

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,281	0	5,281	장외
누계	유가증권	ELS	5,281	0	5,281	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	10.99	3.98	(3.03)	(10.04)	(17.05)	(24.06)	(31.08)	
자산	48.82	41.81	34.80	27.79	20.78	13.77	6.76	
시나리오	52.17	45.16	38.15	31.14	24.13	17.11	10.10	
	0.00%	21.03	14.02	7.01	0.00	(7.01)	(14.02)	(21.03)
	-2.67%	(44.59)	(51.60)	(58.61)	(65.62)	(72.63)	(79.64)	(86.66)
	-5.33%	(144.69)	(151.71)	(158.72)	(165.73)	(172.74)	(179.75)	(186.76)
	-8.00%	(279.28)	(286.30)	(293.31)	(300.32)	(307.33)	(314.34)	(321.35)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502348032	신한투자(ELS)1408	39.83
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	93.83
KR6661350035	동양(ELS)520	93.85
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	93.83
총 최대손실 예상금액		321.35

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	368.69
-----	--------

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,014	0	5,014	장외
누계	유가증권	ELS	5,014	0	5,014	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	258.45	244.47	230.48	216.49	202.51	188.52	174.53	
자산	181.34	167.35	153.37	139.38	125.39	111.40	97.42	
시나	109.18	95.19	81.20	67.21	53.23	39.24	25.25	
리오	41.96	27.97	13.99	0.00	(13.99)	(27.97)	(41.96)	
	(20.30)	(34.29)	(48.28)	(62.27)	(76.25)	(90.24)	(104.23)	
	(77.62)	(91.61)	(105.59)	(119.58)	(133.57)	(147.56)	(161.54)	
	(129.99)	(143.97)	(157.96)	(171.95)	(185.94)	(199.92)	(213.91)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293160A1	대우증권ELS4537	54.09
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	51.19
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	54.23
KR66693120A9	동양W(ELS)927	54.40
총 최대손실 예상금액		213.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 197.43

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

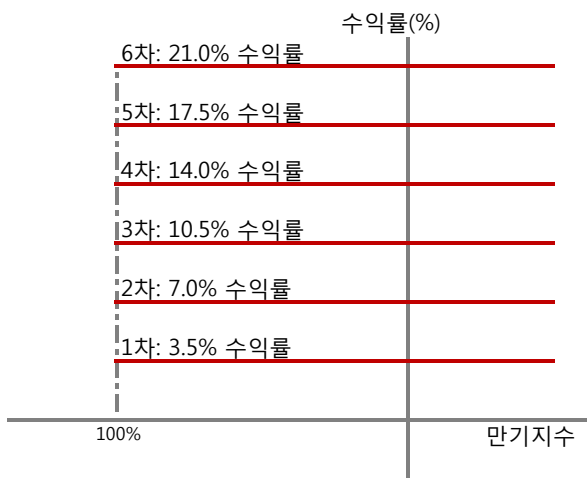
1. 계약금액

단위(백만원)

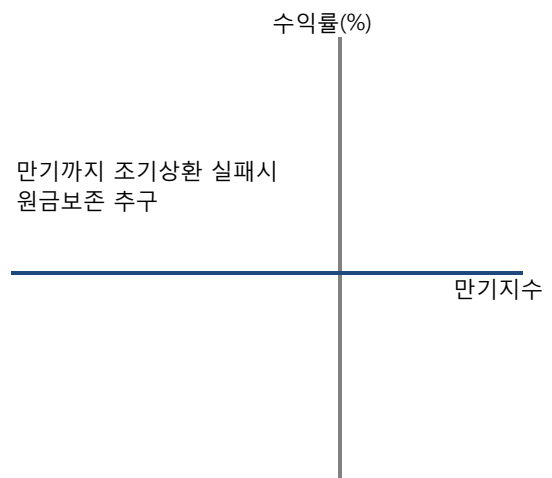
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외
누계	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외

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	85.29	79.07	72.84	66.61	60.39	54.16	47.94	
자산	62.05	55.82	49.59	43.37	37.14	30.92	24.69	
시나리오	39.84	33.62	27.39	21.16	14.94	8.71	2.49	
	18.68	12.45	6.23	0.00	(6.23)	(12.45)	(18.68)	
	(1.45)	(7.67)	(13.90)	(20.12)	(26.35)	(32.57)	(38.80)	
	(20.53)	(26.75)	(32.98)	(39.20)	(45.43)	(51.66)	(57.88)	
	(38.57)	(44.79)	(51.02)	(57.25)	(63.47)	(69.70)	(75.92)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	19.37
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	19.54
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	19.50
KR66623360C2	동양W(ELS)950	17.51
총 최대손실 예상금액		75.92

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 72.03

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

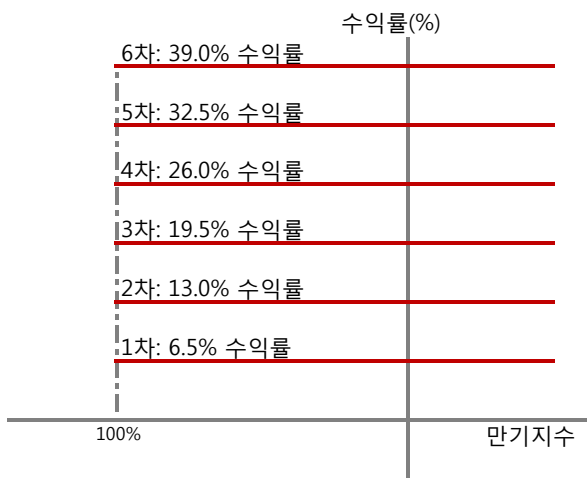
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,368	0	3,368	장외
누계	유가증권	ELS	3,368	0	3,368	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	188.32	174.13	159.95	145.77	131.58	117.40	103.22	
자산	137.63	123.45	109.27	95.08	80.90	66.72	52.53	
시나	89.04	74.86	60.68	46.49	32.31	18.13	3.94	
리오	42.55	28.37	14.18	0.00	(14.18)	(28.37)	(42.55)	
	(1.85)	(16.03)	(30.21)	(44.40)	(58.58)	(72.76)	(86.95)	
	(44.15)	(58.33)	(72.51)	(86.70)	(100.88)	(115.06)	(129.25)	
	(84.35)	(98.54)	(112.72)	(126.90)	(141.09)	(155.27)	(169.45)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	43.34
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	43.45
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	43.42
KR66623340C4	동양W(ELS)949	39.24
총 최대손실 예상금액		169.45

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 160.63

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

1. 계약금액

단위(백만원)

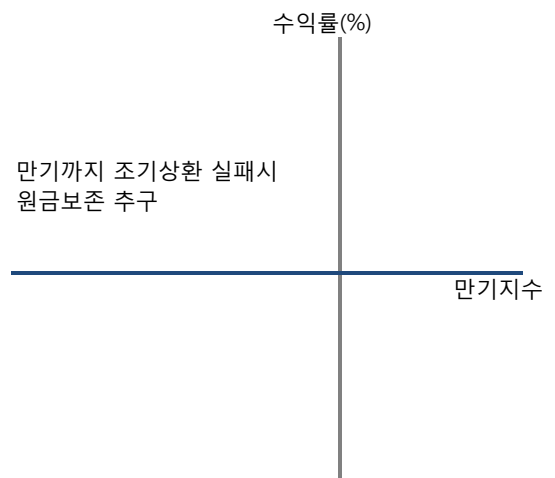
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,092	0	1,092	장외
누계	유가증권	ELS	1,092	0	1,092	장외

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	2.51	2.26	2.02	1.77	1.52	1.28	1.03	
자산	1.90	1.66	1.41	1.16	0.92	0.67	0.42	
시나	1.31	1.07	0.82	0.57	0.33	0.08	(0.17)	
리오	0.74	0.49	0.25	0.00	(0.25)	(0.49)	(0.74)	
	0.18	(0.06)	(0.31)	(0.56)	(0.80)	(1.05)	(1.30)	
	(0.35)	(0.60)	(0.85)	(1.10)	(1.34)	(1.59)	(1.84)	
	(0.88)	(1.12)	(1.37)	(1.62)	(1.86)	(2.11)	(2.36)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.65
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.65
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.40
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.65
총 최대손실 예상금액		2.36

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.51
-----	------

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

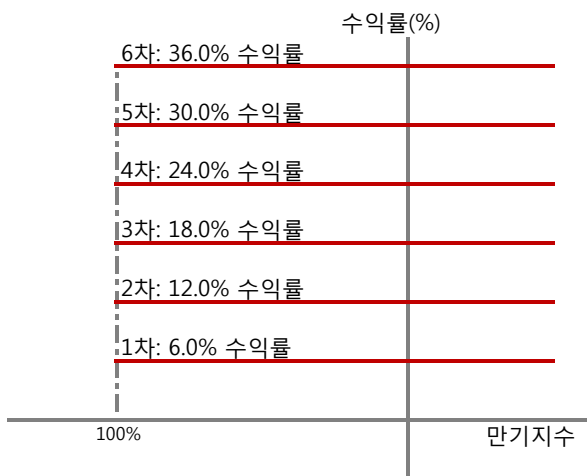
1. 계약금액

단위(백만원)

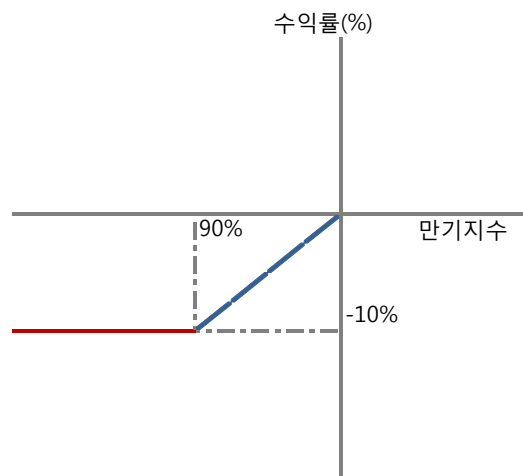
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	711	0	711	장외
누계	유가증권	ELS	711	0	711	장외

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	10.32	9.49	8.65	7.81	6.97	6.13	5.29	
자산	7.55	6.71	5.87	5.03	4.19	3.35	2.51	
시나리오	4.94	4.11	3.27	2.43	1.59	0.75	(0.09)	
	0.00%	2.52	1.68	0.84	0.00	(0.84)	(1.68)	(2.52)
	-2.67%	0.27	(0.57)	(1.41)	(2.25)	(3.09)	(3.93)	(4.77)
	-5.33%	(1.81)	(2.65)	(3.49)	(4.33)	(5.17)	(6.01)	(6.85)
	-8.00%	(3.71)	(4.55)	(5.39)	(6.23)	(7.07)	(7.91)	(8.75)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502331129	신한투자(ELS)2235	2.28
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	1.91
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	2.28
KR6662317124	동양W(ELS)975	2.28
총 최대손실 예상금액		8.75

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	11.60
-----	-------

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

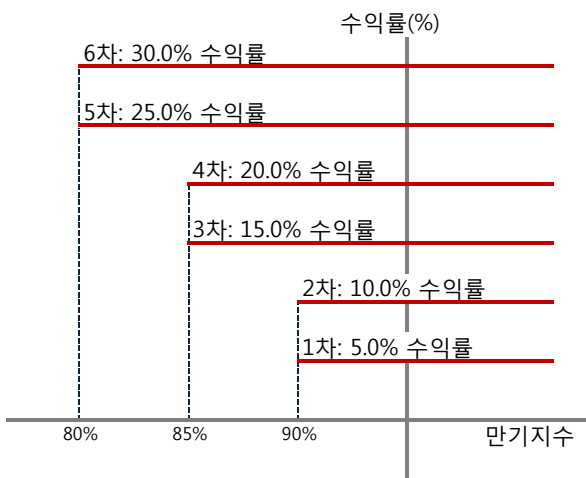
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,474	0	8,474	장외
누계	유가증권	ELS	8,474	0	8,474	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	359.40	325.78	292.16	258.54	224.92	191.29	157.67	
자산	301.49	267.87	234.25	200.63	167.01	133.38	99.76	
시나	215.31	181.69	148.07	114.45	80.83	47.21	13.58	
리오	100.86	67.24	33.62	0.00	(33.62)	(67.24)	(100.86)	
	(41.85)	(75.47)	(109.10)	(142.72)	(176.34)	(209.96)	(243.58)	
	(212.84)	(246.46)	(280.08)	(313.70)	(347.33)	(380.95)	(414.57)	
	(412.10)	(445.72)	(479.34)	(512.96)	(546.58)	(580.20)	(613.83)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	163.36
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	164.34
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	154.80
KR6662374141	동양W(ELS)1004	131.32
총 최대손실 예상금액		613.83

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 658.46

메리츠주가지수연계증권제12호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

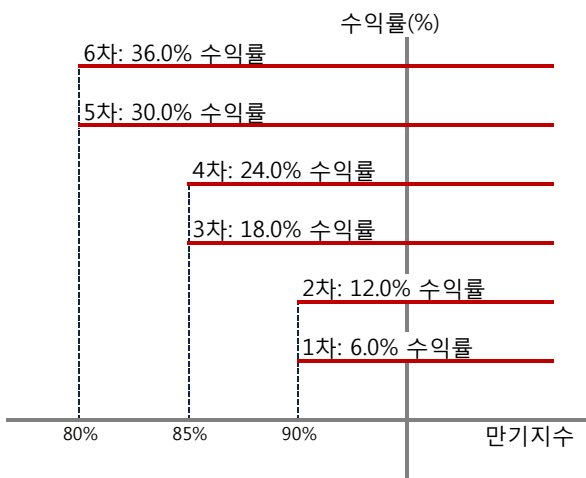
1. 계약금액

단위(백만원)

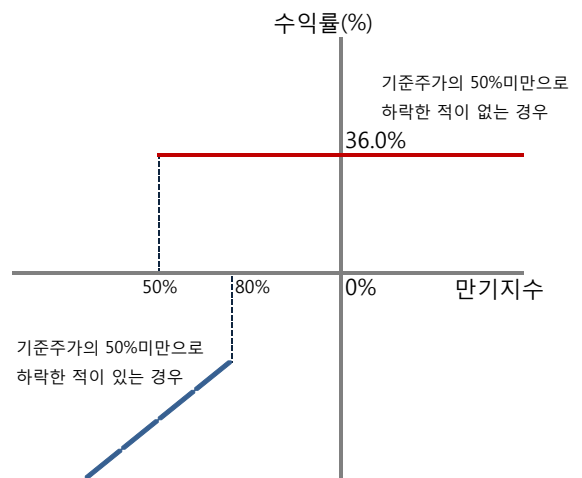
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외
누계	유가증권	ELS	20,000	0	20,000	장외

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	8.00%	8.00%	8.00%	8.00%	8.00%	8.00%	8.00%	8.00%
자산	(251.85)	(251.85)	(251.85)	(251.85)	(251.85)	(251.85)	(251.85)	(251.85)
사	(149.25)	(149.25)	(149.25)	(149.25)	(149.25)	(149.25)	(149.25)	(149.25)
나	(65.30)	(65.30)	(65.30)	(65.30)	(65.30)	(65.30)	(65.30)	(65.30)
리	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
오	46.64	46.64	46.64	46.64	46.64	46.64	46.64	46.64
리	74.62	74.62	74.62	74.62	74.62	74.62	74.62	74.62
오	83.95	83.95	83.95	83.95	83.95	83.95	83.95	83.95

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6553331150	우리투자증권(ELS)4448	67.03
KR6573333152	한국투자증권(ELS)2106	67.62
KR6663329151	동양W(ELS)1018	55.87
KR6673309151	해피플러스(ELS)529	61.33
총 최대손실 예상금액		251.85

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

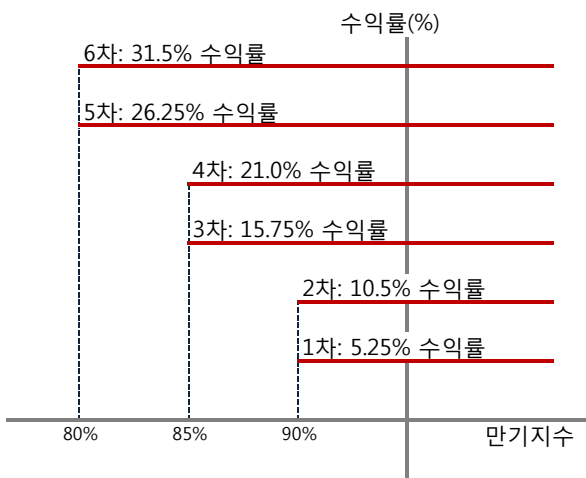
1. 계약금액

단위(백만원)

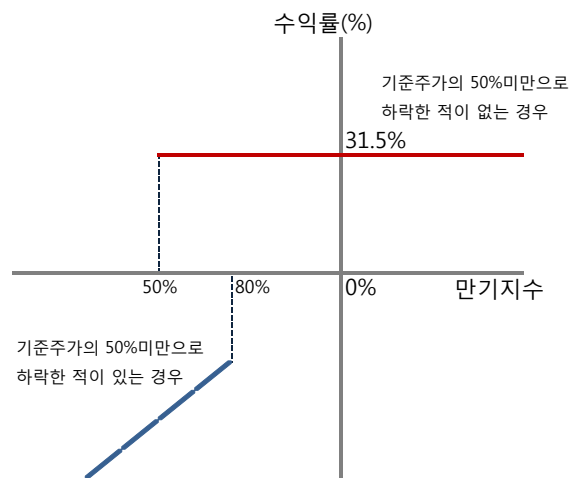
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,921	0	4,921	장외
누계	유가증권	ELS	4,921	0	4,921	장외

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	313.69	280.66	247.62	214.59	181.55	148.52	115.48	
자산	256.98	223.94	190.91	157.87	124.83	91.80	58.76	
시나리오	2.67%	185.45	152.41	119.38	86.34	53.31	(12.76)	
	0.00%	99.11	66.07	33.04	0.00	(33.04)	(66.07)	
	-2.67%	(2.05)	(35.08)	(68.12)	(101.15)	(134.19)	(167.22)	
	-5.33%	(118.01)	(151.05)	(184.08)	(217.12)	(250.15)	(283.19)	
	-8.00%	(248.79)	(281.82)	(314.86)	(347.89)	(380.93)	(413.96)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	111.83
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	111.83
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	112.17
KR6663346155	동양W(ELS)1009	111.17
총 최대손실 예상금액		447.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

425.62

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

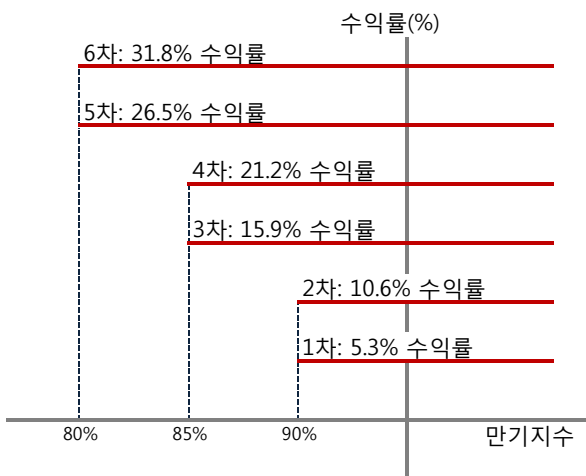
1. 계약금액

단위(백만원)

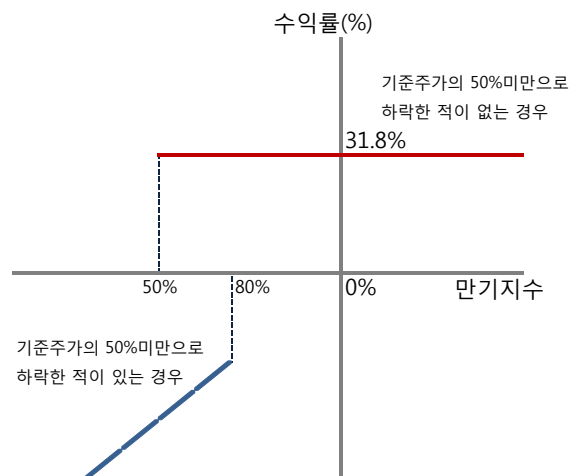
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,949	0	6,949	장외
누계	유가증권	ELS	6,949	0	6,949	장외

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	488.05	439.70	391.36	343.01	294.67	246.32	197.98	
자산	393.61	345.26	296.92	248.57	200.22	151.88	103.53	
시나	279.27	230.92	182.58	134.23	85.89	37.54	(10.80)	
리오	0.00%	96.69	48.35	0.00	(48.35)	(96.69)	(145.04)	
	-2.67%	(9.09)	(57.44)	(105.78)	(154.13)	(202.47)	(299.16)	
	-5.33%	(183.11)	(231.45)	(279.80)	(328.14)	(376.49)	(473.18)	
	-8.00%	(377.02)	(425.37)	(473.71)	(522.06)	(570.40)	(667.09)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	157.60
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	169.64
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	170.29
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	169.57
총 최대손실 예상금액		667.09

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	677.66
-----	--------

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

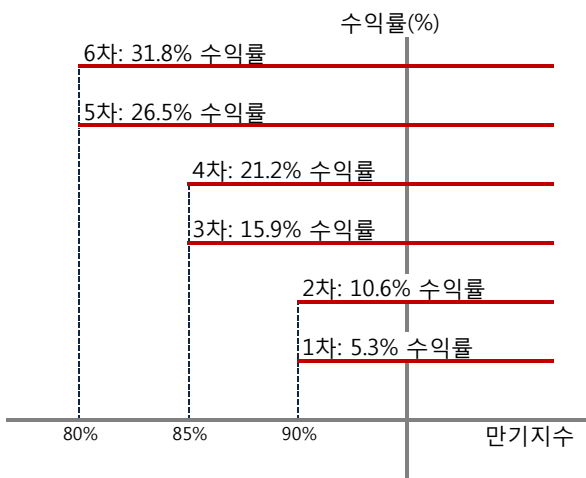
1. 계약금액

단위(백만원)

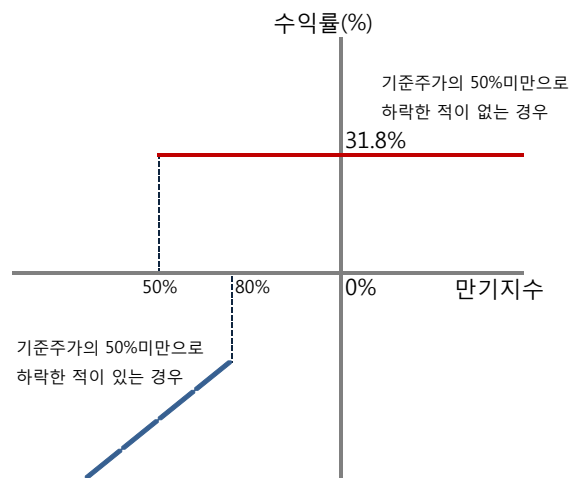
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,441	0	5,441	장외
누계	유가증권	ELS	5,441	0	5,441	장외

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	354.96	316.89	278.82	240.74	202.67	164.60	126.52	
자산	290.49	252.42	214.35	176.28	138.20	100.13	62.06	
시나리오	210.25	172.17	134.10	96.03	57.96	19.88	(18.19)	
	114.22	76.15	38.07	0.00	(38.07)	(76.15)	(114.22)	
	2.41	(35.66)	(73.74)	(111.81)	(149.88)	(187.95)	(226.03)	
	(125.18)	(163.25)	(201.33)	(239.40)	(277.47)	(315.54)	(353.62)	
	(268.55)	(306.62)	(344.70)	(382.77)	(420.84)	(458.91)	(496.99)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	124.94
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	121.21
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	125.16
KR6663324160	동양W(ELS)1028	125.68
총 최대손실 예상금액		496.99

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 480.33

메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

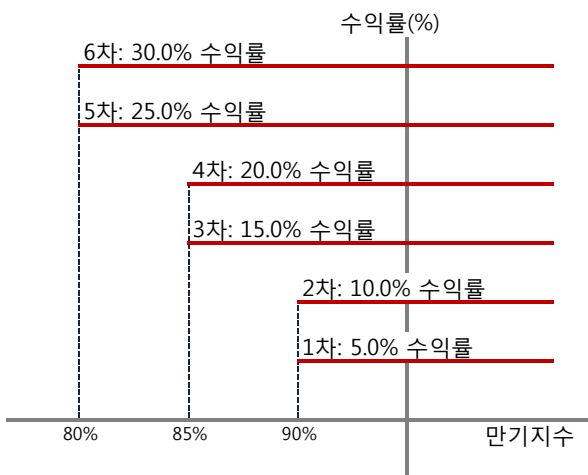
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,899	0	5,899	장외
누계	유가증권	ELS	5,899	0	5,899	장외

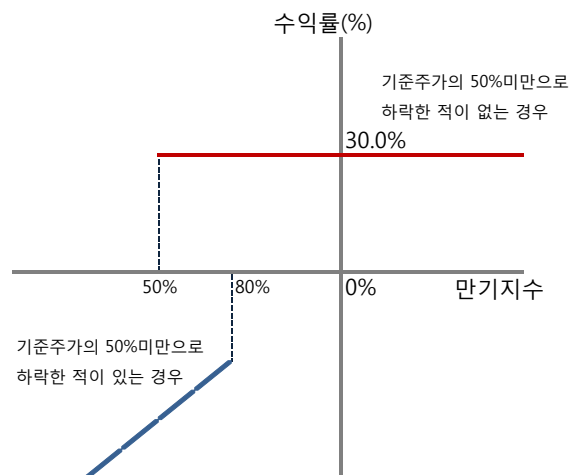
단위(백만원)

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%	411.28	367.16	323.03	278.91	234.78	190.65	146.53
자산	5.33%	334.23	290.11	245.98	201.86	157.73	113.60	69.48
시나리오	2.67%	241.26	197.14	153.01	108.89	64.76	20.63	(23.49)
	0.00%	132.38	88.25	44.13	0.00	(44.13)	(88.25)	(132.38)
	-2.67%	7.57	(36.55)	(80.68)	(124.80)	(168.93)	(213.06)	(257.18)
	-5.33%	(133.15)	(177.28)	(221.40)	(265.53)	(309.65)	(353.78)	(397.91)
	-8.00%	(289.79)	(333.92)	(378.04)	(422.17)	(466.29)	(510.42)	(554.55)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503322176	신한투자(ELS)2982	138.77
KR6543311171	신영증권(ELS)2189	138.91
KR6553334170	우리투자증권(ELS)4750	137.54
KR6663322172	동양W(ELS)1040	139.33
총 최대손실 예상금액		554.55

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 528.72

메리츠한증지수연계증권제27호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

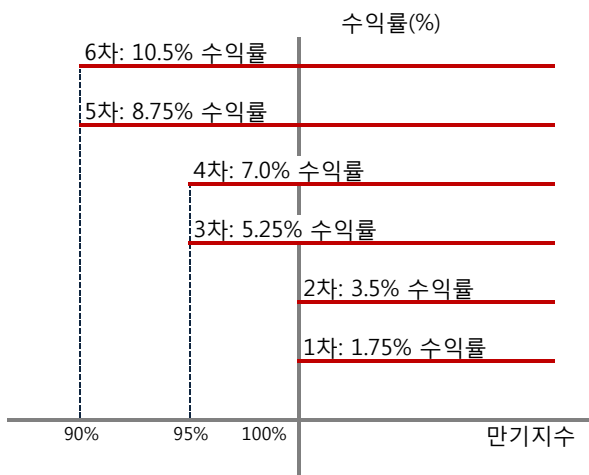
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

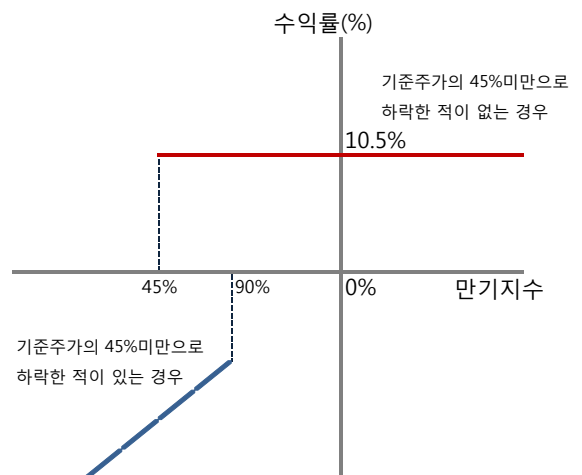
단위(백만원)

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%	(614.91)	(611.27)	(607.64)	(604.00)	(600.37)	(596.73)	(593.09)
	5.33%	(390.00)	(386.36)	(382.73)	(379.09)	(375.46)	(371.82)	(368.18)
	2.67%	(188.66)	(185.03)	(181.39)	(177.76)	(174.12)	(170.49)	(166.85)
	0.00%	(10.91)	(7.27)	(3.64)	0.00	3.64	7.27	10.91
	-2.67%	143.27	146.91	150.55	154.18	157.82	161.45	165.09
	-5.33%	273.88	277.51	281.15	284.79	288.42	292.06	295.69
	-8.00%	380.91	384.54	388.18	391.81	395.45	399.09	402.72

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	단위(백만원)
KR65033AL250	신한투자(ELS)4533	151.74
KR65233AT259	대우증권(ELS)7497	157.80
KR65533BV256	우리투자증권(ELS)6128	156.87
KR6703394256	H&D증권(ELS)2764	148.50
총 최대손실 예상금액		614.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 564.01

메리츠한증지수연계증권제28호[ELS-파생형]

공시일: 2012-08-02

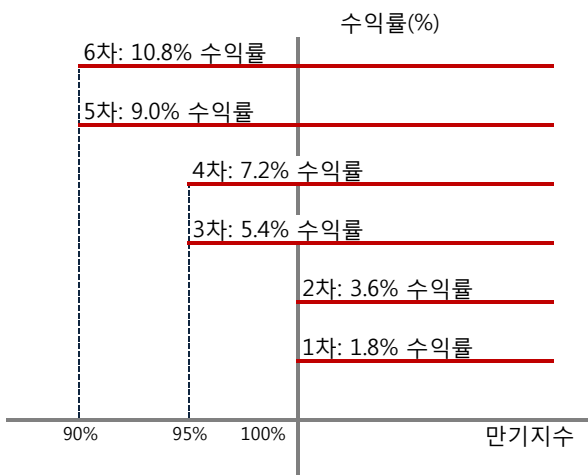
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,001	0	30,001	장외
누계	유가증권	ELS	30,001	0	30,001	장외

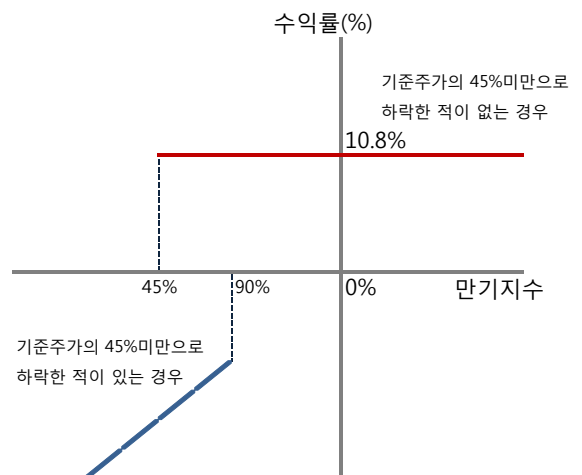
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	134.24	135.17	136.10	137.03	137.96	138.89	139.82
	5.33%	43.78	44.71	45.64	46.57	47.50	48.43	49.36
	2.67%	(1.90)	(0.97)	(0.04)	0.89	1.82	2.75	3.68
	0.00%	(2.79)	(1.86)	(0.93)	0.00	0.93	1.86	2.79
	-2.67%	41.10	42.03	42.96	43.89	44.82	45.75	46.68
	-5.33%	129.78	130.71	131.64	132.57	133.50	134.43	135.36
	-8.00%	263.24	264.17	265.10	266.03	266.96	267.89	268.82

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	최대손실 예상금액
KR65033D3251	신한투자(ELS)4637	0.69
KR65233D7250	대우증권(ELS)7731	0.72
KR65533CD252	우리투자증권(ELS)6116	0.71
KR67033B6252	H&D증권(ELS)2735	0.67
총 최대손실 예상금액		2.79

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 213.40