

파생상품집합 투자기구의 위험에 관한 지표공시

메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

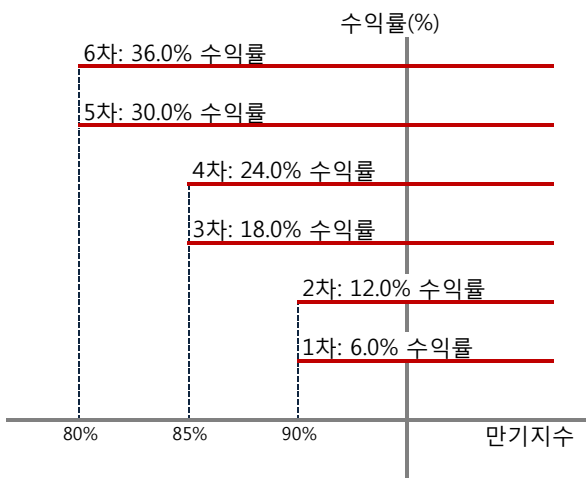
1. 계약금액

단위(백만원)

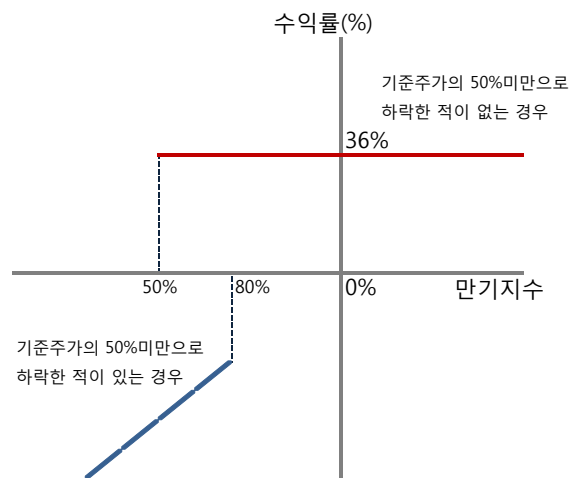
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,867	0	4,867	장외
누계	유가증권	ELS	4,867	0	4,867	장외

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%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-8.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502348032	신한투자(ELS)1408	0.00
KR6582353035	현대증권(ELS)2010-1232	0.00
KR6661350035	동양(ELS)520	0.00
KR6702358039	H&D증권(ELS)545	0.00
총 최대손실 예상금액		0.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 0.00

메리츠2Star증권KIST-1[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

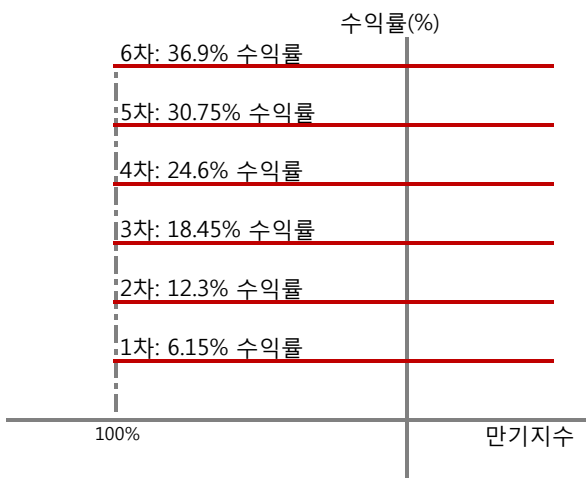
1. 계약금액

단위(백만원)

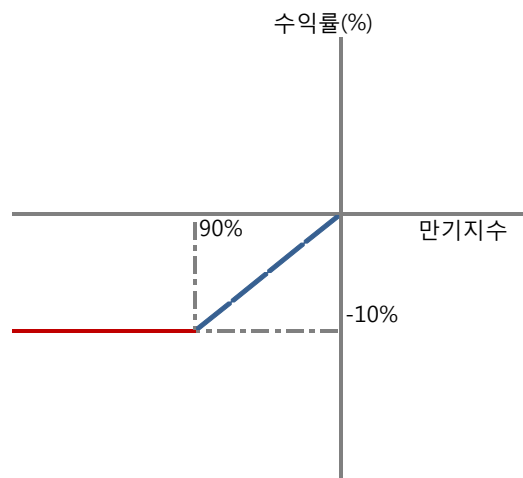
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,945	0	4,945	장외
누계	유가증권	ELS	4,945	0	4,945	장외

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%	(513.32)	(513.76)	(514.20)	(514.64)	(515.08)	(515.52)	(515.96)
	5.33%	(221.35)	(221.79)	(222.23)	(222.67)	(223.11)	(223.55)	(223.99)
	2.67%	(49.80)	(50.24)	(50.68)	(51.12)	(51.57)	(52.01)	(52.45)
	0.00%	1.32	0.88	0.44	0.00	(0.44)	(0.88)	(1.32)
	-2.67%	(67.97)	(68.42)	(68.86)	(69.30)	(69.74)	(70.18)	(70.62)
	-5.33%	(257.69)	(258.14)	(258.58)	(259.02)	(259.46)	(259.90)	(260.34)
	-8.00%	(567.84)	(568.28)	(568.72)	(569.16)	(569.60)	(570.04)	(570.48)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65293160A1	대우증권ELS4537	145.94
KR65593110A3	우리투자증권(ELS)3541	130.14
KR65893090A4	현대증권(ELS)2010-1453	146.26
KR66693120A9	동양W(ELS)927	148.15
총 최대손실 예상금액		570.48

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	181.60
-----	--------

메리츠2Star증권SEST-2호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

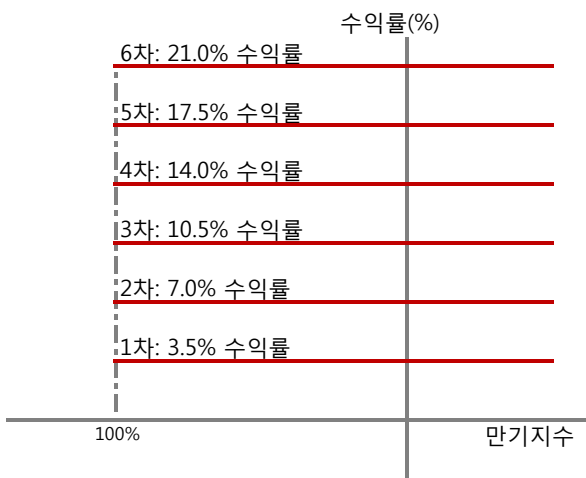
1. 계약금액

단위(백만원)

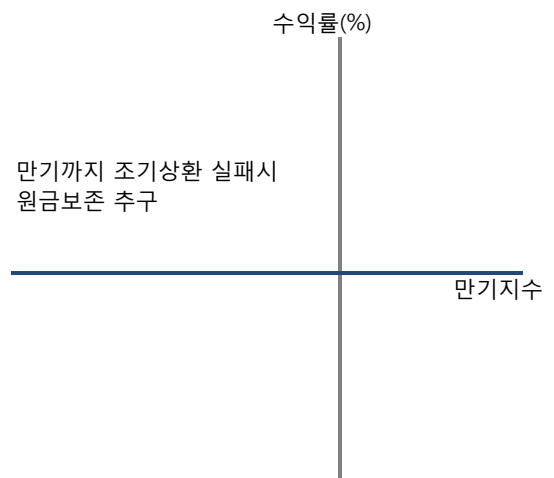
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,404	0	3,404	장외
누계	유가증권	ELS	3,404	0	3,404	장외

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%	80.63	77.98	75.32	72.67	70.02	67.36	64.71
	5.33%	64.57	61.91	59.26	56.61	53.95	51.30	48.65
	2.67%	40.35	37.69	35.04	32.38	29.73	27.08	24.42
	0.00%	7.96	5.31	2.65	0.00	(2.65)	(5.31)	(7.96)
	-2.67%	(32.59)	(35.24)	(37.89)	(40.55)	(43.20)	(45.85)	(48.51)
	-5.33%	(81.29)	(83.95)	(86.60)	(89.25)	(91.91)	(94.56)	(97.21)
	-8.00%	(138.16)	(140.82)	(143.47)	(146.12)	(148.78)	(151.43)	(154.08)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523460C3	우리투자증권(ELS)3756	39.49
KR65823220C8	현대증권(ELS)2010-1534	39.67
KR65923520C0	미래에셋증권(ELS)1637	39.78
KR66623360C2	동양W(ELS)950	35.14
총 최대손실 예상금액		154.08

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 164.31

메리츠2Star증권SEST-3호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

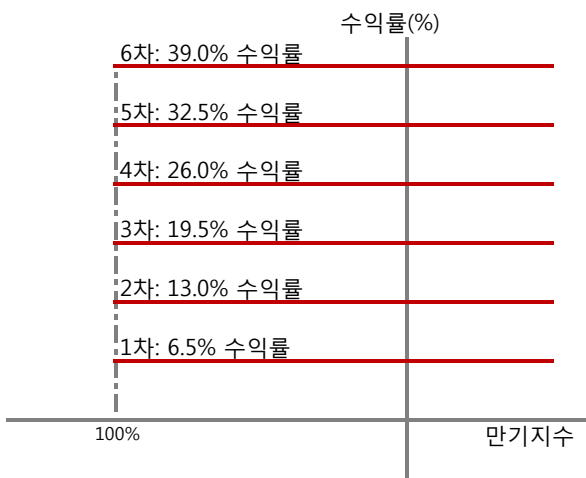
1. 계약금액

단위(백만원)

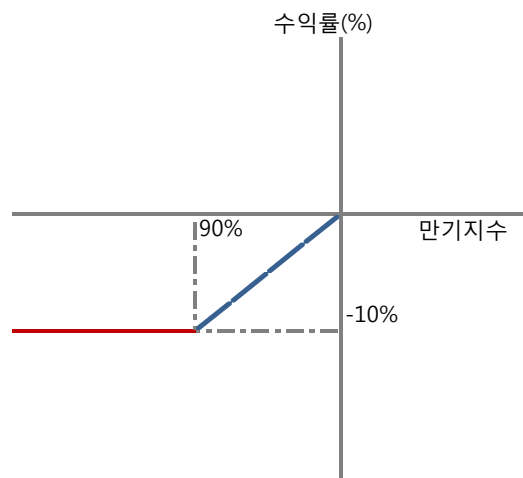
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,262	0	3,262	장외
누계	유가증권	ELS	3,262	0	3,262	장외

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%	166.63	160.78	154.93	149.08	143.23	137.38	131.52
	5.33%	134.86	129.01	123.16	117.30	111.45	105.60	99.75
	2.67%	85.17	79.32	73.46	67.61	61.76	55.91	50.06
	0.00%	17.56	11.70	5.85	0.00	(5.85)	(11.70)	(17.56)
	-2.67%	(67.97)	(73.83)	(79.68)	(85.53)	(91.38)	(97.23)	(103.09)
	-5.33%	(171.42)	(177.27)	(183.13)	(188.98)	(194.83)	(200.68)	(206.53)
	-8.00%	(292.79)	(298.64)	(304.49)	(310.34)	(316.19)	(322.05)	(327.90)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액		단위(백만원)
KR65523450C4	우리투자증권(ELS)3755	86.49
KR65823210C9	현대증권(ELS)2010-1533	86.66
KR65923510C1	미래에셋증권(ELS)1636	86.75
KR66623340C4	동양W(ELS)949	67.99
총 최대손실 예상금액		327.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	348.73
-----	--------

메리츠2Star증권KBKT-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

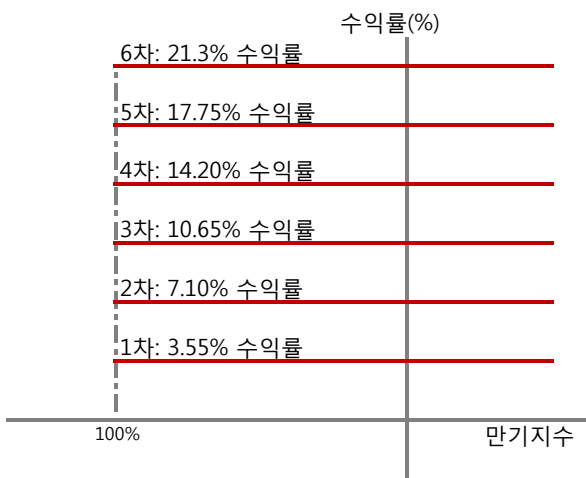
1. 계약금액

단위(백만원)

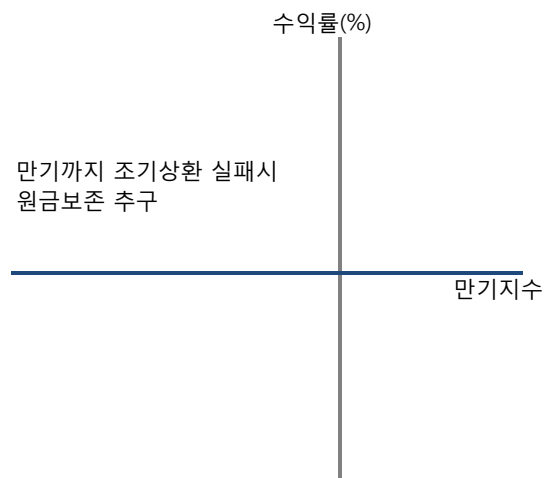
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장외

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	2.90	2.84	2.79	2.74	2.69	2.63	2.58	
자산	1.85	1.79	1.74	1.69	1.64	1.58	1.53	
시나리오	0.93	0.88	0.83	0.78	0.72	0.67	0.62	
	0.16	0.10	0.05	0.00	(0.05)	(0.10)	(0.16)	
	(0.48)	(0.53)	(0.59)	(0.64)	(0.69)	(0.74)	(0.80)	
	(0.98)	(1.04)	(1.09)	(1.14)	(1.19)	(1.25)	(1.30)	
	(1.35)	(1.40)	(1.45)	(1.51)	(1.56)	(1.61)	(1.66)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6552345128	우리투자증권(ELS)3989	0.46
KR6582317121	현대증권(ELS)2011-1588	0.46
KR6592350120	미래에셋증권(ELS)1896	0.27
KR6662316126	동양W(ELS)974	0.46
총 최대손실 예상금액		1.66

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

1.68

메리츠2Star증권KBSF-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

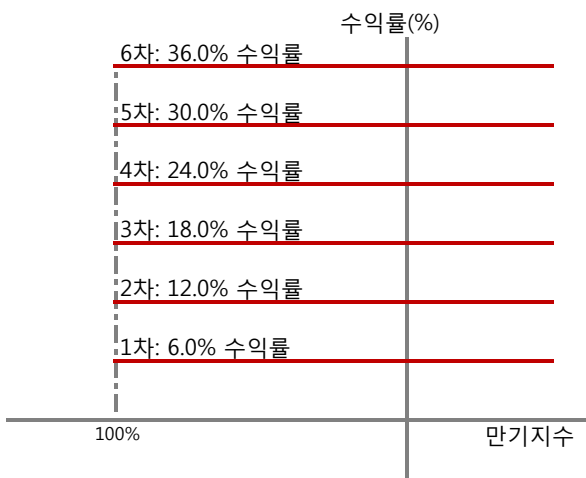
1. 계약금액

단위(백만원)

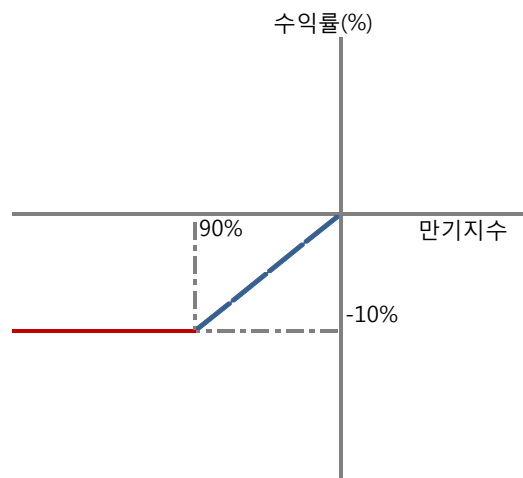
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	706	0	706	장외
누계	유가증권	ELS	706	0	706	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동 시나리오(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오

단위(백만원)

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초	5.84	5.70	5.57	5.44	5.31	5.18	5.04	
자산	3.77	3.64	3.51	3.38	3.24	3.11	2.98	
시나리오	1.96	1.83	1.70	1.56	1.43	1.30	1.17	
	0.40	0.26	0.13	0.00	(0.13)	(0.26)	(0.40)	
	(0.92)	(1.05)	(1.18)	(1.31)	(1.45)	(1.58)	(1.71)	
	(1.98)	(2.11)	(2.25)	(2.38)	(2.51)	(2.64)	(2.77)	
	(2.80)	(2.93)	(3.06)	(3.19)	(3.33)	(3.46)	(3.59)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6502331129	신한투자(ELS)2235	0.94
KR6552343123	우리투자증권(ELS)3988	0.77
KR6582319127	현대증권(ELS)2011-1589	0.94
KR6662317124	동양W(ELS)975	0.94
총 최대손실 예상금액		3.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 2.93

메리츠2Star증권SEPO-6호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

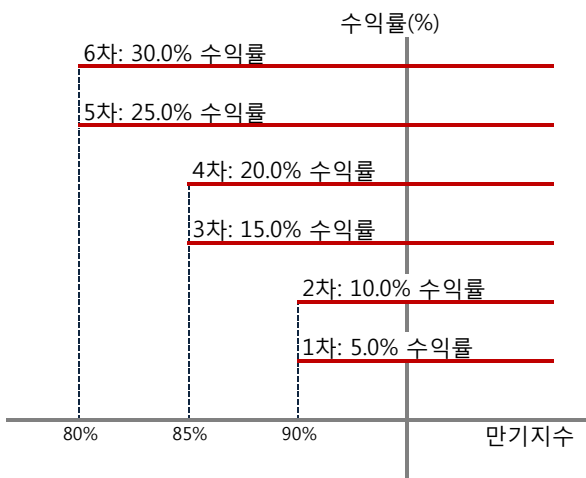
1. 계약금액

단위(백만원)

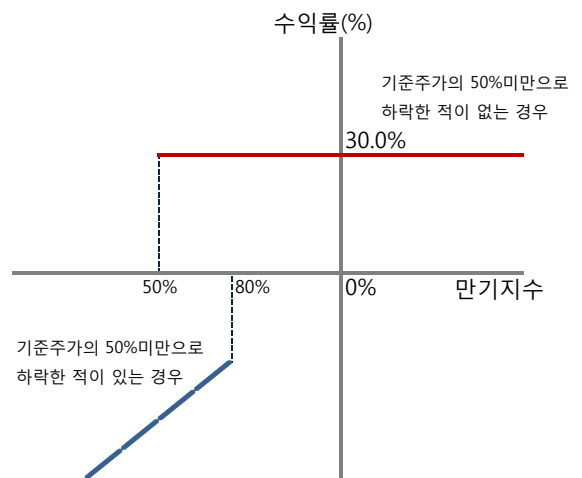
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,097	0	8,097	장외
누계	유가증권	ELS	8,097	0	8,097	장외

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	397.45	375.06	352.67	330.27	307.88	285.49	263.10	
자산	337.71	315.32	292.93	270.53	248.14	225.75	203.36	
시나	227.62	205.22	182.83	160.44	138.05	115.66	93.27	
리오	67.17	44.78	22.39	0.00	(22.39)	(44.78)	(67.17)	
	(143.62)	(166.01)	(188.40)	(210.79)	(233.18)	(255.58)	(277.97)	
	(404.76)	(427.15)	(449.55)	(471.94)	(494.33)	(516.72)	(539.11)	
	(716.26)	(738.65)	(761.04)	(783.43)	(805.82)	(828.21)	(850.61)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65523BH140	우리투자증권(ELS)4416	232.59
KR6582383149	현대증권(ELS)2011-1698	232.42
KR6592397147	미래에셋증권(ELS)2173	178.28
KR6662374141	동양W(ELS)1004	207.32
총 최대손실 예상금액		850.61

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액

871.55

메리츠한증지수연계증권제17호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

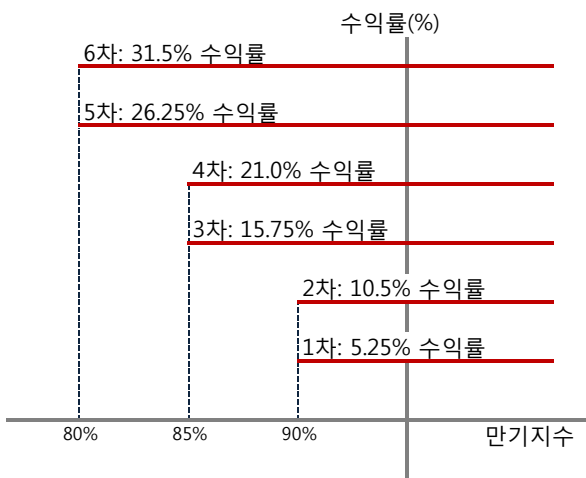
1. 계약금액

단위(백만원)

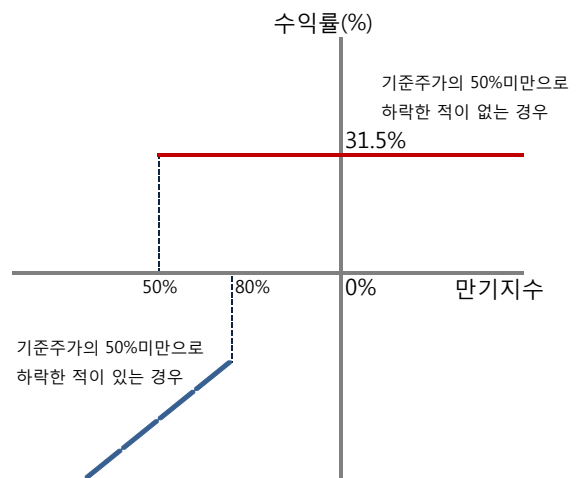
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,260	0	4,260	장외
누계	유가증권	ELS	4,260	0	4,260	장외

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%	(14.29)	(18.70)	(23.10)	(27.51)	(31.91)	(36.32)	(40.72)
	5.33%	3.89	(0.51)	(4.92)	(9.32)	(13.73)	(18.13)	(22.53)
	2.67%	13.06	8.66	4.25	(0.15)	(4.56)	(8.96)	(13.37)
	0.00%	13.21	8.81	4.40	0.00	(4.40)	(8.81)	(13.21)
	-2.67%	4.35	(0.06)	(4.46)	(8.87)	(13.27)	(17.67)	(22.08)
	-5.33%	(13.53)	(17.94)	(22.34)	(26.75)	(31.15)	(35.56)	(39.96)
	-8.00%	(40.43)	(44.84)	(49.24)	(53.65)	(58.05)	(62.46)	(66.86)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6553363153	우리투자증권(ELS)4485	17.13
KR6573353150	한국투자증권(ELS)2116	18.78
KR6593354154	미래에셋증권(ELS)2235	19.37
KR6663346155	동양W(ELS)1009	11.59
총 최대손실 예상금액		66.86

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 50.23

메리츠한증지수연계증권제19호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

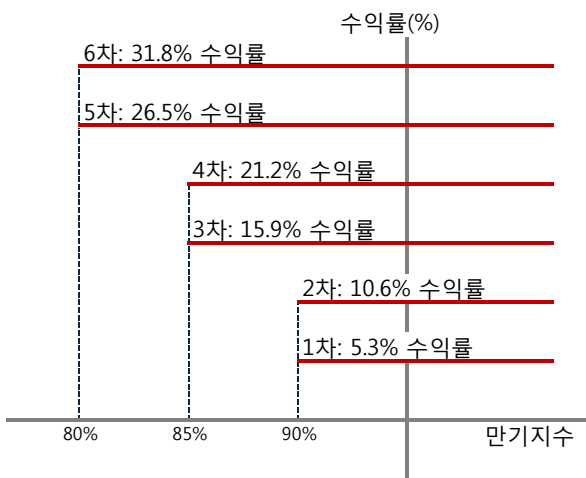
1. 계약금액

단위(백만원)

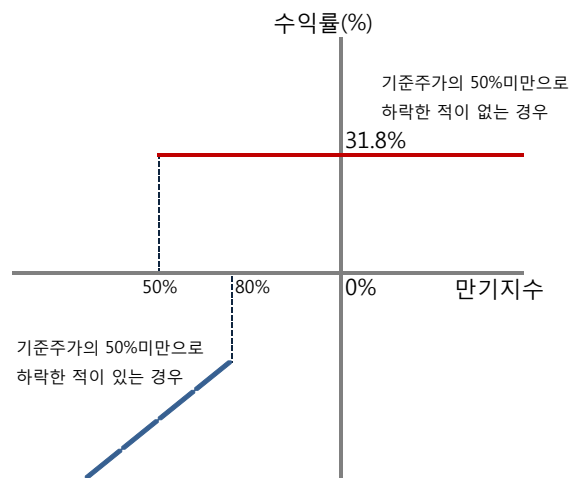
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	6,520	0	6,520	장외
누계	유가증권	ELS	6,520	0	6,520	장외

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	7.02	(2.11)	(11.24)	(20.38)	(29.51)	(38.64)	(47.78)	
자산	29.65	20.52	11.38	2.25	(6.88)	(16.02)	(25.15)	
시나	36.44	27.31	18.17	9.04	(0.09)	(9.22)	(18.36)	
리오	0.00%	18.27	9.13	0.00	(9.13)	(18.27)	(27.40)	
	-2.67%	(6.61)	(15.74)	(24.88)	(34.01)	(43.14)	(52.27)	
	-5.33%	(38.19)	(47.32)	(56.45)	(65.59)	(74.72)	(83.85)	
	-8.00%	(94.73)	(103.87)	(113.00)	(122.13)	(131.26)	(140.40)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65533C6151	우리투자증권(ELS)4595	26.64
KR65933AH150	미래에셋증권(ELS)2299	39.80
KR66633AV156	동양W(ELS)1019	43.21
KR67033A2153	H&D증권(ELS)1724	39.89
총 최대손실 예상금액		149.53

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 127.14

메리츠한증지수연계증권제20호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

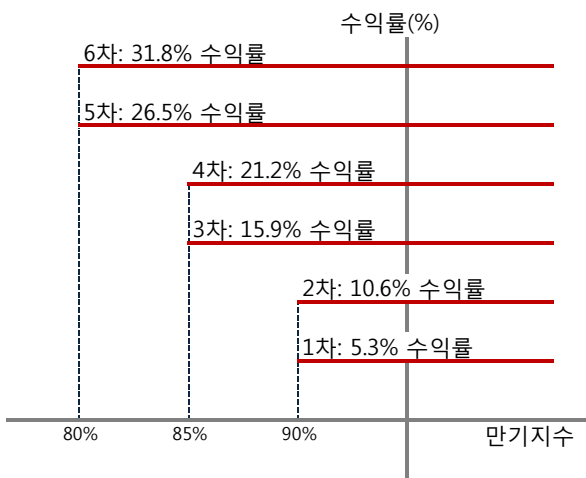
1. 계약금액

단위(백만원)

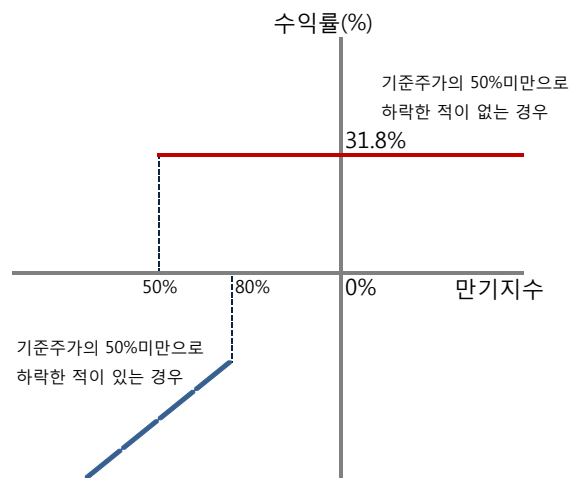
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	4,862	0	4,862	장외
누계	유가증권	ELS	4,862	0	4,862	장외

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	6.65	(0.58)	(7.82)	(15.05)	(22.29)	(29.52)	(36.76)	
자산	22.11	14.87	7.64	0.40	(6.83)	(14.07)	(21.30)	
시나	27.12	19.89	12.65	5.42	(1.82)	(9.05)	(16.29)	
리오	0.00%	21.71	14.47	7.24	0.00	(7.24)	(14.47)	
	-2.67%	5.85	(1.38)	(8.62)	(15.85)	(23.09)	(30.32)	
	-5.33%	(20.44)	(27.67)	(34.91)	(42.14)	(49.38)	(56.61)	
	-8.00%	(57.16)	(64.40)	(71.63)	(78.87)	(86.10)	(93.34)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR6503341168	신한투자(ELS)2834	27.81
KR6553344161	우리투자증권(ELS)4621	17.28
KR6583319167	현대증권(ELS)2011-1768	27.66
KR6663324160	동양W(ELS)1028	27.83
총 최대손실 예상금액		100.57

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 94.24

메리츠 2스타증권 KS-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

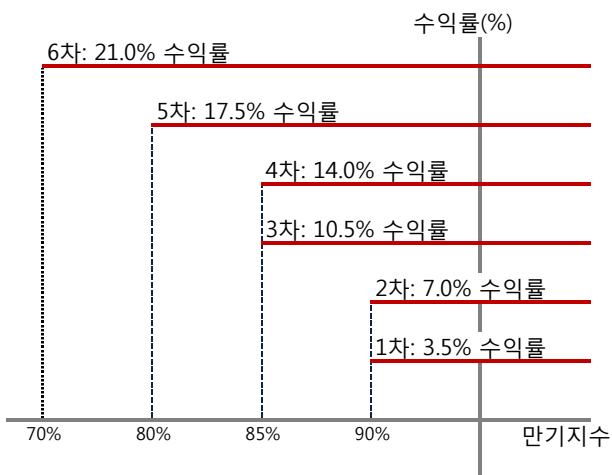
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	621	0	621	장외
누계	유가증권	ELS	621	0	621	장외

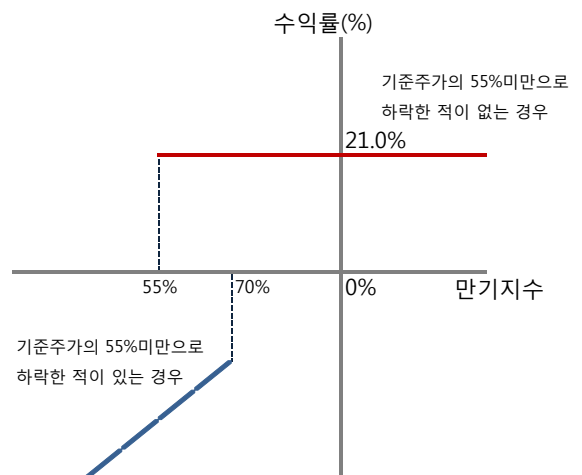
단위(백만원)

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	19.71	17.21	14.71	12.22	9.72	7.22	4.72	
시나리오	16.57	14.07	11.58	9.08	6.58	4.08	1.58	
리오	12.50	10.00	7.50	5.01	2.51	0.01	(2.49)	
	7.49	5.00	2.50	0.00	(2.50)	(5.00)	(7.49)	
	1.56	(0.94)	(3.44)	(5.94)	(8.44)	(10.94)	(13.43)	
	(5.32)	(7.82)	(10.32)	(12.81)	(15.31)	(17.81)	(20.31)	
	(13.13)	(15.62)	(18.12)	(20.62)	(23.12)	(25.62)	(28.12)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	최대손실 예상금액
KR6502366315	신한투자(ELS)6143	6.82
KR6522359316	대우증권(ELS)8664	7.14
KR6621312315	교보증권(ELS)10007	6.89
KR6772307312	KB STAR(ELS)334	7.26
총 최대손실 예상금액		28.12

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 25.12

메리츠 2Star증권 SELE-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

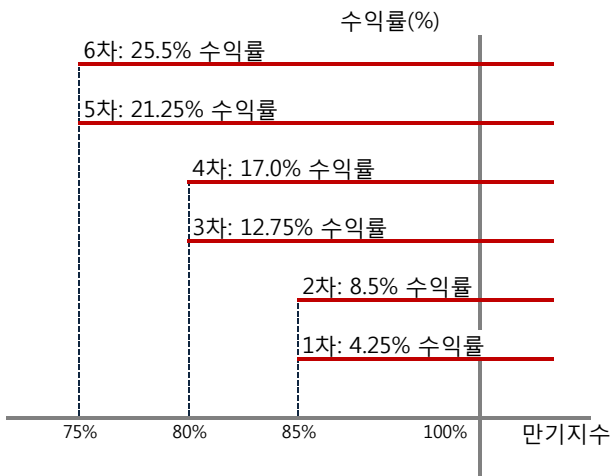
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,534	0	2,534	장외
누계	유가증권	ELS	2,534	0	2,534	장외

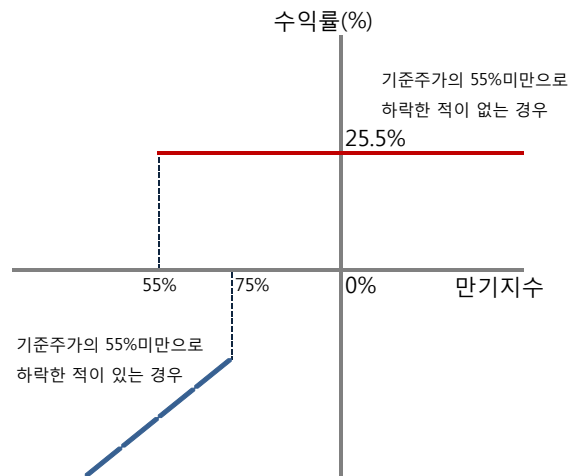
단위(백만원)

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	60.54	53.03	45.52	38.01	30.51	23.00	15.49	
자산	52.31	44.81	37.30	29.79	22.29	14.78	7.27	
시나리오	39.64	32.14	24.63	17.12	9.61	2.11	(5.40)	
리	22.52	15.01	7.51	0.00	(7.51)	(15.01)	(22.52)	
리	0.95	(6.56)	(14.07)	(21.57)	(29.08)	(36.59)	(44.09)	
리	(25.08)	(32.58)	(40.09)	(47.60)	(55.10)	(62.61)	(70.12)	
리	(55.55)	(63.06)	(70.56)	(78.07)	(85.58)	(93.09)	(100.59)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65223A1316	대우증권(ELS)8666	24.88
KR6542329315	신영증권플랜업(ELS)3238	25.24
KR6582364313	현대증권(ELS)2013-2624	25.29
KR6592374310	미래에셋증권(ELS)4281	25.19
총 최대손실 예상금액		100.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 90.92

메리츠 2스타주가연동증권 SL-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

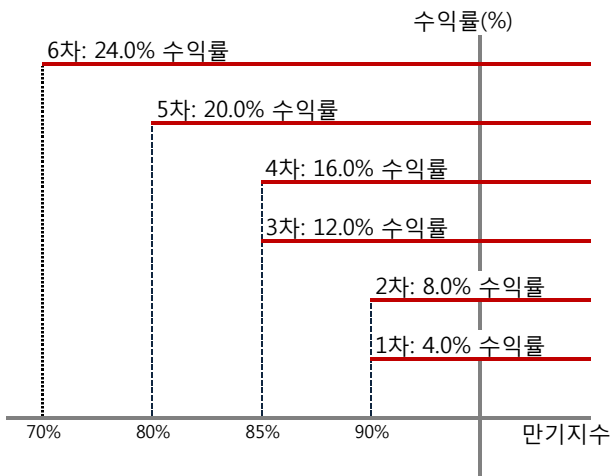
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	5,244	0	5,244	장외
누계	유가증권	ELS	5,244	0	5,244	장외

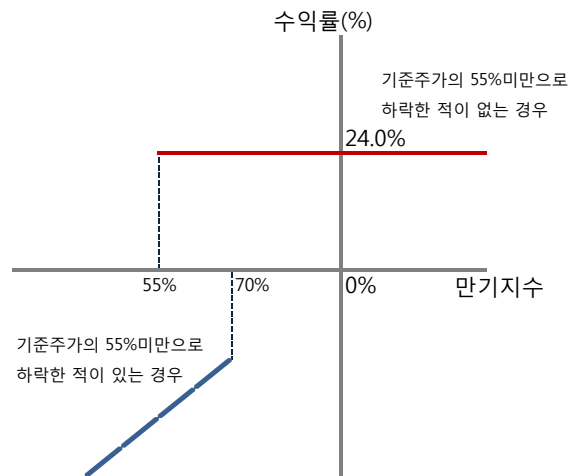
단위(백만원)

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	170.86	145.80	120.74	95.68	70.62	45.56	20.50	
자산	145.69	120.63	95.57	70.51	45.45	20.40	(4.66)	
시나	113.80	88.74	63.68	38.62	13.56	(11.50)	(36.56)	
리오	75.18	50.12	25.06	0.00	(25.06)	(50.12)	(75.18)	
	29.83	4.77	(20.29)	(45.35)	(70.40)	(95.46)	(120.52)	
	(22.24)	(47.30)	(72.36)	(97.42)	(122.48)	(147.53)	(172.59)	
	(81.04)	(106.10)	(131.15)	(156.21)	(181.27)	(206.33)	(231.39)	

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

단위(백만원)

KR65023A1334	신한투자(ELS)6492	57.67
KR6522385337	대우증권(ELS)8895	57.29
KR6621330333	교보증권(ELS)10066	58.21
KR6772315331	KB STAR(ELS)395	58.21
총 최대손실 예상금액		231.39

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 218.03

메리츠 2스타주가연동증권 LK-1호[ELS-파생형]

공시일: 2013-03-19

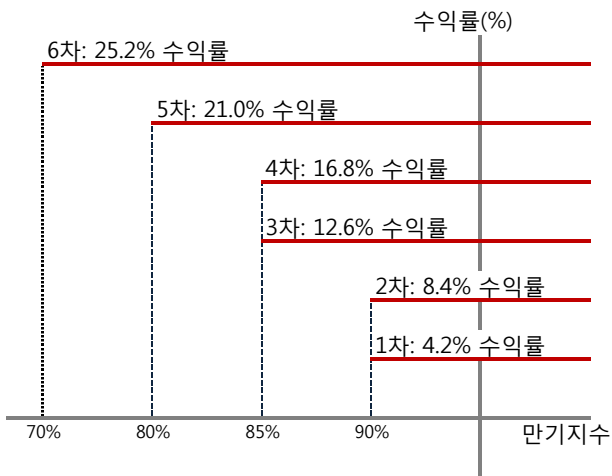
1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,793	0	2,793	장외
누계	유가증권	ELS	2,793	0	2,793	장외

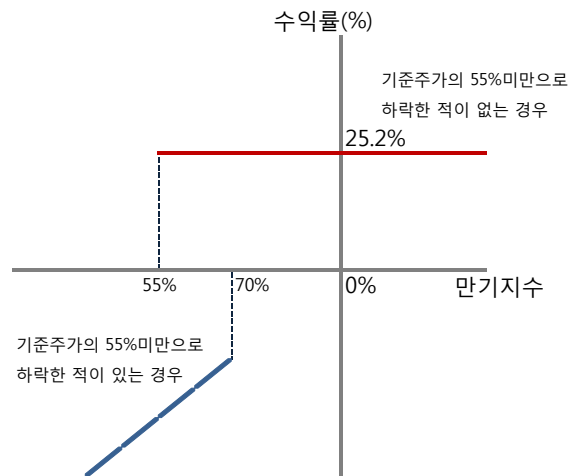
단위(백만원)

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	47.04	40.96	34.89	28.81	22.74	16.67	10.59	
시나리오	40.86	34.78	28.71	22.64	16.56	10.49	4.41	
리오	31.25	25.18	19.11	13.03	6.96	0.88	(5.19)	
	18.22	12.15	6.07	0.00	(6.07)	(12.15)	(18.22)	
	1.77	(4.31)	(10.38)	(16.46)	(22.53)	(28.61)	(34.68)	
	(18.12)	(24.19)	(30.27)	(36.34)	(42.42)	(48.49)	(54.56)	
	(41.43)	(47.50)	(53.58)	(59.65)	(65.73)	(71.80)	(77.88)	

단위(백만원)

시나리오법에 의한 최대손실 예상금액

시나리오	자산	최대손실 예상금액
KR65023A0336	신한투자(ELS)6492	19.48
KR6522386335	대우증권(ELS)8895	19.28
KR6572385336	교보증권(ELS)10066	19.37
KR6772318335	KB STAR(ELS)395	19.75
총 최대손실 예상금액		77.88

단위(백만원)

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액 69.32