

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

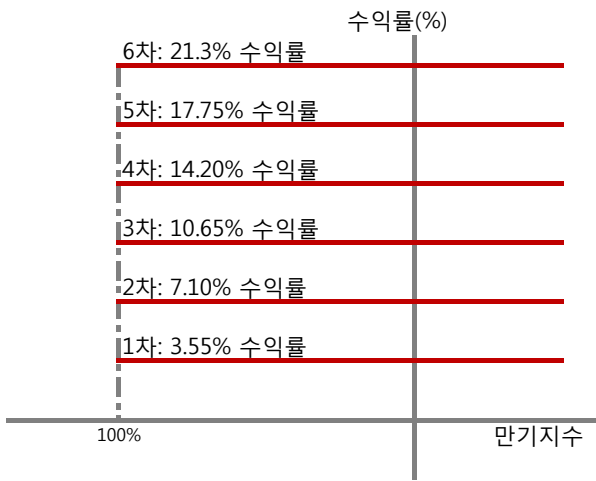
1. 계약금액

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

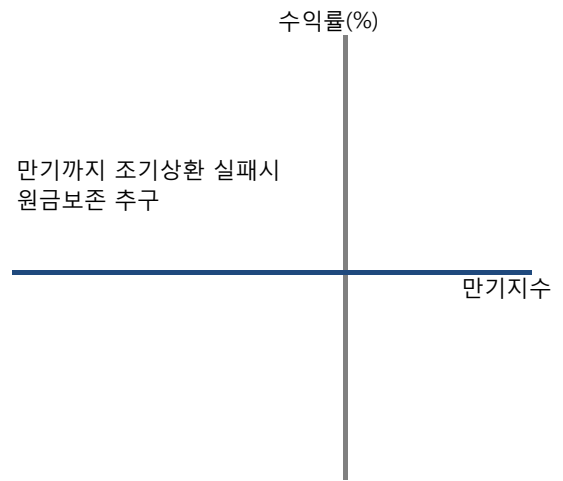
단위(백만원)

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%	0.26	0.25	0.25	0.24	0.23	0.23	0.22
자산	5.33%	0.16	0.16	0.15	0.15	0.14	0.13	0.13
시나	2.67%	0.08	0.08	0.07	0.07	0.06	0.05	0.05
리오	0.00%	0.02	0.01	0.01	0.00	(0.01)	(0.01)	(0.02)
	-2.67%	(0.03)	(0.04)	(0.05)	(0.05)	(0.06)	(0.06)	(0.07)
	-5.33%	(0.07)	(0.08)	(0.08)	(0.09)	(0.10)	(0.10)	(0.11)
	-8.00%	(0.10)	(0.10)	(0.11)	(0.11)	(0.12)	(0.13)	(0.13)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.04
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.04
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.02
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.04
총 최대손실 예상금액		0.13

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

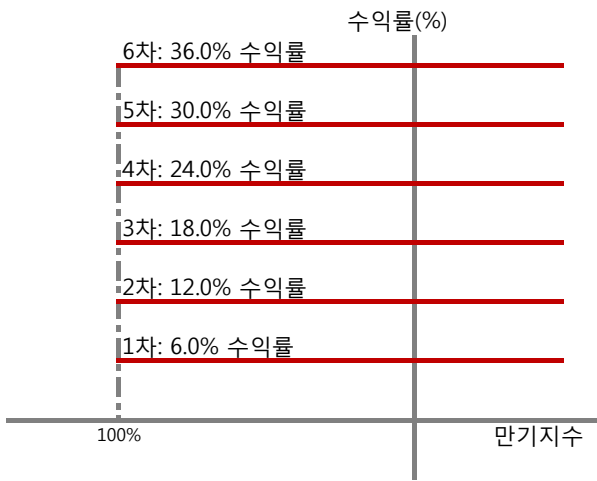
1. 계약금액

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

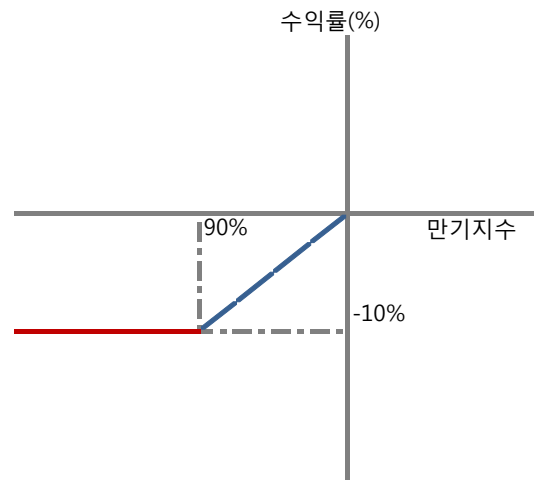
단위(백만원)

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%	1.90	1.89	1.88	1.87	1.85	1.84	1.83
	5.33%	1.16	1.15	1.14	1.12	1.11	1.10	1.09
	2.67%	0.54	0.53	0.51	0.50	0.49	0.48	0.47
	0.00%	0.04	0.02	0.01	0.00	(0.01)	(0.02)	(0.04)
	-2.67%	(0.35)	(0.36)	(0.37)	(0.38)	(0.39)	(0.41)	(0.42)
	-5.33%	(0.61)	(0.62)	(0.63)	(0.64)	(0.66)	(0.67)	(0.68)
	-8.00%	(0.75)	(0.76)	(0.77)	(0.79)	(0.80)	(0.81)	(0.82)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	0.22
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	0.18
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	0.22
KR6662317124	동양W(ELS)975	0.22
총 최대손실 예상금액		0.82

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.76
-----	------

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

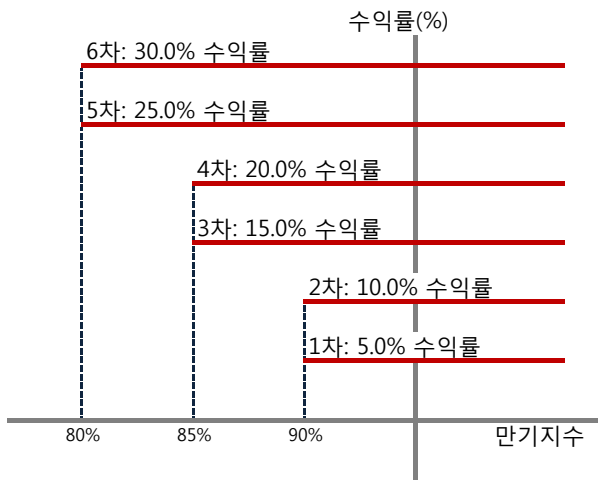
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	7,934	0	7,934	장외
누계	유가증권	ELS	7,934	0	7,934	장외

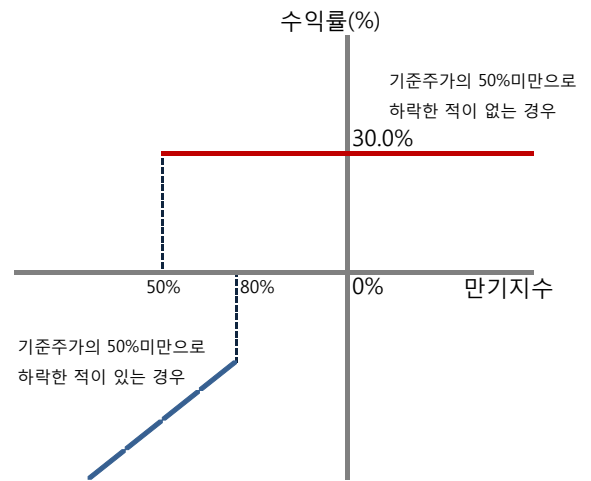
단위(백만원)

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%	(45.21)	(49.78)	(54.34)	(58.91)	(63.47)	(68.04)	(72.60)
	5.33%	20.74	16.18	11.61	7.04	2.48	(2.09)	(6.65)
	2.67%	40.38	35.81	31.25	26.68	22.11	17.55	12.98
	0.00%	13.70	9.13	4.57	0.00	(4.57)	(9.13)	(13.70)
	-2.67%	(59.30)	(63.86)	(68.43)	(73.00)	(77.56)	(82.13)	(86.69)
	-5.33%	(178.61)	(183.18)	(187.74)	(192.31)	(196.87)	(201.44)	(206.00)
	-8.00%	(344.24)	(348.80)	(353.37)	(357.93)	(362.50)	(367.07)	(371.63)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	102.18
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	102.13
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	70.64
KR6662374141	동양W(ELS)1004	96.68
총 최대손실 예상금액		371.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	375.62
-----	--------

메리츠한중지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

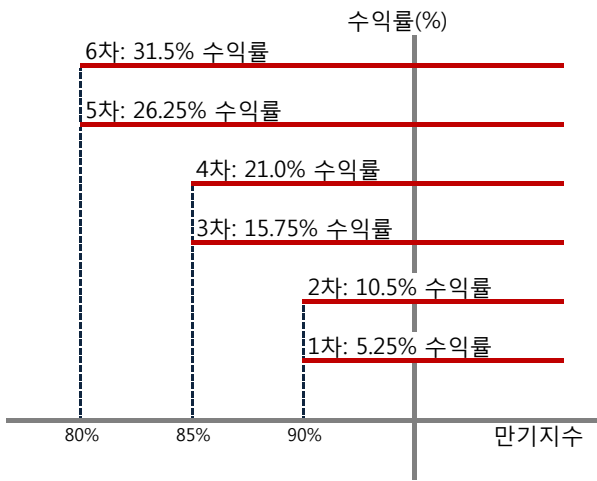
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,022	0	4,022	장외
누계	유가증권	ELS	4,022	0	4,022	장외

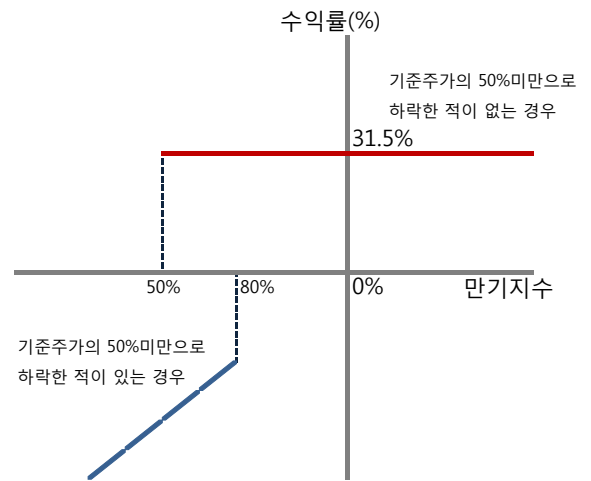
단위(백만원)

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 시나리오	8.00%	(25.94)	(26.47)	(27.00)	(27.53)	(28.06)	(28.59)	(29.12)
	5.33%	(14.31)	(14.84)	(15.37)	(15.90)	(16.43)	(16.97)	(17.50)
	2.67%	(5.14)	(5.67)	(6.20)	(6.73)	(7.26)	(7.79)	(8.32)
	0.00%	1.59	1.06	0.53	0.00	(0.53)	(1.06)	(1.59)
	-2.67%	5.87	5.34	4.81	4.28	3.75	3.22	2.69
	-5.33%	7.71	7.18	6.65	6.12	5.59	5.06	4.53
	-8.00%	7.10	6.57	6.04	5.50	4.97	4.44	3.91

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	7.26
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	8.89
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	8.86
KR6663346155	동양W(ELS)1009	4.10
총 최대손실 예상금액		29.12

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.96
-----	-------

메리츠한중지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

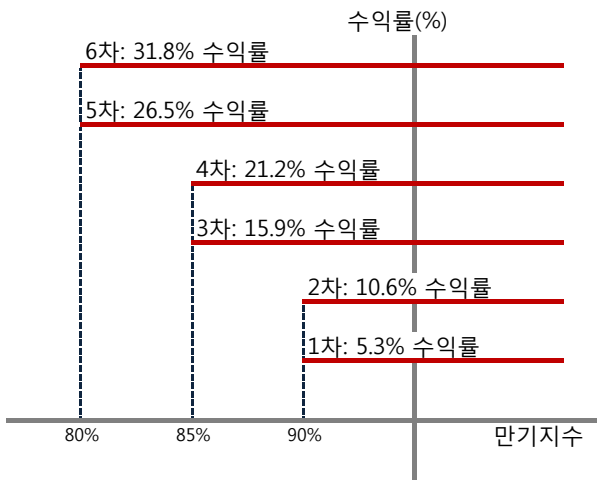
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,782	0	4,782	장외
누계	유가증권	ELS	4,782	0	4,782	장외

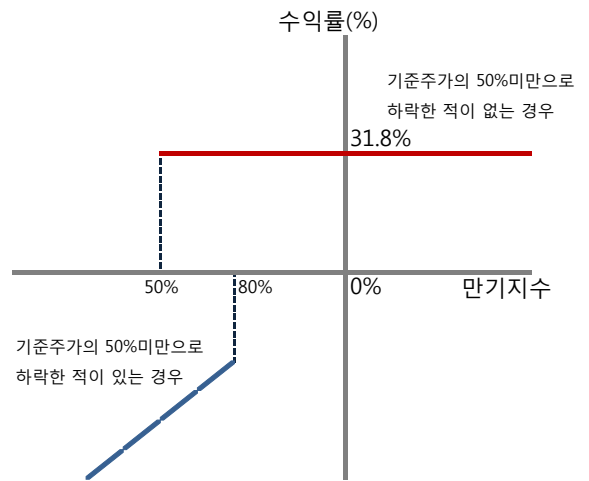
단위(백만원)

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%	(26.39)	(27.61)	(28.83)	(30.05)	(31.26)	(32.48)	(33.70)
	5.33%	(11.25)	(12.47)	(13.69)	(14.91)	(16.12)	(17.34)	(18.56)
	2.67%	(1.23)	(2.45)	(3.67)	(4.89)	(6.11)	(7.33)	(8.55)
	0.00%	3.66	2.44	1.22	0.00	(1.22)	(2.44)	(3.66)
	-2.67%	3.42	2.20	0.98	(0.23)	(1.45)	(2.67)	(3.89)
	-5.33%	(1.94)	(3.16)	(4.37)	(5.59)	(6.81)	(8.03)	(9.25)
	-8.00%	(12.42)	(13.64)	(14.86)	(16.08)	(17.30)	(18.51)	(19.73)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	9.88
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	6.45
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	9.96
KR6663324160	동양W(ELS)1028	7.41
총 최대손실 예상금액		33.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.16
-----	------

메리츠 2스타증권 KS-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

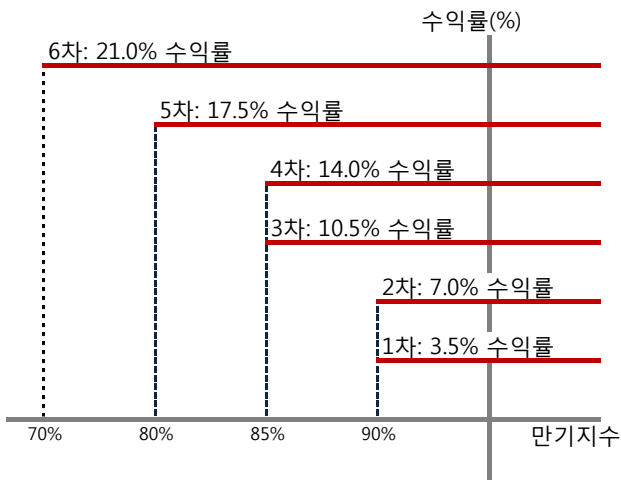
1. 계약금액

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

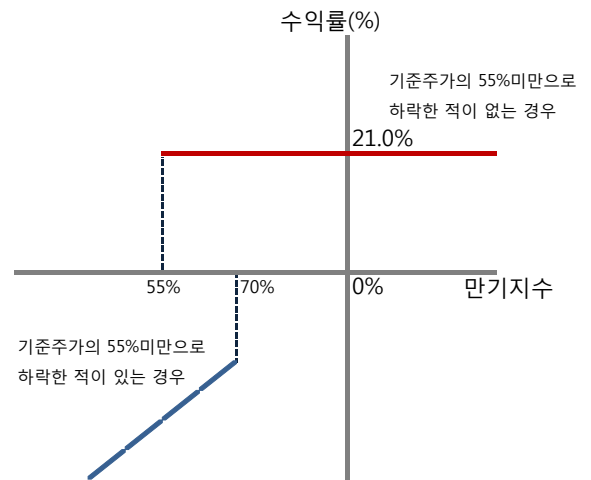
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	15.93	13.78	11.64	9.50	7.35	5.21	3.06
	5.33%	13.87	11.73	9.59	7.44	5.30	3.16	1.01
	2.67%	10.71	8.57	6.42	4.28	2.13	(0.01)	(2.15)
	0.00%	6.43	4.29	2.14	0.00	(2.14)	(4.29)	(6.43)
	-2.67%	1.04	(1.10)	(3.25)	(5.39)	(7.53)	(9.68)	(11.82)
	-5.33%	(5.46)	(7.60)	(9.75)	(11.89)	(14.04)	(16.18)	(18.32)
	-8.00%	(13.08)	(15.22)	(17.36)	(19.51)	(21.65)	(23.80)	(25.94)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502366315	신한투자(ELS)6143	6.46
KR6522359316	대우증권(ELS)8664	6.42
KR6621312315	교보증권(ELS)10007	6.53
KR6772307312	KB STAR(ELS)334	6.54
총 최대손실 예상금액		25.94

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 35.42

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

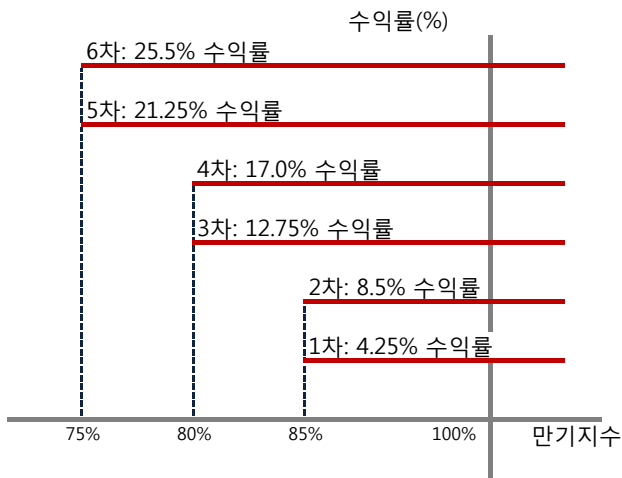
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,514	0	2,514	장외
누계	유가증권	ELS	2,514	0	2,514	장외

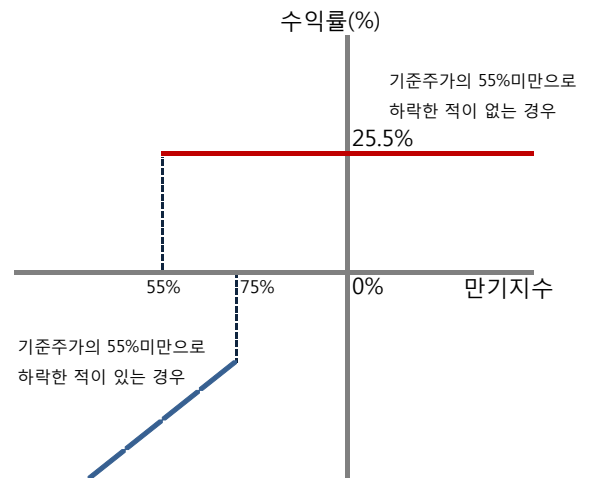
단위(백만원)

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%	56.04	49.14	42.25	35.35	28.45	21.56	14.66
	5.33%	49.15	42.25	35.36	28.46	21.56	14.67	7.77
	2.67%	37.37	30.47	23.57	16.68	9.78	2.88	(4.01)
	0.00%	20.69	13.79	6.90	0.00	(6.90)	(13.79)	(20.69)
	-2.67%	(0.88)	(7.78)	(14.67)	(21.57)	(28.47)	(35.36)	(42.26)
	-5.33%	(27.34)	(34.24)	(41.13)	(48.03)	(54.93)	(61.82)	(68.72)
	-8.00%	(58.70)	(65.59)	(72.49)	(79.38)	(86.28)	(93.18)	(100.07)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	25.05
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	25.28
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	24.60
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	25.15
총 최대손실 예상금액		100.07

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 111.68

메리트 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

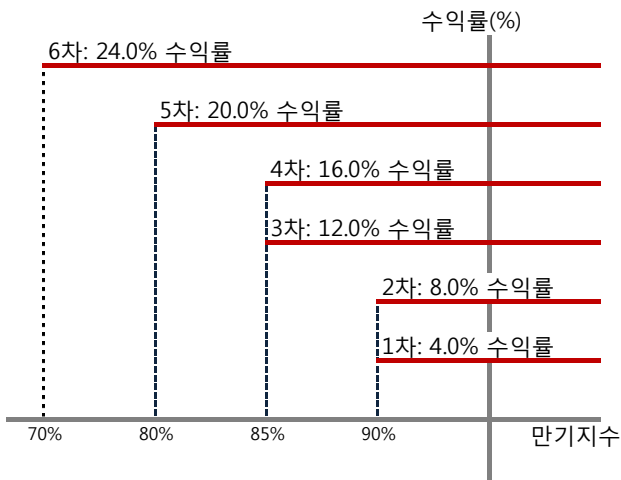
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,244	0	5,244	장외
누계	유가증권	ELS	5,244	0	5,244	장외

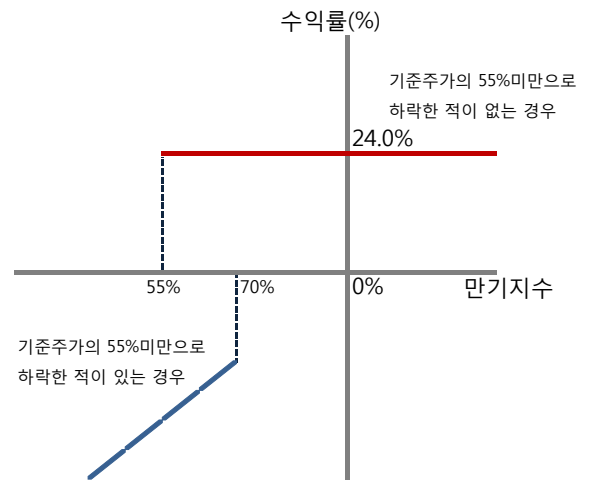
단위(백만원)

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%	129.91	112.24	94.56	76.89	59.21	41.53	23.86
	5.33%	111.49	93.82	76.14	58.46	40.79	23.11	5.44
	2.67%	85.86	68.19	50.51	32.84	15.16	(2.52)	(20.19)
	0.00%	53.03	35.35	17.68	0.00	(17.68)	(35.35)	(53.03)
	-2.67%	12.98	(4.69)	(22.37)	(40.04)	(57.72)	(75.40)	(93.07)
	-5.33%	(34.27)	(51.94)	(69.62)	(87.30)	(104.97)	(122.65)	(140.32)
	-8.00%	(88.73)	(106.40)	(124.08)	(141.76)	(159.43)	(177.11)	(194.78)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	48.56
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	48.32
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	48.96
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	48.96
총 최대손실 예상금액		194.78

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 193.13

메리츠 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

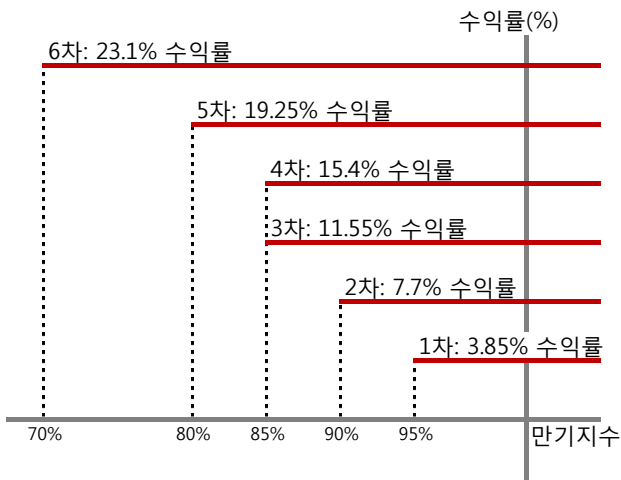
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,173	0	1,173	장외
누계	유가증권	ELS	1,173	0	1,173	장외

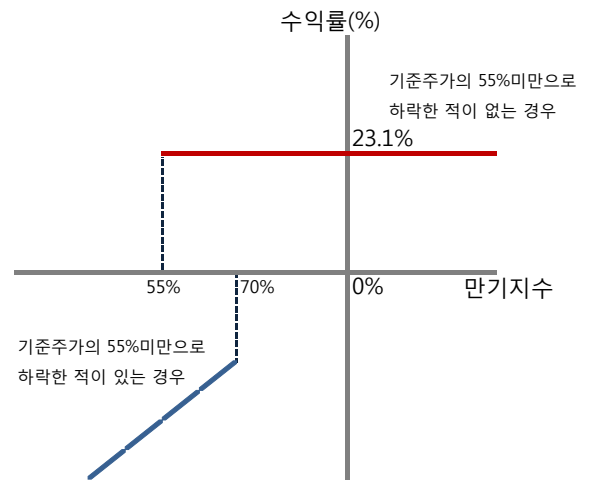
단위(백만원)

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%	37.27	31.93	26.59	21.25	15.92	10.58	5.24
	5.33%	31.83	26.49	21.15	15.81	10.47	5.14	(0.20)
	2.67%	24.75	19.41	14.07	8.73	3.39	(1.95)	(7.29)
	0.00%	16.02	10.68	5.34	0.00	(5.34)	(10.68)	(16.02)
	-2.67%	5.64	0.31	(5.03)	(10.37)	(15.71)	(21.05)	(26.39)
	-5.33%	(6.37)	(11.71)	(17.05)	(22.39)	(27.73)	(33.07)	(38.41)
	-8.00%	(20.04)	(25.38)	(30.72)	(36.05)	(41.39)	(46.73)	(52.07)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	13.02
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	12.94
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	12.97
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	13.14
총 최대손실 예상금액		52.07

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 44.23

메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-09-17

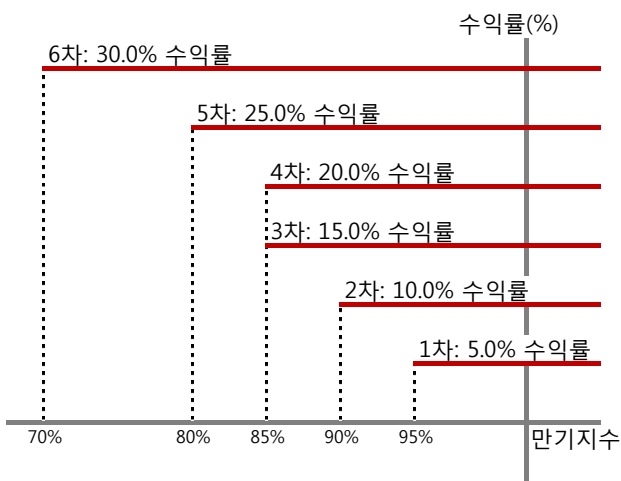
1. 계약금액

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

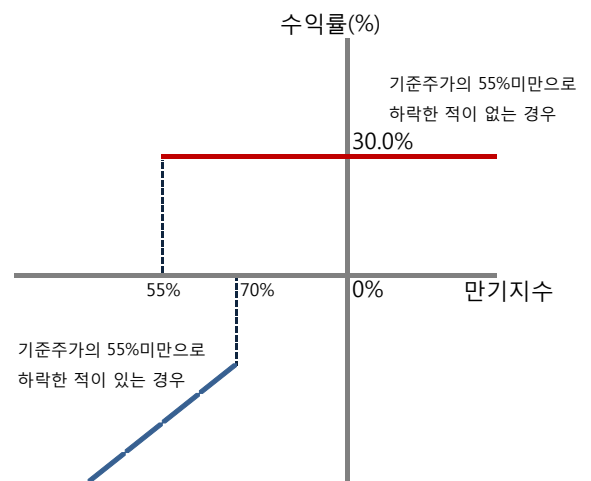
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	47.37	40.33	33.30	26.27	19.23	12.20	5.17
	5.33%	40.50	33.46	26.43	19.40	12.36	5.33	(1.71)
	2.67%	31.74	24.71	17.67	10.64	3.61	(3.43)	(10.46)
	0.00%	21.10	14.07	7.03	0.00	(7.03)	(14.07)	(21.10)
	-2.67%	8.58	1.54	(5.49)	(12.52)	(19.56)	(26.59)	(33.62)
	-5.33%	(5.83)	(12.86)	(19.90)	(26.93)	(33.96)	(41.00)	(48.03)
	-8.00%	(22.12)	(29.15)	(36.19)	(43.22)	(50.25)	(57.29)	(64.32)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	16.08
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	15.99
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	16.03
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	16.22
총 최대손실 예상금액		64.32

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 63.07