)
	5.33%	(141.28)	(138.37)	(135.46)	(132.55)	(129.65)	(126.74)	(123.83)
자산 시나 리오	2.67%	(77.81)	(74.91)	(72.00)	(69.09)	(66.18)	(63.27)	(60.36)
	0.00%	(8.73)	(5.82)	(2.91)	0.00	2.91	5.82	8.73
	-2.67%	65.99	68.90	71.80	74.71	77.62	80.53	83.44
	-5.33%	146.32	149.23	152.14	155.05	157.96	160.87	163.78
	-8.00%	232.28	235.19	238.10	241.01	243.92	246.83	249.74

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523302299	대우증권(ELS)8158	51.48
KR6553351299	우리투자증권(ELS)6537	51.28
KR6573301290	한국투자증권(ELS)2749	50.26
KR6593336292	미래에셋증권(ELS)3955	46.11
총 최대손실 예상금액		199.12

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 291.84