

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

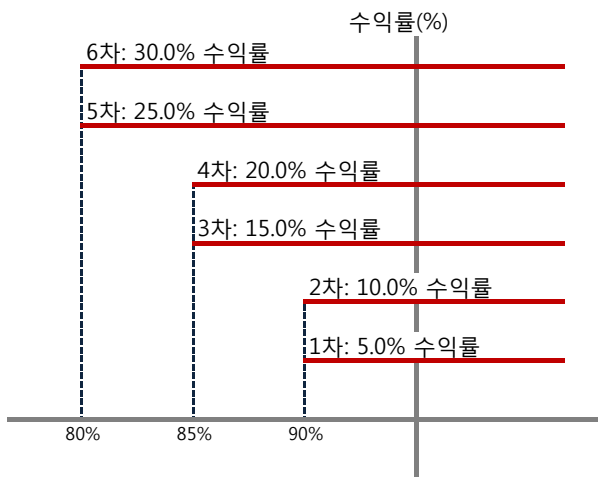
1. 계약금액

단위(백만원)

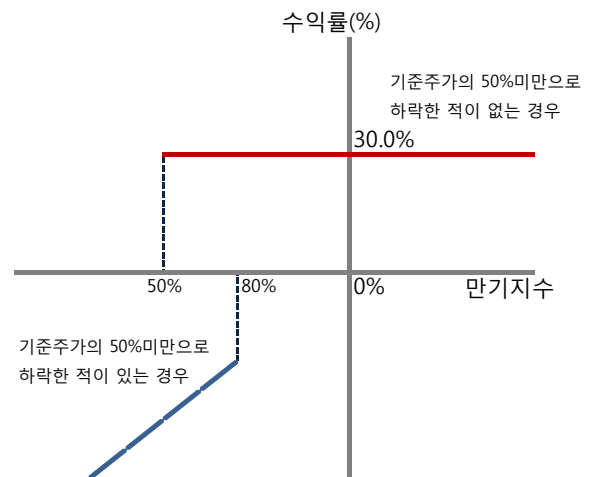
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,406	0	4,406	장외
누계	유가증권	ELS	4,406	0	4,406	장외

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%	(12.74)	(12.82)	(12.91)	(12.99)	(13.07)	(13.16)	(13.24)
	5.33%	(5.52)	(5.61)	(5.69)	(5.77)	(5.86)	(5.94)	(6.02)
	2.67%	(1.19)	(1.28)	(1.36)	(1.44)	(1.53)	(1.61)	(1.69)
	0.00%	0.25	0.17	0.08	0.00	(0.08)	(0.17)	(0.25)
	-2.67%	(1.19)	(1.28)	(1.36)	(1.44)	(1.53)	(1.61)	(1.69)
	-5.33%	(5.52)	(5.61)	(5.69)	(5.77)	(5.86)	(5.94)	(6.02)
	-8.00%	(12.74)	(12.82)	(12.91)	(12.99)	(13.07)	(13.16)	(13.24)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	3.73
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	3.18
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	3.32
KR6662374141	동양W(ELS)1004	3.01
총 최대손실 예상금액		13.24

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

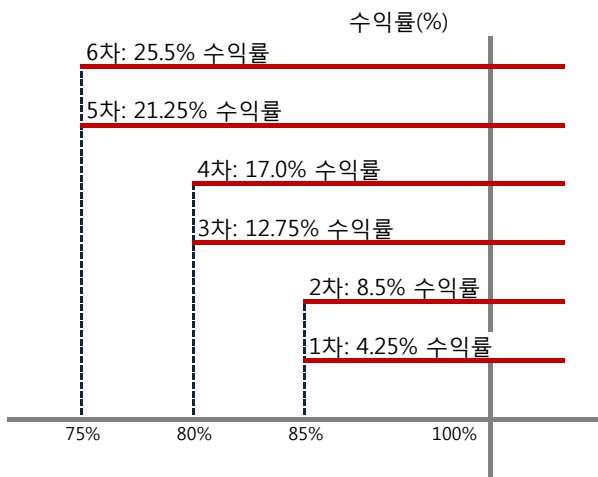
1. 계약금액

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

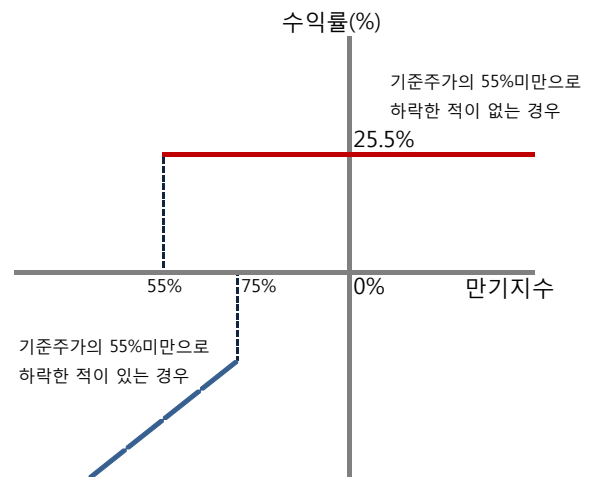
단위(백만원)

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%	38.44	34.14	29.83	25.53	21.22	16.92	12.61
	5.33%	36.38	32.08	27.77	23.47	19.16	14.86	10.55
	2.67%	27.87	23.57	19.26	14.96	10.65	6.35	2.04
	0.00%	12.91	8.61	4.30	0.00	(4.30)	(8.61)	(12.91)
	-2.67%	(8.49)	(12.80)	(17.10)	(21.41)	(25.71)	(30.02)	(34.32)
	-5.33%	(36.35)	(40.66)	(44.96)	(49.27)	(53.57)	(57.88)	(62.18)
	-8.00%	(70.66)	(74.96)	(79.27)	(83.57)	(87.88)	(92.18)	(96.49)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	24.63
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	24.89
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	22.22
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	24.75
총 최대손실 예상금액		96.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 104.18

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

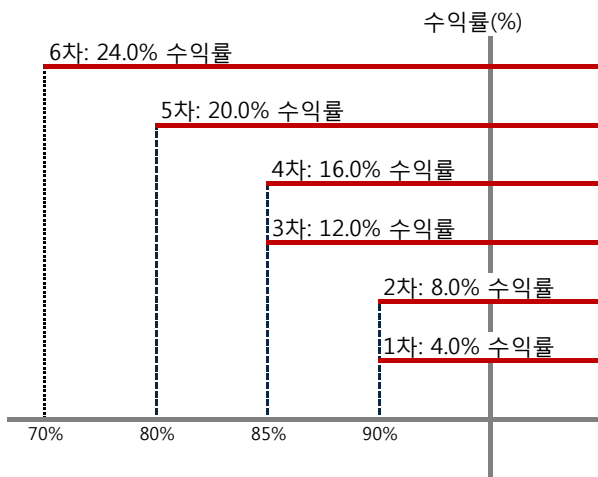
1. 계약금액

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

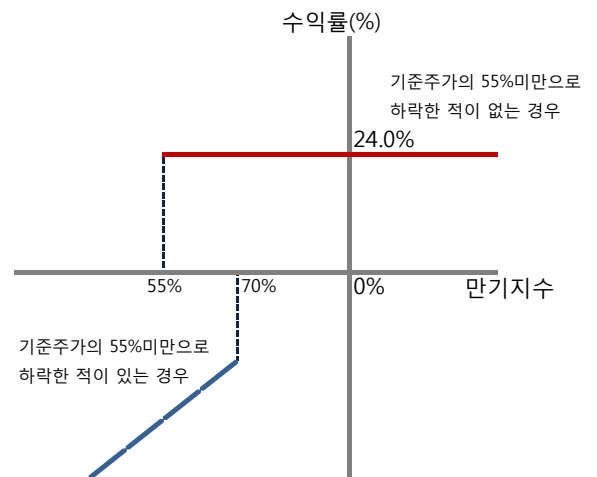
단위(백만원)

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%	184.36	165.28	146.19	127.11	108.03	88.94	69.86
	5.33%	152.91	133.83	114.75	95.66	76.58	57.50	38.41
	2.67%	110.54	91.46	72.38	53.29	34.21	15.13	(3.96)
	0.00%	57.25	38.17	19.08	0.00	(19.08)	(38.17)	(57.25)
	-2.67%	(6.97)	(26.05)	(45.13)	(64.22)	(83.30)	(102.38)	(121.47)
	-5.33%	(82.11)	(101.19)	(120.27)	(139.36)	(158.44)	(177.53)	(196.61)
	-8.00%	(168.17)	(187.25)	(206.34)	(225.42)	(244.51)	(263.59)	(282.67)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	70.67
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	70.37
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	71.36
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	70.28
총 최대손실 예상금액		282.67

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 304.52

메리트 2스타주가연동증권 KH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

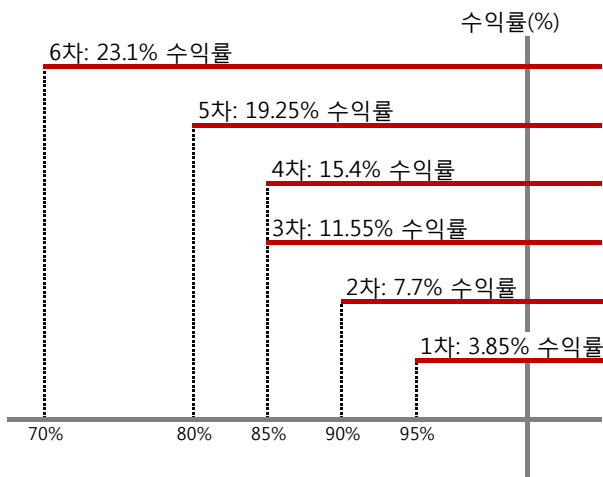
1. 계약금액

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

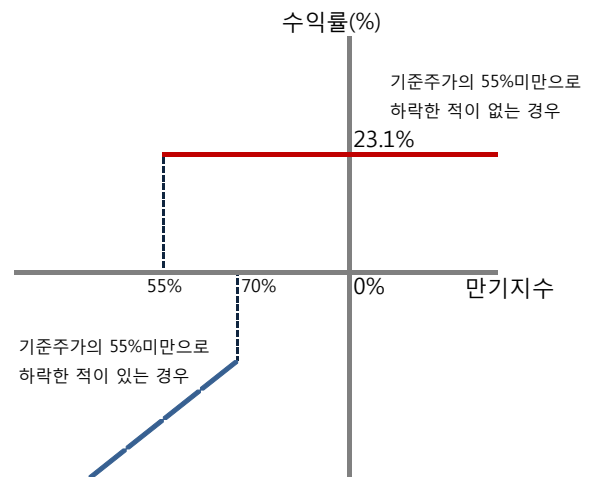
단위(백만원)

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%	16.41	14.04	11.67	9.29	6.92	4.55	2.18
	5.33%	15.65	13.28	10.90	8.53	6.16	3.79	1.42
	2.67%	12.55	10.18	7.81	5.43	3.06	0.69	(1.68)
	0.00%	7.12	4.74	2.37	0.00	(2.37)	(4.74)	(7.12)
	-2.67%	(0.66)	(3.03)	(5.40)	(7.77)	(10.14)	(12.51)	(14.89)
	-5.33%	(10.76)	(13.13)	(15.51)	(17.88)	(20.25)	(22.62)	(24.99)
	-8.00%	(23.21)	(25.58)	(27.95)	(30.32)	(32.69)	(35.06)	(37.44)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512307374	대신증권(ELS)3488	9.35
KR6572310375	한국투자증권(ELS)3381	9.26
KR6582311371	현대증권(ELS)2013-2962	9.30
KR6772302370	KB STAR(ELS)480	9.53
총 최대손실 예상금액		37.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 33.97

메리츠 2스타주가연동증권 LH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

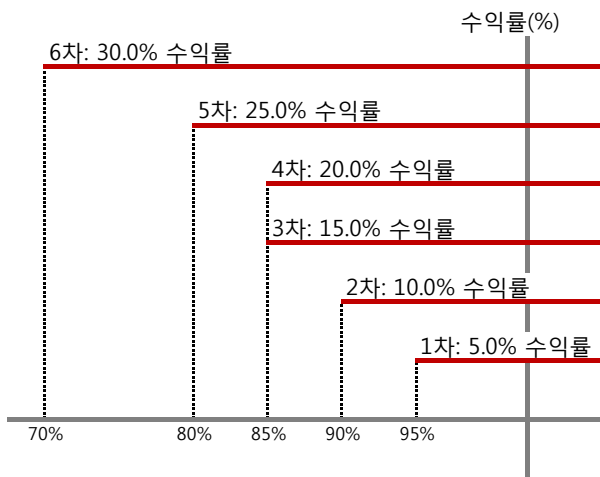
1. 계약금액

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

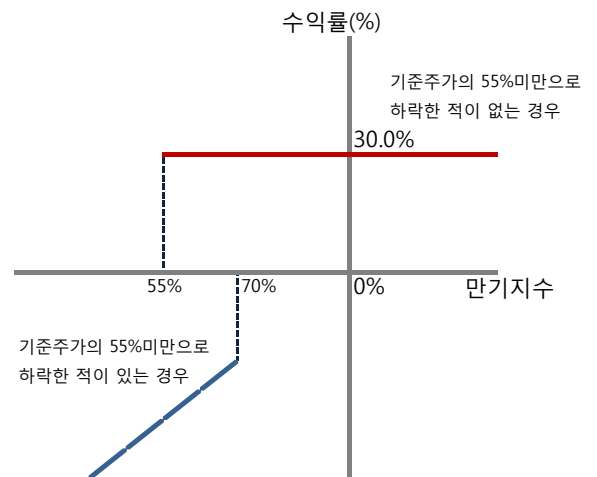
단위(백만원)

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%	46.56	40.44	34.33	28.21	22.09	15.97	9.85
	5.33%	39.57	33.45	27.33	21.21	15.10	8.98	2.86
	2.67%	30.17	24.05	17.93	11.81	5.69	(0.42)	(6.54)
	0.00%	18.35	12.24	6.12	0.00	(6.12)	(12.24)	(18.35)
	-2.67%	4.13	(1.98)	(8.10)	(14.22)	(20.34)	(26.46)	(32.58)
	-5.33%	(12.50)	(18.61)	(24.73)	(30.85)	(36.97)	(43.09)	(49.20)
	-8.00%	(31.53)	(37.65)	(43.77)	(49.89)	(56.01)	(62.12)	(68.24)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512323389	대신증권(ELS)3554	17.04
KR6572337386	한국투자증권(ELS)3430	16.93
KR6582335388	현대증권(ELS)2013-3009	16.99
KR6771313386	KB STAR(ELS)503	17.28
총 최대손실 예상금액		68.24

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 66.43

메리트 2스타주가연동증권 SH-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

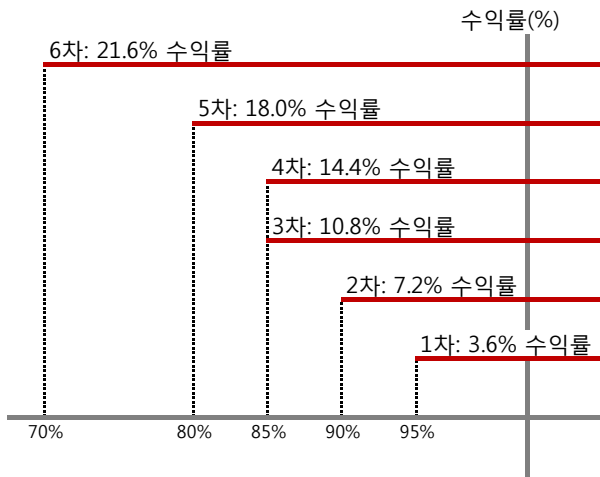
1. 계약금액

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

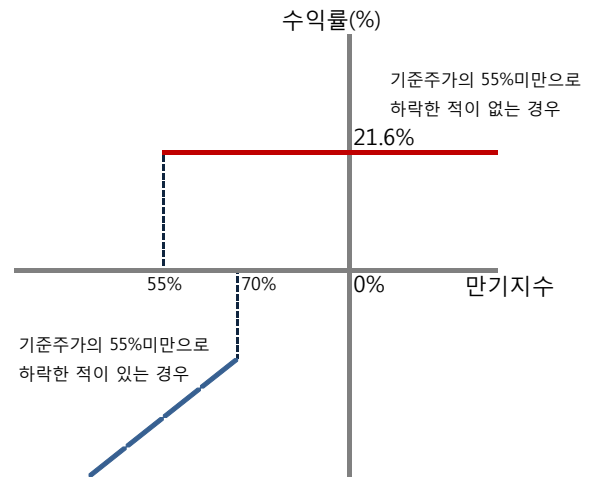
단위(백만원)

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%	186.24	159.03	131.81	104.60	77.39	50.18	22.97
	5.33%	153.07	125.86	98.64	71.43	44.22	17.01	(10.20)
	2.67%	118.20	90.99	63.78	36.57	9.35	(17.86)	(45.07)
	0.00%	81.63	54.42	27.21	0.00	(27.21)	(54.42)	(81.63)
	-2.67%	43.37	16.16	(11.05)	(38.26)	(65.47)	(92.69)	(119.90)
	-5.33%	3.41	(23.80)	(51.01)	(78.23)	(105.44)	(132.65)	(159.86)
	-8.00%	(38.25)	(65.46)	(92.67)	(119.88)	(147.10)	(174.31)	(201.52)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65123A0392	대신증권(ELS)3674	17.28
KR6572385393	한국투자증권(ELS)3470	50.37
KR6582382398	현대증권(ELS)2013-3080	50.35
KR6652340391	한화스마트(ELS)2562	50.36
총 최대손실 예상금액		168.37

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 204.43

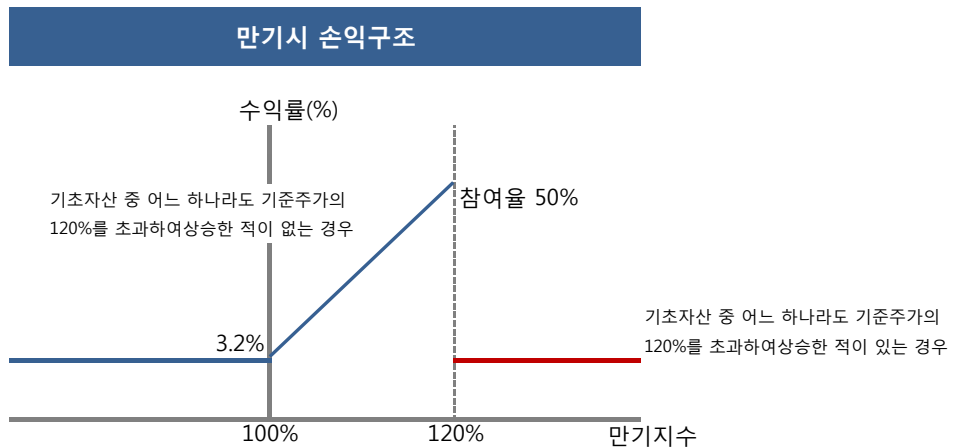
메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제27호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

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%	(1.22)	(1.27)	(1.32)	(1.37)	(1.42)	(1.47)	(1.52)
	5.33%	(0.66)	(0.71)	(0.76)	(0.81)	(0.86)	(0.91)	(0.97)
	2.67%	(0.20)	(0.25)	(0.30)	(0.35)	(0.41)	(0.46)	(0.51)
	0.00%	0.15	0.10	0.05	0.00	(0.05)	(0.10)	(0.15)
	-2.67%	0.41	0.35	0.30	0.25	0.20	0.15	0.10
	-5.33%	0.56	0.50	0.45	0.40	0.35	0.30	0.25
	-8.00%	0.60	0.55	0.50	0.45	0.40	0.35	0.30

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65233DT410	대우증권(ELS)10589	0.38
KR65533C9411	우리투자증권(ELS)8477	0.38
KR65833AC419	현대증권(ELS)2014-3295	0.38
KR6693362412	NH농협증권(ELS)1293	0.38
총 최대손실 예상금액		1.52

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.26
-----	------

메리츠 한증지수연계 증권투자신탁 제28호[ELS-파생형]

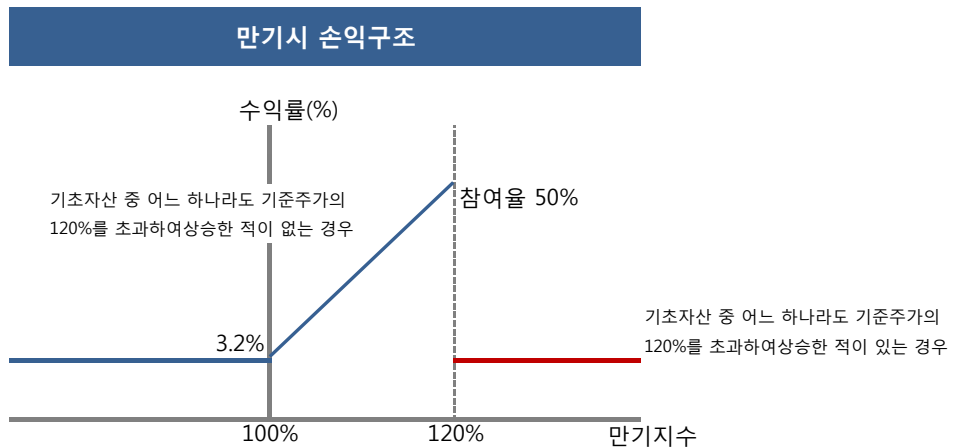
공시일: 2014-04-01

1. 계약금액

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

단위(백만원)

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%	(2.36)	(2.39)	(2.41)	(2.44)	(2.47)	(2.50)	(2.52)
	5.33%	(1.36)	(1.38)	(1.41)	(1.44)	(1.46)	(1.49)	(1.52)
	2.67%	(0.54)	(0.57)	(0.60)	(0.62)	(0.65)	(0.68)	(0.70)
	0.00%	0.08	0.05	0.03	0.00	(0.03)	(0.05)	(0.08)
	-2.67%	0.51	0.49	0.46	0.43	0.41	0.38	0.35
	-5.33%	0.76	0.73	0.70	0.68	0.65	0.62	0.60
	-8.00%	0.81	0.78	0.76	0.73	0.70	0.68	0.65

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523368423	대우증권(ELS)10777	0.84
KR6553377427	우리투자증권(ELS)8498	0.00
KR6583336427	현대증권(ELS)2014-3321	0.84
KR6693322424	NH농협증권(ELS)1298	0.84
총 최대손실 예상금액		2.52

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.40
-----	------

메리트 2스타주가연동증권 KH-2호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

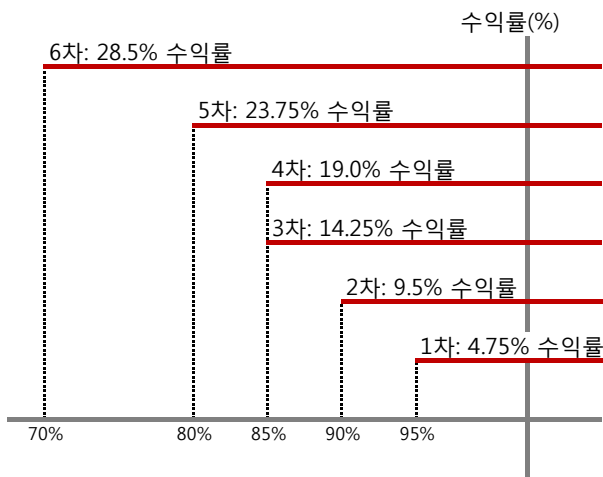
1. 계약금액

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

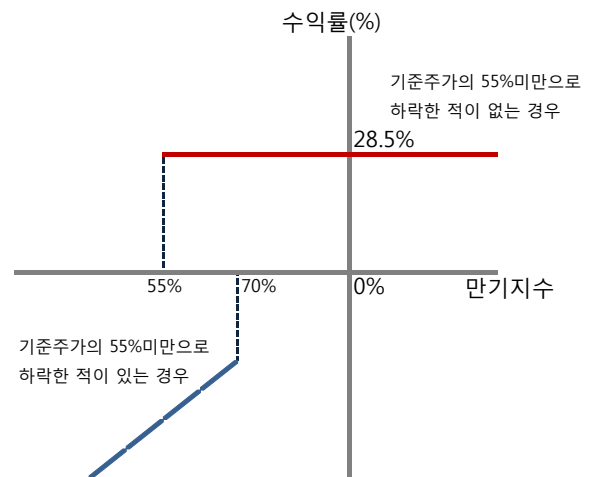
단위(백만원)

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%	32.50	27.25	22.00	16.75	11.50	6.24	0.99
	5.33%	27.59	22.33	17.08	11.83	6.58	1.33	(3.92)
	2.67%	22.00	16.75	11.50	6.25	1.00	(4.25)	(9.50)
	0.00%	15.75	10.50	5.25	0.00	(5.25)	(10.50)	(15.75)
	-2.67%	8.84	3.59	(1.66)	(6.92)	(12.17)	(17.42)	(22.67)
	-5.33%	1.25	(4.00)	(9.25)	(14.50)	(19.75)	(25.00)	(30.25)
	-8.00%	(6.99)	(12.25)	(17.50)	(22.75)	(28.00)	(33.25)	(38.50)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6542310430	신영증권플랜업(ELS)3990	9.63
KR6552335434	우리투자증권(ELS)8653	9.58
KR6572308437	한국투자증권(ELS)3834	9.60
KR6772307437	KB STAR(ELS)613	9.70
총 최대손실 예상금액		38.50

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 50.73

메리츠 주가지수연계증권 HE-1호[ELS-파생형]

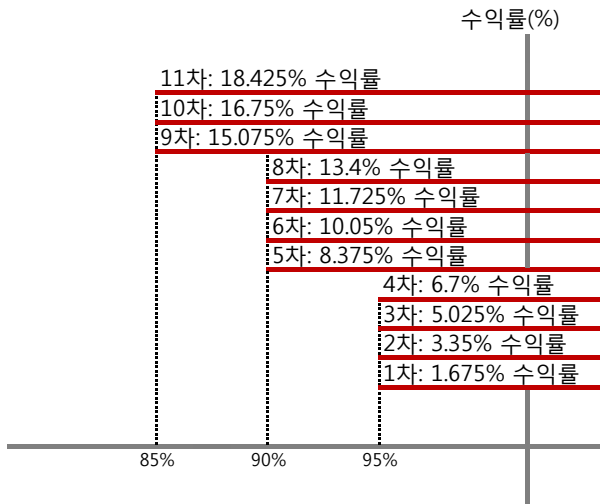
공시일: 2014-04-01

1. 계약금액

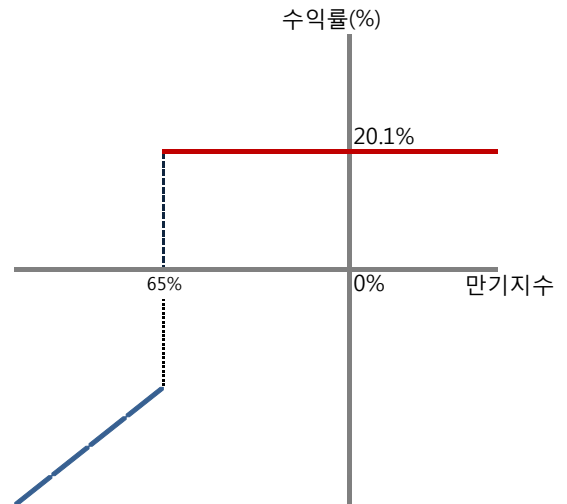
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	단위(백만원)
신규	유가증권	ELS	783	0	783	비고
누계	유가증권	ELS	783	0	783	장외

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 시나 리오	8.00%	8.06	6.80	5.54	4.28	3.02	1.75	0.49
	5.33%	9.48	8.22	6.96	5.69	4.43	3.17	1.91
	2.67%	8.05	6.79	5.53	4.27	3.01	1.75	0.48
	0.00%	3.78	2.52	1.26	0.00	(1.26)	(2.52)	(3.78)
	-2.67%	(3.33)	(4.59)	(5.85)	(7.11)	(8.37)	(9.63)	(10.90)
	-5.33%	(13.28)	(14.54)	(15.80)	(17.06)	(18.33)	(19.59)	(20.85)
	-8.00%	(26.08)	(27.34)	(28.60)	(29.86)	(31.12)	(32.38)	(33.65)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513317430	대신증권(ELS)4203	8.47
KR6523335430	대우증권(ELS)10783	8.33
KR6573302439	한국투자증권(ELS)3821	8.37
KR6703309437	H&D증권(ELS)4174	8.48
총 최대손실 예상금액		33.65

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 32.06

메리츠 주가지수연계증권 KHE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2014-04-01

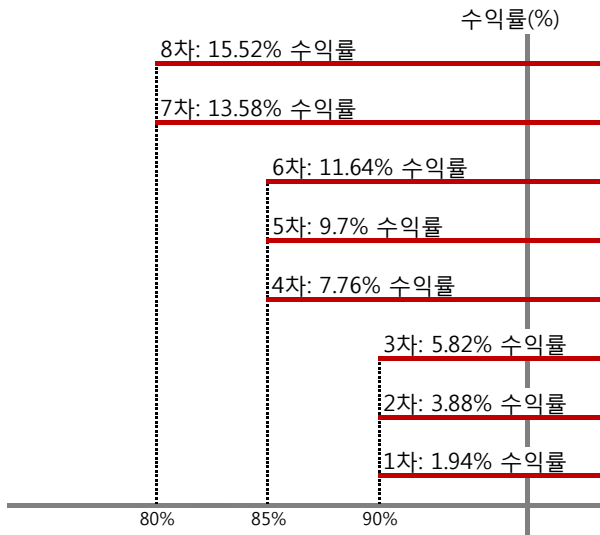
1. 계약금액

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

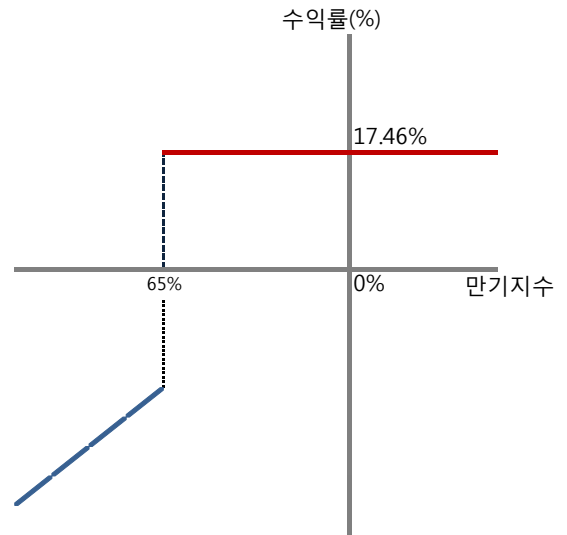
단위(백만원)

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%	(3.71)	(3.95)	(4.19)	(4.42)	(4.66)	(4.90)	(5.14)
	5.33%	(0.30)	(0.54)	(0.78)	(1.02)	(1.26)	(1.49)	(1.73)
	2.67%	1.17	0.93	0.69	0.46	0.22	(0.02)	(0.26)
	0.00%	0.71	0.48	0.24	0.00	(0.24)	(0.48)	(0.71)
	-2.67%	(1.67)	(1.91)	(2.15)	(2.39)	(2.62)	(2.86)	(3.10)
	-5.33%	(5.99)	(6.23)	(6.47)	(6.70)	(6.94)	(7.18)	(7.42)
	-8.00%	(12.24)	(12.48)	(12.72)	(12.95)	(13.19)	(13.43)	(13.67)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513315434	대신증권(ELS)4200	3.43
KR6573303437	한국투자증권(ELS)3822	3.39
KR6593329438	미래에셋증권(ELS)5768	3.40
KR6703310435	하나대투증권(ELS)4176	3.44
총 최대손실 예상금액		13.67

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	11.47
-----	-------

메리츠 주가지수연계증권 HE-2호[ELS-파생형]

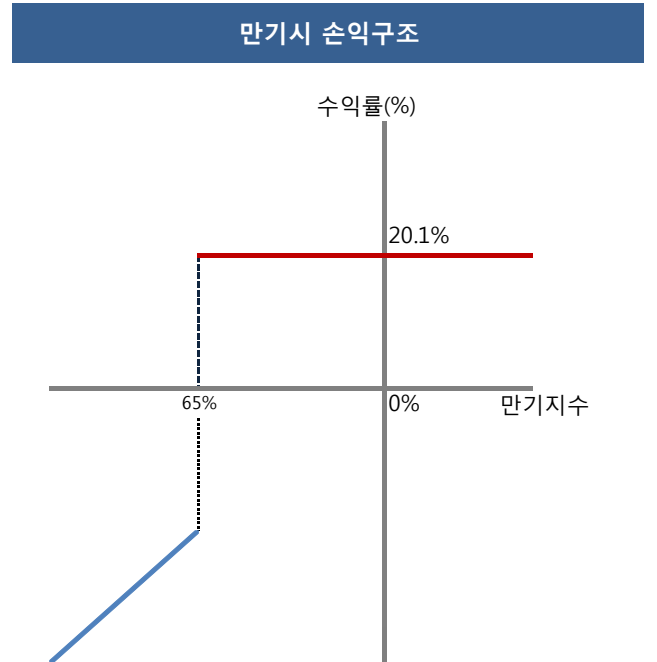
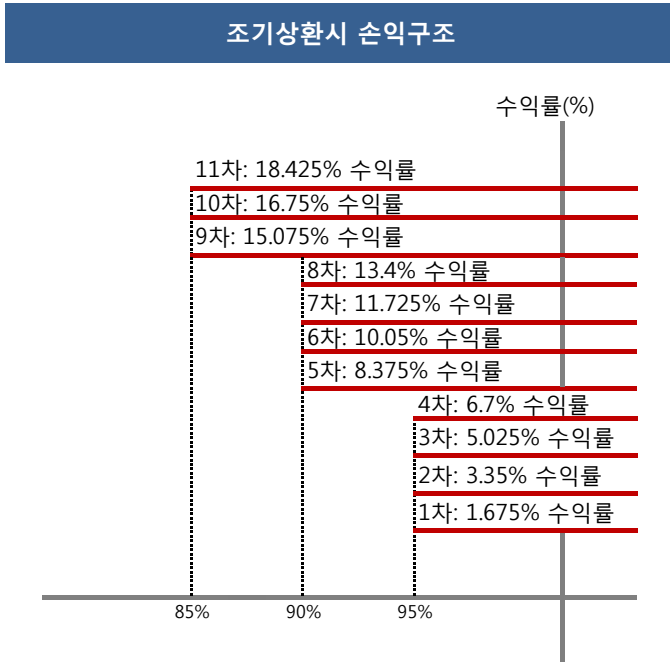
공시일: 2014-04-01

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



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%	(0.07)	(0.34)	(0.60)	(0.87)	(1.14)	(1.40)	(1.67)
	5.33%	1.24	0.97	0.70	0.44	0.17	(0.10)	(0.36)
	2.67%	1.53	1.26	0.99	0.73	0.46	0.19	(0.07)
	0.00%	0.80	0.53	0.27	0.00	(0.27)	(0.53)	(0.80)
	-2.67%	(0.94)	(1.21)	(1.48)	(1.74)	(2.01)	(2.28)	(2.55)
	-5.33%	(3.71)	(3.97)	(4.24)	(4.51)	(4.77)	(5.04)	(5.31)
	-8.00%	(7.49)	(7.75)	(8.02)	(8.29)	(8.55)	(8.82)	(9.09)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65133A2438	대신증권(ELS)4245	2.29
KR65233B7435	대우증권(ELS)10910	2.25
KR6573315431	한국투자증권(ELS)3854	2.26
KR6703373433	하나대투증권(ELS)4071	2.29
총 최대손실 예상금액		9.09

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.26
-----	------