

**파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시**

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-13

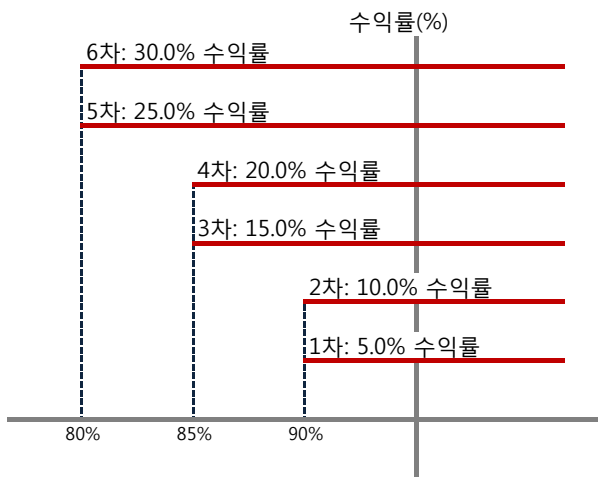
## 1. 계약금액

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

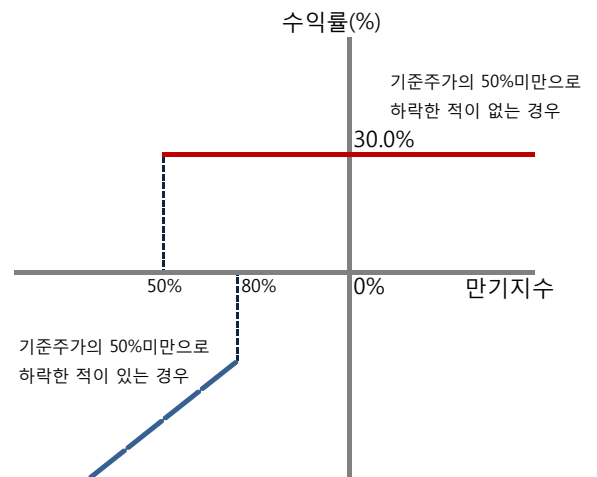
단위(백만원)

## 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%	(280.10)	(280.52)	(280.94)	(281.35)	(281.77)	(282.18)	(282.60)
	5.33%	(114.74)	(115.16)	(115.57)	(115.99)	(116.40)	(116.82)	(117.23)
	2.67%	(20.96)	(21.37)	(21.79)	(22.20)	(22.62)	(23.03)	(23.45)
	0.00%	1.25	0.83	0.42	0.00	(0.42)	(0.83)	(1.25)
	-2.67%	(48.13)	(48.54)	(48.96)	(49.38)	(49.79)	(50.21)	(50.62)
	-5.33%	(169.08)	(169.50)	(169.92)	(170.33)	(170.75)	(171.16)	(171.58)
	-8.00%	(361.62)	(362.03)	(362.45)	(362.87)	(363.28)	(363.70)	(364.11)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	103.41
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	102.63
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	94.99
KR6662374141	동양W(ELS)1004	63.07
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>364.11</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	170.87
-----	--------

# 메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-13

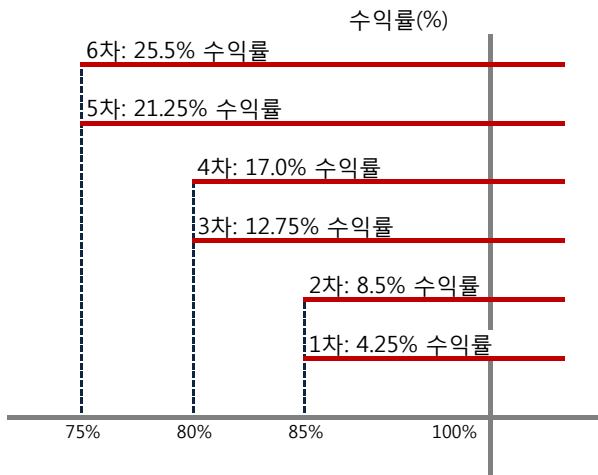
## 1. 계약금액

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

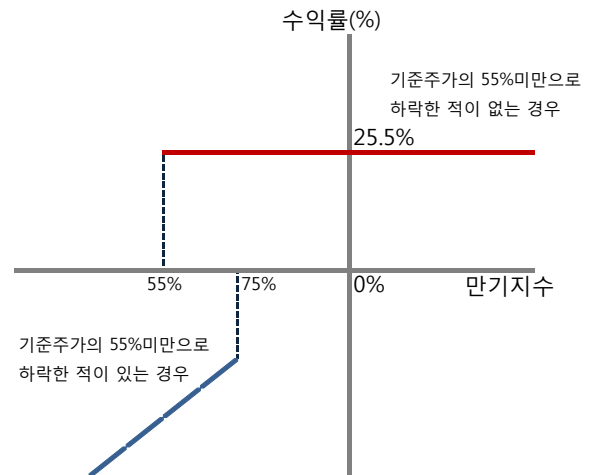
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	90.37	81.87	73.36	64.86	56.36	47.85	39.35
	5.33%	74.36	65.85	57.35	48.84	40.34	31.84	23.33
	2.67%	52.74	44.23	35.73	27.22	18.72	10.22	1.71
	0.00%	25.51	17.01	8.50	0.00	(8.50)	(17.01)	(25.51)
	-2.67%	(7.32)	(15.82)	(24.33)	(32.83)	(41.33)	(49.84)	(58.34)
	-5.33%	(45.75)	(54.26)	(62.76)	(71.26)	(79.77)	(88.27)	(96.78)
	-8.00%	(89.79)	(98.29)	(106.80)	(115.30)	(123.81)	(132.31)	(140.81)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	36.05
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	36.23
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	32.41
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	36.12
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>140.81</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	124.99
-----	--------

# 메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-13

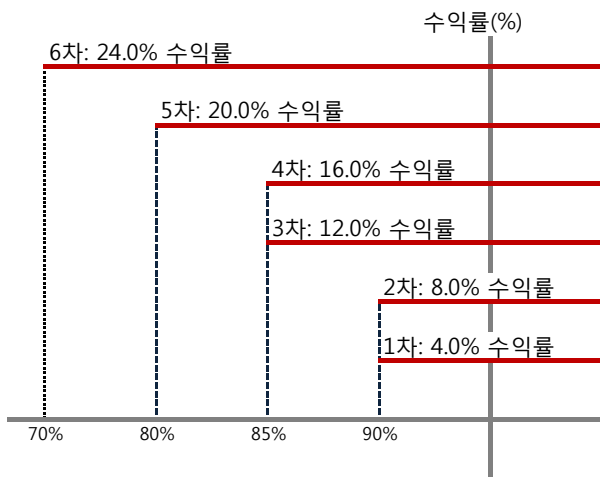
## 1. 계약금액

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

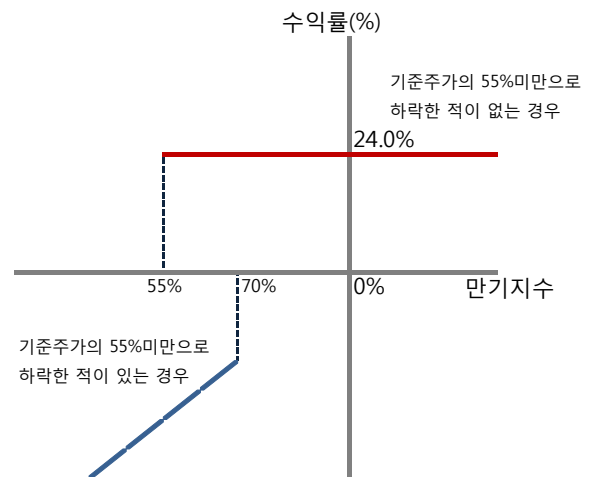
단위(백만원)

## 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%	275.81	248.70	221.60	194.49	167.39	140.28	113.18
	5.33%	219.22	192.12	165.01	137.91	110.81	83.70	56.60
	2.67%	154.39	127.29	100.18	73.08	45.97	18.87	(8.23)
	0.00%	81.31	54.21	27.10	0.00	(27.10)	(54.21)	(81.31)
	-2.67%	(0.01)	(27.12)	(54.22)	(81.33)	(108.43)	(135.54)	(162.64)
	-5.33%	(89.59)	(116.70)	(143.80)	(170.90)	(198.01)	(225.11)	(252.22)
	-8.00%	(187.42)	(214.52)	(241.63)	(268.73)	(295.83)	(322.94)	(350.04)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	87.49
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	87.31
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	87.96
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	87.29
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>350.04</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 448.74

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-13

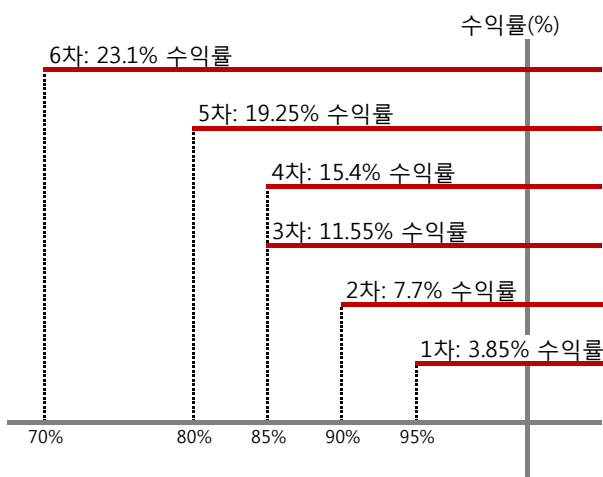
## 1. 계약금액

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

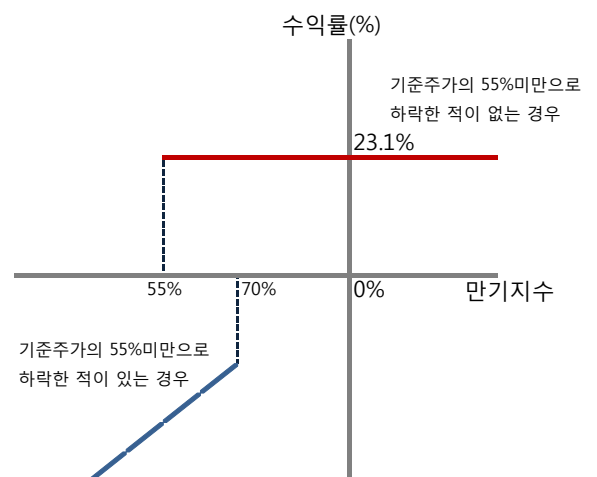
단위(백만원)

## 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 시나 리오	8.00%	59.38	52.94	46.51	40.07	33.63	27.20	20.76
	5.33%	47.77	41.33	34.90	28.46	22.02	15.59	9.15
	2.67%	34.41	27.98	21.54	15.10	8.67	2.23	(4.21)
	0.00%	19.31	12.87	6.44	0.00	(6.44)	(12.87)	(19.31)
	-2.67%	2.46	(3.97)	(10.41)	(16.85)	(23.28)	(29.72)	(36.16)
	-5.33%	(16.13)	(22.57)	(29.00)	(35.44)	(41.88)	(48.31)	(54.75)
	-8.00%	(36.47)	(42.90)	(49.34)	(55.78)	(62.21)	(68.65)	(75.09)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	18.77
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	18.67
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	18.70
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	18.95
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>75.09</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	75.80
-----	-------

# 메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-13

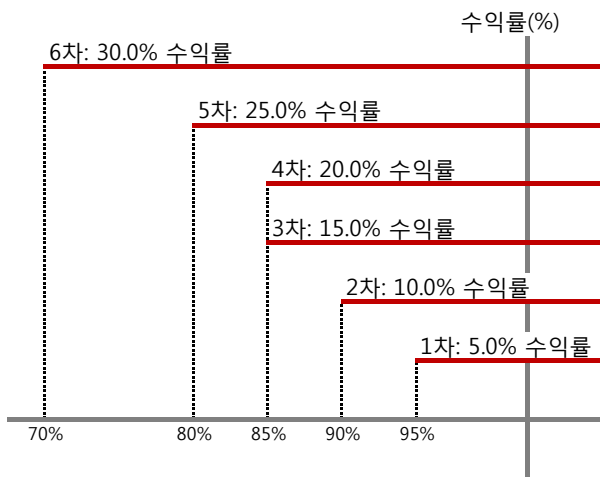
## 1. 계약금액

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

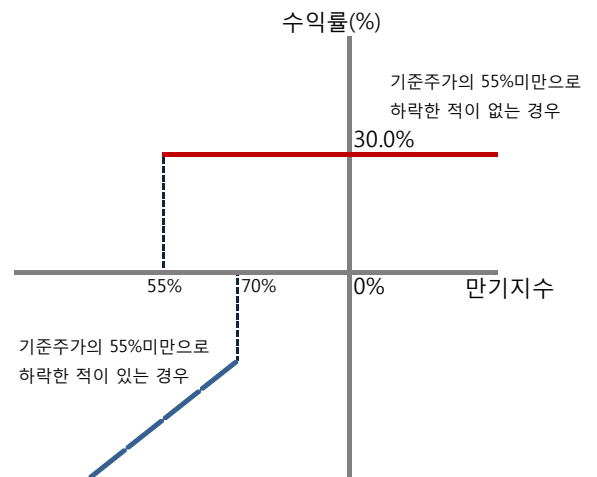
단위(백만원)

## 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%	62.63	53.98	45.32	36.67	28.01	19.36	10.70
	5.33%	52.59	43.94	35.28	26.63	17.97	9.32	0.66
	2.67%	40.37	31.71	23.06	14.40	5.75	(2.91)	(11.56)
	0.00%	25.96	17.31	8.65	0.00	(8.65)	(17.31)	(25.96)
	-2.67%	9.38	0.73	(7.93)	(16.58)	(25.24)	(33.89)	(42.55)
	-5.33%	(9.39)	(18.04)	(26.70)	(35.35)	(44.00)	(52.66)	(61.31)
	-8.00%	(30.33)	(38.99)	(47.64)	(56.30)	(64.95)	(73.61)	(82.26)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	20.56
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	20.45
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	20.50
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	20.75
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>82.26</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 70.54

# 메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-13

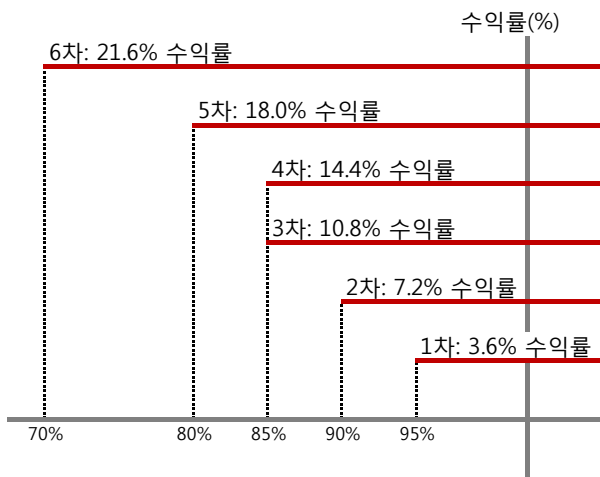
## 1. 계약금액

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

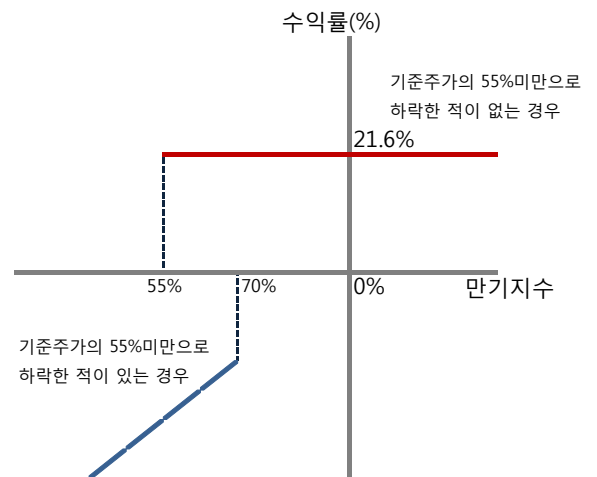
단위(백만원)

## 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%	160.94	137.93	114.92	91.91	68.90	45.89	22.88
	5.33%	131.42	108.41	85.40	62.39	39.38	16.37	(6.64)
	2.67%	100.78	77.77	54.76	31.75	8.74	(14.27)	(37.28)
	0.00%	69.03	46.02	23.01	0.00	(23.01)	(46.02)	(69.03)
	-2.67%	36.16	13.15	(9.86)	(32.87)	(55.88)	(78.89)	(101.90)
	-5.33%	2.18	(20.83)	(43.84)	(66.85)	(89.86)	(112.87)	(135.88)
	-8.00%	(32.92)	(55.93)	(78.94)	(101.95)	(124.96)	(147.97)	(170.98)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	20.75
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	42.74
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	42.73
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	42.73
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>148.96</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 164.23

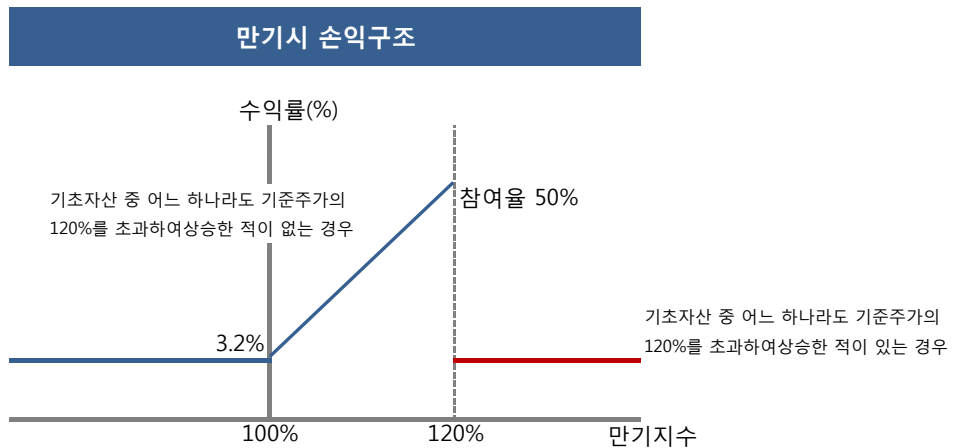
# 메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-13

## 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%	(0.92)	(0.92)	(0.92)	(0.92)	(0.92)	(0.92)	(0.92)
	5.33%	(0.56)	(0.56)	(0.56)	(0.56)	(0.56)	(0.56)	(0.56)
	2.67%	(0.25)	(0.25)	(0.25)	(0.25)	(0.25)	(0.25)	(0.25)
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	(0.00)	(0.00)	(0.00)
	-2.67%	0.19	0.19	0.19	0.19	0.19	0.19	0.19
	-5.33%	0.32	0.32	0.32	0.32	0.32	0.32	0.32
	-8.00%	0.39	0.39	0.39	0.39	0.39	0.39	0.39

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.23
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.23
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.23
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.23
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>0.92</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.35
-----	------