

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

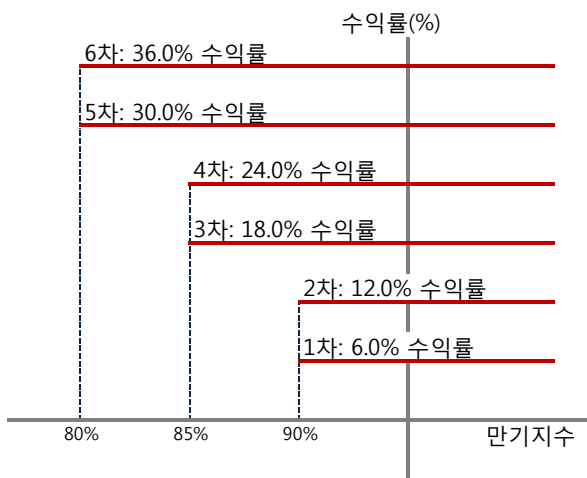
1. 계약금액

단위(백만원)

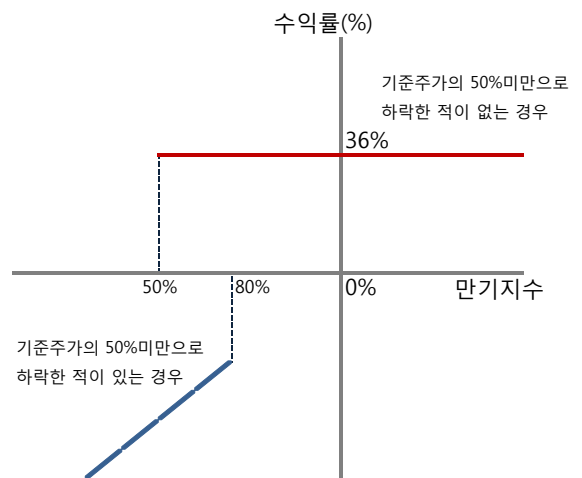
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,998	0	4,998	장외
누계	유가증권	ELS	4,998	0	4,998	장외

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	8.57	6.02	3.48	0.94	(1.61)	(4.15)	(6.69)	
자산	23.34	20.80	18.25	15.71	13.17	10.62	8.08	
시나	23.03	20.49	17.94	15.40	12.86	10.31	7.77	
리오	7.63	5.09	2.54	0.00	(2.54)	(5.09)	(7.63)	
	(22.86)	(25.40)	(27.94)	(30.49)	(33.03)	(35.57)	(38.12)	
	(68.43)	(70.97)	(73.52)	(76.06)	(78.60)	(81.15)	(83.69)	
	(129.09)	(131.63)	(134.17)	(136.72)	(139.26)	(141.80)	(144.35)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502348032	신한투자(ELS)1408	15.06
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	43.18
KR6661350035	동양(ELS)520	43.05
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	43.06
총 최대손실 예상금액		144.35

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 138.15

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

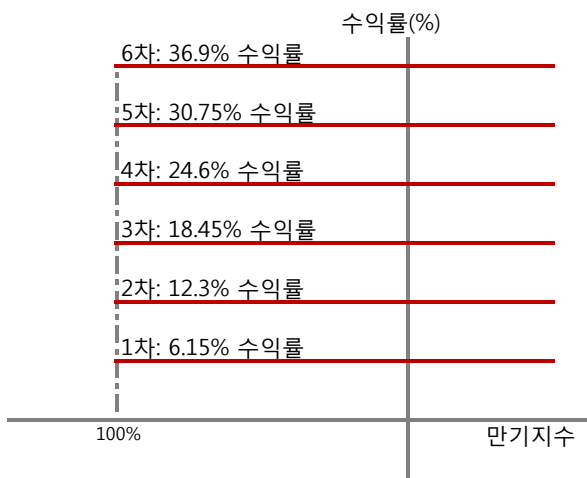
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,951	0	4,951	장외
누계	유가증권	ELS	4,951	0	4,951	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	357.42	350.80	344.18	337.56	330.94	324.32	317.70	
자산	234.54	227.92	221.30	214.68	208.06	201.44	194.82	
시나	122.02	115.40	108.78	102.16	95.54	88.92	82.30	
리오	0.00%	13.24	6.62	0.00	(6.62)	(13.24)	(19.86)	
	-2.67%	(78.57)	(85.18)	(91.80)	(98.42)	(105.04)	(111.66)	
	-5.33%	(160.01)	(166.63)	(173.25)	(179.87)	(186.49)	(193.11)	
	-8.00%	(231.10)	(237.72)	(244.34)	(250.96)	(257.58)	(264.20)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293160A1	대우증권ELS4537	67.76
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	60.76
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	67.79
KR66693120A9	동양W(ELS)927	67.88
총 최대손실 예상금액		264.20

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	283.62
-----	--------

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

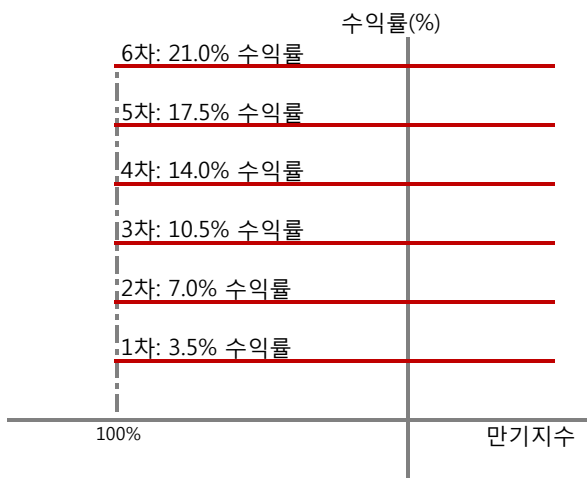
1. 계약금액

단위(백만원)

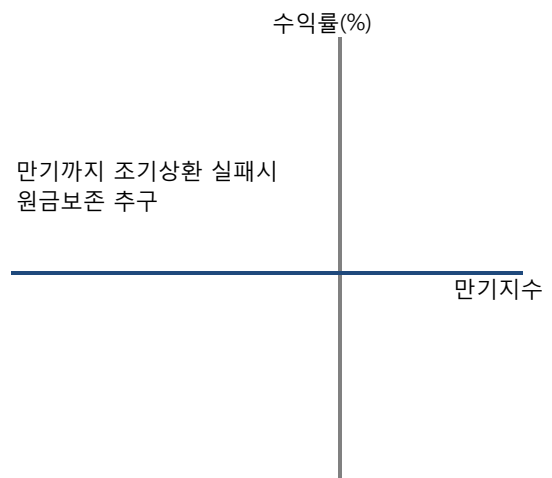
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외
누계	유가증권	ELS	3,424	0	3,424	장외

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	129.79	126.63	123.48	120.32	117.17	114.01	110.86	
자산	86.23	83.08	79.92	76.77	73.61	70.46	67.31	
시나리오	46.12	42.97	39.82	36.66	33.51	30.35	27.20	
	9.46	6.31	3.15	0.00	(3.15)	(6.31)	(9.46)	
	(23.75)	(26.91)	(30.06)	(33.21)	(36.37)	(39.52)	(42.68)	
	(53.52)	(56.67)	(59.83)	(62.98)	(66.14)	(69.29)	(72.45)	
	(79.84)	(82.99)	(86.15)	(89.30)	(92.46)	(95.61)	(98.77)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	25.30
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	25.38
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	25.39
KR66623360C2	동양W(ELS)950	22.70
총 최대손실 예상금액		98.77

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 105.87

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

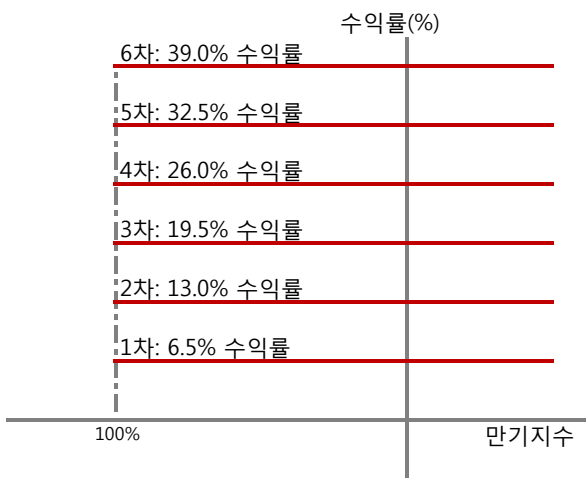
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,290	0	3,290	장외
누계	유가증권	ELS	3,290	0	3,290	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	285.52	278.29	271.05	263.81	256.58	249.34	242.10	
자산	190.50	183.26	176.02	168.79	161.55	154.31	147.08	
시나	102.56	95.32	88.09	80.85	73.61	66.38	59.14	
리오	0.00%	21.71	14.47	7.24	0.00	(7.24)	(14.47)	(21.71)
	-2.67%	(52.05)	(59.29)	(66.52)	(73.76)	(81.00)	(88.23)	(95.47)
	-5.33%	(118.72)	(125.96)	(133.19)	(140.43)	(147.67)	(154.90)	(162.14)
	-8.00%	(178.30)	(185.54)	(192.78)	(200.01)	(207.25)	(214.49)	(221.72)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	58.18
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	58.18
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	58.18
KR66623340C4	동양W(ELS)949	47.18
총 최대손실 예상금액		221.72

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 239.96

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

1. 계약금액

단위(백만원)

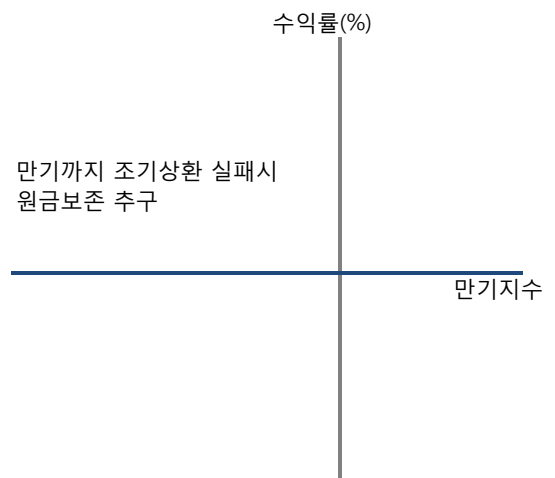
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외

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	3.25	3.13	3.00	2.88	2.75	2.62	2.50	
자산	2.18	2.05	1.92	1.80	1.67	1.55	1.42	
시나리오	1.22	1.09	0.97	0.84	0.71	0.59	0.46	
	0.38	0.25	0.13	0.00	(0.13)	(0.25)	(0.38)	
	(0.34)	(0.47)	(0.59)	(0.72)	(0.85)	(0.97)	(1.10)	
	(0.94)	(1.07)	(1.20)	(1.32)	(1.45)	(1.57)	(1.70)	
	(1.43)	(1.55)	(1.68)	(1.80)	(1.93)	(2.06)	(2.18)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.61
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.61
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.36
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.61
총 최대손실 예상금액		2.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

2.78

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

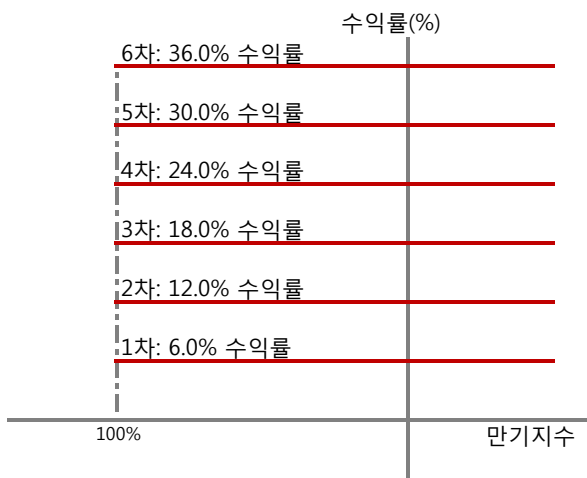
1. 계약금액

단위(백만원)

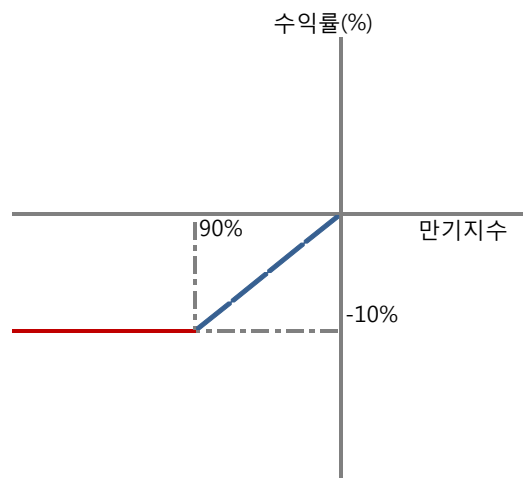
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	706	0	706	장외
누계	유가증권	ELS	706	0	706	장외

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%	5.59	5.37	5.14	4.92	4.69	4.47	4.24
	5.33%	3.77	3.54	3.32	3.09	2.87	2.65	2.42
	2.67%	2.13	1.90	1.68	1.46	1.23	1.01	0.78
	0.00%	0.67	0.45	0.22	0.00	(0.22)	(0.45)	(0.67)
	-2.67%	(0.60)	(0.82)	(1.05)	(1.27)	(1.50)	(1.72)	(1.94)
	-5.33%	(1.69)	(1.91)	(2.13)	(2.36)	(2.58)	(2.81)	(3.03)
	-8.00%	(2.59)	(2.81)	(3.04)	(3.26)	(3.49)	(3.71)	(3.94)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR6502331129	신한투자(ELS)2235	1.03
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	0.84
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	1.03
KR6662317124	동양W(ELS)975	1.03
총 최대손실 예상금액		3.94

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.29
-----	------

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

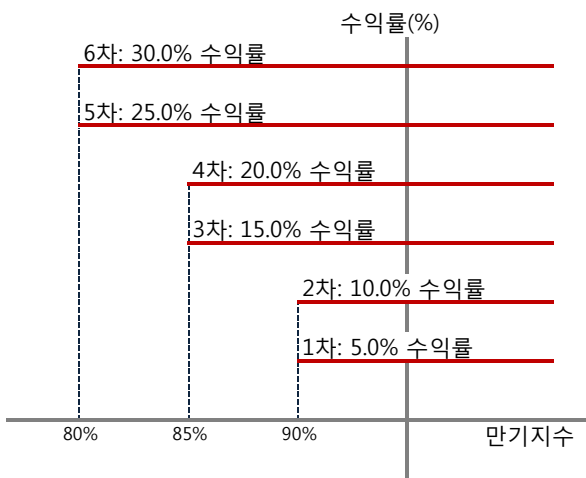
1. 계약금액

단위(백만원)

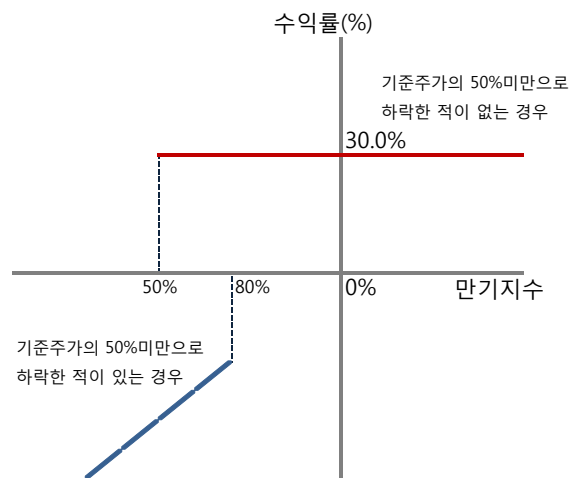
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,218	0	8,218	장외
누계	유가증권	ELS	8,218	0	8,218	장외

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%	763.82	726.18	688.53	650.89	613.25	575.60	537.96
자산	5.33%	583.85	546.20	508.56	470.92	433.27	395.63	357.99
시나	2.67%	366.88	329.24	291.60	253.95	216.31	178.67	141.02
리오	0.00%	112.93	75.29	37.64	0.00	(37.64)	(75.29)	(112.93)
	-2.67%	(178.01)	(215.66)	(253.30)	(290.94)	(328.59)	(366.23)	(403.87)
	-5.33%	(505.95)	(543.59)	(581.23)	(618.88)	(656.52)	(694.16)	(731.81)
	-8.00%	(870.87)	(908.51)	(946.16)	(983.80)	(1021.44)	(1059.09)	(1096.73)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	298.05
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	297.46
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	245.00
KR6662374141	동양W(ELS)1004	256.22
총 최대손실 예상금액		1096.73

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 1,176.54

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

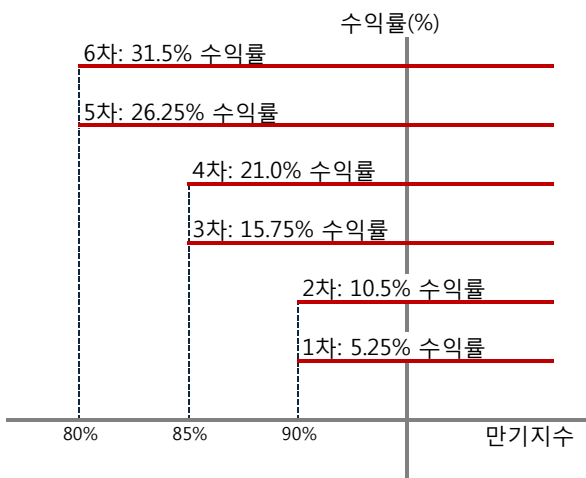
1. 계약금액

단위(백만원)

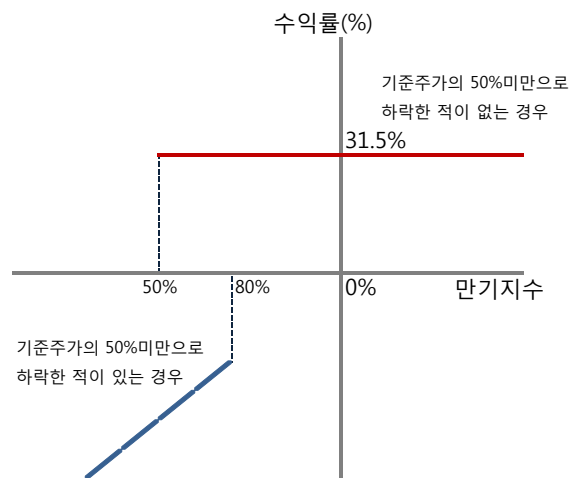
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,801	0	4,801	장외
누계	유가증권	ELS	4,801	0	4,801	장외

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	163.98	145.60	127.23	108.86	90.48	72.11	53.74	
자산	138.94	120.56	102.19	83.82	65.44	47.07	28.70	
시나리오	102.65	84.28	65.90	47.53	29.16	10.78	(7.59)	
	55.12	36.75	18.37	0.00	(18.37)	(36.75)	(55.12)	
	(3.66)	(22.03)	(40.40)	(58.78)	(77.15)	(95.52)	(113.89)	
	(73.68)	(92.05)	(110.42)	(128.80)	(147.17)	(165.54)	(183.92)	
	(154.94)	(173.32)	(191.69)	(210.06)	(228.43)	(246.81)	(265.18)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	67.92
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	67.97
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	68.18
KR6663346155	동양W(ELS)1009	61.11
총 최대손실 예상금액		265.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

242.82

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

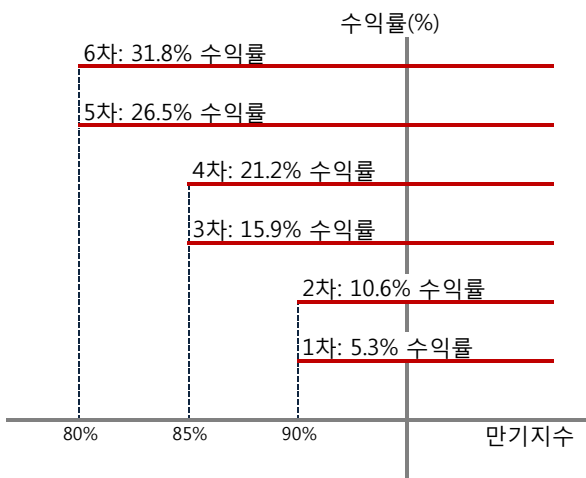
1. 계약금액

단위(백만원)

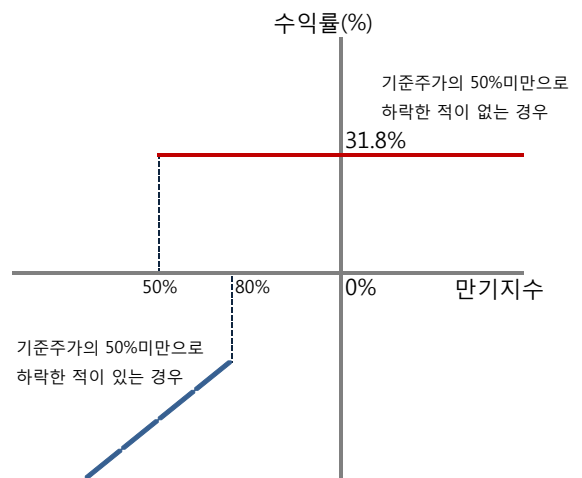
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,937	0	6,937	장외
누계	유가증권	ELS	6,937	0	6,937	장외

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	265.30	234.39	203.49	172.58	141.68	110.77	79.87	
자산	225.54	194.63	163.73	132.82	101.92	71.02	40.11	
시나리오	168.01	137.11	106.20	75.30	44.39	13.49	(17.42)	
	92.71	61.81	30.90	0.00	(30.90)	(61.81)	(92.71)	
	(0.35)	(31.26)	(62.16)	(93.07)	(123.97)	(154.88)	(185.78)	
	(111.19)	(142.09)	(173.00)	(203.90)	(234.80)	(265.71)	(296.61)	
	(239.79)	(270.69)	(301.60)	(332.50)	(363.41)	(394.31)	(425.22)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	99.78
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	108.26
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	108.97
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	108.22
총 최대손실 예상금액		425.22

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 404.09

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

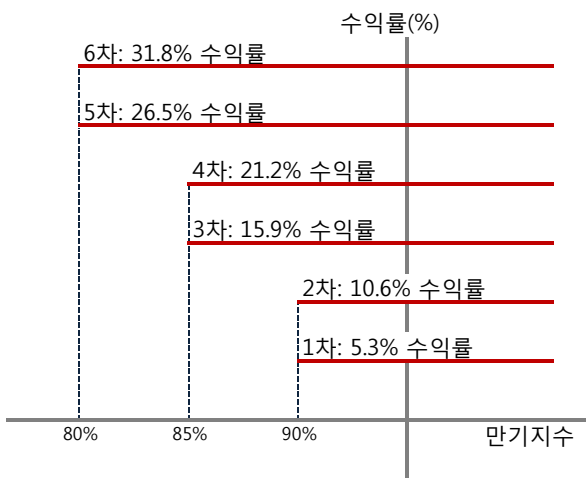
1. 계약금액

단위(백만원)

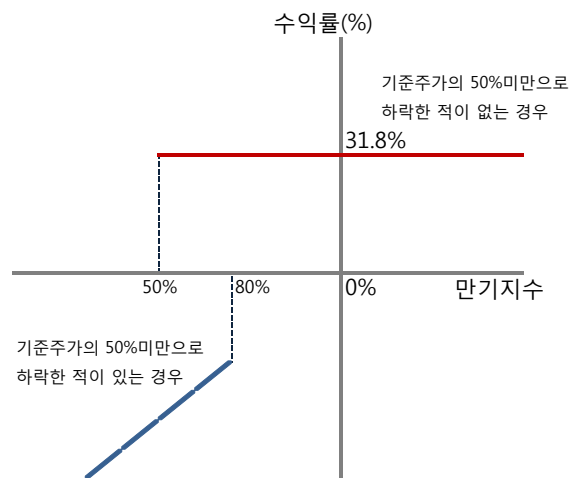
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,381	0	5,381	장외
누계	유가증권	ELS	5,381	0	5,381	장외

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	240.53	221.52	202.51	183.49	164.48	145.47	126.46	
자산	189.87	170.86	151.85	132.84	113.83	94.82	75.81	
시나리오	128.71	109.69	90.68	71.67	52.66	33.65	14.64	
	57.03	38.02	19.01	0.00	(19.01)	(38.02)	(57.03)	
	(25.15)	(44.16)	(63.17)	(82.18)	(101.19)	(120.20)	(139.21)	
	(117.84)	(136.85)	(155.86)	(174.87)	(193.88)	(212.89)	(231.90)	
	(221.04)	(240.05)	(259.06)	(278.07)	(297.08)	(316.09)	(335.10)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	84.15
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	76.86
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	84.72
KR6663324160	동양W(ELS)1028	89.37
총 최대손실 예상금액		335.10

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

432.12

메리츠한증지수연계증권제24호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

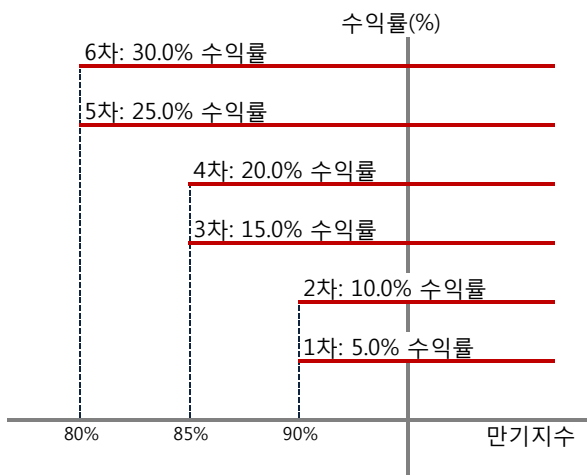
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,892	0	5,892	장외
누계	유가증권	ELS	5,892	0	5,892	장외

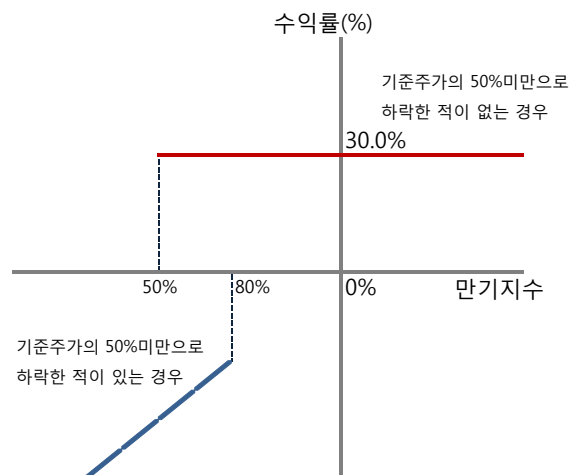
단위(백만원)

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	201.33	177.93	154.52	131.12	107.72	84.32	60.92	
시나리오	175.98	152.58	129.18	105.77	82.37	58.97	35.57	
	132.27	108.87	85.47	62.07	38.66	15.26	(8.14)	
	70.21	46.80	23.40	0.00	(23.40)	(46.80)	(70.21)	
	(10.22)	(33.62)	(57.02)	(80.42)	(103.83)	(127.23)	(150.63)	
	(109.00)	(132.40)	(155.80)	(179.20)	(202.61)	(226.01)	(249.41)	
	(226.14)	(249.54)	(272.94)	(296.34)	(319.75)	(343.15)	(366.55)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503322176	신한투자(ELS)2982	91.23
KR6543311171	신영증권(ELS)2189	91.68
KR6553334170	우리투자증권(ELS)4750	89.27
KR6663322172	동양W(ELS)1040	94.37
총 최대손실 예상금액		366.55

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 350.28

메리츠주가지수연계증권제27호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

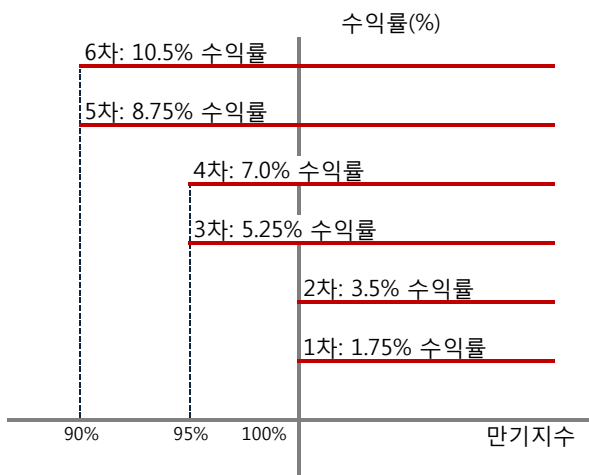
1. 계약금액

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

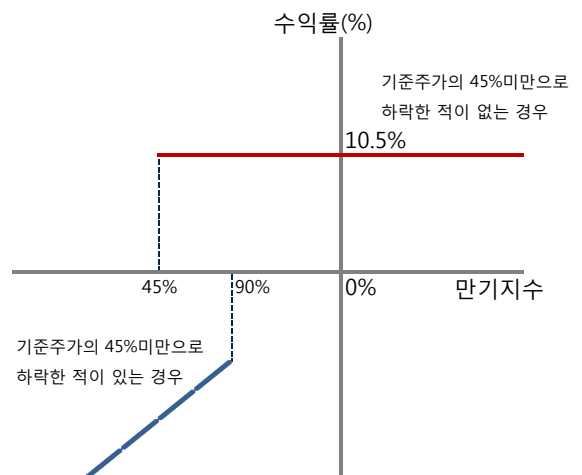
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	8.00%	(123.54)	(121.26)	(118.98)	(116.70)	(114.42)	(112.14)	(109.86)
자산	5.33%	(88.36)	(86.08)	(83.80)	(81.52)	(79.24)	(76.96)	(74.68)
사	2.67%	(49.46)	(47.18)	(44.90)	(42.62)	(40.34)	(38.06)	(35.78)
나	0.00%	(6.84)	(4.56)	(2.28)	0.00	2.28	4.56	6.84
리	-2.67%	39.50	41.78	44.06	46.34	48.62	50.90	53.18
오	-5.33%	89.56	91.84	94.12	96.40	98.68	100.96	103.24
리	-8.00%	143.33	145.61	147.89	150.17	152.45	154.73	157.01

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65033AL250	신한투자(ELS)4533	30.30
KR65233AT259	대우증권(ELS)7497	31.84
KR65533BV256	우리투자증권(ELS)6128	31.75
KR6703394256	H&D증권(ELS)2764	29.65
총 최대손실 예상금액		123.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 165.76

메리츠주가지수연계증권제30호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

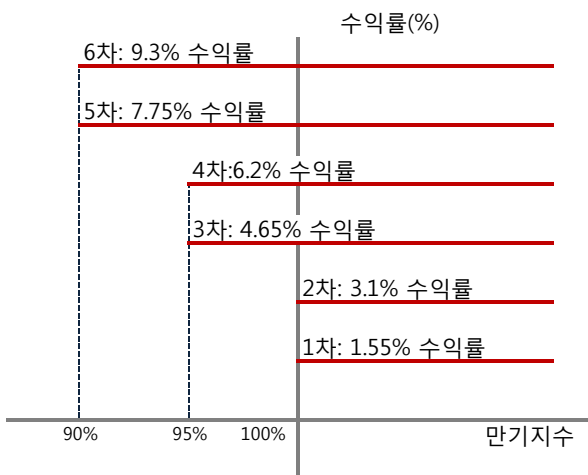
1. 계약금액

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

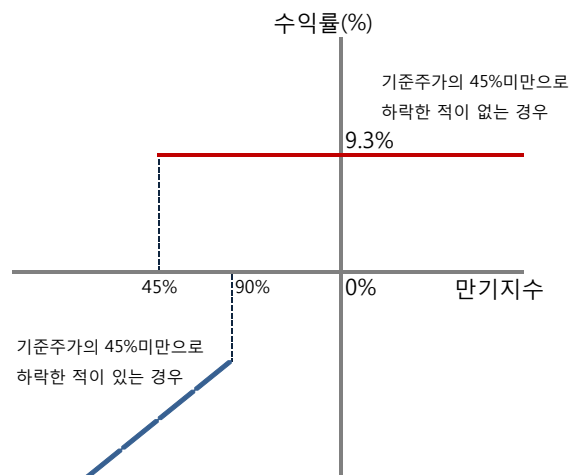
단위(백만원)

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

구분	변동성 시나리오						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산	8.00%	5.33%	2.67%	0.00%	-2.67%	-5.33%	-8.00%
시나리오	(133.89)	(88.77)	(45.24)	(3.30)	37.04	75.79	112.95
	(132.79)	(87.67)	(44.14)	(2.20)	38.14	76.89	114.05
	(131.69)	(86.57)	(43.04)	(1.10)	39.24	78.00	115.16
	(130.59)	(85.47)	(41.94)	0.00	40.34	79.10	116.26
	(129.49)	(84.36)	(40.84)	1.10	41.45	80.20	117.36
	(128.38)	(83.26)	(39.73)	2.20	42.55	81.30	118.46
	(127.28)	(82.16)	(38.63)	3.30	43.65	82.40	119.56

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	예상금액
KR65233BT281	대우증권(ELS)8153	9.45
KR65533BB282	우리투자증권(ELS)6416	9.55
KR65733AY282	한국투자증권(ELS)2750	9.52
KR6583383288	현대증권(ELS)2012-2464	9.33
총 최대손실 예상금액		133.89

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 131.59

메리츠주가지수연계증권제31호[ELS-파생형]

공시일: 2012-11-26

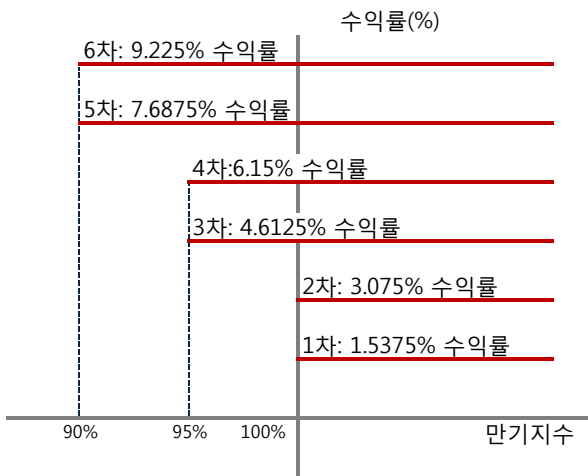
1. 계약금액

단위(백만원)

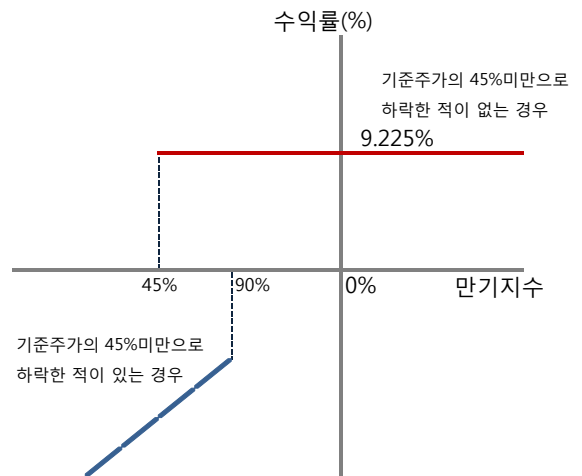
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외
누계	유가증권	ELS	30,000	0	30,000	장외

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%	(368.16)	(367.49)	(366.83)	(366.16)	(365.50)	(364.83)	(364.16)
자산	5.33%	(234.35)	(233.68)	(233.02)	(232.35)	(231.68)	(231.02)	(230.35)
시나	2.67%	(112.29)	(111.63)	(110.96)	(110.30)	(109.63)	(108.96)	(108.30)
리오	0.00%	(2.00)	(1.33)	(0.67)	0.00	0.67	1.33	2.00
	-2.67%	96.54	97.21	97.87	98.54	99.20	99.87	100.54
	-5.33%	183.32	183.99	184.65	185.32	185.98	186.65	187.32
	-8.00%	258.34	259.01	259.67	260.34	261.01	261.67	262.34

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6523302299	대우증권(ELS)8158	0.00
KR6553351299	우리투자증권(ELS)6537	0.00
KR6573301290	한국투자증권(ELS)2749	0.00
KR6593336292	미래에셋증권(ELS)3955	0.00
총 최대손실 예상금액		368.16

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

434.07