

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

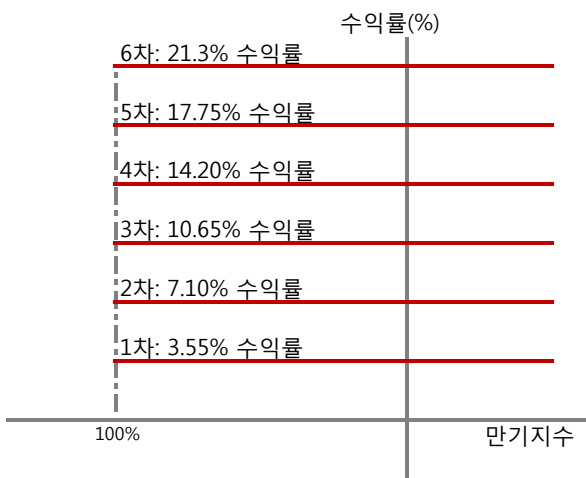
1. 계약금액

단위(백만원)

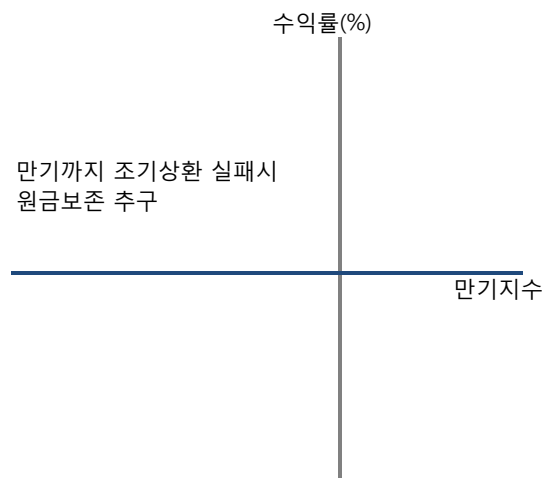
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외

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%	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06
자산	5.33%	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04
시나	2.67%	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02
리오	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)
	-5.33%	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)
	-8.00%	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.01
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.01
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.00
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.01
총 최대손실 예상금액		0.02

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

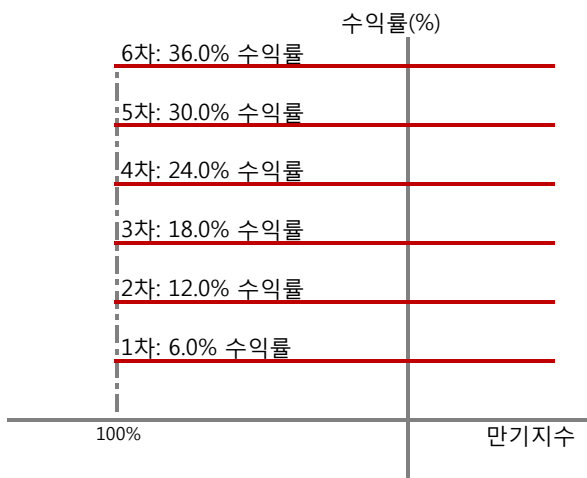
1. 계약금액

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							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	3.08	3.07	3.06	3.05	3.05	3.04	3.03
자산	5.33%	1.85	1.84	1.84	1.83	1.82	1.81	1.81
시나	2.67%	0.83	0.83	0.82	0.81	0.80	0.80	0.79
리오	0.00%	0.02	0.02	0.01	0.00	(0.01)	(0.02)	(0.02)
	-2.67%	(0.58)	(0.59)	(0.60)	(0.61)	(0.61)	(0.62)	(0.63)
	-5.33%	(0.98)	(0.99)	(1.00)	(1.00)	(1.01)	(1.02)	(1.03)
	-8.00%	(1.18)	(1.18)	(1.19)	(1.20)	(1.21)	(1.21)	(1.22)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	0.32
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	0.26
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	0.32
KR6662317124	동양W(ELS)975	0.32
총 최대손실 예상금액		1.22

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.46

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

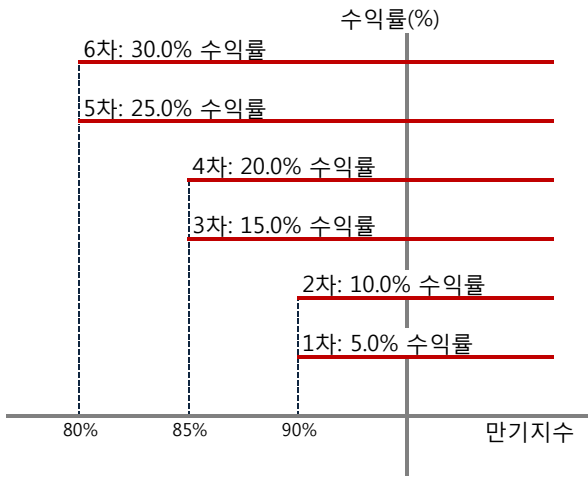
1. 계약금액

단위(백만원)

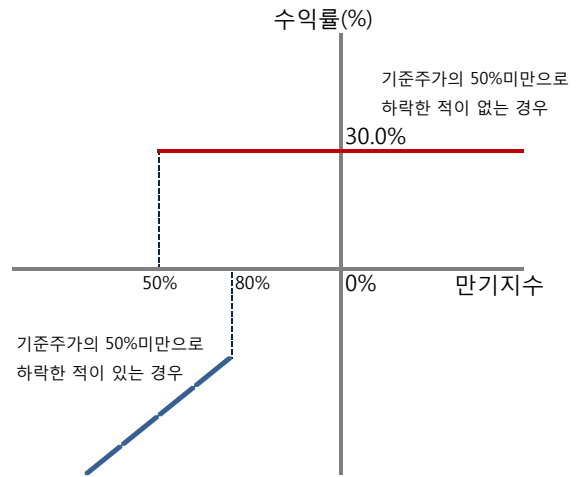
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,721	0	5,721	장외
누계	유가증권	ELS	5,721	0	5,721	장외

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%	(55.10)	(56.39)	(57.69)	(58.99)	(60.29)	(61.58)	(62.88)
자산	5.33%	(13.53)	(14.83)	(16.12)	(17.42)	(18.72)	(20.01)	(21.31)
사	2.67%	6.14	4.84	3.54	2.24	0.95	(0.35)	(1.65)
나	0.00%	3.89	2.59	1.30	0.00	(1.30)	(2.59)	(3.89)
리	-2.67%	(20.26)	(21.55)	(22.85)	(24.15)	(25.45)	(26.74)	(28.04)
오	-5.33%	(66.31)	(67.61)	(68.91)	(70.20)	(71.50)	(72.80)	(74.10)
시	-8.00%	(134.27)	(135.57)	(136.87)	(138.17)	(139.46)	(140.76)	(142.06)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	42.46
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	41.75
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	34.94
KR6662374141	동양W(ELS)1004	22.91
총 최대손실 예상금액		142.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

120.19

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

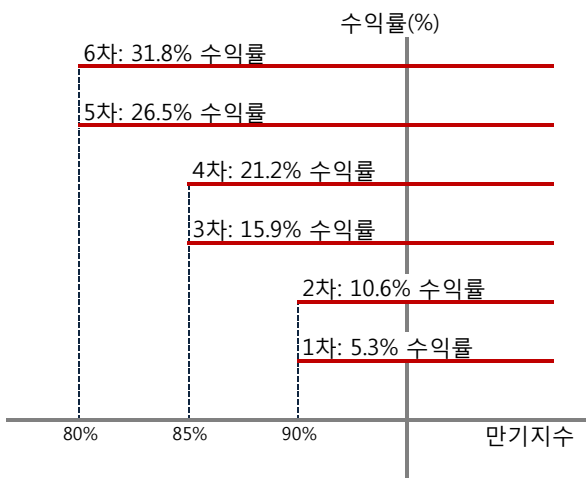
1. 계약금액

단위(백만원)

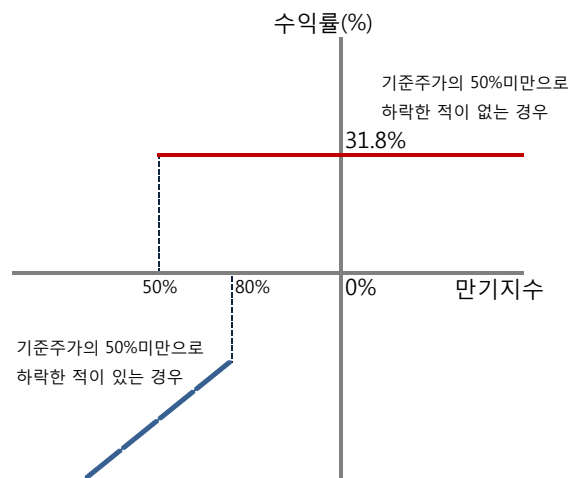
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,589	0	2,589	장외
누계	유가증권	ELS	2,589	0	2,589	장외

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	7.48	7.47	7.46	7.45	7.44	7.43	7.42	
자산	3.21	3.20	3.19	3.18	3.17	3.16	3.14	
시나리오	0.73	0.72	0.71	0.70	0.68	0.67	0.66	
	0.03	0.02	0.01	0.00	(0.01)	(0.02)	(0.03)	
	1.13	1.12	1.10	1.09	1.08	1.07	1.06	
	4.01	4.00	3.99	3.97	3.96	3.95	3.94	
	8.68	8.67	8.65	8.64	8.63	8.62	8.61	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	0.01
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	0.01
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	0.01
KR6663324160	동양W(ELS)1028	0.01
총 최대손실 예상금액		0.03

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 3.30

메리츠 2스타증권 KS-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

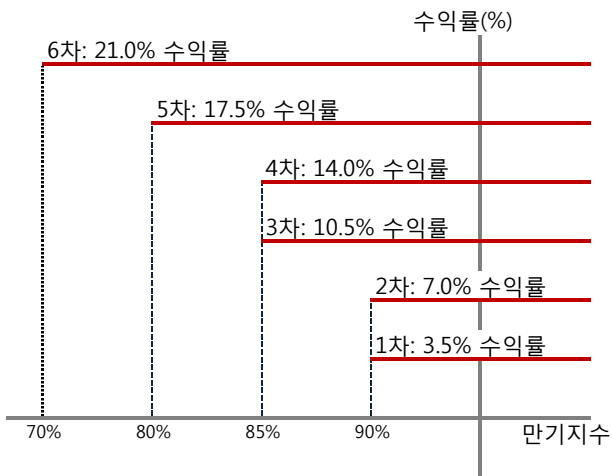
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	600	0	600	장외
누계	유가증권	ELS	600	0	600	장외

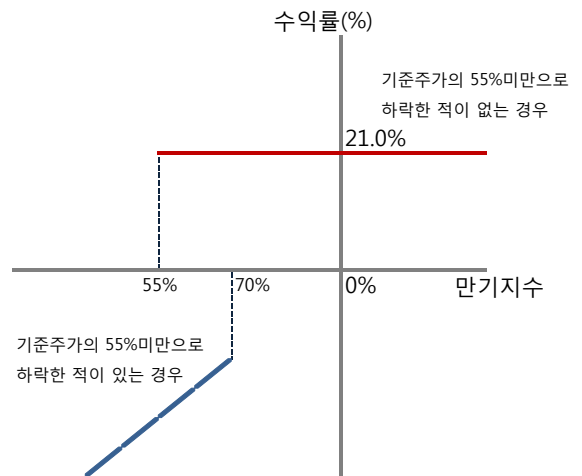
단위(백만원)

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%	2.23	1.66	1.09	0.51	(0.06)	(0.63)	(1.20)
자산	5.33%	3.53	2.96	2.39	1.82	1.25	0.68	0.11
시나	2.67%	3.36	2.79	2.22	1.65	1.08	0.51	(0.06)
리오	0.00%	1.71	1.14	0.57	0.00	(0.57)	(1.14)	(1.71)
	-2.67%	(1.42)	(1.99)	(2.56)	(3.13)	(3.70)	(4.27)	(4.84)
	-5.33%	(6.03)	(6.60)	(7.17)	(7.74)	(8.31)	(8.88)	(9.45)
	-8.00%	(12.11)	(12.68)	(13.25)	(13.82)	(14.39)	(14.97)	(15.54)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	예상금액
KR6502366315	신한투자(ELS)6143	3.99
KR6522359316	대우증권(ELS)8664	3.92
KR6621312315	교보증권(ELS)10007	4.07
KR6772307312	KB STAR(ELS)334	3.55
총 최대손실 예상금액		15.54

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 14.68

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

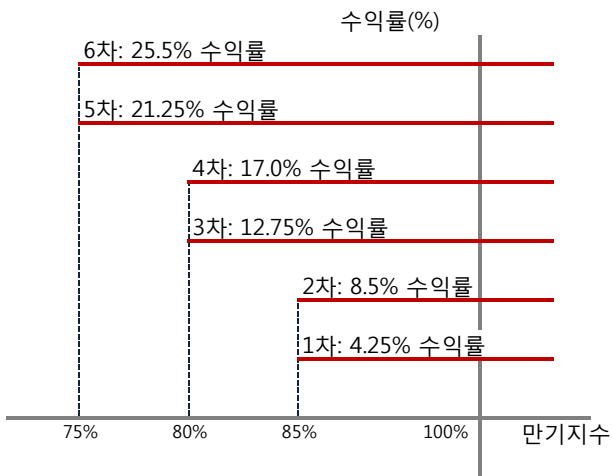
1. 계약금액

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

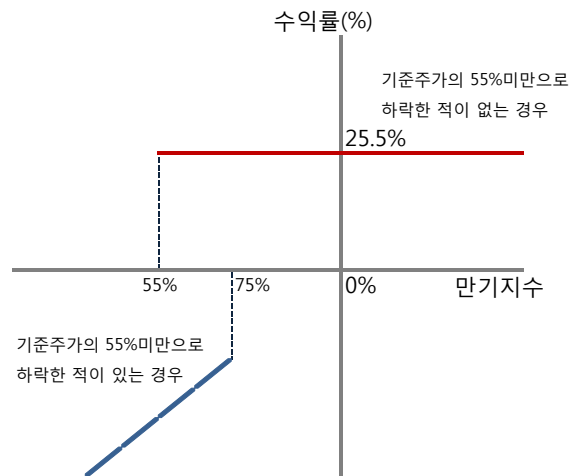
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	45.20	39.65	34.10	28.54	22.99	17.44	11.89
	5.33%	43.47	37.92	32.37	26.82	21.26	15.71	10.16
	2.67%	33.95	28.40	22.85	17.30	11.75	6.20	0.65
	0.00%	16.65	11.10	5.55	0.00	(5.55)	(11.10)	(16.65)
	-2.67%	(8.43)	(13.99)	(19.54)	(25.09)	(30.64)	(36.19)	(41.74)
	-5.33%	(41.31)	(46.86)	(52.41)	(57.96)	(63.51)	(69.06)	(74.62)
	-8.00%	(81.97)	(87.52)	(93.07)	(98.62)	(104.17)	(109.72)	(115.28)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	29.15
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	29.56
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	27.25
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	29.32
총 최대손실 예상금액		115.28

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 128.78

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

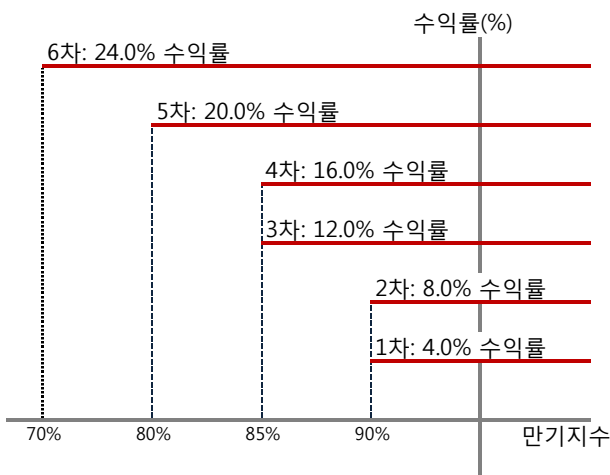
1. 계약금액

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

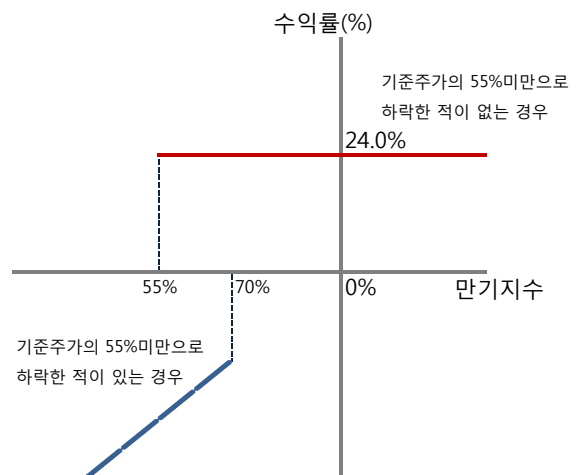
단위(백만원)

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%	226.51	200.24	173.97	147.70	121.43	95.15	68.88
자산	5.33%	186.20	159.93	133.66	107.39	81.12	54.85	28.58
시나리오	2.67%	136.97	110.70	84.43	58.16	31.89	5.62	(20.66)
리오	0.00%	78.81	52.54	26.27	0.00	(26.27)	(52.54)	(78.81)
	-2.67%	11.73	(14.54)	(40.81)	(67.08)	(93.35)	(119.62)	(145.89)
	-5.33%	(64.28)	(90.55)	(116.82)	(143.09)	(169.36)	(195.63)	(221.90)
	-8.00%	(149.21)	(175.48)	(201.75)	(228.02)	(254.29)	(280.56)	(306.83)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	76.48
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	76.03
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	77.16
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	77.16
총 최대손실 예상금액		306.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 298.56

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

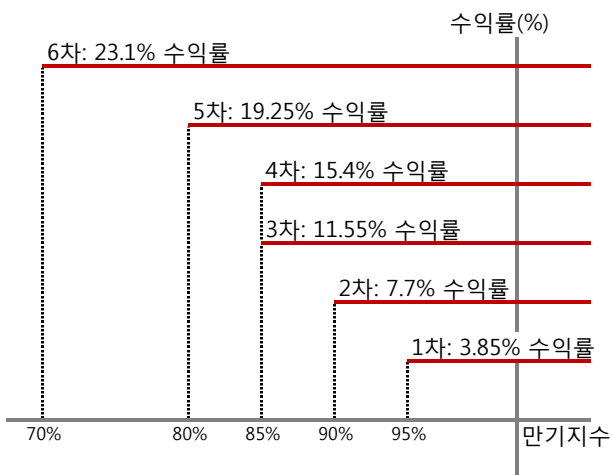
1. 계약금액

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

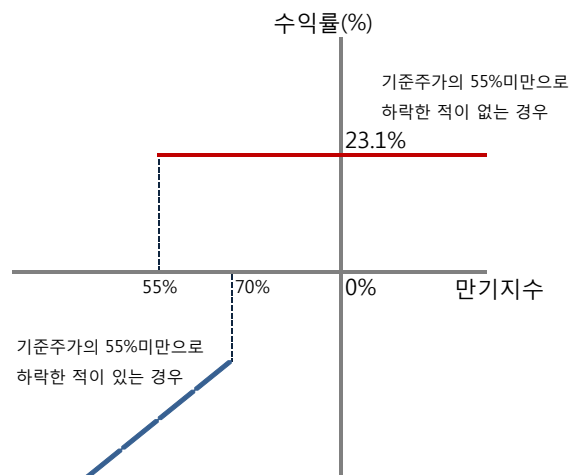
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	단위(백만원)						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	11.52	9.68	7.85	6.01	4.18	2.35	0.51
	5.33%	12.67	10.83	9.00	7.16	5.33	3.49	1.66
	2.67%	10.66	8.83	6.99	5.16	3.32	1.49	(0.34)
	0.00%	5.50	3.67	1.83	0.00	(1.83)	(3.67)	(5.50)
	-2.67%	(2.81)	(4.64)	(6.48)	(8.31)	(10.15)	(11.98)	(13.81)
	-5.33%	(14.27)	(16.11)	(17.94)	(19.78)	(21.61)	(23.45)	(25.28)
	-8.00%	(28.89)	(30.73)	(32.56)	(34.40)	(36.23)	(38.06)	(39.90)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR6512307374	대신증권(ELS)3488	9.98
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	9.86
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	9.91
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	10.14
총 최대손실 예상금액		39.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 32.23

메리트 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

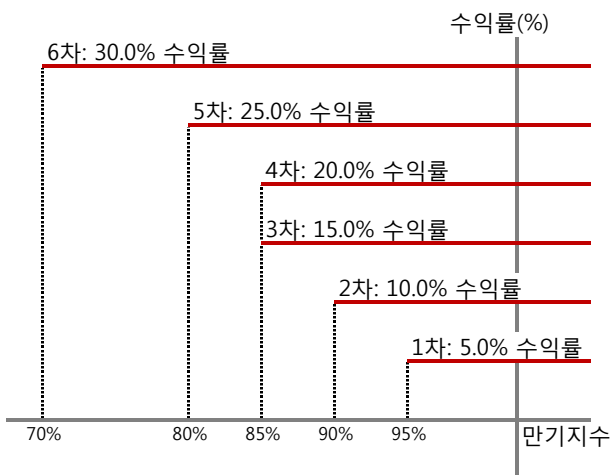
1. 계약금액

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

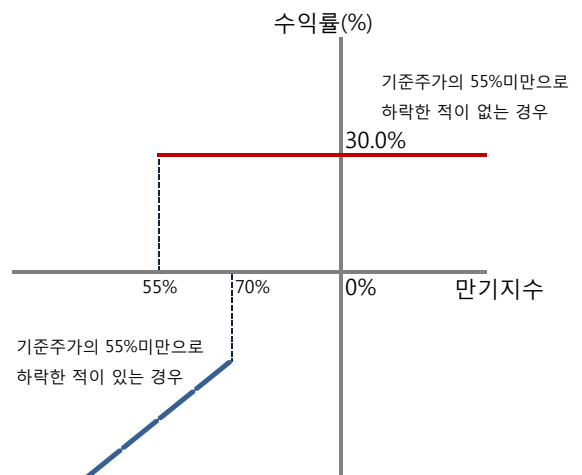
단위(백만원)

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 시나 리오	8.00%	99.41	86.73	74.04	61.35	48.67	35.98	23.29
	5.33%	79.80	67.12	54.43	41.74	29.06	16.37	3.68
	2.67%	59.35	46.66	33.98	21.29	8.60	(4.08)	(16.77)
	0.00%	38.06	25.37	12.69	0.00	(12.69)	(25.37)	(38.06)
	-2.67%	15.93	3.24	(9.44)	(22.13)	(34.82)	(47.50)	(60.19)
	-5.33%	(7.04)	(19.73)	(32.42)	(45.10)	(57.79)	(70.48)	(83.16)
	-8.00%	(30.85)	(43.54)	(56.23)	(68.91)	(81.60)	(94.29)	(106.97)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR6512323389	대신증권(ELS)3554	26.75
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	26.65
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	26.70
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	26.88
총 최대손실 예상금액		106.97

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 106.57

메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-11-19

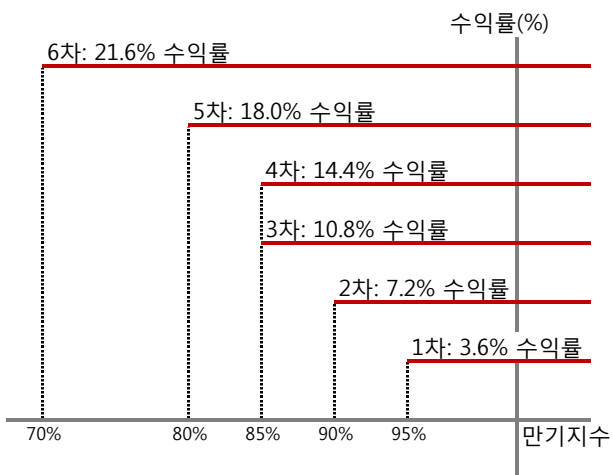
1. 계약금액

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

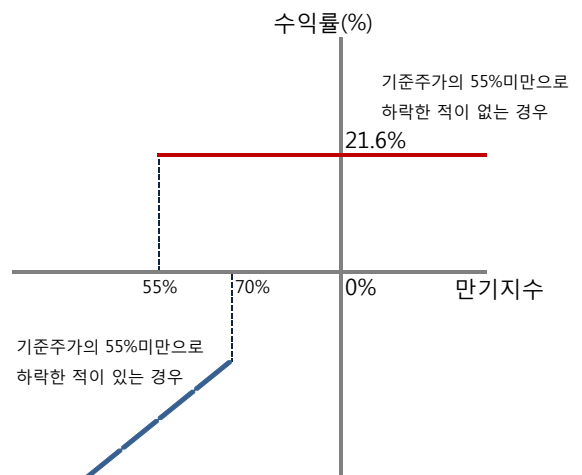
단위(백만원)

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	111.03	94.70	78.38	62.06	45.74	29.41	13.09	
시나리오	8.00%	5.33%	2.67%	0.00%	-2.67%	-5.33%	-8.00%	
	93.10	76.78	60.46	44.14	27.81	11.49	(4.83)	
	72.42	56.09	39.77	23.45	7.13	(9.19)	(25.52)	
	48.97	32.64	16.32	0.00	(16.32)	(32.64)	(48.97)	
	22.75	6.43	(9.89)	(26.21)	(42.54)	(58.86)	(75.18)	
	(6.22)	(22.55)	(38.87)	(55.19)	(71.51)	(87.84)	(104.16)	
	(37.96)	(54.29)	(70.61)	(86.93)	(103.25)	(119.58)	(135.90)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	최대손실 예상금액
KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	26.88
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	33.96
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	33.85
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	33.88
총 최대손실 예상금액		128.57

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 123.57