

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

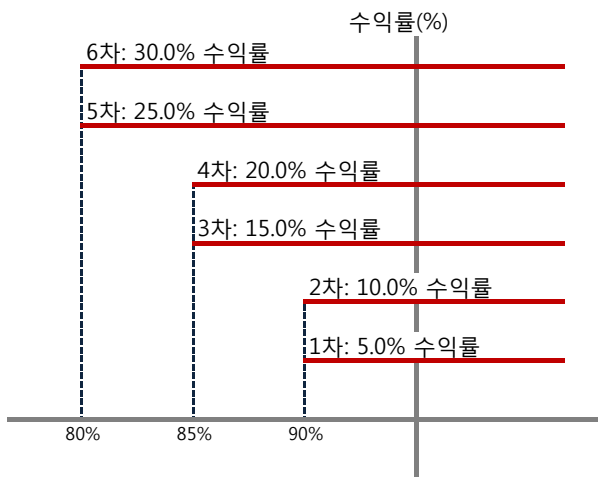
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,406	0	4,406	장외
누계	유가증권	ELS	4,406	0	4,406	장외

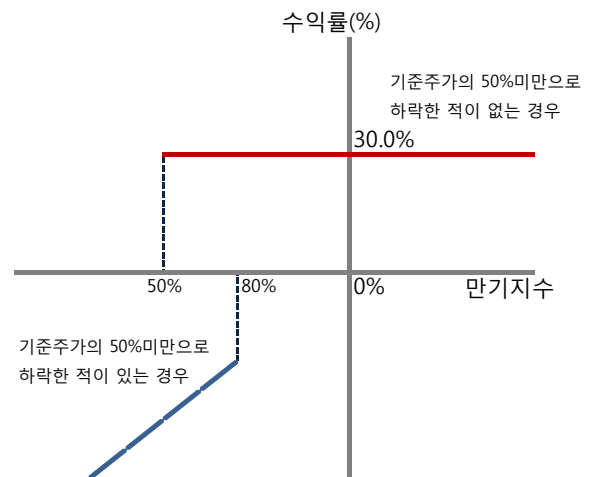
단위(백만원)

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%	(9.28)	(9.36)	(9.45)	(9.53)	(9.61)	(9.70)	(9.78)
	5.33%	(3.98)	(4.07)	(4.15)	(4.23)	(4.32)	(4.40)	(4.48)
	2.67%	(0.81)	(0.89)	(0.98)	(1.06)	(1.14)	(1.23)	(1.31)
	0.00%	0.25	0.17	0.08	0.00	(0.08)	(0.17)	(0.25)
	-2.67%	(0.81)	(0.89)	(0.98)	(1.06)	(1.14)	(1.23)	(1.31)
	-5.33%	(3.98)	(4.07)	(4.15)	(4.23)	(4.32)	(4.40)	(4.48)
	-8.00%	(9.28)	(9.36)	(9.45)	(9.53)	(9.61)	(9.70)	(9.78)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	2.74
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	2.33
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	2.43
KR6662374141	동양W(ELS)1004	2.27
총 최대손실 예상금액		9.78

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

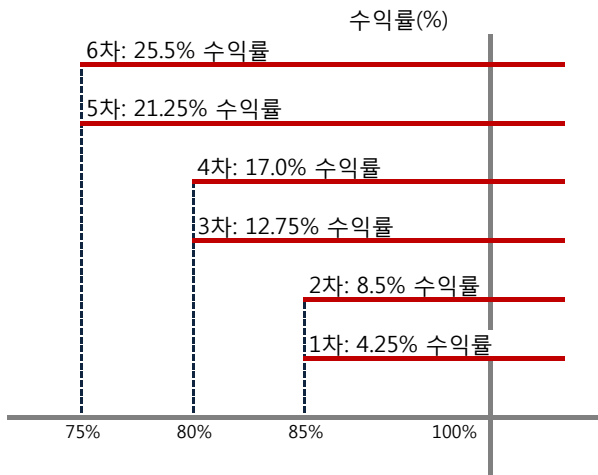
1. 계약금액

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

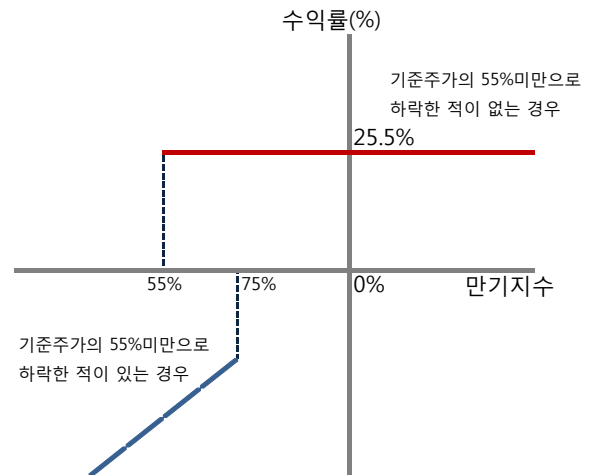
단위(백만원)

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%	89.49	81.09	72.69	64.29	55.89	47.49	39.09
	5.33%	75.30	66.90	58.50	50.10	41.69	33.29	24.89
	2.67%	53.87	45.47	37.07	28.67	20.26	11.86	3.46
	0.00%	25.20	16.80	8.40	0.00	(8.40)	(16.80)	(25.20)
	-2.67%	(10.70)	(19.10)	(27.50)	(35.90)	(44.30)	(52.70)	(61.10)
	-5.33%	(53.84)	(62.24)	(70.64)	(79.04)	(87.44)	(95.84)	(104.24)
	-8.00%	(104.21)	(112.61)	(121.01)	(129.41)	(137.81)	(146.22)	(154.62)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	39.55
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	39.80
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	35.60
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	39.66
총 최대손실 예상금액		154.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 187.43

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

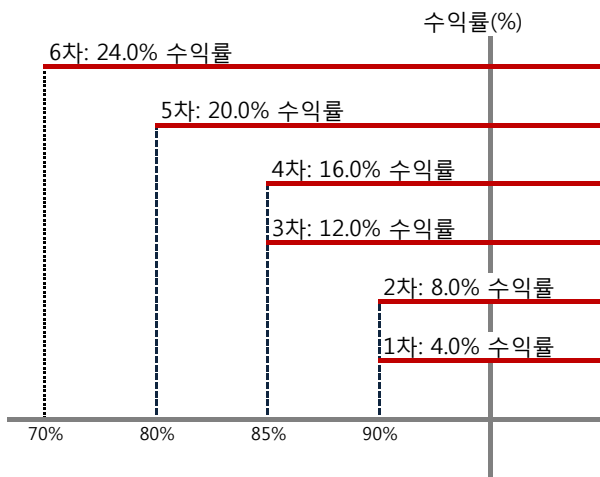
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,224	0	5,224	장외
누계	유가증권	ELS	5,224	0	5,224	장외

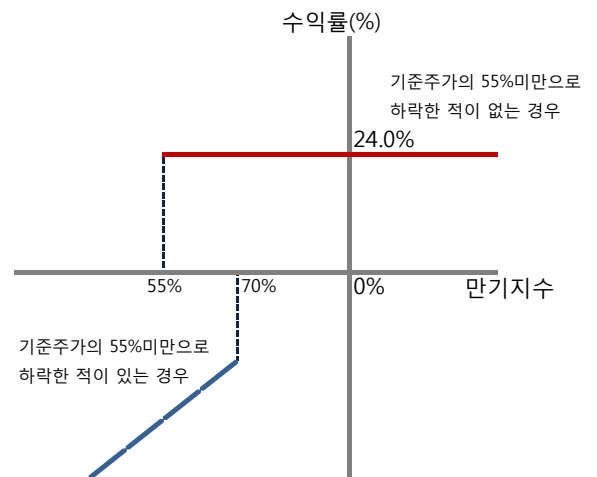
단위(백만원)

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%	181.34	161.04	140.75	120.45	100.16	79.86	59.57
	5.33%	152.06	131.77	111.47	91.18	70.88	50.59	30.30
	2.67%	111.91	91.62	71.32	51.03	30.73	10.44	(9.86)
	0.00%	60.88	40.59	20.29	0.00	(20.29)	(40.59)	(60.88)
	-2.67%	(1.02)	(21.31)	(41.61)	(61.90)	(82.20)	(102.49)	(122.79)
	-5.33%	(73.80)	(94.09)	(114.39)	(134.68)	(154.98)	(175.27)	(195.56)
	-8.00%	(157.45)	(177.75)	(198.04)	(218.34)	(238.63)	(258.92)	(279.22)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	69.90
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	69.73
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	70.33
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	69.26
총 최대손실 예상금액		279.22

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 278.94

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

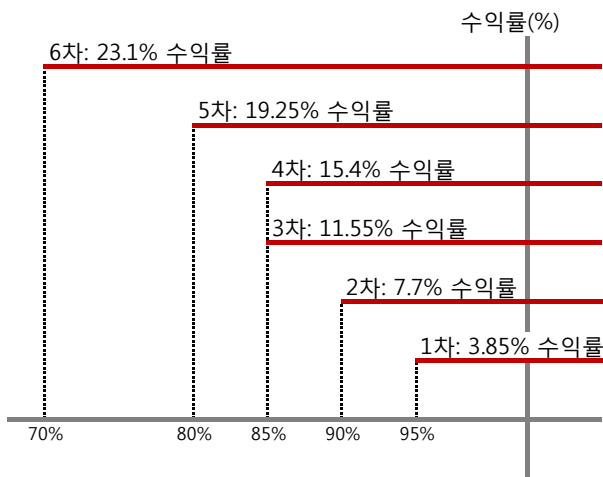
1. 계약금액

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

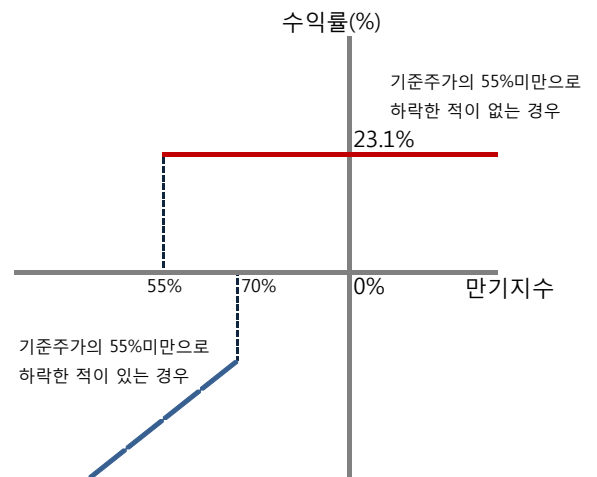
단위(백만원)

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%	23.01	20.19	17.36	14.54	11.72	8.89	6.07
	5.33%	20.42	17.59	14.77	11.94	9.12	6.30	3.47
	2.67%	15.57	12.75	9.92	7.10	4.27	1.45	(1.38)
	0.00%	8.47	5.65	2.82	0.00	(2.82)	(5.65)	(8.47)
	-2.67%	(0.87)	(3.70)	(6.52)	(9.35)	(12.17)	(15.00)	(17.82)
	-5.33%	(12.47)	(15.30)	(18.12)	(20.95)	(23.77)	(26.60)	(29.42)
	-8.00%	(26.33)	(29.15)	(31.98)	(34.80)	(37.62)	(40.45)	(43.27)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	10.81
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	10.70
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	10.75
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	11.01
총 최대손실 예상금액		43.27

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 41.88

메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

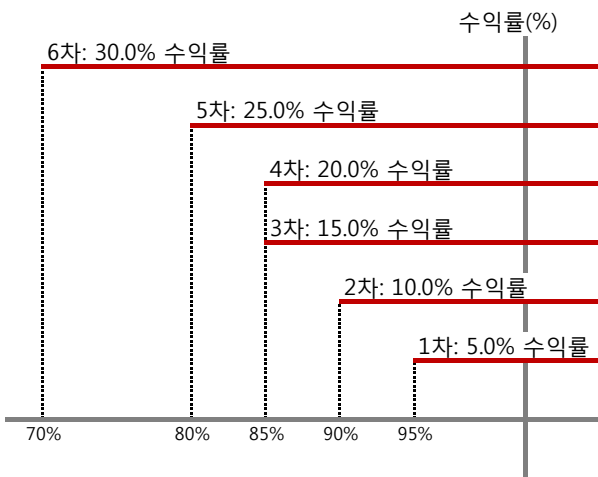
1. 계약금액

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

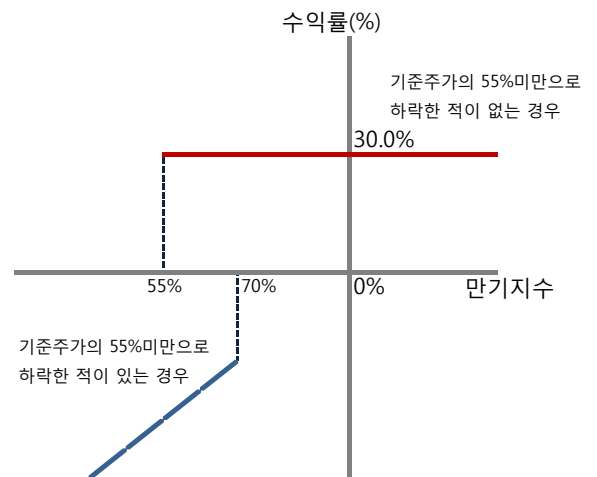
단위(백만원)

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%	51.73	45.27	38.82	32.36	25.91	19.45	13.00
	5.33%	43.10	36.64	30.19	23.73	17.28	10.82	4.36
	2.67%	32.31	25.85	19.40	12.94	6.49	0.03	(6.42)
	0.00%	19.37	12.91	6.46	0.00	(6.46)	(12.91)	(19.37)
	-2.67%	4.27	(2.19)	(8.64)	(15.10)	(21.55)	(28.01)	(34.46)
	-5.33%	(12.98)	(19.44)	(25.89)	(32.35)	(38.81)	(45.26)	(51.72)
	-8.00%	(32.39)	(38.85)	(45.30)	(51.76)	(58.21)	(64.67)	(71.12)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	17.76
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	17.65
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	17.71
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	18.01
총 최대손실 예상금액		71.12

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 74.33

메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

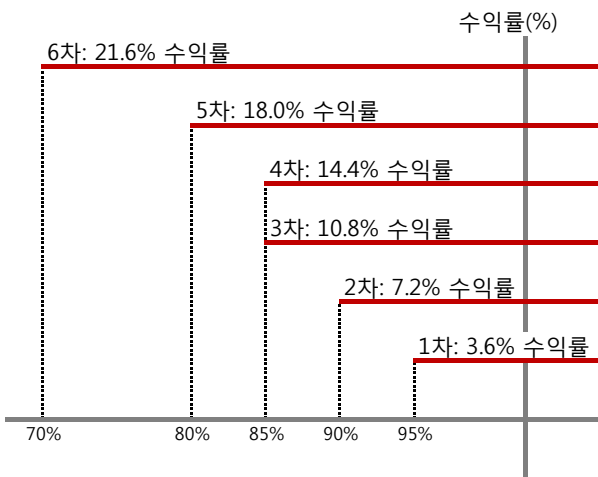
1. 계약금액

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

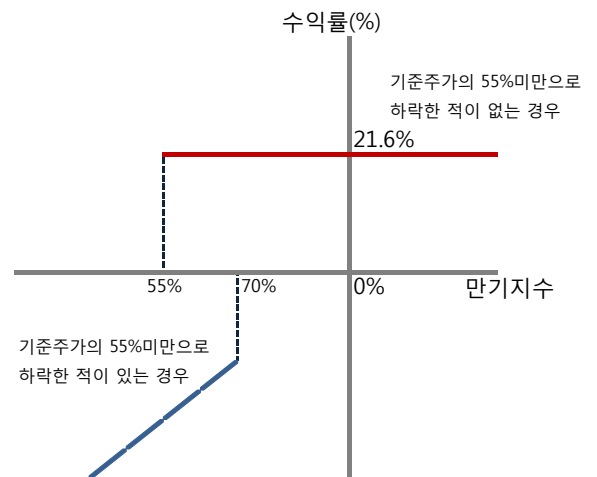
단위(백만원)

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%	181.38	153.60	125.82	98.04	70.26	42.48	14.70
	5.33%	150.41	122.63	94.85	67.07	39.29	11.51	(16.27)
	2.67%	117.73	89.95	62.17	34.39	6.61	(21.17)	(48.95)
	0.00%	83.34	55.56	27.78	0.00	(27.78)	(55.56)	(83.34)
	-2.67%	47.24	19.46	(8.32)	(36.10)	(63.89)	(91.67)	(119.45)
	-5.33%	9.42	(18.36)	(46.14)	(73.92)	(101.70)	(129.48)	(157.26)
	-8.00%	(30.11)	(57.89)	(85.67)	(113.45)	(141.23)	(169.01)	(196.79)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	18.01
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	49.20
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	49.21
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	49.21
총 최대손실 예상금액		165.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 190.86

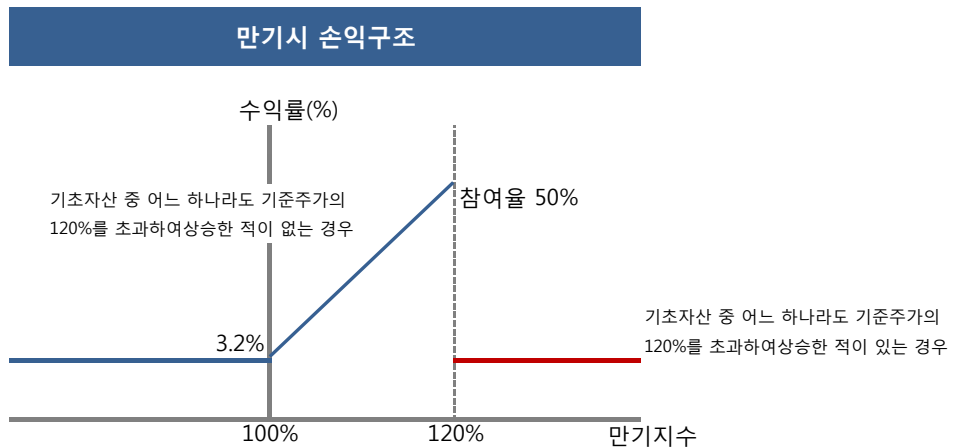
메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

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%	(0.69)	(0.75)	(0.82)	(0.88)	(0.94)	(1.00)	(1.06)
	5.33%	(0.32)	(0.38)	(0.44)	(0.50)	(0.57)	(0.63)	(0.69)
	2.67%	(0.03)	(0.09)	(0.15)	(0.21)	(0.27)	(0.33)	(0.40)
	0.00%	0.18	0.12	0.06	0.00	(0.06)	(0.12)	(0.18)
	-2.67%	0.32	0.25	0.19	0.13	0.07	0.01	(0.05)
	-5.33%	0.37	0.31	0.24	0.18	0.12	0.06	(0.00)
	-8.00%	0.34	0.28	0.21	0.15	0.09	0.03	(0.03)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.27
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.27
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.26
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.26
총 최대손실 예상금액		1.06

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.31
-----	------

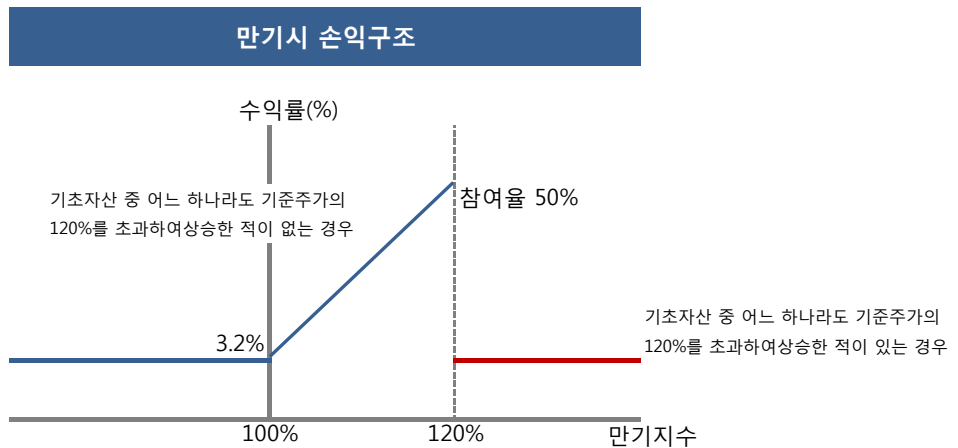
메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제28호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

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%	(2.88)	(2.95)	(3.01)	(3.08)	(3.15)	(3.21)	(3.28)
	5.33%	(1.58)	(1.65)	(1.71)	(1.78)	(1.84)	(1.91)	(1.97)
	2.67%	(0.55)	(0.62)	(0.68)	(0.75)	(0.81)	(0.88)	(0.95)
	0.00%	0.20	0.13	0.07	0.00	(0.07)	(0.13)	(0.20)
	-2.67%	0.67	0.60	0.54	0.47	0.41	0.34	0.28
	-5.33%	0.86	0.80	0.73	0.67	0.60	0.53	0.47
	-8.00%	0.78	0.71	0.65	0.58	0.52	0.45	0.39

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523368423	대우증권(ELS)10777	0.82
KR6553377427	우리투자증권(ELS)8498	0.82
KR6583336427	현대증권(ELS)2014-3321	0.82
KR6693322424	NH농협증권(ELS)1298	0.82
총 최대손실 예상금액		3.28

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.26
-----	------

메리트 2스타주가연동증권 KH-2호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

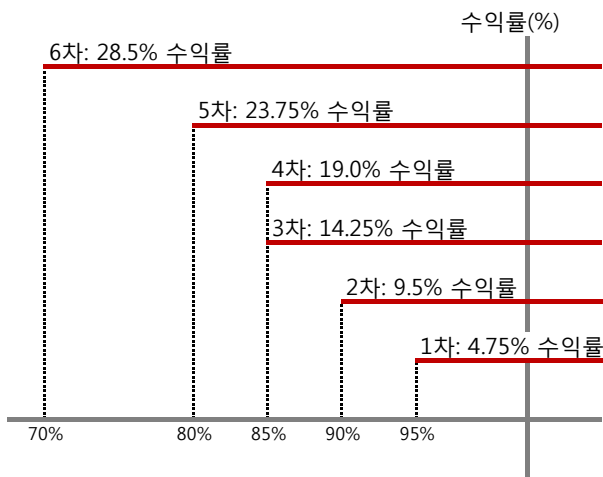
1. 계약금액

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

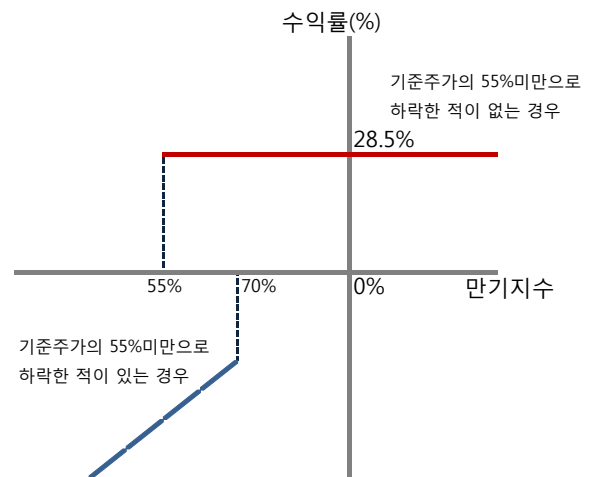
단위(백만원)

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 시나 리오	8.00%	27.43	22.84	18.24	13.65	9.06	4.47	(0.12)
	5.33%	23.66	19.07	14.48	9.89	5.30	0.70	(3.89)
	2.67%	19.11	14.52	9.93	5.34	0.74	(3.85)	(8.44)
	0.00%	13.77	9.18	4.59	0.00	(4.59)	(9.18)	(13.77)
	-2.67%	7.65	3.06	(1.53)	(6.12)	(10.71)	(15.31)	(19.90)
	-5.33%	0.75	(3.85)	(8.44)	(13.03)	(17.62)	(22.21)	(26.80)
	-8.00%	(6.95)	(11.54)	(16.13)	(20.72)	(25.31)	(29.91)	(34.50)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6542310430	신영증권플랜업(ELS)3990	8.63
KR6552335434	우리투자증권(ELS)8653	8.57
KR6572308437	한국투자증권(ELS)3834	8.59
KR6772307437	KB STAR(ELS)613	8.71
총 최대손실 예상금액		34.50

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 32.16

메리츠 주가지수연계증권 HE-1호[ELS-파생형]

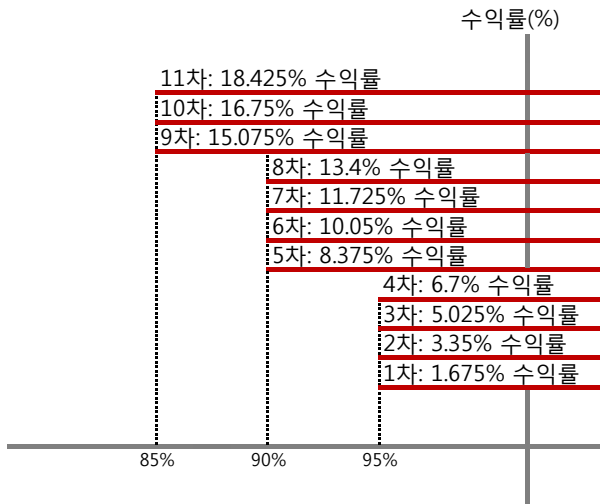
공시일: 2014-03-26

1. 계약금액

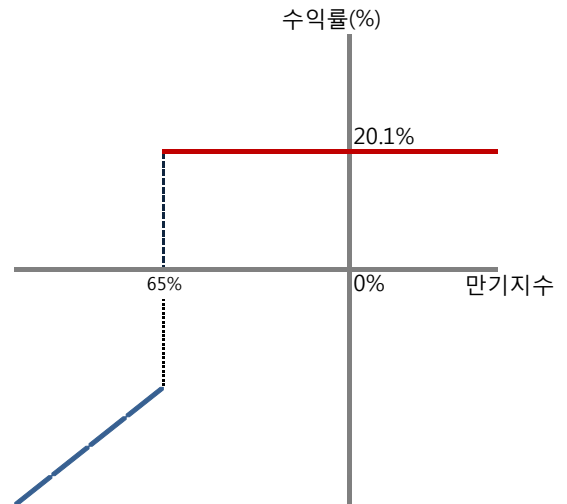
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
신규	유가증권	ELS	783	0	783	비고
누계	유가증권	ELS	783	0	783	장외

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%	23.77	21.72	19.66	17.61	15.55	13.50	11.44
	5.33%	20.06	18.00	15.95	13.89	11.84	9.78	7.73
	2.67%	14.19	12.13	10.08	8.03	5.97	3.92	1.86
	0.00%	6.16	4.11	2.05	0.00	(2.05)	(4.11)	(6.16)
	-2.67%	(4.02)	(6.07)	(8.13)	(10.18)	(12.24)	(14.29)	(16.35)
	-5.33%	(16.35)	(18.41)	(20.46)	(22.52)	(24.57)	(26.63)	(28.68)
	-8.00%	(30.85)	(32.90)	(34.96)	(37.01)	(39.07)	(41.12)	(43.18)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513317430	대신증권(ELS)4203	10.85
KR6523335430	대우증권(ELS)10783	10.71
KR6573302439	한국투자증권(ELS)3821	10.76
KR6703309437	H&D증권(ELS)4174	10.86
총 최대손실 예상금액		43.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	41.52
-----	-------

메리츠 주가지수연계증권 KHE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

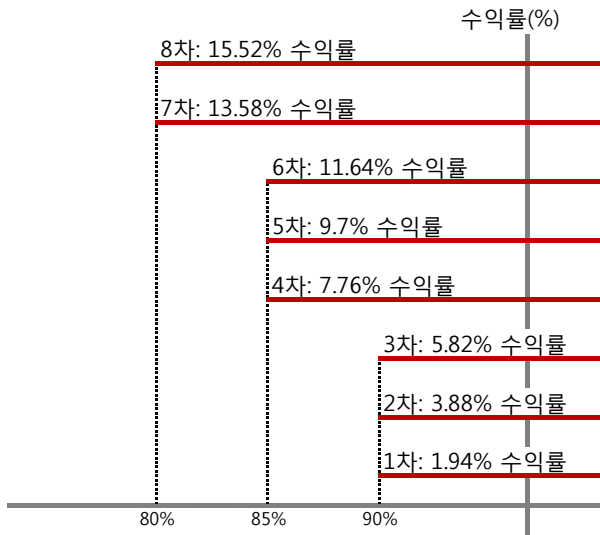
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	822	0	822	장외
누계	유가증권	ELS	822	0	822	장외

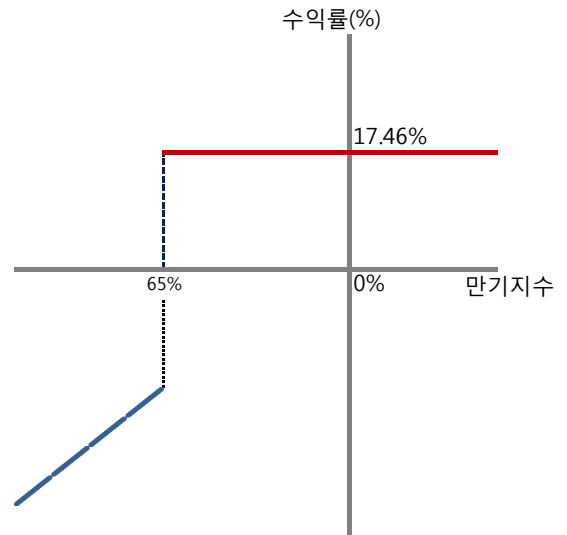
단위(백만원)

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%	13.92	12.22	10.52	8.81	7.11	5.41	3.70
	5.33%	13.68	11.98	10.28	8.57	6.87	5.17	3.46
	2.67%	10.75	9.04	7.34	5.64	3.93	2.23	0.53
	0.00%	5.11	3.41	1.70	0.00	(1.70)	(3.41)	(5.11)
	-2.67%	(3.22)	(4.93)	(6.63)	(8.33)	(10.04)	(11.74)	(13.44)
	-5.33%	(14.26)	(15.96)	(17.66)	(19.37)	(21.07)	(22.77)	(24.48)
	-8.00%	(27.99)	(29.69)	(31.39)	(33.10)	(34.80)	(36.50)	(38.21)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513315434	대신증권(ELS)4200	9.58
KR6573303437	한국투자증권(ELS)3822	9.51
KR6593329438	미래에셋증권(ELS)5768	9.53
KR6703310435	하나대투증권(ELS)4176	9.59
총 최대손실 예상금액		38.21

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	37.96
-----	-------

메리츠 주가지수연계증권 HE-2호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-26

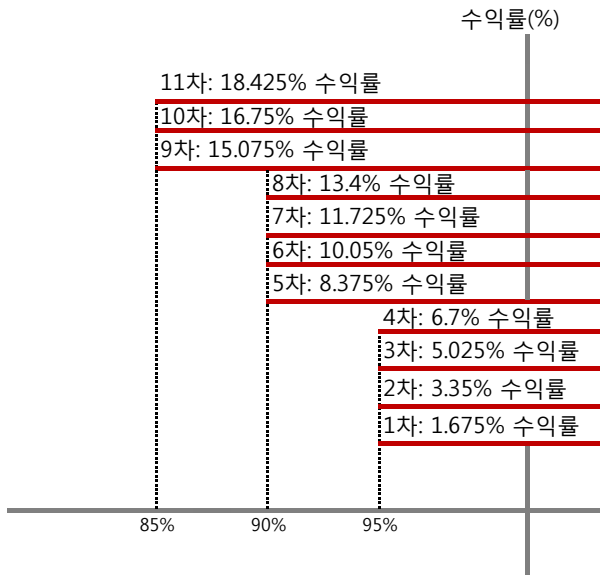
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	327	0	327	장외
누계	유가증권	ELS	327	0	327	장외

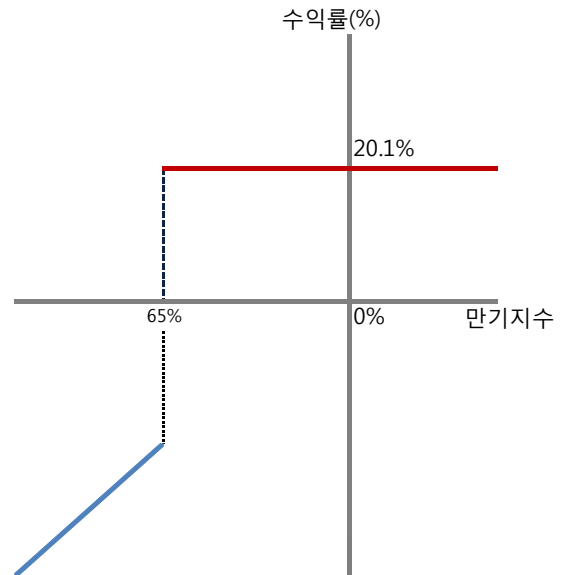
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	5.44	4.88	4.32	3.76	3.20	2.65	2.09
	5.33%	5.14	4.58	4.02	3.46	2.90	2.34	1.78
	2.67%	3.88	3.32	2.76	2.20	1.64	1.08	0.52
	0.00%	1.68	1.12	0.56	0.00	(0.56)	(1.12)	(1.68)
	-2.67%	(1.47)	(2.03)	(2.59)	(3.15)	(3.71)	(4.27)	(4.83)
	-5.33%	(5.57)	(6.13)	(6.69)	(7.25)	(7.81)	(8.37)	(8.93)
	-8.00%	(10.62)	(11.18)	(11.74)	(12.30)	(12.86)	(13.41)	(13.97)

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR65133A2438	대신증권(ELS)4245	3.52
KR65233B7435	대우증권(ELS)10910	3.46
KR6573315431	한국투자증권(ELS)3854	3.48
KR6703373433	하나대투증권(ELS)4071	3.52
총 최대손실 예상금액		13.97

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.53
-----	-------