

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠 WTI Index 사모특별 1호

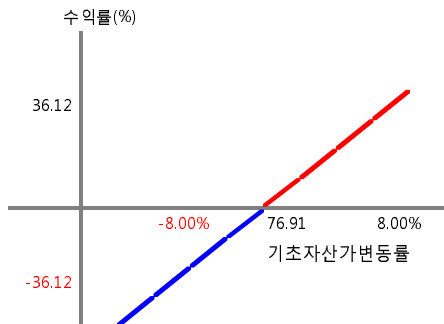
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

단위(백만원)

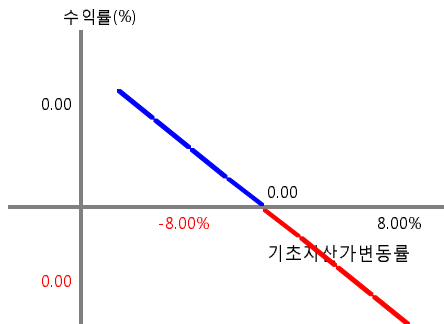
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내

2. 만기시점의 손익구조



기초자산의 만기가격이 평균매입가보다 큰(작은) 경우 이익(손실) 발생(단위: USD/barrel)

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long



기초자산의 만기가격이 평균매입가보다 큰(작은) 경우 이익(손실) 발생(단위: USD/barrel)

3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	36.12
	5.33%	24.06
	2.67%	12.05
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.05
	-5.33%	-24.06
	-8.00%	-36.12

최대손실 시나리오

위험액	-36.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	146.33
-----	--------

메리트WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

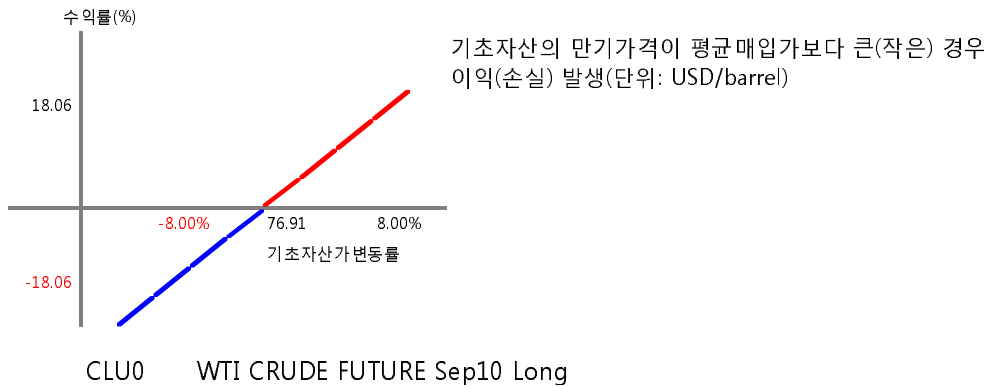
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	36.12
	5.33%	24.06
	2.67%	12.05
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.05
	-5.33%	-24.06
	-8.00%	-36.12

최대손실 시나리오

위험액	-36.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	95.74
-----	-------

메리츠WTIIIndex특별자산1호[원유_파생형]

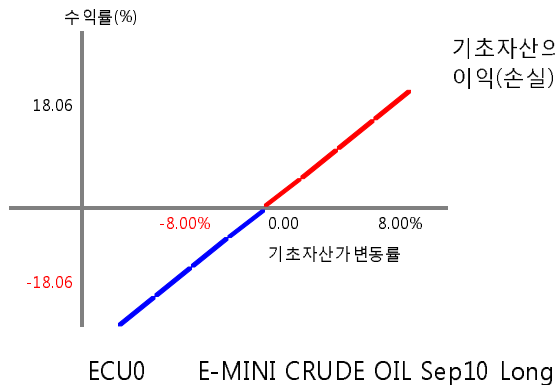
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1	0	1	장내

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

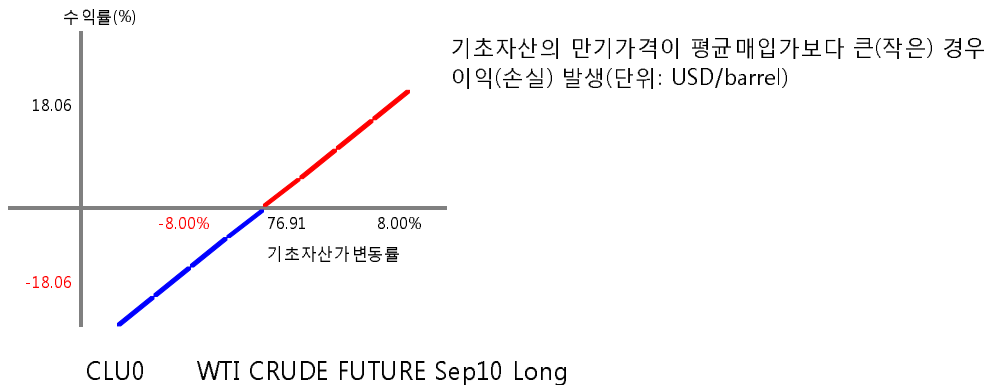
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	47.46
	5.33%	31.62
	2.67%	15.84
시나리오	0.00%	0.00
	-2.67%	-15.84
	-5.33%	-31.62
	-8.00%	-47.46

최대손실 시나리오

위험액 -47.46

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 188.82

메리츠PremiumCommodity특별자산1

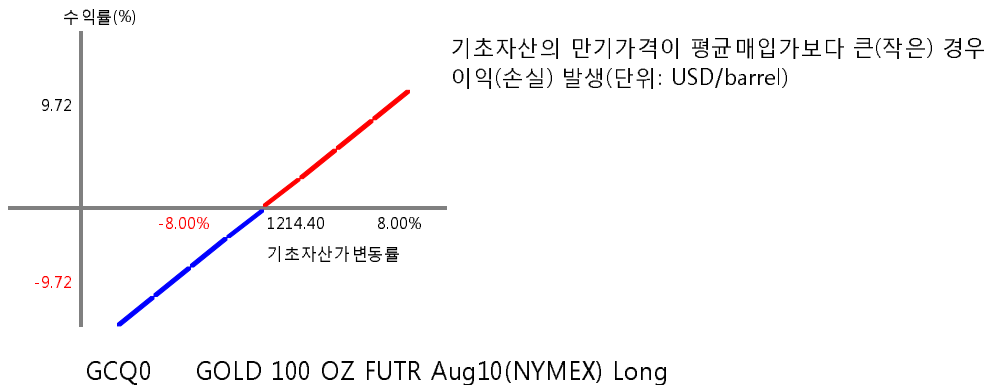
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1	0	1	장내

2. 만기시점의 손익구조



메리츠PremiumCommodity특별자산1

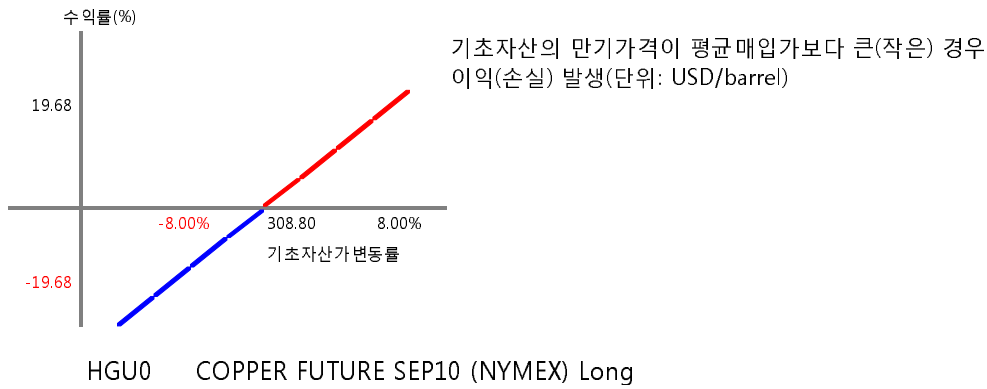
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 만기시점의 손익구조



메리츠WTIIndex사모특별자산2호

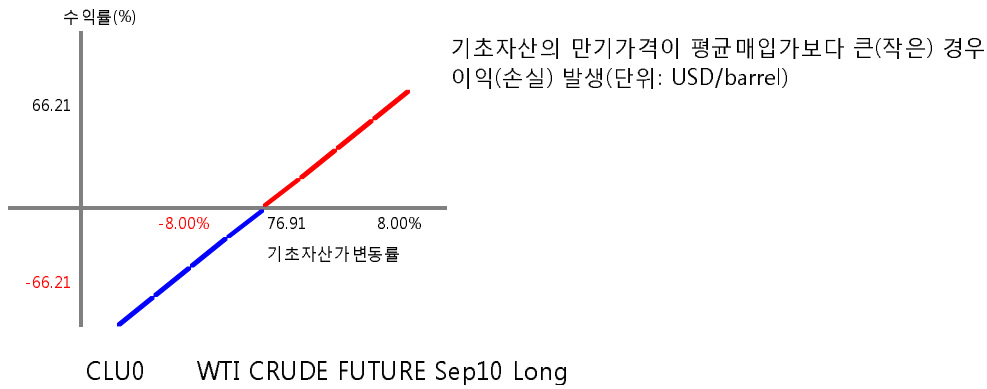
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11	0	11	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLU0 WTI CRUDE FUTURE Sep10 Long

구분	시나리오	
기초 자산	8.00%	66.21
	5.33%	44.11
	2.67%	22.10
	0.00%	0.00
시나리오	-2.67%	-22.10
	-5.33%	-44.11
	-8.00%	-66.21

최대손실 시나리오	
위험액	-66.21

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	249.40
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제5호[ELS-파생형]

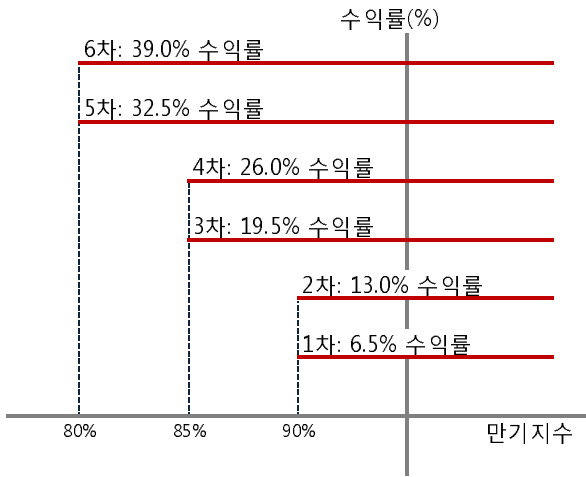
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

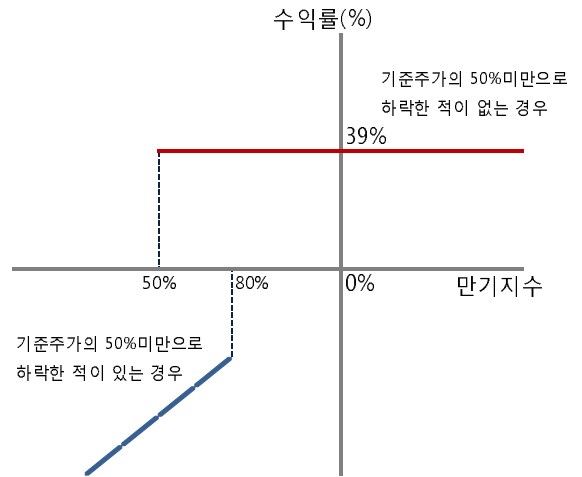
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장외

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%	5.49	5.41	5.33	5.26	5.18	5.10	5.02
	5.33%	2.56	2.48	2.40	2.33	2.25	2.17	2.09
	2.67%	0.81	0.73	0.65	0.57	0.50	0.42	0.34
	0.00%	0.23	0.15	0.08	0.00	(0.08)	(0.15)	(0.23)
	-2.67%	0.84	0.76	0.68	0.60	0.53	0.45	0.37
	-5.33%	2.62	2.54	2.46	2.39	2.31	2.23	2.15
	-8.00%	5.58	5.50	5.42	5.35	5.27	5.19	5.11

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513101032	대신증권(ELS)993	0.06
KR6553313034	우리투자증권(ELS)2980	0.06
KR6663306035	동양(ELS)485	0.06
KR6703307035	H&D증권(ELS)504	0.06
총 최대손실 예상금액		0.23

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.85
-----	------

메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-17

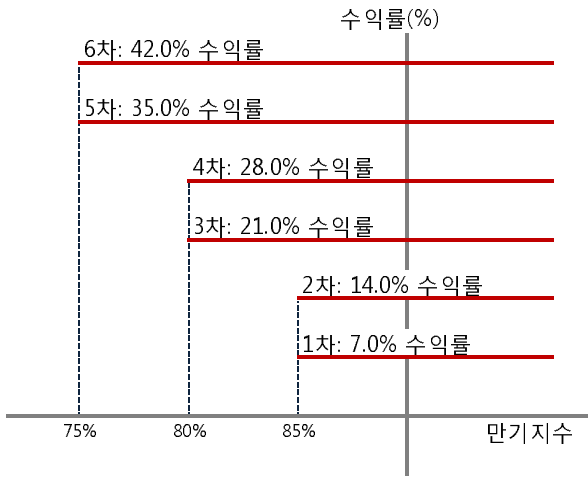
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장외

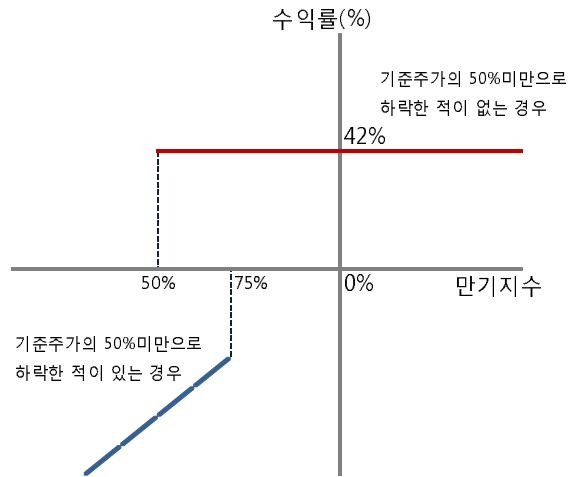
단위(백만원)

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%	(5.72)	(8.34)	(10.95)	(13.56)	(16.18)	(18.79)	(21.40)
자산	5.33%	5.11	2.50	(0.12)	(2.73)	(5.34)	(7.96)	(10.57)
시나	2.67%	9.63	7.02	4.41	1.79	(0.82)	(3.43)	(6.05)
리오	0.00%	7.84	5.23	2.61	0.00	(2.61)	(5.23)	(7.84)
	-2.67%	(0.27)	(2.88)	(5.49)	(8.11)	(10.72)	(13.33)	(15.95)
	-5.33%	(14.68)	(17.30)	(19.91)	(22.52)	(25.14)	(27.75)	(30.37)
	-8.00%	(35.42)	(38.03)	(40.64)	(43.26)	(45.87)	(48.48)	(51.10)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502333034	신한투자(ELS)1395	51.10
총 최대손실 예상금액		51.10

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	43.16
-----	-------

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

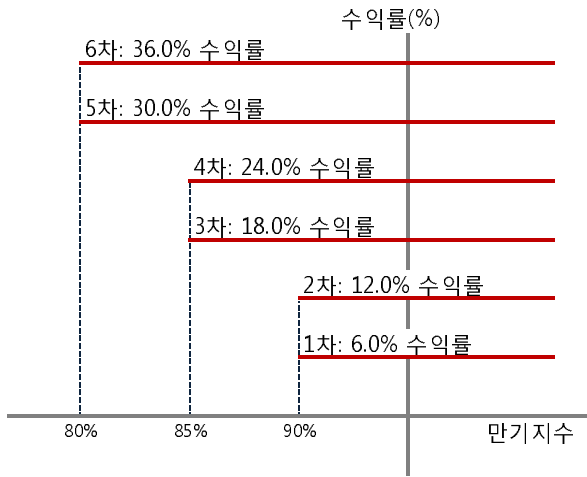
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

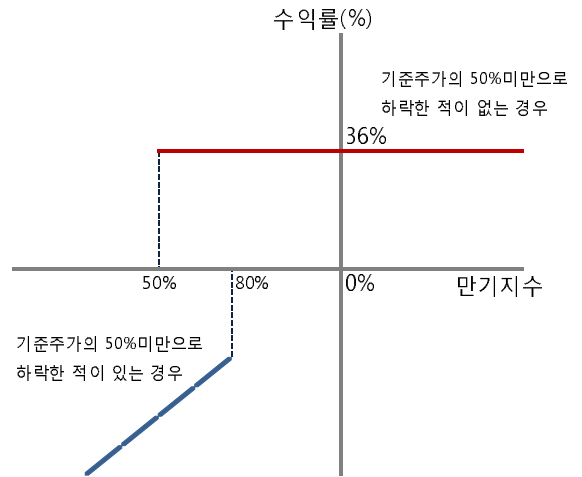
							단위(백만원)
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고	
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외	
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장외	

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	8.00%	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	79.68	66.39	53.10	39.81	26.52	13.22	(0.07)
	5.33%	68.94	55.64	42.35	29.06	15.77	2.48	(10.82)
	2.67%	55.67	42.37	29.08	15.79	2.50	(10.79)	(24.08)
	0.00%	39.88	26.58	13.29	0.00	(13.29)	(26.58)	(39.88)
	-2.67%	21.56	8.27	(5.02)	(18.31)	(31.60)	(44.90)	(58.19)
	-5.33%	0.73	(12.56)	(25.86)	(39.15)	(52.44)	(65.73)	(79.02)
	-8.00%	(22.63)	(35.92)	(49.21)	(62.50)	(75.79)	(89.09)	(102.38)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	102.38
총 최대손실 예상금액		102.38

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	89.86
-----	-------

메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

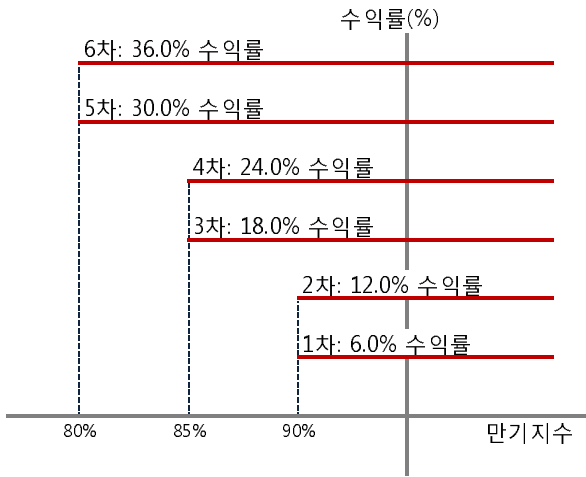
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

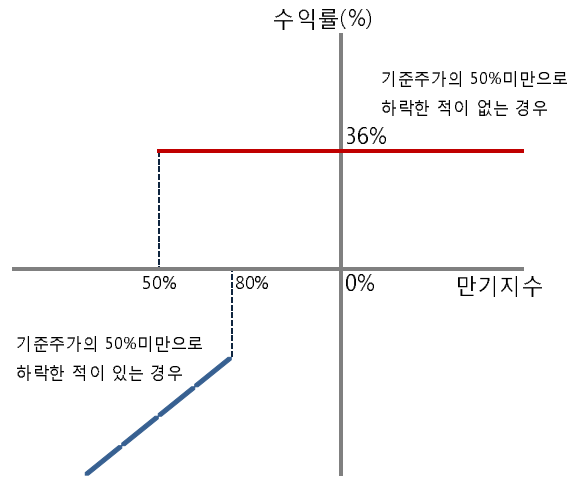
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장외

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%	59.92	49.83	39.75	29.67	19.58	9.50	(0.58)
	5.33%	52.51	42.43	32.34	22.26	12.18	2.09	(7.99)
	2.67%	42.62	32.54	22.45	12.37	2.29	(7.80)	(17.88)
	0.00%	30.25	20.17	10.08	0.00	(10.08)	(20.17)	(30.25)
	-2.67%	15.40	5.32	(4.77)	(14.85)	(24.93)	(35.02)	(45.10)
	-5.33%	(1.93)	(12.01)	(22.10)	(32.18)	(42.26)	(52.35)	(62.43)
	-8.00%	(21.74)	(31.83)	(41.91)	(51.99)	(62.08)	(72.16)	(82.24)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6512107048	대신증권(ELS)1029	82.24
총 최대손실 예상금액		82.24

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	97.87
-----	-------

메리츠주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-17

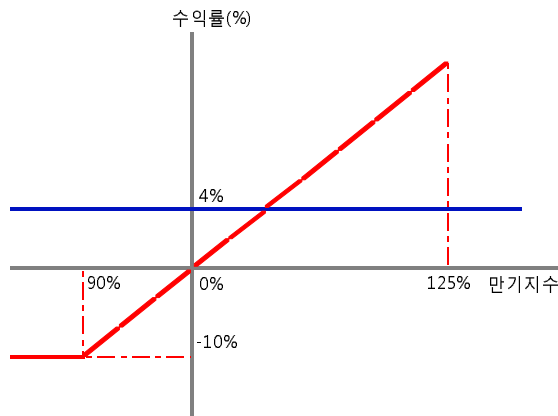
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	445	0	445	장외

단위(백만원)

2. 만기시점의 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%	10.54	9.77	9.00	8.22	7.45	6.68	5.91
	5.33%	8.09	7.32	6.54	5.77	5.00	4.23	3.46
	2.67%	5.35	4.57	3.80	3.03	2.26	1.49	0.72
	0.00%	2.32	1.54	0.77	0.00	(0.77)	(1.54)	(2.32)
	-2.67%	(1.01)	(1.78)	(2.55)	(3.32)	(4.09)	(4.87)	(5.64)
	-5.33%	(4.62)	(5.39)	(6.16)	(6.93)	(7.71)	(8.48)	(9.25)
	-8.00%	(8.52)	(9.29)	(10.06)	(10.84)	(11.61)	(12.38)	(13.15)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503339048	신한투자(ELS)1447	13.15
총 최대손실 예상금액		13.15

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.12
-----	-------

메리츠한증지수연계증권제6호[ELS-파생형]

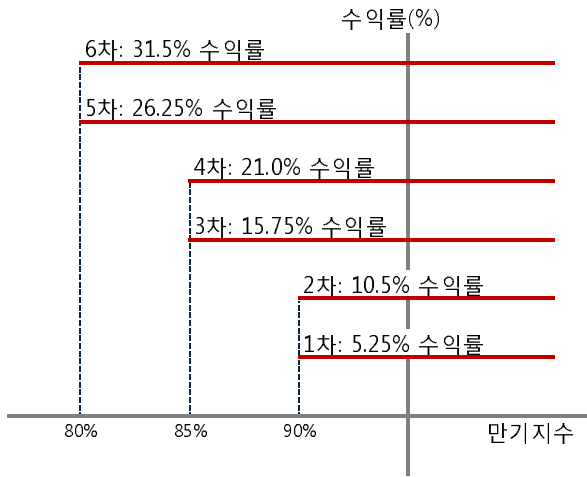
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

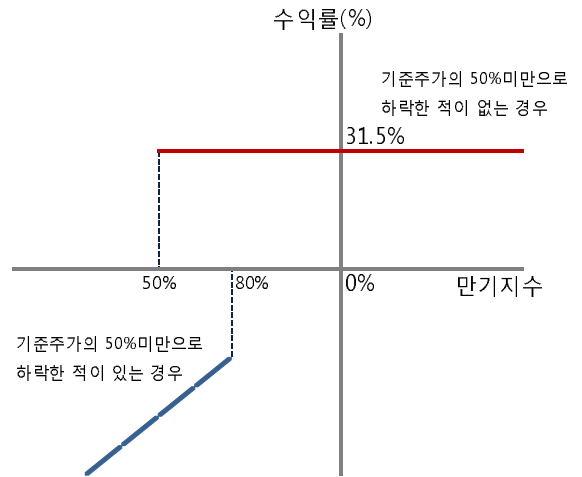
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장외

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%	12.03	8.69	5.36	2.02	(1.32)	(4.66)	(8.00)
	5.33%	12.90	9.56	6.22	2.89	(0.45)	(3.79)	(7.13)
	2.67%	12.23	8.89	5.55	2.21	(1.12)	(4.46)	(7.80)
	0.00%	10.02	6.68	3.34	0.00	(3.34)	(6.68)	(10.02)
	-2.67%	6.26	2.92	(0.42)	(3.76)	(7.09)	(10.43)	(13.77)
	-5.33%	0.96	(2.38)	(5.72)	(9.05)	(12.39)	(15.73)	(19.07)
	-8.00%	(5.88)	(9.22)	(12.56)	(15.89)	(19.23)	(22.57)	(25.91)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513135048	대신증권(ELS)1059	25.91
총 최대손실 예상금액		25.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 24.81

메리츠한증지수연계증권제7호[ELS-파생형]

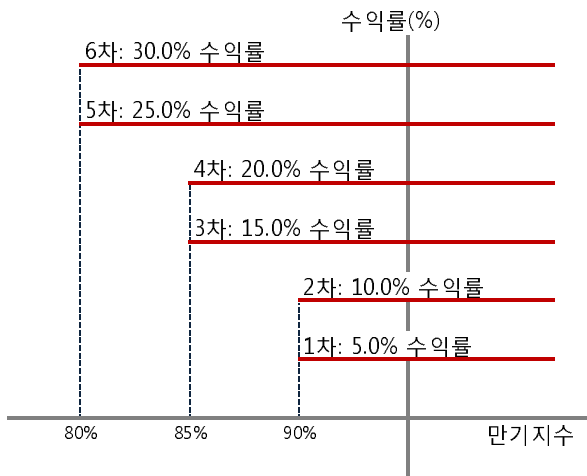
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

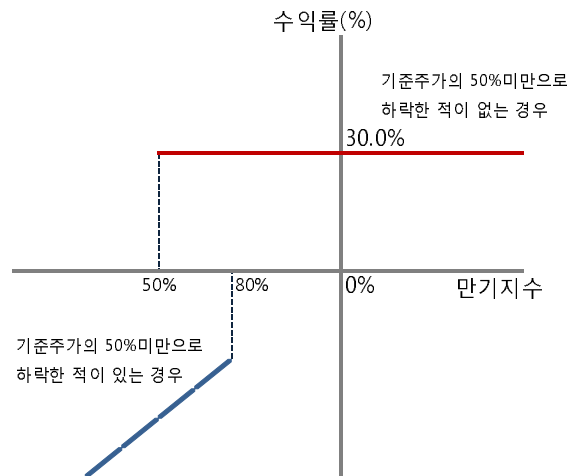
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,146	0	1,146	장외

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%	3.42	2.08	0.73	(0.62)	(1.97)	(3.32)	(4.67)
	5.33%	4.49	3.14	1.80	0.45	(0.90)	(2.25)	(3.60)
	2.67%	4.70	3.35	2.00	0.65	(0.69)	(2.04)	(3.39)
	0.00%	4.05	2.70	1.35	0.00	(1.35)	(2.70)	(4.05)
	-2.67%	2.53	1.18	(0.17)	(1.52)	(2.86)	(4.21)	(5.56)
	-5.33%	0.15	(1.20)	(2.54)	(3.89)	(5.24)	(6.59)	(7.94)
	-8.00%	(3.09)	(4.44)	(5.78)	(7.13)	(8.48)	(9.83)	(11.18)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6513118051	대신증권(ELS)1072	11.18
총 최대손실 예상금액		11.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.75
-----	-------

메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

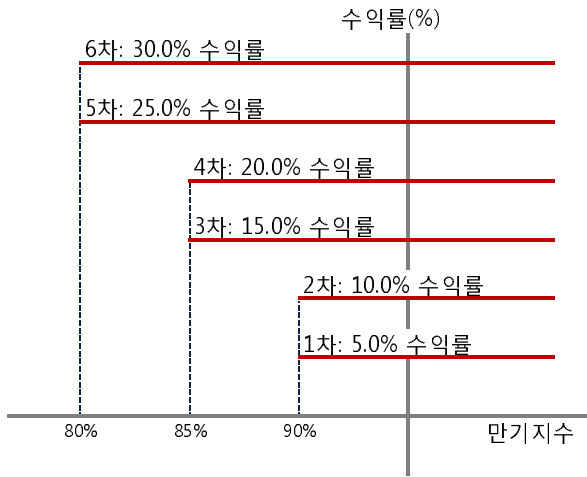
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

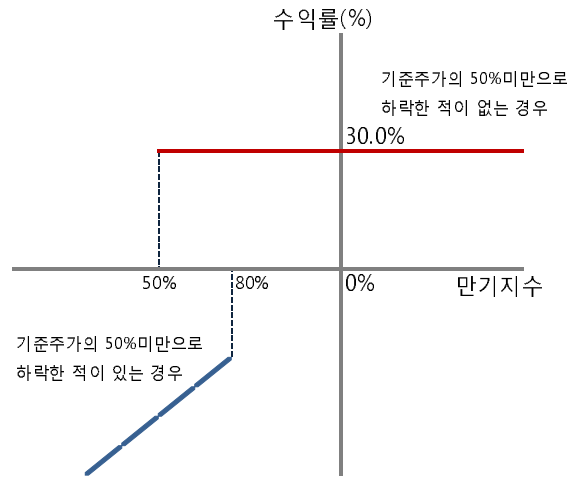
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,347	0	1,347	장외

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%	13.43	10.72	8.01	5.30	2.59	(0.12)	(2.83)
	5.33%	12.96	10.25	7.54	4.83	2.12	(0.59)	(3.30)
	2.67%	11.19	8.48	5.77	3.06	0.35	(2.36)	(5.07)
	0.00%	8.13	5.42	2.71	0.00	(2.71)	(5.42)	(8.13)
	-2.67%	3.77	1.06	(1.65)	(4.36)	(7.07)	(9.78)	(12.49)
	-5.33%	(1.89)	(4.60)	(7.31)	(10.02)	(12.73)	(15.44)	(18.15)
	-8.00%	(8.84)	(11.55)	(14.26)	(16.97)	(19.68)	(22.39)	(25.10)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6512123052	대신증권(ELS)1087	25.10
총 최대손실 예상금액		25.10

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 13.06

메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

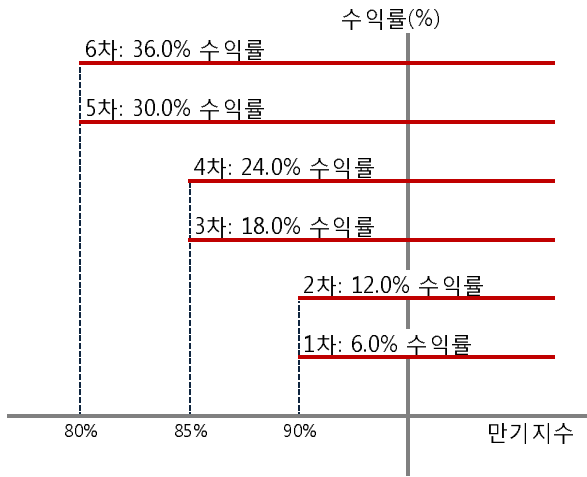
공시일: 2010-08-17

1. 계약금액

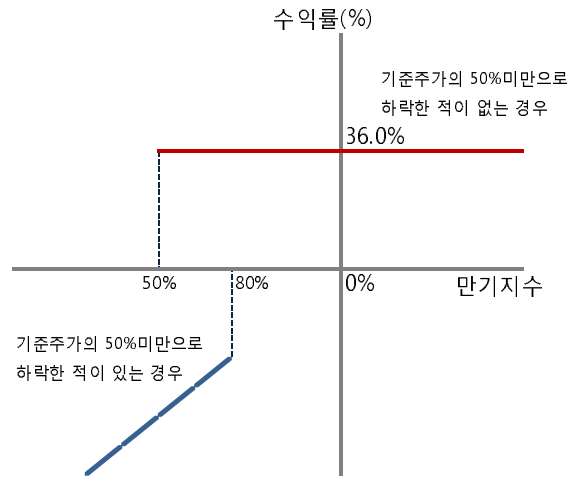
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장외

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%	1.16	0.85	0.53	0.21	(0.11)	(0.42)	(0.74)
	5.33%	1.18	0.86	0.54	0.22	(0.09)	(0.41)	(0.73)
	2.67%	1.10	0.79	0.47	0.15	(0.16)	(0.48)	(0.80)
	0.00%	0.95	0.63	0.32	0.00	(0.32)	(0.63)	(0.95)
	-2.67%	0.72	0.40	0.08	(0.24)	(0.55)	(0.87)	(1.19)
	-5.33%	0.40	0.08	(0.24)	(0.55)	(0.87)	(1.19)	(1.51)
	-8.00%	(0.00)	(0.32)	(0.64)	(0.95)	(1.27)	(1.59)	(1.91)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6509358059	신한투자(ELS)1506	1.91
총 최대손실 예상금액		1.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.86
-----	------

메리츠2Star증권HISD-1[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-17

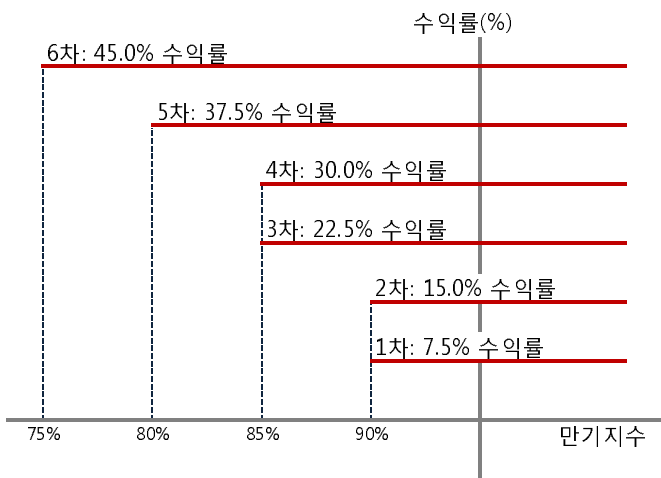
1. 계약금액

단위(백만원)

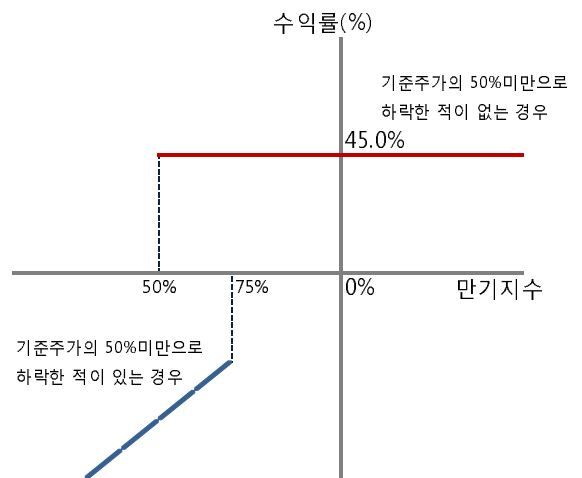
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	444	0	444	장외
누계	유가증권	선물	444	0	444	장외

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 시나리오	8.00%	16.52	13.28	10.05	6.82	3.59	0.36	(2.87)
	5.33%	14.71	11.47	8.24	5.01	1.78	(1.45)	(4.68)
	2.67%	12.43	9.20	5.97	2.74	(0.49)	(3.72)	(6.96)
	0.00%	9.69	6.46	3.23	0.00	(3.23)	(6.46)	(9.69)
	-2.67%	6.49	3.26	0.03	(3.20)	(6.43)	(9.66)	(12.90)
	-5.33%	2.83	(0.40)	(3.63)	(6.87)	(10.10)	(13.33)	(16.56)
	-8.00%	(1.30)	(4.53)	(7.76)	(10.99)	(14.23)	(17.46)	(20.69)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6519101069	대신증권(ELS)1101	20.69
총 최대손실 예상금액		20.69

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 21.53

메리츠한증지수연계증권제8호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-17

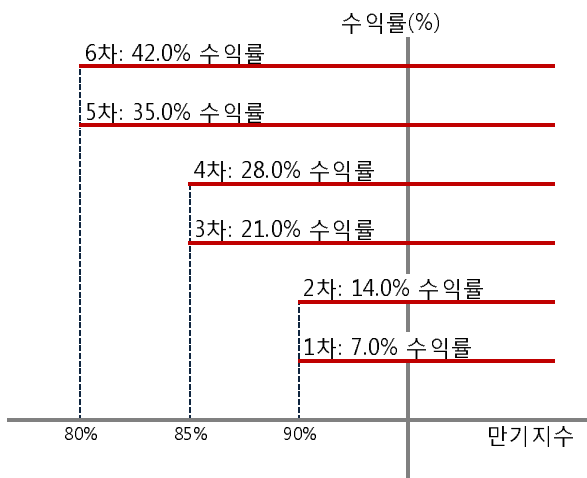
1. 계약금액

단위(백만원)

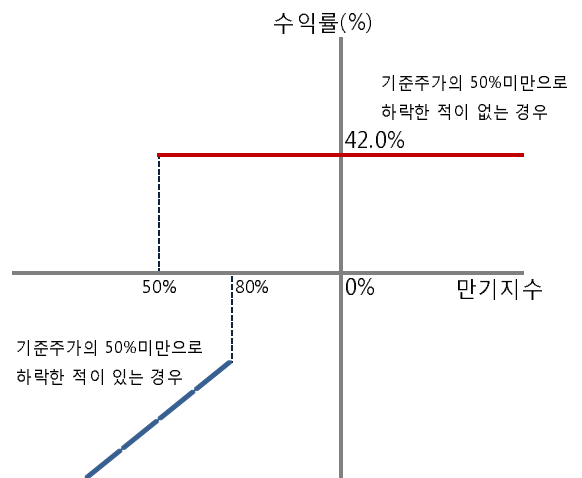
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장외

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%	10.84	7.79	4.73	1.67	(1.39)	(4.45)	(7.51)
	5.33%	11.11	8.05	5.00	1.94	(1.12)	(4.18)	(7.24)
	2.67%	10.56	7.50	4.44	1.38	(1.68)	(4.74)	(7.79)
	0.00%	9.18	6.12	3.06	0.00	(3.06)	(6.12)	(9.18)
	-2.67%	6.97	3.91	0.85	(2.20)	(5.26)	(8.32)	(11.38)
	-5.33%	3.94	0.88	(2.17)	(5.23)	(8.29)	(11.35)	(14.41)
	-8.00%	0.09	(2.97)	(6.03)	(9.09)	(12.14)	(15.20)	(18.26)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6513121063	대신증권(ELS)1120	18.26
총 최대손실 예상금액		18.26

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 14.12

메리츠주가지수연계증권제2호[ELS-파생형]

공시일: 2010-08-17

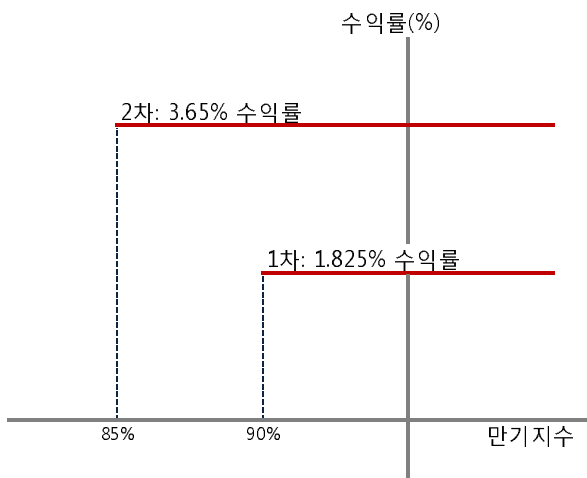
1. 계약금액

단위(백만원)

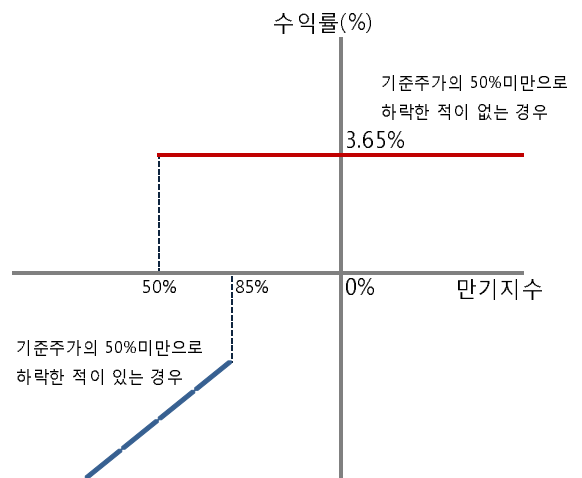
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장외

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	7.56	7.57	7.57	7.57	7.57	7.57	7.57	7.58
자산	3.29	3.29	3.30	3.30	3.30	3.30	3.30	3.31
시나리오	2.67%	0.77	0.77	0.77	0.78	0.78	0.78	0.78
	0.00%	(0.01)	(0.00)	(0.00)	0.00	0.00	0.00	0.01
	-2.67%	0.97	0.97	0.97	0.97	0.98	0.98	0.98
	-5.33%	3.69	3.69	3.69	3.69	3.70	3.70	3.70
	-8.00%	8.16	8.16	8.16	8.16	8.17	8.17	8.17

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553352065	우리투자증권(ELS)3254	0.01
총 최대손실 예상금액		0.01

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1.69