

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

# 메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

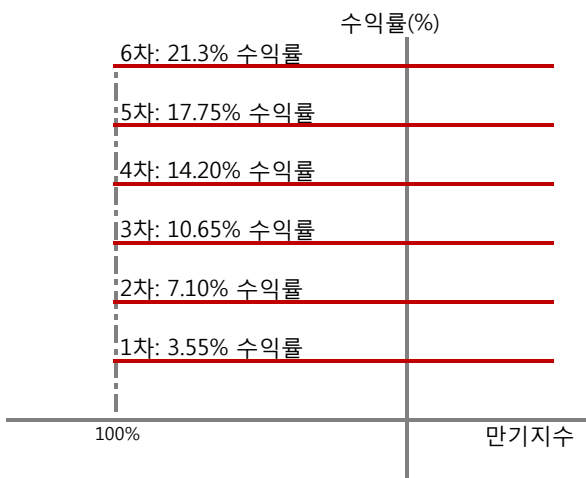
## 1. 계약금액

단위(백만원)

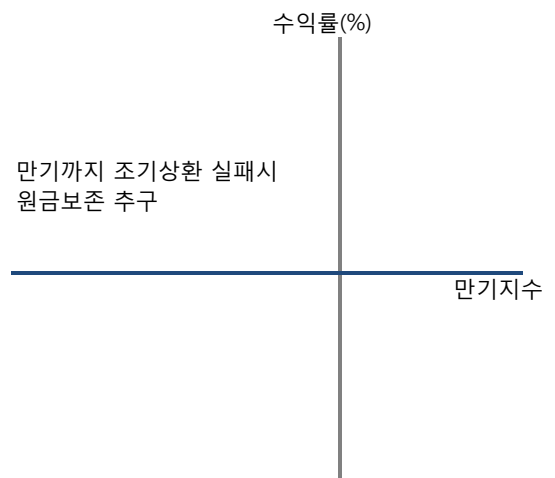
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	0.36	0.36	0.36	0.35	0.35	0.35	0.35
자산	5.33%	0.22	0.22	0.22	0.21	0.21	0.21	0.21
시나리오	2.67%	0.10	0.10	0.10	0.10	0.09	0.09	0.09
	0.00%	0.01	0.00	0.00	0.00	(0.00)	(0.00)	(0.01)
	-2.67%	(0.07)	(0.07)	(0.07)	(0.07)	(0.07)	(0.08)	(0.08)
	-5.33%	(0.12)	(0.12)	(0.12)	(0.12)	(0.12)	(0.13)	(0.13)
	-8.00%	(0.14)	(0.14)	(0.15)	(0.15)	(0.15)	(0.15)	(0.15)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.04
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.04
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.03
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.04
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>0.15</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

# 메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

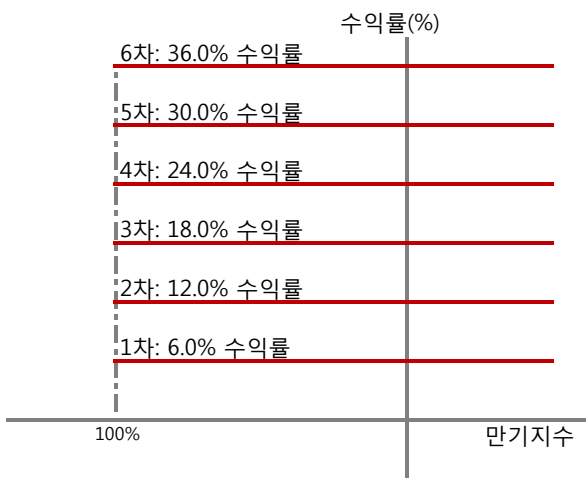
## 1. 계약금액

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 시나리오	8.00%	4.34	4.32	4.30	4.28	4.27	4.25	4.23
	5.33%	2.64	2.62	2.60	2.59	2.57	2.55	2.53
	2.67%	1.21	1.19	1.18	1.16	1.14	1.12	1.10
	0.00%	0.05	0.04	0.02	0.00	(0.02)	(0.04)	(0.05)
	-2.67%	(0.83)	(0.85)	(0.87)	(0.89)	(0.91)	(0.92)	(0.94)
	-5.33%	(1.45)	(1.47)	(1.49)	(1.51)	(1.52)	(1.54)	(1.56)
	-8.00%	(1.80)	(1.82)	(1.84)	(1.85)	(1.87)	(1.89)	(1.91)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	0.50
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	0.41
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	0.50
KR6662317124	동양W(ELS)975	0.50
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>1.91</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1.19

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

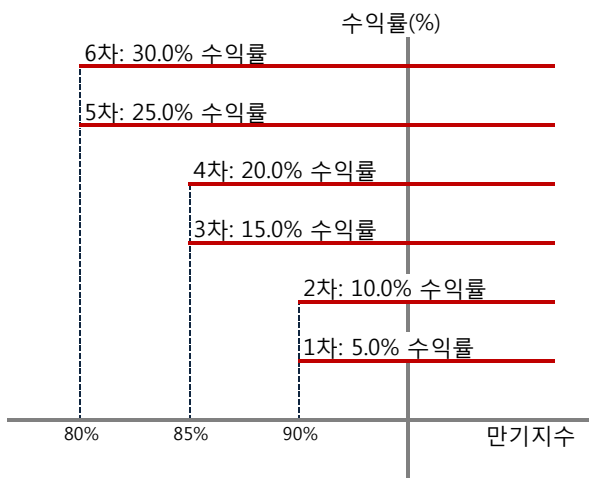
## 1. 계약금액

단위(백만원)

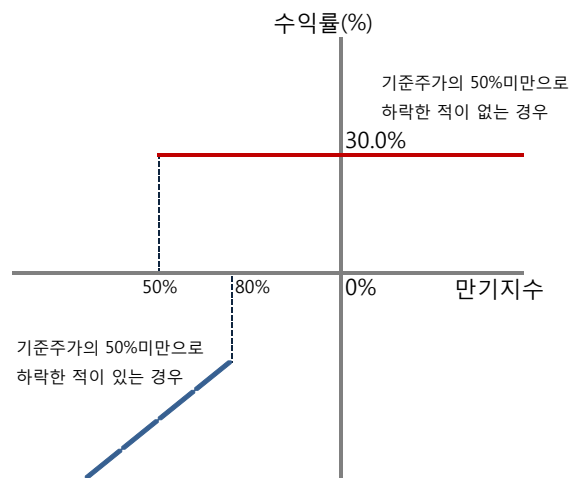
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,358	0	6,358	장외
누계	유가증권	ELS	6,358	0	6,358	장외

## 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%	(14.24)	(20.22)	(26.21)	(32.19)	(38.17)	(44.16)	(50.14)
자산	5.33%	58.68	52.70	46.71	40.73	34.74	28.76	22.77
사	2.67%	69.41	63.43	57.44	51.46	45.47	39.49	33.50
나	0.00%	17.95	11.97	5.98	0.00	(5.98)	(11.97)	(17.95)
리	-2.67%	(95.69)	(101.67)	(107.66)	(113.64)	(119.63)	(125.61)	(131.60)
오	-5.33%	(271.52)	(277.50)	(283.49)	(289.47)	(295.46)	(301.44)	(307.43)
시	-8.00%	(509.53)	(515.52)	(521.50)	(527.49)	(533.47)	(539.46)	(545.44)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	155.86
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	164.85
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	121.09
KR6662374141	동양W(ELS)1004	103.65
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>545.44</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 447.93

# 메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

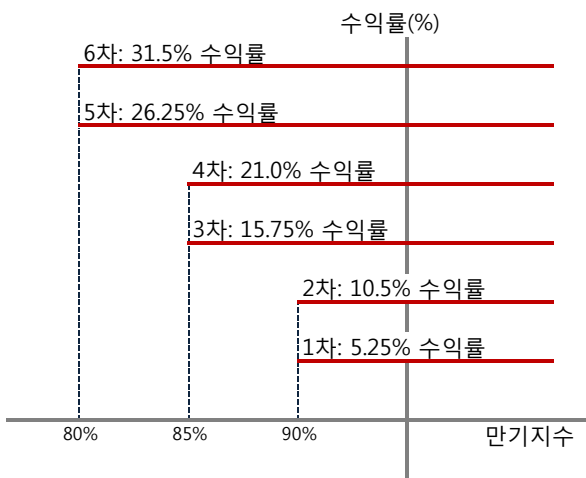
## 1. 계약금액

단위(백만원)

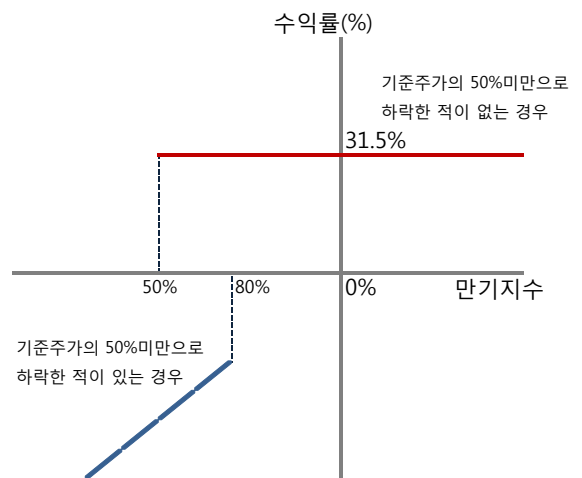
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,756	0	2,756	장외
누계	유가증권	ELS	2,756	0	2,756	장외

## 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%	(17.26)	(17.48)	(17.70)	(17.92)	(18.14)	(18.36)	(18.58)
자산	5.33%	(11.43)	(11.65)	(11.87)	(12.09)	(12.31)	(12.53)	(12.74)
사	2.67%	(5.45)	(5.67)	(5.89)	(6.11)	(6.33)	(6.55)	(6.77)
나	0.00%	0.66	0.44	0.22	0.00	(0.22)	(0.44)	(0.66)
리	-2.67%	6.91	6.69	6.47	6.25	6.03	5.81	5.59
오	-5.33%	13.30	13.08	12.86	12.65	12.43	12.21	11.99
시	-8.00%	19.84	19.62	19.40	19.18	18.96	18.74	18.52

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	5.82
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	5.47
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	5.68
KR6663346155	동양W(ELS)1009	1.61
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>18.58</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

31.88

# 메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

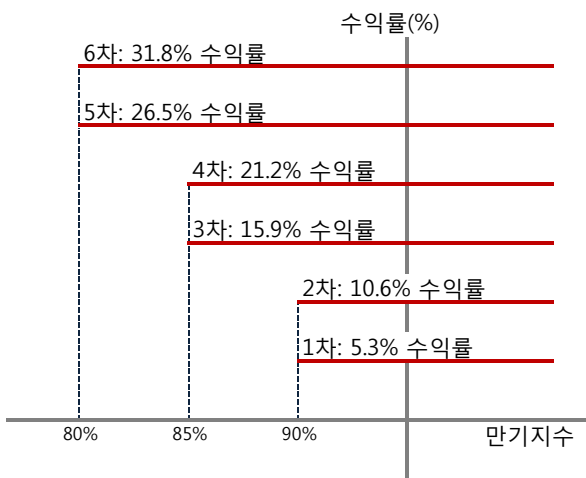
## 1. 계약금액

단위(백만원)

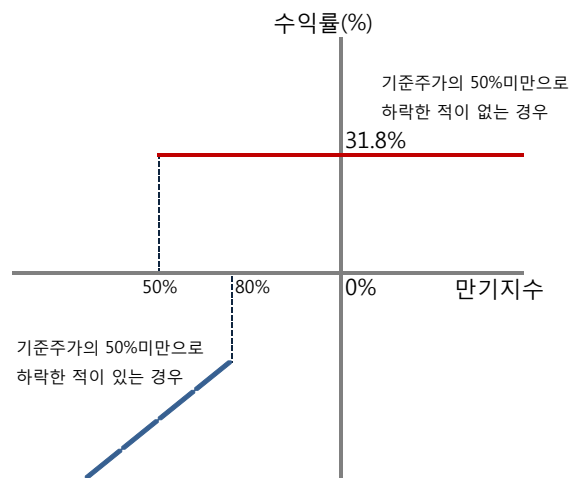
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,112	0	3,112	장외
누계	유가증권	ELS	3,112	0	3,112	장외

## 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%	(22.57)	(22.95)	(23.33)	(23.71)	(24.09)	(24.47)	(24.85)
자산	5.33%	(12.44)	(12.82)	(13.20)	(13.58)	(13.96)	(14.34)	(14.72)
시나	2.67%	(4.54)	(4.91)	(5.29)	(5.67)	(6.05)	(6.43)	(6.81)
리오	0.00%	1.14	0.76	0.38	0.00	(0.38)	(0.76)	(1.14)
	-2.67%	4.58	4.20	3.82	3.44	3.07	2.69	2.31
	-5.33%	5.80	5.42	5.04	4.66	4.28	3.90	3.52
	-8.00%	4.79	4.41	4.03	3.65	3.27	2.89	2.51

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	8.17
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	6.99
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	4.86
KR6663324160	동양W(ELS)1028	4.82
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>24.85</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

14.29

# 메리츠 2스타증권 KS-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

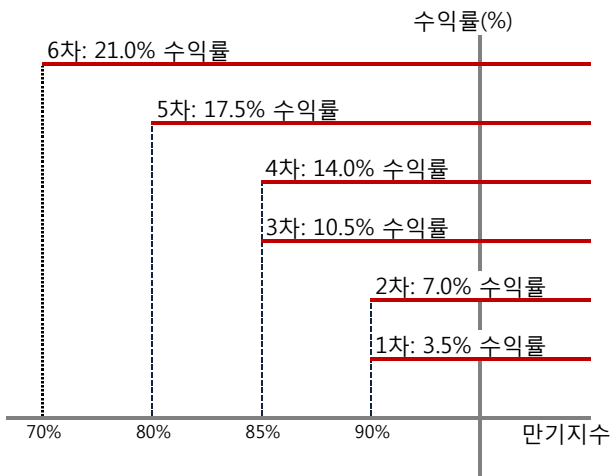
## 1. 계약금액

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

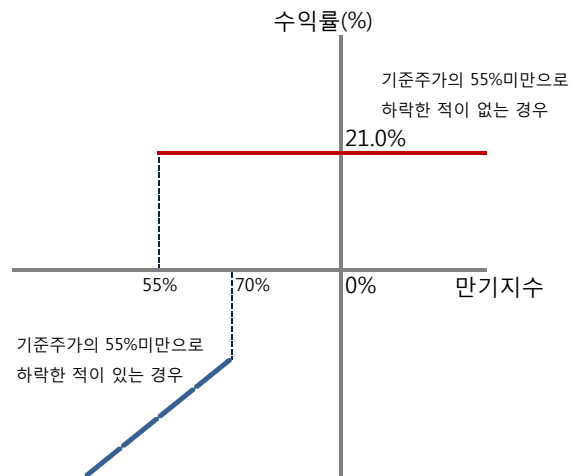
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	10.26	8.75	7.24	5.74	4.23	2.72	1.21
자산	5.33%	9.65	8.14	6.64	5.13	3.62	2.11	0.60
시나	2.67%	7.74	6.23	4.72	3.21	1.71	0.20	(1.31)
리오	0.00%	4.53	3.02	1.51	0.00	(1.51)	(3.02)	(4.53)
	-2.67%	0.01	(1.50)	(3.01)	(4.52)	(6.03)	(7.54)	(9.04)
	-5.33%	(5.81)	(7.32)	(8.83)	(10.34)	(11.85)	(13.36)	(14.87)
	-8.00%	(12.94)	(14.45)	(15.96)	(17.46)	(18.97)	(20.48)	(21.99)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502366315	신한투자(ELS)6143	5.47
KR6522359316	대우증권(ELS)8664	5.41
KR6621312315	교보증권(ELS)10007	5.55
KR6772307312	KB STAR(ELS)334	5.56
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>21.99</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

22.73

# 메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

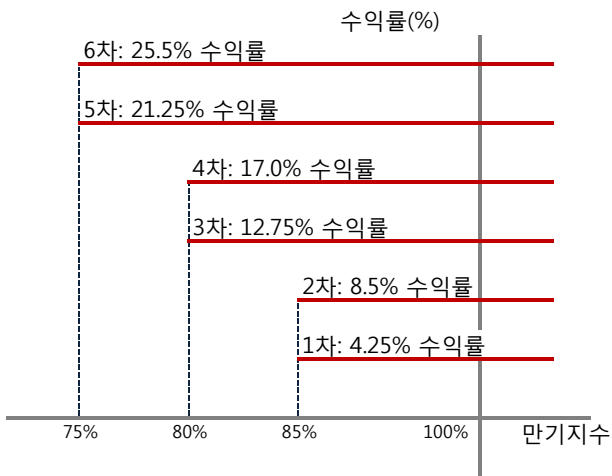
## 1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,483	0	2,483	장외
누계	유가증권	ELS	2,483	0	2,483	장외

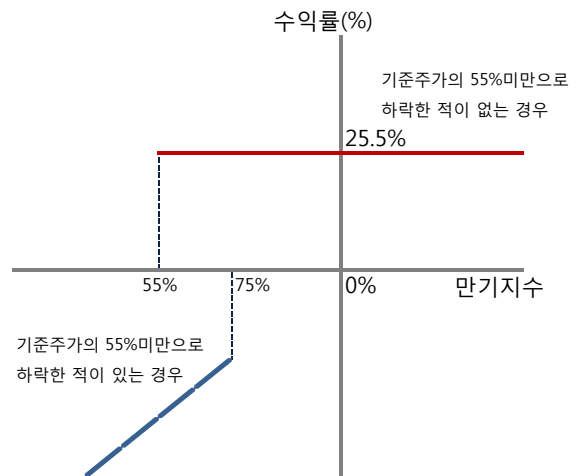
단위(백만원)

## 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%	32.24	27.73	23.22	18.71	14.19	9.68	5.17
자산	5.33%	31.03	26.52	22.01	17.50	12.99	8.48	3.96
사	2.67%	24.80	20.29	15.78	11.26	6.75	2.24	(2.27)
나	0.00%	13.53	9.02	4.51	0.00	(4.51)	(9.02)	(13.53)
리	-2.67%	(2.76)	(7.27)	(11.78)	(16.29)	(20.80)	(25.32)	(29.83)
오	-5.33%	(24.08)	(28.59)	(33.10)	(37.61)	(42.13)	(46.64)	(51.15)
	-8.00%	(50.43)	(54.94)	(59.45)	(63.96)	(68.48)	(72.99)	(77.50)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	19.63
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	19.84
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	18.32
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	19.72
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>77.50</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

79.31



# 메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

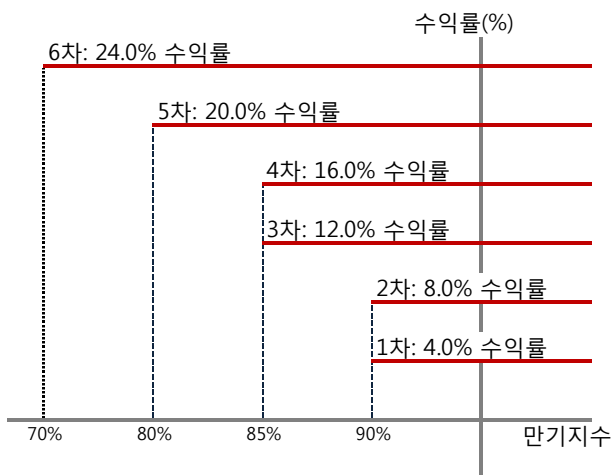
## 1. 계약금액

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

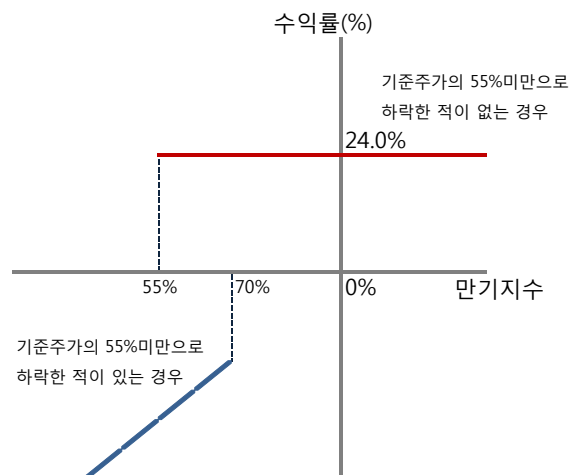
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	174.00	150.49	126.98	103.47	79.96	56.45	32.93
자산	5.33%	148.50	124.99	101.47	77.96	54.45	30.94	7.43
시나리오	2.67%	114.01	90.50	66.99	43.47	19.96	(3.55)	(27.06)
리오	0.00%	70.53	47.02	23.51	0.00	(23.51)	(47.02)	(70.53)
	-2.67%	18.07	(5.44)	(28.95)	(52.46)	(75.97)	(99.48)	(122.99)
	-5.33%	(43.37)	(66.88)	(90.39)	(113.90)	(137.41)	(160.93)	(184.44)
	-8.00%	(113.80)	(137.31)	(160.82)	(184.33)	(207.84)	(231.35)	(254.87)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	63.54
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	63.22
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	64.05
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	64.05
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>254.87</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 303.01

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

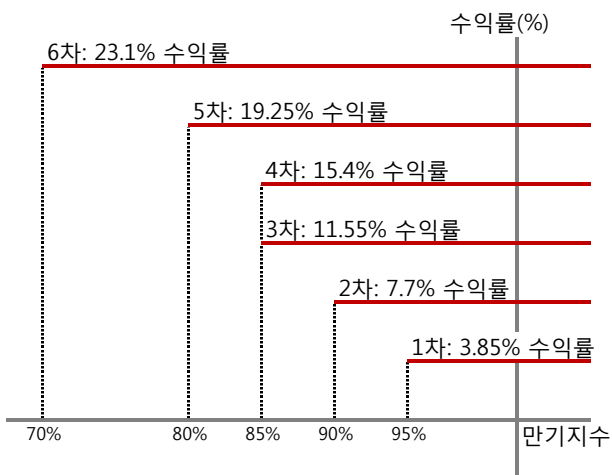
## 1. 계약금액

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

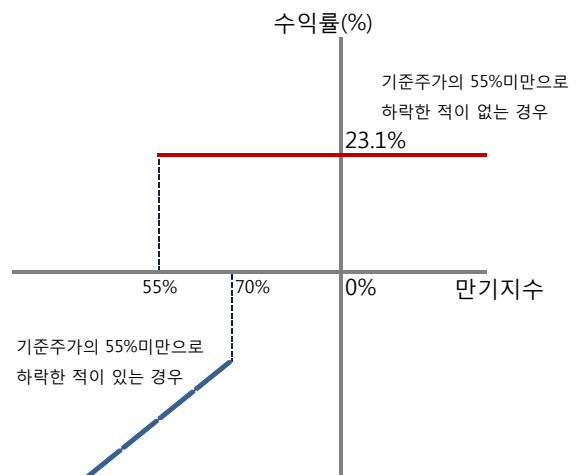
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	13.78	11.65	9.52	7.40	5.27	3.14	1.01
자산	5.33%	13.10	10.98	8.85	6.72	4.59	2.47	0.34
시나	2.67%	10.64	8.51	6.38	4.26	2.13	0.00	(2.13)
리오	0.00%	6.38	4.25	2.13	0.00	(2.13)	(4.25)	(6.38)
	-2.67%	0.34	(1.79)	(3.92)	(6.05)	(8.17)	(10.30)	(12.43)
	-5.33%	(7.50)	(9.63)	(11.76)	(13.88)	(16.01)	(18.14)	(20.27)
	-8.00%	(17.13)	(19.26)	(21.39)	(23.51)	(25.64)	(27.77)	(29.90)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	최대손실 예상금액
KR6512307374	대신증권(ELS)3488	7.48
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	7.41
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	7.44
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	7.57
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>29.90</b>

단위(백만원)

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 23.55

# 메리트 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

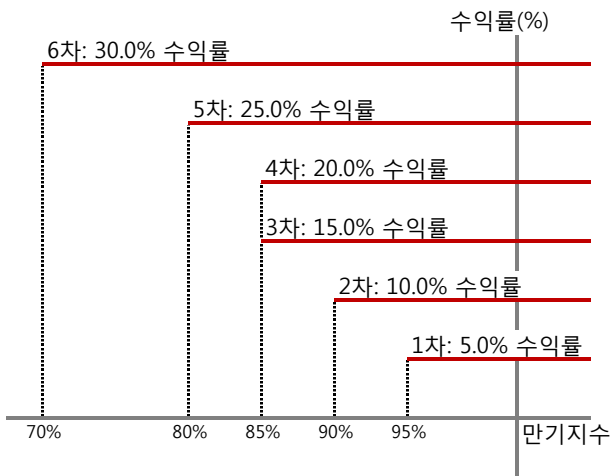
## 1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,383	0	1,383	장외
누계	유가증권	ELS	1,383	0	1,383	장외

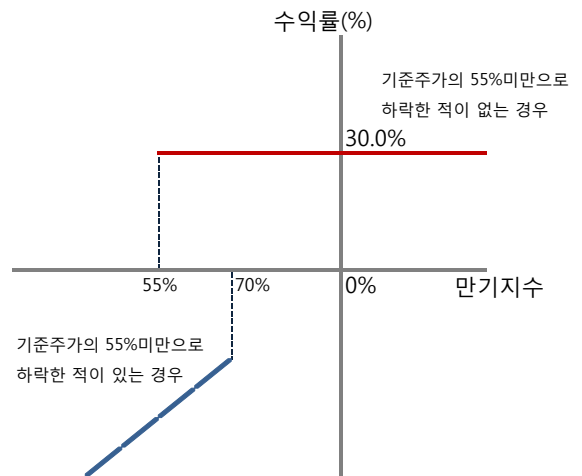
단위(백만원)

## 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%	81.73	70.24	58.75	47.26	35.77	24.28	12.80
	5.33%	67.66	56.17	44.68	33.19	21.70	10.21	(1.28)
	2.67%	51.90	40.41	28.92	17.44	5.95	(5.54)	(17.03)
	0.00%	34.47	22.98	11.49	0.00	(11.49)	(22.98)	(34.47)
	-2.67%	15.35	3.86	(7.63)	(19.12)	(30.61)	(42.10)	(53.58)
	-5.33%	(5.46)	(16.95)	(28.43)	(39.92)	(51.41)	(62.90)	(74.39)
	-8.00%	(27.94)	(39.43)	(50.92)	(62.41)	(73.90)	(85.39)	(96.87)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR6512323389	대신증권(ELS)3554	24.22
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	24.12
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	24.17
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	24.37
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>96.87</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 95.65

# 메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-10-14

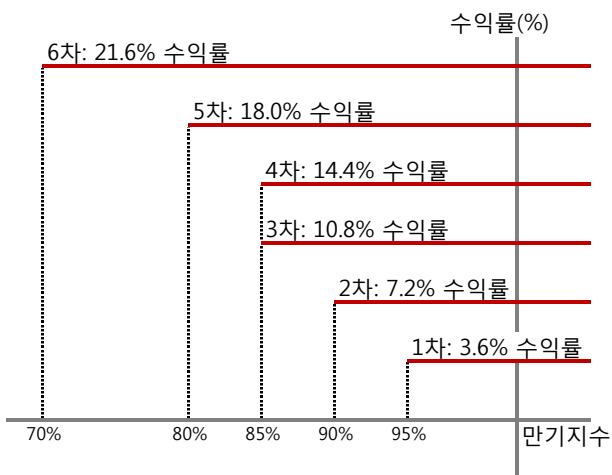
## 1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,263	0	2,263	장외
누계	유가증권	ELS	2,263	0	2,263	장외

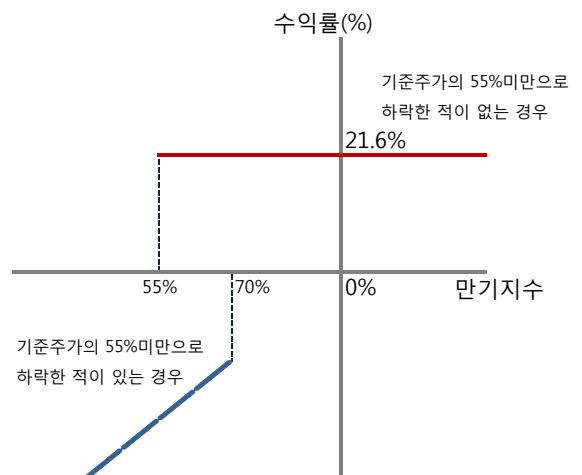
단위(백만원)

## 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	61.55	52.69	43.84	34.98	26.12	17.27	8.41	
시나리오	8.00%	52.29	43.43	34.58	25.72	16.86	8.01	
	5.33%	40.63	31.77	22.92	14.06	5.20	(3.65)	
	2.67%	26.57	17.71	8.86	0.00	(8.86)	(17.71)	
	0.00%	10.11	1.25	(7.60)	(16.46)	(25.32)	(34.17)	
	-2.67%	(8.75)	(17.61)	(26.46)	(35.32)	(44.17)	(53.03)	
	-5.33%	(30.01)	(38.86)	(47.72)	(56.58)	(65.43)	(74.29)	
	-8.00%						(83.15)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	24.37
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	20.74
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	20.63
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	20.67
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>86.41</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 92.72