

**파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시**

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-24

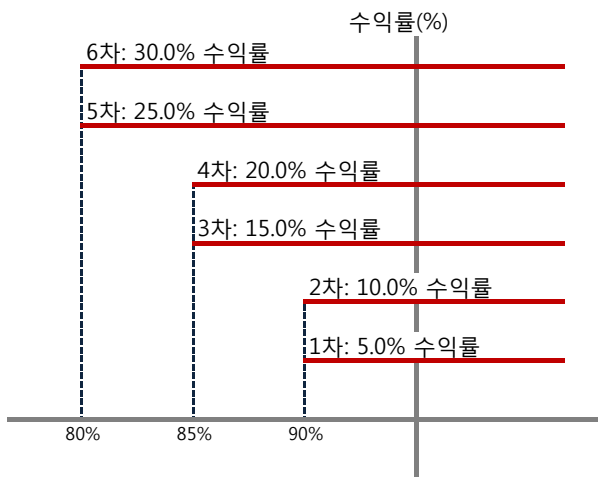
## 1. 계약금액

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

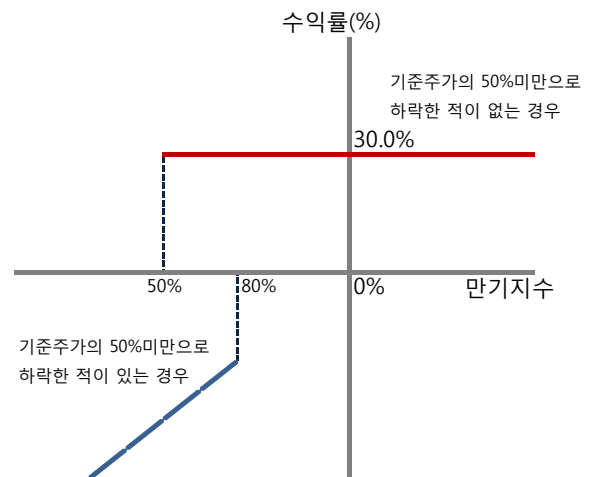
단위(백만원)

## 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 시나리오	8.00%	(245.37)	(245.67)	(245.97)	(246.28)	(246.58)	(246.88)	(247.19)
	5.33%	(104.41)	(104.71)	(105.02)	(105.32)	(105.62)	(105.93)	(106.23)
	2.67%	(22.32)	(22.62)	(22.92)	(23.23)	(23.53)	(23.83)	(24.14)
	0.00%	0.91	0.61	0.30	0.00	(0.30)	(0.61)	(0.91)
	-2.67%	(34.73)	(35.03)	(35.33)	(35.64)	(35.94)	(36.25)	(36.55)
	-5.33%	(129.23)	(129.53)	(129.84)	(130.14)	(130.45)	(130.75)	(131.05)
	-8.00%	(282.60)	(282.90)	(283.21)	(283.51)	(283.81)	(284.12)	(284.42)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	79.89
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	73.68
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	78.60
KR6662374141	동양W(ELS)1004	52.25
총 최대손실 예상금액		284.42

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	84.73
-----	-------

# 메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-24

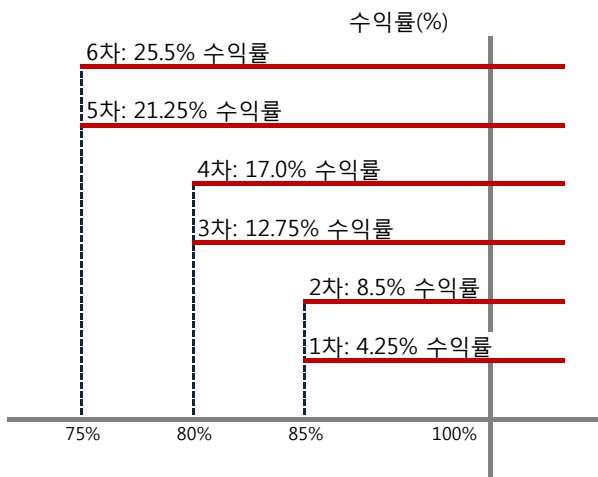
## 1. 계약금액

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

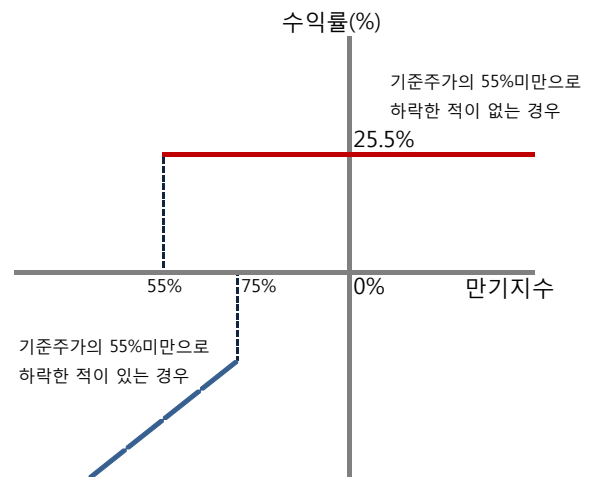
단위(백만원)

## 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%	88.40	80.24	72.07	63.91	55.75	47.58	39.42
	5.33%	73.38	65.22	57.06	48.89	40.73	32.57	24.40
	2.67%	52.08	43.92	35.75	27.59	19.43	11.26	3.10
	0.00%	24.49	16.33	8.16	0.00	(8.16)	(16.33)	(24.49)
	-2.67%	(9.38)	(17.55)	(25.71)	(33.88)	(42.04)	(50.20)	(58.37)
	-5.33%	(49.55)	(57.71)	(65.87)	(74.04)	(82.20)	(90.36)	(98.53)
	-8.00%	(95.99)	(104.16)	(112.32)	(120.48)	(128.65)	(136.81)	(144.97)

### 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	37.10
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	37.31
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	33.37
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	37.19
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>144.97</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	167.45
-----	--------

# 메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-24

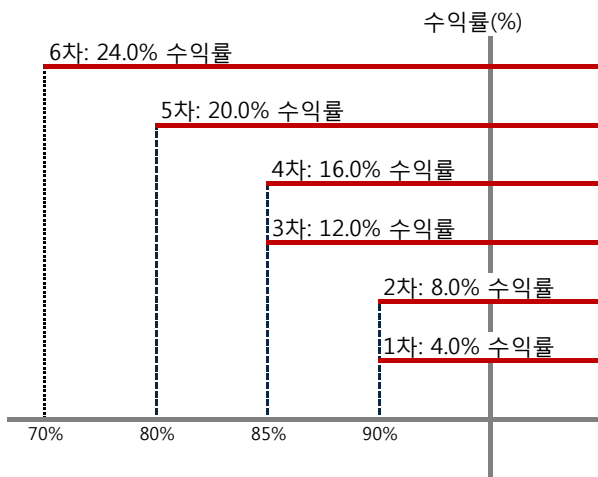
## 1. 계약금액

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

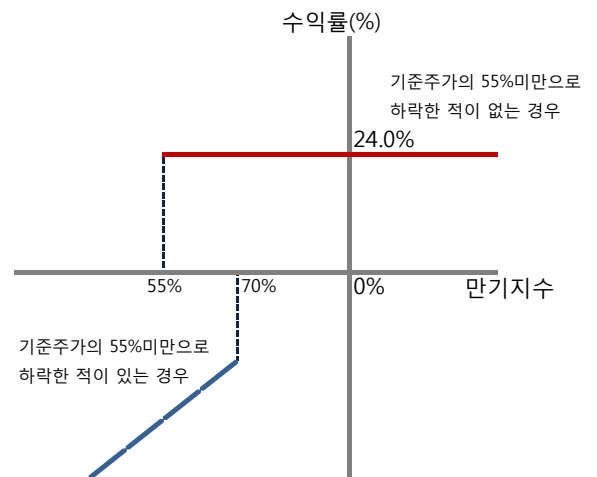
단위(백만원)

## 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%	278.72	250.66	222.61	194.56	166.50	138.45	110.39
	5.33%	223.10	195.04	166.99	138.94	110.88	82.83	54.77
	2.67%	158.24	130.19	102.14	74.08	46.03	17.98	(10.08)
	0.00%	84.16	56.11	28.05	0.00	(28.05)	(56.11)	(84.16)
	-2.67%	0.85	(27.21)	(55.26)	(83.31)	(111.37)	(139.42)	(167.48)
	-5.33%	(91.70)	(119.75)	(147.81)	(175.86)	(203.91)	(231.97)	(260.02)
	-8.00%	(193.47)	(221.53)	(249.58)	(277.64)	(305.69)	(333.74)	(361.80)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	90.44
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	90.29
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	90.88
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	90.19
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>361.80</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 385.01

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-24

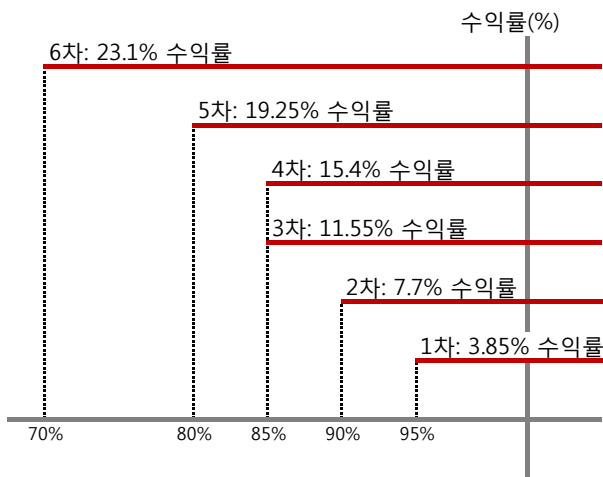
## 1. 계약금액

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

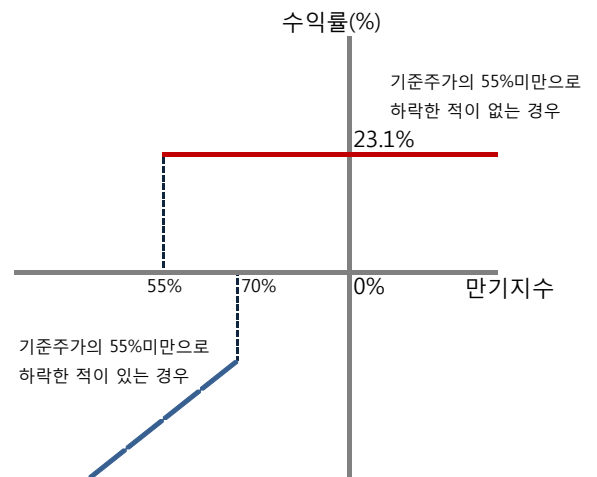
단위(백만원)

## 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%	51.69	45.80	39.90	34.01	28.12	22.23	16.33
	5.33%	42.22	36.33	30.43	24.54	18.65	12.76	6.86
	2.67%	30.88	24.99	19.10	13.20	7.31	1.42	(4.47)
	0.00%	17.68	11.79	5.89	0.00	(5.89)	(11.79)	(17.68)
	-2.67%	2.61	(3.28)	(9.18)	(15.07)	(20.96)	(26.86)	(32.75)
	-5.33%	(14.33)	(20.22)	(26.11)	(32.01)	(37.90)	(43.79)	(49.69)
	-8.00%	(33.13)	(39.02)	(44.92)	(50.81)	(56.70)	(62.60)	(68.49)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	17.12
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	17.01
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	17.05
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	17.31
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>68.49</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

60.42

# 메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-24

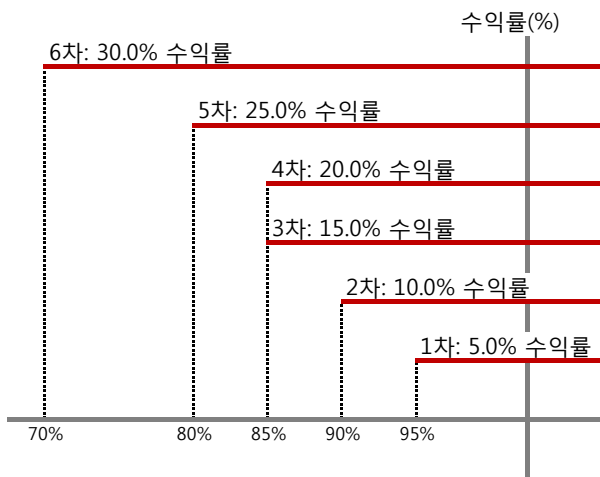
## 1. 계약금액

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

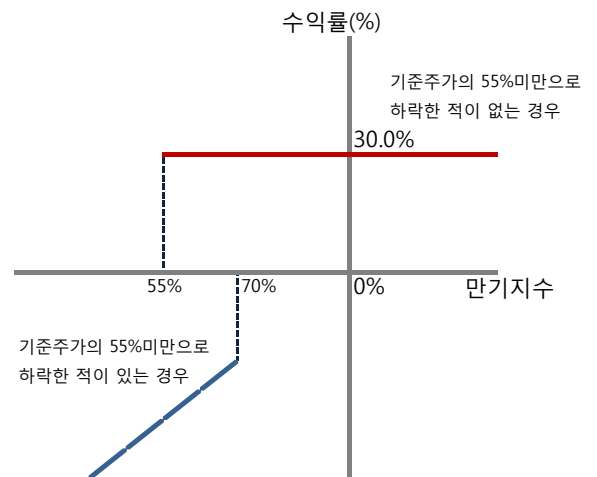
단위(백만원)

## 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%	57.40	49.71	42.02	34.33	26.64	18.95	11.26
	5.33%	48.02	40.33	32.64	24.95	17.26	9.57	1.88
	2.67%	36.58	28.89	21.20	13.51	5.82	(1.87)	(9.56)
	0.00%	23.07	15.38	7.69	0.00	(7.69)	(15.38)	(23.07)
	-2.67%	7.49	(0.20)	(7.89)	(15.58)	(23.27)	(30.95)	(38.64)
	-5.33%	(10.15)	(17.84)	(25.53)	(33.22)	(40.91)	(48.60)	(56.29)
	-8.00%	(29.86)	(37.55)	(45.24)	(52.93)	(60.62)	(68.31)	(75.99)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	18.99
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	18.88
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	18.93
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	19.19
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>75.99</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 76.11

# 메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-24

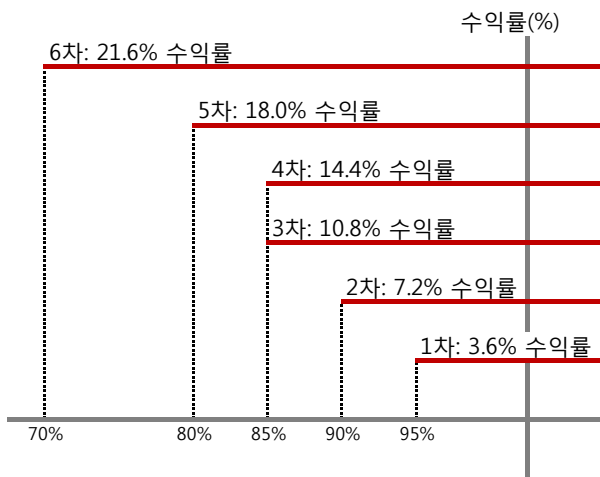
## 1. 계약금액

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

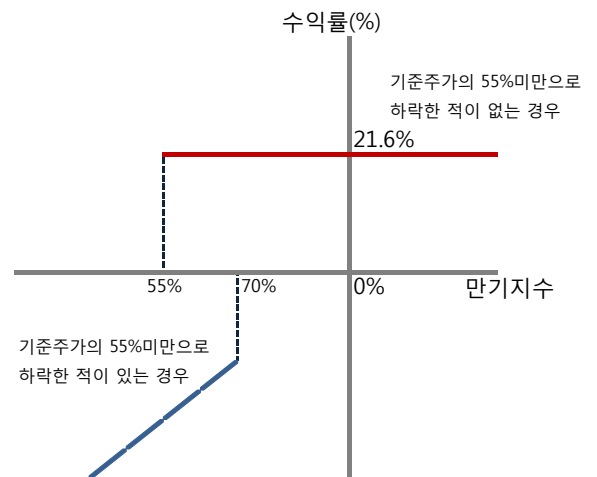
단위(백만원)

## 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%	156.86	135.56	114.26	92.96	71.65	50.35	29.05
	5.33%	127.06	105.76	84.46	63.15	41.85	20.55	(0.75)
	2.67%	96.08	74.77	53.47	32.17	10.87	(10.44)	(31.74)
	0.00%	63.91	42.60	21.30	0.00	(21.30)	(42.60)	(63.91)
	-2.67%	30.55	9.25	(12.05)	(33.35)	(54.66)	(75.96)	(97.26)
	-5.33%	(3.98)	(25.29)	(46.59)	(67.89)	(89.19)	(110.50)	(131.80)
	-8.00%	(39.71)	(61.01)	(82.31)	(103.61)	(124.92)	(146.22)	(167.52)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	19.19
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	41.87
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	41.84
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	41.85
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>144.75</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 160.70

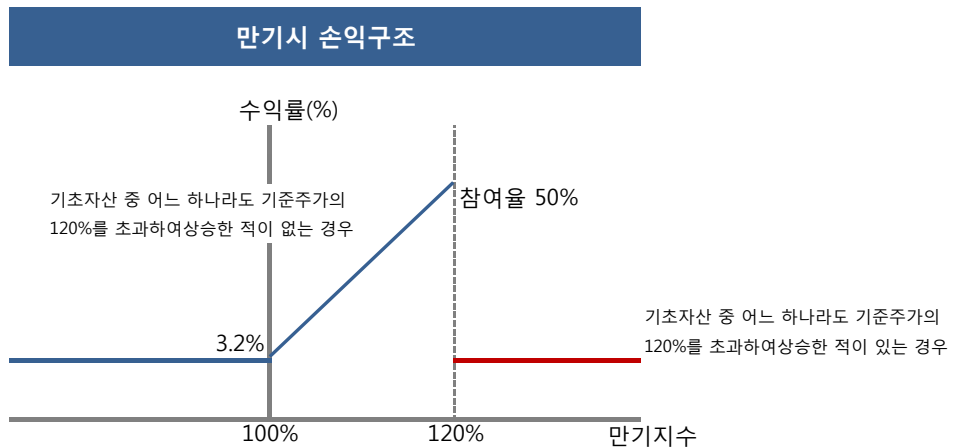
# 메리츠 한중지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-02-24

## 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%	(1.24)	(1.31)	(1.39)	(1.46)	(1.53)	(1.61)	(1.68)
	5.33%	(0.62)	(0.69)	(0.76)	(0.84)	(0.91)	(0.98)	(1.05)
	2.67%	(0.13)	(0.20)	(0.27)	(0.35)	(0.42)	(0.49)	(0.57)
	0.00%	0.22	0.15	0.07	0.00	(0.07)	(0.15)	(0.22)
	-2.67%	0.43	0.36	0.28	0.21	0.14	0.06	(0.01)
	-5.33%	0.50	0.43	0.35	0.28	0.21	0.13	0.06
	-8.00%	0.43	0.36	0.29	0.21	0.14	0.07	(0.01)

### 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.42
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.42
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.42
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.42
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>1.68</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.36
-----	------