

**파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시**

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-21

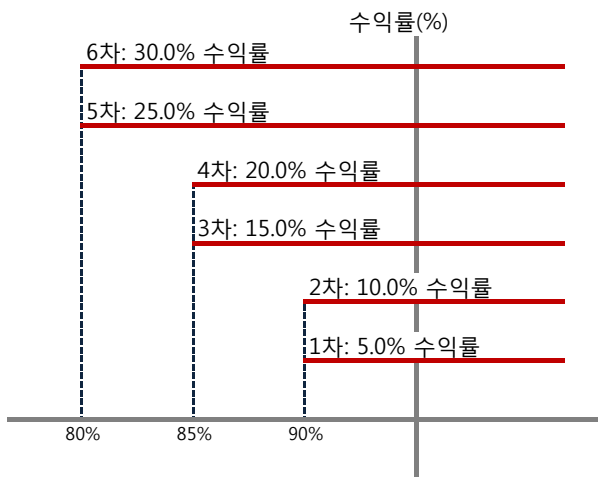
## 1. 계약금액

단위(백만원)

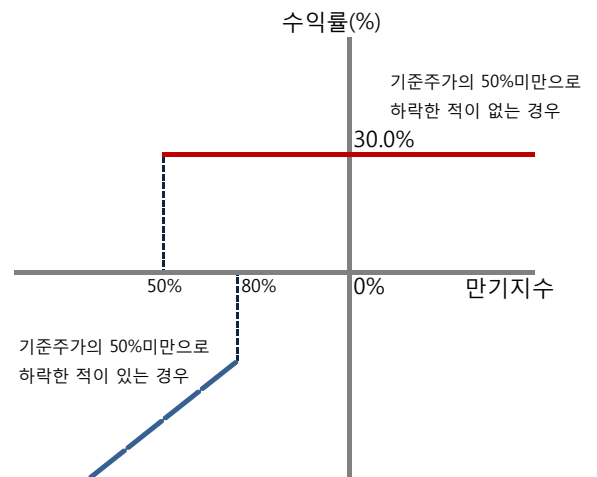
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,065	0	5,065	장외
누계	유가증권	ELS	5,065	0	5,065	장외

## 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%	5.33%	2.67%	0.00%	-2.67%	-5.33%	-8.00%
자산	(233.23)	(98.81)	(20.71)	1.07	(33.46)	(124.31)	(271.48)
시나	(233.59)	(99.17)	(21.07)	0.72	(33.82)	(124.67)	(271.84)
리오	(233.95)	(99.53)	(21.43)	0.36	(34.18)	(125.03)	(272.19)
	(234.31)	(99.89)	(21.78)	0.00	(34.53)	(125.38)	(272.55)
	(234.66)	(100.24)	(22.14)	(0.36)	(34.89)	(125.74)	(272.91)
	(235.02)	(100.60)	(22.50)	(0.72)	(35.25)	(126.10)	(273.27)
	(235.38)	(100.96)	(22.86)	(1.07)	(35.61)	(126.46)	(273.62)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	76.88
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	70.89
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	75.63
KR6662374141	동양W(ELS)1004	50.22
총 최대손실 예상금액		273.62

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 69.28

# 메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-21

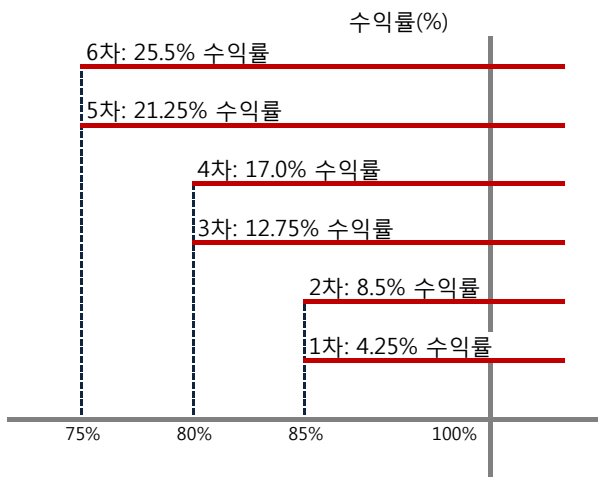
## 1. 계약금액

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

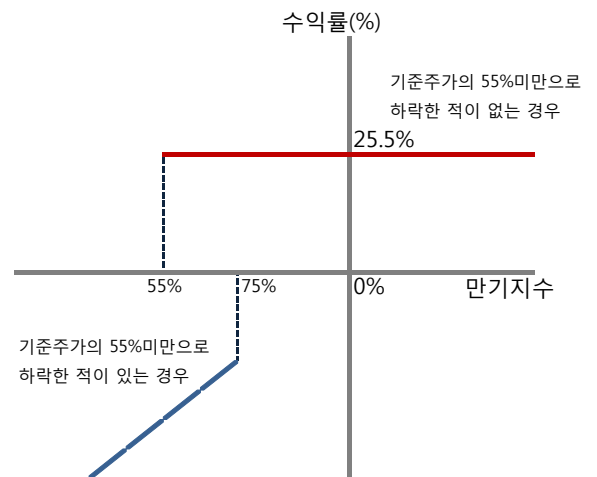
단위(백만원)

## 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%	87.93	79.14	70.36	61.58	52.80	44.02	35.24
	5.33%	74.08	65.30	56.51	47.73	38.95	30.17	21.39
	2.67%	53.55	44.77	35.99	27.21	18.42	9.64	0.86
	0.00%	26.35	17.56	8.78	0.00	(8.78)	(17.56)	(26.35)
	-2.67%	(7.54)	(16.32)	(25.10)	(33.88)	(42.67)	(51.45)	(60.23)
	-5.33%	(48.10)	(56.88)	(65.66)	(74.45)	(83.23)	(92.01)	(100.79)
	-8.00%	(95.34)	(104.12)	(112.90)	(121.68)	(130.47)	(139.25)	(148.03)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	37.90
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	38.08
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	34.07
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	37.97
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>148.03</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 137.94

# 메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-21

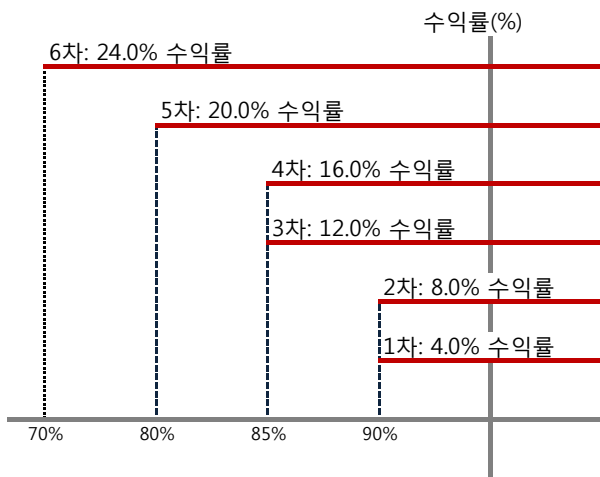
## 1. 계약금액

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

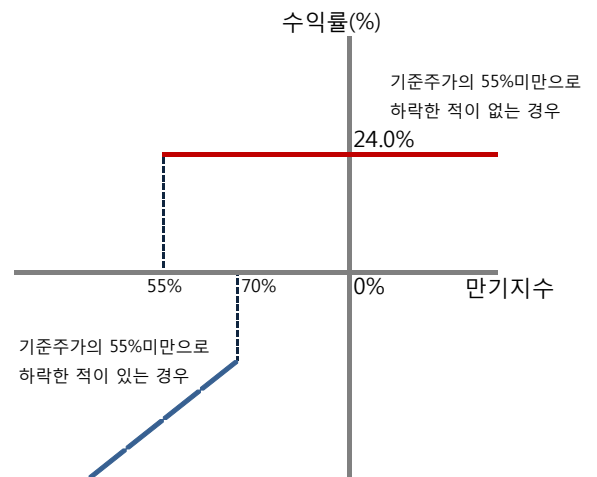
단위(백만원)

## 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%	269.26	241.12	212.98	184.83	156.69	128.55	100.41
	5.33%	217.82	189.68	161.53	133.39	105.25	77.11	48.97
	2.67%	156.21	128.06	99.92	71.78	43.64	15.50	(12.64)
	0.00%	84.43	56.28	28.14	0.00	(28.14)	(56.28)	(84.43)
	-2.67%	2.47	(25.67)	(53.81)	(81.95)	(110.09)	(138.23)	(166.38)
	-5.33%	(89.65)	(117.79)	(145.93)	(174.07)	(202.21)	(230.36)	(258.50)
	-8.00%	(191.94)	(220.08)	(248.22)	(276.36)	(304.50)	(332.65)	(360.79)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	90.23
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	90.14
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	90.56
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	89.86
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>360.79</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 361.60

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-21

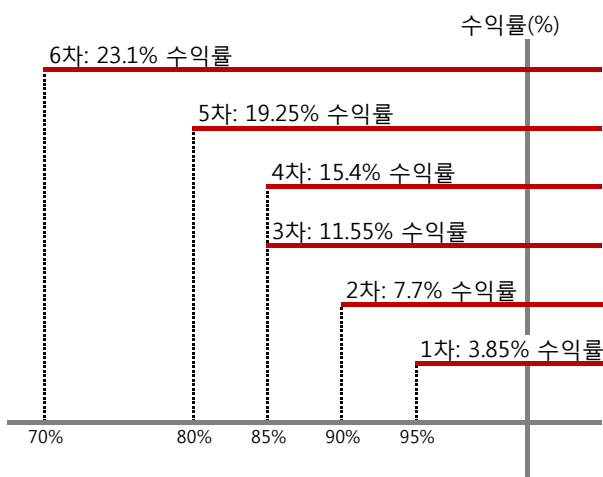
## 1. 계약금액

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

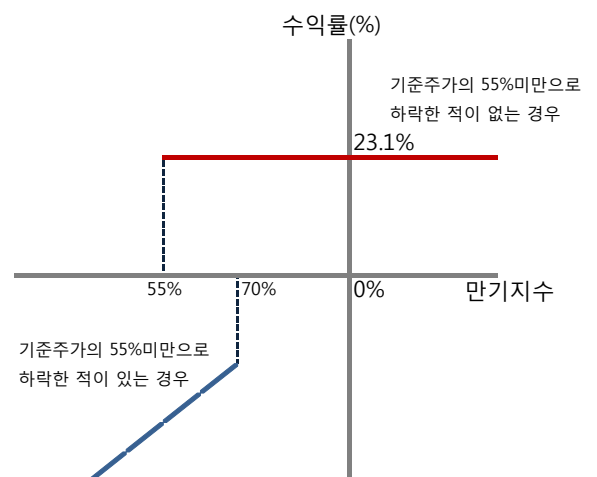
단위(백만원)

## 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%	56.47	50.06	43.64	37.22	30.80	24.38	17.97
	5.33%	45.92	39.51	33.09	26.67	20.25	13.83	7.42
	2.67%	33.52	27.10	20.68	14.26	7.84	1.43	(4.99)
	0.00%	19.25	12.84	6.42	0.00	(6.42)	(12.84)	(19.25)
	-2.67%	3.14	(3.28)	(9.70)	(16.12)	(22.54)	(28.95)	(35.37)
	-5.33%	(14.84)	(21.26)	(27.67)	(34.09)	(40.51)	(46.93)	(53.35)
	-8.00%	(34.67)	(41.08)	(47.50)	(53.92)	(60.34)	(66.76)	(73.17)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	18.29
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	18.18
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	18.22
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	18.48
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>73.17</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 69.01

# 메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-21

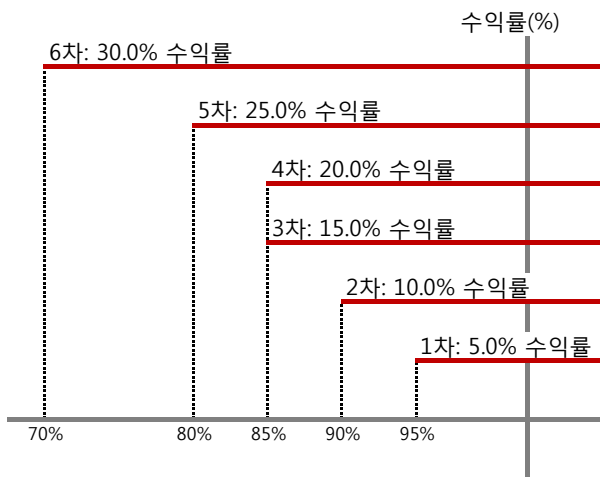
## 1. 계약금액

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

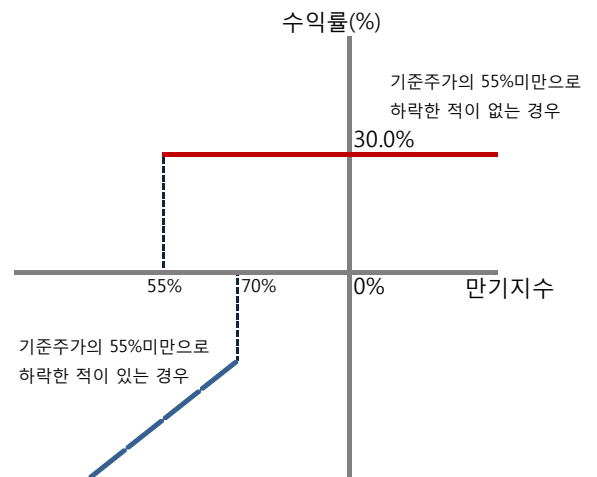
단위(백만원)

## 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%	60.22	52.29	44.36	36.43	28.49	20.56	12.63
	5.33%	50.25	42.32	34.39	26.45	18.52	10.59	2.66
	2.67%	38.11	30.18	22.25	14.31	6.38	(1.55)	(9.49)
	0.00%	23.80	15.87	7.93	0.00	(7.93)	(15.87)	(23.80)
	-2.67%	7.32	(0.62)	(8.55)	(16.48)	(24.42)	(32.35)	(40.28)
	-5.33%	(11.34)	(19.27)	(27.20)	(35.14)	(43.07)	(51.00)	(58.93)
	-8.00%	(32.16)	(40.09)	(48.03)	(55.96)	(63.89)	(71.83)	(79.76)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	19.93
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	19.82
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	19.87
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	20.14
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>79.76</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

81.35

# 메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-21

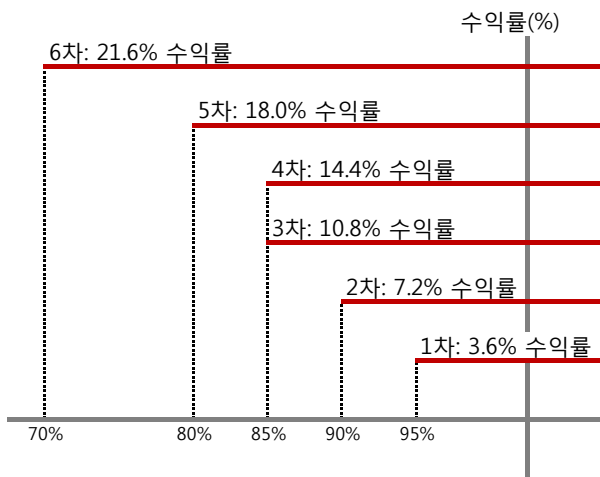
## 1. 계약금액

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

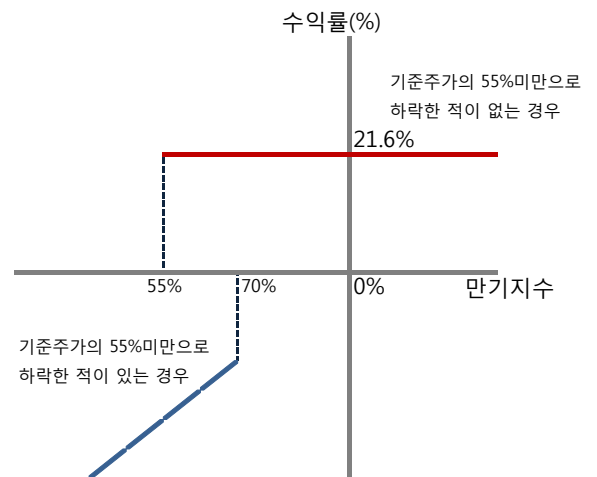
단위(백만원)

## 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 시나 리오	8.00%	142.48	120.92	99.35	77.79	56.22	34.66	13.09
	5.33%	118.91	97.35	75.78	54.22	32.65	11.09	(10.48)
	2.67%	92.99	71.42	49.86	28.29	6.72	(14.84)	(36.41)
	0.00%	64.70	43.13	21.57	0.00	(21.57)	(43.13)	(64.70)
	-2.67%	34.04	12.48	(9.09)	(30.65)	(52.22)	(73.78)	(95.35)
	-5.33%	1.03	(20.53)	(42.10)	(63.66)	(85.23)	(106.79)	(128.36)
	-8.00%	(34.34)	(55.91)	(77.47)	(99.04)	(120.60)	(142.17)	(163.73)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	20.14
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	40.93
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	40.92
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	40.92
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>142.91</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 139.13

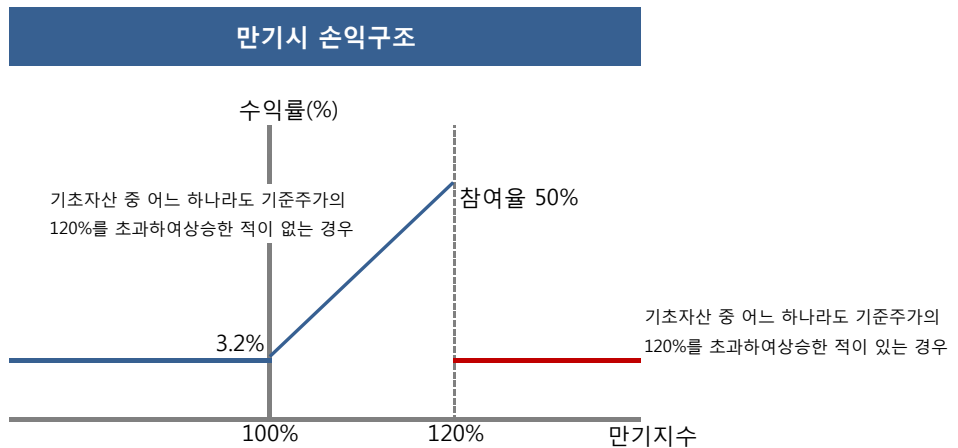
# 메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-21

## 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%	(1.52)	(1.54)	(1.55)	(1.57)	(1.58)	(1.60)	(1.62)
	5.33%	(0.87)	(0.88)	(0.90)	(0.92)	(0.93)	(0.95)	(0.96)
	2.67%	(0.35)	(0.36)	(0.38)	(0.39)	(0.41)	(0.42)	(0.44)
	0.00%	0.05	0.03	0.02	0.00	(0.02)	(0.03)	(0.05)
	-2.67%	0.31	0.29	0.28	0.26	0.25	0.23	0.22
	-5.33%	0.44	0.43	0.41	0.39	0.38	0.36	0.35
	-8.00%	0.44	0.43	0.41	0.40	0.38	0.37	0.35

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.40
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.40
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.40
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.40
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>1.62</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.99
-----	------