

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

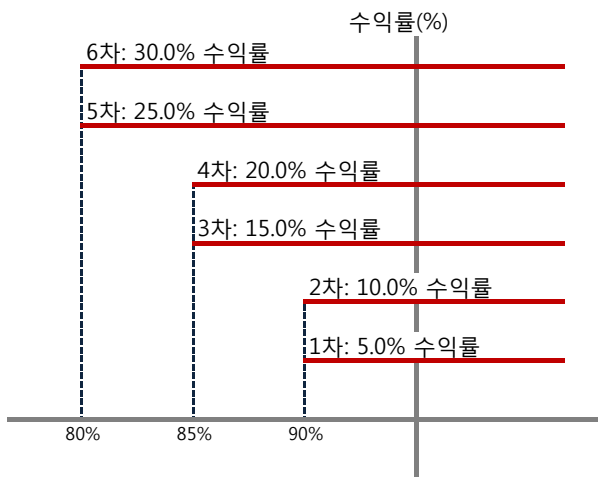
## 1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,748	0	4,748	장외
누계	유가증권	ELS	4,748	0	4,748	장외

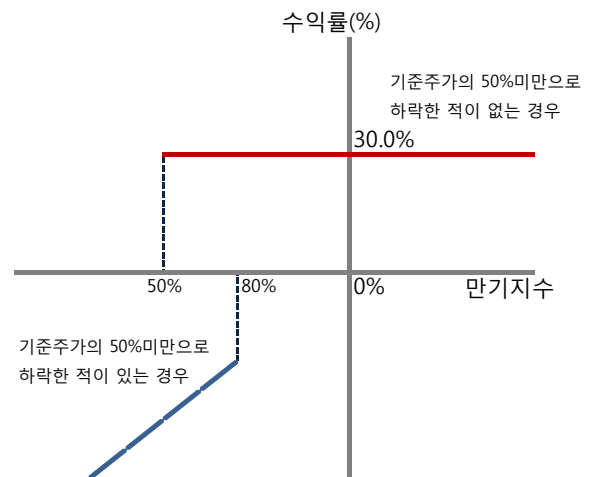
단위(백만원)

## 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%	(506.22)	(506.80)	(507.39)	(507.97)	(508.56)	(509.15)	(509.73)
	5.33%	(214.67)	(215.25)	(215.84)	(216.43)	(217.01)	(217.60)	(218.18)
	2.67%	(45.34)	(45.93)	(46.52)	(47.10)	(47.69)	(48.27)	(48.86)
	0.00%	1.76	1.17	0.59	0.00	(0.59)	(1.17)	(1.76)
	-2.67%	(73.37)	(73.95)	(74.54)	(75.12)	(75.71)	(76.29)	(76.88)
	-5.33%	(270.72)	(271.30)	(271.89)	(272.47)	(273.06)	(273.64)	(274.23)
	-8.00%	(590.29)	(590.87)	(591.46)	(592.04)	(592.63)	(593.22)	(593.80)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	158.41
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	143.88
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	175.01
KR6662374141	동양W(ELS)1004	116.49
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>593.80</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	158.54
-----	--------

# 메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

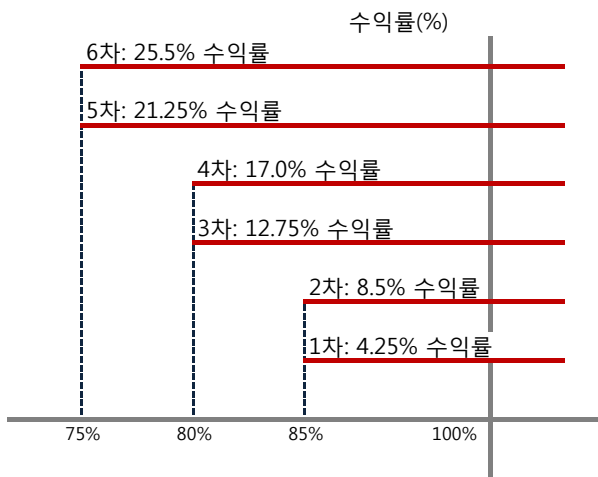
## 1. 계약금액

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

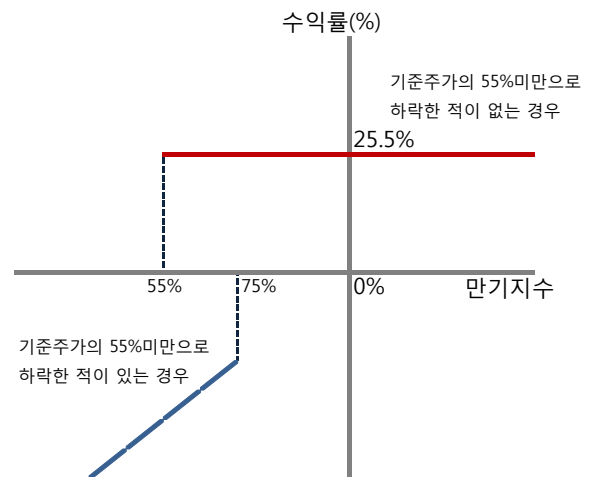
단위(백만원)

## 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 시나 리오	8.00%	84.07	75.95	67.84	59.72	51.60	43.49	35.37
	5.33%	70.89	62.77	54.66	46.54	38.42	30.31	22.19
	2.67%	50.98	42.87	34.75	26.63	18.52	10.40	2.28
	0.00%	24.35	16.23	8.12	0.00	(8.12)	(16.23)	(24.35)
	-2.67%	(9.01)	(17.13)	(25.24)	(33.36)	(41.48)	(49.59)	(57.71)
	-5.33%	(49.10)	(57.21)	(65.33)	(73.45)	(81.56)	(89.68)	(97.80)
	-8.00%	(95.91)	(104.03)	(112.14)	(120.26)	(128.38)	(136.49)	(144.61)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	37.00
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	37.23
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	33.28
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	37.10
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>144.61</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 155.87

# 메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

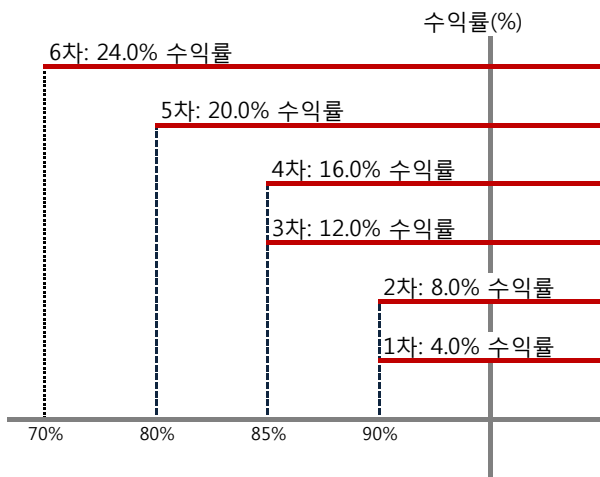
## 1. 계약금액

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

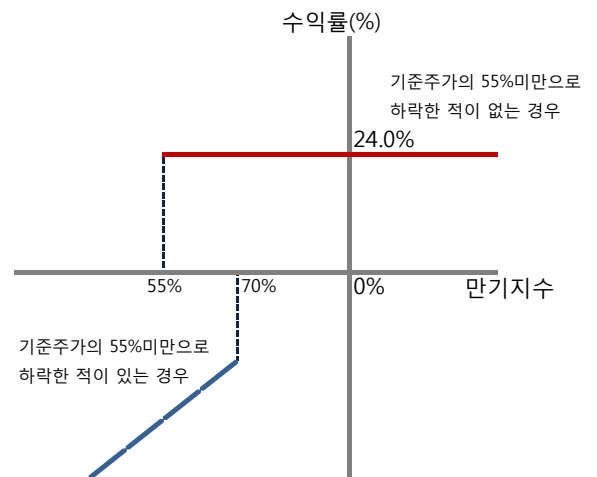
단위(백만원)

## 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%	261.66	235.21	208.75	182.29	155.83	129.37	102.92
	5.33%	211.58	185.12	158.67	132.21	105.75	79.29	52.83
	2.67%	150.82	124.36	97.90	71.45	44.99	18.53	(7.93)
	0.00%	79.37	52.92	26.46	0.00	(26.46)	(52.92)	(79.37)
	-2.67%	(2.75)	(29.21)	(55.67)	(82.13)	(108.58)	(135.04)	(161.50)
	-5.33%	(95.56)	(122.02)	(148.48)	(174.94)	(201.39)	(227.85)	(254.31)
	-8.00%	(199.05)	(225.51)	(251.97)	(278.43)	(304.88)	(331.34)	(357.80)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	89.43
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	89.28
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	89.89
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	89.20
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>357.80</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 303.15

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

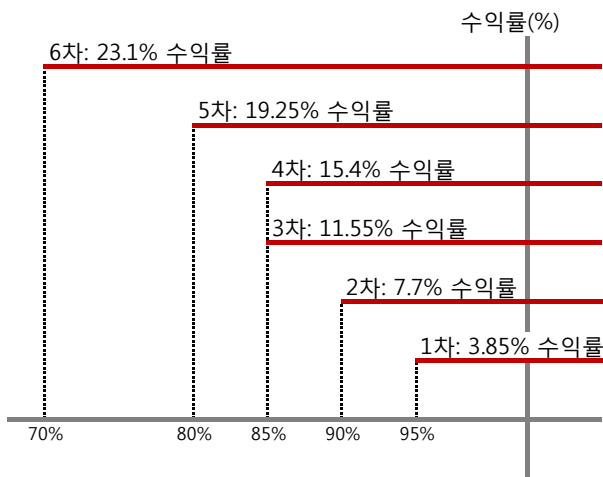
## 1. 계약금액

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

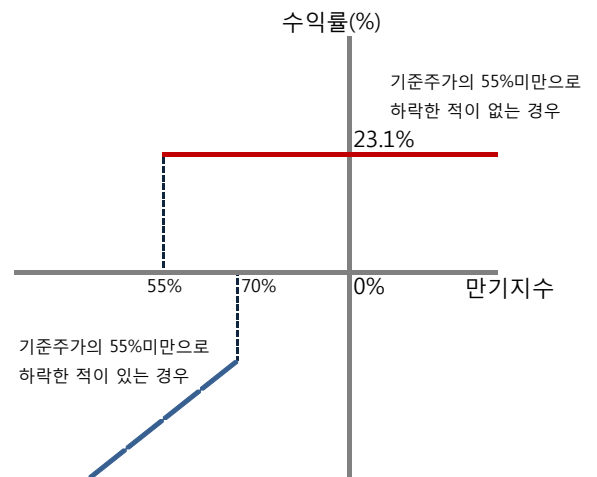
단위(백만원)

## 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%	37.77	33.29	28.81	24.33	19.85	15.37	10.89
	5.33%	31.85	27.37	22.88	18.40	13.92	9.44	4.96
	2.67%	23.74	19.26	14.77	10.29	5.81	1.33	(3.15)
	0.00%	13.44	8.96	4.48	0.00	(4.48)	(8.96)	(13.44)
	-2.67%	0.97	(3.51)	(7.99)	(12.48)	(16.96)	(21.44)	(25.92)
	-5.33%	(13.69)	(18.17)	(22.65)	(27.13)	(31.61)	(36.10)	(40.58)
	-8.00%	(30.53)	(35.01)	(39.49)	(43.97)	(48.46)	(52.94)	(57.42)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	14.35
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	14.24
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	14.28
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	14.55
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>57.42</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 66.46

# 메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

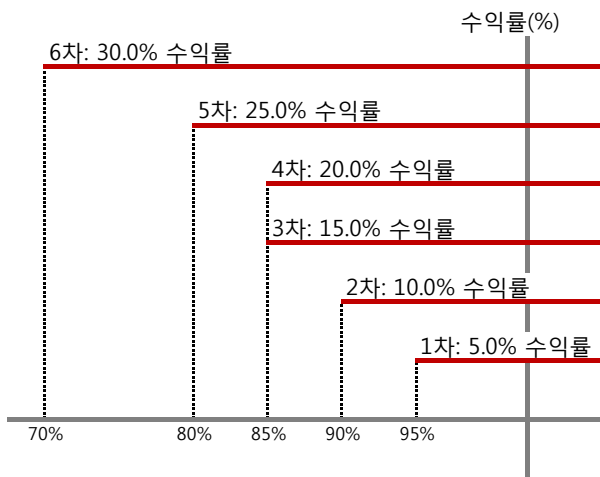
## 1. 계약금액

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

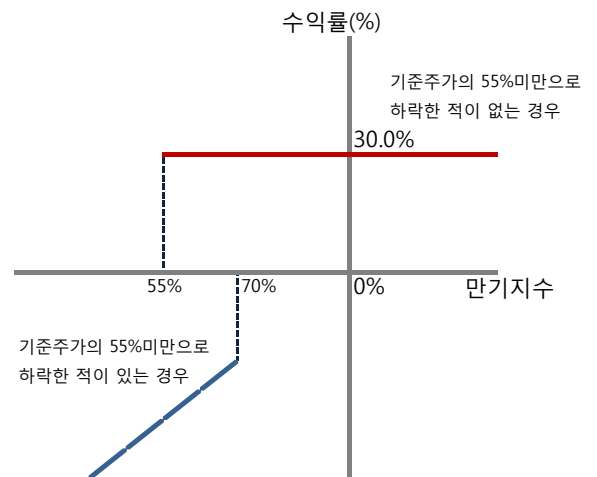
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	74.92	64.89	54.85	44.81	34.78	24.74	14.71
	5.33%	62.29	52.25	42.21	32.18	22.14	12.11	2.07
	2.67%	47.35	37.31	27.28	17.24	7.21	(2.83)	(12.87)
	0.00%	30.11	20.07	10.04	0.00	(10.04)	(20.07)	(30.11)
	-2.67%	10.56	0.53	(9.51)	(19.54)	(29.58)	(39.62)	(49.65)
	-5.33%	(11.28)	(21.32)	(31.36)	(41.39)	(51.43)	(61.46)	(71.50)
	-8.00%	(35.44)	(45.47)	(55.51)	(65.54)	(75.58)	(85.62)	(95.65)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	23.90
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	23.80
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	23.84
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	24.11
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>95.65</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 84.83

# 메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

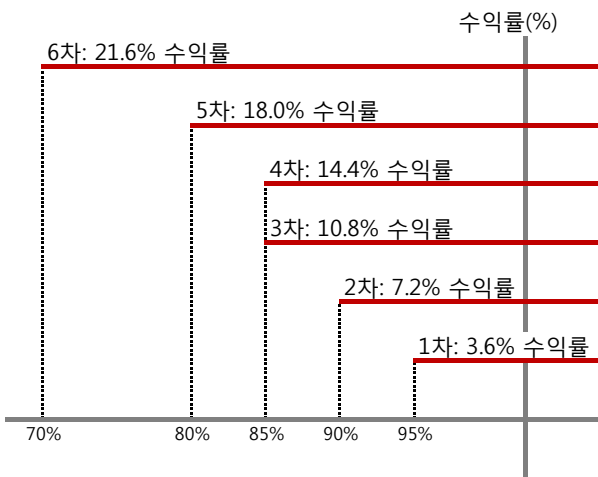
## 1. 계약금액

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

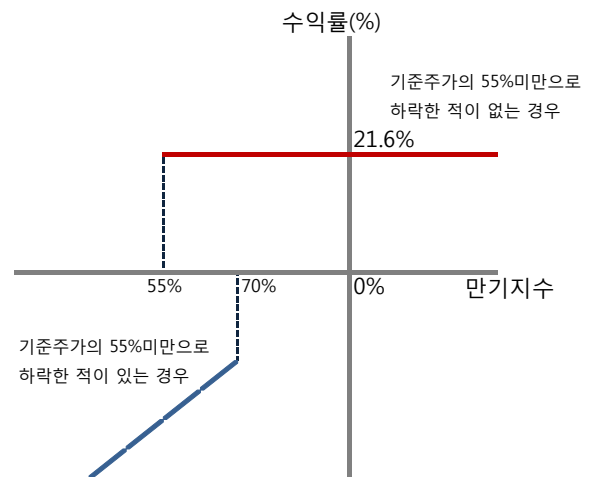
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	단위(백만원)						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	172.15	147.54	122.94	98.34	73.74	49.13	24.53
	5.33%	140.78	116.18	91.57	66.97	42.37	17.77	(6.84)
	2.67%	108.00	83.40	58.79	34.19	9.59	(15.01)	(39.62)
	0.00%	73.81	49.21	24.60	0.00	(24.60)	(49.21)	(73.81)
	-2.67%	38.20	13.60	(11.00)	(35.60)	(60.21)	(84.81)	(109.41)
	-5.33%	1.19	(23.42)	(48.02)	(72.62)	(97.22)	(121.83)	(146.43)
	-8.00%	(37.24)	(61.85)	(86.45)	(111.05)	(135.65)	(160.26)	(184.86)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	대신증권(ELS)3674	단위(백만원)
KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	24.11
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	46.21
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	46.19
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	46.19
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>162.70</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	182.93
-----	--------

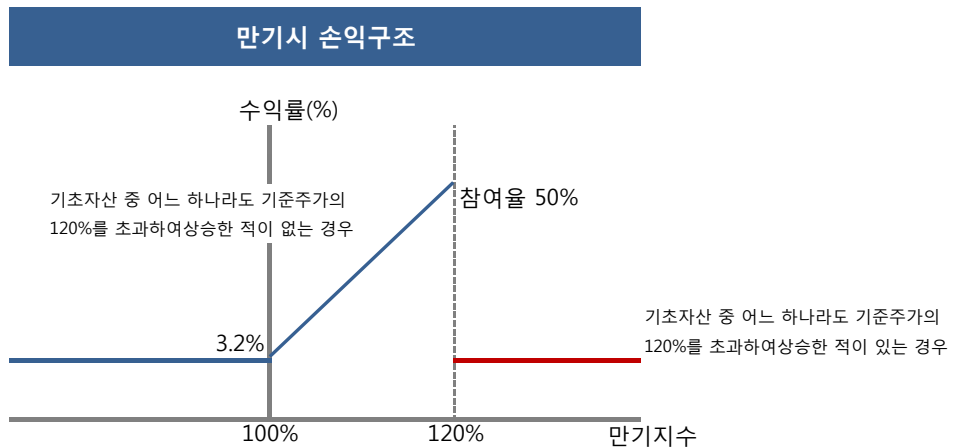
# 메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

## 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%	(0.33)	(0.43)	(0.54)	(0.64)	(0.74)	(0.85)	(0.95)
	5.33%	(0.01)	(0.11)	(0.21)	(0.32)	(0.42)	(0.53)	(0.63)
	2.67%	0.21	0.10	(0.00)	(0.10)	(0.21)	(0.31)	(0.42)
	0.00%	0.31	0.21	0.10	0.00	(0.10)	(0.21)	(0.31)
	-2.67%	0.31	0.20	0.10	(0.01)	(0.11)	(0.21)	(0.32)
	-5.33%	0.19	0.09	(0.02)	(0.12)	(0.22)	(0.33)	(0.43)
	-8.00%	(0.03)	(0.13)	(0.24)	(0.34)	(0.45)	(0.55)	(0.66)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.24
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.24
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.24
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.24
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>0.95</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.98
-----	------



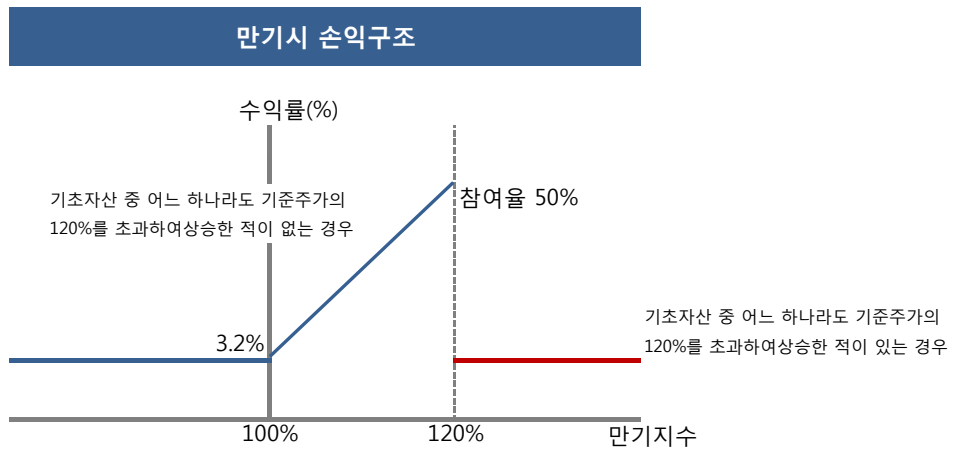
# 메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제28호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

## 1. 계약금액

						단위(백만원)
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	10,838	0	10,838	장외
누계	유가증권	ELS	10,838	0	10,838	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%	(1.69)	(1.79)	(1.88)	(1.98)	(2.07)	(2.17)	(2.26)
	5.33%	(0.88)	(0.97)	(1.07)	(1.16)	(1.26)	(1.35)	(1.45)
	2.67%	(0.22)	(0.31)	(0.41)	(0.50)	(0.60)	(0.69)	(0.79)
	0.00%	0.29	0.19	0.10	0.00	(0.10)	(0.19)	(0.29)
	-2.67%	0.63	0.53	0.44	0.34	0.25	0.15	0.06
	-5.33%	0.81	0.72	0.62	0.53	0.43	0.34	0.24
	-8.00%	0.84	0.74	0.65	0.55	0.46	0.36	0.27

### 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523368423	대우증권(ELS)10777	0.57
KR6553377427	우리투자증권(ELS)8498	0.57
KR6583336427	현대증권(ELS)2014-3321	0.57
KR6693322424	NH농협증권(ELS)1298	0.56
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>2.26</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.07
-----	------

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-2호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-07

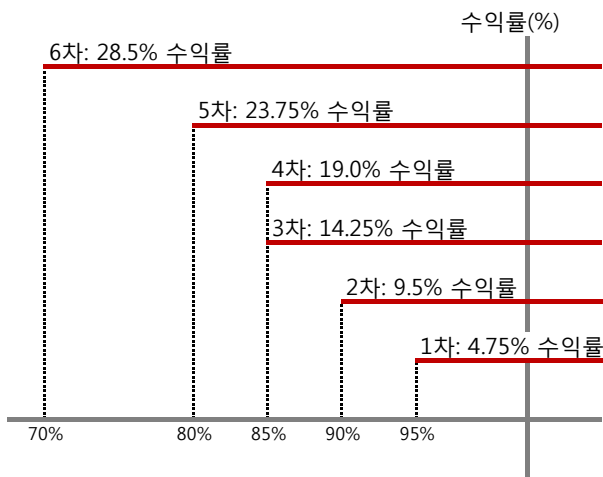
## 1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	649	0	649	장외
누계	유가증권	ELS	649	0	649	장외

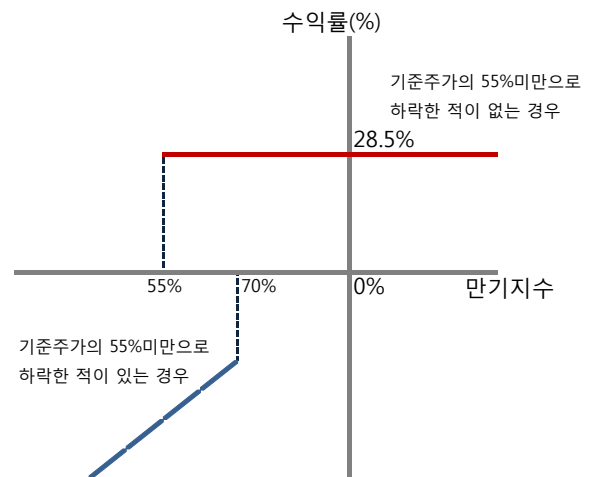
단위(백만원)

## 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%	15.25	13.09	10.93	8.78	6.62	4.46	2.31
	5.33%	13.02	10.86	8.71	6.55	4.39	2.24	0.08
	2.67%	10.10	7.94	5.78	3.63	1.47	(0.69)	(2.85)
	0.00%	6.47	4.31	2.16	0.00	(2.16)	(4.31)	(6.47)
	-2.67%	2.15	(0.01)	(2.17)	(4.32)	(6.48)	(8.64)	(10.79)
	-5.33%	(2.88)	(5.03)	(7.19)	(9.35)	(11.50)	(13.66)	(15.82)
	-8.00%	(8.60)	(10.76)	(12.91)	(15.07)	(17.23)	(19.38)	(21.54)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6542310430	신영증권플랜업(ELS)3990	5.39
KR6552335434	우리투자증권(ELS)8653	5.33
KR6572308437	한국투자증권(ELS)3834	5.35
KR6772307437	KB STAR(ELS)613	5.48
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>21.54</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 19.68