

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-12

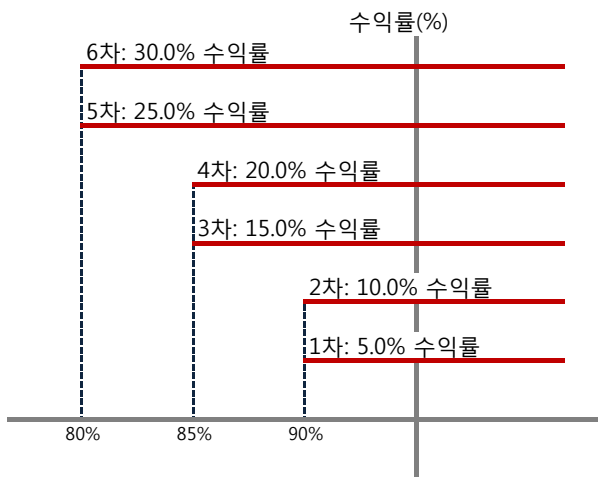
1. 계약금액

단위(백만원)

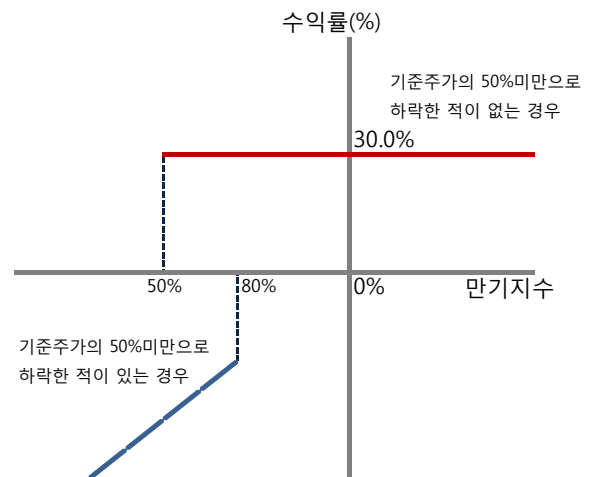
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,366	0	5,366	장외
누계	유가증권	ELS	5,366	0	5,366	장외

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%	(393.63)	(395.02)	(396.41)	(397.79)	(399.18)	(400.57)	(401.95)
	5.33%	(153.56)	(154.95)	(156.34)	(157.72)	(159.11)	(160.50)	(161.89)
	2.67%	(20.96)	(22.35)	(23.74)	(25.13)	(26.51)	(27.90)	(29.29)
	0.00%	4.16	2.77	1.39	0.00	(1.39)	(2.77)	(4.16)
	-2.67%	(78.18)	(79.57)	(80.96)	(82.34)	(83.73)	(85.12)	(86.51)
	-5.33%	(268.00)	(269.39)	(270.77)	(272.16)	(273.55)	(274.93)	(276.32)
	-8.00%	(565.28)	(566.67)	(568.06)	(569.45)	(570.83)	(572.22)	(573.61)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	163.05
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	161.82
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	149.77
KR6662374141	동양W(ELS)1004	98.97
총 최대손실 예상금액		573.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 294.51

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-12

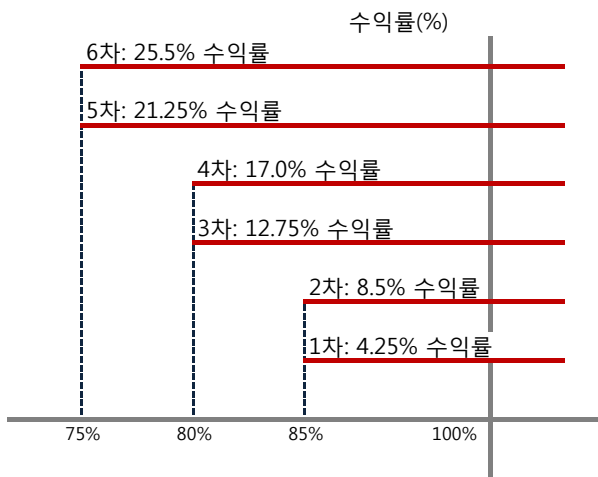
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,463	0	2,463	장외
누계	유가증권	ELS	2,463	0	2,463	장외

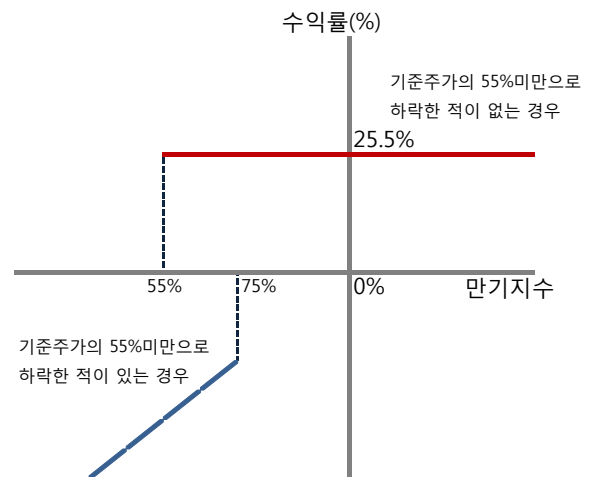
단위(백만원)

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%	100.96	91.42	81.89	72.35	62.81	53.28	43.74
	5.33%	82.36	72.83	63.29	53.75	44.22	34.68	25.14
	2.67%	58.24	48.71	39.17	29.64	20.10	10.56	1.03
	0.00%	28.61	19.07	9.54	0.00	(9.54)	(19.07)	(28.61)
	-2.67%	(6.55)	(16.08)	(25.62)	(35.16)	(44.69)	(54.23)	(63.76)
	-5.33%	(47.22)	(56.76)	(66.29)	(75.83)	(85.37)	(94.90)	(104.44)
	-8.00%	(93.42)	(102.95)	(112.49)	(122.03)	(131.56)	(141.10)	(150.63)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	38.57
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	38.75
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	34.67
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	38.64
총 최대손실 예상금액		150.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 148.56

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-12

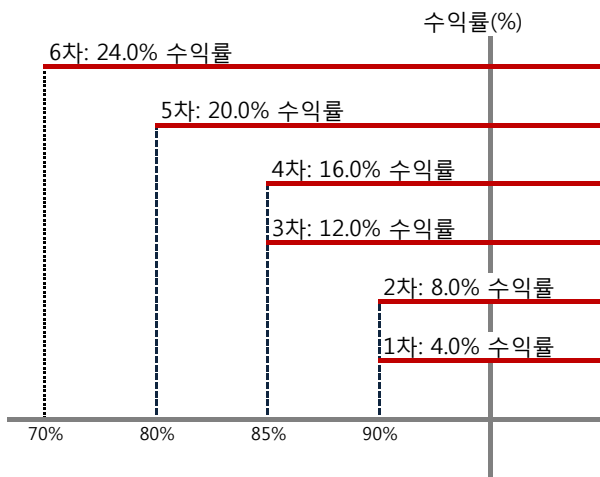
1. 계약금액

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

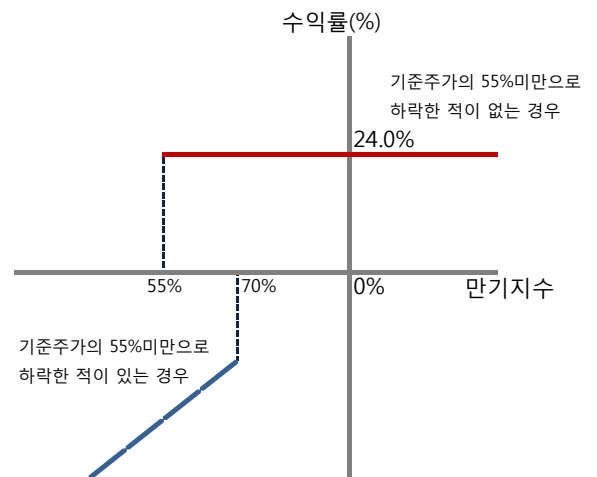
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	288.48	259.51	230.55	201.58	172.61	143.65	114.68
	5.33%	231.08	202.11	173.15	144.18	115.21	86.25	57.28
	2.67%	163.89	134.92	105.95	76.99	48.02	19.05	(9.91)
	0.00%	86.90	57.93	28.97	0.00	(28.97)	(57.93)	(86.90)
	-2.67%	0.12	(28.85)	(57.82)	(86.78)	(115.75)	(144.72)	(173.68)
	-5.33%	(96.46)	(125.42)	(154.39)	(183.36)	(212.32)	(241.29)	(270.26)
	-8.00%	(202.83)	(231.80)	(260.76)	(289.73)	(318.70)	(347.66)	(376.63)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	94.17
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	94.03
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	94.58
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	93.86
총 최대손실 예상금액		376.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 328.96

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-12

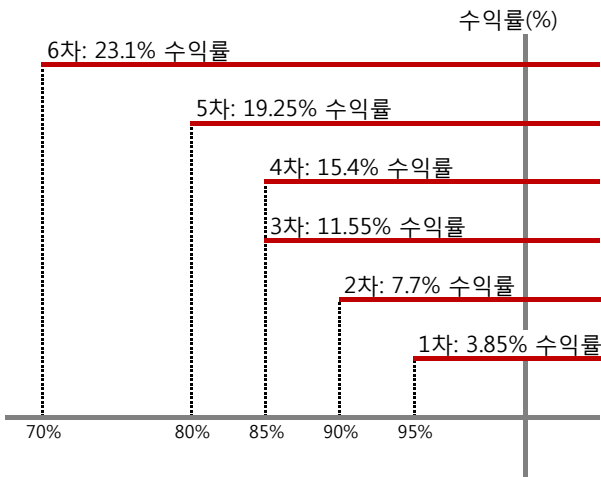
1. 계약금액

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

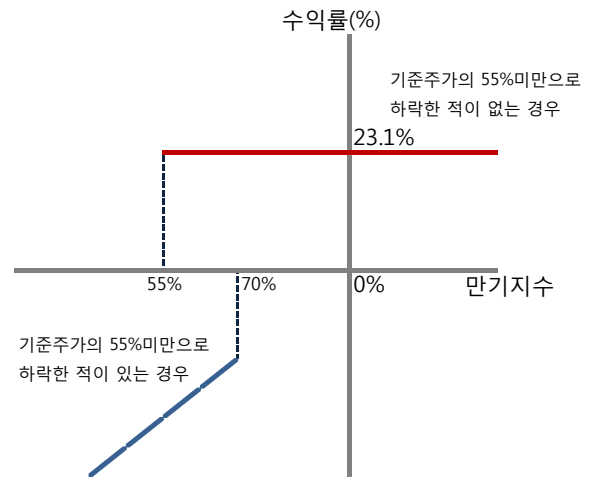
단위(백만원)

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%	54.51	48.41	42.32	36.22	30.12	24.03	17.93
	5.33%	44.30	38.20	32.10	26.01	19.91	13.81	7.71
	2.67%	32.23	26.13	20.03	13.93	7.84	1.74	(4.36)
	0.00%	18.29	12.19	6.10	0.00	(6.10)	(12.19)	(18.29)
	-2.67%	2.50	(3.60)	(9.70)	(15.79)	(21.89)	(27.99)	(34.09)
	-5.33%	(15.16)	(21.25)	(27.35)	(33.45)	(39.55)	(45.64)	(51.74)
	-8.00%	(34.67)	(40.77)	(46.87)	(52.96)	(59.06)	(65.16)	(71.26)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	17.81
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	17.71
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	17.75
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	17.99
총 최대손실 예상금액		71.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 54.53

메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-12

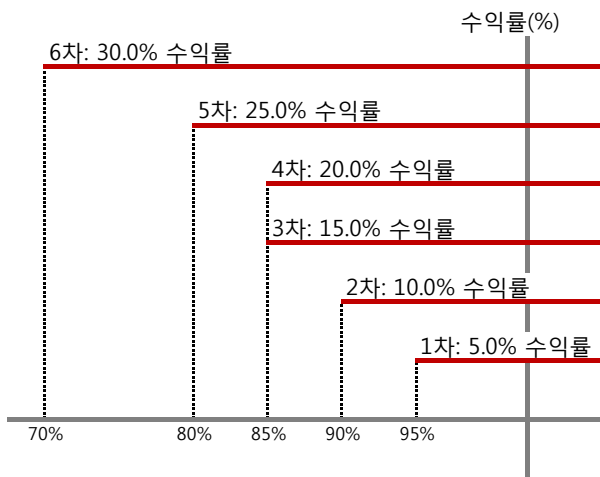
1. 계약금액

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

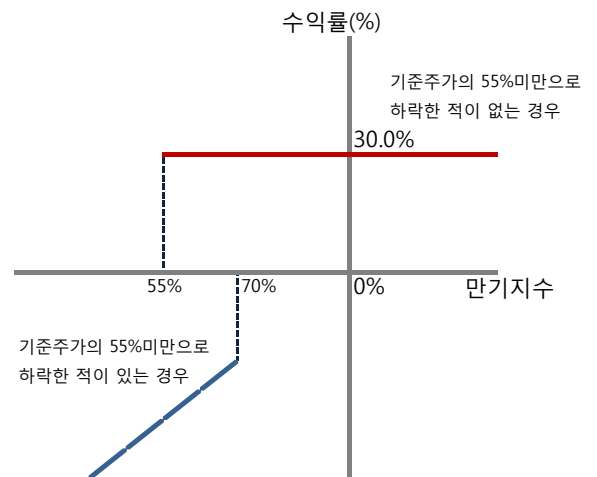
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	65.03	56.78	48.53	40.29	32.04	23.79	15.55
	5.33%	53.44	45.19	36.95	28.70	20.45	12.21	3.96
	2.67%	40.01	31.76	23.52	15.27	7.02	(1.22)	(9.47)
	0.00%	24.74	16.49	8.25	0.00	(8.25)	(16.49)	(24.74)
	-2.67%	7.63	(0.62)	(8.87)	(17.11)	(25.36)	(33.60)	(41.85)
	-5.33%	(11.33)	(19.57)	(27.82)	(36.07)	(44.31)	(52.56)	(60.80)
	-8.00%	(32.12)	(40.37)	(48.61)	(56.86)	(65.11)	(73.35)	(81.60)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	20.39
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	20.29
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	20.33
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	20.59
총 최대손실 예상금액		81.60

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 86.23

메리츠 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-12

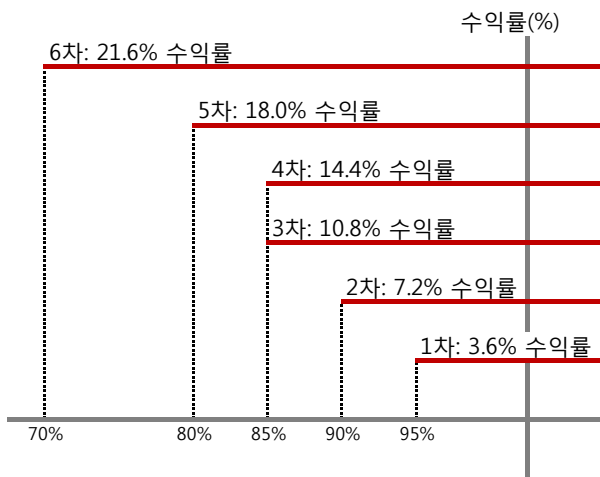
1. 계약금액

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

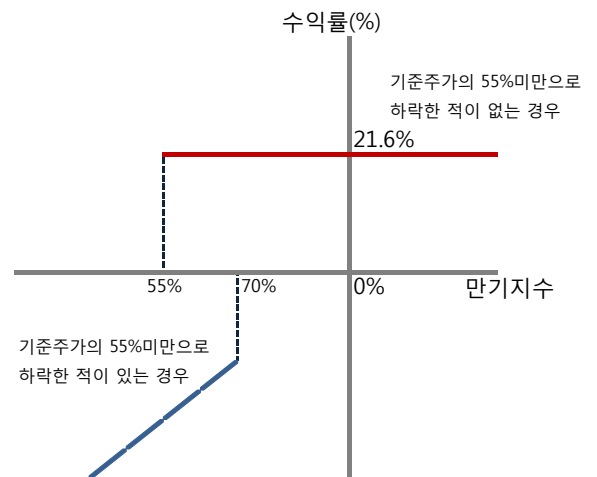
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	165.83	142.97	120.12	97.27	74.41	51.56	28.71
	5.33%	134.24	111.39	88.53	65.68	42.83	19.97	(2.88)
	2.67%	101.82	78.97	56.11	33.26	10.41	(12.45)	(35.30)
	0.00%	68.56	45.71	22.85	0.00	(22.85)	(45.71)	(68.56)
	-2.67%	34.47	11.61	(11.24)	(34.09)	(56.95)	(79.80)	(102.65)
	-5.33%	(0.47)	(23.32)	(46.17)	(69.03)	(91.88)	(114.73)	(137.59)
	-8.00%	(36.23)	(59.09)	(81.94)	(104.79)	(127.65)	(150.50)	(173.35)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	20.59
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	43.33
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	43.30
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	43.31
총 최대손실 예상금액		150.53

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 178.54

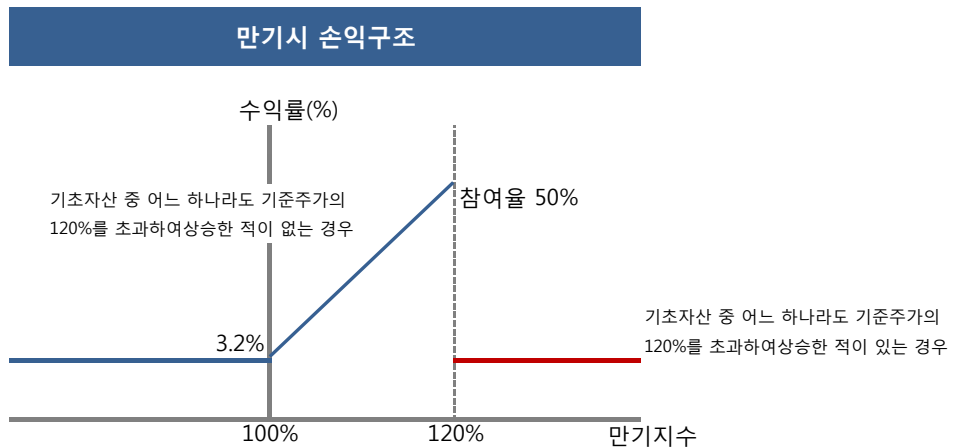
메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-12

1. 계약금액

						단위(백만원)
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,550	0	6,550	장외
누계	유가증권	ELS	6,550	0	6,550	장외

2. 만기시점의 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%	(0.53)	(0.58)	(0.62)	(0.66)	(0.71)	(0.75)	(0.79)
	5.33%	(0.26)	(0.30)	(0.34)	(0.39)	(0.43)	(0.47)	(0.52)
	2.67%	(0.04)	(0.08)	(0.12)	(0.17)	(0.21)	(0.25)	(0.29)
	0.00%	0.13	0.09	0.04	0.00	(0.04)	(0.09)	(0.13)
	-2.67%	0.24	0.20	0.15	0.11	0.07	0.02	(0.02)
	-5.33%	0.29	0.25	0.21	0.16	0.12	0.08	0.03
	-8.00%	0.29	0.25	0.21	0.16	0.12	0.08	0.03

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.20
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.20
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.20
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.20
총 최대손실 예상금액		0.79

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.49
-----	------