

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

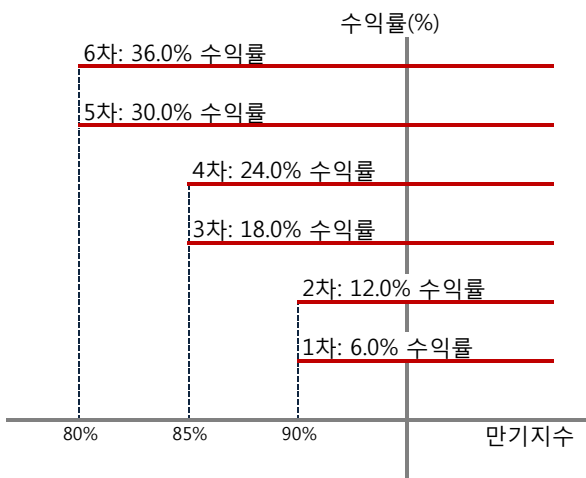
1. 계약금액

단위(백만원)

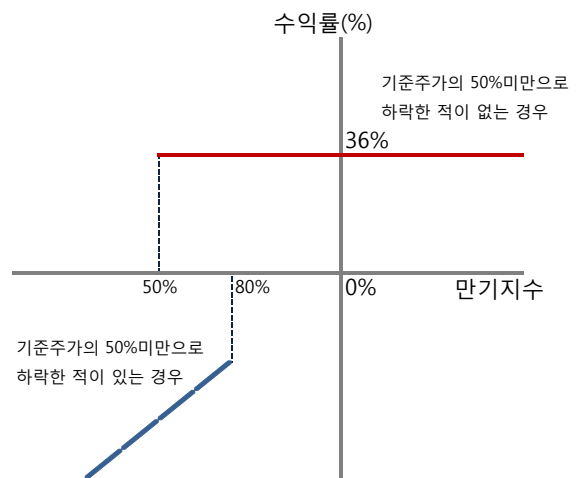
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,868	0	4,868	장외
누계	유가증권	ELS	4,868	0	4,868	장외

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%	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)
자산	5.33%	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)
사	2.67%	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)
나	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
리	-2.67%	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)
오	-5.33%	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)	(0.14)
시	-8.00%	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)	(0.31)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	0.03
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	0.09
KR6661350035	동양(ELS)520	0.09
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	0.09
총 최대손실 예상금액		0.31

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

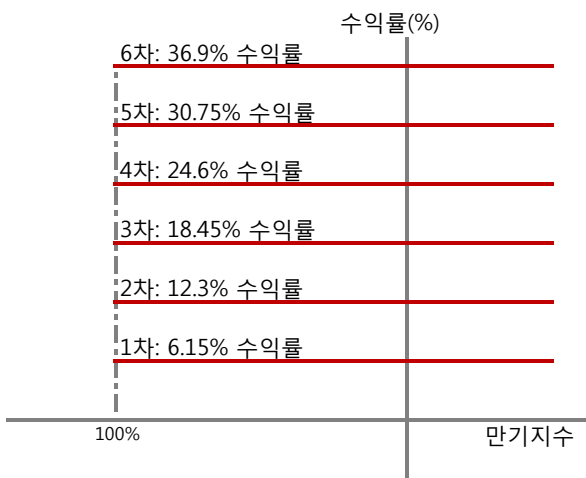
1. 계약금액

단위(백만원)

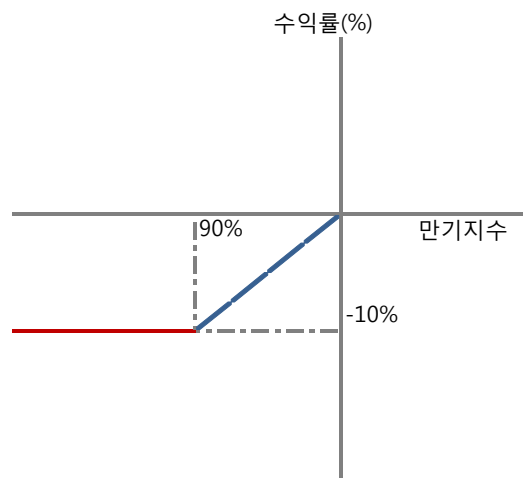
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,945	0	4,945	장외
누계	유가증권	ELS	4,945	0	4,945	장외

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	466.60	456.04	445.48	434.93	424.37	413.81	403.26	
자산	321.86	311.30	300.74	290.19	279.63	269.07	258.52	
시나	176.88	166.32	155.77	145.21	134.66	124.10	113.54	
리오	31.67	21.11	10.56	0.00	(10.56)	(21.11)	(31.67)	
	(113.78)	(124.34)	(134.89)	(145.45)	(156.00)	(166.56)	(177.12)	
	(259.46)	(270.02)	(280.58)	(291.13)	(301.69)	(312.24)	(322.80)	
	(405.38)	(415.94)	(426.50)	(437.05)	(447.61)	(458.16)	(468.72)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293160A1	대우증권ELS4537	120.13
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	107.15
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	120.32
KR66693120A9	동양W(ELS)927	121.13
총 최대손실 예상금액		468.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 491.92

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

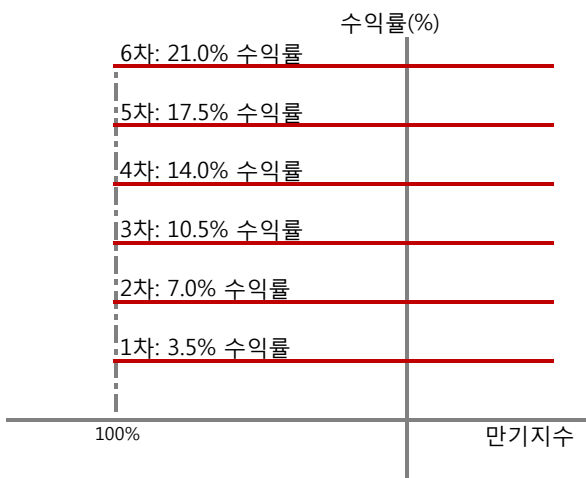
1. 계약금액

단위(백만원)

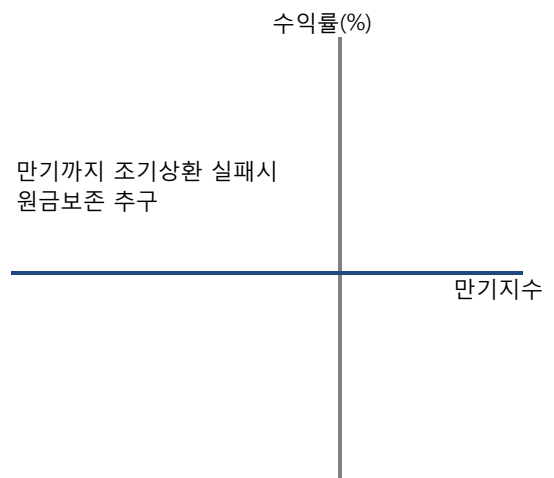
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,404	0	3,404	장외
누계	유가증권	ELS	3,404	0	3,404	장외

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	131.12	126.06	121.01	115.95	110.90	105.84	100.79	
자산	92.83	87.77	82.72	77.66	72.61	67.55	62.50	
시나리오	54.18	49.12	44.07	39.01	33.96	28.90	23.84	
	15.17	10.11	5.06	0.00	(5.06)	(10.11)	(15.17)	
	(24.21)	(29.26)	(34.32)	(39.37)	(44.43)	(49.48)	(54.54)	
	(63.94)	(68.99)	(74.05)	(79.10)	(84.16)	(89.21)	(94.27)	
	(104.03)	(109.08)	(114.14)	(119.19)	(124.25)	(129.30)	(134.36)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	34.55
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	34.66
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	34.71
KR66623360C2	동양W(ELS)950	30.44
총 최대손실 예상금액		134.36

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 137.74

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

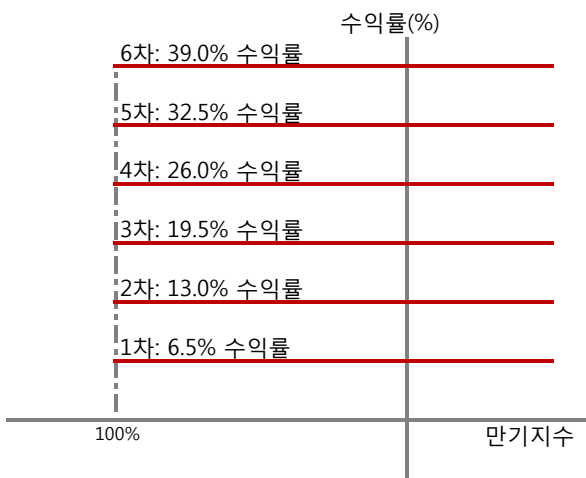
1. 계약금액

단위(백만원)

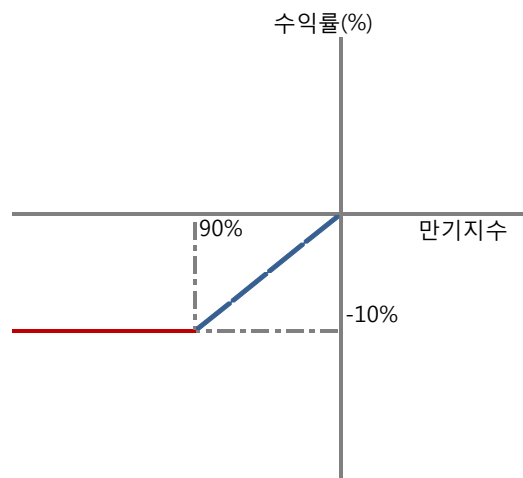
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,269	0	3,269	장외
누계	유가증권	ELS	3,269	0	3,269	장외

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	281.47	270.19	258.90	247.62	236.33	225.05	213.76	
자산	200.22	188.93	177.65	166.36	155.08	143.79	132.51	
시나리오	117.68	106.39	95.11	83.82	72.54	61.25	49.97	
	0.00%	22.57	11.29	0.00	(11.29)	(22.57)	(33.86)	
	-2.67%	(51.25)	(62.53)	(73.82)	(85.10)	(96.39)	(107.67)	
	-5.33%	(137.63)	(148.92)	(160.21)	(171.49)	(182.78)	(194.06)	
	-8.00%	(225.30)	(236.59)	(247.87)	(259.16)	(270.44)	(281.73)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	77.28
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	77.34
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	77.37
KR66623340C4	동양W(ELS)949	61.02
총 최대손실 예상금액		293.02

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 300.10

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

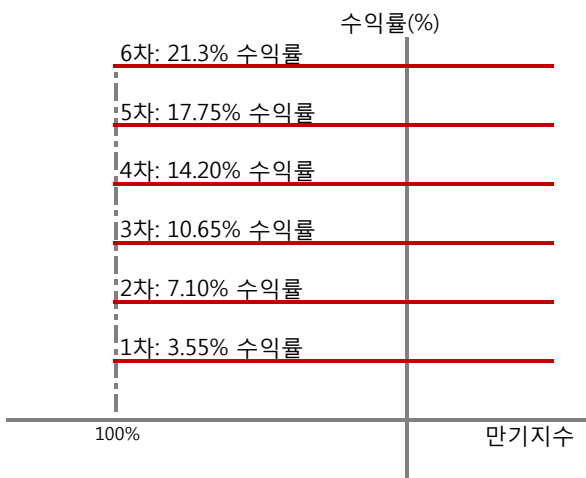
1. 계약금액

단위(백만원)

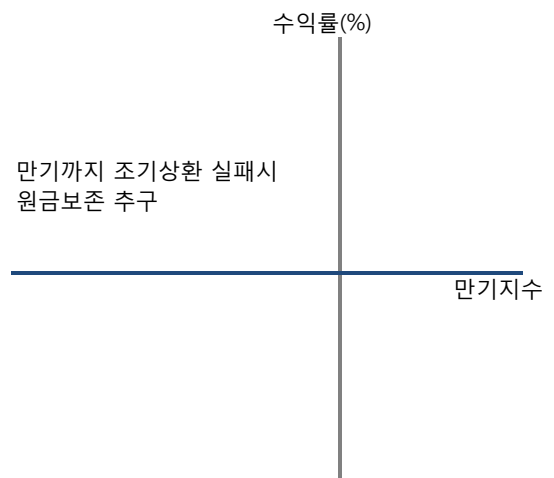
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외

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%	7.55	7.22	6.89	6.56	6.23	5.90	5.57
	5.33%	5.13	4.81	4.48	4.15	3.82	3.49	3.16
	2.67%	2.95	2.62	2.29	1.96	1.63	1.30	0.97
	0.00%	0.99	0.66	0.33	0.00	(0.33)	(0.66)	(0.99)
	-2.67%	(0.74)	(1.07)	(1.40)	(1.73)	(2.06)	(2.39)	(2.72)
	-5.33%	(2.25)	(2.58)	(2.91)	(3.24)	(3.57)	(3.90)	(4.23)
	-8.00%	(3.53)	(3.86)	(4.19)	(4.52)	(4.85)	(5.18)	(5.51)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	1.53
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	1.54
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.90
KR6662316126	동양W(ELS)974	1.54
총 최대손실 예상금액		5.51

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 6.50

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

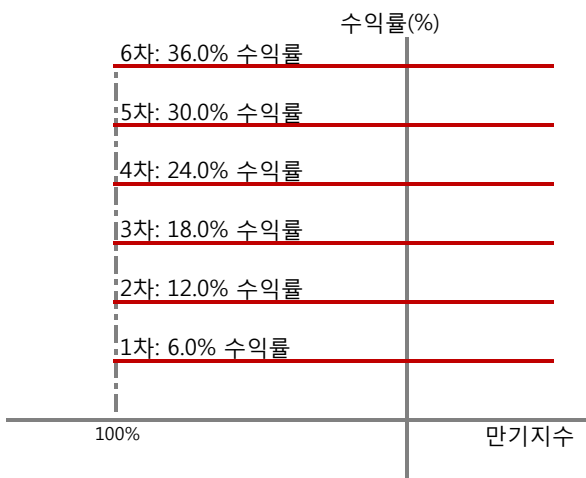
1. 계약금액

단위(백만원)

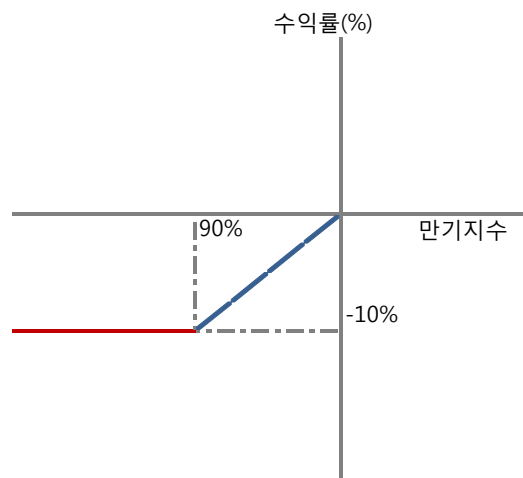
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	706	0	706	장외
누계	유가증권	ELS	706	0	706	장외

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%	13.51	12.90	12.30	11.69	11.09	10.48	9.88
	5.33%	9.26	8.65	8.05	7.44	6.84	6.23	5.63
	2.67%	5.36	4.76	4.15	3.55	2.94	2.34	1.73
	0.00%	1.81	1.21	0.60	0.00	(0.60)	(1.21)	(1.81)
	-2.67%	(1.38)	(1.99)	(2.59)	(3.19)	(3.80)	(4.40)	(5.01)
	-5.33%	(4.22)	(4.83)	(5.43)	(6.04)	(6.64)	(7.25)	(7.85)
	-8.00%	(6.72)	(7.32)	(7.93)	(8.53)	(9.14)	(9.74)	(10.34)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	2.72
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	2.21
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	2.72
KR6662317124	동양W(ELS)975	2.71
총 최대손실 예상금액		10.34

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

11.68

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

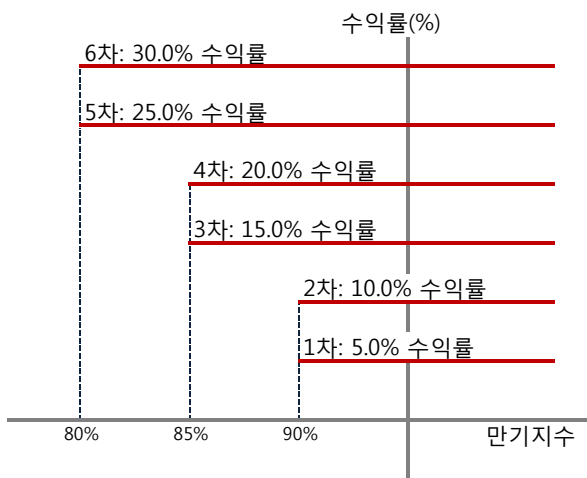
1. 계약금액

단위(백만원)

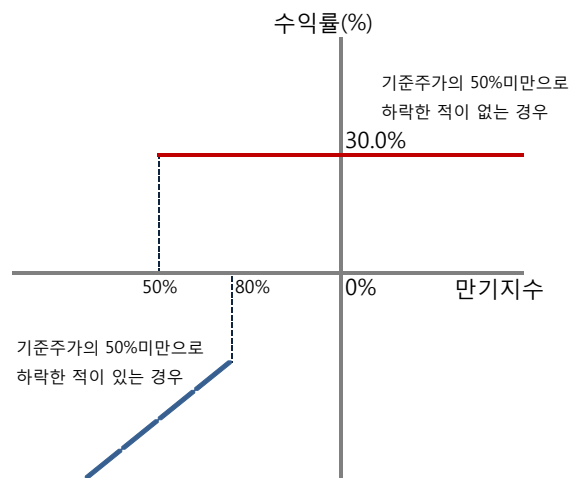
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,182	0	8,182	장외
누계	유가증권	ELS	8,182	0	8,182	장외

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	179.74	159.33	138.93	118.53	98.12	77.72	57.31	
자산	178.87	158.47	138.07	117.66	97.26	76.85	56.45	
시나리오	139.36	118.96	98.56	78.15	57.75	37.35	16.94	
	61.21	40.81	20.40	0.00	(20.40)	(40.81)	(61.21)	
	(55.59)	(75.99)	(96.40)	(116.80)	(137.20)	(157.61)	(178.01)	
	(211.03)	(231.44)	(251.84)	(272.24)	(292.65)	(313.05)	(333.45)	
	(405.12)	(425.53)	(445.93)	(466.33)	(486.74)	(507.14)	(527.54)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	143.67
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	143.97
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	116.27
KR6662374141	동양W(ELS)1004	123.63
총 최대손실 예상금액		527.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	550.67
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

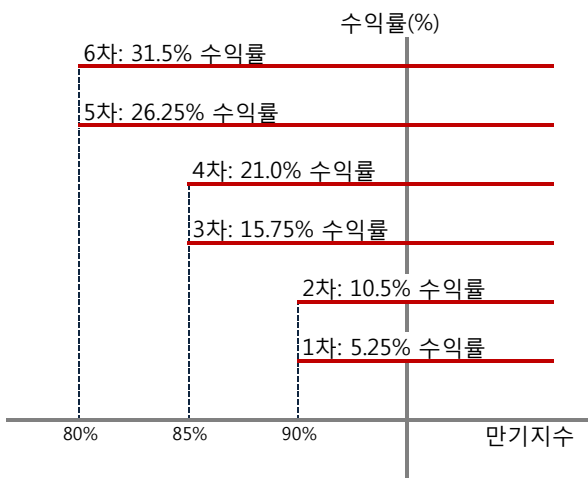
1. 계약금액

단위(백만원)

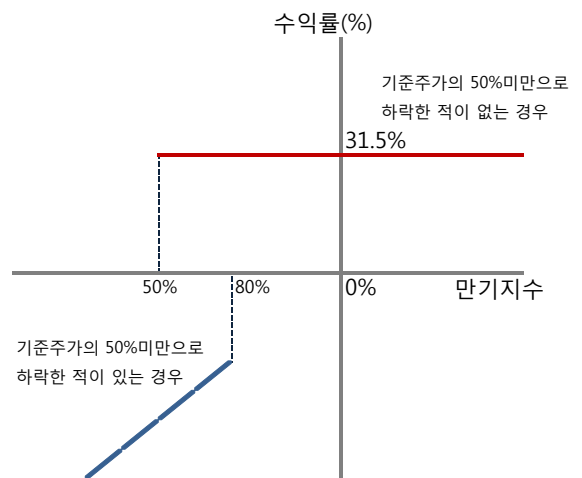
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,290	0	4,290	장외
누계	유가증권	ELS	4,290	0	4,290	장외

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 자산 시나리오	8.00%	(7.27)	(7.78)	(8.29)	(8.80)	(9.31)	(9.82)	(10.33)
	5.33%	(4.25)	(4.76)	(5.27)	(5.78)	(6.29)	(6.80)	(7.31)
	2.67%	(1.32)	(1.83)	(2.34)	(2.85)	(3.36)	(3.87)	(4.38)
	0.00%	1.53	1.02	0.51	0.00	(0.51)	(1.02)	(1.53)
	-2.67%	4.29	3.78	3.27	2.76	2.25	1.74	1.23
	-5.33%	6.96	6.45	5.94	5.43	4.92	4.41	3.90
	-8.00%	9.54	9.03	8.52	8.01	7.50	6.99	6.48

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	2.91
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	3.04
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	2.97
KR6663346155	동양W(ELS)1009	1.41
총 최대손실 예상금액		10.33

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

16.65

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

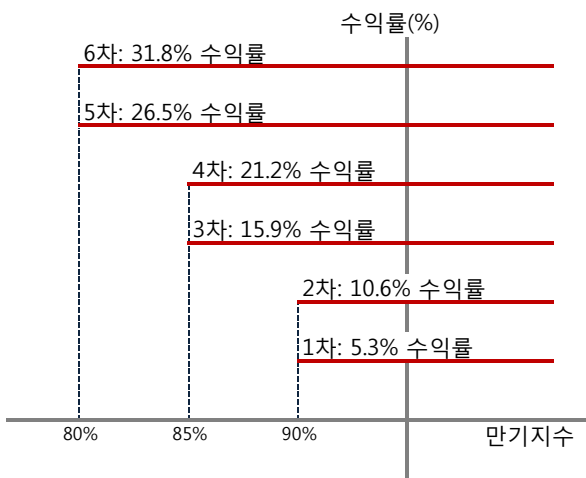
1. 계약금액

단위(백만원)

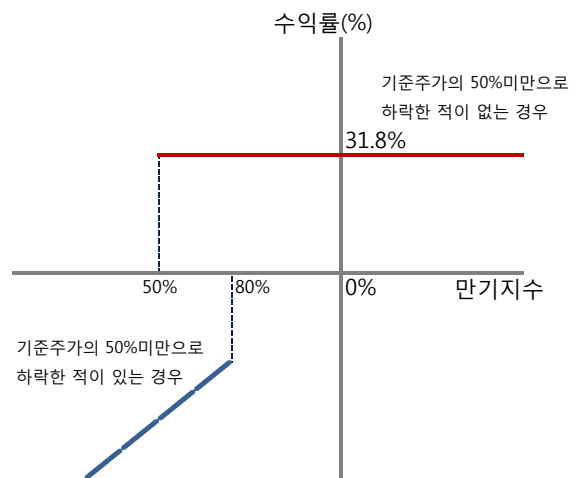
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,537	0	6,537	장외
누계	유가증권	ELS	6,537	0	6,537	장외

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%	(6.92)	(7.60)	(8.28)	(8.97)	(9.65)	(10.33)	(11.01)
자산	5.33%	(3.68)	(4.37)	(5.05)	(5.73)	(6.42)	(7.10)	(7.78)
사	2.67%	(0.70)	(1.38)	(2.06)	(2.74)	(3.43)	(4.11)	(4.79)
나	0.00%	2.05	1.37	0.68	0.00	(0.68)	(1.37)	(2.05)
리	-2.67%	4.55	3.87	3.18	2.50	1.82	1.13	0.45
오	-5.33%	6.80	6.12	5.44	4.75	4.07	3.39	2.71
시	-8.00%	8.81	8.13	7.45	6.76	6.08	5.40	4.72

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	2.17
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	3.03
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	2.78
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	3.03
총 최대손실 예상금액		11.01

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.71
-----	------

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

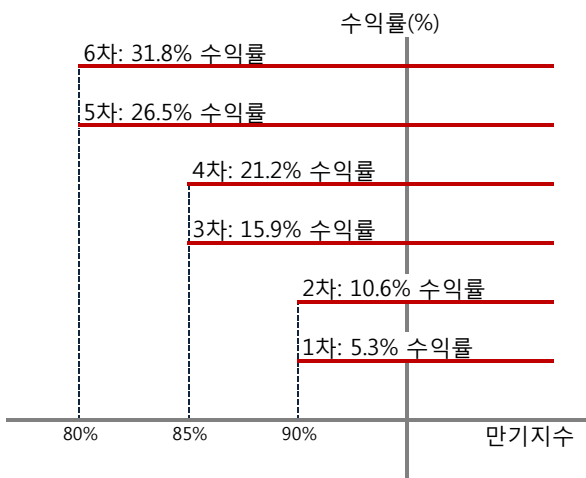
1. 계약금액

단위(백만원)

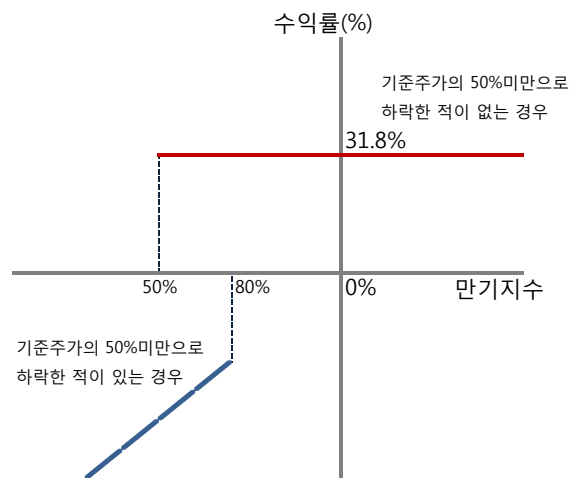
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,982	0	4,982	장외
누계	유가증권	ELS	4,982	0	4,982	장외

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%	(6.49)	(7.10)	(7.71)	(8.32)	(8.92)	(9.53)	(10.14)
자산	5.33%	(3.22)	(3.82)	(4.43)	(5.04)	(5.65)	(6.26)	(6.86)
시나	2.67%	(0.44)	(1.05)	(1.66)	(2.27)	(2.88)	(3.48)	(4.09)
리오	0.00%	1.82	1.22	0.61	0.00	(0.61)	(1.22)	(1.82)
	-2.67%	3.59	2.98	2.37	1.76	1.16	0.55	(0.06)
	-5.33%	4.85	4.24	3.63	3.03	2.42	1.81	1.20
	-8.00%	5.61	5.00	4.39	3.78	3.18	2.57	1.96

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6503341168	신한투자(ELS)2834	2.85
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	1.85
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	2.85
KR6663324160	동양W(ELS)1028	2.59
총 최대손실 예상금액		10.14

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.64
-----	------

메리츠주가지수연계증권제27호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

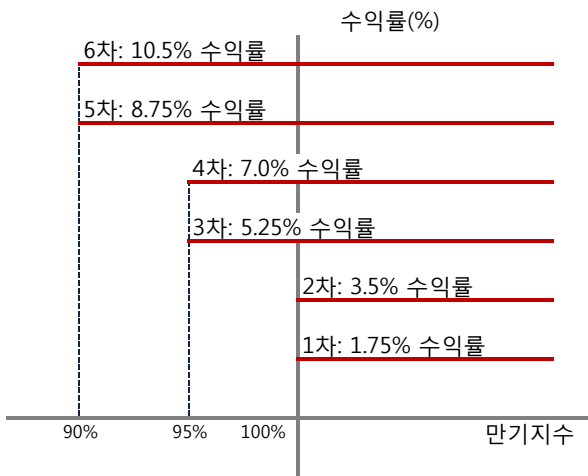
1. 계약금액

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

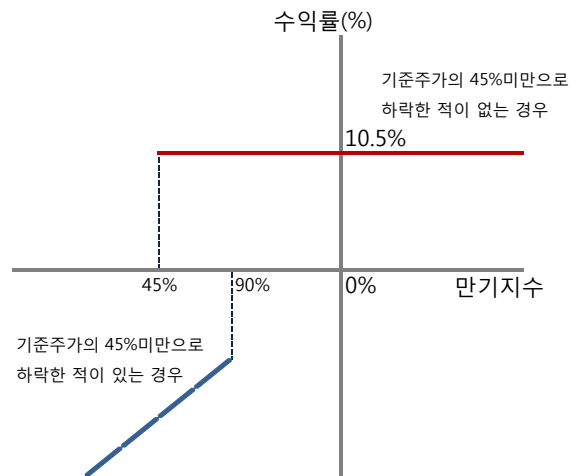
단위(백만원)

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	8.00%	150.12	150.46	150.80	151.14	151.48	151.82	152.16
자산	5.33%	58.23	58.57	58.91	59.25	59.59	59.93	60.27
시나	2.67%	7.85	8.19	8.53	8.87	9.21	9.55	9.89
리오	0.00%	(1.02)	(0.68)	(0.34)	0.00	0.34	0.68	1.02
	-2.67%	31.63	31.97	32.31	32.65	32.99	33.33	33.67
	-5.33%	105.78	106.12	106.46	106.80	107.14	107.48	107.82
	-8.00%	221.46	221.79	222.13	222.47	222.81	223.15	223.49

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	최대손실 예상금액
KR65033AL250	신한투자(ELS)4533	0.25
KR65233AT259	대우증권(ELS)7497	0.26
KR65533BV256	우리투자증권(ELS)6128	0.26
KR6703394256	H&D증권(ELS)2764	0.24
총 최대손실 예상금액		1.02

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 156.73

메리츠주가지수연계증권제30호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

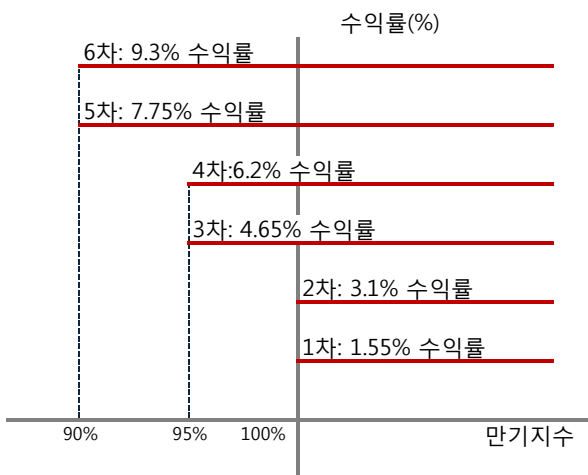
1. 계약금액

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

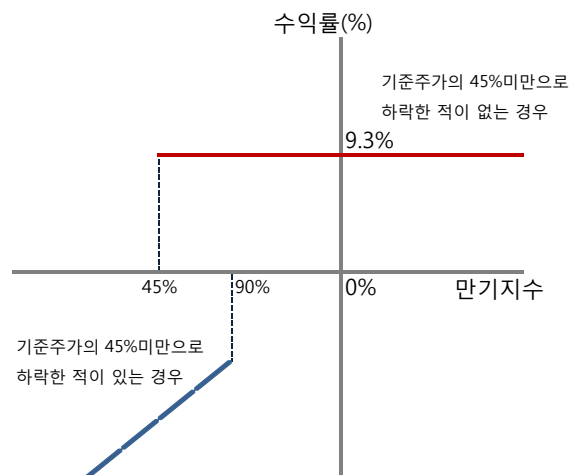
단위(백만원)

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%	(140.78)	(138.76)	(136.74)	(134.73)	(132.71)	(130.69)	(128.67)
자산	5.33%	(107.48)	(105.46)	(103.44)	(101.43)	(99.41)	(97.39)	(95.37)
시나	2.67%	(62.57)	(60.55)	(58.54)	(56.52)	(54.50)	(52.48)	(50.46)
리오	0.00%	(6.06)	(4.04)	(2.02)	0.00	2.02	4.04	6.06
	-2.67%	62.07	64.09	66.11	68.13	70.14	72.16	74.18
	-5.33%	141.81	143.82	145.84	147.86	149.88	151.90	153.92
	-8.00%	233.15	235.17	237.19	239.21	241.22	243.24	245.26

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233BT281	대우증권(ELS)8153	35.85
KR65533BB282	우리투자증권(ELS)6416	35.72
KR65733AY282	한국투자증권(ELS)2750	35.27
KR6583383288	현대증권(ELS)2012-2464	33.94
총 최대손실 예상금액		140.78

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 311.61

메리츠주가지수연계증권제31호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

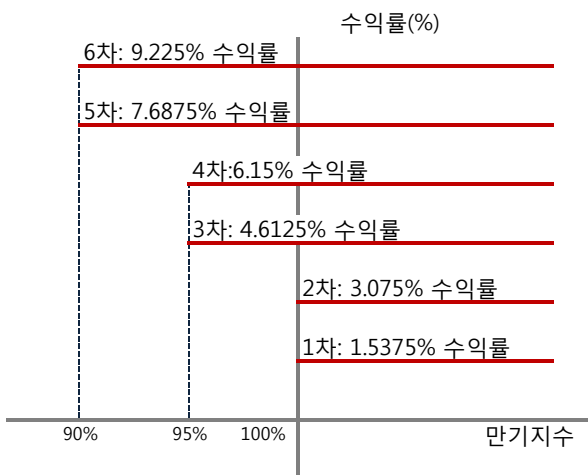
1. 계약금액

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

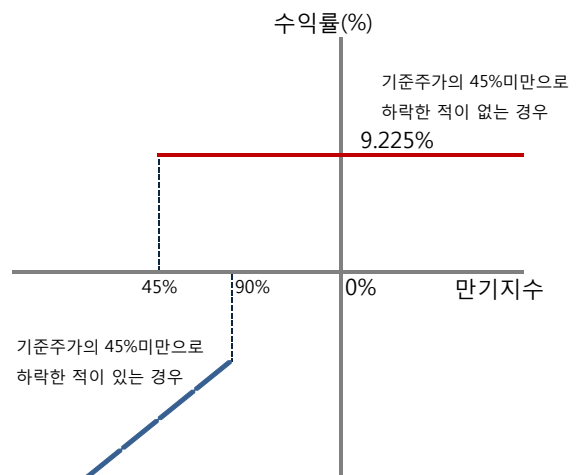
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							단위(백만원)
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(118.85)	(116.87)	(114.89)	(112.91)	(110.93)	(108.95)	(106.97)
	5.33%	(92.27)	(90.29)	(88.32)	(86.34)	(84.36)	(82.38)	(80.40)
	2.67%	(54.64)	(52.66)	(50.68)	(48.70)	(46.72)	(44.74)	(42.76)
	0.00%	(5.94)	(3.96)	(1.98)	0.00	1.98	3.96	5.94
	-2.67%	53.82	55.80	57.78	59.76	61.74	63.72	65.70
	-5.33%	124.64	126.62	128.60	130.58	132.56	134.54	136.52
	-8.00%	206.52	208.50	210.48	212.46	214.44	216.42	218.39

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR6523302299	대우증권(ELS)8158	30.45
KR6553351299	우리투자증권(ELS)6537	30.34
KR6573301290	한국투자증권(ELS)2749	29.92
KR6593336292	미래에셋증권(ELS)3955	28.13
총 최대손실 예상금액		118.85

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 257.62

메리츠 2스타증권 KS-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

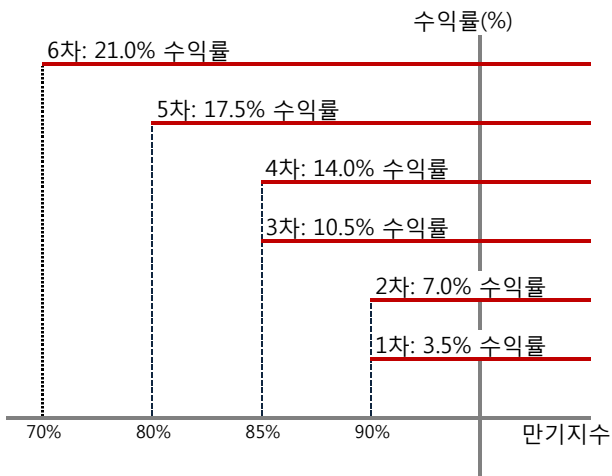
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	621	0	621	장외
누계	유가증권	ELS	621	0	621	장외

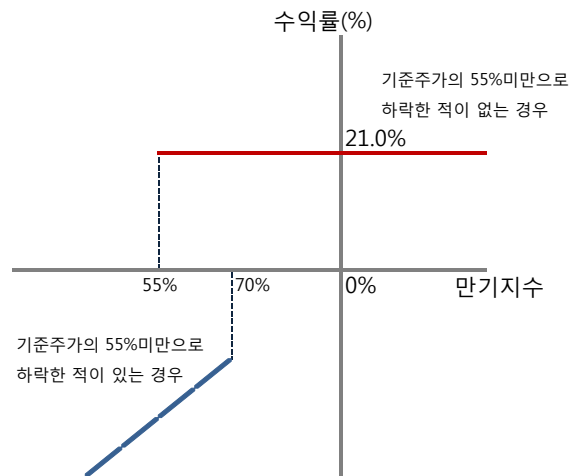
단위(백만원)

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	25.96	22.33	18.70	15.07	11.44	7.81	4.19	
시나리오	21.74	18.11	14.48	10.86	7.23	3.60	(0.03)	
리오	16.72	13.09	9.46	5.83	2.20	(1.42)	(5.05)	
	10.88	7.26	3.63	0.00	(3.63)	(7.26)	(10.88)	
	4.24	0.61	(3.01)	(6.64)	(10.27)	(13.90)	(17.53)	
	(3.21)	(6.84)	(10.47)	(14.09)	(17.72)	(21.35)	(24.98)	
	(11.47)	(15.10)	(18.73)	(22.35)	(25.98)	(29.61)	(33.24)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	최대손실 예상금액
KR6502366315	신한투자(ELS)6143	8.15
KR6522359316	대우증권(ELS)8664	8.39
KR6621312315	교보증권(ELS)10007	8.20
KR6772307312	KB STAR(ELS)334	8.49
총 최대손실 예상금액		33.24

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 29.86

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-01-31

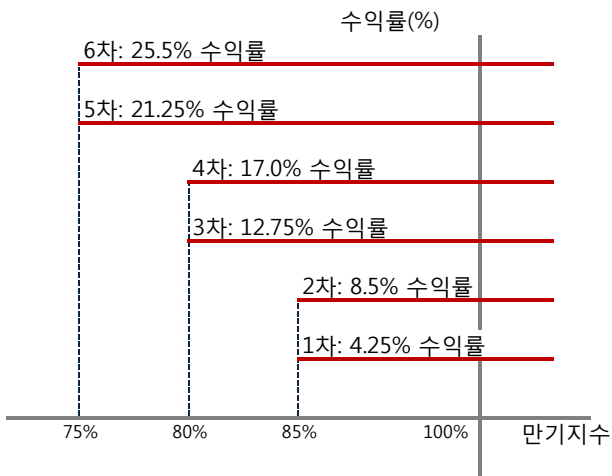
1. 계약금액

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

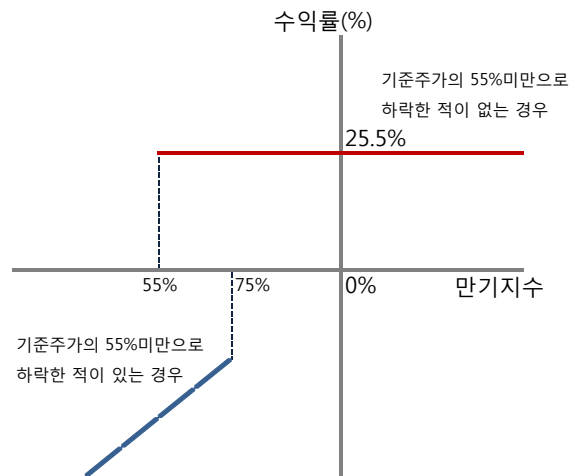
단위(백만원)

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 시나 리오	8.00%	99.62	86.33	73.05	59.76	46.48	33.19	19.91
	5.33%	82.98	69.70	56.41	43.13	29.84	16.56	3.27
	2.67%	63.06	49.78	36.49	23.21	9.92	(3.36)	(16.65)
	0.00%	39.85	26.57	13.28	0.00	(13.28)	(26.57)	(39.85)
	-2.67%	13.36	0.08	(13.21)	(26.49)	(39.78)	(53.06)	(66.35)
	-5.33%	(16.42)	(29.70)	(42.99)	(56.27)	(69.55)	(82.84)	(96.12)
	-8.00%	(49.48)	(62.76)	(76.05)	(89.33)	(102.62)	(115.90)	(129.19)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	32.08
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	32.30
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	32.52
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	32.28
총 최대손실 예상금액		129.19

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 164.17