

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

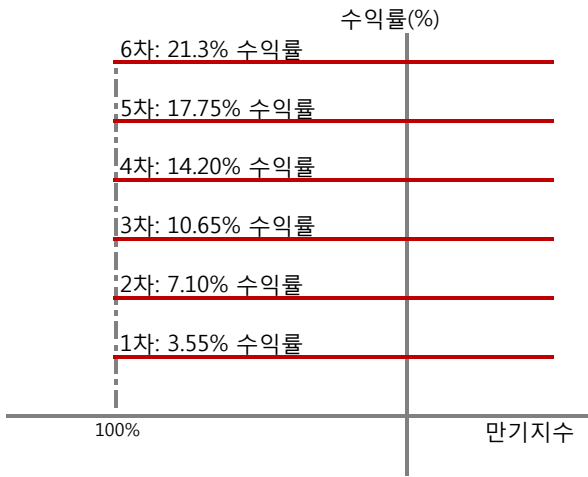
1. 계약금액

단위(백만원)

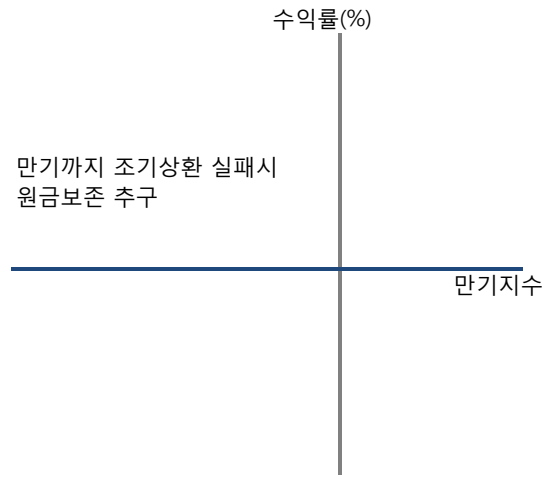
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	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)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.00
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.00
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.00
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

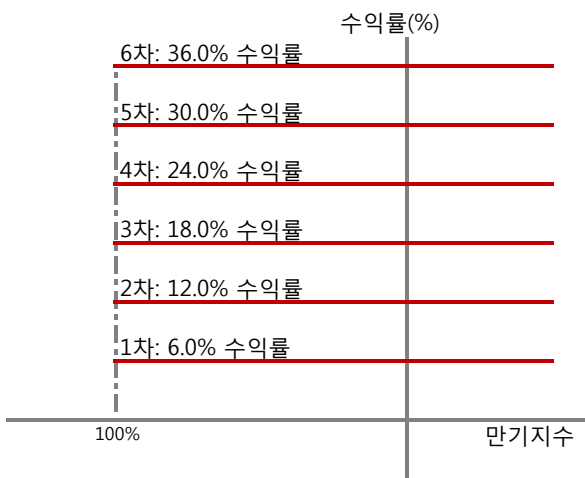
1. 계약금액

단위(백만원)

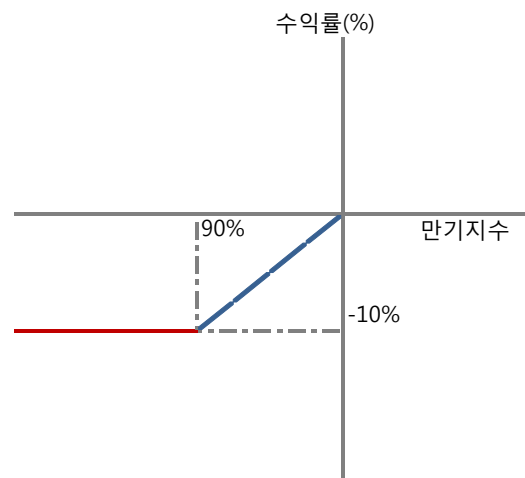
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	706	0	706	장외
누계	유가증권	ELS	706	0	706	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	5.33%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	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)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	0.00
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	0.00
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	0.00
KR6662317124	동양W(ELS)975	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

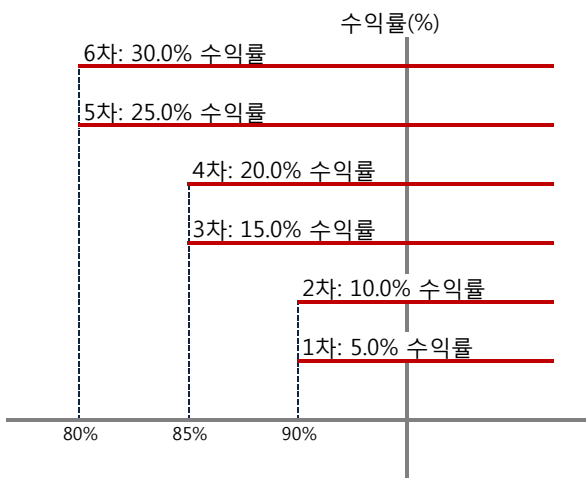
1. 계약금액

단위(백만원)

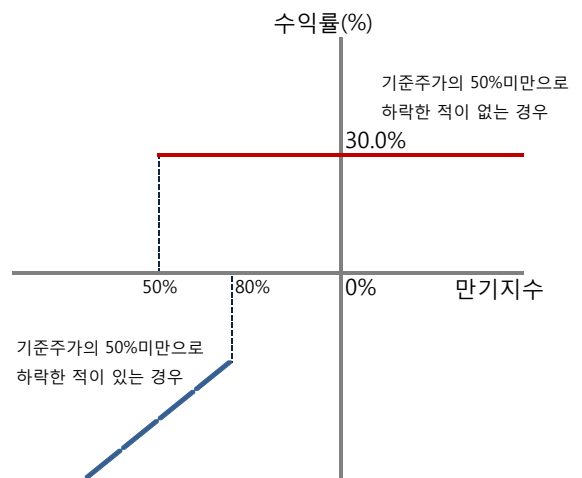
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,652	0	5,652	장외
누계	유가증권	ELS	5,652	0	5,652	장외

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%	(99.13)	(99.41)	(99.70)	(99.99)	(100.27)	(100.56)	(100.84)
자산	5.33%	(39.21)	(39.50)	(39.78)	(40.07)	(40.36)	(40.64)	(40.93)
사	2.67%	(5.88)	(6.17)	(6.45)	(6.74)	(7.03)	(7.31)	(7.60)
나	0.00%	0.86	0.57	0.29	0.00	(0.29)	(0.57)	(0.86)
리	-2.67%	(18.99)	(19.28)	(19.56)	(19.85)	(20.13)	(20.42)	(20.71)
오	-5.33%	(65.43)	(65.71)	(66.00)	(66.28)	(66.57)	(66.86)	(67.14)
시	-8.00%	(138.45)	(138.74)	(139.02)	(139.31)	(139.60)	(139.88)	(140.17)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	41.72
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	40.77
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	34.75
KR6662374141	동양W(ELS)1004	22.93
총 최대손실 예상금액		140.17

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 106.54

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

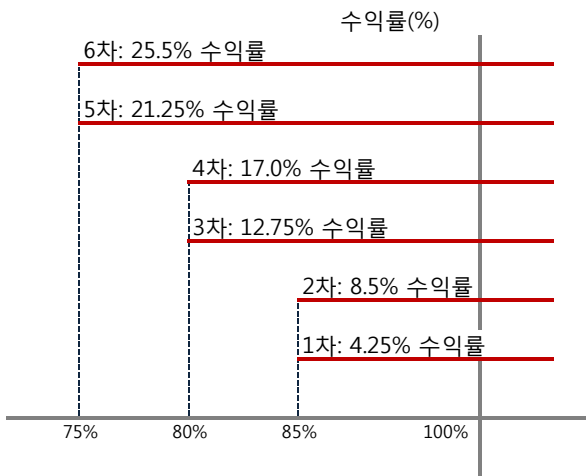
1. 계약금액

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

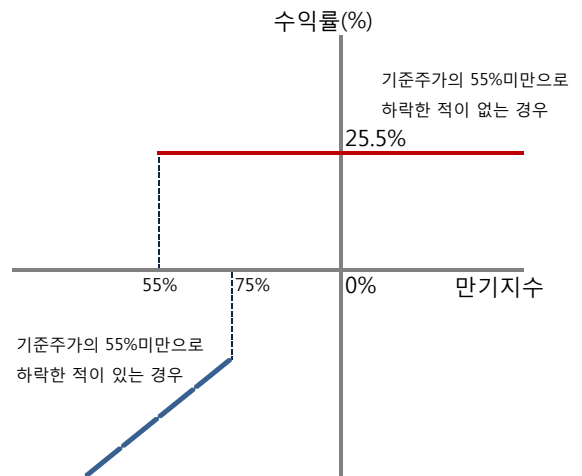
단위(백만원)

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%	77.63	69.46	61.29	53.12	44.95	36.79	28.62
자산	5.33%	65.46	57.29	49.12	40.95	32.78	24.62	16.45
시나	2.67%	47.75	39.58	31.41	23.25	15.08	6.91	(1.26)
리오	0.00%	24.51	16.34	8.17	0.00	(8.17)	(16.34)	(24.51)
	-2.67%	(4.28)	(12.45)	(20.61)	(28.78)	(36.95)	(45.12)	(53.29)
	-5.33%	(38.60)	(46.77)	(54.93)	(63.10)	(71.27)	(79.44)	(87.61)
	-8.00%	(78.46)	(86.62)	(94.79)	(102.96)	(111.13)	(119.30)	(127.47)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	32.37
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	32.54
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	30.13
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	32.43
총 최대손실 예상금액		127.47

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 143.74

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

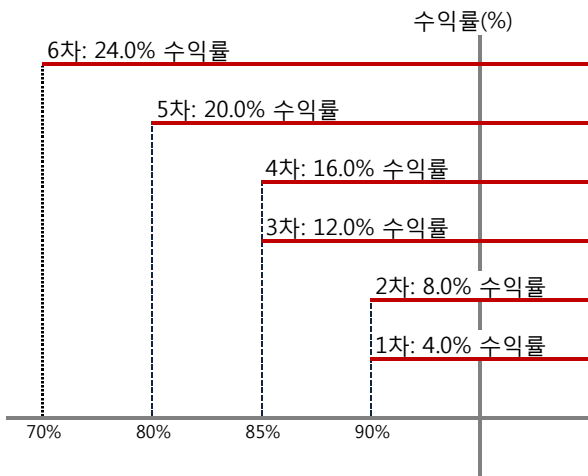
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,234	0	5,234	장외
누계	유가증권	ELS	5,234	0	5,234	장외

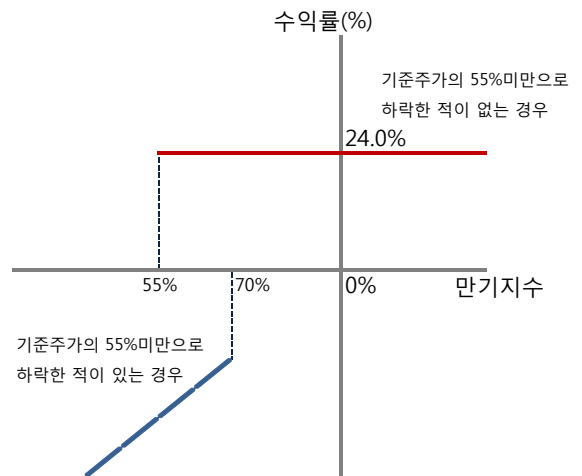
단위(백만원)

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%	211.84	188.51	165.19	141.86	118.53	95.20	71.87
	5.33%	173.31	149.98	126.65	103.32	79.99	56.67	33.34
	2.67%	126.02	102.69	79.36	56.04	32.71	9.38	(13.95)
	0.00%	69.98	46.66	23.33	0.00	(23.33)	(46.66)	(69.98)
	-2.67%	5.20	(18.13)	(41.46)	(64.79)	(88.11)	(111.44)	(134.77)
	-5.33%	(68.34)	(91.67)	(114.99)	(138.32)	(161.65)	(184.98)	(208.31)
	-8.00%	(150.62)	(173.95)	(197.28)	(220.61)	(243.94)	(267.26)	(290.59)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	72.61
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	72.31
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	73.11
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	72.55
총 최대손실 예상금액		290.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

302.25

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

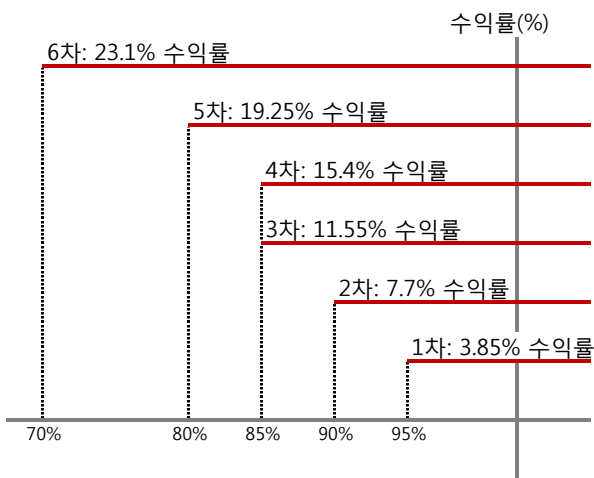
1. 계약금액

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

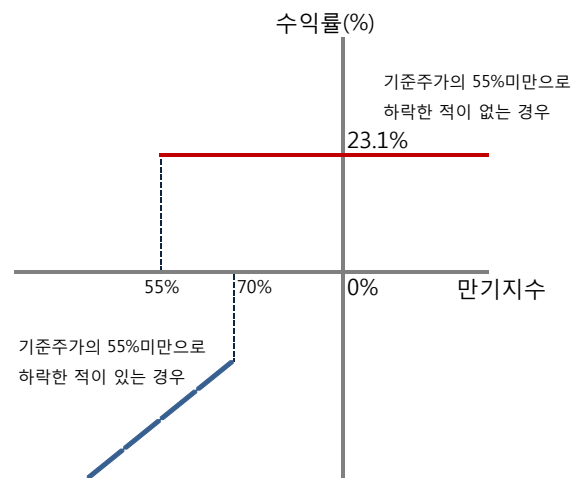
단위(백만원)

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 자산	61.72	53.89	46.05	38.21	30.37	22.53	14.69	
시나리오	5.33%	42.85	35.02	27.18	19.34	11.50	3.66	
	2.67%	30.12	22.28	14.44	6.60	(1.24)	(9.08)	
	0.00%	15.68	7.84	0.00	(7.84)	(15.68)	(23.52)	
	-2.67%	(0.47)	(8.31)	(16.14)	(23.98)	(31.82)	(39.66)	
	-5.33%	(18.31)	(26.15)	(33.99)	(41.83)	(49.67)	(57.51)	
	-8.00%	(37.87)	(45.70)	(53.54)	(61.38)	(69.22)	(77.06)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

증권번호	증권명	단위(백만원)
KR6512307374	대신증권(ELS)3488	19.27
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	19.19
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	19.22
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	19.38
총 최대손실 예상금액		77.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액: 88.70

메리트 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

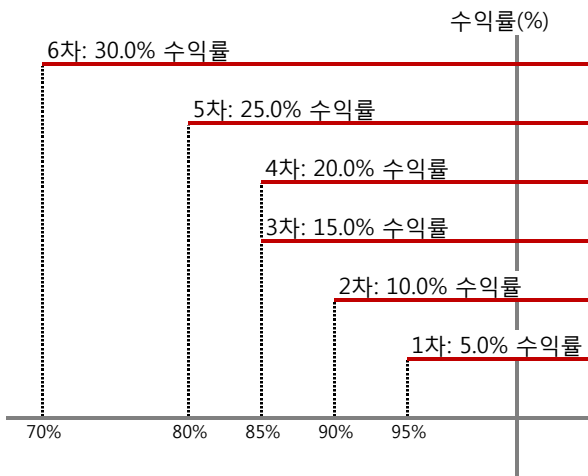
1. 계약금액

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

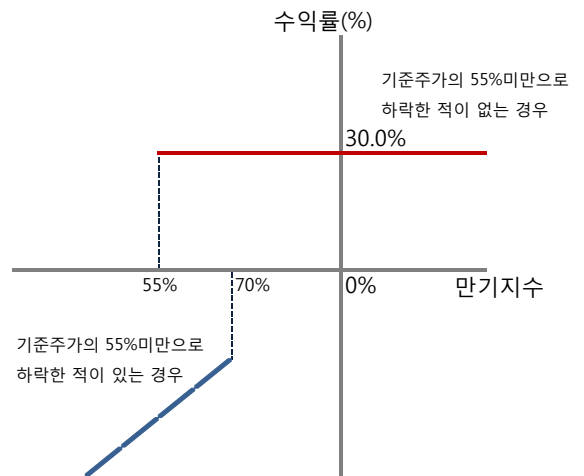
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	단위(백만원)						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	76.00	67.95	59.90	51.85	43.80	35.75	27.70
	5.33%	59.89	51.84	43.79	35.74	27.69	19.64	11.59
	2.67%	42.61	34.56	26.51	18.46	10.41	2.36	(5.69)
	0.00%	24.15	16.10	8.05	0.00	(8.05)	(16.10)	(24.15)
	-2.67%	4.52	(3.53)	(11.58)	(19.63)	(27.68)	(35.73)	(43.78)
	-5.33%	(16.28)	(24.33)	(32.38)	(40.43)	(48.48)	(56.53)	(64.58)
	-8.00%	(38.26)	(46.31)	(54.36)	(62.41)	(70.46)	(78.51)	(86.56)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR6512323389	대신증권(ELS)3554	21.65
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	21.43
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	21.52
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	21.95
총 최대손실 예상금액		86.56

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 76.10

메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-01-14

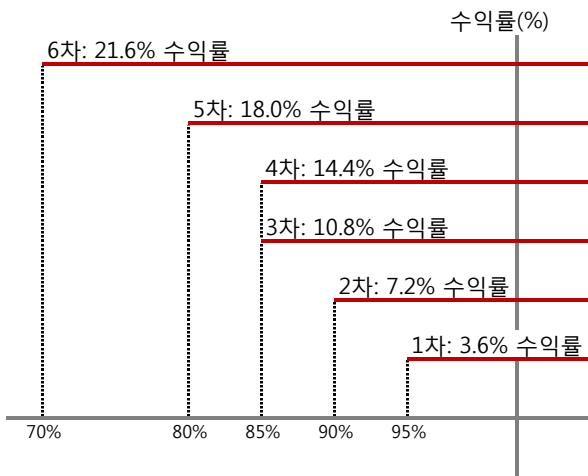
1. 계약금액

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

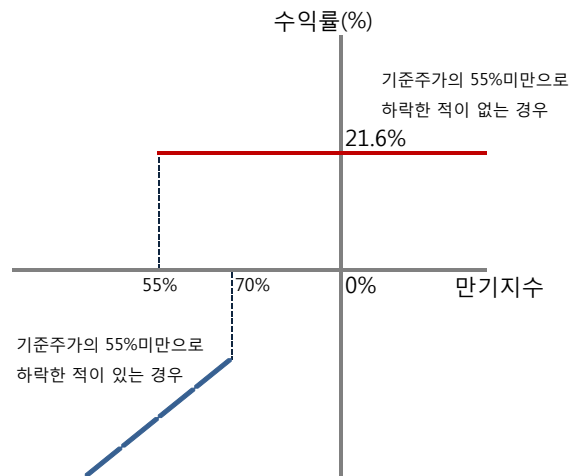
단위(백만원)

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	148.29	127.71	107.13	86.55	65.97	45.39	24.81	
시나리오	5.33%	120.95	100.37	79.79	59.21	38.63	18.05	
	2.67%	92.10	71.52	50.94	30.36	9.78	(10.80)	
	0.00%	61.74	41.16	20.58	0.00	(20.58)	(41.16)	
	-2.67%	29.87	9.29	(11.29)	(31.87)	(52.45)	(73.03)	
	-5.33%	(3.50)	(24.08)	(44.66)	(65.24)	(85.82)	(106.40)	
	-8.00%	(38.38)	(58.96)	(79.54)	(100.12)	(120.70)	(141.28)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	21.95
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	40.46
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	40.42
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	40.43
총 최대손실 예상금액		143.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 165.26