

**파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시**

# 메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

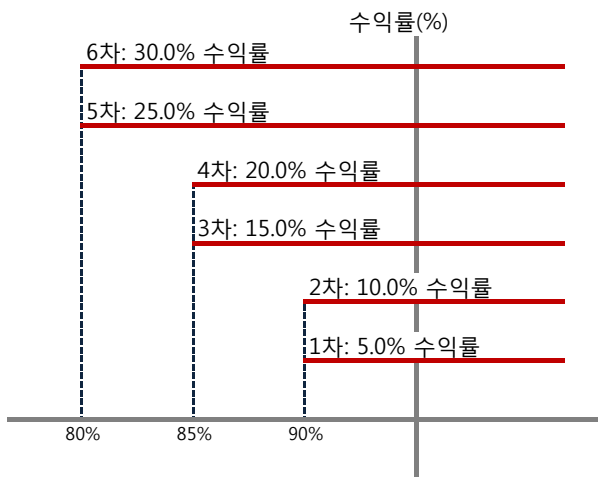
## 1. 계약금액

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

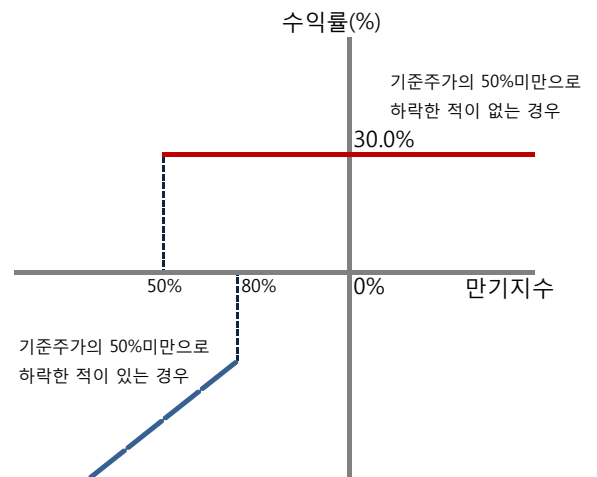
단위(백만원)

## 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	8.00%	5.33%	2.67%	0.00%	-2.67%	-5.33%	-8.00%	
자산	(2.09)	(0.79)	(0.01)	0.25	(0.01)	(0.79)	(2.09)	
시나	(2.17)	(0.87)	(0.09)	0.17	(0.09)	(0.87)	(2.17)	
리오	(2.25)	(0.96)	(0.18)	0.08	(0.18)	(0.96)	(2.25)	
	(2.34)	(1.04)	(0.26)	0.00	(0.26)	(1.04)	(2.34)	
	(2.42)	(1.12)	(0.34)	(0.08)	(0.34)	(1.12)	(2.42)	
	(2.50)	(1.21)	(0.43)	(0.17)	(0.43)	(1.21)	(2.50)	
	(2.59)	(1.29)	(0.51)	(0.25)	(0.51)	(1.29)	(2.59)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	0.67
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	0.57
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	0.60
KR6662374141	동양W(ELS)1004	0.75
총 최대손실 예상금액		2.59

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

# 메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

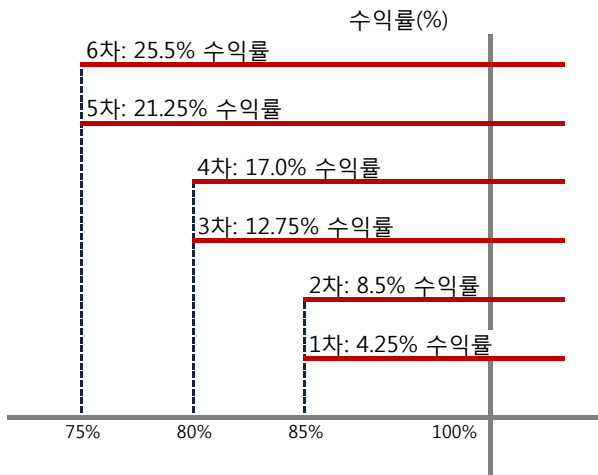
## 1. 계약금액

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

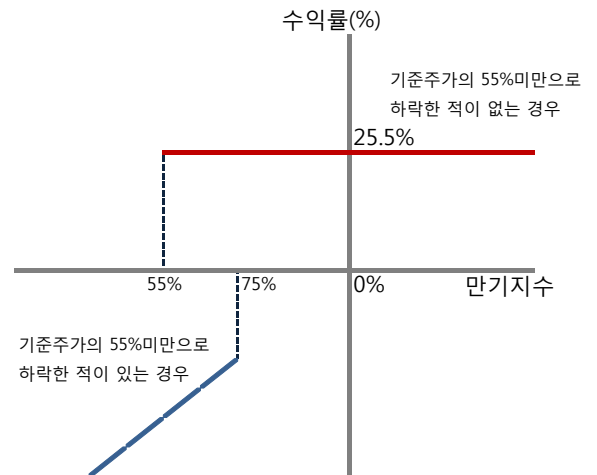
단위(백만원)

## 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%	42.19	36.49	30.79	25.08	19.38	13.68	7.97
	5.33%	41.45	35.75	30.05	24.34	18.64	12.94	7.23
	2.67%	33.09	27.39	21.69	15.98	10.28	4.57	(1.13)
	0.00%	17.11	11.41	5.70	0.00	(5.70)	(11.41)	(17.11)
	-2.67%	(6.49)	(12.20)	(17.90)	(23.60)	(29.31)	(35.01)	(40.71)
	-5.33%	(37.72)	(43.42)	(49.12)	(54.83)	(60.53)	(66.23)	(71.94)
	-8.00%	(76.56)	(82.26)	(87.97)	(93.67)	(99.37)	(105.08)	(110.78)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	28.30
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	28.56
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	25.51
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	28.41
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>110.78</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

96.97

# 메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

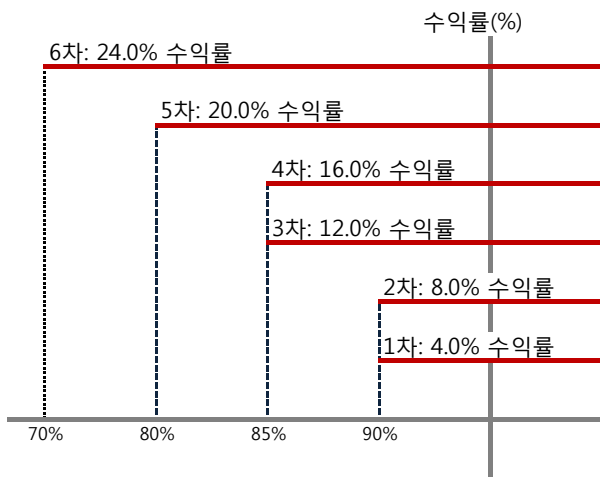
## 1. 계약금액

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

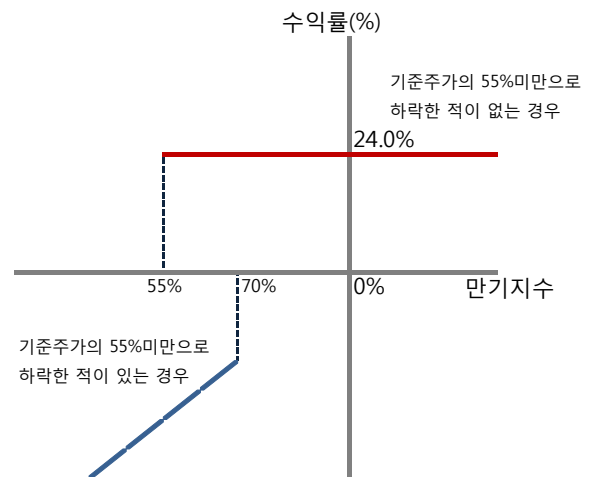
단위(백만원)

## 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 시나리오	8.00%	209.06	189.36	169.66	149.95	130.25	110.55	90.85
	5.33%	168.85	149.15	129.45	109.74	90.04	70.34	50.64
	2.67%	118.87	99.16	79.46	59.76	40.06	20.35	0.65
	0.00%	59.11	39.40	19.70	0.00	(19.70)	(39.40)	(59.11)
	-2.67%	(10.43)	(30.13)	(49.83)	(69.53)	(89.24)	(108.94)	(128.64)
	-5.33%	(89.74)	(109.44)	(129.14)	(148.84)	(168.55)	(188.25)	(207.95)
	-8.00%	(178.82)	(198.52)	(218.23)	(237.93)	(257.63)	(277.33)	(297.04)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	74.29
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	74.02
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	74.94
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	73.79
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>297.04</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 327.33

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

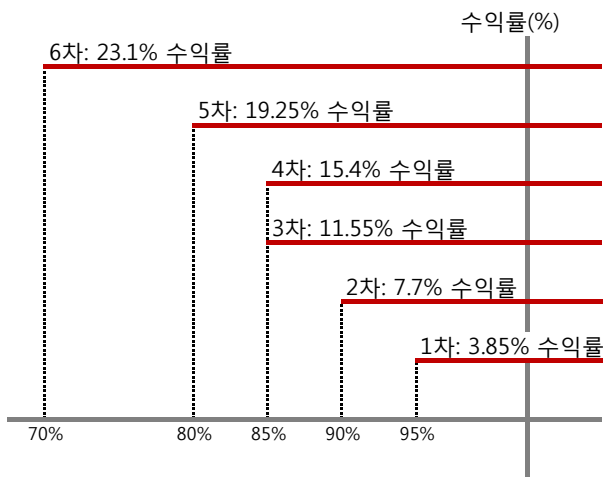
## 1. 계약금액

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

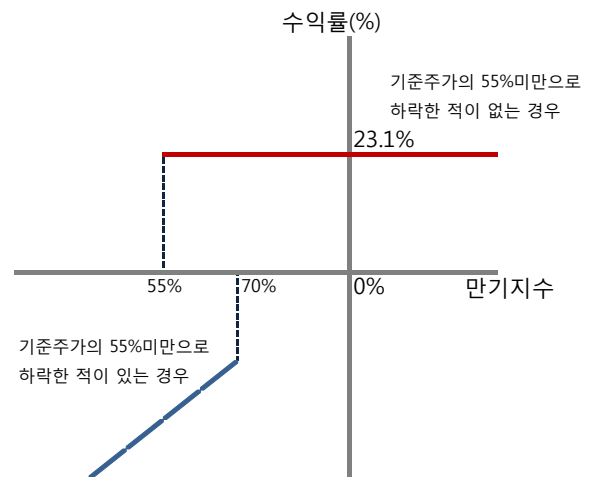
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	15.63	13.50	11.37	9.24	7.11	4.99	2.86
	5.33%	14.63	12.50	10.37	8.25	6.12	3.99	1.86
	2.67%	11.55	9.42	7.29	5.17	3.04	0.91	(1.22)
	0.00%	6.38	4.26	2.13	0.00	(2.13)	(4.26)	(6.38)
	-2.67%	(0.87)	(3.00)	(5.12)	(7.25)	(9.38)	(11.51)	(13.64)
	-5.33%	(10.21)	(12.33)	(14.46)	(16.59)	(18.72)	(20.84)	(22.97)
	-8.00%	(21.63)	(23.76)	(25.88)	(28.01)	(30.14)	(32.27)	(34.40)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	8.59
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	8.50
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	8.54
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	8.76
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>34.40</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 35.70

# 메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

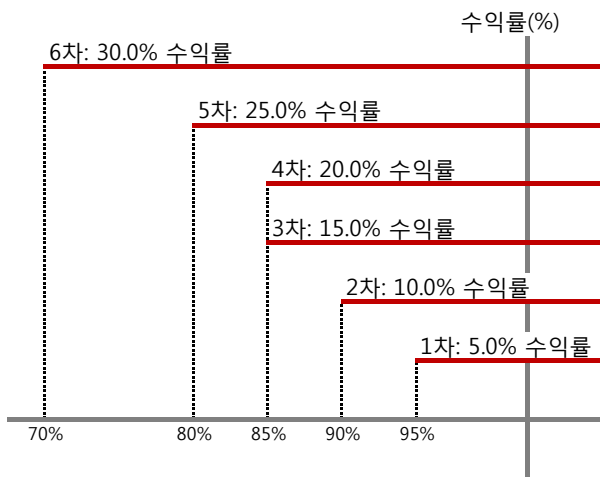
## 1. 계약금액

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

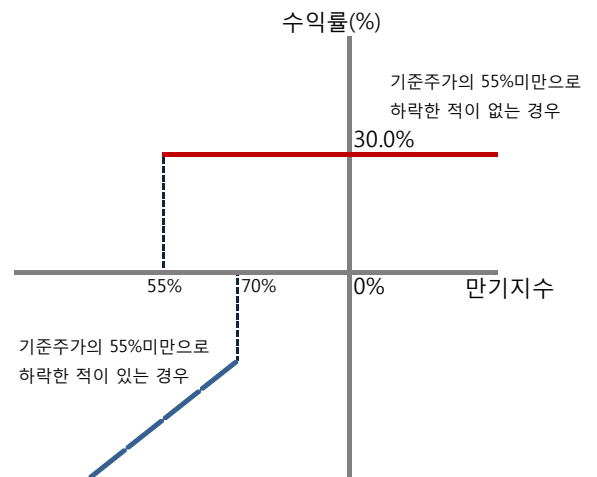
단위(백만원)

## 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%	49.10	43.06	37.01	30.97	24.92	18.88	12.83
	5.33%	40.90	34.85	28.81	22.76	16.72	10.67	4.63
	2.67%	30.57	24.53	18.48	12.44	6.39	0.35	(5.69)
	0.00%	18.13	12.09	6.04	0.00	(6.04)	(12.09)	(18.13)
	-2.67%	3.58	(2.47)	(8.51)	(14.56)	(20.60)	(26.65)	(32.69)
	-5.33%	(13.10)	(19.14)	(25.18)	(31.23)	(37.27)	(43.32)	(49.36)
	-8.00%	(31.89)	(37.93)	(43.97)	(50.02)	(56.06)	(62.11)	(68.15)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	17.02
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	16.90
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	16.96
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	17.27
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>68.15</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 61.05

# 메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

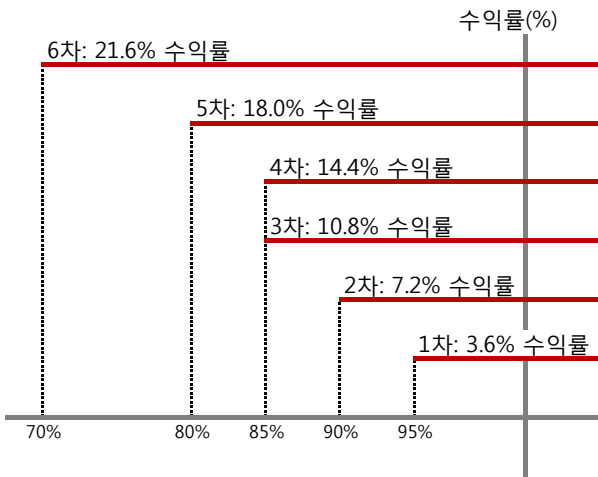
## 1. 계약금액

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

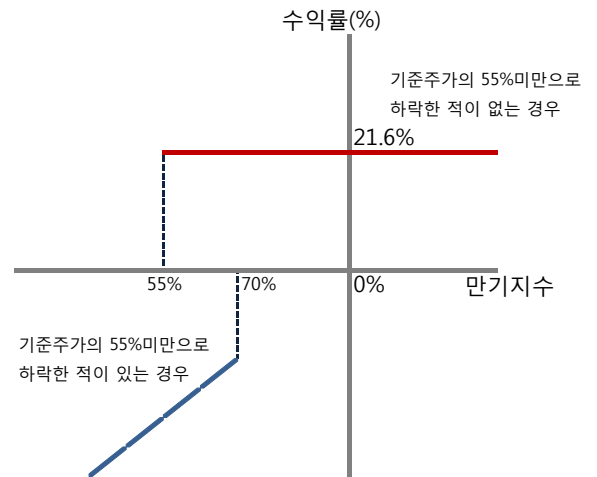
단위(백만원)

## 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%	184.65	156.59	128.54	100.48	72.42	44.37	16.31
	5.33%	153.11	125.05	96.99	68.94	40.88	12.82	(15.23)
	2.67%	119.61	91.56	63.50	35.44	7.39	(20.67)	(48.73)
	0.00%	84.17	56.11	28.06	0.00	(28.06)	(56.11)	(84.17)
	-2.67%	46.77	18.72	(9.34)	(37.40)	(65.45)	(93.51)	(121.56)
	-5.33%	7.43	(20.63)	(48.68)	(76.74)	(104.80)	(132.85)	(160.91)
	-8.00%	(33.87)	(61.93)	(89.98)	(118.04)	(146.09)	(174.15)	(202.21)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	17.27
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	50.55
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	50.56
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	50.55
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>168.93</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 186.22

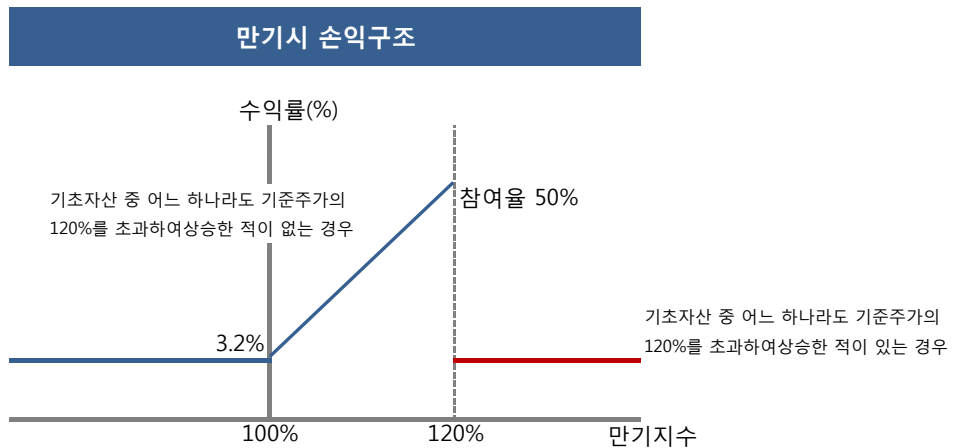
# 메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

## 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%	(1.11)	(1.16)	(1.21)	(1.27)	(1.32)	(1.37)	(1.42)
	5.33%	(0.57)	(0.62)	(0.67)	(0.72)	(0.78)	(0.83)	(0.88)
	2.67%	(0.15)	(0.20)	(0.25)	(0.30)	(0.35)	(0.41)	(0.46)
	0.00%	0.16	0.10	0.05	0.00	(0.05)	(0.10)	(0.16)
	-2.67%	0.34	0.29	0.23	0.18	0.13	0.08	0.03
	-5.33%	0.40	0.35	0.30	0.24	0.19	0.14	0.09
	-8.00%	0.34	0.29	0.24	0.19	0.13	0.08	0.03

### 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.36
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.36
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.36
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.35
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>1.42</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.70
-----	------



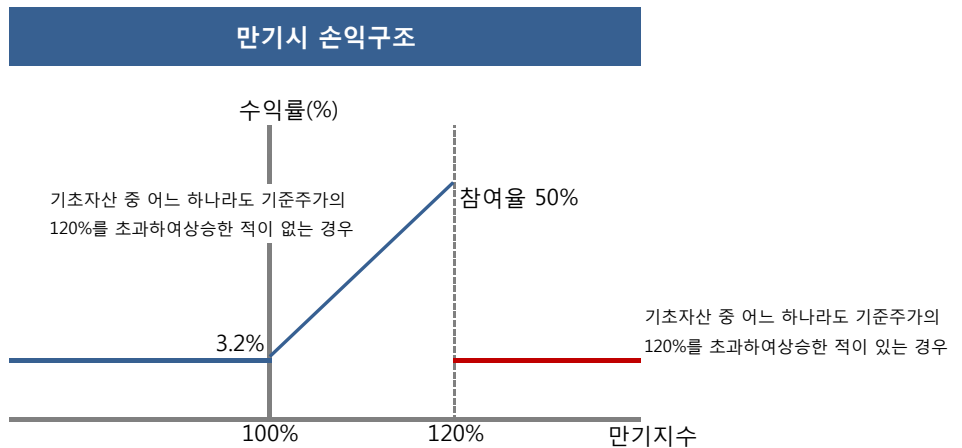
# 메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제28호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

## 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%	(2.21)	(2.26)	(2.31)	(2.36)	(2.41)	(2.46)	(2.51)
	5.33%	(1.27)	(1.32)	(1.37)	(1.42)	(1.47)	(1.52)	(1.57)
	2.67%	(0.49)	(0.54)	(0.59)	(0.64)	(0.69)	(0.74)	(0.79)
	0.00%	0.15	0.10	0.05	0.00	(0.05)	(0.10)	(0.15)
	-2.67%	0.64	0.59	0.54	0.49	0.44	0.39	0.34
	-5.33%	0.98	0.93	0.88	0.83	0.78	0.73	0.68
	-8.00%	1.18	1.13	1.08	1.03	0.98	0.93	0.88

### 시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523368423	대우증권(ELS)10777	0.63
KR6553377427	우리투자증권(ELS)8498	0.63
KR6583336427	현대증권(ELS)2014-3321	0.63
KR6693322424	NH농협증권(ELS)1298	0.63
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>2.51</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.10
-----	------

# 메리트 2스타주가연동증권 KH-2호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

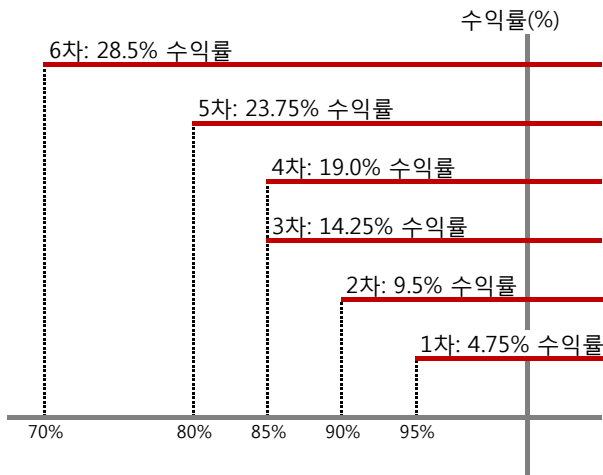
## 1. 계약금액

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

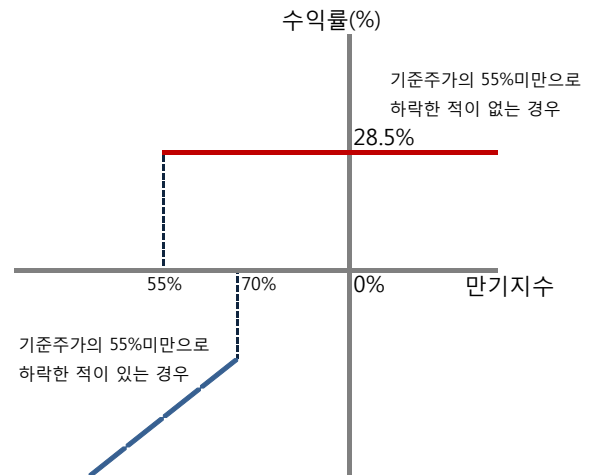
단위(백만원)

## 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%	27.88	23.41	18.94	14.47	10.00	5.53	1.06
	5.33%	23.73	19.26	14.79	10.33	5.86	1.39	(3.08)
	2.67%	18.91	14.44	9.97	5.50	1.03	(3.44)	(7.91)
	0.00%	13.41	8.94	4.47	0.00	(4.47)	(8.94)	(13.41)
	-2.67%	7.23	2.76	(1.71)	(6.18)	(10.65)	(15.12)	(19.59)
	-5.33%	0.38	(4.09)	(8.56)	(13.03)	(17.50)	(21.97)	(26.44)
	-8.00%	(7.15)	(11.62)	(16.09)	(20.56)	(25.03)	(29.50)	(33.97)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6542310430	신영증권플랜업(ELS)3990	8.49
KR6552335434	우리투자증권(ELS)8653	8.44
KR6572308437	한국투자증권(ELS)3834	8.46
KR6772307437	KB STAR(ELS)613	8.57
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>33.97</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 31.98

# 메리츠 주가지수연계증권 HE-1호[ELS-파생형]

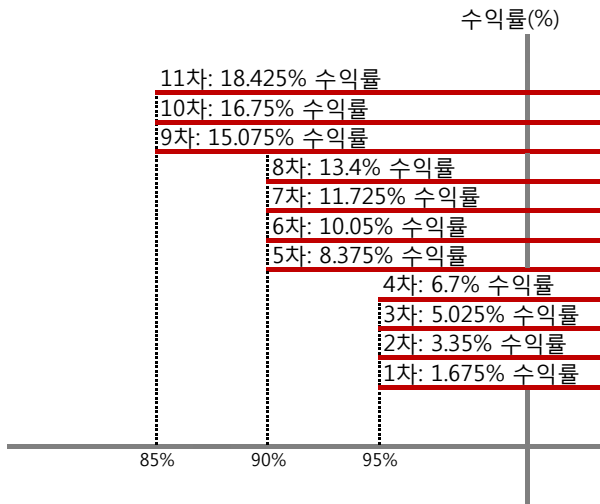
공시일: 2014-03-28

## 1. 계약금액

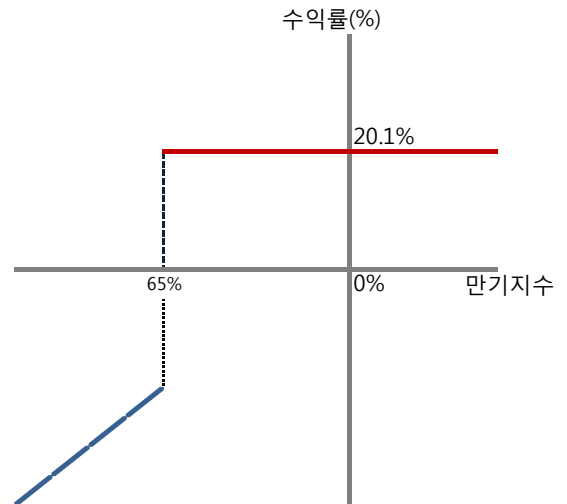
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
신규	유가증권	ELS	783	0	783	비고
누계	유가증권	ELS	783	0	783	장외

## 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%	16.50	15.04	13.59	12.14	10.69	9.24	7.79
	5.33%	14.67	13.22	11.77	10.32	8.87	7.42	5.97
	2.67%	10.63	9.18	7.73	6.27	4.82	3.37	1.92
	0.00%	4.35	2.90	1.45	0.00	(1.45)	(2.90)	(4.35)
	-2.67%	(4.15)	(5.60)	(7.05)	(8.50)	(9.95)	(11.40)	(12.85)
	-5.33%	(14.88)	(16.33)	(17.78)	(19.23)	(20.68)	(22.13)	(23.58)
	-8.00%	(27.83)	(29.28)	(30.74)	(32.19)	(33.64)	(35.09)	(36.54)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513317430	대신증권(ELS)4203	9.19
KR6523335430	대우증권(ELS)10783	9.05
KR6573302439	한국투자증권(ELS)3821	9.10
KR6703309437	H&D증권(ELS)4174	9.20
총 최대손실 예상금액		36.54

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	36.40
-----	-------

# 메리츠 주가지수연계증권 KHE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

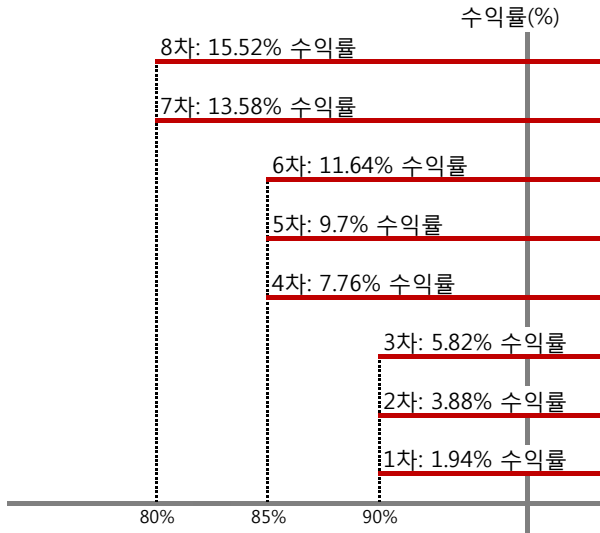
## 1. 계약금액

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

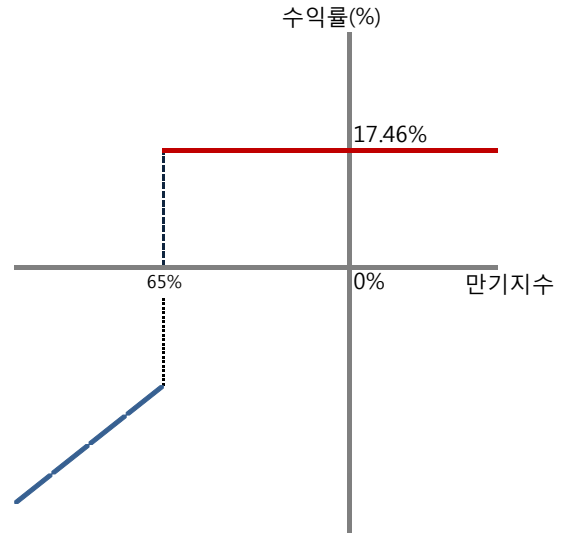
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	6.01	4.91	3.80	2.69	1.59	0.48	(0.63)
	5.33%	7.82	6.72	5.61	4.50	3.40	2.29	1.18
	2.67%	6.92	5.82	4.71	3.60	2.50	1.39	0.28
	0.00%	3.32	2.21	1.11	0.00	(1.11)	(2.21)	(3.32)
	-2.67%	(2.99)	(4.10)	(5.21)	(6.31)	(7.42)	(8.53)	(9.63)
	-5.33%	(12.01)	(13.12)	(14.22)	(15.33)	(16.44)	(17.54)	(18.65)
	-8.00%	(23.74)	(24.84)	(25.95)	(27.06)	(28.16)	(29.27)	(30.38)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	예상금액	단위(백만원)
KR6513315434	대신증권(ELS)4200	7.62
KR6573303437	한국투자증권(ELS)3822	7.56
KR6593329438	미래에셋증권(ELS)5768	7.57
KR6703310435	하나대투증권(ELS)4176	7.63
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>30.38</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.02
-----	-------

# 메리츠 주가지수연계증권 HE-2호[ELS-파생형]

공시일: 2014-03-28

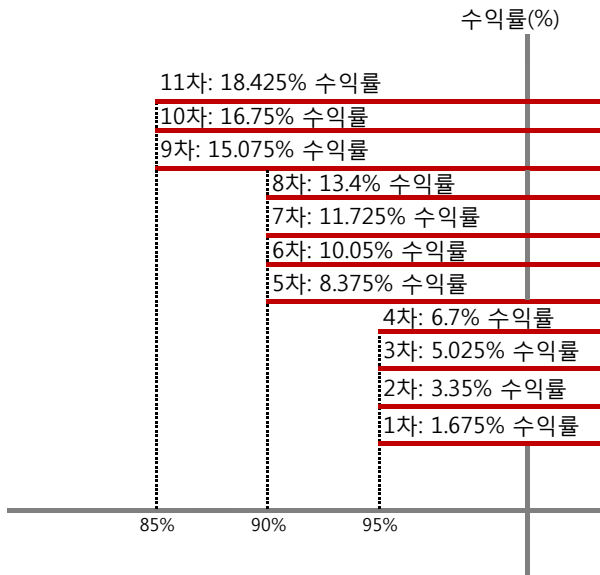
## 1. 계약금액

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

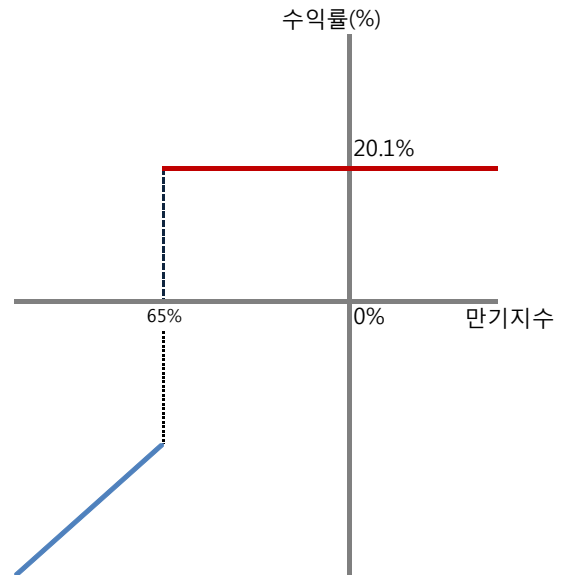
단위(백만원)

## 2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



## 3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

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%	1.93	1.58	1.24	0.90	0.55	0.21	(0.13)
	5.33%	2.57	2.23	1.88	1.54	1.20	0.85	0.51
	2.67%	2.27	1.93	1.58	1.24	0.90	0.55	0.21
	0.00%	1.03	0.69	0.34	0.00	(0.34)	(0.69)	(1.03)
	-2.67%	(1.15)	(1.50)	(1.84)	(2.18)	(2.53)	(2.87)	(3.21)
	-5.33%	(4.28)	(4.62)	(4.97)	(5.31)	(5.65)	(6.00)	(6.34)
	-8.00%	(8.35)	(8.69)	(9.04)	(9.38)	(9.72)	(10.07)	(10.41)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65133A2438	대신증권(ELS)4245	2.62
KR65233B7435	대우증권(ELS)10910	2.57
KR6573315431	한국투자증권(ELS)3854	2.59
KR6703373433	하나대투증권(ELS)4071	2.62
<b>총 최대손실 예상금액</b>		<b>10.41</b>

## 4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.95
-----	------