

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-20

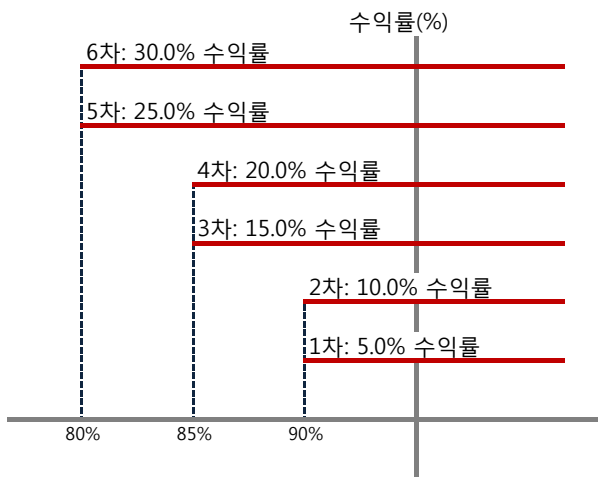
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,065	0	5,065	장외
누계	유가증권	ELS	5,065	0	5,065	장외

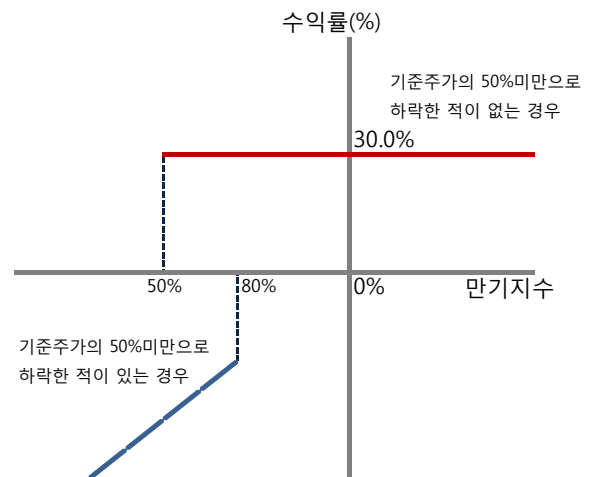
단위(백만원)

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%	(190.63)	(190.80)	(190.97)	(191.14)	(191.30)	(191.47)	(191.64)
	5.33%	(80.58)	(80.75)	(80.92)	(81.09)	(81.25)	(81.42)	(81.59)
	2.67%	(16.87)	(17.04)	(17.21)	(17.37)	(17.54)	(17.71)	(17.88)
	0.00%	0.50	0.34	0.17	0.00	(0.17)	(0.34)	(0.50)
	-2.67%	(28.46)	(28.63)	(28.80)	(28.96)	(29.13)	(29.30)	(29.47)
	-5.33%	(103.76)	(103.93)	(104.10)	(104.26)	(104.43)	(104.60)	(104.77)
	-8.00%	(225.40)	(225.57)	(225.73)	(225.90)	(226.07)	(226.24)	(226.41)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	63.59
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	58.64
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	62.56
KR6662374141	동양W(ELS)1004	41.62
총 최대손실 예상금액		226.41

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	73.08
-----	-------

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-20

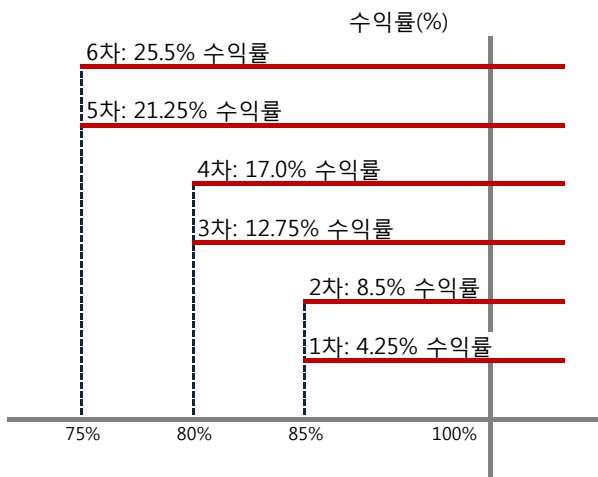
1. 계약금액

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

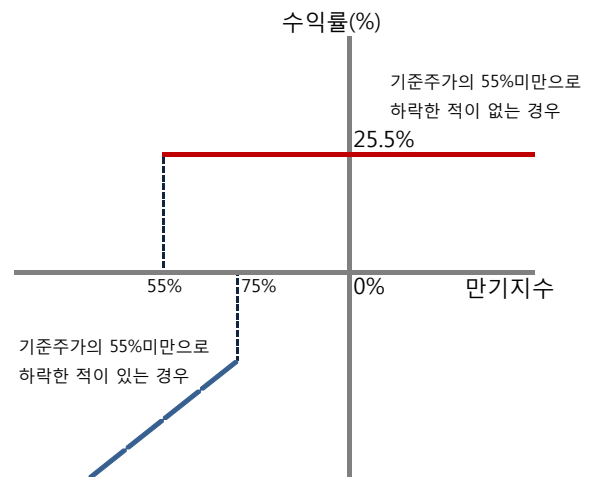
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	80.98	73.00	65.02	57.04	49.06	41.08	33.10
	5.33%	68.21	60.23	52.25	44.27	36.29	28.31	20.33
	2.67%	49.19	41.21	33.23	25.25	17.27	9.29	1.31
	0.00%	23.94	15.96	7.98	0.00	(7.98)	(15.96)	(23.94)
	-2.67%	(7.55)	(15.53)	(23.51)	(31.49)	(39.47)	(47.45)	(55.43)
	-5.33%	(45.28)	(53.26)	(61.24)	(69.22)	(77.20)	(85.18)	(93.16)
	-8.00%	(89.24)	(97.22)	(105.20)	(113.18)	(121.17)	(129.15)	(137.13)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	35.10
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	35.29
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	31.56
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	35.18
총 최대손실 예상금액		137.13

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	120.65
-----	--------

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-20

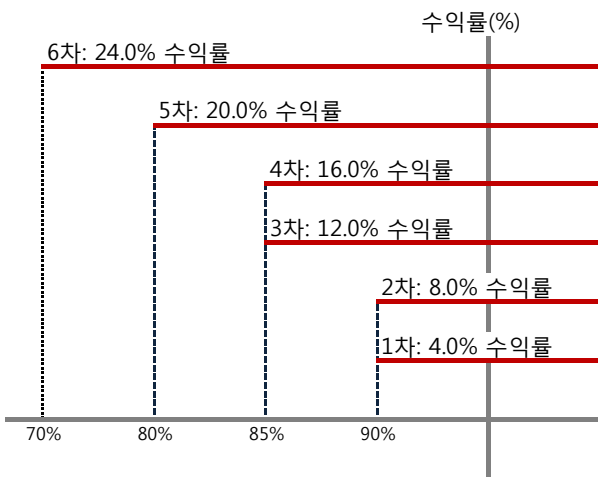
1. 계약금액

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

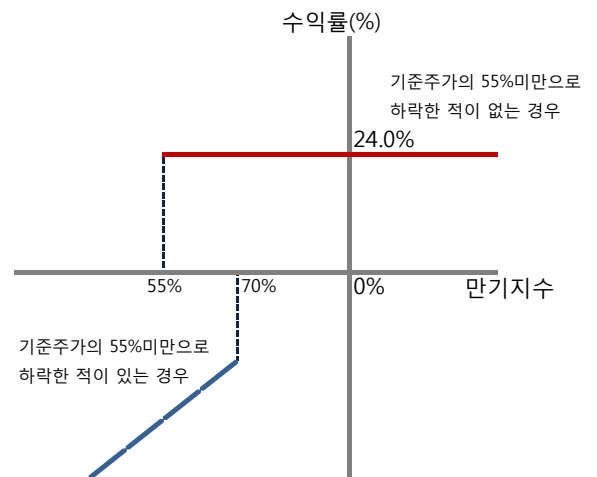
단위(백만원)

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 시나리오	8.00%	262.80	235.62	208.44	181.27	154.09	126.91	99.73
	5.33%	211.87	184.70	157.52	130.34	103.16	75.98	48.81
	2.67%	151.45	124.27	97.10	69.92	42.74	15.56	(11.62)
	0.00%	81.53	54.36	27.18	0.00	(27.18)	(54.36)	(81.53)
	-2.67%	2.12	(25.06)	(52.24)	(79.41)	(106.59)	(133.77)	(160.95)
	-5.33%	(86.79)	(113.97)	(141.15)	(168.32)	(195.50)	(222.68)	(249.86)
	-8.00%	(185.20)	(212.38)	(239.55)	(266.73)	(293.91)	(321.09)	(348.27)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	87.08
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	86.95
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	87.45
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	86.78
총 최대손실 예상금액		348.27

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 319.56

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-20

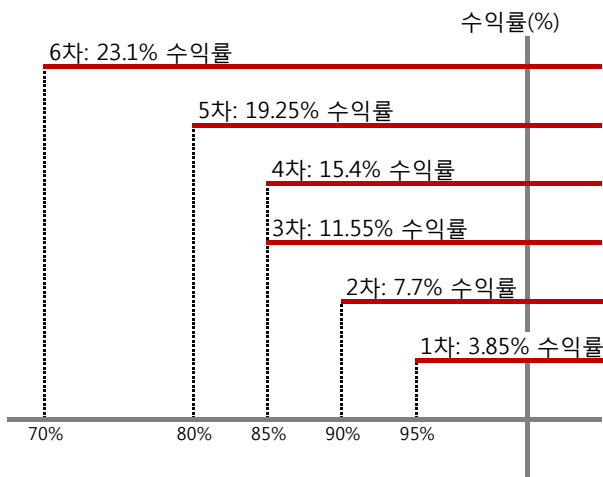
1. 계약금액

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

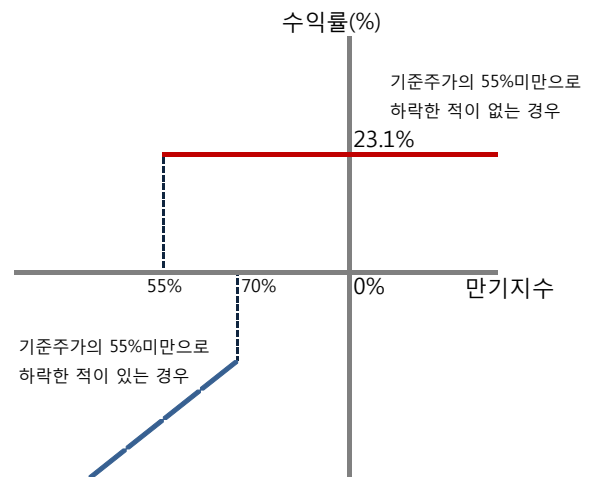
단위(백만원)

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%	51.74	45.71	39.68	33.65	27.61	21.58	15.55
	5.33%	42.63	36.59	30.56	24.53	18.50	12.46	6.43
	2.67%	31.41	25.38	19.35	13.31	7.28	1.25	(4.78)
	0.00%	18.10	12.07	6.03	0.00	(6.03)	(12.07)	(18.10)
	-2.67%	2.69	(3.35)	(9.38)	(15.41)	(21.44)	(27.48)	(33.51)
	-5.33%	(14.82)	(20.86)	(26.89)	(32.92)	(38.95)	(44.99)	(51.02)
	-8.00%	(34.43)	(40.46)	(46.50)	(52.53)	(58.56)	(64.59)	(70.63)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	17.65
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	17.55
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	17.58
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	17.85
총 최대손실 예상금액		70.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	56.59
-----	-------

메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-20

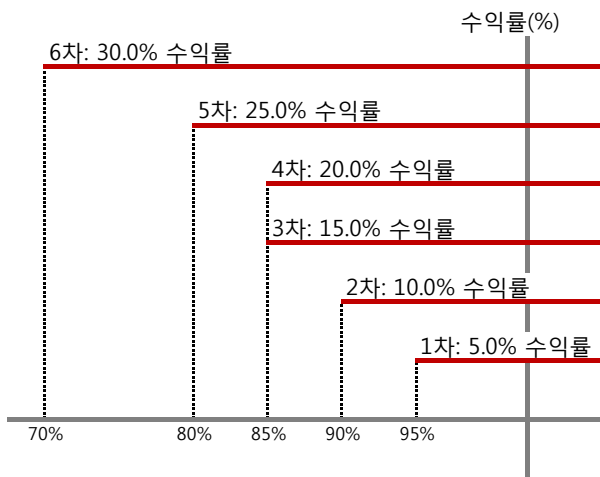
1. 계약금액

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

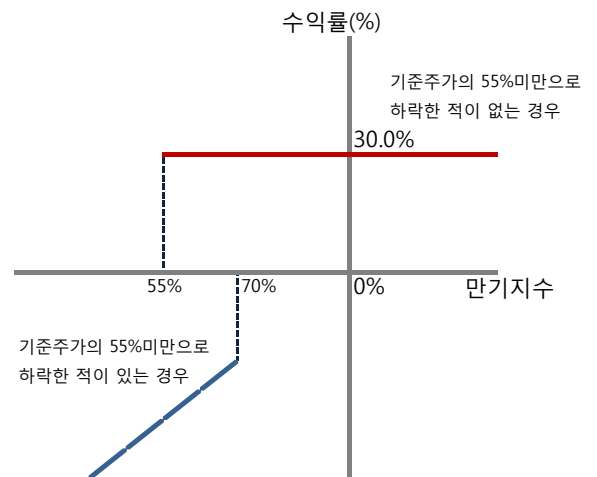
단위(백만원)

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 시나리오	8.00%	59.13	51.10	43.08	35.05	27.03	19.01	10.98
	5.33%	49.58	41.55	33.53	25.50	17.48	9.46	1.43
	2.67%	37.89	29.87	21.84	13.82	5.80	(2.23)	(10.25)
	0.00%	24.07	16.05	8.02	0.00	(8.02)	(16.05)	(24.07)
	-2.67%	8.12	0.09	(7.93)	(15.96)	(23.98)	(32.00)	(40.03)
	-5.33%	(9.98)	(18.00)	(26.02)	(34.05)	(42.07)	(50.10)	(58.12)
	-8.00%	(30.20)	(38.23)	(46.25)	(54.28)	(62.30)	(70.32)	(78.35)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	19.58
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	19.47
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	19.52
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	19.78
총 최대손실 예상금액		78.35

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 75.54

메리츠 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-20

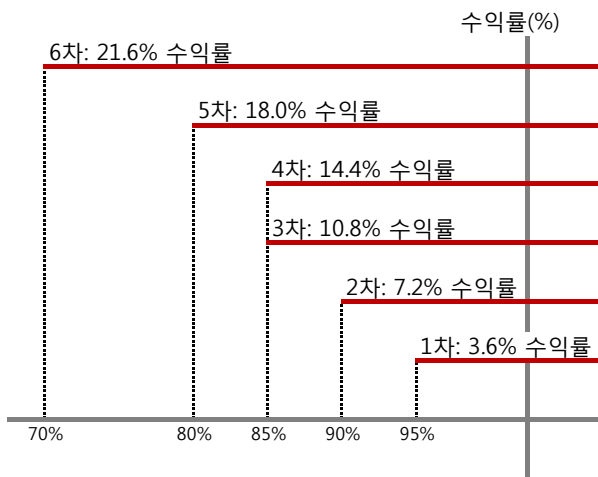
1. 계약금액

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

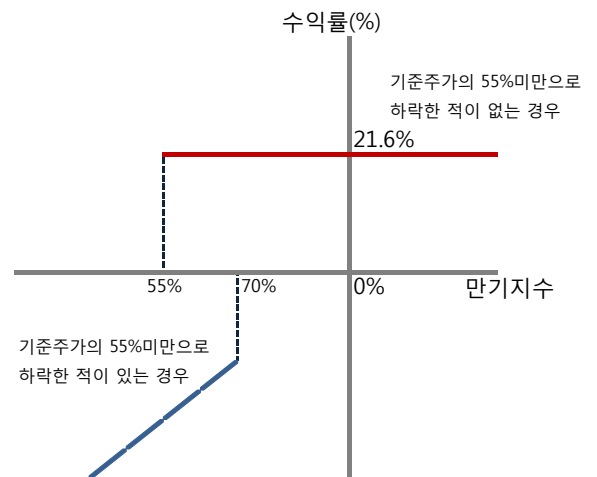
단위(백만원)

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%	152.97	131.91	110.85	89.79	68.73	47.67	26.60
	5.33%	124.35	103.29	82.23	61.17	40.11	19.05	(2.01)
	2.67%	94.42	73.36	52.30	31.24	10.18	(10.88)	(31.94)
	0.00%	63.18	42.12	21.06	0.00	(21.06)	(42.12)	(63.18)
	-2.67%	30.63	9.57	(11.49)	(32.55)	(53.61)	(74.67)	(95.73)
	-5.33%	(3.23)	(24.29)	(45.35)	(66.41)	(87.48)	(108.54)	(129.60)
	-8.00%	(38.40)	(59.47)	(80.53)	(101.59)	(122.65)	(143.71)	(164.77)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	19.78
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	41.19
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	41.16
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	41.17
총 최대손실 예상금액		143.30

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 146.62

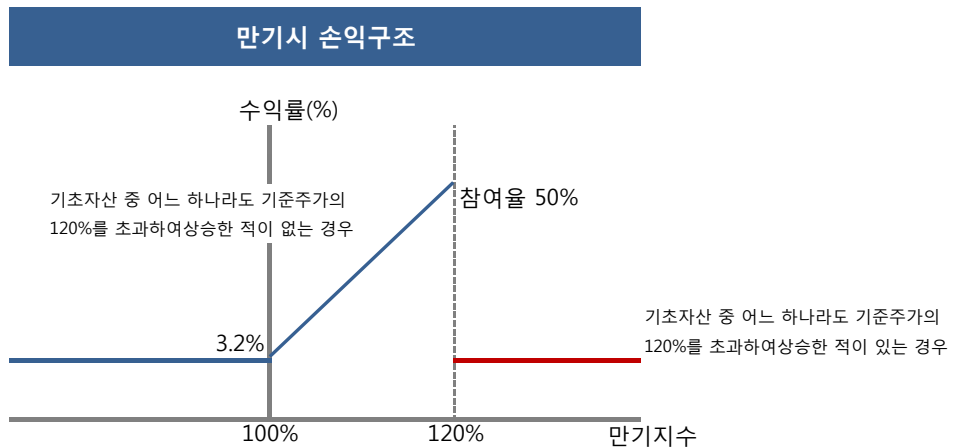
메리츠 한중지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-20

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%	(1.33)	(1.33)	(1.32)	(1.31)	(1.30)	(1.30)	(1.29)
	5.33%	(0.79)	(0.78)	(0.78)	(0.77)	(0.76)	(0.76)	(0.75)
	2.67%	(0.35)	(0.35)	(0.34)	(0.33)	(0.33)	(0.32)	(0.31)
	0.00%	(0.02)	(0.01)	(0.01)	0.00	0.01	0.01	0.02
	-2.67%	0.21	0.22	0.22	0.23	0.24	0.24	0.25
	-5.33%	0.34	0.34	0.35	0.36	0.36	0.37	0.38
	-8.00%	0.36	0.37	0.37	0.38	0.39	0.39	0.40

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.33
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.33
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.33
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.33
총 최대손실 예상금액		1.33

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.62
-----	------