

**파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시**

---

[1] 메리츠2Star사모증권GCWF-1호

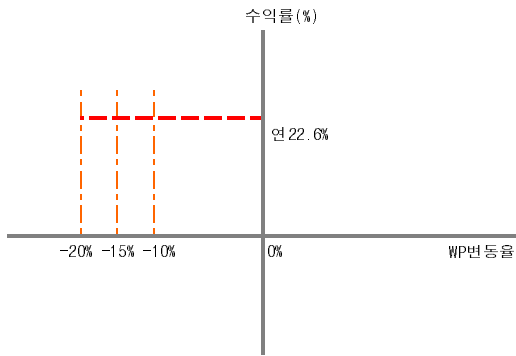
1. 계약금액

단위(백만원)

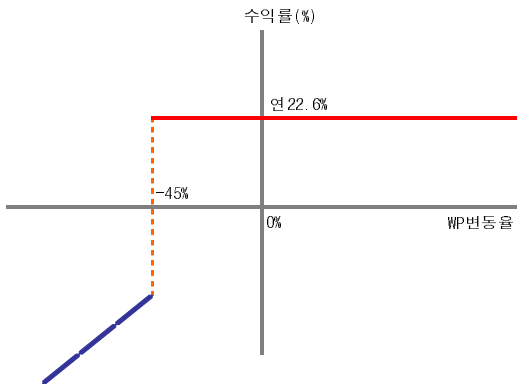
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	198	0	198	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622316W80 교보증권(ELS)386

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	5.06	3.95	2.84	1.73	0.62	(0.49)	(1.59)
	5.33%	5.06	3.95	2.84	1.73	0.62	(0.49)	(1.60)
	2.67%	4.48	3.37	2.26	1.15	0.05	(1.06)	(2.17)
	0.00%	3.33	2.22	1.11	0.00	(1.11)	(2.22)	(3.33)
	-2.67%	1.60	0.49	(0.62)	(1.73)	(2.84)	(3.95)	(5.06)
	-5.33%	(0.71)	(1.82)	(2.93)	(4.04)	(5.15)	(6.26)	(7.37)
	-8.00%	(3.60)	(4.71)	(5.81)	(6.92)	(8.03)	(9.14)	(10.25)

최대손실 시나리오

위험액	-10.25
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	14.05
-----	-------

[2] 메리츠2Star사모증권HCSV-1

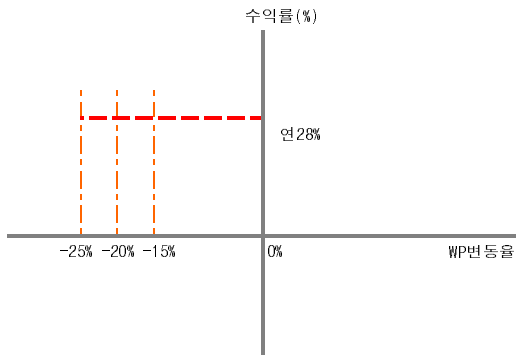
1. 계약금액

단위(백만원)

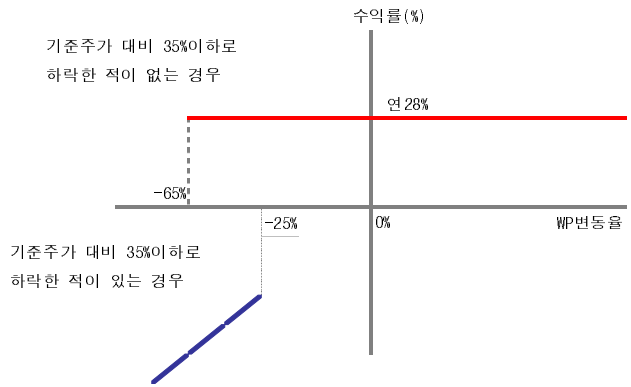
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	821	0	821	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622301W53 교보증권(ELS)336

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	12.56	4.23	(4.11)	(12.44)	(20.78)	(29.11)	(37.45)
	5.33%	18.49	10.16	1.82	(6.51)	(14.85)	(23.18)	(31.52)
	2.67%	22.64	14.31	5.97	(2.36)	(10.70)	(19.03)	(27.37)
	0.00%	25.01	16.67	8.34	0.00	(8.34)	(16.67)	(25.01)
	-2.67%	25.59	17.25	8.92	0.58	(7.76)	(16.09)	(24.43)
	-5.33%	24.38	16.05	7.71	(0.62)	(8.96)	(17.29)	(25.63)
	-8.00%	21.39	13.06	4.72	(3.61)	(11.95)	(20.28)	(28.62)

최대손실 시나리오

위험액	-28.62
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	35.12
-----	-------

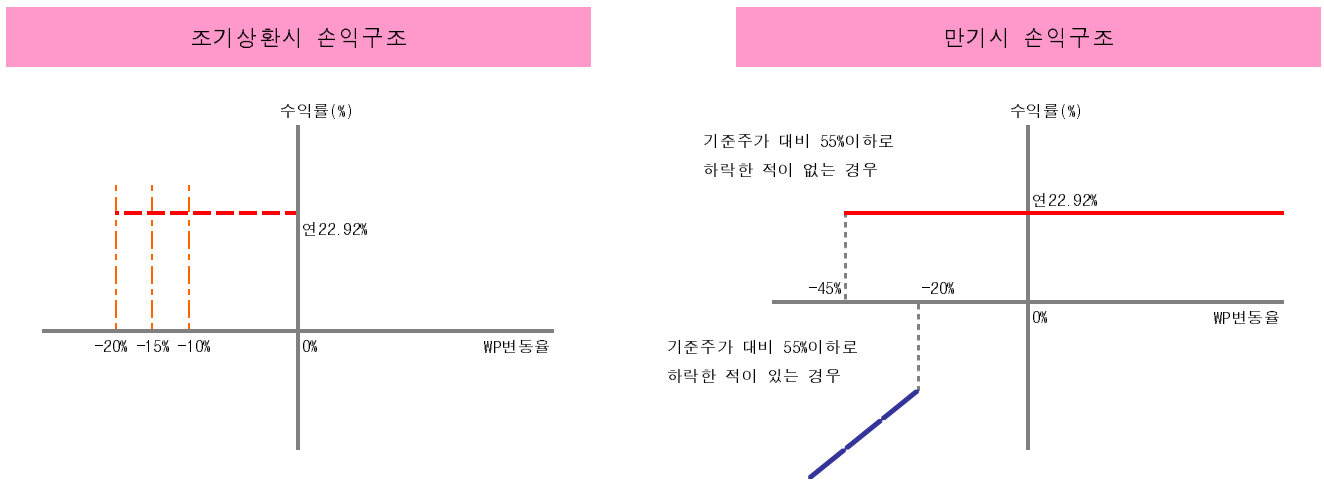
[4] 메리츠2Star사모증권HMSE-1호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	411	0	411	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572394WB7 한국투자증권(ELS)1460

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	11.15	9.41	7.67	5.93	4.19	2.45	0.71
	5.33%	9.78	8.04	6.30	4.56	2.82	1.08	(0.66)
	2.67%	7.80	6.06	4.32	2.58	0.85	(0.89)	(2.63)
	0.00%	5.22	3.48	1.74	0.00	(1.74)	(3.48)	(5.22)
	-2.67%	2.03	0.29	(1.45)	(3.19)	(4.93)	(6.67)	(8.41)
	-5.33%	(1.77)	(3.51)	(5.25)	(6.99)	(8.73)	(10.47)	(12.21)
	-8.00%	(6.18)	(7.92)	(9.66)	(11.40)	(13.14)	(14.88)	(16.62)

최대손실 시나리오

위험액	-16.62
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	15.22
-----	-------

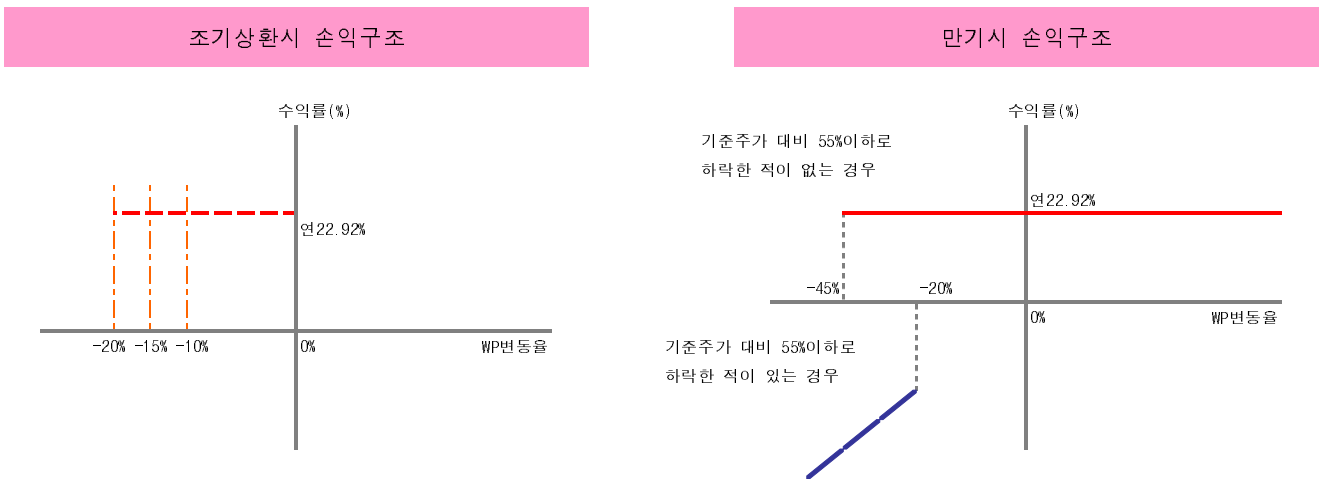
[5] 메리츠2Star사모증권HMSE-2호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	683	0	683	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572394WB7 한국투자증권(ELS)1460

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	18.52	15.63	12.74	9.85	6.96	4.07	1.18
	5.33%	16.24	13.35	10.46	7.57	4.69	1.80	(1.09)
	2.67%	12.96	10.07	7.18	4.29	1.40	(1.49)	(4.37)
	0.00%	8.67	5.78	2.89	0.00	(2.89)	(5.78)	(8.67)
	-2.67%	3.37	0.48	(2.41)	(5.30)	(8.19)	(11.08)	(13.97)
	-5.33%	(2.94)	(5.83)	(8.72)	(11.61)	(14.50)	(17.39)	(20.28)
	-8.00%	(10.26)	(13.15)	(16.04)	(18.93)	(21.82)	(24.71)	(27.59)

최대손실 시나리오

위험액	-27.59
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.26
-----	-------

[6] 메리츠2Star사모증권HSLC-1호

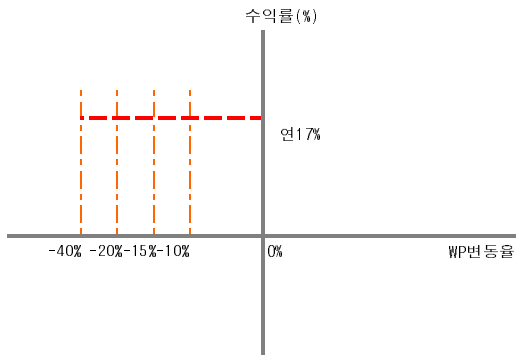
1. 계약금액

단위(백만원)

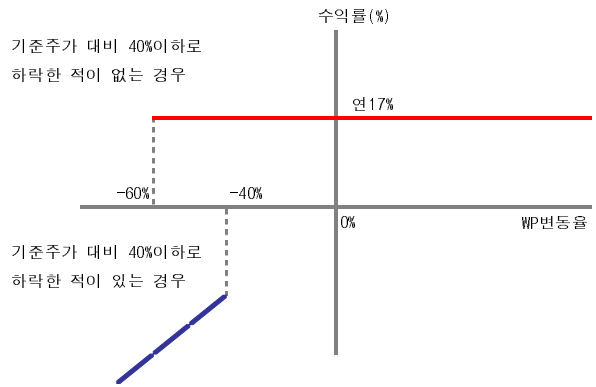
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	211	0	211	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662317WC7 동양(ELS)413

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	12.50	9.93	7.36	4.79	2.22	(0.36)	(2.93)
	5.33%	11.11	8.54	5.97	3.40	0.83	(1.74)	(4.31)
	2.67%	9.52	6.95	4.38	1.81	(0.76)	(3.33)	(5.90)
	0.00%	7.71	5.14	2.57	0.00	(2.57)	(5.14)	(7.71)
	-2.67%	5.69	3.12	0.55	(2.02)	(4.59)	(7.16)	(9.73)
	-5.33%	3.46	0.89	(1.68)	(4.25)	(6.82)	(9.39)	(11.96)
	-8.00%	1.02	(1.55)	(4.13)	(6.70)	(9.27)	(11.84)	(14.41)

최대손실 시나리오

위험액	-14.41
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.08
-----	-------

[8] 메리츠2Star사모증권HVSE-1호

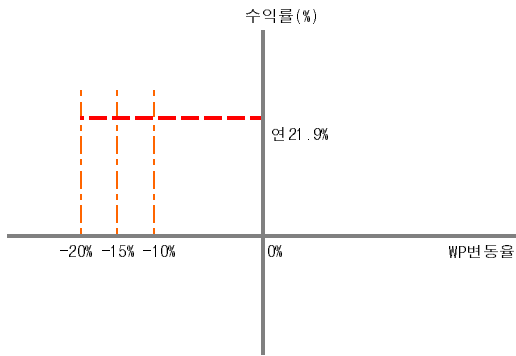
1. 계약금액

단위(백만원)

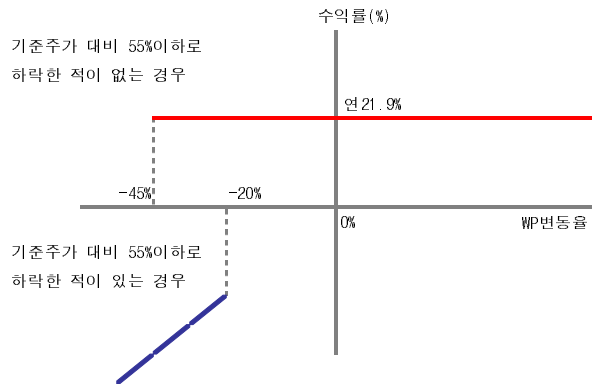
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	90	0	90	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572337W74 한국투자증권(ELS)1271

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)	(0.12)	(0.17)	(0.21)	(0.26)	(0.31)	(0.36)
	5.33%	0.14	0.10	0.05	0.00	(0.04)	(0.09)	(0.14)
	2.67%	0.22	0.17	0.12	0.07	0.03	(0.02)	(0.07)
	0.00%	0.14	0.09	0.05	0.00	(0.05)	(0.09)	(0.14)
	-2.67%	(0.08)	(0.13)	(0.17)	(0.22)	(0.27)	(0.32)	(0.36)
	-5.33%	(0.45)	(0.49)	(0.54)	(0.59)	(0.64)	(0.68)	(0.73)
	-8.00%	(0.96)	(1.01)	(1.06)	(1.10)	(1.15)	(1.20)	(1.24)

최대손실 시나리오

위험액	-1.24
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.78
-----	------

[9] 메리츠2Star사모증권HVWF-1호

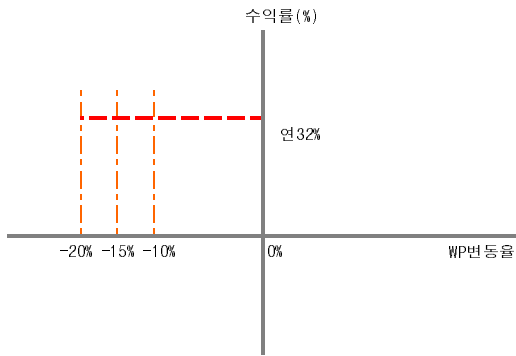
1. 계약금액

단위(백만원)

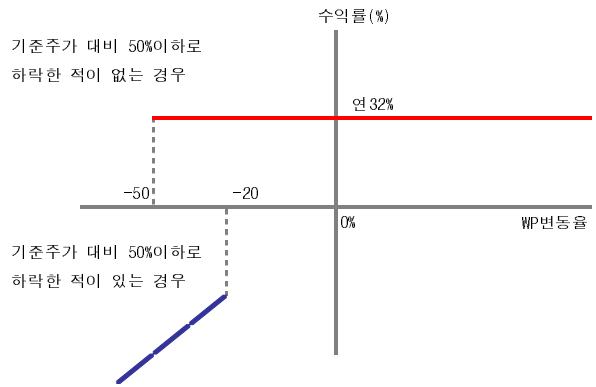
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	200	0	200	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552310W77 우리투자증권(ELS)2503

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	5.22	4.19	3.17	2.14	1.11	0.08	(0.95)
	5.33%	4.71	3.68	2.65	1.62	0.59	(0.44)	(1.47)
	2.67%	3.99	2.97	1.94	0.91	(0.12)	(1.15)	(2.18)
	0.00%	3.09	2.06	1.03	0.00	(1.03)	(2.06)	(3.09)
	-2.67%	1.99	0.96	(0.07)	(1.10)	(2.13)	(3.16)	(4.19)
	-5.33%	0.70	(0.33)	(1.36)	(2.39)	(3.42)	(4.45)	(5.48)
	-8.00%	(0.79)	(1.82)	(2.85)	(3.88)	(4.91)	(5.94)	(6.97)

최대손실 시나리오

위험액	-6.97
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.02
-----	------



[10] 메리츠2Star사모증권KBST-1호

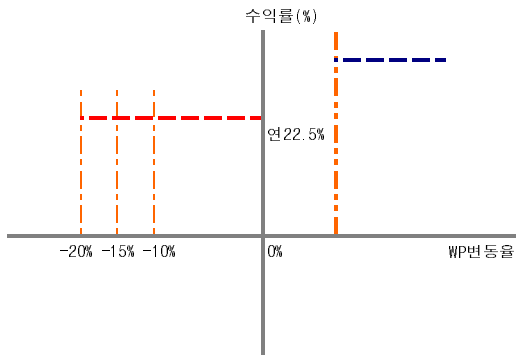
1. 계약금액

단위(백만원)

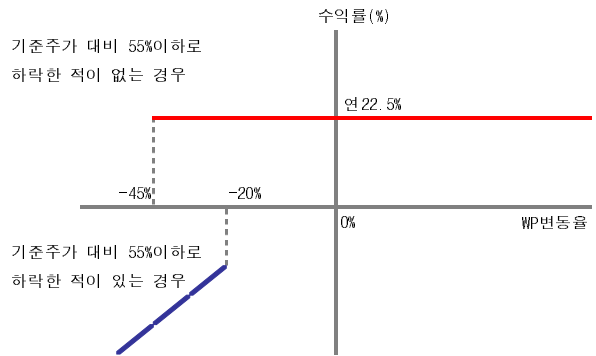
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	197	0	197	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622303WA0 교보증권(ELS)413

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	15.48	13.17	10.86	8.55	6.24	3.93	1.62
	5.33%	12.74	10.43	8.13	5.82	3.51	1.20	(1.11)
	2.67%	9.89	7.58	5.27	2.97	0.66	(1.65)	(3.96)
	0.00%	6.93	4.62	2.31	0.00	(2.31)	(4.62)	(6.93)
	-2.67%	3.85	1.54	(0.77)	(3.08)	(5.39)	(7.70)	(10.01)
	-5.33%	0.65	(1.66)	(3.97)	(6.28)	(8.59)	(10.89)	(13.20)
	-8.00%	(2.66)	(4.97)	(7.28)	(9.59)	(11.90)	(14.20)	(16.51)

최대손실 시나리오

위험액	-16.51
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.81
-----	-------

[11] 메리츠2Star사모증권KEGL-1호

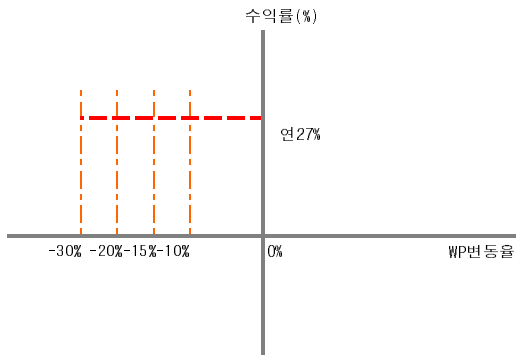
1. 계약금액

단위(백만원)

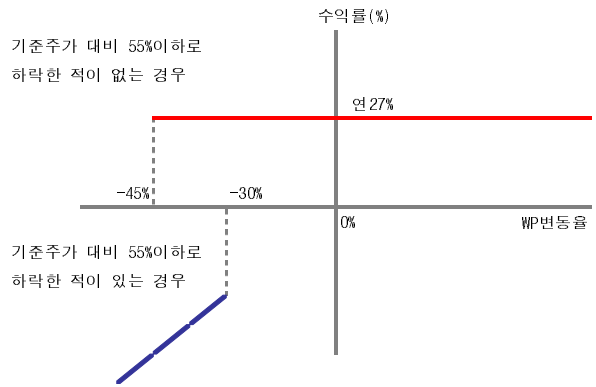
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	4,950	0	4,950	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662328W82 동양(ELS)298

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	763.90	579.36	394.83	210.29	25.75	(158.78)	(343.32)
	5.33%	696.74	512.21	327.67	143.13	(41.40)	(225.94)	(410.47)
	2.67%	626.64	442.11	257.57	73.04	(111.50)	(296.03)	(480.57)
	0.00%	553.61	369.07	184.54	0.00	(184.54)	(369.07)	(553.61)
	-2.67%	477.63	293.10	108.56	(75.98)	(260.51)	(445.05)	(629.58)
	-5.33%	398.71	214.18	29.64	(154.89)	(339.43)	(523.96)	(708.50)
	-8.00%	316.86	132.32	(52.21)	(236.75)	(421.29)	(605.82)	(790.36)

최대 손실 시나리오

위험액	-790.36
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	736.29
-----	--------

[12] 메리츠2Star사모증권KEGL-2호

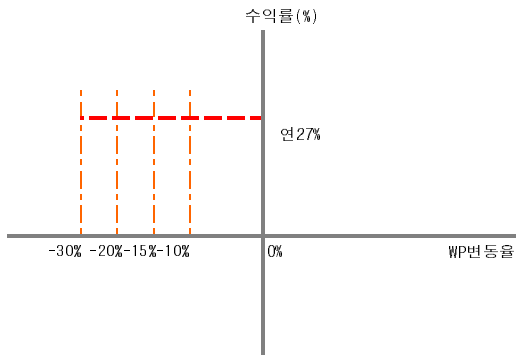
1. 계약금액

단위(백만원)

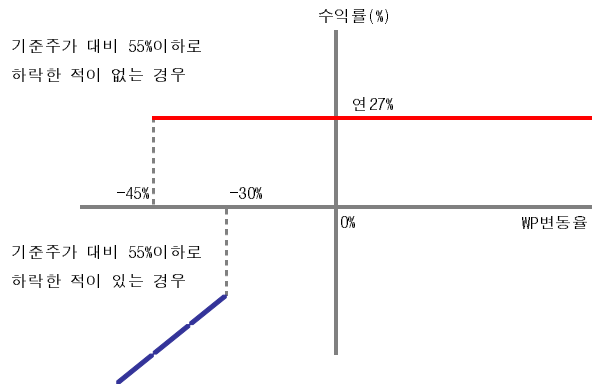
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,982	0	1,982	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6542314W82 신영증권(ELS)1227

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	317.26	244.69	172.12	99.55	26.98	(45.59)	(118.16)
	5.33%	284.01	211.44	138.87	66.30	(6.28)	(78.85)	(151.42)
	2.67%	250.82	178.25	105.68	33.11	(39.46)	(112.03)	(184.60)
	0.00%	217.71	145.14	72.57	0.00	(72.57)	(145.14)	(217.71)
	-2.67%	184.67	112.10	39.53	(33.04)	(105.61)	(178.18)	(250.75)
	-5.33%	151.70	79.13	6.56	(66.01)	(138.58)	(211.15)	(283.72)
	-8.00%	118.80	46.23	(26.34)	(98.91)	(171.48)	(244.05)	(316.62)

최대손실 시나리오

위험액	-316.62
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	281.63
-----	--------

[13] 메리츠2Star사모증권KEGL-3호

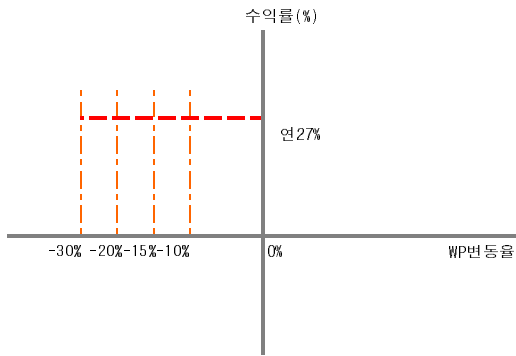
1. 계약금액

단위(백만원)

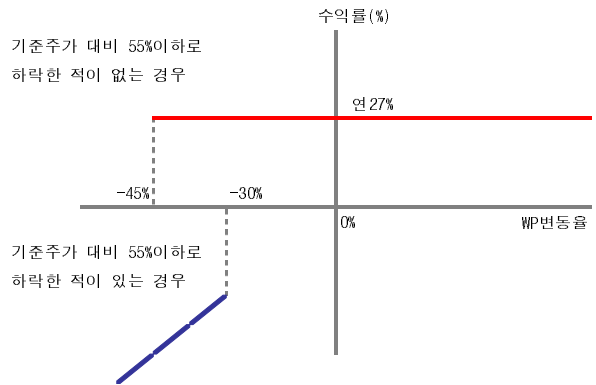
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,986	0	1,986	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6542325W89 신영증권(ELS)1246

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	338.52	264.24	189.97	115.69	41.41	(32.86)	(107.14)
	5.33%	299.32	225.04	150.77	76.49	2.22	(72.06)	(146.33)
	2.67%	260.76	186.48	112.20	37.93	(36.35)	(110.62)	(184.90)
	0.00%	222.83	148.55	74.28	0.00	(74.28)	(148.55)	(222.83)
	-2.67%	185.53	111.26	36.98	(37.29)	(111.57)	(185.84)	(260.12)
	-5.33%	148.88	74.60	0.32	(73.95)	(148.23)	(222.50)	(296.78)
	-8.00%	112.85	38.58	(35.70)	(109.97)	(184.25)	(258.52)	(332.80)

최대손실 시나리오

위험액	-332.80
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	342.05
-----	--------

[14] 메리츠2Star사모증권KEGL-4호

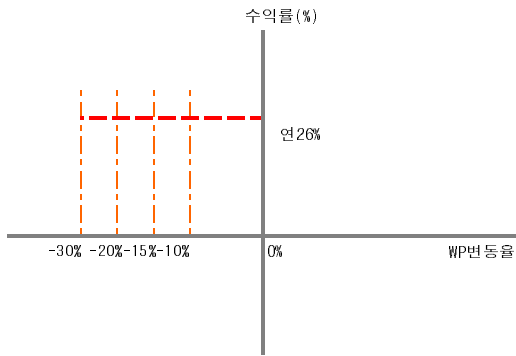
1. 계약금액

단위(백만원)

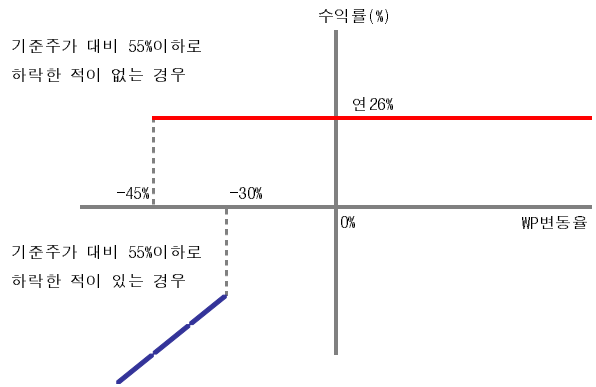
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,982	0	2,982	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6542327W87 신영증권(ELS)1248

구분	변동성 시나리오							
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	491.47	378.85	266.23	153.61	40.99	(71.63)	(184.25)
	5.33%	440.12	327.50	214.88	102.26	(10.36)	(122.98)	(235.60)
	2.67%	388.92	276.30	163.68	51.06	(61.56)	(174.18)	(286.80)
	0.00%	337.86	225.24	112.62	0.00	(112.62)	(225.24)	(337.86)
	-2.67%	286.94	174.32	61.70	(50.92)	(163.54)	(276.16)	(388.78)
	-5.33%	236.16	123.54	10.93	(101.69)	(214.31)	(326.93)	(439.55)
	-8.00%	185.53	72.91	(39.71)	(152.33)	(264.95)	(377.57)	(490.19)

최대손실 시나리오

위험액	-490.19
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	484.90
-----	--------

[17] 메리츠2Star사모증권KEKT-2호

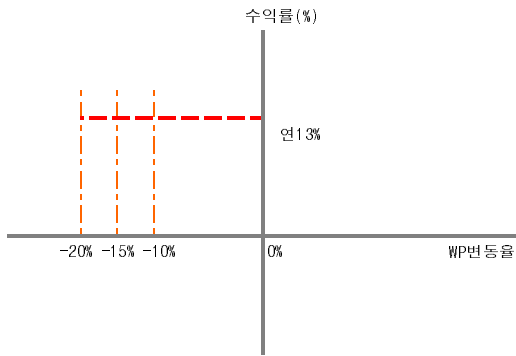
1. 계약금액

단위(백만원)

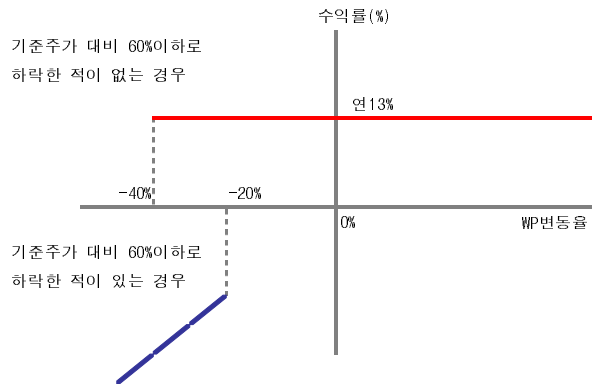
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	198	0	198	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6672311W80 해피플러스(ELS)126

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[18] 메리츠2Star사모증권KESB-1호

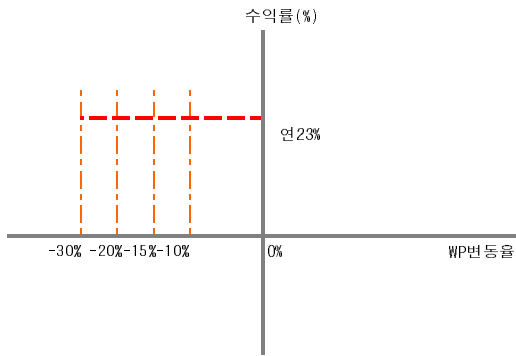
1. 계약금액

단위(백만원)

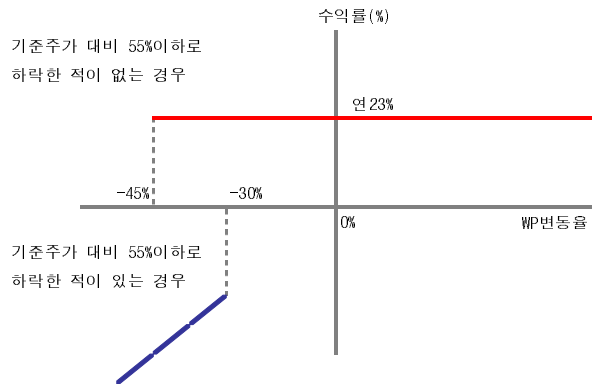
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	4,950	0	4,950	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662327W83 동양(ELS)297

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)
	5.33%	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)
	2.67%	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)	(0.75)
	-5.33%	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)	(2.98)
	-8.00%	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)	(6.72)

최대 손실 시나리오

위험액	-6.72
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[19] 메리츠2Star사모증권KESB-3호

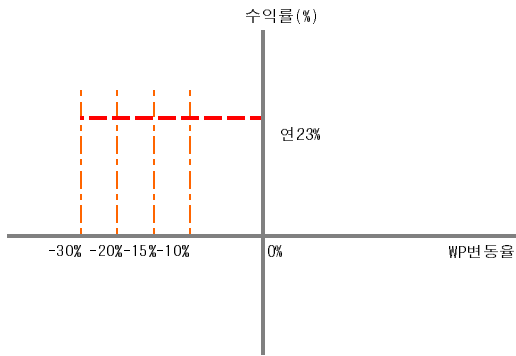
1. 계약금액

단위(백만원)

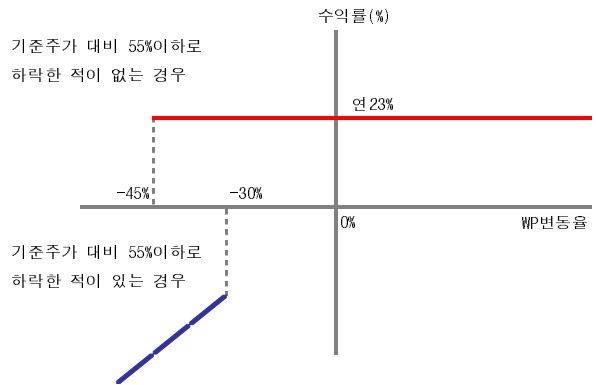
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,988	0	1,988	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6542315W81 신영증권(ELS)1228

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	(56.19)	(57.32)	(58.46)	(59.59)	(60.72)	(61.86)	(62.99)
	5.33%	(21.95)	(23.08)	(24.22)	(25.35)	(26.48)	(27.62)	(28.75)
	2.67%	(2.09)	(3.22)	(4.35)	(5.49)	(6.62)	(7.76)	(8.89)
	0.00%	3.40	2.27	1.13	0.00	(1.13)	(2.27)	(3.40)
	-2.67%	(5.49)	(6.62)	(7.75)	(8.89)	(10.02)	(11.16)	(12.29)
	-5.33%	(28.75)	(29.88)	(31.02)	(32.15)	(33.29)	(34.42)	(35.55)
	-8.00%	(66.39)	(67.52)	(68.66)	(69.79)	(70.92)	(72.06)	(73.19)

최대손실 시나리오

위험액	-73.19
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	34.07
-----	-------



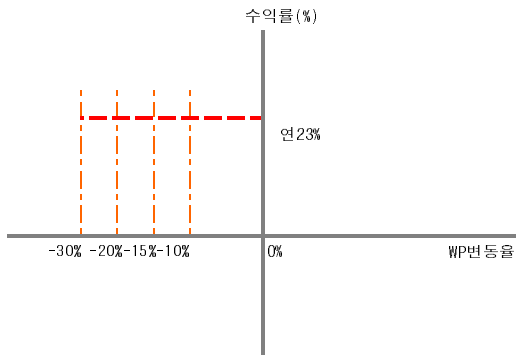
1. 계약금액

단위(백만원)

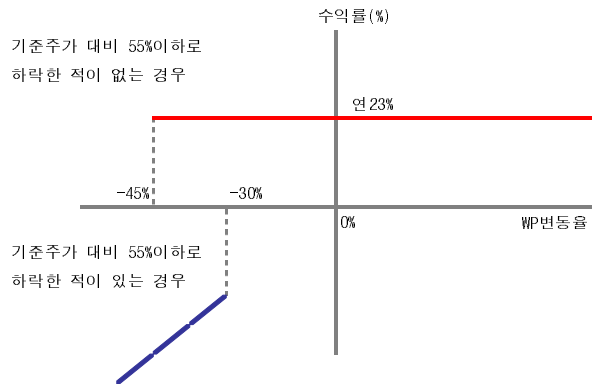
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,092	0	2,092	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6542326W88 신영증권(ELS)1247

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	46.54	34.85	23.16	11.47	(0.22)	(11.91)	(23.60)
	5.33%	49.20	37.51	25.82	14.13	2.44	(9.25)	(20.94)
	2.67%	45.38	33.69	22.00	10.31	(1.38)	(13.07)	(24.76)
	0.00%	35.07	23.38	11.69	0.00	(11.69)	(23.38)	(35.07)
	-2.67%	18.27	6.58	(5.11)	(16.79)	(28.48)	(40.17)	(51.86)
	-5.33%	(5.01)	(16.70)	(28.39)	(40.07)	(51.76)	(63.45)	(75.14)
	-8.00%	(34.77)	(46.46)	(58.15)	(69.84)	(81.53)	(93.22)	(104.91)

최대손실 시나리오

위험액	-104.91
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	125.64
-----	--------

[21] 메리츠2Star사모증권KESB-5호

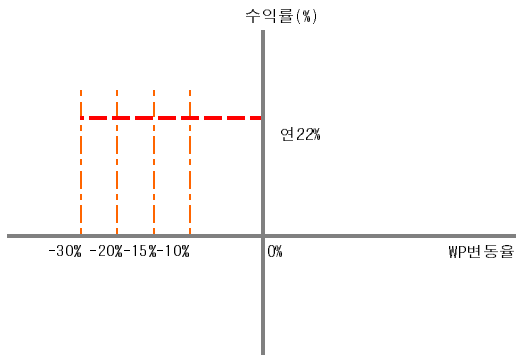
1. 계약금액

단위(백만원)

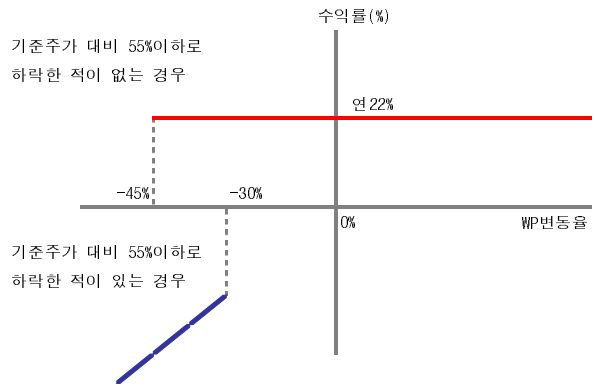
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,988	0	1,988	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6542328W86 신영증권(ELS)1249

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	58.15	44.20	30.25	16.30	2.35	(11.60)	(25.56)
	5.33%	59.65	45.70	31.74	17.79	3.84	(10.11)	(24.06)
	2.67%	54.21	40.26	26.31	12.36	(1.59)	(15.54)	(29.50)
	0.00%	41.86	27.90	13.95	0.00	(13.95)	(27.90)	(41.86)
	-2.67%	22.57	8.62	(5.33)	(19.28)	(33.24)	(47.19)	(61.14)
	-5.33%	(3.64)	(17.59)	(31.54)	(45.50)	(59.45)	(73.40)	(87.35)
	-8.00%	(36.78)	(50.73)	(64.68)	(78.63)	(92.58)	(106.54)	(120.49)

최대손실 시나리오

위험액	-120.49
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	104.71
-----	--------

[22-1] 메리츠2Star사모증권KGSH-1호

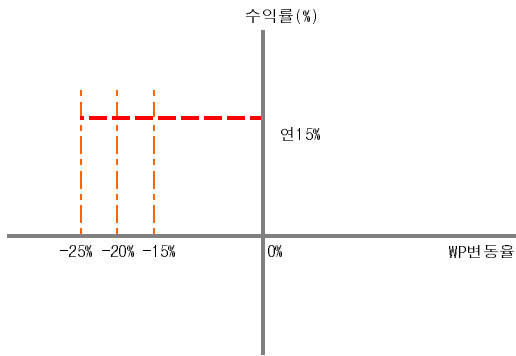
1. 계약금액

단위(백만원)

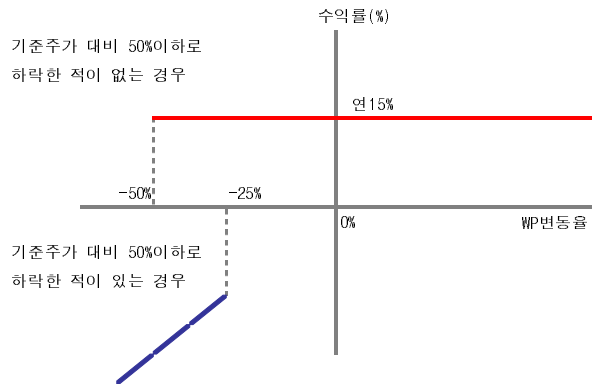
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552359WB4 우리투자증권(ELS)2765

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	1.05	0.88	0.72	0.56	0.39	0.23	0.06
	5.33%	0.89	0.73	0.56	0.40	0.23	0.07	(0.10)
	2.67%	0.70	0.54	0.38	0.21	0.05	(0.12)	(0.28)
	0.00%	0.49	0.33	0.16	0.00	(0.16)	(0.33)	(0.49)
	-2.67%	0.25	0.09	(0.07)	(0.24)	(0.40)	(0.57)	(0.73)
	-5.33%	(0.01)	(0.17)	(0.34)	(0.50)	(0.67)	(0.83)	(0.99)
	-8.00%	(0.30)	(0.46)	(0.63)	(0.79)	(0.96)	(1.12)	(1.29)

최대손실 시나리오

위험액	-1.29
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.55
-----	------

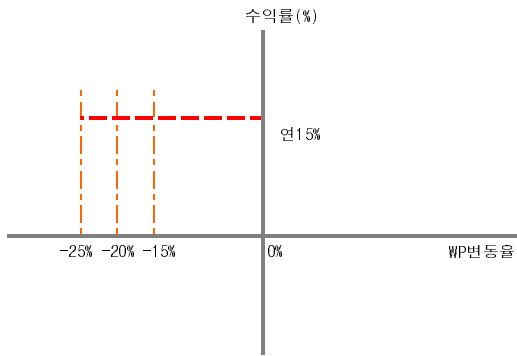
1. 계약금액

단위(백만원)

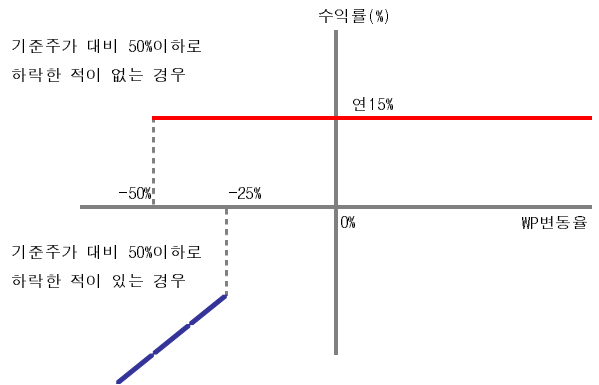
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

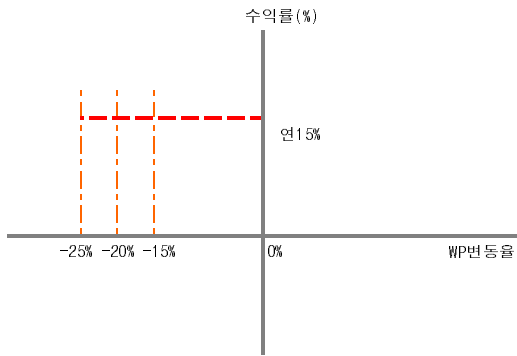
1. 계약금액

단위(백만원)

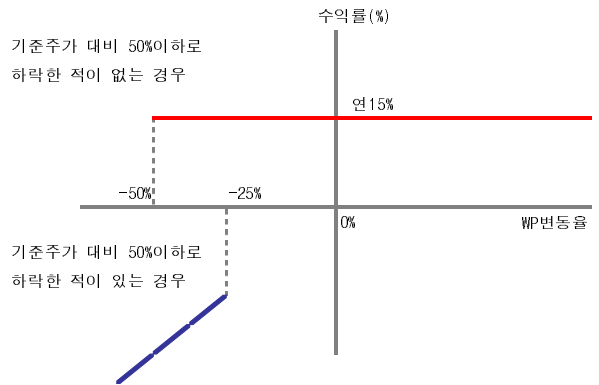
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

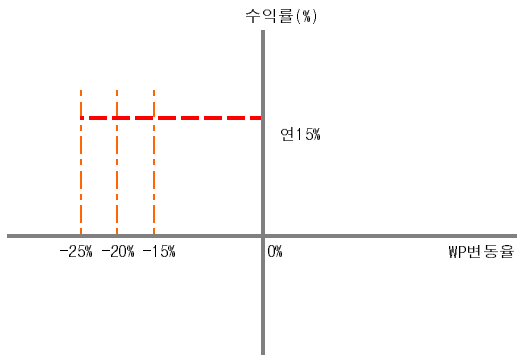
1. 계약금액

단위(백만원)

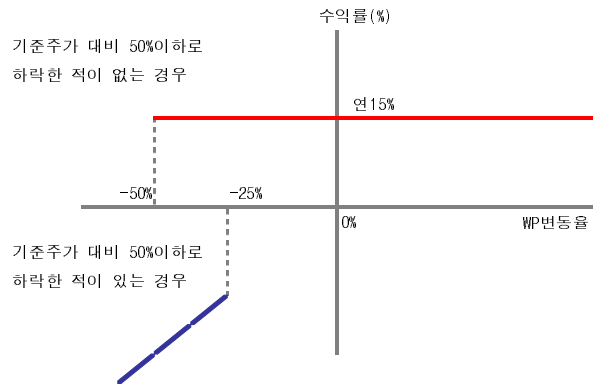
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[24] 메리츠2Star사모증권KISE-2호

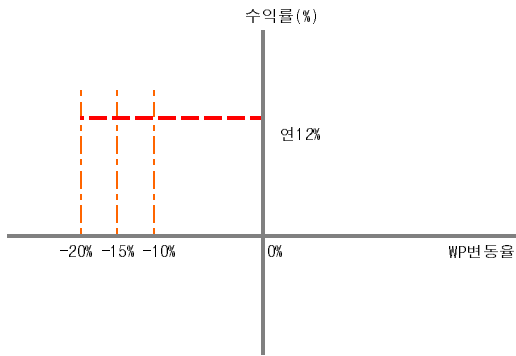
1. 계약금액

단위(백만원)

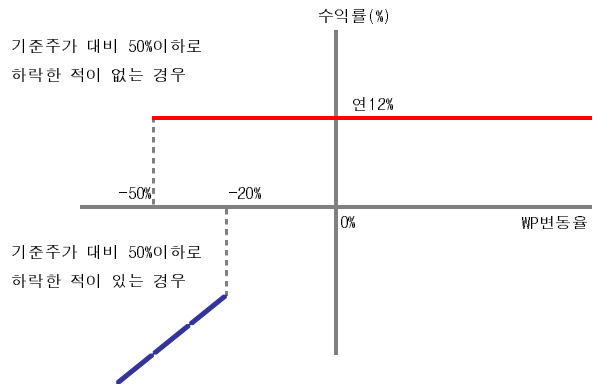
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,412	0	1,412	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6529361WB0 대우증권(ELS)3405

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	3.51	3.40	3.29	3.17	3.06	2.95	2.84
	5.33%	1.26	1.15	1.04	0.93	0.82	0.71	0.60
	2.67%	0.20	0.09	(0.02)	(0.13)	(0.24)	(0.35)	(0.46)
	0.00%	0.33	0.22	0.11	0.00	(0.11)	(0.22)	(0.33)
	-2.67%	1.65	1.54	1.43	1.32	1.21	1.10	0.99
	-5.33%	4.17	4.06	3.95	3.84	3.73	3.62	3.51
	-8.00%	7.87	7.76	7.65	7.54	7.43	7.32	7.21

최대손실 시나리오

위험액	7.21
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	7.07
-----	------

[25] 메리츠2Star사모증권KISE-3호

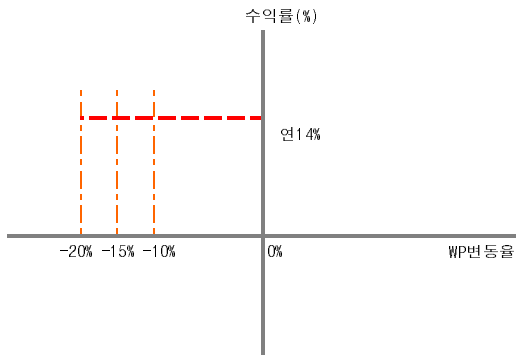
1. 계약금액

단위(백만원)

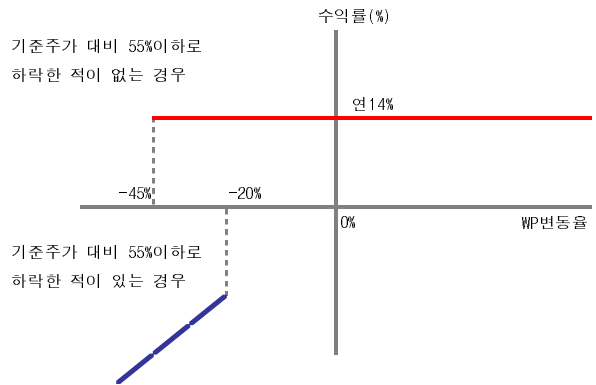
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	285	0	285	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6529363WB6 대우증권(ELS)3408

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	0.85	0.76	0.67	0.59	0.50	0.41	0.32
	5.33%	0.57	0.48	0.39	0.31	0.22	0.13	0.04
	2.67%	0.38	0.29	0.20	0.11	0.02	(0.07)	(0.16)
	0.00%	0.27	0.18	0.09	0.00	(0.09)	(0.18)	(0.27)
	-2.67%	0.24	0.15	0.06	(0.02)	(0.11)	(0.20)	(0.29)
	-5.33%	0.30	0.22	0.13	0.04	(0.05)	(0.14)	(0.23)
	-8.00%	0.45	0.36	0.27	0.19	0.10	0.01	(0.08)

최대손실 시나리오

위험액	-0.08
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.07
-----	------



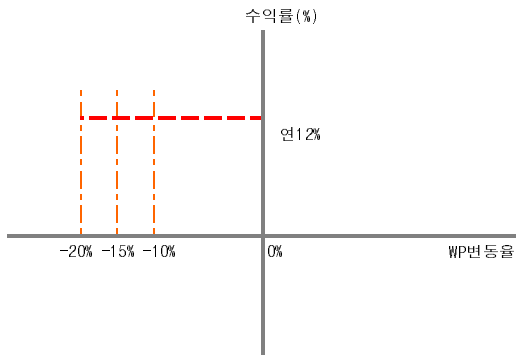
1. 계약금액

단위(백만원)

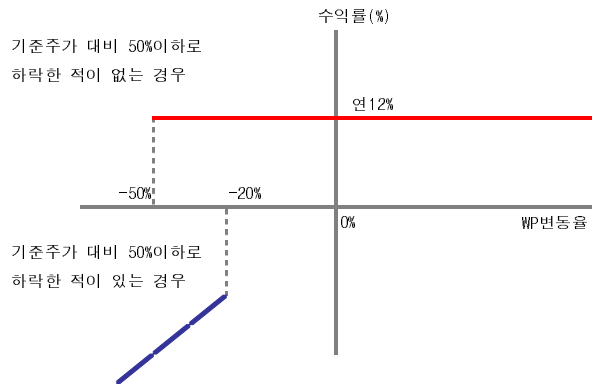
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	452	0	452	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6529379WB2 대우증권(ELS)3434

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	0.73	0.74	0.75	0.76	0.77	0.77	0.78
	5.33%	0.25	0.26	0.26	0.27	0.28	0.29	0.30
	2.67%	(0.01)	0.00	0.01	0.02	0.03	0.04	0.04
	0.00%	(0.02)	(0.02)	(0.01)	0.00	0.01	0.02	0.02
	-2.67%	0.19	0.20	0.21	0.22	0.22	0.23	0.24
	-5.33%	0.64	0.65	0.66	0.66	0.67	0.68	0.69
	-8.00%	1.32	1.33	1.34	1.35	1.36	1.36	1.37

최대손실 시나리오

위험액	1.37
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.10
-----	------

[27] 메리츠2Star사모증권KISE-5호

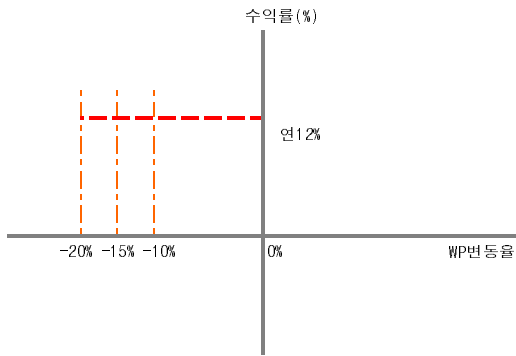
1. 계약금액

단위(백만원)

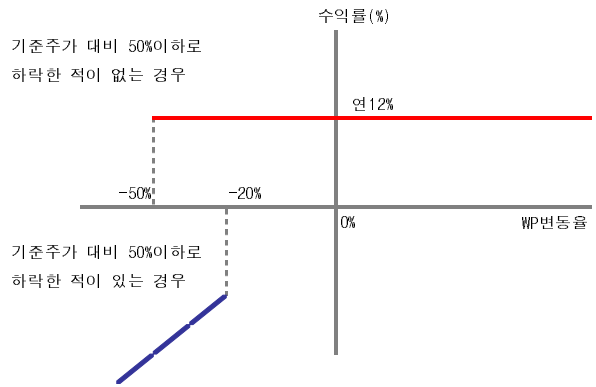
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	983	0	983	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6529379WB2 대우증권(ELS)3434

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	1.59	1.61	1.63	1.65	1.67	1.68	1.70
	5.33%	0.54	0.55	0.57	0.59	0.61	0.63	0.64
	2.67%	(0.01)	0.01	0.02	0.04	0.06	0.08	0.09
	0.00%	(0.05)	(0.04)	(0.02)	0.00	0.02	0.04	0.05
	-2.67%	0.41	0.43	0.45	0.47	0.49	0.50	0.52
	-5.33%	1.39	1.41	1.42	1.44	1.46	1.48	1.50
	-8.00%	2.87	2.89	2.91	2.93	2.94	2.96	2.98

최대손실 시나리오

위험액	2.98
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.39
-----	------

[28] 메리츠2Star사모증권KIST-1호

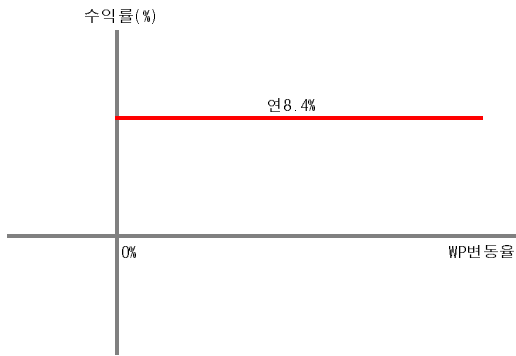
1. 계약금액

단위(백만원)

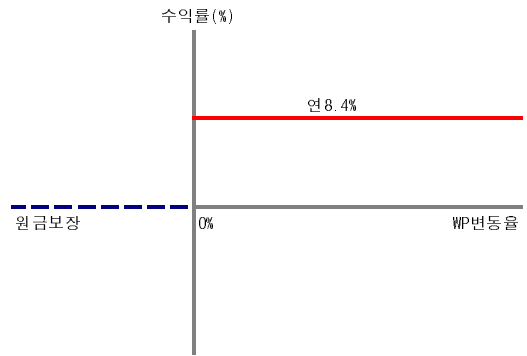
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	9,910	0	9,910	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6669301W96 동양(ELS)306

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	(35.94)	(42.20)	(48.46)	(54.72)	(60.98)	(67.24)	(73.50)
	5.33%	(11.72)	(17.99)	(24.25)	(30.51)	(36.77)	(43.03)	(49.29)
	2.67%	6.52	0.26	(6.01)	(12.27)	(18.53)	(24.79)	(31.05)
	0.00%	18.78	12.52	6.26	0.00	(6.26)	(12.52)	(18.78)
	-2.67%	25.07	18.81	12.55	6.29	0.03	(6.23)	(12.49)
	-5.33%	25.39	19.13	12.87	6.61	0.35	(5.91)	(12.18)
	-8.00%	19.73	13.47	7.21	0.95	(5.31)	(11.57)	(17.84)

최대 손실 시나리오

위험액	-17.84
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	97.99
-----	-------

[29] 메리츠2Star사모증권LCHF-1호

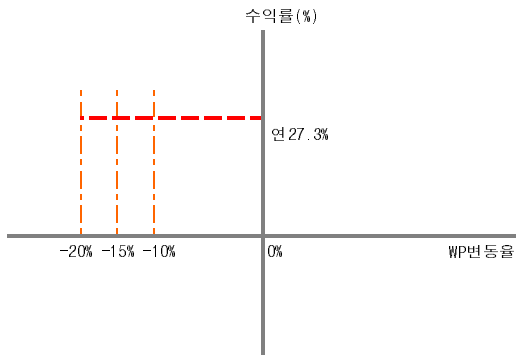
1. 계약금액

단위(백만원)

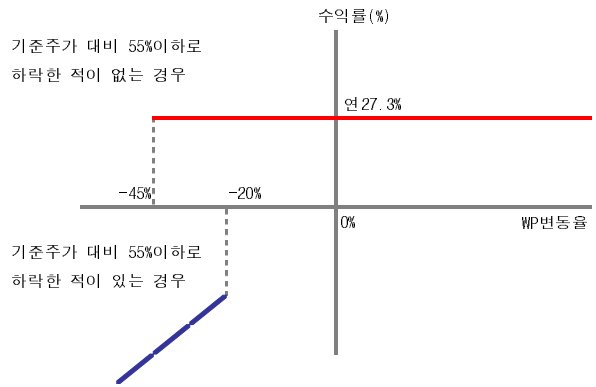
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	632	0	632	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622311WA3 교보증권(ELS)424

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	87.22	82.02	76.82	71.62	66.41	61.21	56.01
	5.33%	62.10	56.90	51.70	46.49	41.29	36.09	30.89
	2.67%	38.23	33.03	27.82	22.62	17.42	12.22	7.02
	0.00%	15.60	10.40	5.20	0.00	(5.20)	(10.40)	(15.60)
	-2.67%	(5.77)	(10.97)	(16.17)	(21.37)	(26.57)	(31.78)	(36.98)
	-5.33%	(25.89)	(31.09)	(36.29)	(41.49)	(46.70)	(51.90)	(57.10)
	-8.00%	(44.76)	(49.96)	(55.17)	(60.37)	(65.57)	(70.77)	(75.97)

최대손실 시나리오

위험액	-75.97
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	104.73
-----	--------

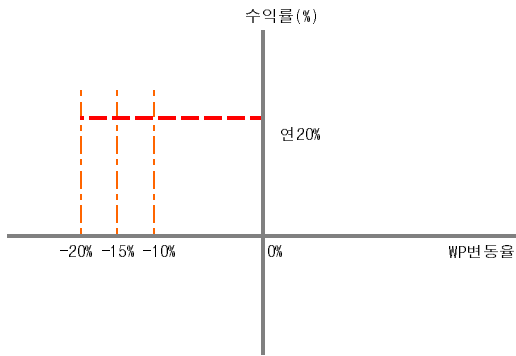
1. 계약금액

단위(백만원)

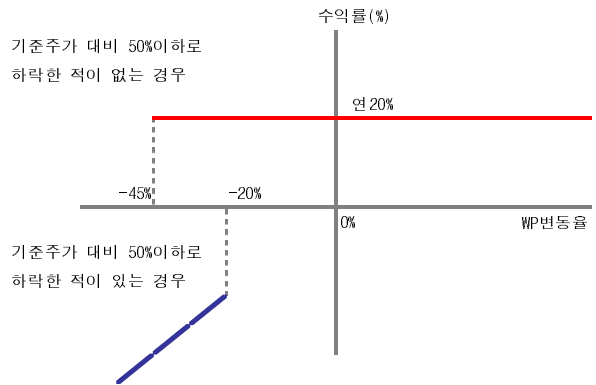
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	506	0	506	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572374WA1 한국투자증권(ELS)1391

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	15.62	12.78	9.94	7.10	4.25	1.41	(1.43)
	5.33%	13.99	11.15	8.31	5.47	2.62	(0.22)	(3.06)
	2.67%	11.63	8.79	5.94	3.10	0.26	(2.58)	(5.43)
	0.00%	8.53	5.68	2.84	0.00	(2.84)	(5.68)	(8.53)
	-2.67%	4.69	1.85	(1.00)	(3.84)	(6.68)	(9.52)	(12.37)
	-5.33%	0.11	(2.73)	(5.57)	(8.41)	(11.26)	(14.10)	(16.94)
	-8.00%	(5.20)	(8.04)	(10.88)	(13.73)	(16.57)	(19.41)	(22.25)

최대손실 시나리오

위험액	-22.25
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	21.26
-----	-------

[31] 메리츠2Star사모증권LEKG-1호

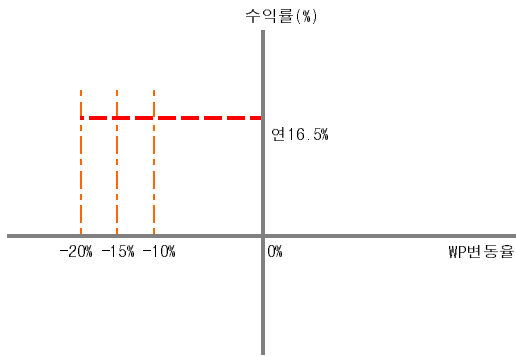
1. 계약금액

단위(백만원)

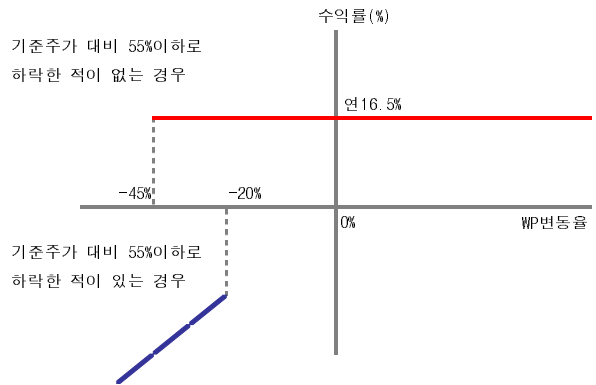
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	572	0	572	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6661308WC7 동양(ELS)404

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	14.67	12.29	9.91	7.54	5.16	2.78	0.40
	5.33%	13.38	11.00	8.62	6.25	3.87	1.49	(0.89)
	2.67%	10.87	8.49	6.11	3.73	1.35	(1.02)	(3.40)
	0.00%	7.14	4.76	2.38	0.00	(2.38)	(4.76)	(7.14)
	-2.67%	2.18	(0.20)	(2.58)	(4.96)	(7.33)	(9.71)	(12.09)
	-5.33%	(4.00)	(6.37)	(8.75)	(11.13)	(13.51)	(15.89)	(18.27)
	-8.00%	(11.39)	(13.77)	(16.15)	(18.53)	(20.91)	(23.29)	(25.67)

최대 손실 시나리오

위험액	-25.67
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.69
-----	-------

[32] 메리츠2Star사모증권LEKM-1호

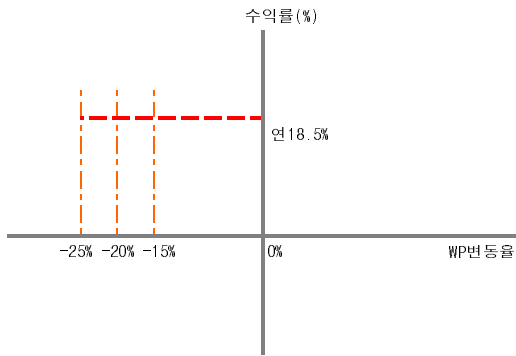
1. 계약금액

단위(백만원)

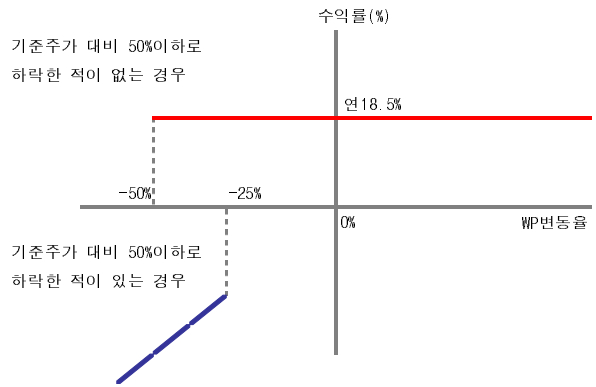
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	362	0	362	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702312WC0 H&D증권(ELS)398

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	4.76	3.84	2.92	2.01	1.09	0.17	(0.75)
	5.33%	4.33	3.41	2.50	1.58	0.66	(0.26)	(1.18)
	2.67%	3.67	2.75	1.83	0.91	(0.01)	(0.93)	(1.85)
	0.00%	2.76	1.84	0.92	0.00	(0.92)	(1.84)	(2.76)
	-2.67%	1.61	0.69	(0.23)	(1.15)	(2.07)	(2.99)	(3.91)
	-5.33%	0.22	(0.70)	(1.62)	(2.54)	(3.46)	(4.37)	(5.29)
	-8.00%	(1.41)	(2.33)	(3.25)	(4.17)	(5.08)	(6.00)	(6.92)

최대손실 시나리오

위험액	-6.92
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.75
-----	------

[33] 메리츠2Star사모증권LESE-1호

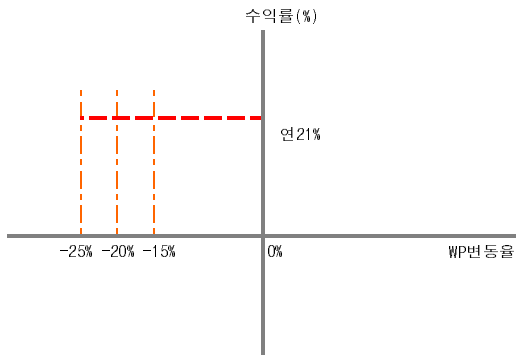
1. 계약금액

단위(백만원)

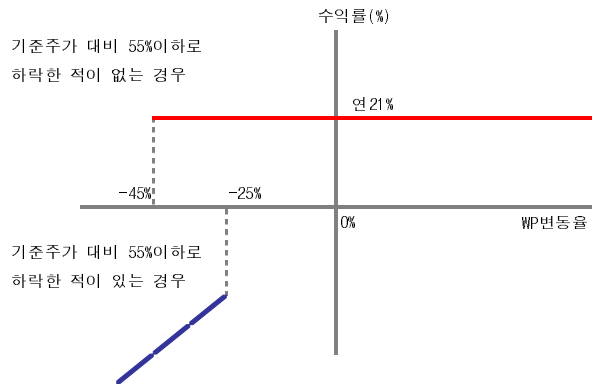
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	748	0	748	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572327WB7 한국투자증권(ELS)1415

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(3.71)	(4.04)	(4.38)	(4.71)	(5.04)	(5.38)	(5.71)
	5.33%	(0.32)	(0.65)	(0.98)	(1.32)	(1.65)	(1.99)	(2.32)
	2.67%	1.25	0.92	0.59	0.25	(0.08)	(0.42)	(0.75)
	0.00%	1.00	0.67	0.33	0.00	(0.33)	(0.67)	(1.00)
	-2.67%	(1.07)	(1.41)	(1.74)	(2.07)	(2.41)	(2.74)	(3.08)
	-5.33%	(4.97)	(5.30)	(5.64)	(5.97)	(6.31)	(6.64)	(6.97)
	-8.00%	(10.69)	(11.02)	(11.36)	(11.69)	(12.03)	(12.36)	(12.69)

최대손실 시나리오

위험액	-12.69
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	10.26
-----	-------



[34] 메리츠2Star사모증권LESH-3호

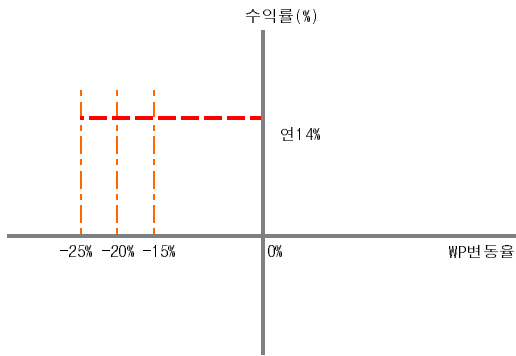
1. 계약금액

단위(백만원)

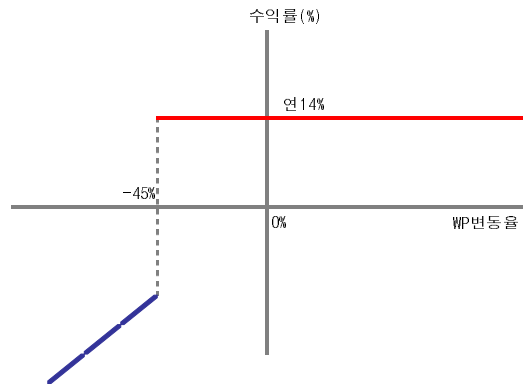
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,104	0	1,104	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6652308WA2 한화스마트(ELS)192

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	28.70	23.74	18.78	13.83	8.87	3.92	(1.04)
	5.33%	25.64	20.69	15.73	10.78	5.82	0.87	(4.09)
	2.67%	21.04	16.08	11.12	6.17	1.21	(3.74)	(8.70)
	0.00%	14.87	9.91	4.96	0.00	(4.96)	(9.91)	(14.87)
	-2.67%	7.14	2.19	(2.77)	(7.73)	(12.68)	(17.64)	(22.59)
	-5.33%	(2.14)	(7.10)	(12.05)	(17.01)	(21.97)	(26.92)	(31.88)
	-8.00%	(12.98)	(17.94)	(22.89)	(27.85)	(32.81)	(37.76)	(42.72)

최대손실 시나리오

위험액	-42.72
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	57.30
-----	-------

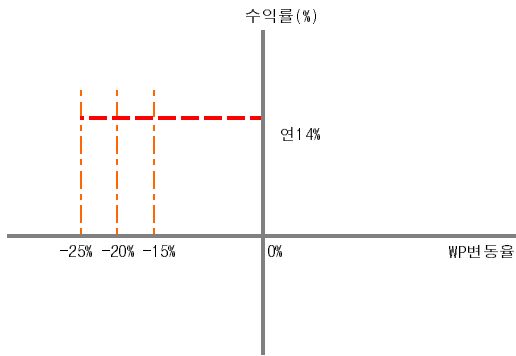
1. 계약금액

단위(백만원)

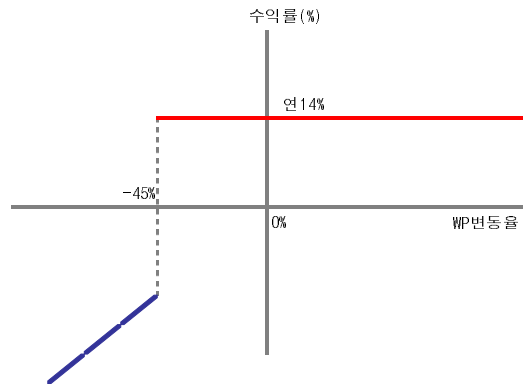
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	487	0	487	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6652308WA2 한화스마트(ELS)192

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	12.67	10.48	8.29	6.10	3.92	1.73	(0.46)
	5.33%	11.32	9.13	6.94	4.76	2.57	0.38	(1.81)
	2.67%	9.28	7.10	4.91	2.72	0.53	(1.65)	(3.84)
	0.00%	6.56	4.38	2.19	0.00	(2.19)	(4.38)	(6.56)
	-2.67%	3.15	0.96	(1.22)	(3.41)	(5.60)	(7.79)	(9.97)
	-5.33%	(0.95)	(3.13)	(5.32)	(7.51)	(9.70)	(11.88)	(14.07)
	-8.00%	(5.73)	(7.92)	(10.11)	(12.29)	(14.48)	(16.67)	(18.86)

최대손실 시나리오

위험액	-18.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.29
-----	-------

[37] 메리츠2Star사모증권SEDM-1호

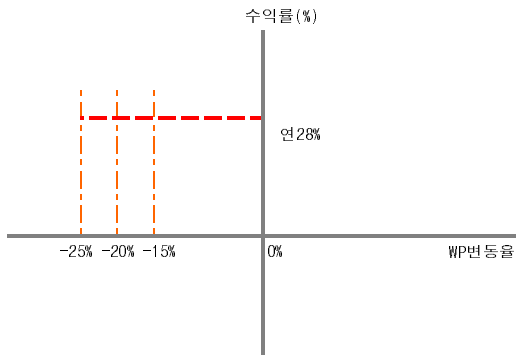
1. 계약금액

단위(백만원)

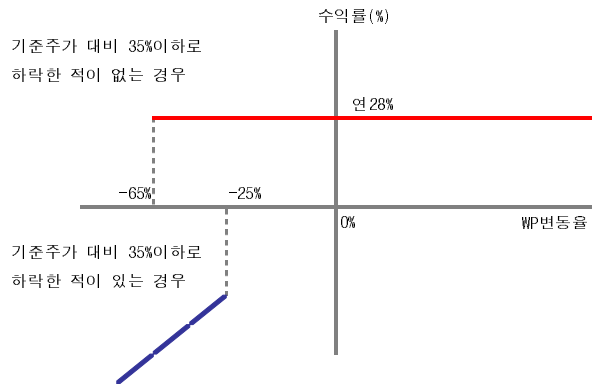
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	445	0	445	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622309W55 교보증권(ELS)344

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	25.56	19.35	13.13	6.91	0.69	(5.53)	(11.75)
	5.33%	23.76	17.54	11.32	5.11	(1.11)	(7.33)	(13.55)
	2.67%	21.46	15.24	9.02	2.80	(3.41)	(9.63)	(15.85)
	0.00%	18.65	12.44	6.22	0.00	(6.22)	(12.44)	(18.65)
	-2.67%	15.35	9.13	2.91	(3.30)	(9.52)	(15.74)	(21.96)
	-5.33%	11.55	5.33	(0.89)	(7.11)	(13.33)	(19.54)	(25.76)
	-8.00%	7.24	1.02	(5.20)	(11.41)	(17.63)	(23.85)	(30.07)

최대손실 시나리오

위험액	-30.07
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	37.42
-----	-------

[38] 메리츠2Star사모증권SELE-2호

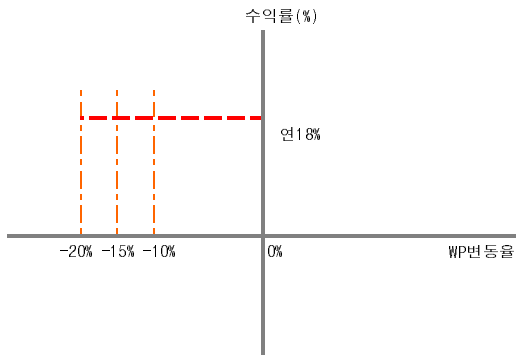
1. 계약금액

단위(백만원)

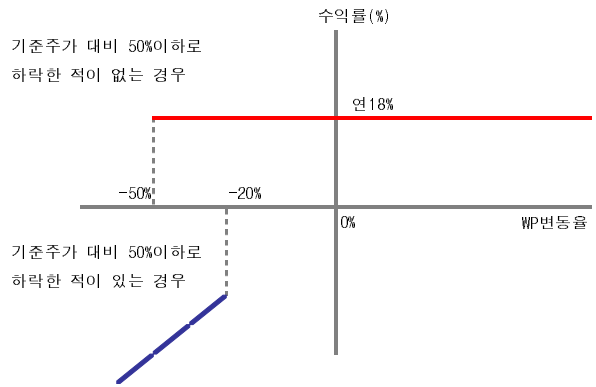
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	644	0	644	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502327WA4 신한투자(ELS)1202

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	21.57	17.80	14.02	10.25	6.48	2.71	(1.07)
	5.33%	18.93	15.16	11.39	7.61	3.84	0.07	(3.70)
	2.67%	15.51	11.74	7.97	4.20	0.42	(3.35)	(7.12)
	0.00%	11.32	7.55	3.77	0.00	(3.77)	(7.55)	(11.32)
	-2.67%	6.34	2.57	(1.20)	(4.97)	(8.75)	(12.52)	(16.29)
	-5.33%	0.59	(3.18)	(6.96)	(10.73)	(14.50)	(18.27)	(22.05)
	-8.00%	(5.94)	(9.72)	(13.49)	(17.26)	(21.03)	(24.81)	(28.58)

최대손실 시나리오

위험액	-28.58
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	27.41
-----	-------

[39] 메리츠2Star사모증권SELE-3호

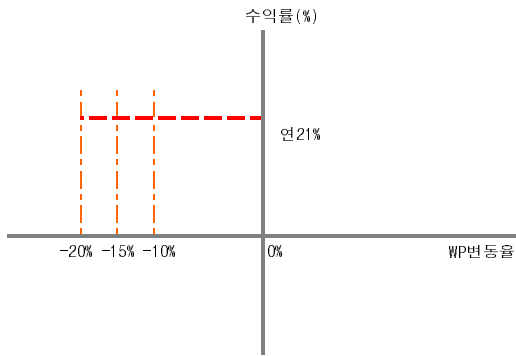
1. 계약금액

단위(백만원)

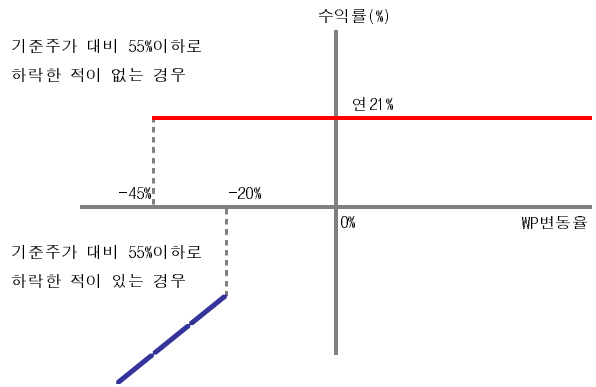
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,890	0	1,890	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662341WB9 동양(ELS)396

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	26.68	21.69	16.70	11.70	6.71	1.72	(3.27)
	5.33%	25.01	20.02	15.03	10.04	5.05	0.05	(4.94)
	2.67%	21.11	16.12	11.13	6.14	1.14	(3.85)	(8.84)
	0.00%	14.98	9.98	4.99	0.00	(4.99)	(9.98)	(14.98)
	-2.67%	6.61	1.61	(3.38)	(8.37)	(13.36)	(18.35)	(23.35)
	-5.33%	(4.00)	(8.99)	(13.98)	(18.97)	(23.96)	(28.96)	(33.95)
	-8.00%	(16.83)	(21.83)	(26.82)	(31.81)	(36.80)	(41.79)	(46.79)

최대손실 시나리오

위험액	-46.79
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	62.87
-----	-------

[ 40 ]                      메리츠2Star사모증권SELE-4호

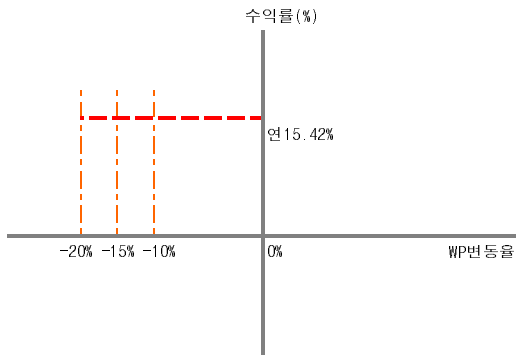
1. 계약금액

단위(백만원)

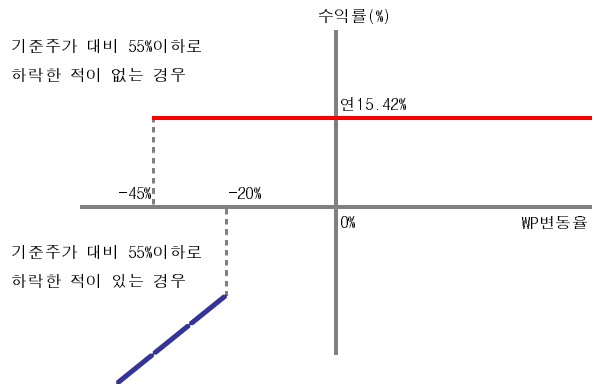
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	937	0	937	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오      KR6502337WB1 신한투자(ELS)1245

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	(0.88)	(1.19)	(1.51)	(1.83)	(2.15)	(2.46)	(2.78)
	5.33%	0.68	0.36	0.05	(0.27)	(0.59)	(0.91)	(1.22)
	2.67%	1.29	0.97	0.66	0.34	0.02	(0.30)	(0.61)
	0.00%	0.95	0.64	0.32	0.00	(0.32)	(0.64)	(0.95)
	-2.67%	(0.33)	(0.65)	(0.97)	(1.29)	(1.61)	(1.92)	(2.24)
	-5.33%	(2.57)	(2.89)	(3.21)	(3.52)	(3.84)	(4.16)	(4.48)
	-8.00%	(5.76)	(6.07)	(6.39)	(6.71)	(7.03)	(7.34)	(7.66)

최대손실 시나리오

위험액	-7.66
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.64
-----	-------

[41] 메리츠2Star사모증권SELE-5호

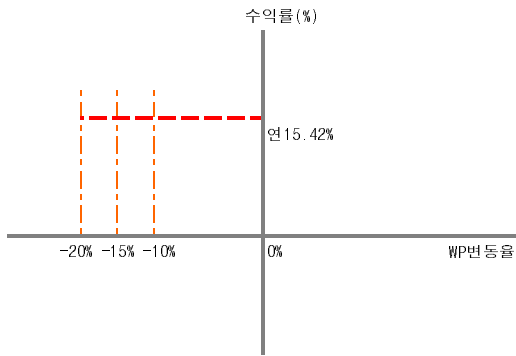
1. 계약금액

단위(백만원)

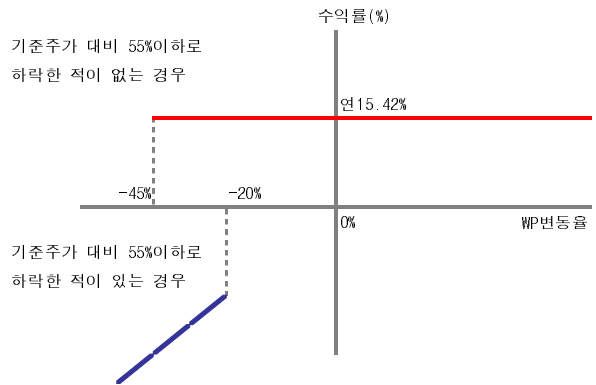
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	158	0	158	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502337WB1 신한투자(ELS)1245

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	(0.15)	(0.20)	(0.26)	(0.31)	(0.36)	(0.42)	(0.47)
	5.33%	0.12	0.06	0.01	(0.05)	(0.10)	(0.15)	(0.21)
	2.67%	0.22	0.16	0.11	0.06	0.00	(0.05)	(0.10)
	0.00%	0.16	0.11	0.05	0.00	(0.05)	(0.11)	(0.16)
	-2.67%	(0.06)	(0.11)	(0.16)	(0.22)	(0.27)	(0.33)	(0.38)
	-5.33%	(0.43)	(0.49)	(0.54)	(0.60)	(0.65)	(0.70)	(0.76)
	-8.00%	(0.97)	(1.03)	(1.08)	(1.13)	(1.19)	(1.24)	(1.30)

최대손실 시나리오

위험액	-1.30
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.81
-----	------

[ 42 ]                      메리츠2Star사모증권SEPO-3호

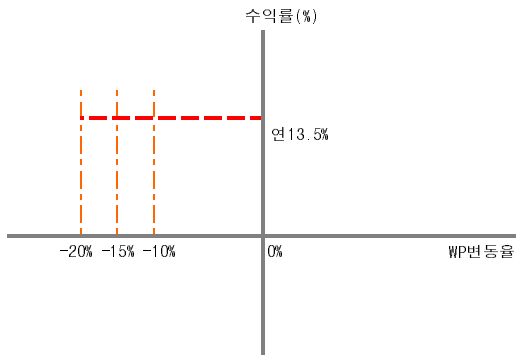
1. 계약금액

단위(백만원)

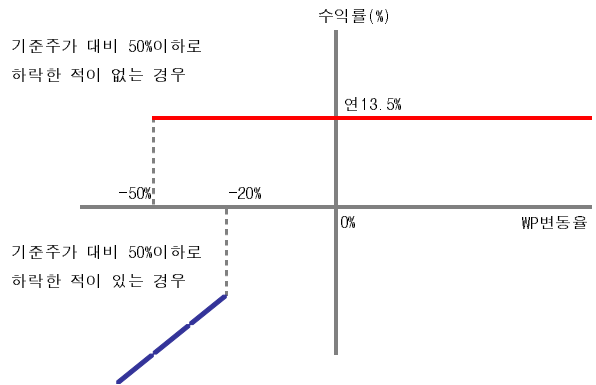
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,030	0	2,030	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오      KR6582309W93    현대증권(ELS)2009-1073

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	(4.69)	(5.21)	(5.73)	(6.25)	(6.77)	(7.30)	(7.82)
	5.33%	(0.76)	(1.28)	(1.80)	(2.32)	(2.84)	(3.36)	(3.88)
	2.67%	1.32	0.80	0.28	(0.24)	(0.76)	(1.28)	(1.80)
	0.00%	1.56	1.04	0.52	0.00	(0.52)	(1.04)	(1.56)
	-2.67%	(0.05)	(0.57)	(1.09)	(1.61)	(2.13)	(2.65)	(3.17)
	-5.33%	(3.51)	(4.03)	(4.55)	(5.07)	(5.59)	(6.11)	(6.63)
	-8.00%	(8.81)	(9.33)	(9.85)	(10.37)	(10.89)	(11.42)	(11.94)

최대손실 시나리오

위험액	-11.94
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.31
-----	-------



[43] 메리츠2Star사모증권SEPO-4호

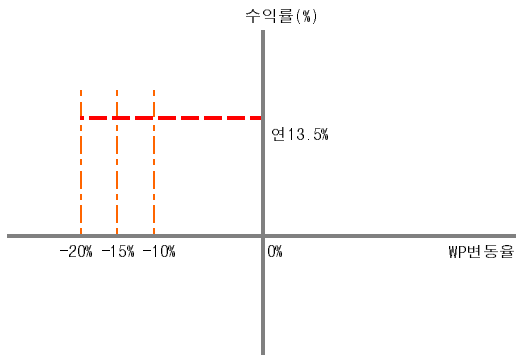
1. 계약금액

단위(백만원)

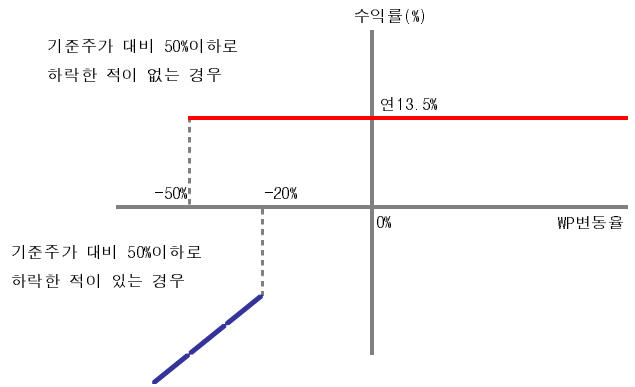
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	49	0	49	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582309W93 현대증권(ELS)2009-1073

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	(0.11)	(0.13)	(0.14)	(0.15)	(0.17)	(0.18)	(0.19)
	5.33%	(0.02)	(0.03)	(0.04)	(0.06)	(0.07)	(0.08)	(0.09)
	2.67%	0.03	0.02	0.01	(0.01)	(0.02)	(0.03)	(0.04)
	0.00%	0.04	0.03	0.01	0.00	(0.01)	(0.03)	(0.04)
	-2.67%	(0.00)	(0.01)	(0.03)	(0.04)	(0.05)	(0.06)	(0.08)
	-5.33%	(0.09)	(0.10)	(0.11)	(0.12)	(0.14)	(0.15)	(0.16)
	-8.00%	(0.21)	(0.23)	(0.24)	(0.25)	(0.27)	(0.28)	(0.29)

최대손실 시나리오

위험액	-0.29
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.76
-----	------

[44] 메리츠2Star사모증권SEPO-5호

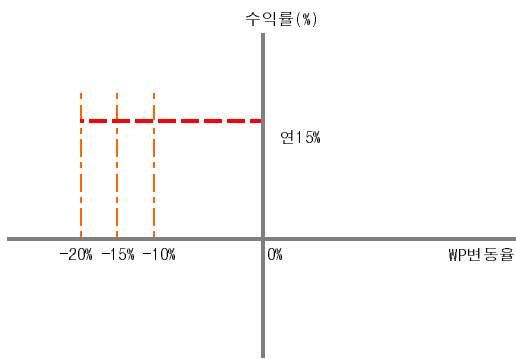
1. 계약금액

단위(백만원)

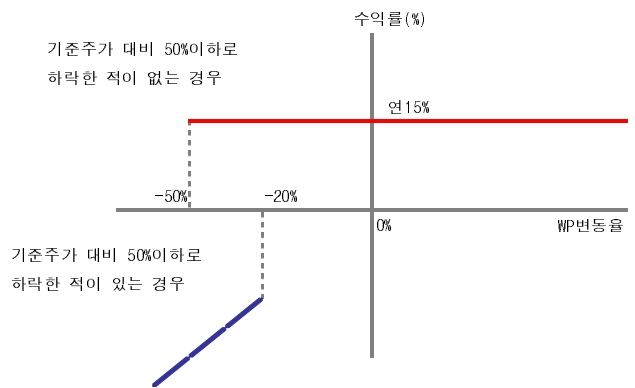
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,044	0	1,044	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502319WA1 신한투자(ELS)1195

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	11.62	9.22	6.81	4.40	2.00	(0.41)	(2.82)
	5.33%	11.10	8.70	6.29	3.88	1.48	(0.93)	(3.34)
	2.67%	9.64	7.23	4.82	2.41	0.01	(2.40)	(4.81)
	0.00%	7.22	4.81	2.41	0.00	(2.41)	(4.81)	(7.22)
	-2.67%	3.86	1.45	(0.95)	(3.36)	(5.77)	(8.18)	(10.58)
	-5.33%	(0.45)	(2.85)	(5.26)	(7.67)	(10.08)	(12.48)	(14.89)
	-8.00%	(5.70)	(8.11)	(10.52)	(12.92)	(15.33)	(17.74)	(20.14)

최대손실 시나리오

위험액	-20.14
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	23.37
-----	-------

[45-1] 메리츠2Star사모증권SESH-5호

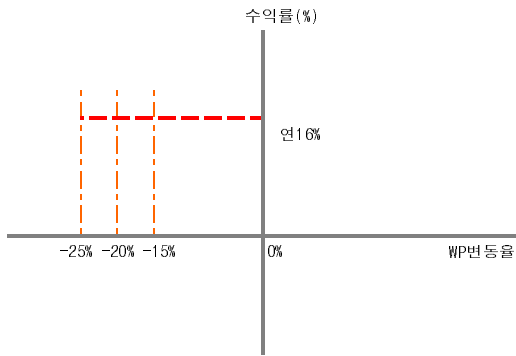
1. 계약금액

단위(백만원)

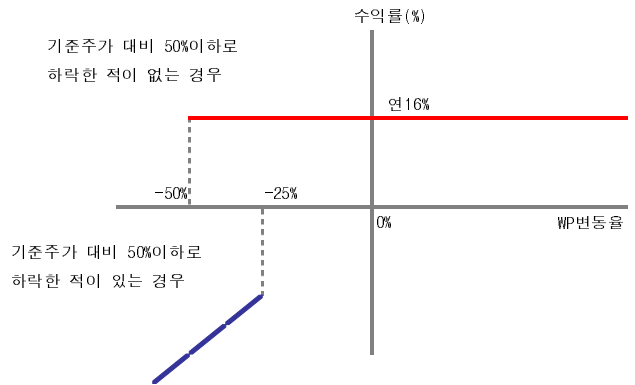
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	225	0	225	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502305W95 신한투자(ELS)1144

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(11.45)	(11.66)	(11.88)	(12.09)	(12.30)	(12.51)	(12.72)
	5.33%	(4.16)	(4.37)	(4.58)	(4.79)	(5.00)	(5.21)	(5.42)
	2.67%	(0.13)	(0.34)	(0.55)	(0.77)	(0.98)	(1.19)	(1.40)
	0.00%	0.63	0.42	0.21	0.00	(0.21)	(0.42)	(0.63)
	-2.67%	(1.87)	(2.08)	(2.29)	(2.50)	(2.71)	(2.92)	(3.13)
	-5.33%	(7.63)	(7.84)	(8.05)	(8.26)	(8.47)	(8.68)	(8.89)
	-8.00%	(16.65)	(16.87)	(17.08)	(17.29)	(17.50)	(17.71)	(17.92)

최대손실 시나리오

위험액	-17.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	18.02
-----	-------

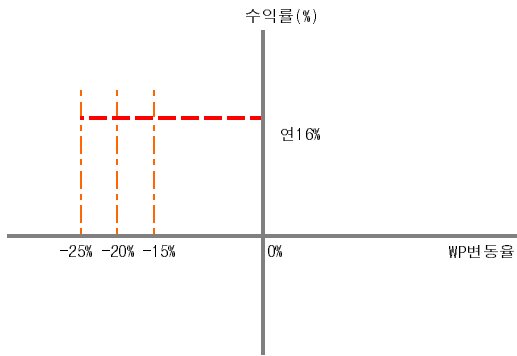
1. 계약금액

단위(백만원)

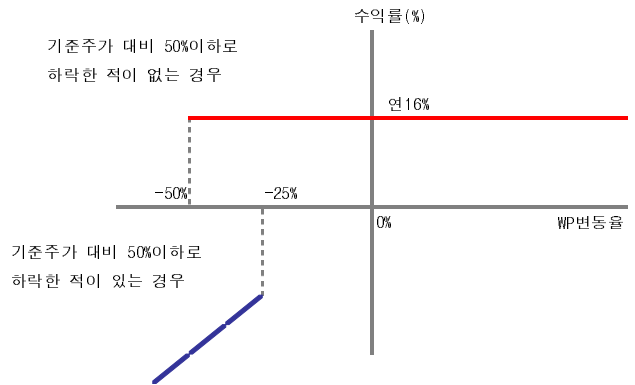
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	225	0	225	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552333W96 우리투자증권(ELS)2619

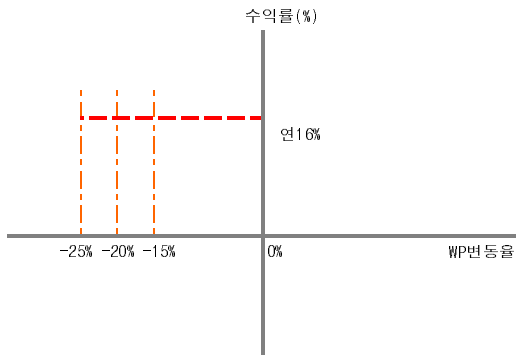
1. 계약금액

단위(백만원)

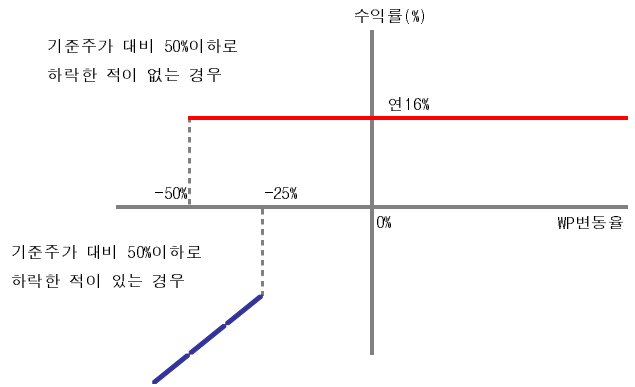
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	224	0	224	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572319W92 한국투자증권(ELS)1327

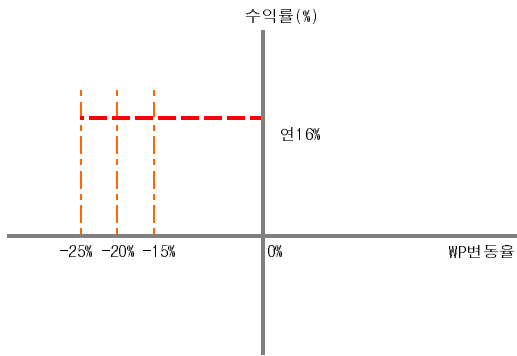
1. 계약금액

단위(백만원)

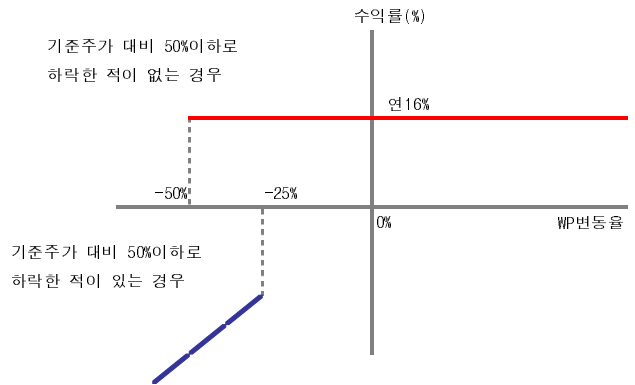
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	225	0	225	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702324W98 H&D증권(ELS)223

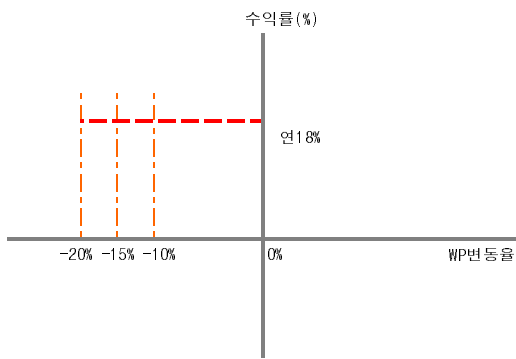
1. 계약금액

단위(백만원)

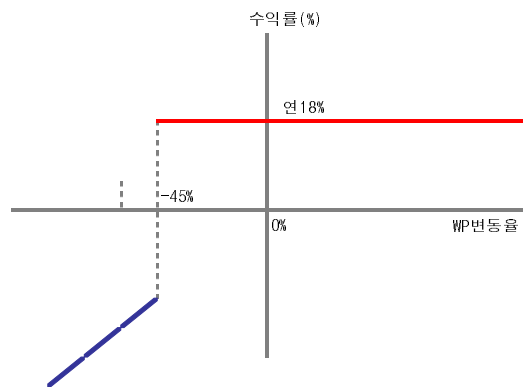
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,012	0	1,012	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	(32.36)	(34.70)	(37.04)	(39.38)	(41.72)	(44.06)	(46.40)
	5.33%	(17.18)	(19.52)	(21.86)	(24.20)	(26.54)	(28.88)	(31.22)
	2.67%	(4.05)	(6.39)	(8.73)	(11.07)	(13.41)	(15.76)	(18.10)
	0.00%	7.02	4.68	2.34	0.00	(2.34)	(4.68)	(7.02)
	-2.67%	16.04	13.70	11.36	9.02	6.68	4.34	2.00
	-5.33%	23.01	20.67	18.33	15.99	13.65	11.31	8.97
	-8.00%	27.93	25.59	23.25	20.91	18.57	16.23	13.88

최대손실 시나리오

위험액	13.88
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.76
-----	-------

[47] 메리츠2Star사모증권SEST-10호

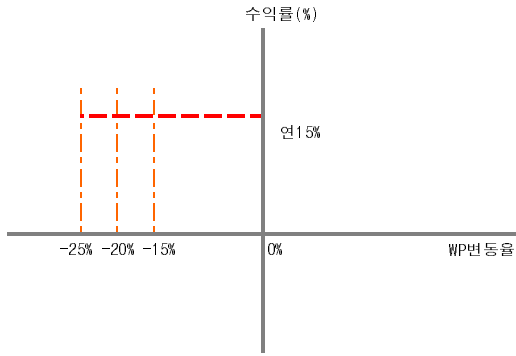
1. 계약금액

단위(백만원)

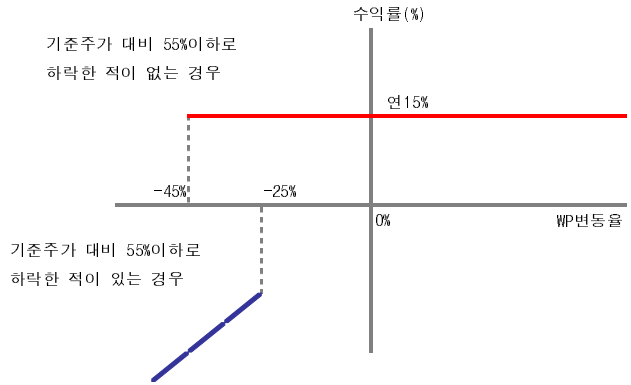
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	889	0	889	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692308WB2 NH투자증권(ELS)205

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	2.36	1.43	0.50	(0.43)	(1.37)	(2.30)	(3.23)
	5.33%	4.07	3.14	2.21	1.28	0.35	(0.58)	(1.51)
	2.67%	4.21	3.28	2.35	1.42	0.49	(0.44)	(1.37)
	0.00%	2.79	1.86	0.93	0.00	(0.93)	(1.86)	(2.79)
	-2.67%	(0.20)	(1.13)	(2.06)	(2.99)	(3.92)	(4.85)	(5.78)
	-5.33%	(4.76)	(5.69)	(6.62)	(7.55)	(8.48)	(9.41)	(10.34)
	-8.00%	(10.89)	(11.82)	(12.75)	(13.68)	(14.61)	(15.54)	(16.47)

최대손실 시나리오

위험액	-16.47
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	15.07
-----	-------



[48] 메리츠2Star사모증권SEST-11호

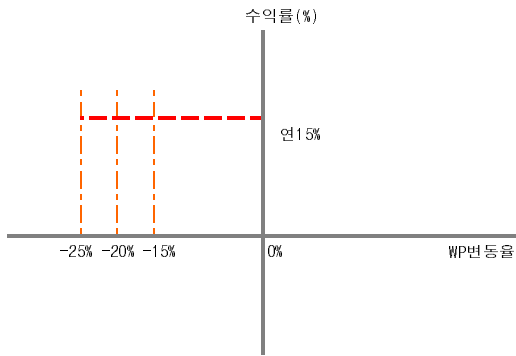
1. 계약금액

단위(백만원)

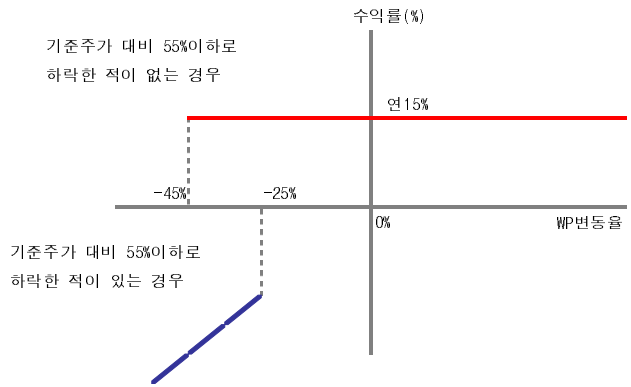
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	395	0	395	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692308WB2 NH투자증권(ELS)205

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	1.05	0.63	0.22	(0.19)	(0.61)	(1.02)	(1.43)
	5.33%	1.81	1.40	0.98	0.57	0.15	(0.26)	(0.67)
	2.67%	1.87	1.46	1.05	0.63	0.22	(0.19)	(0.61)
	0.00%	1.24	0.83	0.41	0.00	(0.41)	(0.83)	(1.24)
	-2.67%	(0.09)	(0.50)	(0.92)	(1.33)	(1.74)	(2.16)	(2.57)
	-5.33%	(2.12)	(2.53)	(2.94)	(3.36)	(3.77)	(4.18)	(4.60)
	-8.00%	(4.84)	(5.25)	(5.67)	(6.08)	(6.49)	(6.91)	(7.32)

최대 손실 시나리오

위험액	-7.32
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	6.70
-----	------

[49] 메리츠2Star사모증권SEST-12호

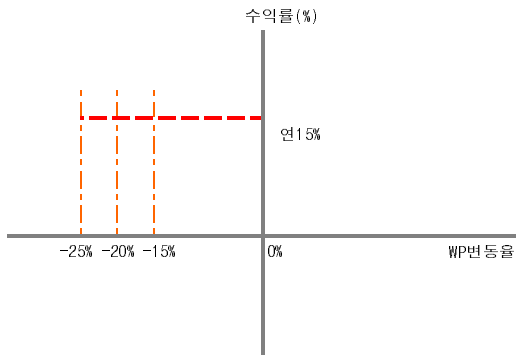
1. 계약금액

단위(백만원)

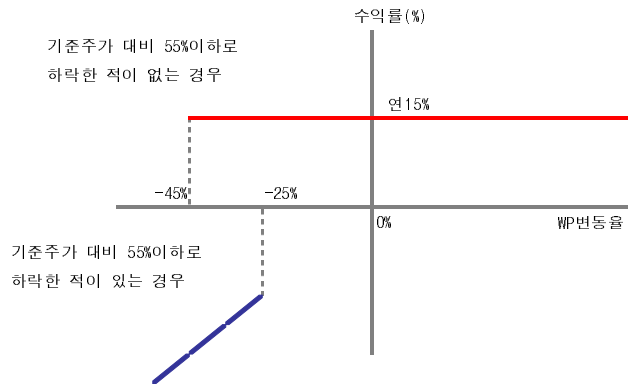
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	610	0	610	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692308WB2 NH투자증권(ELS)205

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	1.62	0.98	0.34	(0.30)	(0.94)	(1.57)	(2.21)
	5.33%	2.79	2.15	1.51	0.88	0.24	(0.40)	(1.04)
	2.67%	2.89	2.25	1.61	0.98	0.34	(0.30)	(0.94)
	0.00%	1.91	1.28	0.64	0.00	(0.64)	(1.28)	(1.91)
	-2.67%	(0.14)	(0.78)	(1.41)	(2.05)	(2.69)	(3.33)	(3.96)
	-5.33%	(3.26)	(3.90)	(4.54)	(5.18)	(5.81)	(6.45)	(7.09)
	-8.00%	(7.46)	(8.10)	(8.74)	(9.38)	(10.01)	(10.65)	(11.29)

최대손실 시나리오

위험액	-11.29
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.33
-----	-------

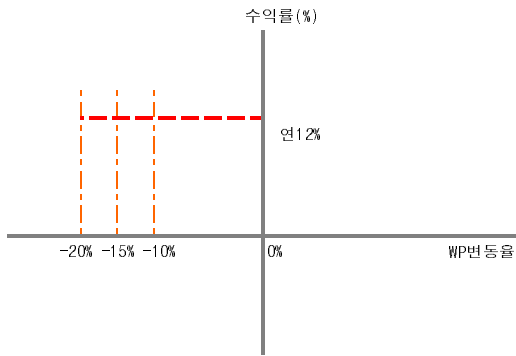
1. 계약금액

단위(백만원)

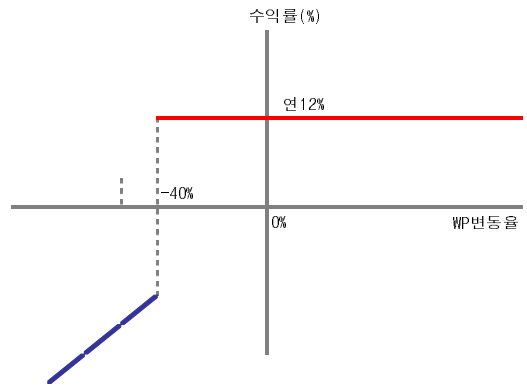
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512118WC1 대신증권(ELS)895

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	3.48	2.78	2.08	1.38	0.68	(0.02)	(0.73)
	5.33%	3.17	2.47	1.77	1.06	0.36	(0.34)	(1.04)
	2.67%	2.71	2.01	1.31	0.60	(0.10)	(0.80)	(1.50)
	0.00%	2.10	1.40	0.70	0.00	(0.70)	(1.40)	(2.10)
	-2.67%	1.36	0.65	(0.05)	(0.75)	(1.45)	(2.15)	(2.85)
	-5.33%	0.46	(0.24)	(0.94)	(1.64)	(2.35)	(3.05)	(3.75)
	-8.00%	(0.58)	(1.28)	(1.98)	(2.68)	(3.38)	(4.09)	(4.79)

최대손실 시나리오

위험액	-4.79
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.65
-----	------

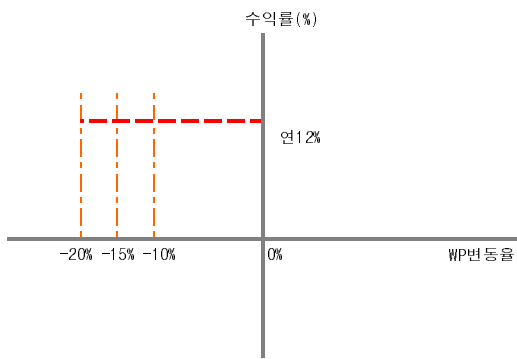
1. 계약금액

단위(백만원)

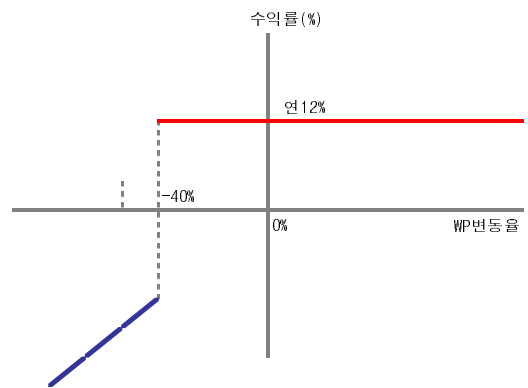
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

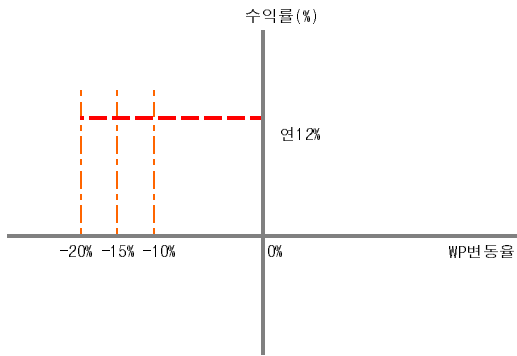
1. 계약금액

단위(백만원)

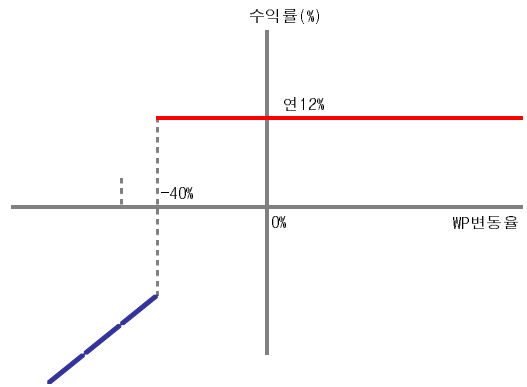
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

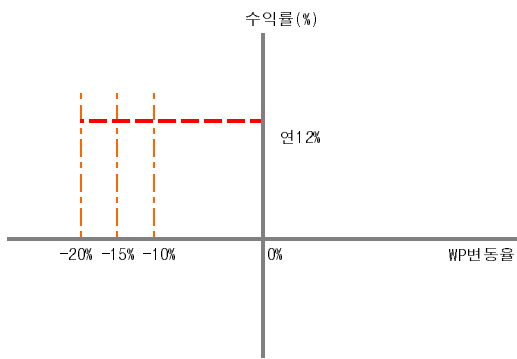
1. 계약금액

단위(백만원)

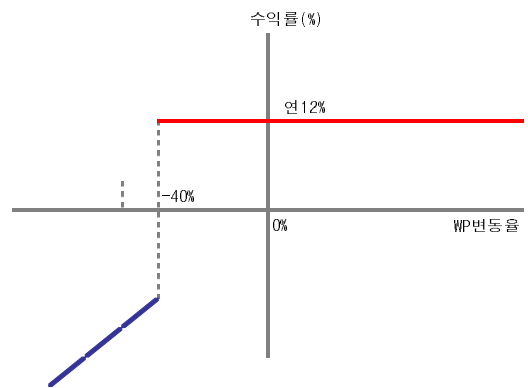
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

[51-1] 메리츠2Star사모증권SEST-14호

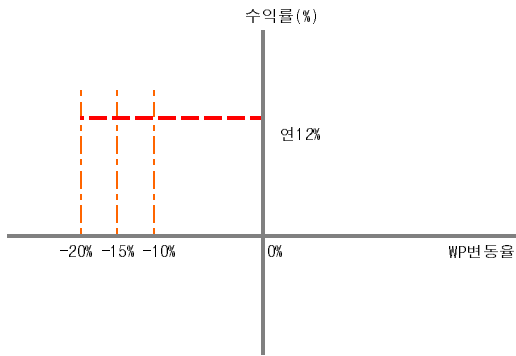
1. 계약금액

단위(백만원)

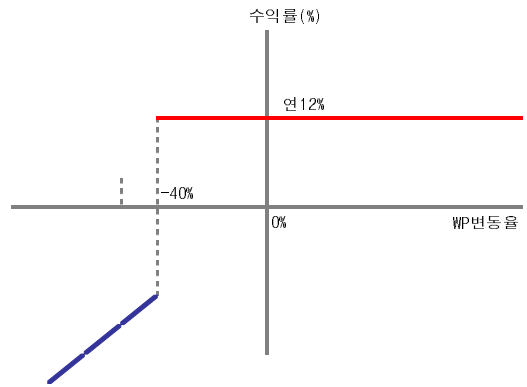
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512118WC1 대신증권(ELS)895

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	3.09	2.47	1.85	1.22	0.60	(0.02)	(0.64)
	5.33%	2.81	2.19	1.57	0.94	0.32	(0.30)	(0.92)
	2.67%	2.40	1.78	1.16	0.54	(0.09)	(0.71)	(1.33)
	0.00%	1.87	1.24	0.62	0.00	(0.62)	(1.24)	(1.87)
	-2.67%	1.20	0.58	(0.04)	(0.66)	(1.29)	(1.91)	(2.53)
	-5.33%	0.41	(0.21)	(0.84)	(1.46)	(2.08)	(2.70)	(3.32)
	-8.00%	(0.51)	(1.13)	(1.76)	(2.38)	(3.00)	(3.62)	(4.25)

최대손실 시나리오

위험액	-4.25
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.12
-----	------

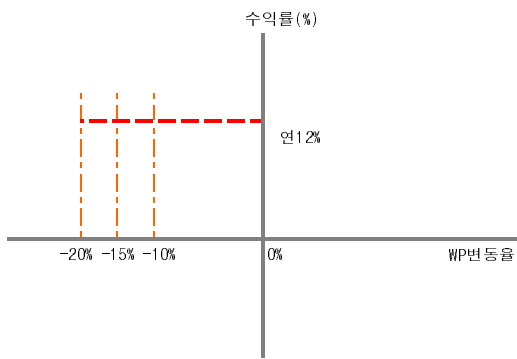
1. 계약금액

단위(백만원)

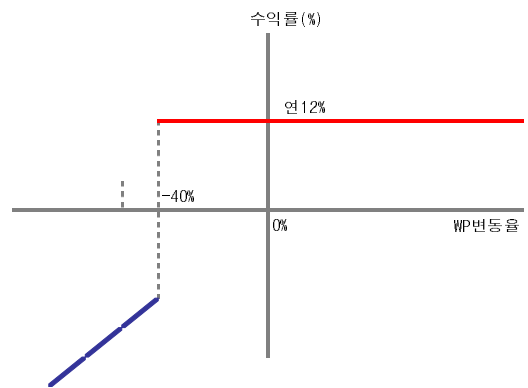
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479



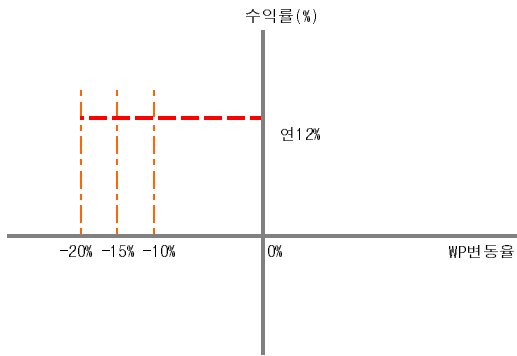
1. 계약금액

단위(백만원)

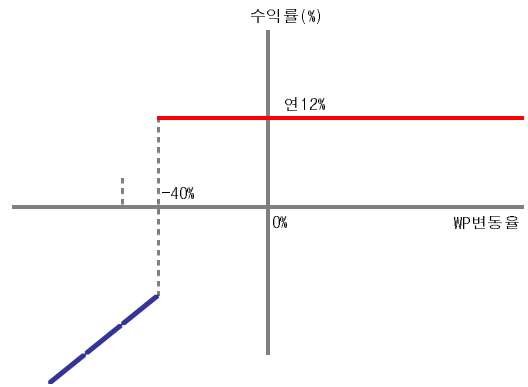
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[51-4]

메리츠2Star사모증권SEST-14호

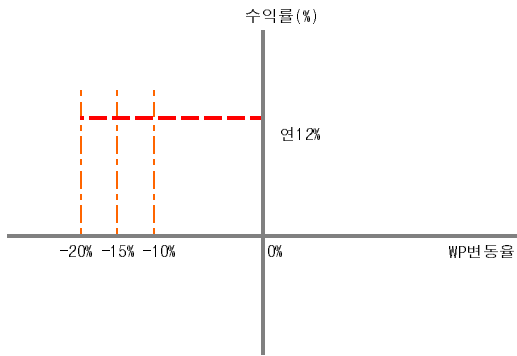
1. 계약금액

단위(백만원)

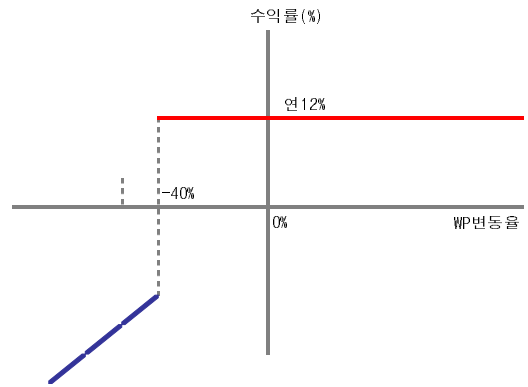
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

[52] 메리츠2Star사모증권SEST-7호

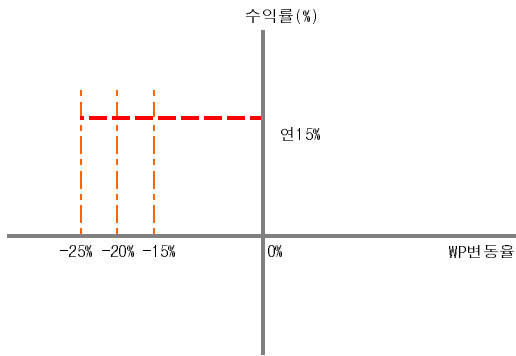
1. 계약금액

단위(백만원)

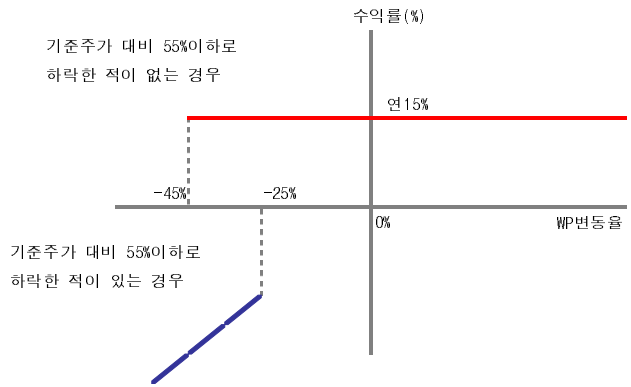
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	919	0	919	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692308WB2 NH투자증권(ELS)205

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	2.44	1.47	0.51	(0.45)	(1.41)	(2.37)	(3.33)
	5.33%	4.21	3.24	2.28	1.32	0.36	(0.60)	(1.56)
	2.67%	4.36	3.39	2.43	1.47	0.51	(0.45)	(1.41)
	0.00%	2.88	1.92	0.96	0.00	(0.96)	(1.92)	(2.88)
	-2.67%	(0.21)	(1.17)	(2.13)	(3.09)	(4.05)	(5.01)	(5.98)
	-5.33%	(4.92)	(5.88)	(6.84)	(7.80)	(8.76)	(9.73)	(10.69)
	-8.00%	(11.25)	(12.21)	(13.17)	(14.13)	(15.10)	(16.06)	(17.02)

최대손실 시나리오

위험액	-17.02
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.58
-----	-------

[53] 메리츠2Star사모증권SEST-8호

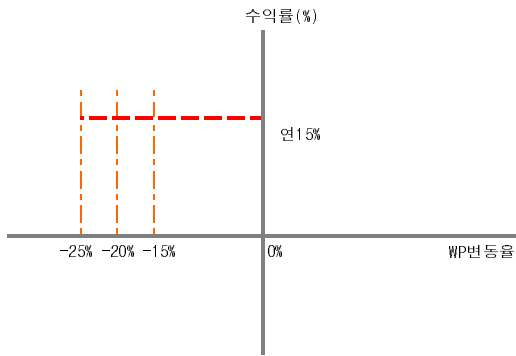
1. 계약금액

단위(백만원)

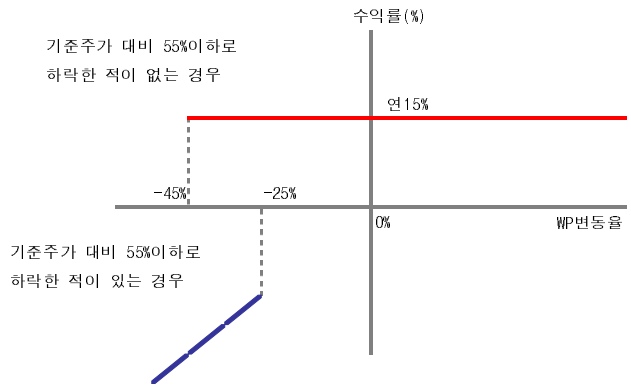
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,651	0	1,651	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692308WB2 NH투자증권(ELS)205

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	4.38	2.65	0.92	(0.81)	(2.54)	(4.26)	(5.99)
	5.33%	7.56	5.83	4.10	2.37	0.65	(1.08)	(2.81)
	2.67%	7.83	6.10	4.37	2.64	0.92	(0.81)	(2.54)
	0.00%	5.18	3.46	1.73	0.00	(1.73)	(3.46)	(5.18)
	-2.67%	(0.37)	(2.10)	(3.83)	(5.56)	(7.28)	(9.01)	(10.74)
	-5.33%	(8.84)	(10.57)	(12.30)	(14.02)	(15.75)	(17.48)	(19.21)
	-8.00%	(20.22)	(21.95)	(23.67)	(25.40)	(27.13)	(28.86)	(30.59)

최대손실 시나리오

위험액	-30.59
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	27.99
-----	-------

[54] 메리츠2Star사모증권SEST-9호

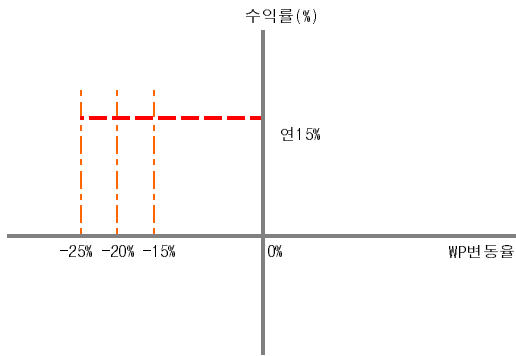
1. 계약금액

단위(백만원)

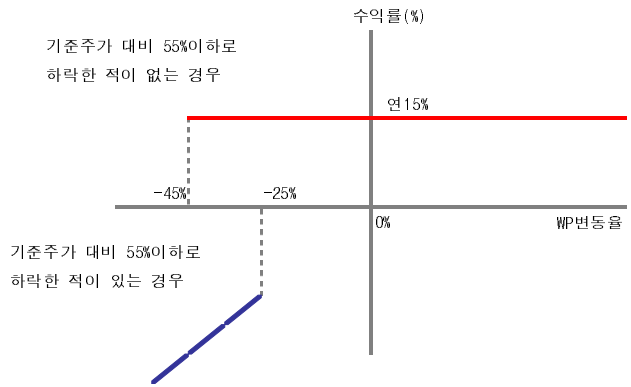
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,589	0	1,589	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692308WB2 NH투자증권(ELS)205

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	4.21	2.55	0.89	(0.78)	(2.44)	(4.10)	(5.77)
	5.33%	7.27	5.61	3.95	2.28	0.62	(1.04)	(2.70)
	2.67%	7.53	5.87	4.21	2.54	0.88	(0.78)	(2.44)
	0.00%	4.99	3.33	1.66	0.00	(1.66)	(3.33)	(4.99)
	-2.67%	(0.36)	(2.02)	(3.68)	(5.35)	(7.01)	(8.67)	(10.33)
	-5.33%	(8.51)	(10.17)	(11.83)	(13.49)	(15.16)	(16.82)	(18.48)
	-8.00%	(19.46)	(21.12)	(22.78)	(24.45)	(26.11)	(27.77)	(29.43)

최대손실 시나리오

위험액	-29.43
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	26.94
-----	-------

[55-1] 메리츠2Star사모증권SEWF-2호

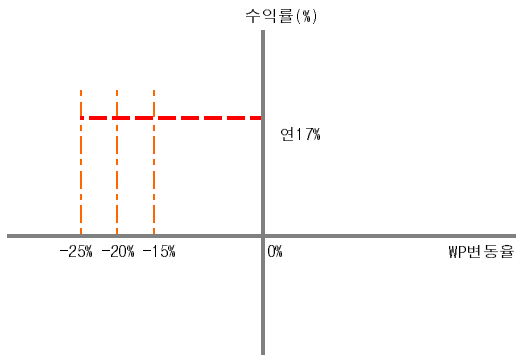
1. 계약금액

단위(백만원)

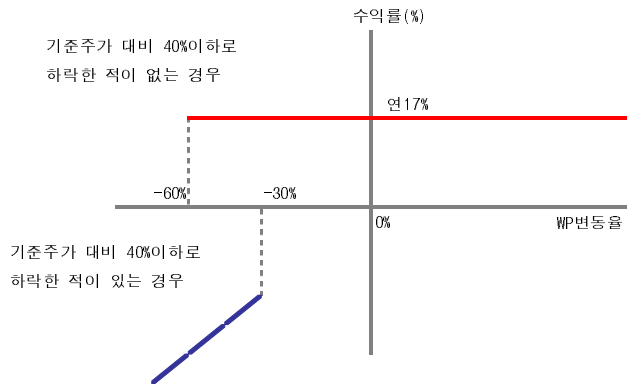
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502301WB7 신한투자(ELS)1206

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	84.15	68.54	52.92	37.31	21.70	6.08	(9.53)
	5.33%	72.39	56.78	41.17	25.55	9.94	(5.68)	(21.29)
	2.67%	59.96	44.34	28.73	13.11	(2.50)	(18.11)	(33.73)
	0.00%	46.84	31.23	15.61	0.00	(15.61)	(31.23)	(46.84)
	-2.67%	33.05	17.44	1.82	(13.79)	(29.41)	(45.02)	(60.64)
	-5.33%	18.58	2.96	(12.65)	(28.26)	(43.88)	(59.49)	(75.11)
	-8.00%	3.43	(12.19)	(27.80)	(43.41)	(59.03)	(74.64)	(90.26)

최대손실 시나리오

위험액	-90.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	74.74
-----	-------

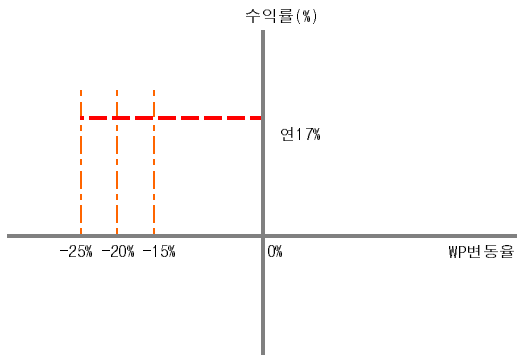
1. 계약금액

단위(백만원)

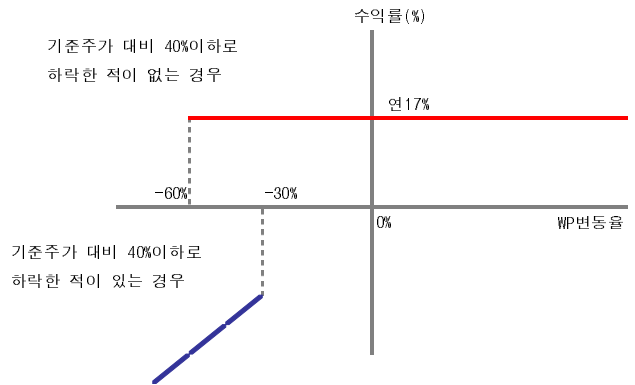
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733

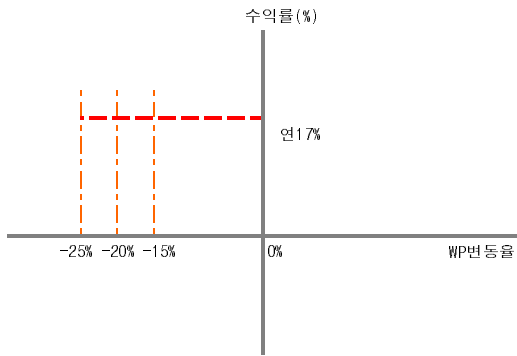
1. 계약금액

단위(백만원)

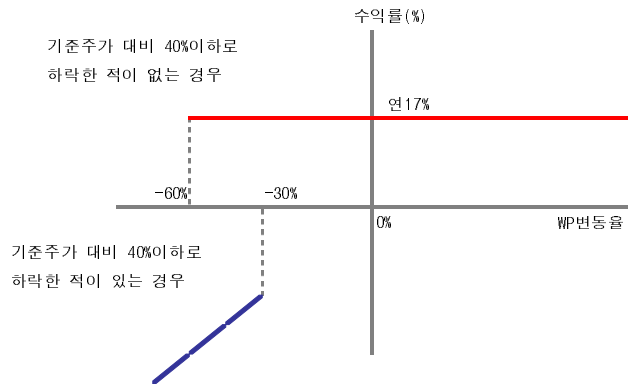
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343



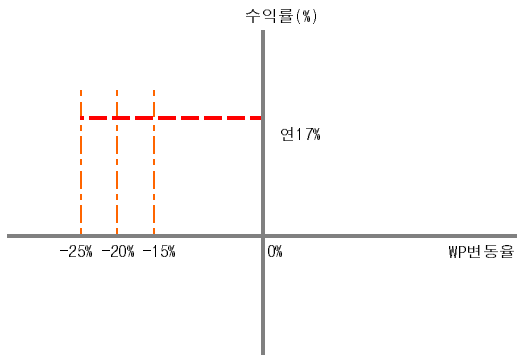
1. 계약금액

단위(백만원)

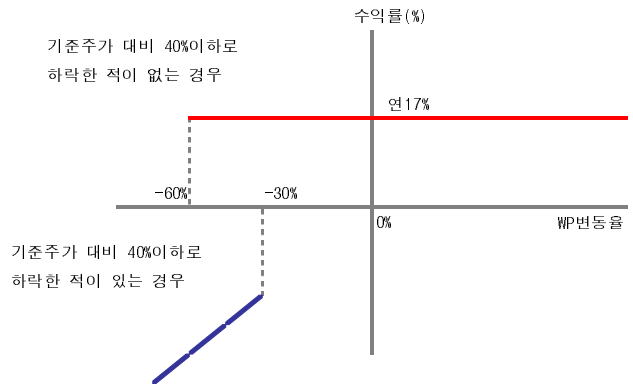
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

[56] 메리츠2Star사모증권SFSE-1호

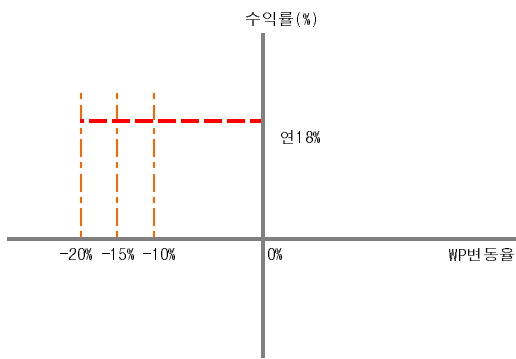
1. 계약금액

단위(백만원)

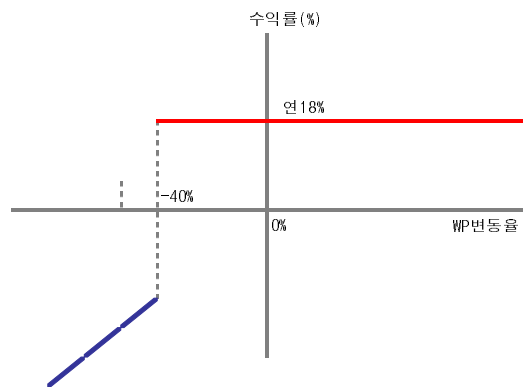
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,512	0	1,512	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662318WC5 동양(ELS)415

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	57.15	49.41	41.66	33.92	26.18	18.44	10.69
	5.33%	47.42	39.68	31.94	24.20	16.45	8.71	0.97
	2.67%	36.12	28.37	20.63	12.89	5.15	(2.60)	(10.34)
	0.00%	23.23	15.48	7.74	0.00	(7.74)	(15.48)	(23.23)
	-2.67%	8.76	1.01	(6.73)	(14.47)	(22.21)	(29.96)	(37.70)
	-5.33%	(7.30)	(15.04)	(22.78)	(30.53)	(38.27)	(46.01)	(53.75)
	-8.00%	(24.94)	(32.68)	(40.42)	(48.16)	(55.91)	(63.65)	(71.39)

최대손실 시나리오

위험액	-71.39
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	113.52
-----	--------

[57] 메리츠2Star사모증권SFSE-2호

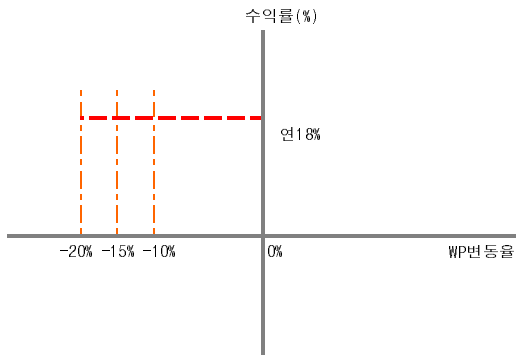
1. 계약금액

단위(백만원)

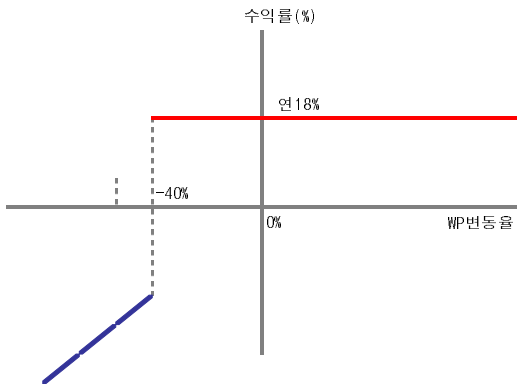
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,720	0	1,720	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662318WC5 동양(ELS)415

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	64.99	56.19	47.38	38.58	29.77	20.97	12.16
	5.33%	53.93	45.13	36.32	27.52	18.71	9.91	1.10
	2.67%	41.07	32.27	23.46	14.66	5.85	(2.95)	(11.76)
	0.00%	26.42	17.61	8.81	0.00	(8.81)	(17.61)	(26.42)
	-2.67%	9.96	1.15	(7.65)	(16.46)	(25.26)	(34.07)	(42.87)
	-5.33%	(8.30)	(17.11)	(25.91)	(34.72)	(43.52)	(52.33)	(61.13)
	-8.00%	(28.36)	(37.16)	(45.97)	(54.77)	(63.58)	(72.38)	(81.19)

최대손실 시나리오

위험액	-81.19
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	129.10
-----	--------

[58] 메리츠2Star사모증권SFSE-3호

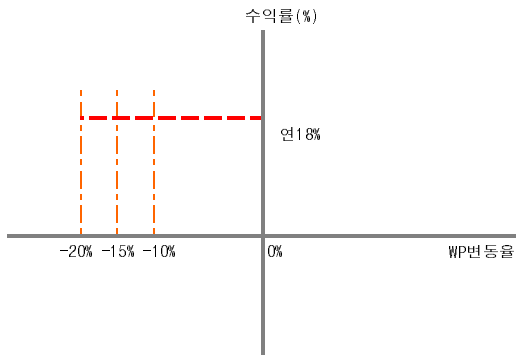
1. 계약금액

단위(백만원)

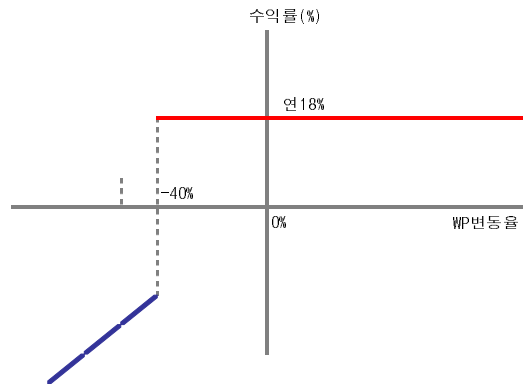
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,177	0	1,177	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662318WC5 동양(ELS)415

구분	변동성 시나리오							
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	44.47	38.45	32.42	26.40	20.37	14.35	8.32
	5.33%	36.90	30.88	24.85	18.83	12.80	6.78	0.75
	2.67%	28.11	22.08	16.06	10.03	4.01	(2.02)	(8.04)
	0.00%	18.08	12.05	6.03	0.00	(6.03)	(12.05)	(18.08)
	-2.67%	6.81	0.79	(5.24)	(11.26)	(17.29)	(23.31)	(29.34)
	-5.33%	(5.68)	(11.71)	(17.73)	(23.76)	(29.78)	(35.81)	(41.83)
	-8.00%	(19.40)	(25.43)	(31.45)	(37.48)	(43.50)	(49.53)	(55.55)

최대손실 시나리오

위험액	-55.55
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	88.34
-----	-------

[59] 메리츠2Star사모증권SFSE-4호

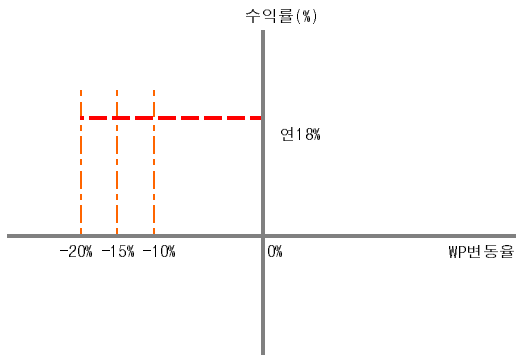
1. 계약금액

단위(백만원)

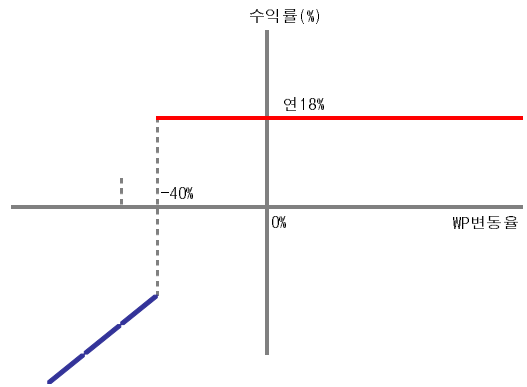
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	332	0	332	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662318WC5 동양(ELS)415

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	12.54	10.84	9.15	7.45	5.75	4.05	2.35
	5.33%	10.41	8.71	7.01	5.31	3.61	1.91	0.21
	2.67%	7.93	6.23	4.53	2.83	1.13	(0.57)	(2.27)
	0.00%	5.10	3.40	1.70	0.00	(1.70)	(3.40)	(5.10)
	-2.67%	1.92	0.22	(1.48)	(3.18)	(4.88)	(6.58)	(8.28)
	-5.33%	(1.60)	(3.30)	(5.00)	(6.70)	(8.40)	(10.10)	(11.80)
	-8.00%	(5.47)	(7.17)	(8.87)	(10.57)	(12.27)	(13.97)	(15.67)

최대손실 시나리오

위험액	-15.67
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.92
-----	-------

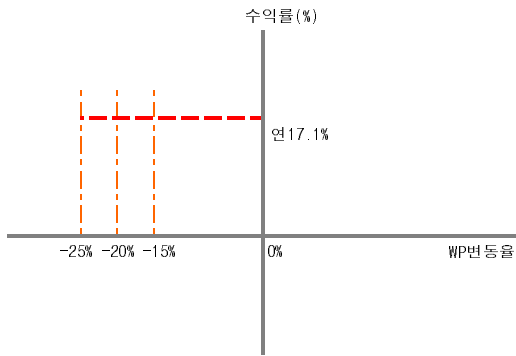
1. 계약금액

단위(백만원)

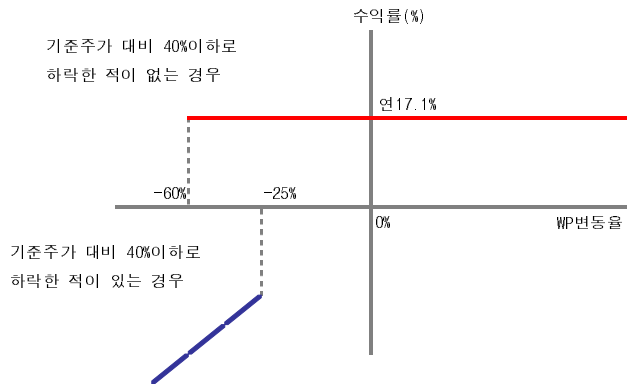
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,503	0	1,503	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622315W81 교보증권(ELS)385

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	93.27	75.27	57.27	39.26	21.26	3.26	(14.75)
	5.33%	82.52	64.52	46.51	28.51	10.51	(7.50)	(25.50)
	2.67%	69.43	51.43	33.43	15.42	(2.58)	(20.58)	(38.59)
	0.00%	54.01	36.01	18.00	0.00	(18.00)	(36.01)	(54.01)
	-2.67%	36.25	18.25	0.24	(17.76)	(35.76)	(53.77)	(71.77)
	-5.33%	16.15	(1.85)	(19.85)	(37.86)	(55.86)	(73.86)	(91.86)
	-8.00%	(6.28)	(24.28)	(42.28)	(60.29)	(78.29)	(96.29)	(114.30)

최대손실 시나리오

위험액	-114.30
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	103.47
-----	--------

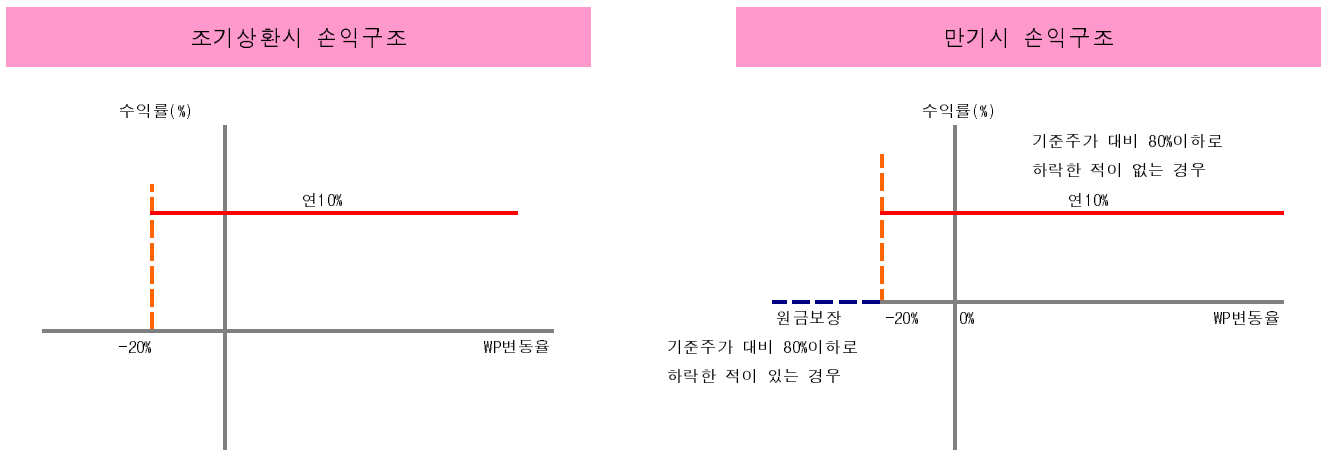
[61] 메리츠2Star사모증권STS0-1호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	522	0	522	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6522313WA0 대우증권(ELS)3286

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	6.31	5.85	5.39	4.93	4.48	4.02	3.56
	5.33%	4.61	4.15	3.70	3.24	2.78	2.32	1.87
	2.67%	2.97	2.51	2.05	1.59	1.14	0.68	0.22
	0.00%	1.37	0.92	0.46	0.00	(0.46)	(0.92)	(1.37)
	-2.67%	(0.17)	(0.63)	(1.09)	(1.54)	(2.00)	(2.46)	(2.92)
	-5.33%	(1.66)	(2.12)	(2.58)	(3.04)	(3.49)	(3.95)	(4.41)
	-8.00%	(3.11)	(3.56)	(4.02)	(4.48)	(4.94)	(5.39)	(5.85)

최대손실 시나리오

위험액	-5.85
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	5.66
-----	------

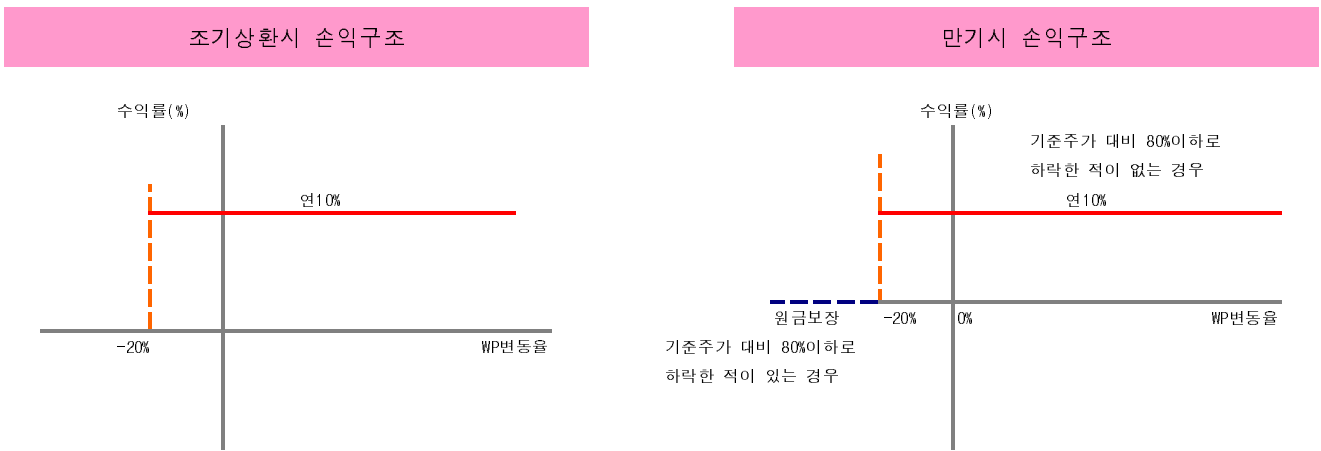
[62] 메리츠2Star사모증권STS0-2호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	209	0	209	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6522313WA0 대우증권(ELS)3286

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	2.53	2.35	2.16	1.98	1.80	1.61	1.43
	5.33%	1.85	1.67	1.48	1.30	1.12	0.93	0.75
	2.67%	1.19	1.01	0.82	0.64	0.46	0.27	0.09
	0.00%	0.55	0.37	0.18	0.00	(0.18)	(0.37)	(0.55)
	-2.67%	(0.07)	(0.25)	(0.44)	(0.62)	(0.80)	(0.99)	(1.17)
	-5.33%	(0.67)	(0.85)	(1.04)	(1.22)	(1.40)	(1.59)	(1.77)
	-8.00%	(1.25)	(1.43)	(1.61)	(1.80)	(1.98)	(2.17)	(2.35)

최대손실 시나리오

위험액	-2.35
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.27
-----	------



[63] 메리츠2Star사모파생상품G-11호

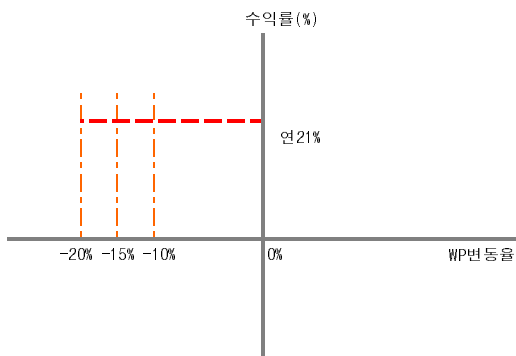
1. 계약금액

단위(백만원)

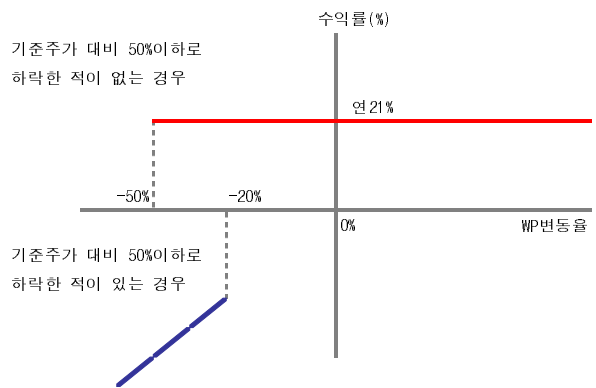
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	235	0	235	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552326W20 우리투자증권(ELS)2315

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	1.03	0.11	(0.80)	(1.72)	(2.63)	(3.54)	(4.46)
	5.33%	2.32	1.40	0.49	(0.42)	(1.34)	(2.25)	(3.17)
	2.67%	2.89	1.98	1.06	0.15	(0.77)	(1.68)	(2.59)
	0.00%	2.74	1.83	0.91	0.00	(0.91)	(1.83)	(2.74)
	-2.67%	1.87	0.96	0.04	(0.87)	(1.78)	(2.70)	(3.61)
	-5.33%	0.28	(0.63)	(1.55)	(2.46)	(3.37)	(4.29)	(5.20)
	-8.00%	(2.03)	(2.94)	(3.86)	(4.77)	(5.68)	(6.60)	(7.51)

최대손실 시나리오

위험액	-7.51
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7.92
-----	------

[64] 메리츠2Star사모HVCJ-1호

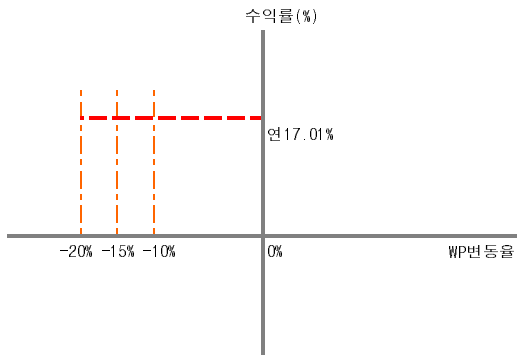
1. 계약금액

단위(백만원)

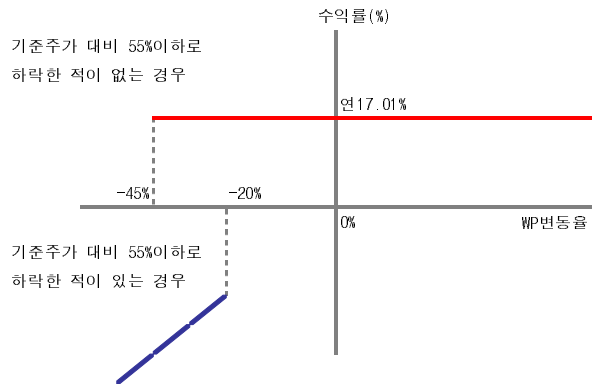
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	660	0	660	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582324W86 현대증권(ELS)2009-1049

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	8.97	7.49	6.00	4.52	3.03	1.55	0.06
	5.33%	8.45	6.97	5.48	4.00	2.51	1.03	(0.46)
	2.67%	6.95	5.46	3.98	2.49	1.01	(0.48)	(1.96)
	0.00%	4.45	2.97	1.48	0.00	(1.48)	(2.97)	(4.45)
	-2.67%	0.98	(0.50)	(1.99)	(3.47)	(4.96)	(6.44)	(7.93)
	-5.33%	(3.48)	(4.96)	(6.45)	(7.93)	(9.42)	(10.90)	(12.39)
	-8.00%	(8.92)	(10.41)	(11.89)	(13.38)	(14.86)	(16.35)	(17.83)

최대손실 시나리오

위험액	-17.83
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.65
-----	-------

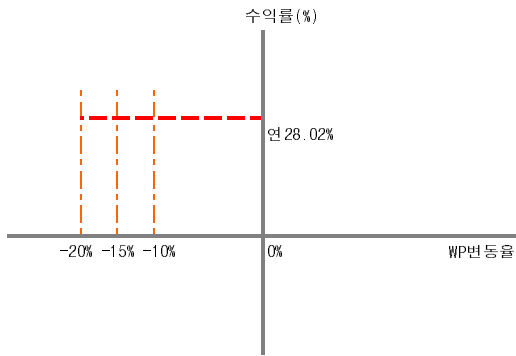
1. 계약금액

단위(백만원)

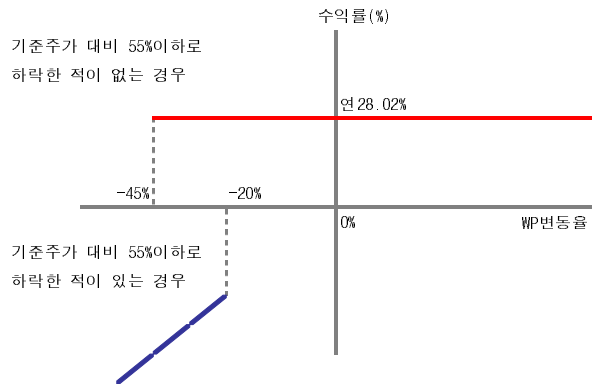
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	786	0	786	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572332W87 한국투자증권(ELS)1297

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	9.06	7.40	5.74	4.08	2.42	0.76	(0.90)
	5.33%	8.81	7.15	5.49	3.83	2.17	0.51	(1.15)
	2.67%	7.45	5.79	4.13	2.47	0.81	(0.85)	(2.51)
	0.00%	4.98	3.32	1.66	0.00	(1.66)	(3.32)	(4.98)
	-2.67%	1.41	(0.25)	(1.91)	(3.57)	(5.23)	(6.89)	(8.55)
	-5.33%	(3.27)	(4.93)	(6.59)	(8.25)	(9.91)	(11.57)	(13.23)
	-8.00%	(9.05)	(10.71)	(12.37)	(14.03)	(15.69)	(17.35)	(19.01)

최대손실 시나리오

위험액	-19.01
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.75
-----	-------

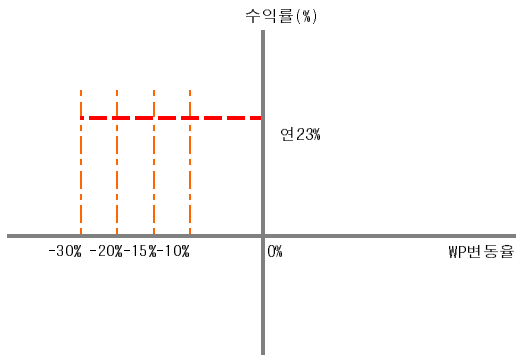
1. 계약금액

단위(백만원)

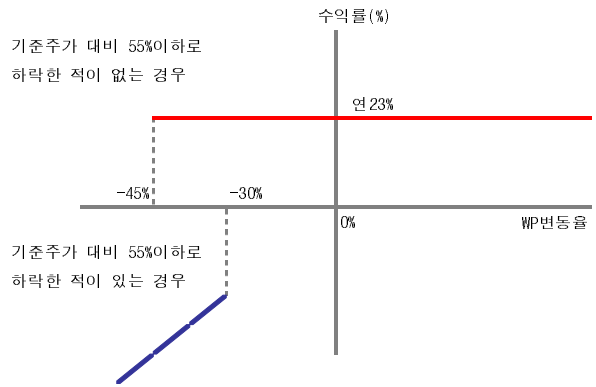
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	4,985	0	4,985	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552350W86 우리투자증권(ELS)2567

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	(113.66)	(119.22)	(124.78)	(130.35)	(135.91)	(141.47)	(147.04)
	5.33%	(36.99)	(42.55)	(48.12)	(53.68)	(59.24)	(64.81)	(70.37)
	2.67%	6.46	0.89	(4.67)	(10.23)	(15.80)	(21.36)	(26.92)
	0.00%	16.69	11.13	5.56	0.00	(5.56)	(11.13)	(16.69)
	-2.67%	(6.29)	(11.86)	(17.42)	(22.98)	(28.55)	(34.11)	(39.68)
	-5.33%	(62.50)	(68.06)	(73.62)	(79.19)	(84.75)	(90.31)	(95.88)
	-8.00%	(151.91)	(157.48)	(163.04)	(168.60)	(174.17)	(179.73)	(185.29)

최대손실 시나리오

위험액	-185.29
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46.91
-----	-------

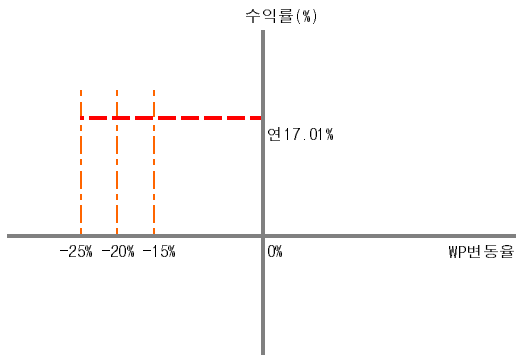
1. 계약금액

단위(백만원)

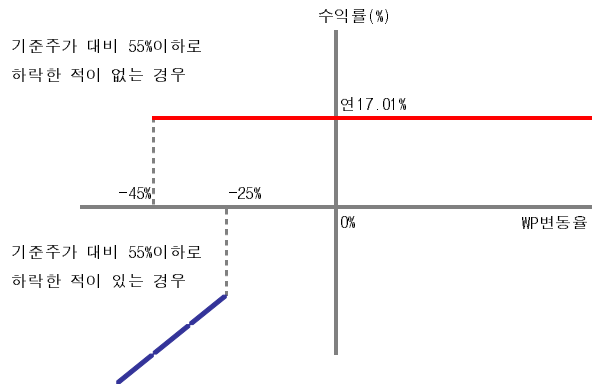
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	226	0	226	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572354W80 한국투자증권(ELS)1312

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	16.39	14.37	12.36	10.34	8.33	6.32	4.30
	5.33%	13.34	11.32	9.31	7.29	5.28	3.27	1.25
	2.67%	9.89	7.88	5.86	3.85	1.83	(0.18)	(2.20)
	0.00%	6.04	4.03	2.01	0.00	(2.01)	(4.03)	(6.04)
	-2.67%	1.80	(0.22)	(2.23)	(4.25)	(6.26)	(8.27)	(10.29)
	-5.33%	(2.84)	(4.86)	(6.87)	(8.89)	(10.90)	(12.92)	(14.93)
	-8.00%	(7.89)	(9.90)	(11.92)	(13.93)	(15.95)	(17.96)	(19.97)

최대손실 시나리오

위험액	-19.97
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.92
-----	-------

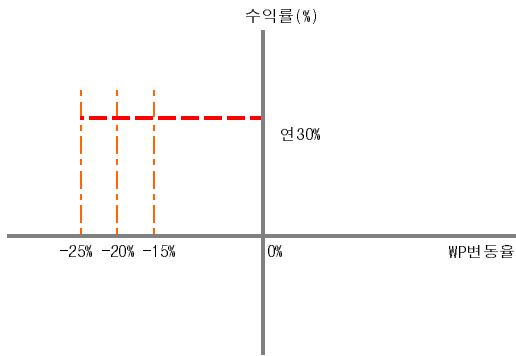
1. 계약금액

단위(백만원)

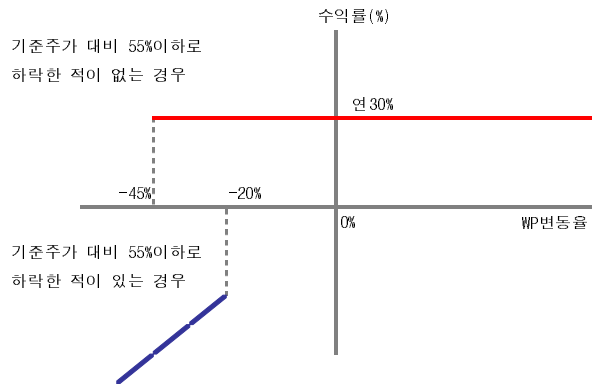
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241	0	241	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572336W75 한국투자증권(ELS)1270

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	8.56	7.39	6.21	5.04	3.86	2.69	1.51
	5.33%	7.51	6.34	5.16	3.99	2.81	1.64	0.46
	2.67%	5.83	4.66	3.48	2.31	1.14	(0.04)	(1.21)
	0.00%	3.52	2.35	1.17	0.00	(1.17)	(2.35)	(3.52)
	-2.67%	0.58	(0.59)	(1.77)	(2.94)	(4.12)	(5.29)	(6.47)
	-5.33%	(2.99)	(4.16)	(5.34)	(6.51)	(7.69)	(8.86)	(10.04)
	-8.00%	(7.19)	(8.36)	(9.54)	(10.71)	(11.89)	(13.06)	(14.24)

최대손실 시나리오

위험액	-14.24
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	15.94
-----	-------

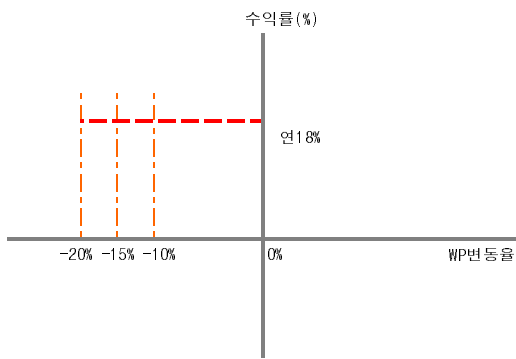
1. 계약금액

단위(백만원)

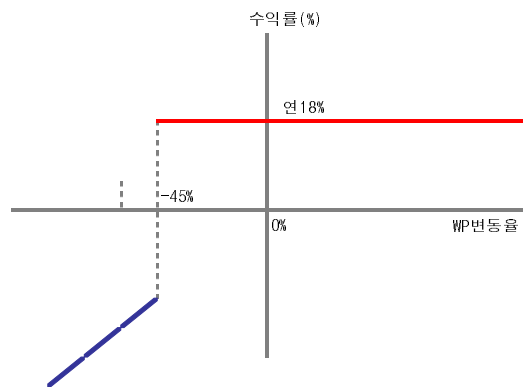
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	557	0	557	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692312W38 NH투자증권(ELS)21

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	(17.80)	(19.09)	(20.38)	(21.66)	(22.95)	(24.24)	(25.53)
	5.33%	(9.45)	(10.74)	(12.03)	(13.31)	(14.60)	(15.89)	(17.18)
	2.67%	(2.23)	(3.52)	(4.80)	(6.09)	(7.38)	(8.67)	(9.96)
	0.00%	3.86	2.58	1.29	0.00	(1.29)	(2.58)	(3.86)
	-2.67%	8.83	7.54	6.25	4.96	3.68	2.39	1.10
	-5.33%	12.66	11.37	10.08	8.80	7.51	6.22	4.93
	-8.00%	15.36	14.08	12.79	11.50	10.21	8.93	7.64

최대손실 시나리오

위험액	7.64
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	21.87
-----	-------

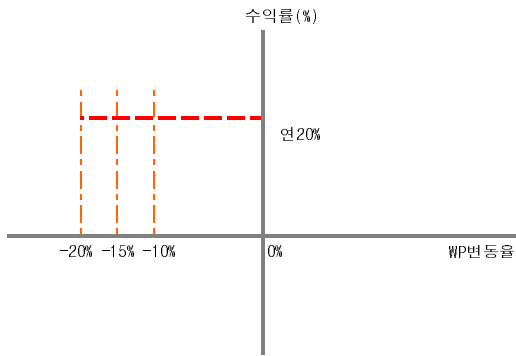
1. 계약금액

단위(백만원)

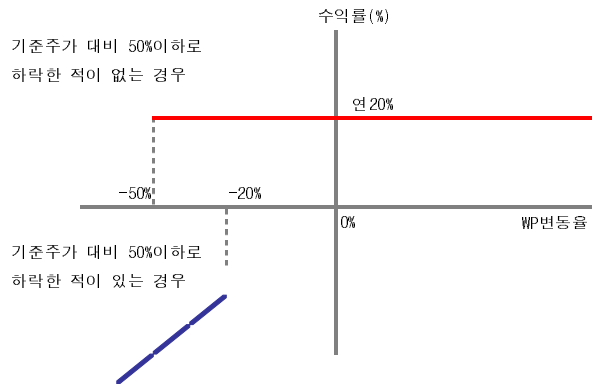
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	239	0	239	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552345W35 우리투자증권(ELS)2382

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(9.02)	(9.64)	(10.27)	(10.89)	(11.51)	(12.14)	(12.76)
	5.33%	(4.73)	(5.36)	(5.98)	(6.60)	(7.23)	(7.85)	(8.48)
	2.67%	(1.10)	(1.73)	(2.35)	(2.97)	(3.60)	(4.22)	(4.85)
	0.00%	1.87	1.25	0.62	0.00	(0.62)	(1.25)	(1.87)
	-2.67%	4.19	3.57	2.94	2.32	1.69	1.07	0.45
	-5.33%	5.86	5.23	4.61	3.98	3.36	2.73	2.11
	-8.00%	6.86	6.24	5.62	4.99	4.37	3.74	3.12

최대손실 시나리오

위험액	3.12
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.54
-----	-------



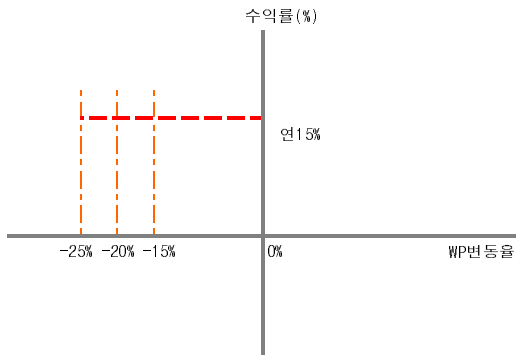
1. 계약금액

단위(백만원)

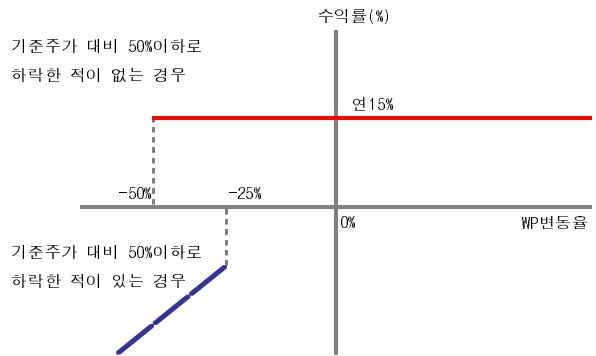
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552359WB4 우리투자증권(ELS)2765

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	184.09	155.28	126.47	97.66	68.86	40.05	11.24
	5.33%	156.15	127.34	98.53	69.73	40.92	12.11	(16.70)
	2.67%	123.59	94.79	65.98	37.17	8.36	(20.44)	(49.25)
	0.00%	86.42	57.62	28.81	0.00	(28.81)	(57.62)	(86.42)
	-2.67%	44.63	15.83	(12.98)	(41.79)	(70.60)	(99.40)	(128.21)
	-5.33%	(1.77)	(30.58)	(59.39)	(88.19)	(117.00)	(145.81)	(174.62)
	-8.00%	(52.79)	(81.60)	(110.41)	(139.21)	(168.02)	(196.83)	(225.64)

최대손실 시나리오

위험액	-225.64
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	272.33
-----	--------

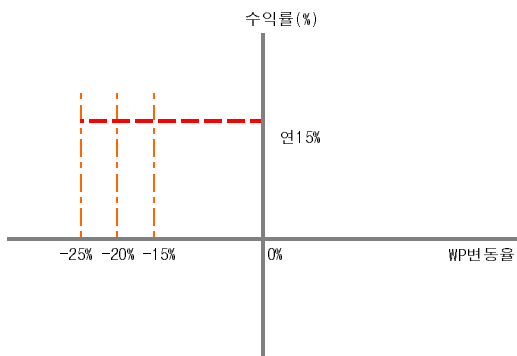
1. 계약금액

단위(백만원)

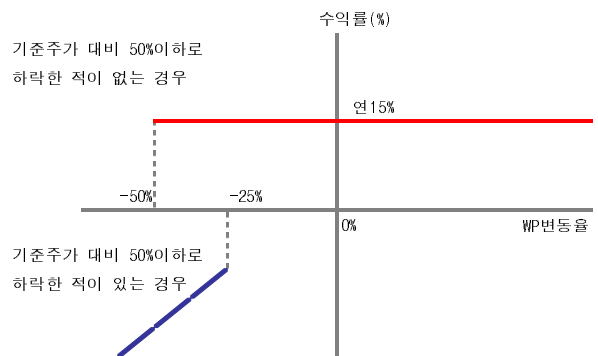
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[77-3]

메리츠2Star증권KGSH-1호

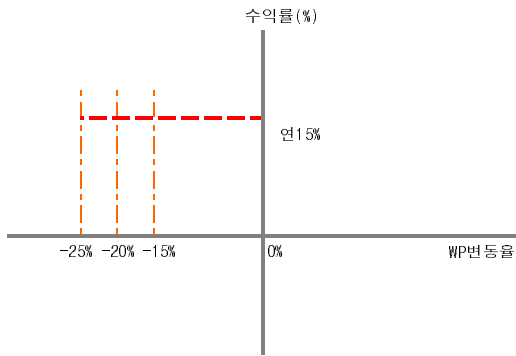
1. 계약금액

단위(백만원)

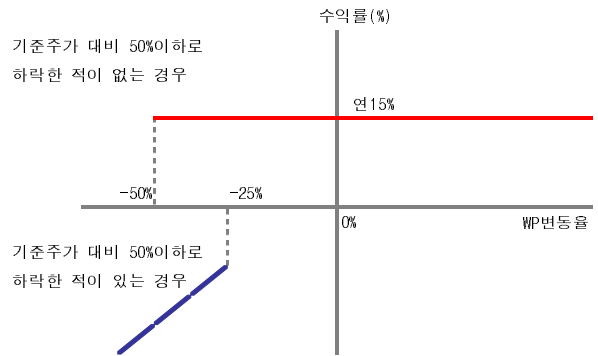
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

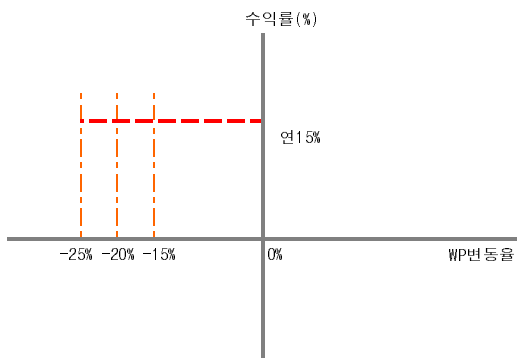
1. 계약금액

단위(백만원)

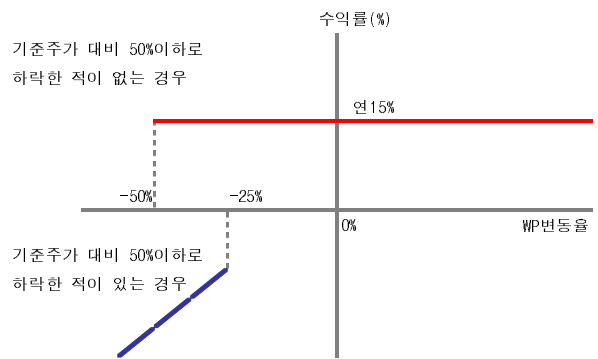
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[78-1] 메리츠2Star증권KISE-1호

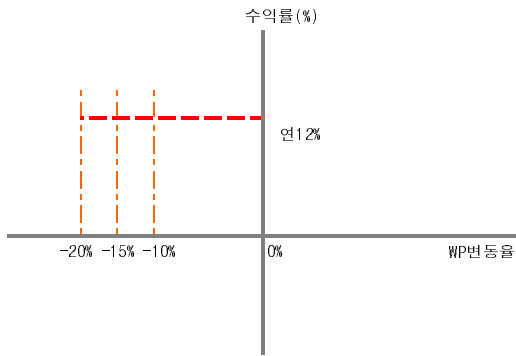
1. 계약금액

단위(백만원)

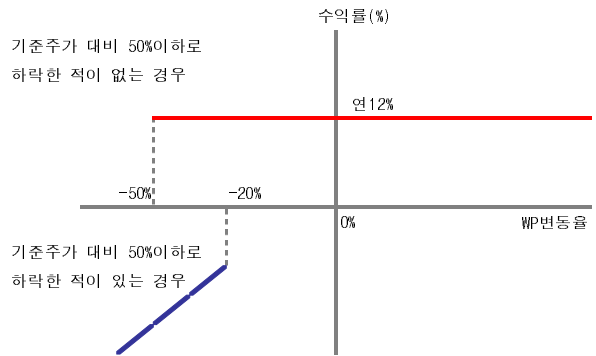
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6509307WB7 신한투자(ELS)1211

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	14.79	13.88	12.98	12.07	11.17	10.26	9.36
	5.33%	6.08	5.18	4.27	3.37	2.46	1.56	0.65
	2.67%	2.06	1.16	0.25	(0.66)	(1.56)	(2.47)	(3.37)
	0.00%	2.72	1.81	0.91	0.00	(0.91)	(1.81)	(2.72)
	-2.67%	8.05	7.14	6.24	5.33	4.43	3.52	2.62
	-5.33%	18.06	17.16	16.25	15.35	14.44	13.54	12.63
	-8.00%	32.76	31.85	30.95	30.04	29.14	28.23	27.33

최대 손실 시나리오

위험액	27.33
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	33.13
-----	-------

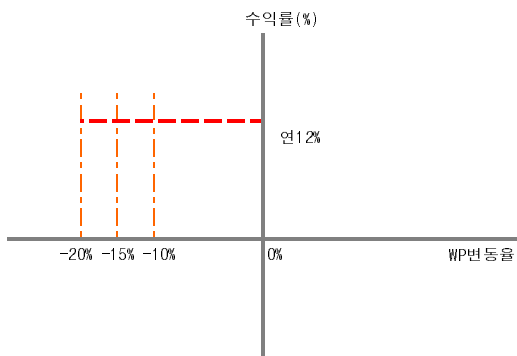
1. 계약금액

단위(백만원)

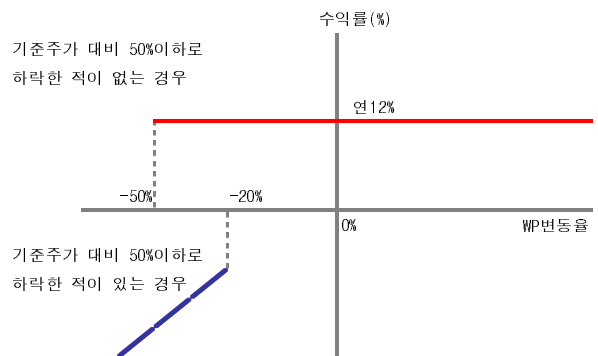
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552329WB7 우리투자증권(ELS)2730

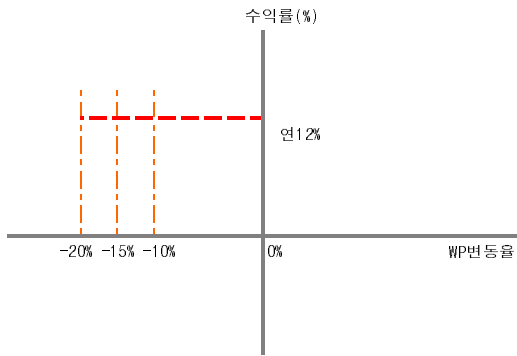
1. 계약금액

단위(백만원)

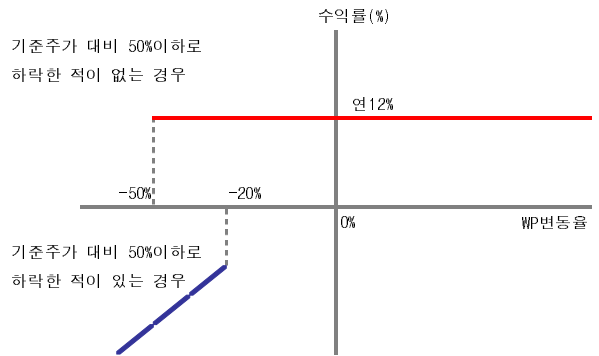
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579318WB9 한국투자증권(ELS)1411

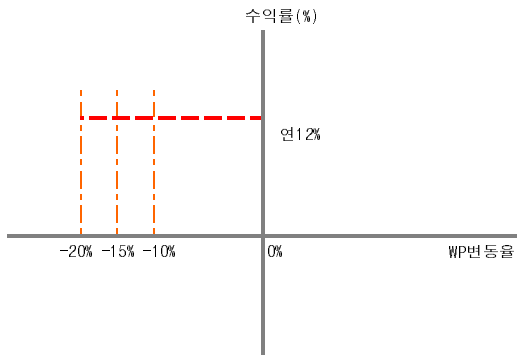
1. 계약금액

단위(백만원)

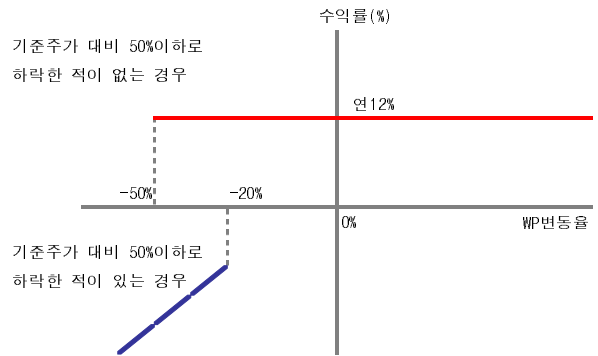
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669313WB1 동양(ELS)347



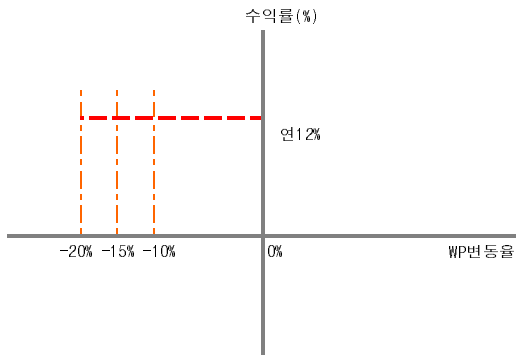
1. 계약금액

단위(백만원)

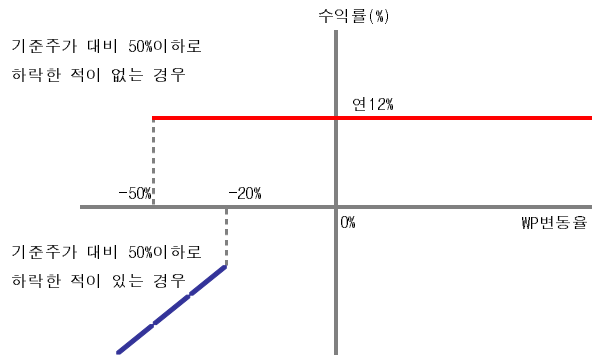
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6509318WB4 신한투자(ELS)1219

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	11.96	11.99	12.03	12.06	12.09	12.12	12.15
	5.33%	4.31	4.34	4.37	4.40	4.43	4.47	4.50
	2.67%	0.29	0.32	0.35	0.38	0.42	0.45	0.48
	0.00%	(0.09)	(0.06)	(0.03)	0.00	0.03	0.06	0.09
	-2.67%	3.16	3.19	3.22	3.25	3.28	3.31	3.35
	-5.33%	10.04	10.07	10.11	10.14	10.17	10.20	10.23
	-8.00%	20.56	20.59	20.63	20.66	20.69	20.72	20.75

최대손실 시나리오

위험액	20.75
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	27.25
-----	-------

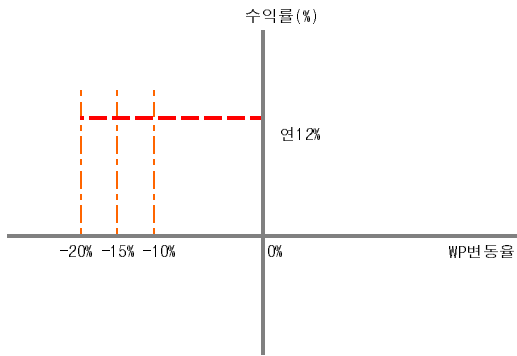
1. 계약금액

단위(백만원)

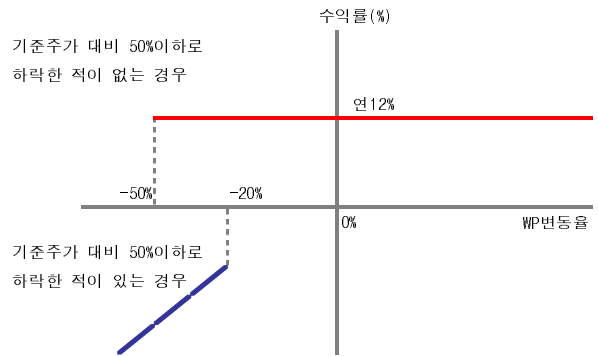
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6549319WB4 신영증권(ELS)1314

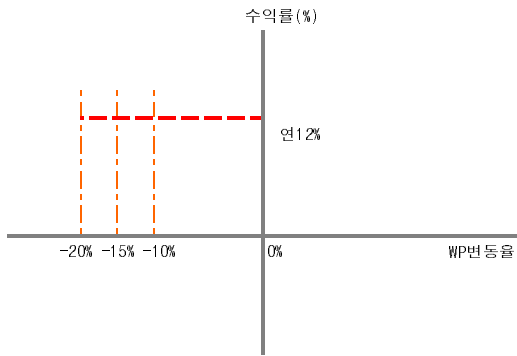
1. 계약금액

단위(백만원)

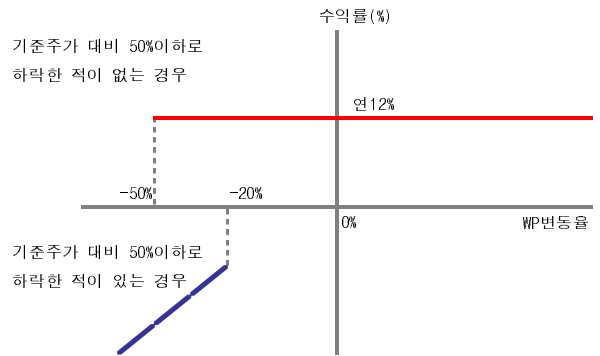
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589315WB3 현대증권(ELS)2009-1123

[79-4]

메리츠2Star증권KISE-2호

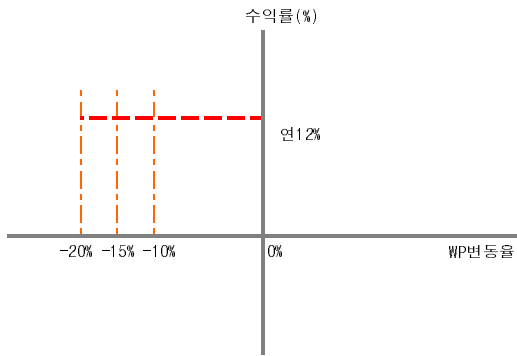
1. 계약금액

단위(백만원)

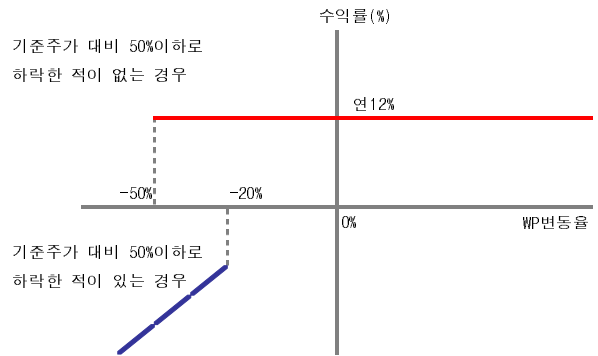
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,053	0	1,053	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669325WB5 동양(ELS)358

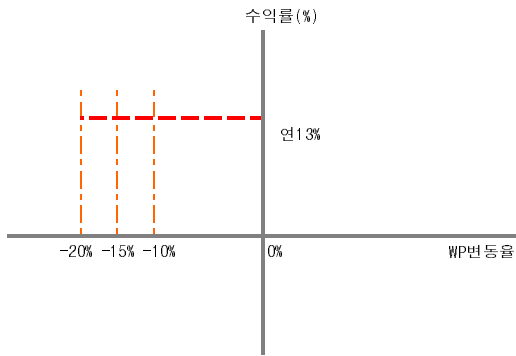
1. 계약금액

단위(백만원)

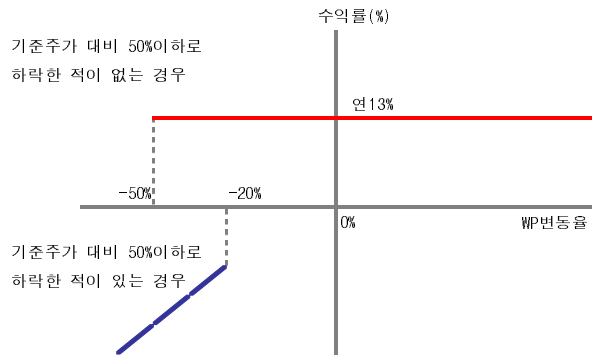
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502325W91 신한투자(ELS)1162

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	35.10	25.28	15.45	5.62	(4.21)	(14.03)	(23.86)
	5.33%	40.90	31.08	21.25	11.42	1.60	(8.23)	(18.06)
	2.67%	39.03	29.20	19.38	9.55	(0.28)	(10.11)	(19.93)
	0.00%	29.48	19.65	9.83	0.00	(9.83)	(19.65)	(29.48)
	-2.67%	12.26	2.43	(7.40)	(17.22)	(27.05)	(36.88)	(46.71)
	-5.33%	(12.64)	(22.46)	(32.29)	(42.12)	(51.95)	(61.77)	(71.60)
	-8.00%	(45.21)	(55.04)	(64.86)	(74.69)	(84.52)	(94.35)	(104.17)

최대손실 시나리오

위험액	-104.17
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	88.18
-----	-------

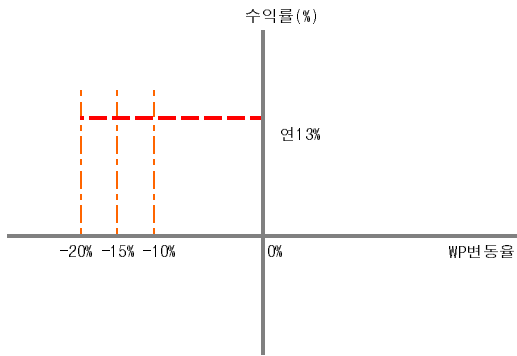
1. 계약금액

단위(백만원)

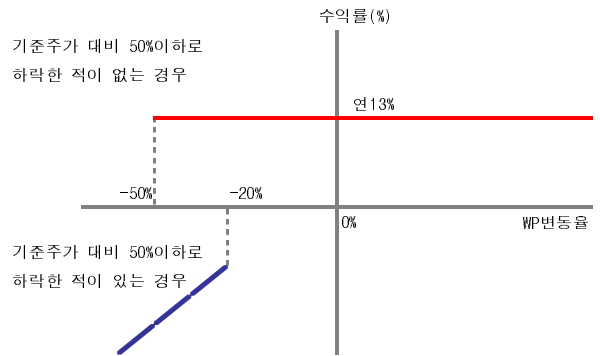
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552375W95 우리투자증권(ELS)2658

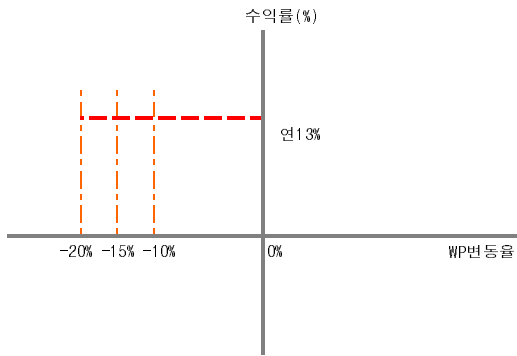
1. 계약금액

단위(백만원)

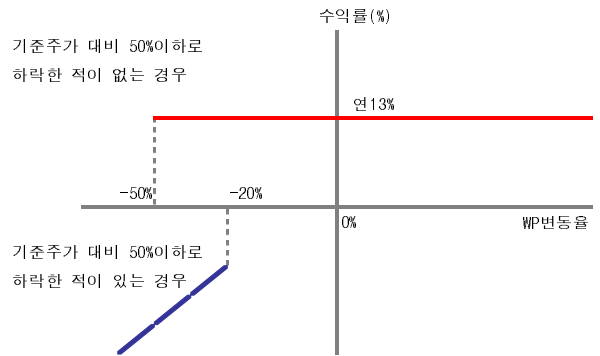
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582137W91 현대증권(ELS)2009-1092

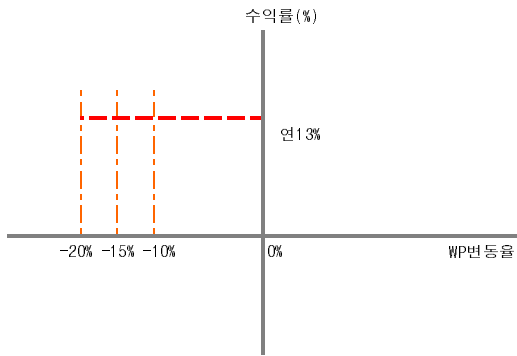
1. 계약금액

단위(백만원)

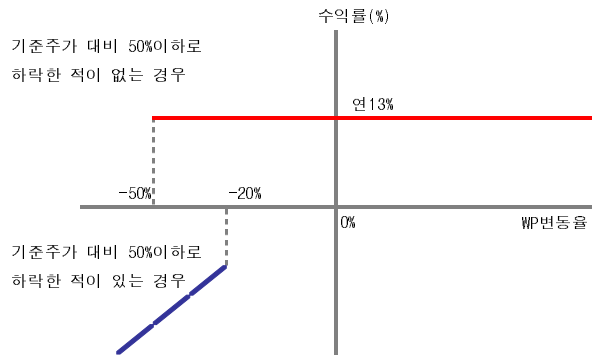
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662339W97 동양(ELS)308



[81-1] 메리츠2Star증권SESH-1호

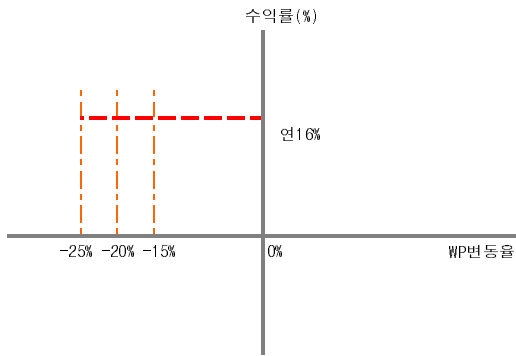
1. 계약금액

단위(백만원)

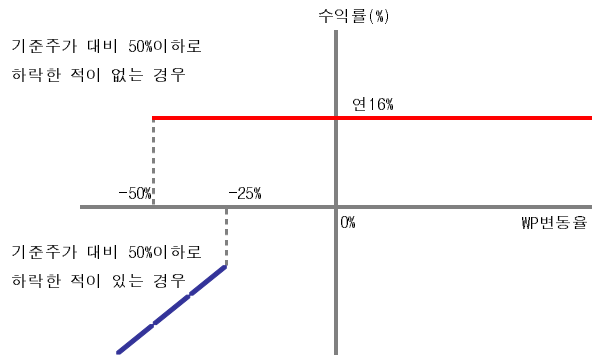
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,484	0	1,484	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502305W95 신한투자(ELS)1144

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(75.68)	(77.07)	(78.46)	(79.85)	(81.24)	(82.63)	(84.02)
	5.33%	(27.50)	(28.89)	(30.28)	(31.67)	(33.06)	(34.45)	(35.84)
	2.67%	(0.88)	(2.27)	(3.66)	(5.05)	(6.44)	(7.84)	(9.23)
	0.00%	4.17	2.78	1.39	0.00	(1.39)	(2.78)	(4.17)
	-2.67%	(12.34)	(13.73)	(15.12)	(16.51)	(17.90)	(19.29)	(20.68)
	-5.33%	(50.40)	(51.79)	(53.18)	(54.57)	(55.96)	(57.36)	(58.75)
	-8.00%	(110.03)	(111.42)	(112.81)	(114.20)	(115.59)	(116.98)	(118.37)

최대 손실 시나리오

위험액	-118.37
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	119.06
-----	--------

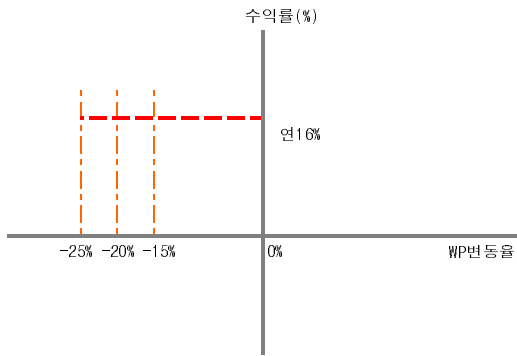
1. 계약금액

단위(백만원)

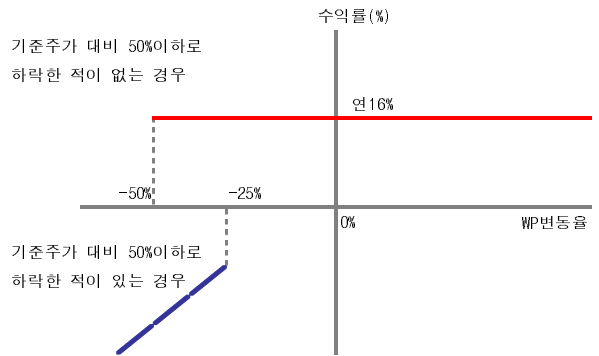
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,485	0	1,485	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552333W96 우리투자증권(ELS)2619

[81-3]

메리츠2Star증권SESH-1호

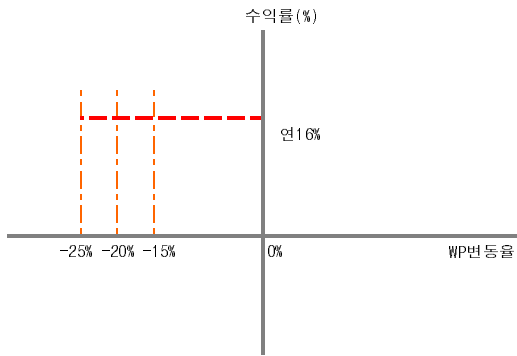
1. 계약금액

단위(백만원)

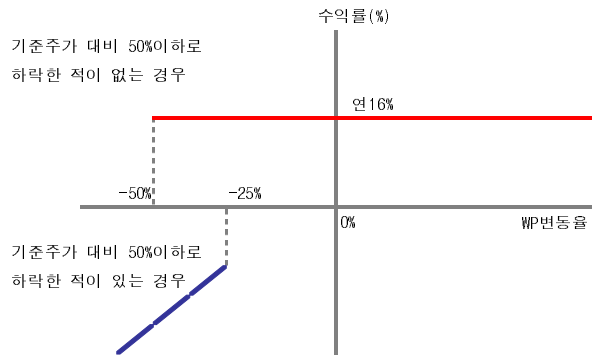
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,483	0	1,483	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572319W92 한국투자증권(ELS)1327

[81-4]

메리츠2Star증권SESH-1호

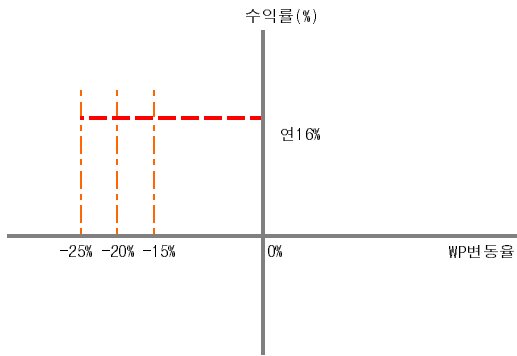
1. 계약금액

단위(백만원)

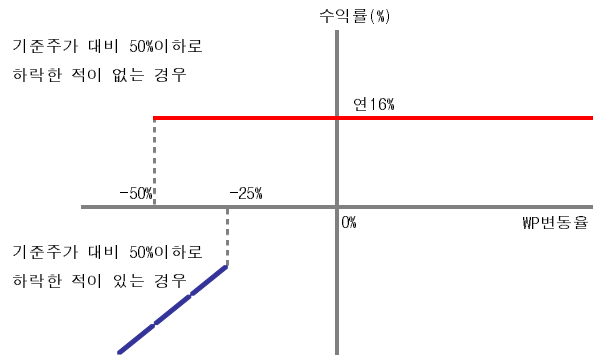
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,484	0	1,484	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702324W98 H&D증권(ELS)223

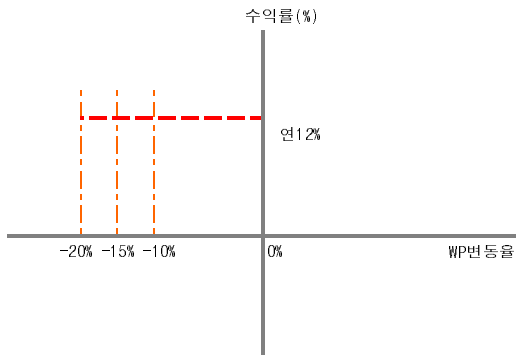
1. 계약금액

단위(백만원)

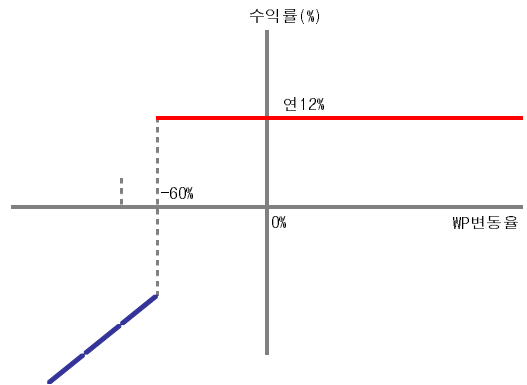
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512118WC1 대신증권(ELS)895

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	26.24	20.96	15.67	10.39	5.10	(0.18)	(5.46)
	5.33%	23.87	18.58	13.30	8.02	2.73	(2.55)	(7.84)
	2.67%	20.41	15.12	9.84	4.55	(0.73)	(6.01)	(11.30)
	0.00%	15.85	10.57	5.28	0.00	(5.28)	(10.57)	(15.85)
	-2.67%	10.21	4.92	(0.36)	(5.64)	(10.93)	(16.21)	(21.50)
	-5.33%	3.47	(1.81)	(7.09)	(12.38)	(17.66)	(22.95)	(28.23)
	-8.00%	(4.35)	(9.64)	(14.92)	(20.20)	(25.49)	(30.77)	(36.06)

최대손실 시나리오

위험액	-36.06
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	35.00
-----	-------

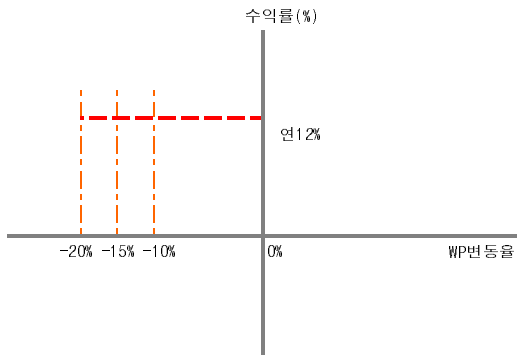
1. 계약금액

단위(백만원)

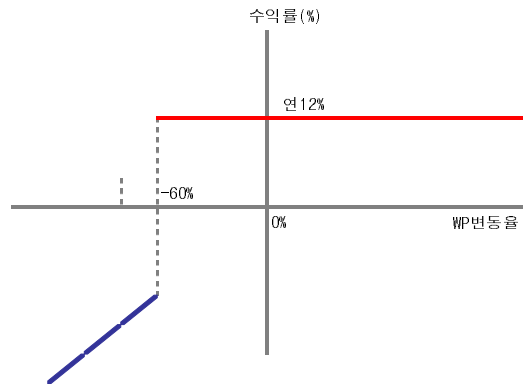
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

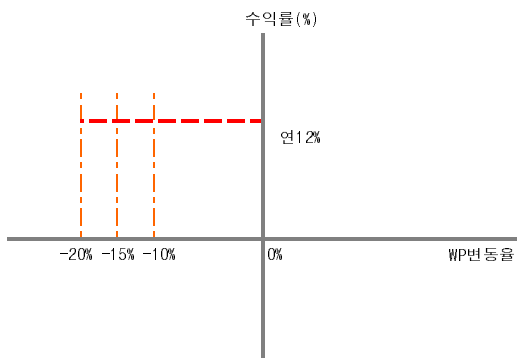
1. 계약금액

단위(백만원)

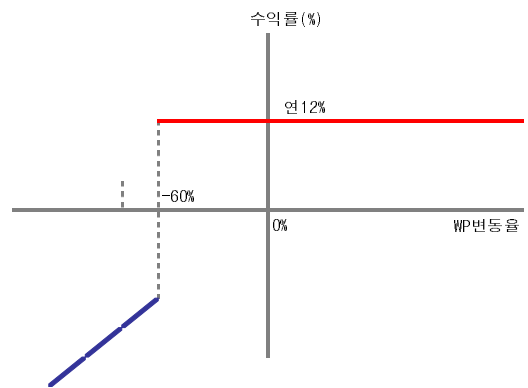
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

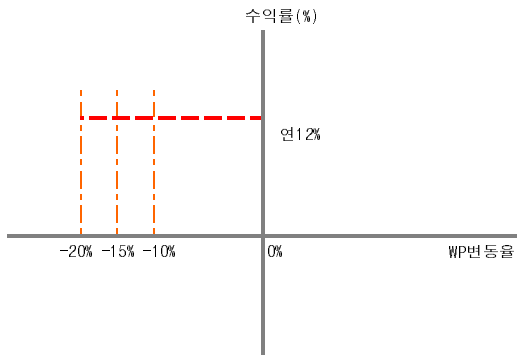
1. 계약금액

단위(백만원)

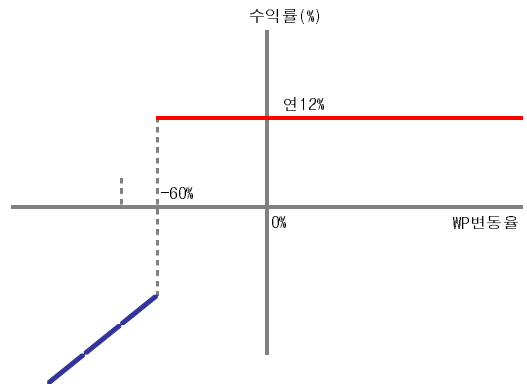
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211



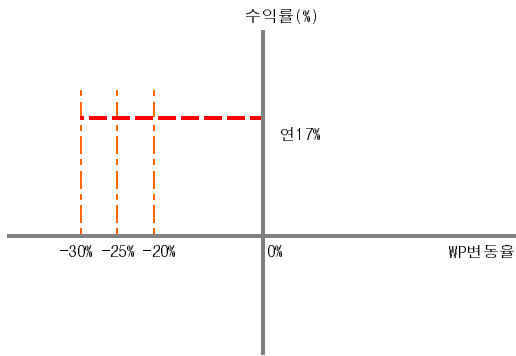
1. 계약금액

단위(백만원)

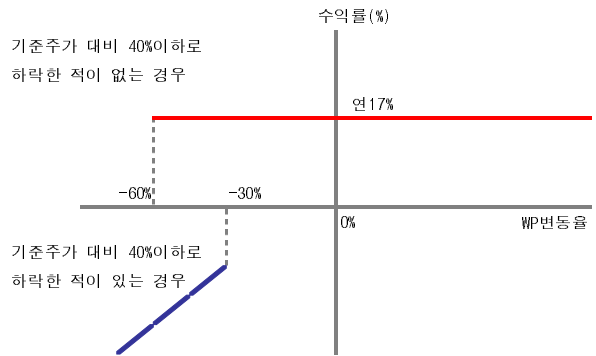
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502301WB7 신한투자(ELS)1206

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	443.87	361.51	279.15	196.80	114.44	32.08	(50.28)
	5.33%	381.85	299.49	217.13	134.77	52.42	(29.94)	(112.30)
	2.67%	316.25	233.90	151.54	69.18	(13.18)	(95.54)	(177.90)
	0.00%	247.08	164.72	82.36	0.00	(82.36)	(164.72)	(247.08)
	-2.67%	174.32	91.96	9.61	(72.75)	(155.11)	(237.47)	(319.83)
	-5.33%	97.99	15.63	(66.73)	(149.09)	(231.45)	(313.80)	(396.16)
	-8.00%	18.08	(64.28)	(146.64)	(229.00)	(311.36)	(393.71)	(476.07)

최대 손실 시나리오

위험액	-476.07
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	394.25
-----	--------

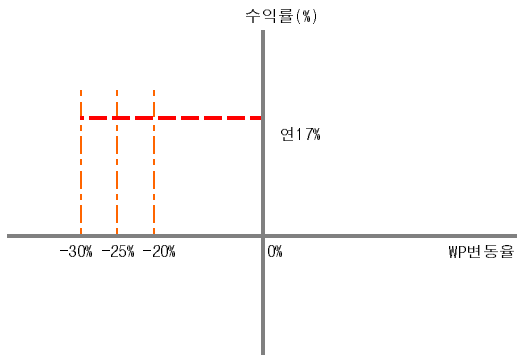
1. 계약금액

단위(백만원)

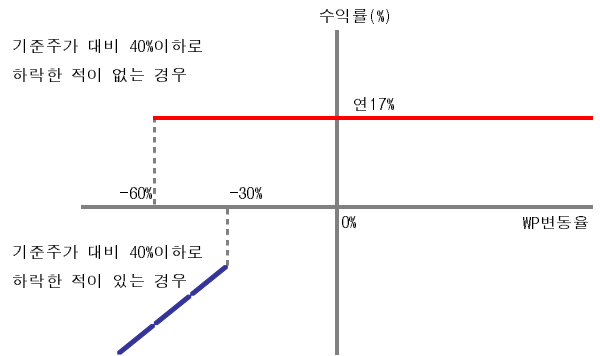
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733

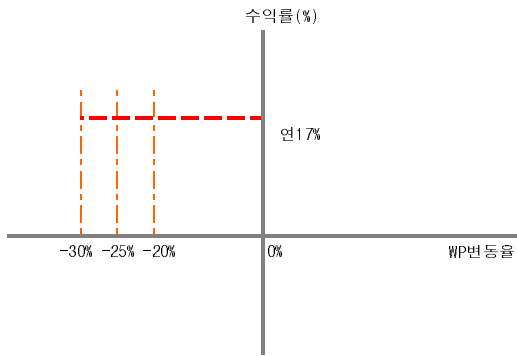
1. 계약금액

단위(백만원)

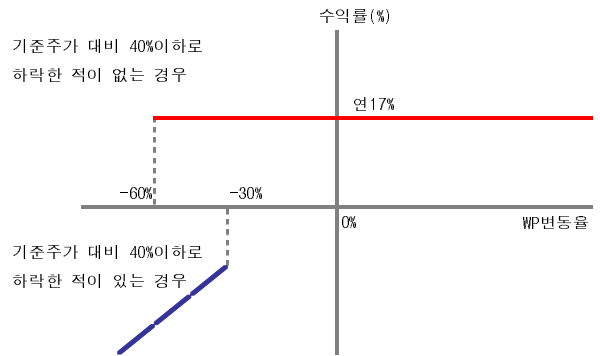
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343

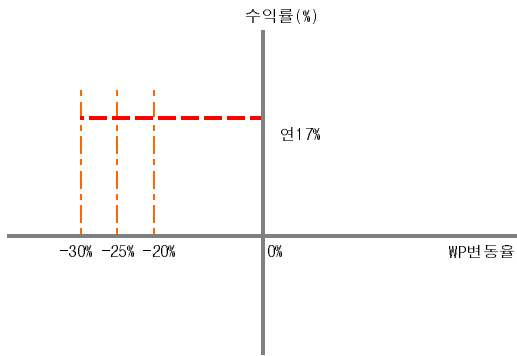
1. 계약금액

단위(백만원)

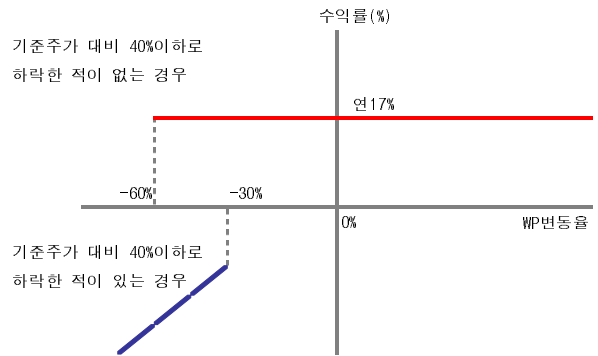
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

[84] 메리츠일종지수연계 사모파생 1호

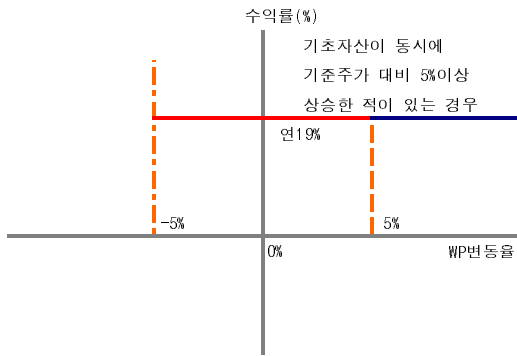
1. 계약금액

단위(백만원)

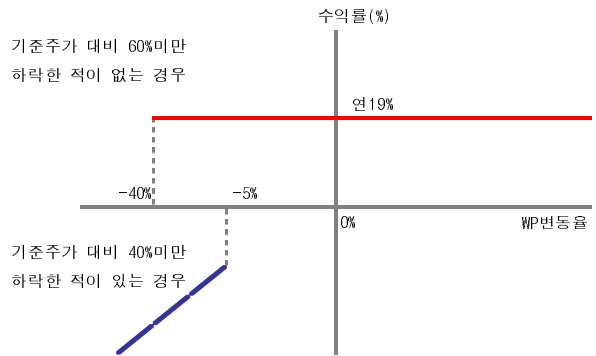
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,268	0	1,268	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR600594WV82 우리투자증권(ELS)2118

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초자산시나리오	8.00%	123.37	121.11	118.86	116.60	114.35	112.09	109.84
	5.33%	82.69	80.44	78.19	75.93	73.68	71.42	69.17
	2.67%	43.83	41.57	39.32	37.06	34.81	32.56	30.30
	0.00%	6.76	4.51	2.25	0.00	(2.25)	(4.51)	(6.76)
	-2.67%	(28.50)	(30.75)	(33.01)	(35.26)	(37.51)	(39.77)	(42.02)
	-5.33%	(61.95)	(64.21)	(66.46)	(68.72)	(70.97)	(73.23)	(75.48)
	-8.00%	(93.61)	(95.86)	(98.12)	(100.37)	(102.62)	(104.88)	(107.13)

최대손실 시나리오

위험액	-107.13
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	105.67
-----	--------

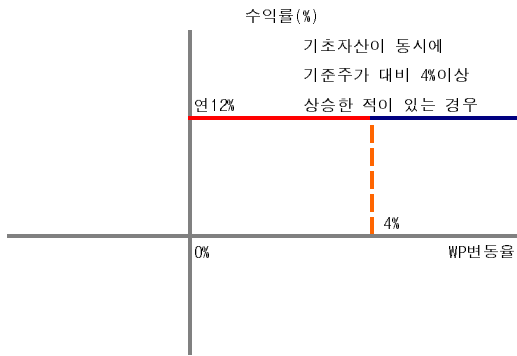
1. 계약금액

단위(백만원)

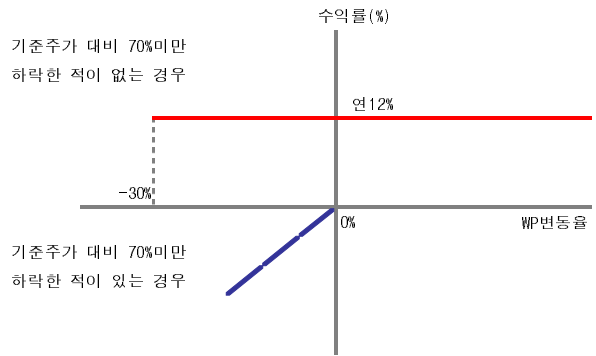
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,278	0	3,278	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6005946TN2 우리투자증권(ELS)1438

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	8020.28	7834.65	7649.02	7463.40	7277.77	7092.15	6906.52
	5.33%	5422.73	5237.10	5051.47	4865.85	4680.22	4494.59	4308.97
	2.67%	2934.93	2749.30	2563.67	2378.05	2192.42	2006.80	1821.17
	0.00%	556.88	371.25	185.63	0.00	(185.63)	(371.25)	(556.88)
	-2.67%	(1711.42)	(1897.04)	(2082.67)	(2268.30)	(2453.92)	(2639.55)	(2825.17)
	-5.33%	(3869.96)	(4055.59)	(4241.21)	(4426.84)	(4612.47)	(4798.09)	(4983.72)
	-8.00%	(5918.75)	(6104.38)	(6290.01)	(6475.63)	(6661.26)	(6846.89)	(7032.51)

최대 손실 시나리오

위험액	-7,032.51
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7,138.67
-----	----------

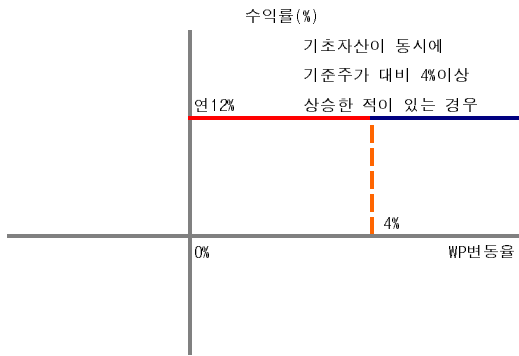
1. 계약금액

단위(백만원)

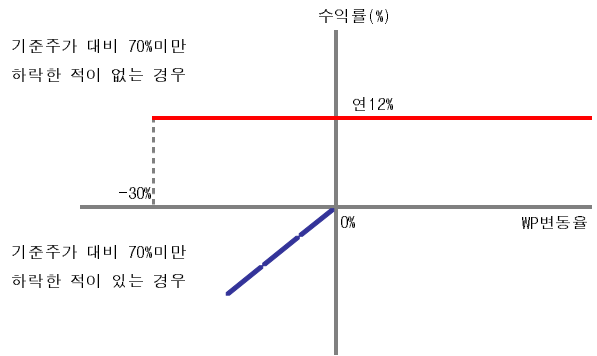
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,480	0	3,480	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

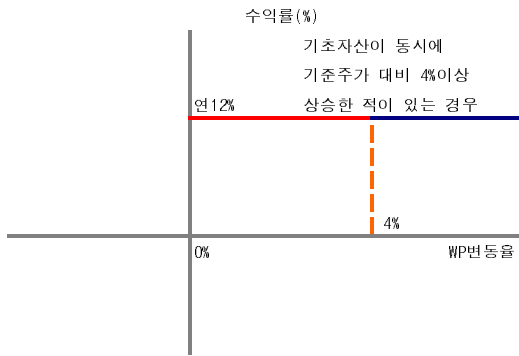
1. 계약금액

단위(백만원)

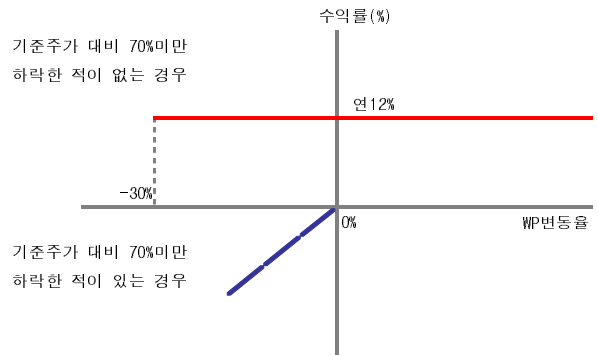
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6,782	0	6,782	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475



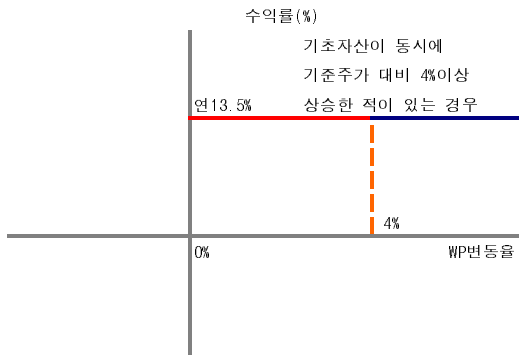
1. 계약금액

단위(백만원)

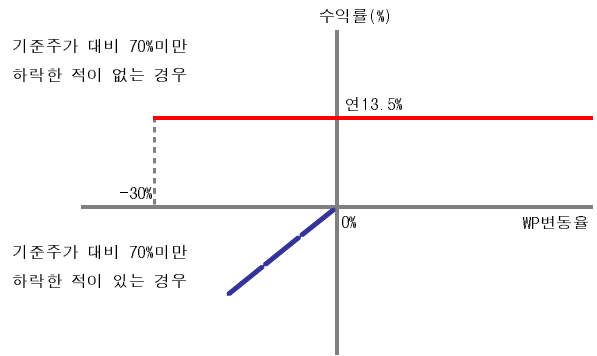
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,485	0	3,485	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

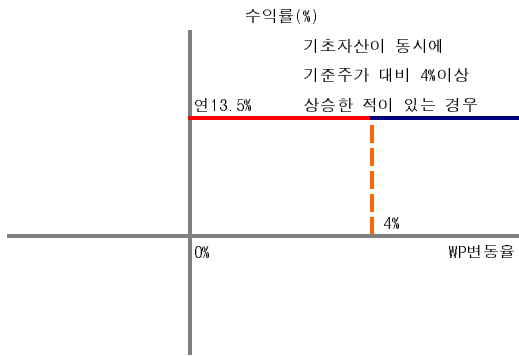
1. 계약금액

단위(백만원)

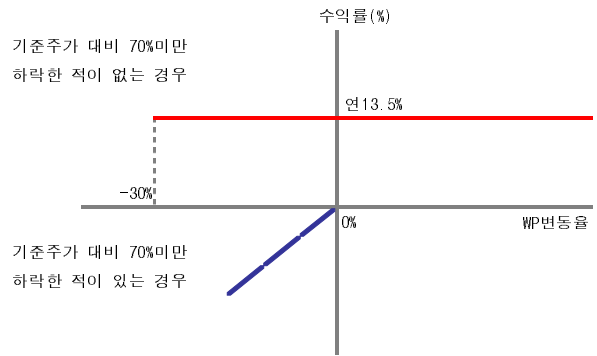
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,514	0	3,514	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535

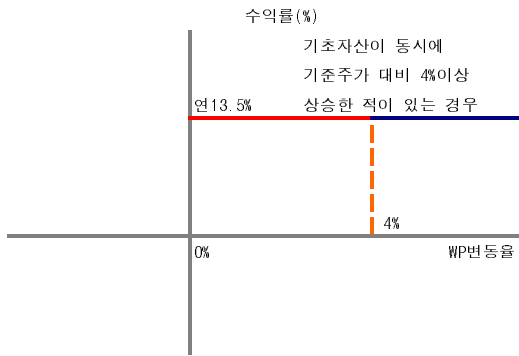
1. 계약금액

단위(백만원)

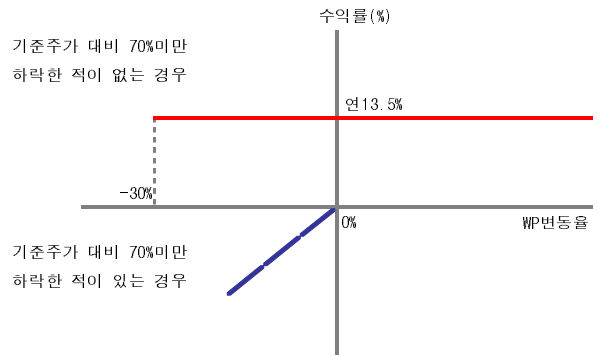
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,056	0	7,056	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6008675TC7 신한투자(ELS)809

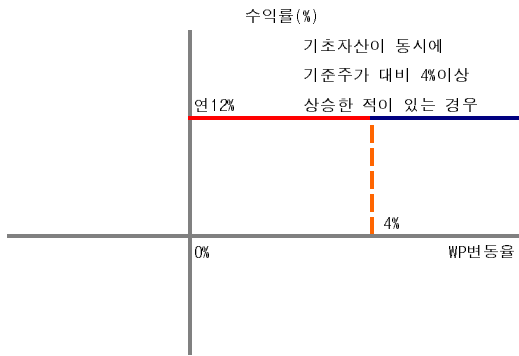
1. 계약금액

단위(백만원)

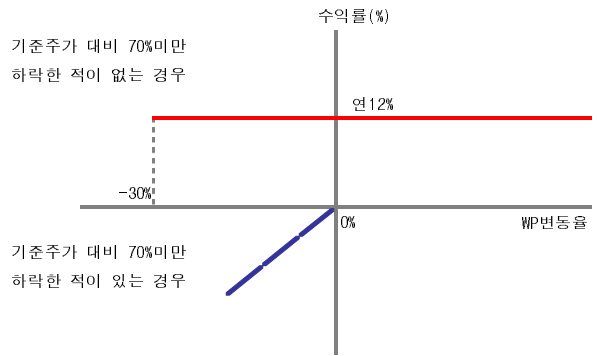
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6,813	0	6,813	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6008676TB7 신한투자(ELS)797

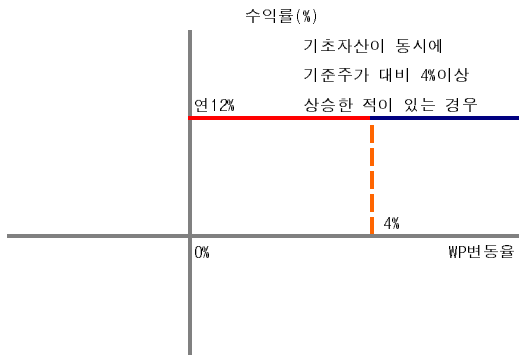
1. 계약금액

단위(백만원)

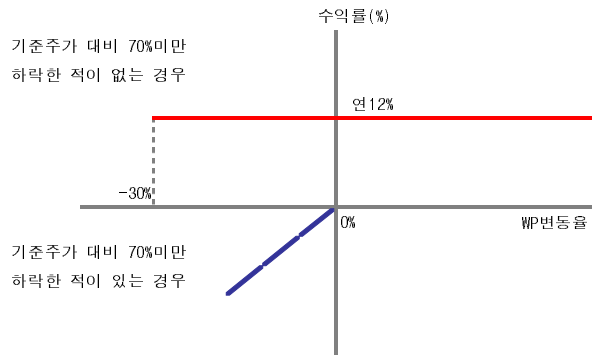
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,288	0	3,288	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6008679TA3 신한투자(ELS)786

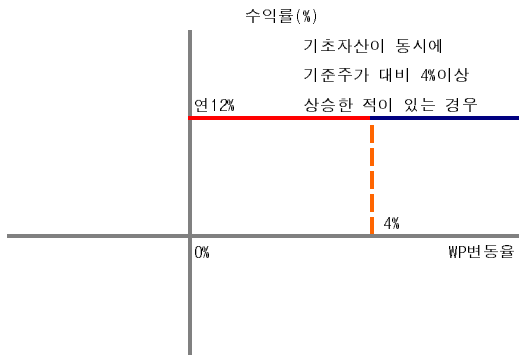
1. 계약금액

단위(백만원)

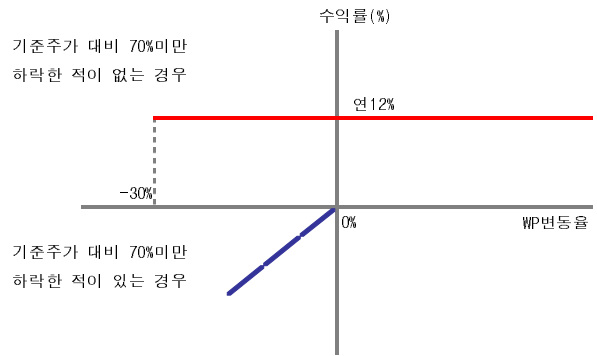
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,495	0	3,495	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600867CTB8 신한투자(ELS)804

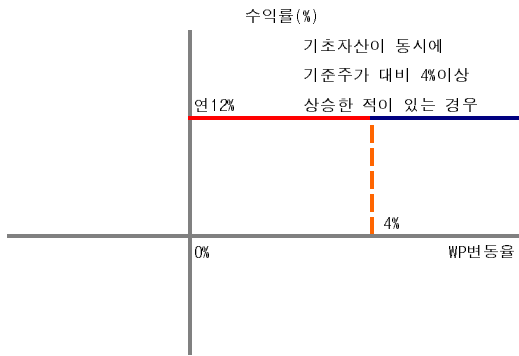
1. 계약금액

단위(백만원)

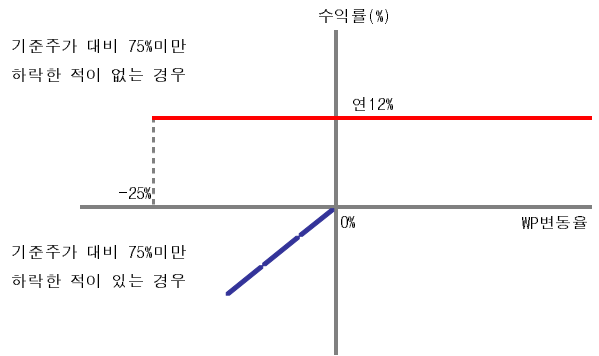
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,385	0	3,385	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

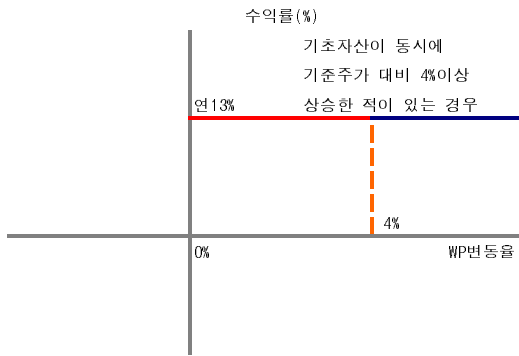
1. 계약금액

단위(백만원)

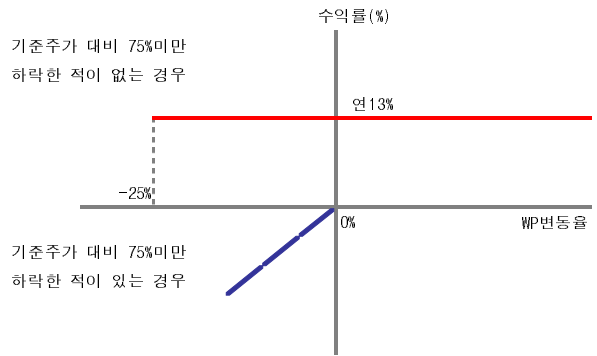
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,013	0	7,013	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6030614TC8 교보증권(ELS)100



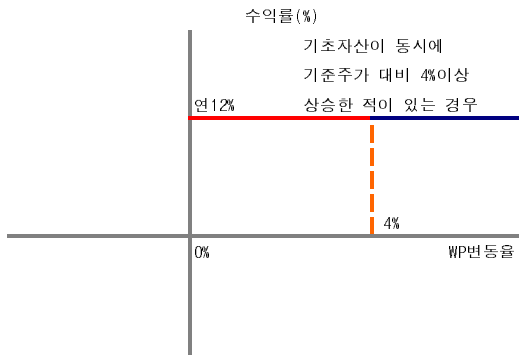
1. 계약금액

단위(백만원)

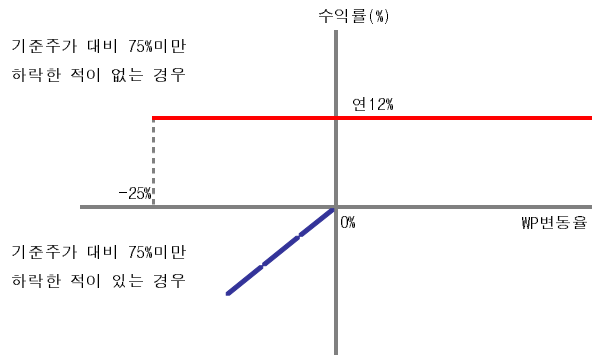
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,485	0	3,485	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[86] 메리츠주가지수연계사모증권10호

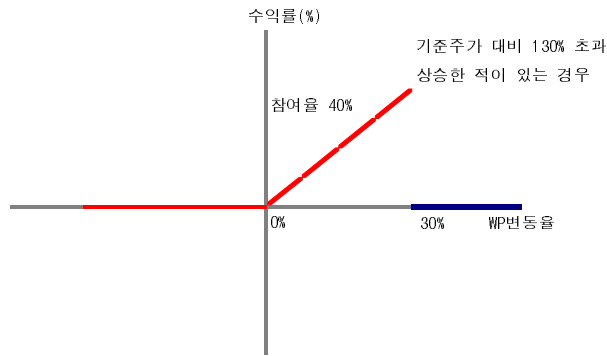
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,289	0	2,289	장익

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6673105W54 해피플러스(ELS)91

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(68.10)	(76.46)	(84.81)	(93.17)	(101.53)	(109.88)	(118.24)
	5.33%	(28.37)	(36.72)	(45.08)	(53.44)	(61.79)	(70.15)	(78.50)
	2.67%	2.69	(5.67)	(14.02)	(22.38)	(30.73)	(39.09)	(47.45)
	0.00%	25.07	16.71	8.36	0.00	(8.36)	(16.71)	(25.07)
	-2.67%	38.77	30.41	22.06	13.70	5.34	(3.01)	(11.37)
	-5.33%	43.79	35.44	27.08	18.72	10.37	2.01	(6.34)
	-8.00%	40.14	31.78	23.42	15.07	6.71	(1.64)	(10.00)

최대손실 시나리오

위험액	-10.00
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	50.47
-----	-------

[90] 메리츠주가지수연계사모증권29호

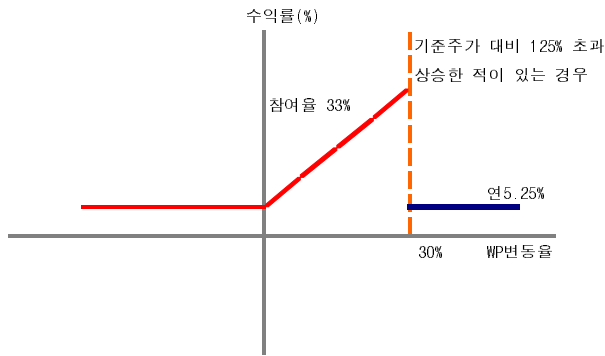
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	539	0	539	장익

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6623313WB6 교보증권(ELS)444

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(0.06)	(0.45)	(0.84)	(1.24)	(1.63)	(2.02)	(2.41)
	5.33%	0.43	0.04	(0.35)	(0.74)	(1.13)	(1.53)	(1.92)
	2.67%	0.84	0.45	0.06	(0.33)	(0.72)	(1.11)	(1.51)
	0.00%	1.18	0.78	0.39	0.00	(0.39)	(0.78)	(1.18)
	-2.67%	1.42	1.03	0.64	0.25	(0.14)	(0.53)	(0.93)
	-5.33%	1.59	1.20	0.81	0.42	0.02	(0.37)	(0.76)
	-8.00%	1.68	1.29	0.89	0.50	0.11	(0.28)	(0.67)

최대손실 시나리오

위험액	-0.67
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.13
-----	------

[91-1] 메리츠주가지수연계사모증권2호

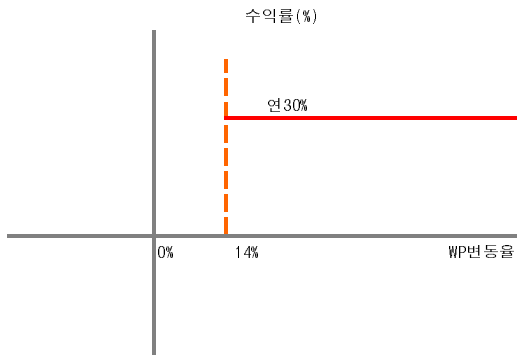
1. 계약금액

단위(백만원)

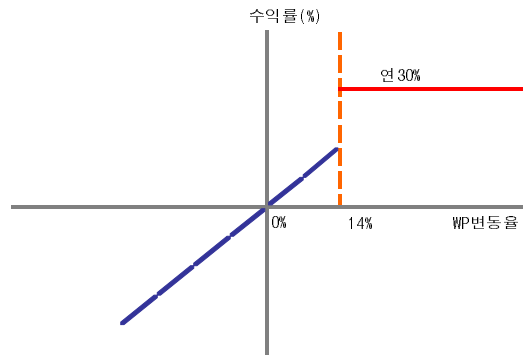
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	4,100	0	4,100	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553351WA2 우리투자증권(ELS)2714

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	1103.09	1013.81	924.52	835.24	745.96	656.67	567.39
	5.33%	833.06	743.78	654.49	565.21	475.92	386.64	297.35
	2.67%	554.65	465.36	376.08	286.79	197.51	108.22	18.94
	0.00%	267.85	178.57	89.28	0.00	(89.28)	(178.57)	(267.85)
	-2.67%	(27.32)	(116.60)	(205.89)	(295.17)	(384.46)	(473.74)	(563.03)
	-5.33%	(330.87)	(420.16)	(509.44)	(598.73)	(688.01)	(777.30)	(866.58)
	-8.00%	(642.81)	(732.09)	(821.38)	(910.66)	(999.95)	(1089.23)	(1178.52)

최대손실 시나리오

위험액	-1,178.52
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1,138.92
-----	----------

[91-2]

메리츠주가지수연계사모증권2호

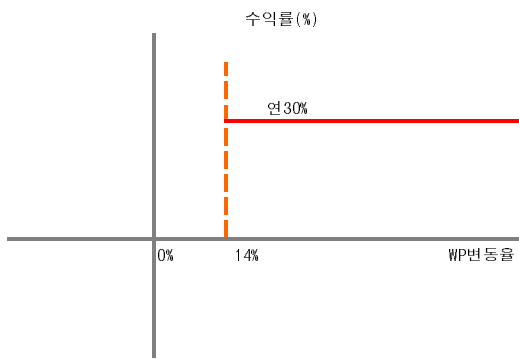
1. 계약금액

단위(백만원)

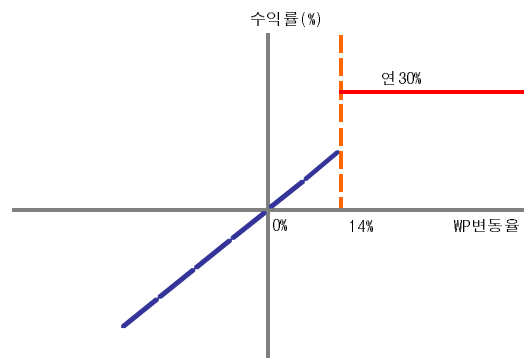
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,800	0	7,800	장위

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553378W90 우리투자증권(ELS)2662

[92] 메리츠주가지수연계사모증권31호

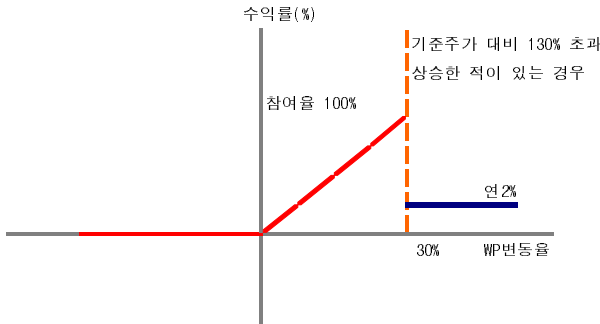
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,239	0	1,239	장익

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653313WB9 한화스마트(ELS)232

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	9.67	5.18	0.68	(3.82)	(8.31)	(12.81)	(17.30)
	5.33%	12.33	7.83	3.34	(1.16)	(5.66)	(10.15)	(14.65)
	2.67%	13.60	9.10	4.61	0.11	(4.38)	(8.88)	(13.38)
	0.00%	13.49	8.99	4.50	0.00	(4.50)	(8.99)	(13.49)
	-2.67%	11.99	7.50	3.00	(1.49)	(5.99)	(10.49)	(14.98)
	-5.33%	9.12	4.62	0.12	(4.37)	(8.87)	(13.36)	(17.86)
	-8.00%	4.86	0.36	(4.14)	(8.63)	(13.13)	(17.62)	(22.12)

최대 손실 시나리오

위험액	-22.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	25.14
-----	-------

[93] 메리츠주가지수연계사모증권5호

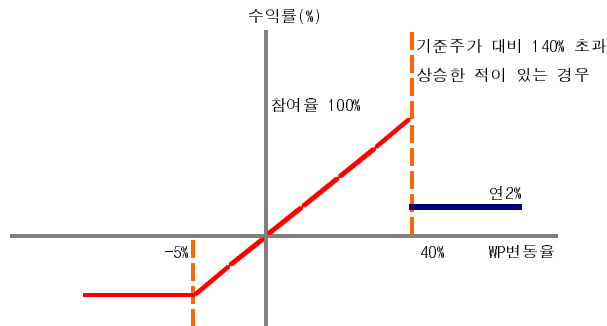
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	587	0	587	장익

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6523317W30 대우증권(ELS)2881

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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[94] 메리츠주가지수연계사모증권제28

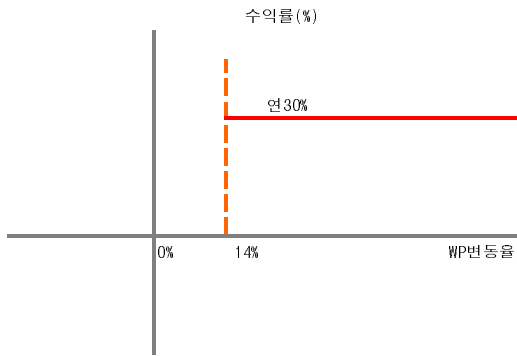
1. 계약금액

단위(백만원)

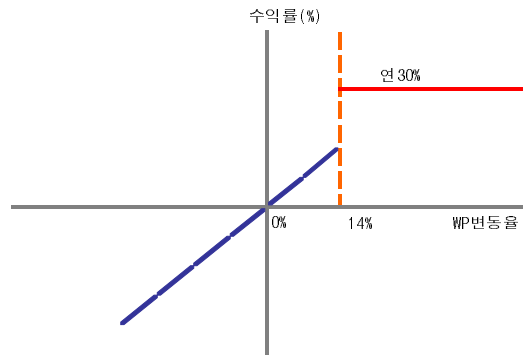
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,945	0	3,945	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503332W90 신한투자(ELS)1165

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	371.51	343.06	314.62	286.17	257.72	229.27	200.82
	5.33%	277.77	249.32	220.87	192.42	163.97	135.53	107.08
	2.67%	182.38	153.93	125.48	97.03	68.59	40.14	11.69
	0.00%	85.35	56.90	28.45	0.00	(28.45)	(56.90)	(85.35)
	-2.67%	(13.33)	(41.78)	(70.23)	(98.68)	(127.13)	(155.58)	(184.03)
	-5.33%	(113.66)	(142.11)	(170.56)	(199.00)	(227.45)	(255.90)	(284.35)
	-8.00%	(215.63)	(244.08)	(272.53)	(300.98)	(329.42)	(357.87)	(386.32)

최대손실 시나리오

위험액	-386.32
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	376.65
-----	--------



[95] 메리트주가지수연계사모증권제30

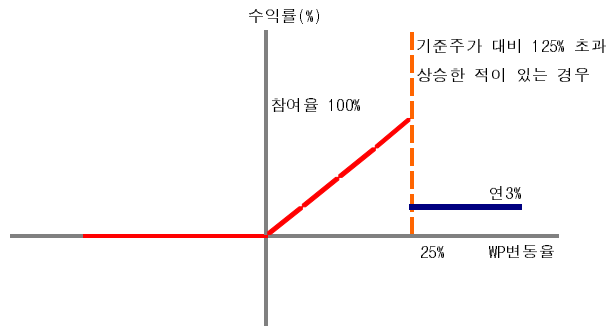
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	434	0	434	장익

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653305WC3 한화스마트(ELS)233

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	4.10	3.49	2.88	2.27	1.66	1.06	0.45
	5.33%	3.51	2.90	2.29	1.68	1.08	0.47	(0.14)
	2.67%	2.75	2.14	1.53	0.93	0.32	(0.29)	(0.90)
	0.00%	1.82	1.22	0.61	0.00	(0.61)	(1.22)	(1.82)
	-2.67%	0.73	0.12	(0.49)	(1.10)	(1.70)	(2.31)	(2.92)
	-5.33%	(0.54)	(1.14)	(1.75)	(2.36)	(2.97)	(3.58)	(4.18)
	-8.00%	(1.97)	(2.58)	(3.19)	(3.79)	(4.40)	(5.01)	(5.62)

최대손실 시나리오

위험액	-5.62
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.09
-----	------

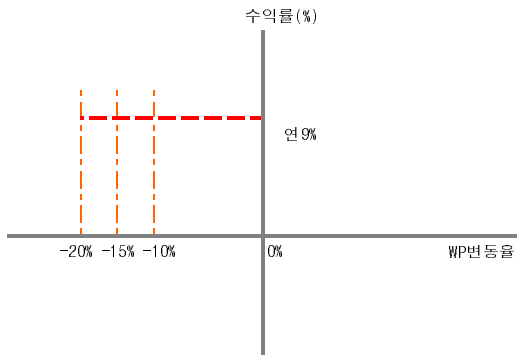
1. 계약금액

단위(백만원)

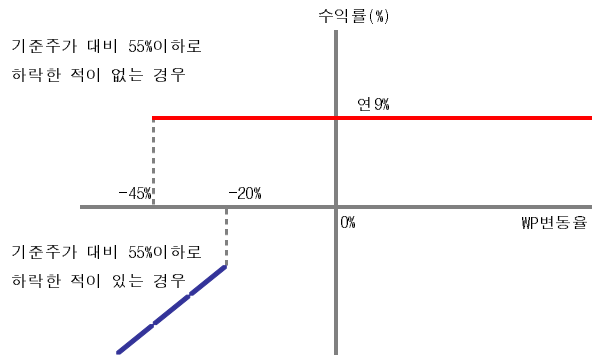
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	685	0	685	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663309WC3 동양(ELS)412

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	0.60	0.57	0.54	0.51	0.48	0.45	0.42
	5.33%	(0.33)	(0.36)	(0.39)	(0.42)	(0.45)	(0.48)	(0.51)
	2.67%	(0.50)	(0.53)	(0.56)	(0.59)	(0.62)	(0.65)	(0.68)
	0.00%	0.09	0.06	0.03	0.00	(0.03)	(0.06)	(0.09)
	-2.67%	1.44	1.41	1.38	1.35	1.32	1.29	1.26
	-5.33%	3.55	3.52	3.49	3.46	3.43	3.40	3.37
	-8.00%	6.41	6.38	6.35	6.32	6.29	6.26	6.23

최대손실 시나리오

위험액	6.23
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	6.49
-----	------

[97] 메리츠주가지수연계사모증권제33

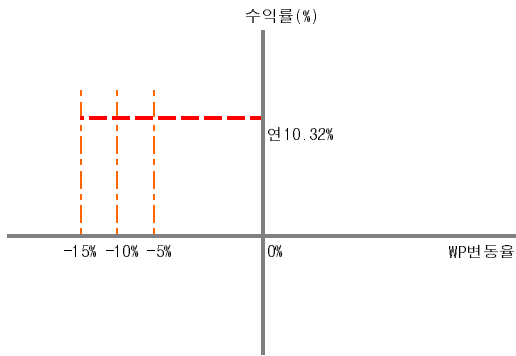
1. 계약금액

단위(백만원)

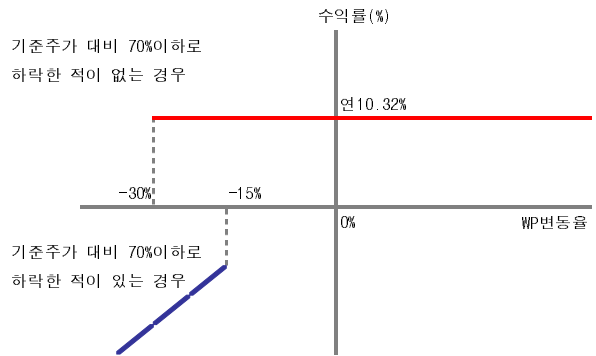
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	507	0	507	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6523330WC9 대우증권(ELS)3445

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	(4.38)	(4.58)	(4.78)	(4.99)	(5.19)	(5.39)	(5.59)
	5.33%	(1.73)	(1.93)	(2.13)	(2.33)	(2.54)	(2.74)	(2.94)
	2.67%	(0.06)	(0.27)	(0.47)	(0.67)	(0.87)	(1.08)	(1.28)
	0.00%	0.61	0.41	0.20	0.00	(0.20)	(0.41)	(0.61)
	-2.67%	0.29	0.09	(0.12)	(0.32)	(0.52)	(0.72)	(0.93)
	-5.33%	(1.02)	(1.22)	(1.43)	(1.63)	(1.83)	(2.03)	(2.24)
	-8.00%	(3.32)	(3.53)	(3.73)	(3.93)	(4.13)	(4.34)	(4.54)

최대손실 시나리오

위험액	-4.54
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.11
-----	------

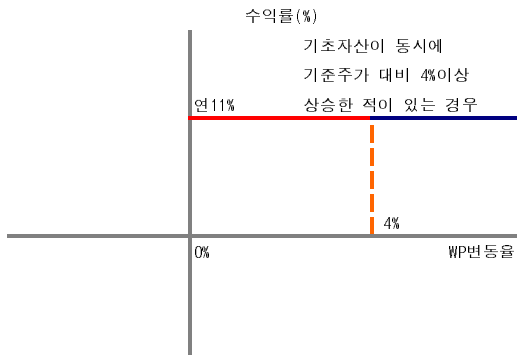
1. 계약금액

단위(백만원)

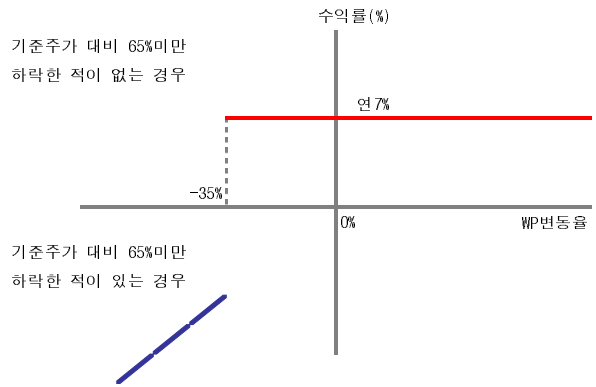
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,263	0	3,263	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR600345RT28 현대증권(ELS)2007-397

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	144.82	144.76	144.70	144.64	144.58	144.52	144.47
	5.33%	96.61	96.55	96.49	96.43	96.37	96.31	96.25
	2.67%	48.39	48.33	48.27	48.21	48.16	48.10	48.04
	0.00%	0.18	0.12	0.06	0.00	(0.06)	(0.12)	(0.18)
	-2.67%	(48.04)	(48.10)	(48.16)	(48.21)	(48.27)	(48.33)	(48.39)
	-5.33%	(96.25)	(96.31)	(96.37)	(96.43)	(96.49)	(96.55)	(96.61)
	-8.00%	(144.47)	(144.52)	(144.58)	(144.64)	(144.70)	(144.76)	(144.82)

최대손실 시나리오

위험액	-144.82
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	144.81
-----	--------

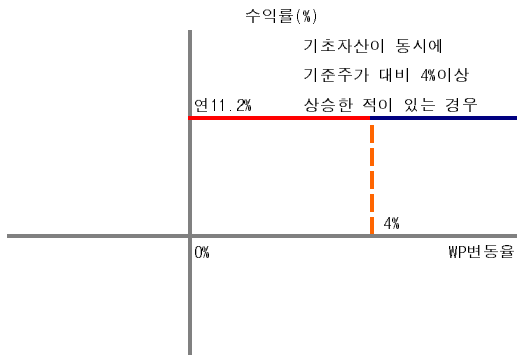
1. 계약금액

단위(백만원)

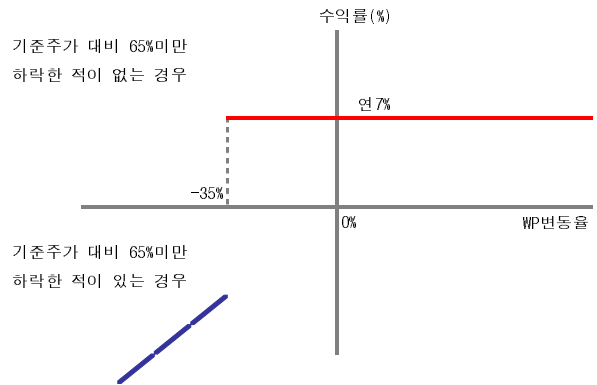
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	234	0	234	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR600345ST27 현대증권(ELS)2007-398

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	10.38	10.38	10.37	10.37	10.36	10.36	10.35
	5.33%	6.92	6.92	6.92	6.91	6.91	6.90	6.90
	2.67%	3.47	3.46	3.46	3.46	3.45	3.45	3.44
	0.00%	0.01	0.01	0.00	0.00	(0.00)	(0.01)	(0.01)
	-2.67%	(3.44)	(3.45)	(3.45)	(3.46)	(3.46)	(3.46)	(3.47)
	-5.33%	(6.90)	(6.90)	(6.91)	(6.91)	(6.92)	(6.92)	(6.92)
	-8.00%	(10.35)	(10.36)	(10.36)	(10.37)	(10.37)	(10.38)	(10.38)

최대손실 시나리오

위험액	-10.38
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	10.38
-----	-------

[102] 메리츠지수연계사모단위파생6호

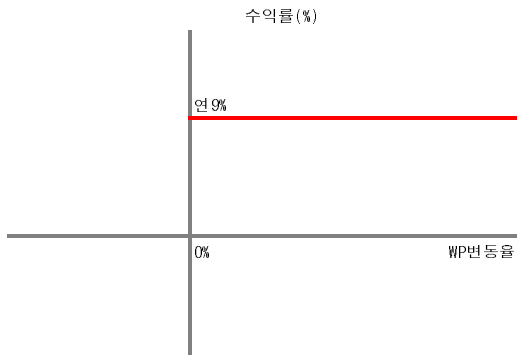
1. 계약금액

단위(백만원)

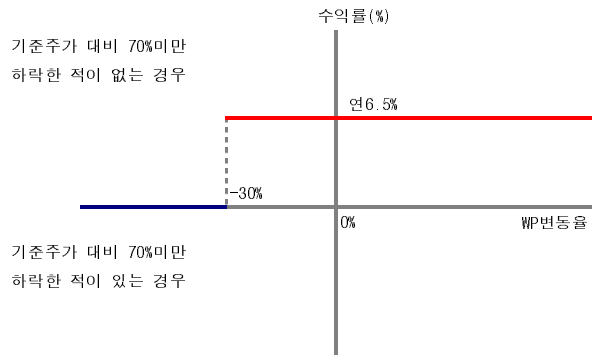
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	850	0	850	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR603762QV23 미래에셋증권(ELS)306

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	30.39	29.34	28.30	27.25	26.21	25.16	24.12
	5.33%	22.58	21.54	20.49	19.45	18.40	17.36	16.31
	2.67%	13.50	12.45	11.41	10.36	9.32	8.27	7.23
	0.00%	3.14	2.09	1.05	0.00	(1.05)	(2.09)	(3.14)
	-2.67%	(8.51)	(9.55)	(10.60)	(11.64)	(12.69)	(13.73)	(14.78)
	-5.33%	(21.43)	(22.47)	(23.52)	(24.56)	(25.61)	(26.65)	(27.70)
	-8.00%	(35.62)	(36.67)	(37.72)	(38.76)	(39.81)	(40.85)	(41.90)

최대손실 시나리오

위험액	-41.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	64.95
-----	-------

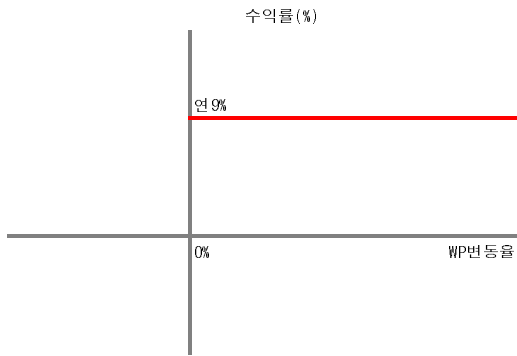
1. 계약금액

단위(백만원)

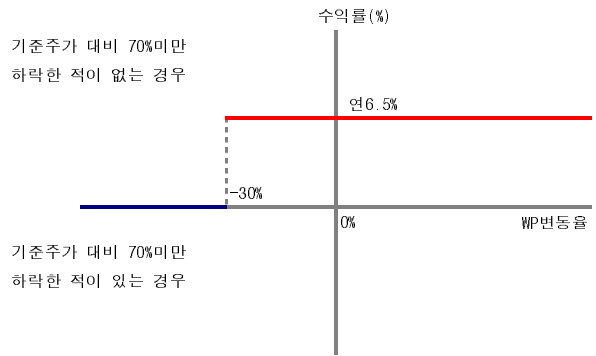
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	794	0	794	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR603762RV22 미래에셋증권(ELS)317

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	28.36	27.39	26.41	25.44	24.46	23.48	22.51
	5.33%	21.08	20.10	19.13	18.15	17.17	16.20	15.22
	2.67%	12.60	11.62	10.65	9.67	8.70	7.72	6.74
	0.00%	2.93	1.95	0.98	0.00	(0.98)	(1.95)	(2.93)
	-2.67%	(7.94)	(8.91)	(9.89)	(10.87)	(11.84)	(12.82)	(13.79)
	-5.33%	(20.00)	(20.97)	(21.95)	(22.92)	(23.90)	(24.88)	(25.85)
	-8.00%	(33.25)	(34.23)	(35.20)	(36.18)	(37.15)	(38.13)	(39.10)

최대손실 시나리오

위험액	-39.10
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	60.62
-----	-------

[104] 메리츠천연가스연계사모증권1호

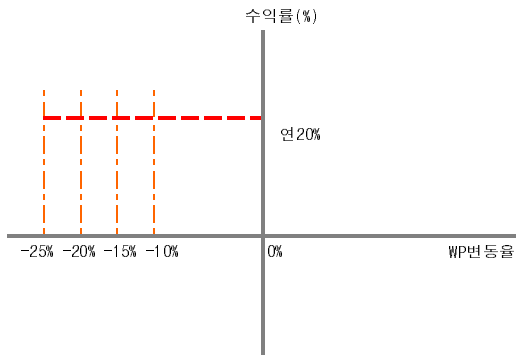
1. 계약금액

단위(백만원)

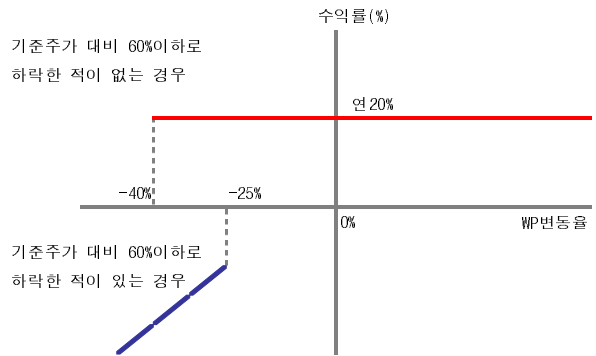
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,503	0	1,503	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6669312W93 동양증권(DLS)10

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	40.04	35.51	30.98	26.44	21.91	17.38	12.85
	5.33%	35.41	30.87	26.34	21.81	17.28	12.75	8.22
	2.67%	26.59	22.06	17.53	13.00	8.47	3.94	(0.60)
	0.00%	13.59	9.06	4.53	0.00	(4.53)	(9.06)	(13.59)
	-2.67%	(3.59)	(8.12)	(12.65)	(17.18)	(21.71)	(26.24)	(30.77)
	-5.33%	(24.95)	(29.48)	(34.01)	(38.55)	(43.08)	(47.61)	(52.14)
	-8.00%	(50.50)	(55.03)	(59.56)	(64.09)	(68.62)	(73.16)	(77.69)

최대손실 시나리오

위험액	-77.69
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	80.03
-----	-------



[105] 메리츠천 연가스연계 사모증권2호

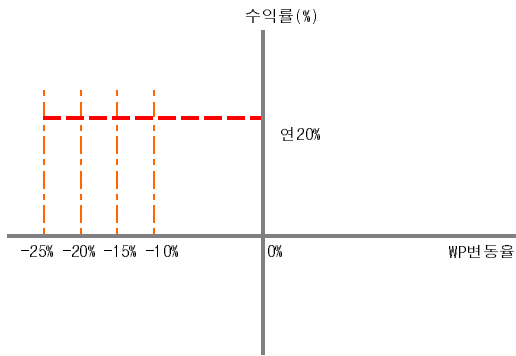
1. 계약금액

단위(백만원)

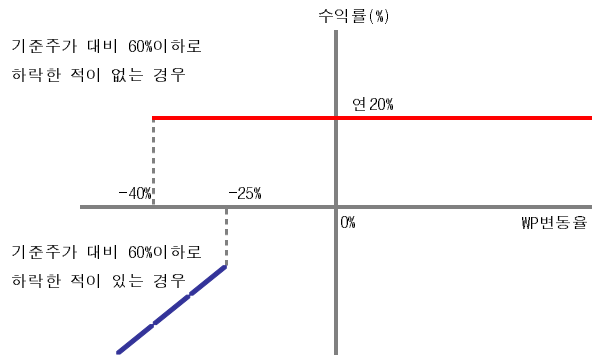
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	979	0	979	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6669322W91 동양증권(DLS)12

구분	변동성 시나리오							
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	45.54	40.60	35.67	30.74	25.80	20.87	15.94
	5.33%	37.57	32.64	27.70	22.77	17.84	12.90	7.97
	2.67%	27.33	22.39	17.46	12.53	7.59	2.66	(2.27)
	0.00%	14.80	9.87	4.93	0.00	(4.93)	(9.87)	(14.80)
	-2.67%	(0.00)	(4.94)	(9.87)	(14.80)	(19.74)	(24.67)	(29.60)
	-5.33%	(17.09)	(22.02)	(26.95)	(31.89)	(36.82)	(41.75)	(46.69)
	-8.00%	(36.45)	(41.38)	(46.32)	(51.25)	(56.18)	(61.12)	(66.05)

최대손실 시나리오

위험액	-66.05
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

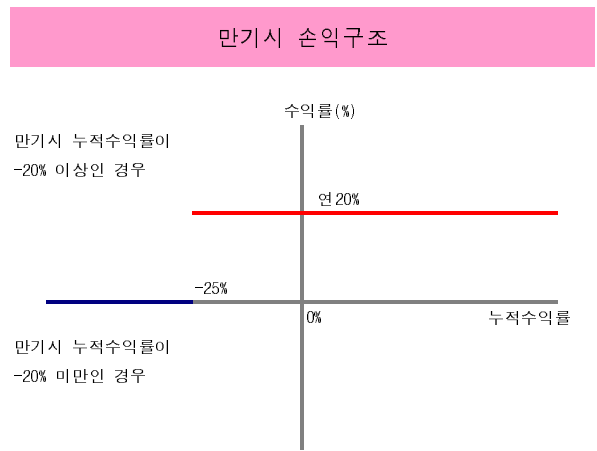
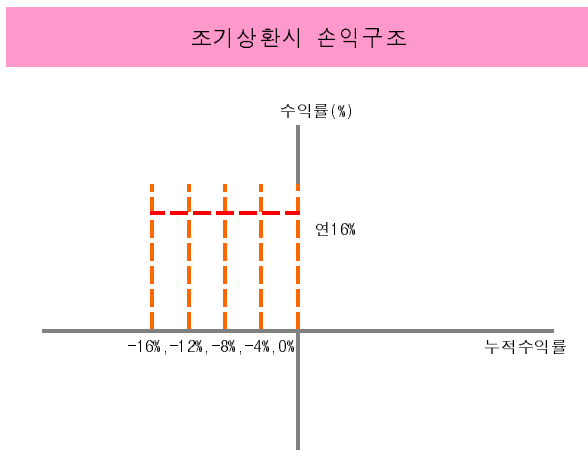
위험액	59.82
-----	-------

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,296	0	5,296	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6003456T62 현대증권(ELS)2007-504

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

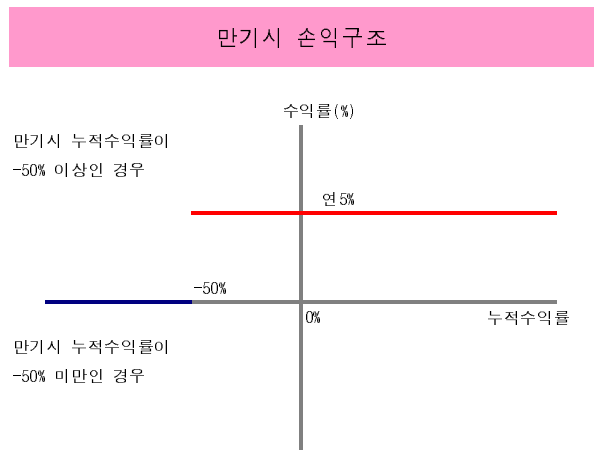
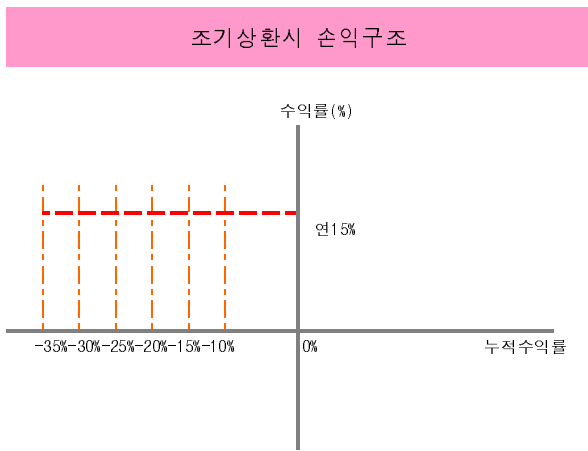
위험액	0.00
-----	------

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,674	0	1,674	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR603762CT80 미래에셋증권(ELS)191

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

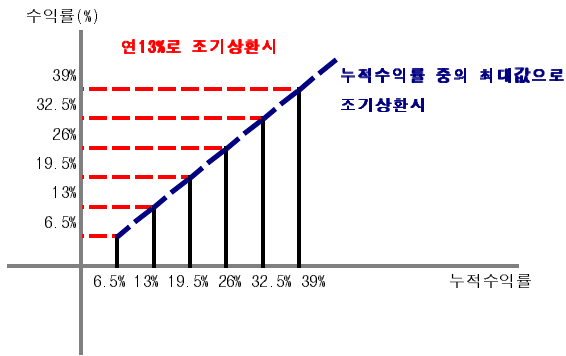
1. 계약금액

단위(백만원)

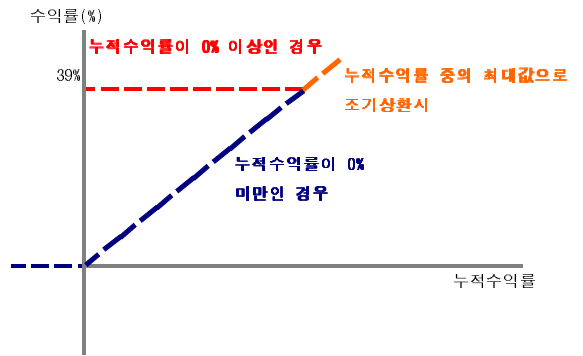
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,631	0	5,631	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR600680AT46 대우증권(ELS)1264

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

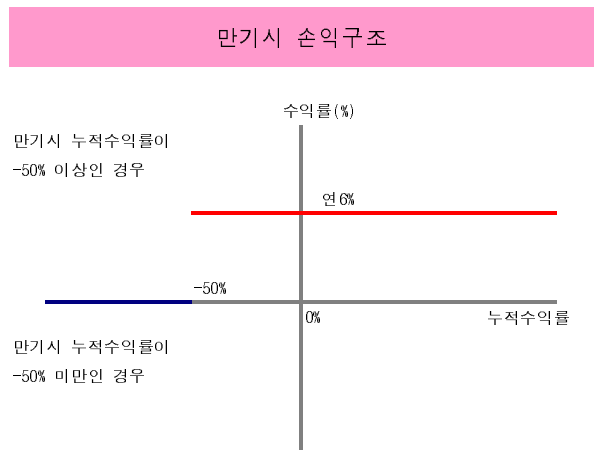
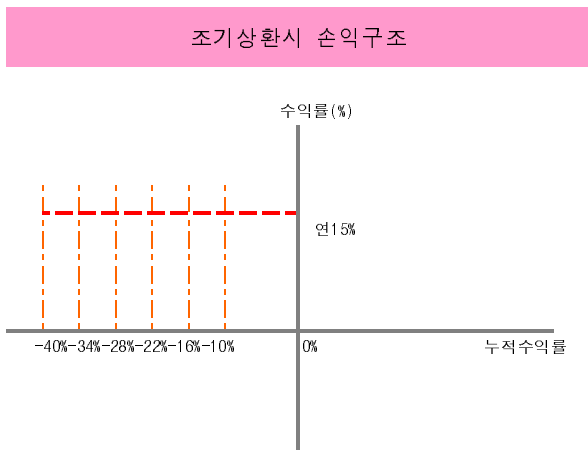
위험액	0.00
-----	------

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	964	0	964	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6006803T81 대우증권(ELS)1533

구분	변동성 시나리오						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	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
	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
	-2.67%	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
	-8.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

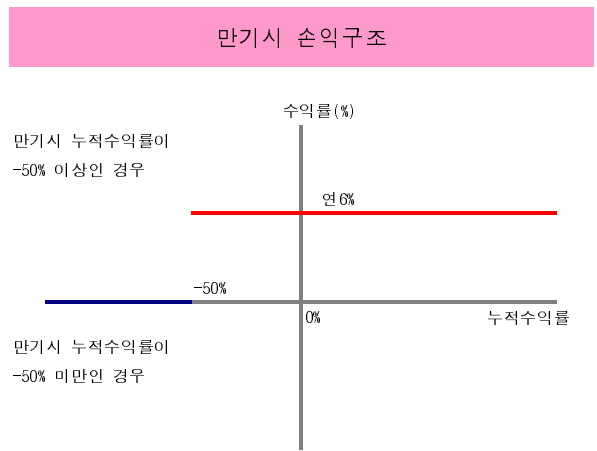
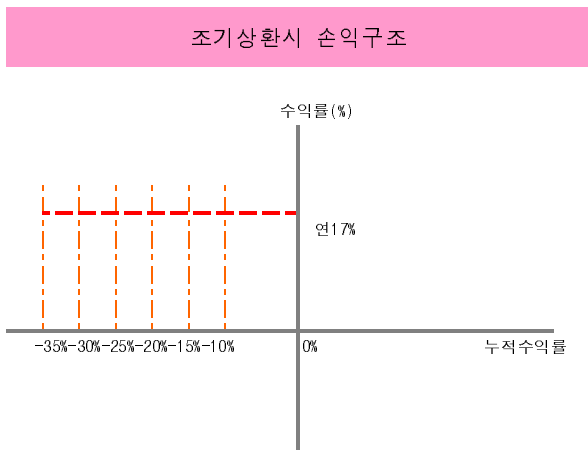
위험액	0.00
-----	------

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,359	0	1,359	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6037627T98 미래에셋증권(ELS)200

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	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%	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)

최대손실 시나리오

위험액	-0.01
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[116]

메리츠한중지수연계사모증권11호

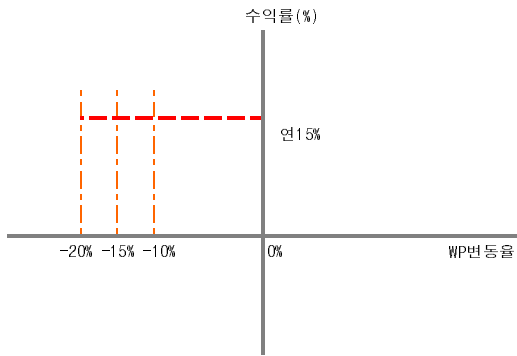
1. 계약금액

단위(백만원)

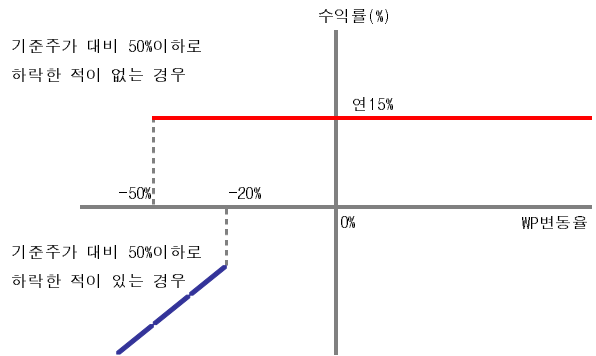
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	956	0	956	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583308WA6 현대증권(ELS)2009-1102

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	19.69	14.82	9.94	5.07	0.20	(4.68)	(9.55)
	5.33%	19.75	14.87	10.00	5.13	0.25	(4.62)	(9.50)
	2.67%	18.06	13.18	8.31	3.44	(1.44)	(6.31)	(11.19)
	0.00%	14.62	9.75	4.87	0.00	(4.87)	(9.75)	(14.62)
	-2.67%	9.44	4.57	(0.31)	(5.18)	(10.06)	(14.93)	(19.80)
	-5.33%	2.52	(2.36)	(7.23)	(12.11)	(16.98)	(21.86)	(26.73)
	-8.00%	(6.16)	(11.03)	(15.90)	(20.78)	(25.65)	(30.53)	(35.40)

최대손실 시나리오

위험액	-35.40
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.93
-----	-------

[117] 메리츠한중지수연계사모증권12호

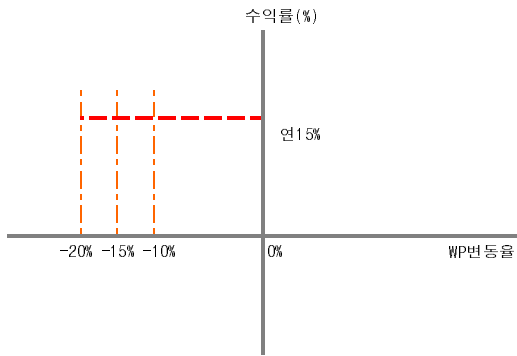
1. 계약금액

단위(백만원)

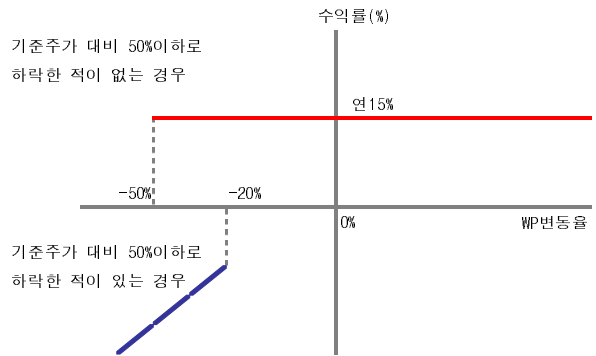
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	454	0	454	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583308WA6 현대증권(ELS)2009-1102

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	9.36	7.04	4.73	2.41	0.09	(2.22)	(4.54)
	5.33%	9.39	7.07	4.75	2.44	0.12	(2.20)	(4.52)
	2.67%	8.58	6.27	3.95	1.63	(0.68)	(3.00)	(5.32)
	0.00%	6.95	4.63	2.32	0.00	(2.32)	(4.63)	(6.95)
	-2.67%	4.49	2.17	(0.15)	(2.46)	(4.78)	(7.10)	(9.41)
	-5.33%	1.20	(1.12)	(3.44)	(5.76)	(8.07)	(10.39)	(12.71)
	-8.00%	(2.93)	(5.24)	(7.56)	(9.88)	(12.20)	(14.51)	(16.83)

최대손실 시나리오

위험액	-16.83
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.23
-----	-------



[118] 메리츠한중지수연계사모증권17호

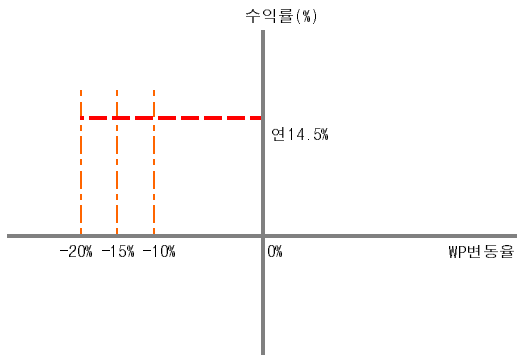
1. 계약금액

단위(백만원)

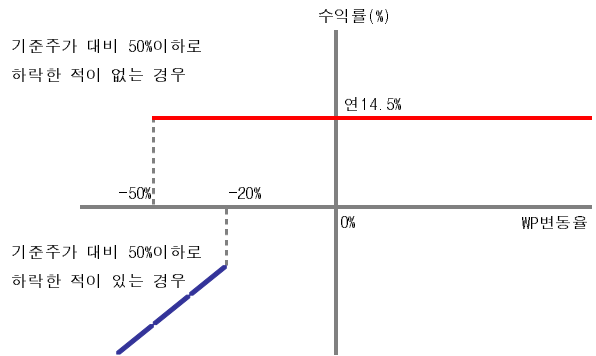
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,135	0	1,135	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6573358WB1 한국투자증권(ELS)1435

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	50.81	40.35	29.89	19.43	8.98	(1.48)	(11.94)
	5.33%	46.91	36.46	26.00	15.54	5.08	(5.38)	(15.83)
	2.67%	40.44	29.98	19.52	9.06	(1.40)	(11.85)	(22.31)
	0.00%	31.37	20.92	10.46	0.00	(10.46)	(20.92)	(31.37)
	-2.67%	19.73	9.27	(1.19)	(11.65)	(22.10)	(32.56)	(43.02)
	-5.33%	5.50	(4.96)	(15.42)	(25.88)	(36.34)	(46.79)	(57.25)
	-8.00%	(11.32)	(21.78)	(32.24)	(42.69)	(53.15)	(63.61)	(74.07)

최대손실 시나리오

위험액	-74.07
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	77.01
-----	-------

[119]

메리츠한중지수연계사모증권18호

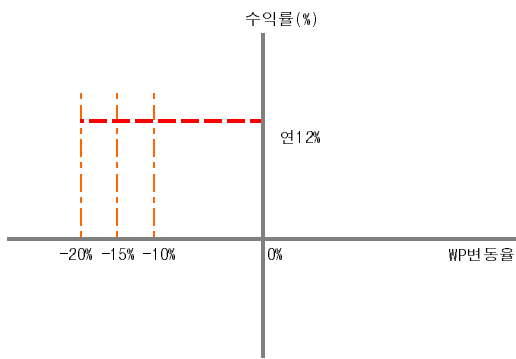
1. 계약금액

단위(백만원)

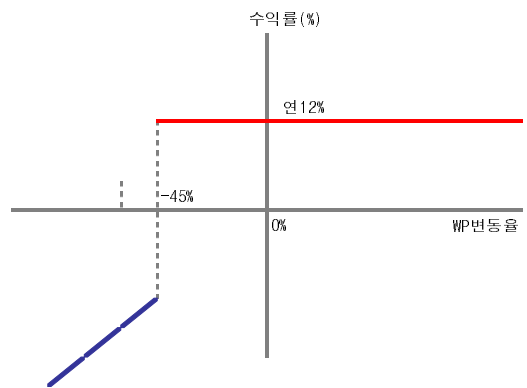
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	297	0	297	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553349WB4 우리투자증권(ELS)2747

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	9.71	7.31	4.90	2.50	0.09	(2.32)	(4.72)
	5.33%	9.39	6.98	4.58	2.17	(0.23)	(2.64)	(5.04)
	2.67%	8.56	6.15	3.75	1.34	(1.07)	(3.47)	(5.88)
	0.00%	7.22	4.81	2.41	0.00	(2.41)	(4.81)	(7.22)
	-2.67%	5.37	2.96	0.56	(1.85)	(4.25)	(6.66)	(9.06)
	-5.33%	3.01	0.61	(1.80)	(4.20)	(6.61)	(9.01)	(11.42)
	-8.00%	0.15	(2.26)	(4.66)	(7.07)	(9.47)	(11.88)	(14.28)

최대손실 시나리오

위험액	-14.28
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.37
-----	-------

[120]

메리츠한중지수연계사모증권20호

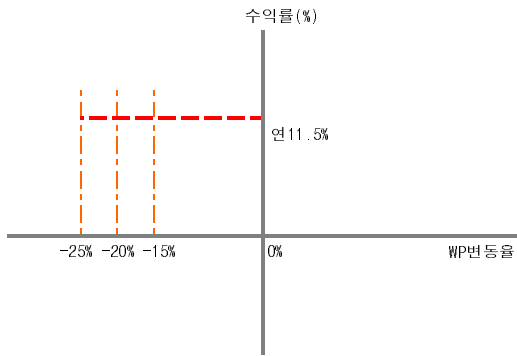
1. 계약금액

단위(백만원)

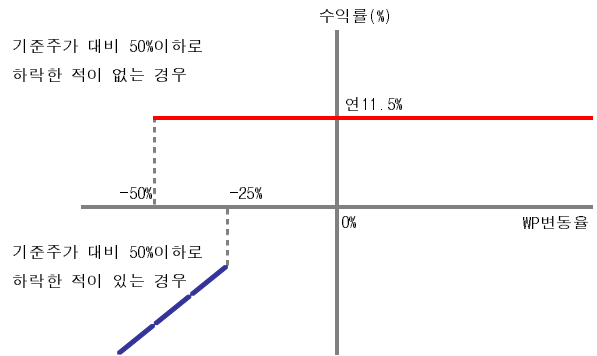
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	41	0	41	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6573392WB0 한국투자증권(ELS)1458

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	1.05	0.87	0.69	0.50	0.32	0.14	(0.04)
	5.33%	0.95	0.77	0.59	0.40	0.22	0.04	(0.14)
	2.67%	0.78	0.60	0.42	0.24	0.05	(0.13)	(0.31)
	0.00%	0.54	0.36	0.18	0.00	(0.18)	(0.36)	(0.54)
	-2.67%	0.24	0.06	(0.12)	(0.30)	(0.49)	(0.67)	(0.85)
	-5.33%	(0.13)	(0.31)	(0.49)	(0.68)	(0.86)	(1.04)	(1.22)
	-8.00%	(0.57)	(0.75)	(0.93)	(1.12)	(1.30)	(1.48)	(1.66)

최대손실 시나리오

위험액	-1.66
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.66
-----	------

[121] 메리츠한중지수연계사모증권제13

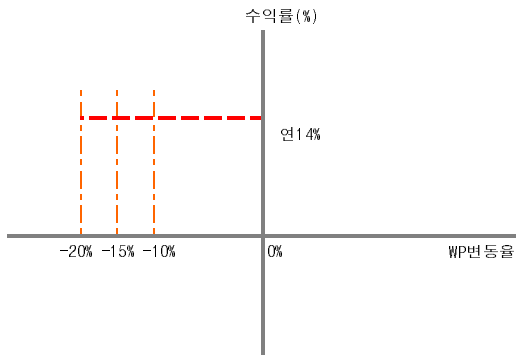
1. 계약금액

단위(백만원)

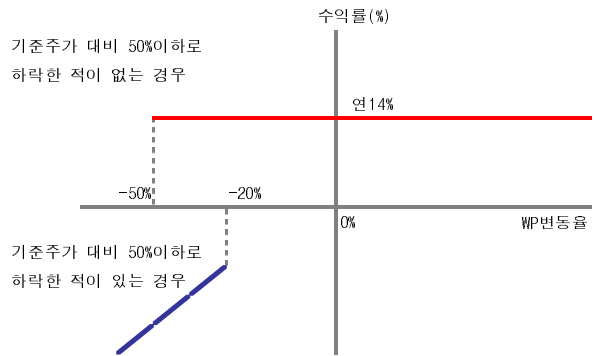
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,517	0	1,517	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6523360WA0 대우증권(ELS)3320

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	47.36	38.17	28.98	19.79	10.60	1.41	(7.78)
	5.33%	43.38	34.19	25.00	15.81	6.62	(2.57)	(11.75)
	2.67%	36.78	27.59	18.40	9.21	0.03	(9.16)	(18.35)
	0.00%	27.57	18.38	9.19	0.00	(9.19)	(18.38)	(27.57)
	-2.67%	15.73	6.54	(2.64)	(11.83)	(21.02)	(30.21)	(39.40)
	-5.33%	1.28	(7.91)	(17.10)	(26.29)	(35.47)	(44.66)	(53.85)
	-8.00%	(15.79)	(24.98)	(34.17)	(43.36)	(52.54)	(61.73)	(70.92)

최대손실 시나리오

위험액	-70.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	65.03
-----	-------

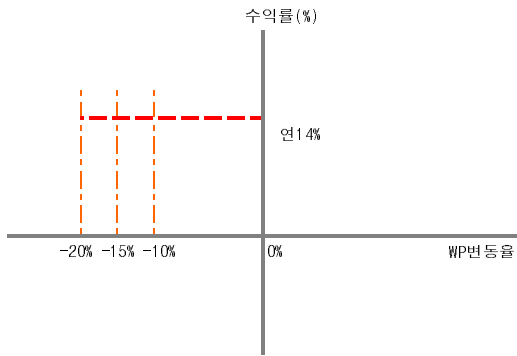
1. 계약금액

단위(백만원)

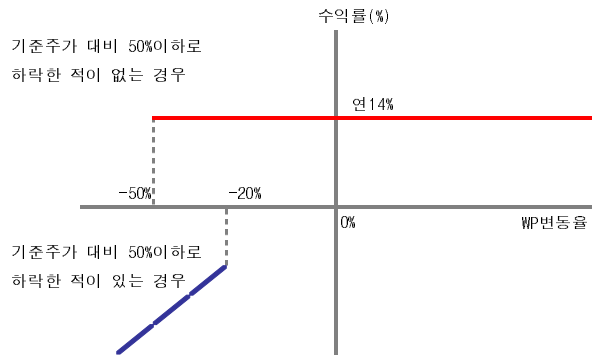
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	215	0	215	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6523360WA0 대우증권(ELS)3320

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	6.72	5.42	4.11	2.81	1.50	0.20	(1.10)
	5.33%	6.15	4.85	3.55	2.24	0.94	(0.36)	(1.67)
	2.67%	5.22	3.92	2.61	1.31	0.00	(1.30)	(2.60)
	0.00%	3.91	2.61	1.30	0.00	(1.30)	(2.61)	(3.91)
	-2.67%	2.23	0.93	(0.38)	(1.68)	(2.98)	(4.29)	(5.59)
	-5.33%	0.18	(1.12)	(2.43)	(3.73)	(5.03)	(6.34)	(7.64)
	-8.00%	(2.24)	(3.54)	(4.85)	(6.15)	(7.46)	(8.76)	(10.06)

최대손실 시나리오

위험액	-10.06
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.23
-----	------

[123]

메리츠한중지수연계사모증권제15

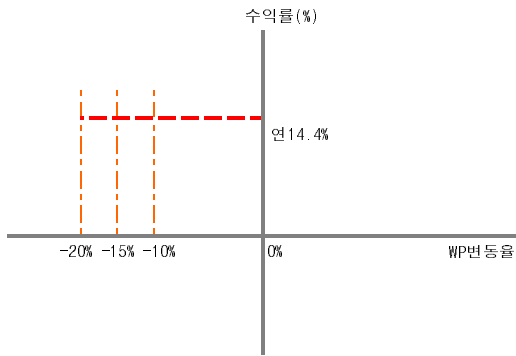
1. 계약금액

단위(백만원)

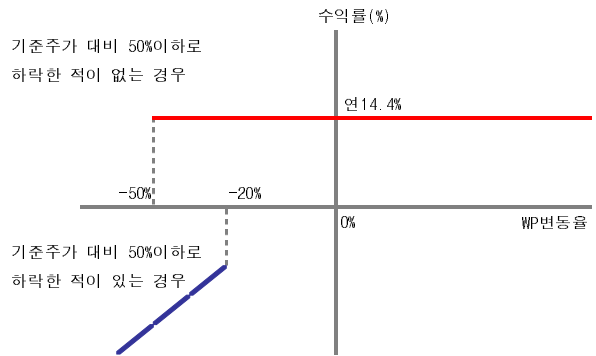
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	598	0	598	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6573380WA7 한국투자증권(ELS)1397

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	21.09	16.88	12.67	8.46	4.25	0.04	(4.17)
	5.33%	19.29	15.08	10.87	6.66	2.44	(1.77)	(5.98)
	2.67%	16.47	12.26	8.05	3.83	(0.38)	(4.59)	(8.80)
	0.00%	12.63	8.42	4.21	0.00	(4.21)	(8.42)	(12.63)
	-2.67%	7.78	3.57	(0.64)	(4.85)	(9.06)	(13.27)	(17.48)
	-5.33%	1.92	(2.29)	(6.50)	(10.71)	(14.92)	(19.14)	(23.35)
	-8.00%	(4.96)	(9.17)	(13.38)	(17.59)	(21.80)	(26.01)	(30.23)

최대손실 시나리오

위험액	-30.23
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.98
-----	-------

[124]

메리츠한중지수연계사모증권제16

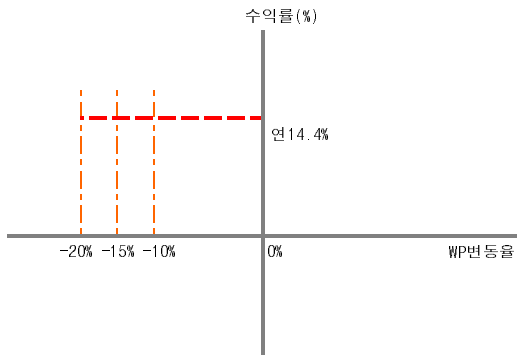
1. 계약금액

단위(백만원)

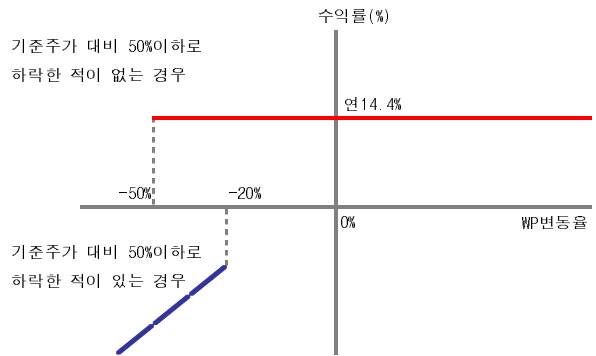
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	520	0	520	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6573380WA7 한국투자증권(ELS)1397

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	18.35	14.68	11.02	7.36	3.70	0.03	(3.63)
	5.33%	16.78	13.11	9.45	5.79	2.13	(1.54)	(5.20)
	2.67%	14.32	10.66	7.00	3.34	(0.33)	(3.99)	(7.65)
	0.00%	10.99	7.32	3.66	0.00	(3.66)	(7.32)	(10.99)
	-2.67%	6.77	3.11	(0.55)	(4.22)	(7.88)	(11.54)	(15.20)
	-5.33%	1.67	(1.99)	(5.65)	(9.32)	(12.98)	(16.64)	(20.30)
	-8.00%	(4.31)	(7.97)	(11.64)	(15.30)	(18.96)	(22.62)	(26.29)

최대손실 시나리오

위험액	-26.29
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	27.81
-----	-------

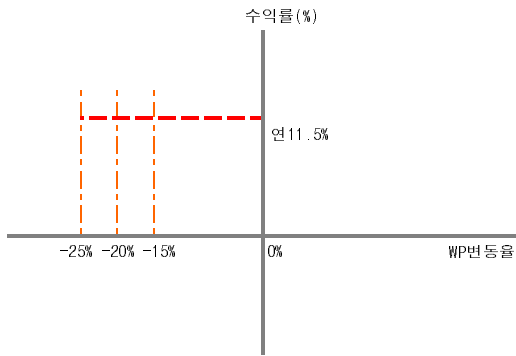
1. 계약금액

단위(백만원)

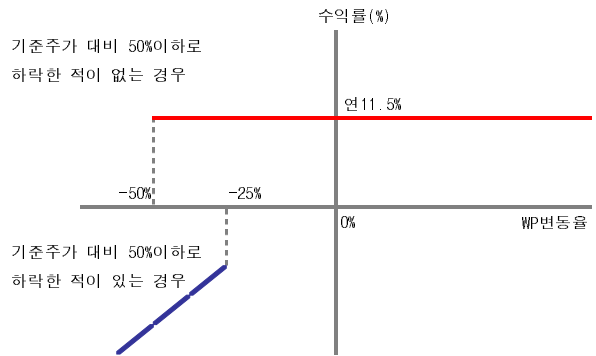
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,212	0	1,212	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6573392WB0 한국투자증권(ELS)1458

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	30.94	25.58	20.23	14.87	9.52	4.16	(1.19)
	5.33%	27.99	22.63	17.28	11.92	6.57	1.21	(4.14)
	2.67%	23.03	17.67	12.32	6.96	1.61	(3.75)	(9.10)
	0.00%	16.06	10.71	5.35	0.00	(5.35)	(10.71)	(16.06)
	-2.67%	7.09	1.74	(3.62)	(8.97)	(14.33)	(19.68)	(25.03)
	-5.33%	(3.88)	(9.24)	(14.59)	(19.95)	(25.30)	(30.66)	(36.01)
	-8.00%	(16.87)	(22.22)	(27.58)	(32.93)	(38.28)	(43.64)	(48.99)

최대손실 시나리오

위험액	-48.99
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	49.03
-----	-------



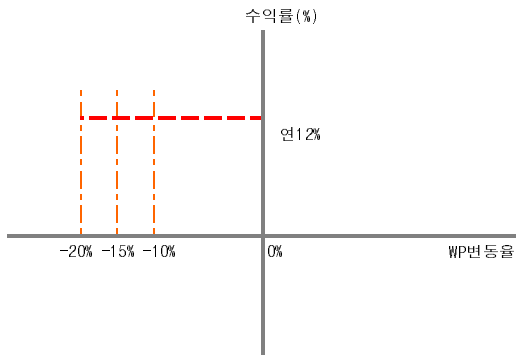
1. 계약금액

단위(백만원)

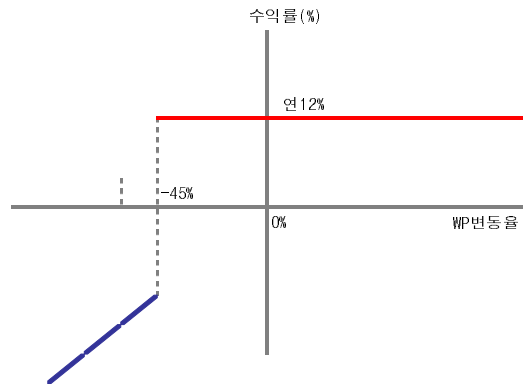
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	199	0	199	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553324WC5 우리투자증권(ELS)2790

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	7.98	6.22	4.45	2.68	0.91	(0.85)	(2.62)
	5.33%	7.40	5.63	3.86	2.10	0.33	(1.44)	(3.21)
	2.67%	6.50	4.74	2.97	1.20	(0.57)	(2.33)	(4.10)
	0.00%	5.30	3.54	1.77	0.00	(1.77)	(3.54)	(5.30)
	-2.67%	3.79	2.03	0.26	(1.51)	(3.28)	(5.04)	(6.81)
	-5.33%	1.98	0.21	(1.56)	(3.33)	(5.09)	(6.86)	(8.63)
	-8.00%	(0.15)	(1.92)	(3.68)	(5.45)	(7.22)	(8.99)	(10.75)

최대손실 시나리오

위험액	-10.75
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	8.75
-----	------

[127] 메리츠한중지수연계사모증권제22

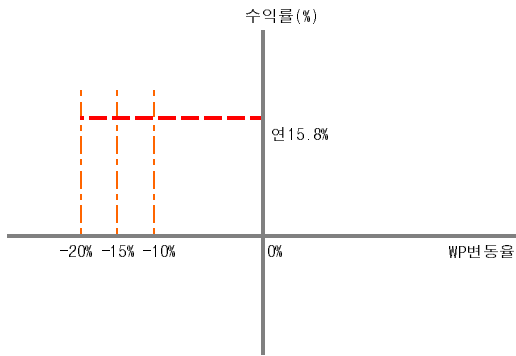
1. 계약금액

단위(백만원)

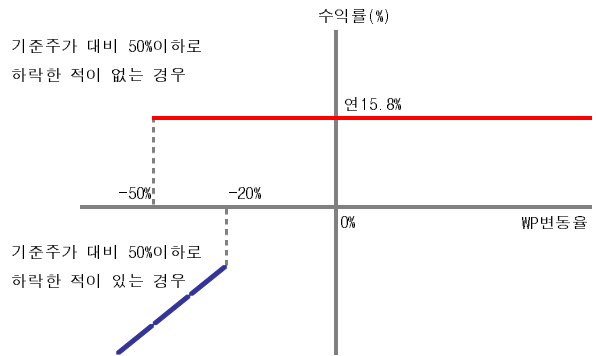
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	666	0	666	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653310WC3 한화스마트(ELS)242

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	28.83	23.37	17.92	12.46	7.01	1.55	(3.90)
	5.33%	25.76	20.30	14.85	9.39	3.94	(1.52)	(6.98)
	2.67%	21.60	16.15	10.69	5.24	(0.22)	(5.67)	(11.13)
	0.00%	16.37	10.91	5.46	0.00	(5.46)	(10.91)	(16.37)
	-2.67%	10.05	4.59	(0.86)	(6.32)	(11.78)	(17.23)	(22.69)
	-5.33%	2.65	(2.81)	(8.27)	(13.72)	(19.18)	(24.63)	(30.09)
	-8.00%	(5.84)	(11.29)	(16.75)	(22.21)	(27.66)	(33.12)	(38.57)

최대손실 시나리오

위험액	-38.57
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	35.38
-----	-------

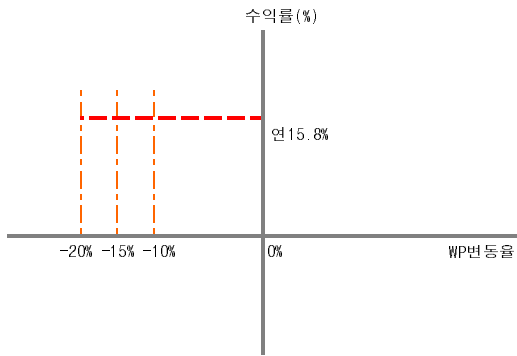
1. 계약금액

단위(백만원)

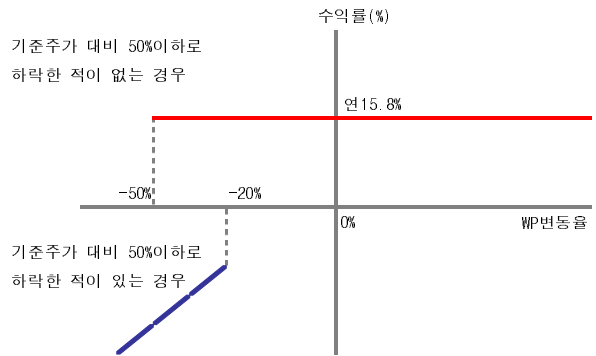
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	91	0	91	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653310WC3 한화스마트(ELS)242

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	3.94	3.20	2.45	1.70	0.96	0.21	(0.53)
	5.33%	3.52	2.78	2.03	1.28	0.54	(0.21)	(0.95)
	2.67%	2.95	2.21	1.46	0.72	(0.03)	(0.78)	(1.52)
	0.00%	2.24	1.49	0.75	0.00	(0.75)	(1.49)	(2.24)
	-2.67%	1.37	0.63	(0.12)	(0.86)	(1.61)	(2.36)	(3.10)
	-5.33%	0.36	(0.38)	(1.13)	(1.88)	(2.62)	(3.37)	(4.11)
	-8.00%	(0.80)	(1.54)	(2.29)	(3.04)	(3.78)	(4.53)	(5.27)

최대손실 시나리오

위험액	-5.27
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.84
-----	------

[129]

메리츠한중지수연계사모증권제24

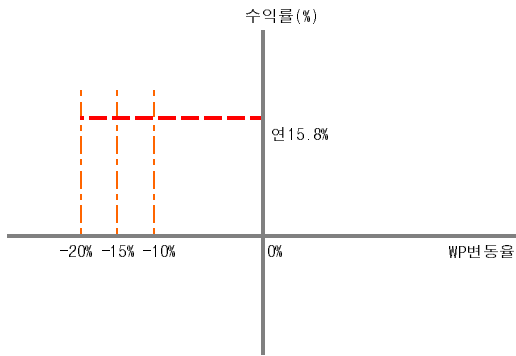
1. 계약금액

단위(백만원)

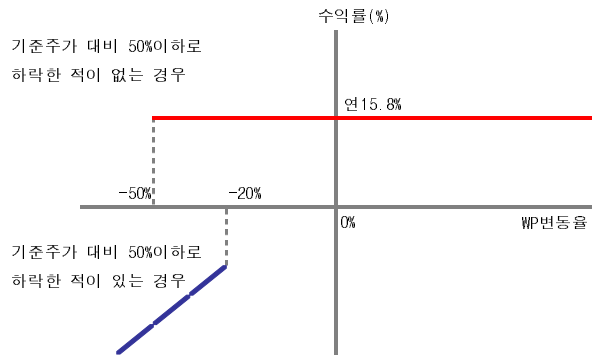
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	570	0	570	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653310WC3 한화스마트(ELS)242

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	24.68	20.01	15.34	10.67	6.00	1.33	(3.34)
	5.33%	22.05	17.38	12.71	8.04	3.37	(1.30)	(5.97)
	2.67%	18.49	13.82	9.15	4.48	(0.19)	(4.86)	(9.53)
	0.00%	14.01	9.34	4.67	0.00	(4.67)	(9.34)	(14.01)
	-2.67%	8.60	3.93	(0.74)	(5.41)	(10.08)	(14.75)	(19.42)
	-5.33%	2.26	(2.41)	(7.08)	(11.75)	(16.42)	(21.09)	(25.76)
	-8.00%	(5.00)	(9.67)	(14.34)	(19.01)	(23.68)	(28.35)	(33.02)

최대손실 시나리오

위험액	-33.02
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	30.28
-----	-------

[131]

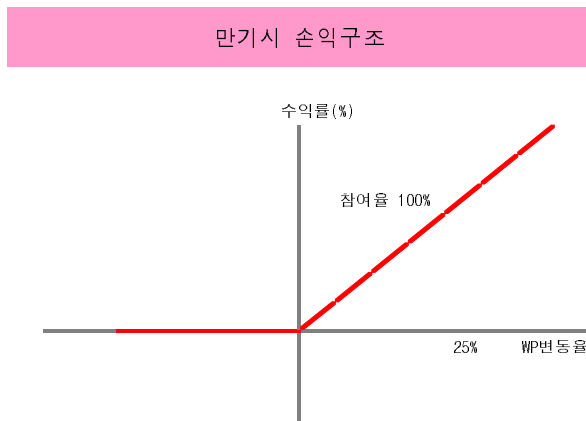
메리츠MLCXALS연계사모증권제1호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	653	0	653	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6519104W76 대신증권(DLS)19

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	90.72	90.85	90.98	91.11	91.24	91.37	91.50
	5.33%	54.79	54.92	55.05	55.18	55.31	55.44	55.57
	2.67%	24.42	24.55	24.68	24.81	24.94	25.07	25.20
	0.00%	(0.39)	(0.26)	(0.13)	0.00	0.13	0.26	0.39
	-2.67%	(19.65)	(19.52)	(19.39)	(19.26)	(19.13)	(19.00)	(18.87)
	-5.33%	(33.35)	(33.22)	(33.09)	(32.96)	(32.83)	(32.70)	(32.56)
	-8.00%	(41.49)	(41.36)	(41.23)	(41.10)	(40.97)	(40.84)	(40.71)

최대손실 시나리오

위험액	-40.71
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	68.43
-----	-------

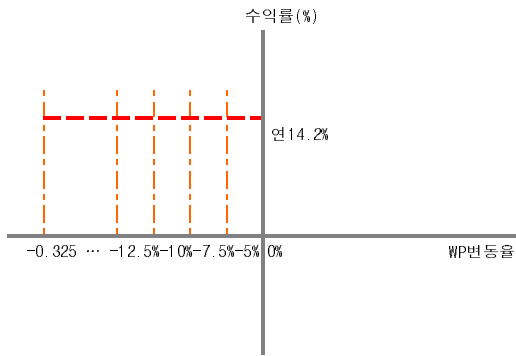
1. 계약금액

단위(백만원)

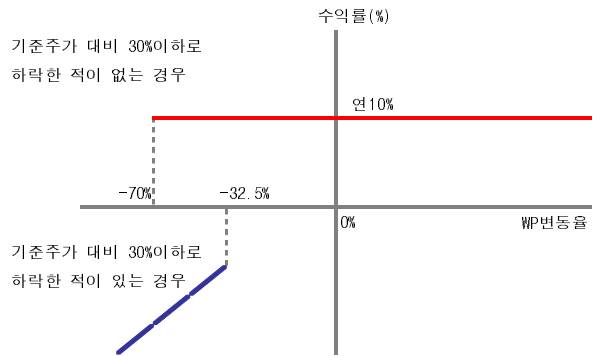
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR600867BTB0 신한투자(ELS)803

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	108.08	99.29	90.51	81.73	72.94	64.16	55.38
	5.33%	84.22	75.43	66.65	57.87	49.08	40.30	31.52
	2.67%	56.98	48.19	39.41	30.63	21.84	13.06	4.28
	0.00%	26.35	17.57	8.78	0.00	(8.78)	(17.57)	(26.35)
	-2.67%	(7.66)	(16.44)	(25.23)	(34.01)	(42.79)	(51.58)	(60.36)
	-5.33%	(45.05)	(53.83)	(62.62)	(71.40)	(80.18)	(88.97)	(97.75)
	-8.00%	(85.83)	(94.61)	(103.39)	(112.18)	(120.96)	(129.74)	(138.53)

최대 손실 시나리오

위험액	-138.53
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	156.69
-----	--------

[135-1]

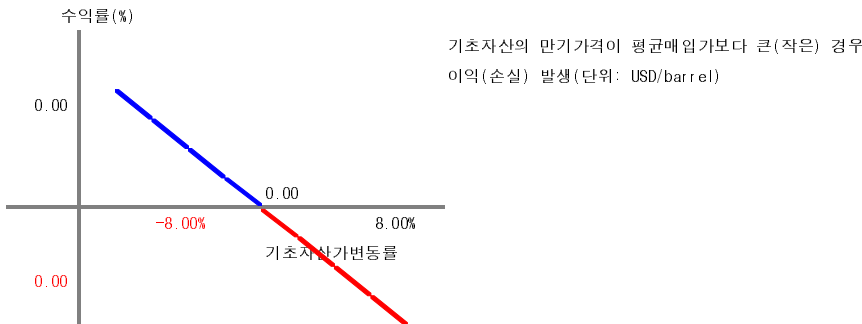
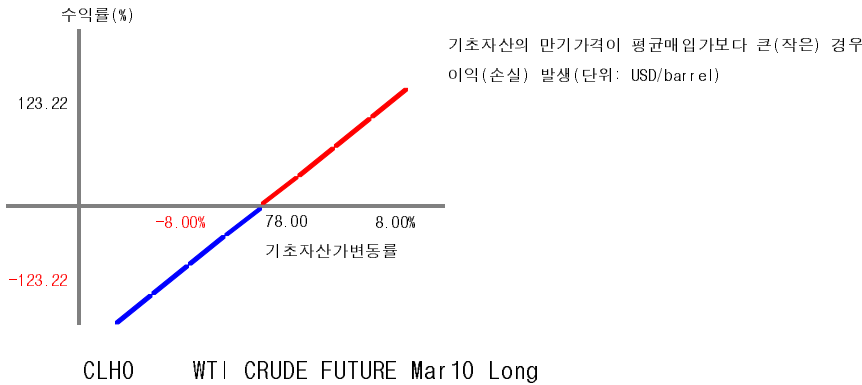
메리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	20	0	20	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLHO WTI CRUDE FUTURE Mar 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	123.22
	5.33%	82.10
	2.67%	41.13
	0.00%	0.00
	-2.67%	-41.13
	-5.33%	-82.10
	-8.00%	-123.22

최대손실 시나리오	
위험액	-123.22

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

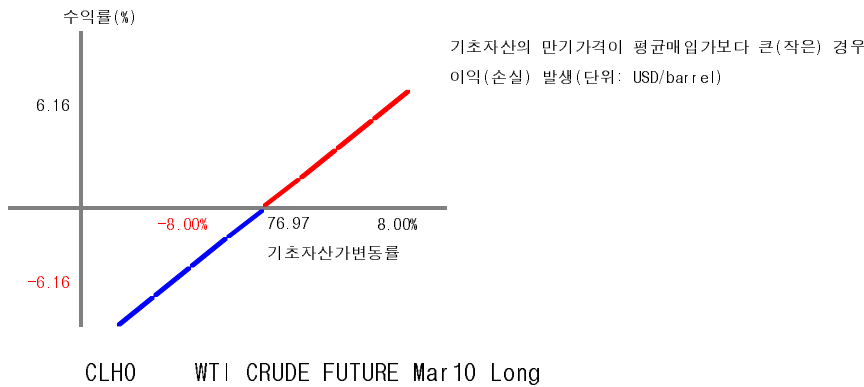
위험액	499
-----	-----

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:1000USD))

CLHO WTI CRUDE FUTURE Mar 10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	6.16
	5.33%	4.10
	2.67%	2.06
	0.00%	0.00
	-2.67%	-2.06
	-5.33%	-4.10
	-8.00%	-6.16

최대손실 시나리오	
위험액	-6.16

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25
-----	----



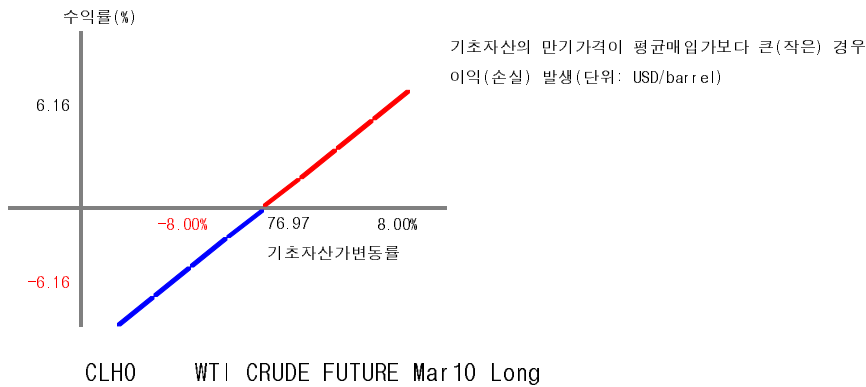
[137-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLHO WTI CRUDE FUTURE Mar10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	21.57
	5.33%	14.37
	2.67%	7.20
	0.00%	0.00
	-2.67%	-7.20
	-5.33%	-14.37
	-8.00%	-21.57

최대손실 시나리오	
위험액	-21.57

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	86
-----	----

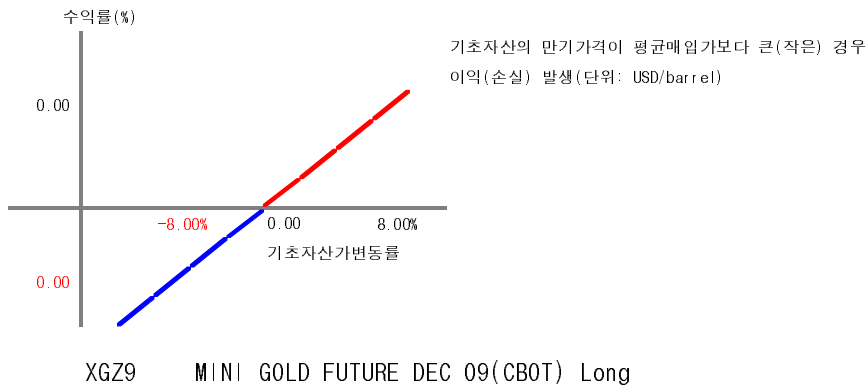
[137-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



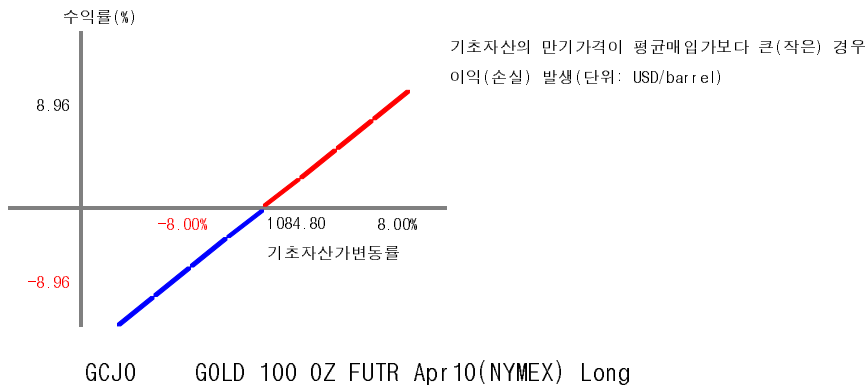
[137-3] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



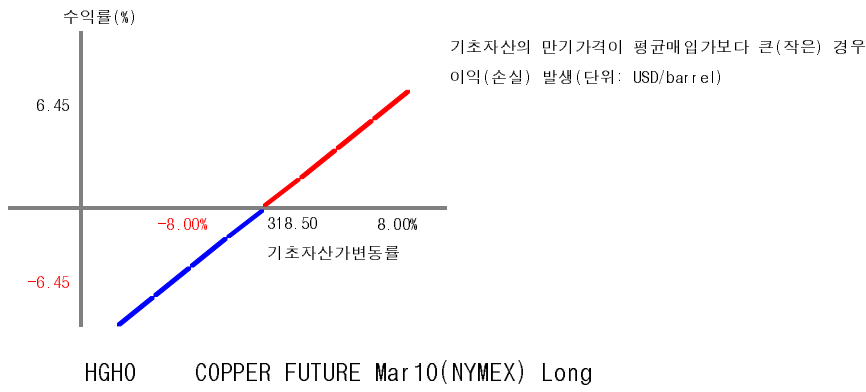
[137-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



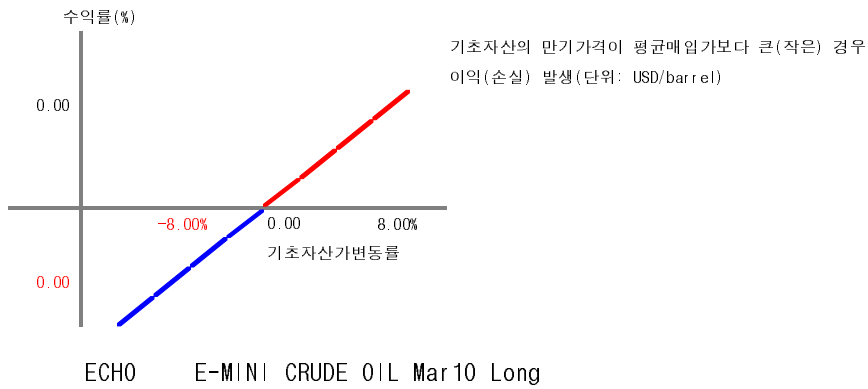
[137-5] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

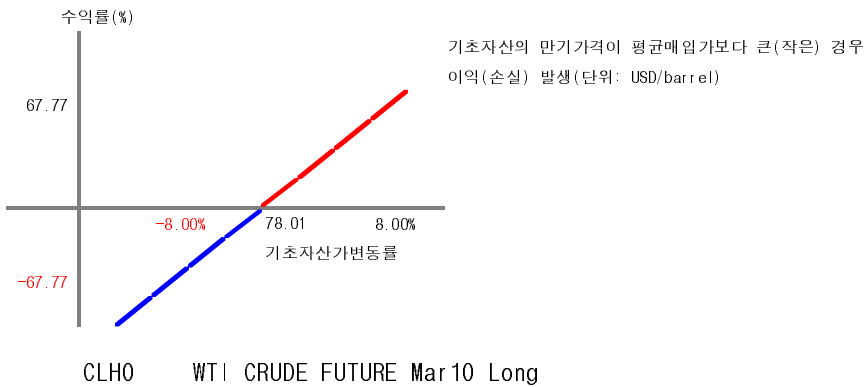


1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:1000USD))

CLHO WTI CRUDE FUTURE Mar10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	67.77
	5.33%	45.15
	2.67%	22.62
	0.00%	0.00
	-2.67%	-22.62
	-5.33%	-45.15
	-8.00%	-67.77

최대손실 시나리오	
위험액	-67.77

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	255
-----	-----

[139] 메리츠2Star사모증권HSSS-1호

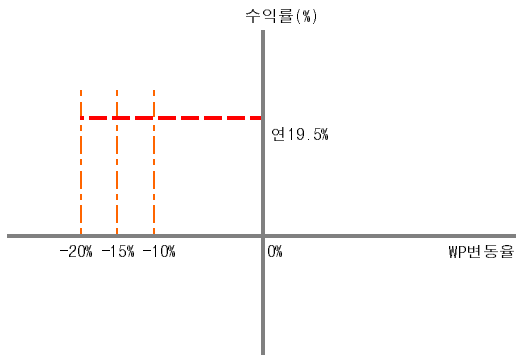
1. 계약금액

단위(백만원)

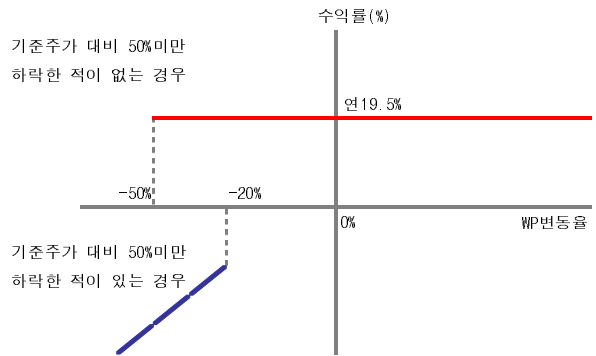
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,000	0	1,000	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6542307014 신영증권(ELS)1387

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	24.63	21.48	18.34	15.19	12.04	8.90	5.75
	5.33%	20.67	17.53	14.38	11.23	8.09	4.94	1.79
	2.67%	15.61	12.46	9.32	6.17	3.02	(0.12)	(3.27)
	0.00%	9.44	6.29	3.15	0.00	(3.15)	(6.29)	(9.44)
	-2.67%	2.16	(0.99)	(4.13)	(7.28)	(10.43)	(13.57)	(16.72)
	-5.33%	(6.22)	(9.37)	(12.52)	(15.66)	(18.81)	(21.96)	(25.10)
	-8.00%	(15.72)	(18.87)	(22.01)	(25.16)	(28.31)	(31.45)	(34.60)

최대손실 시나리오

위험액	-34.60
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	39.06
-----	-------

[140]

메리츠2Star사모증권LESE-2호

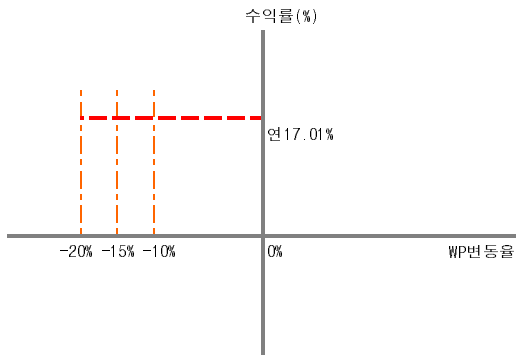
1. 계약금액

단위(백만원)

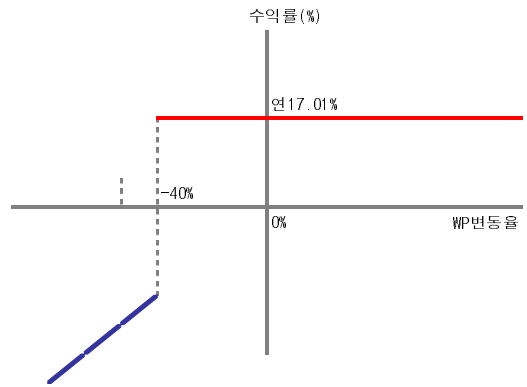
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,436	0	1,436	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662381WC3 동양(ELS)425

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	43.30	35.59	27.88	20.17	12.45	4.74	(2.97)
	5.33%	38.43	30.71	23.00	15.29	7.58	(0.14)	(7.85)
	2.67%	31.70	23.99	16.28	8.57	0.85	(6.86)	(14.57)
	0.00%	23.14	15.42	7.71	0.00	(7.71)	(15.42)	(23.14)
	-2.67%	12.73	5.02	(2.70)	(10.41)	(18.12)	(25.83)	(33.55)
	-5.33%	0.47	(7.24)	(14.95)	(22.66)	(30.38)	(38.09)	(45.80)
	-8.00%	(13.62)	(21.34)	(29.05)	(36.76)	(44.47)	(52.18)	(59.90)

최대손실 시나리오

위험액	-59.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	48.67
-----	-------



[141] 메리츠2Star사모증권LESE-3호

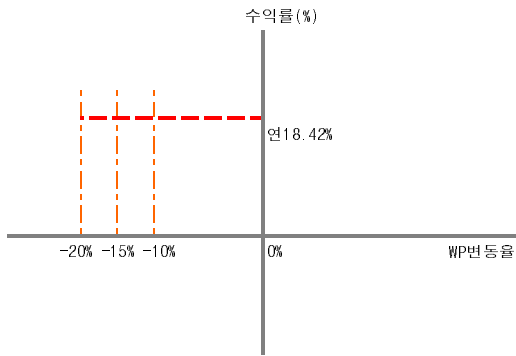
1. 계약금액

단위(백만원)

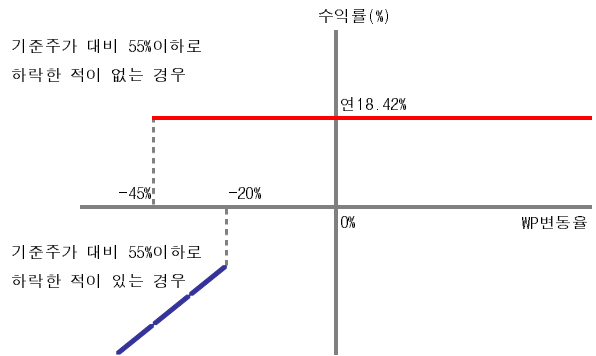
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,000	0	2,000	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622301010 교보증권(ELS)468

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	98.60	83.06	67.51	51.97	36.42	20.88	5.33
	5.33%	84.10	68.56	53.01	37.47	21.92	6.38	(9.17)
	2.67%	66.78	51.23	35.69	20.14	4.60	(10.95)	(26.49)
	0.00%	46.63	31.09	15.54	0.00	(15.54)	(31.09)	(46.63)
	-2.67%	23.67	8.13	(7.42)	(22.96)	(38.51)	(54.05)	(69.60)
	-5.33%	(2.11)	(17.66)	(33.20)	(48.75)	(64.29)	(79.84)	(95.38)
	-8.00%	(30.72)	(46.26)	(61.81)	(77.35)	(92.90)	(108.44)	(123.99)

최대손실 시나리오

위험액	-123.99
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	120.39
-----	--------

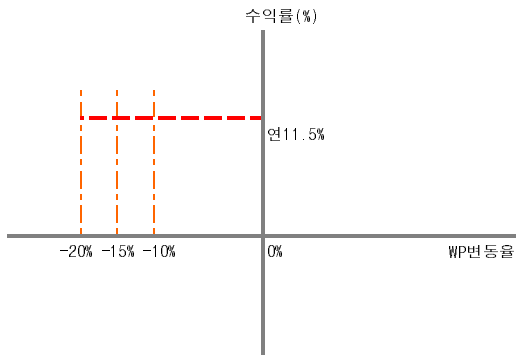
1. 계약금액

단위(백만원)

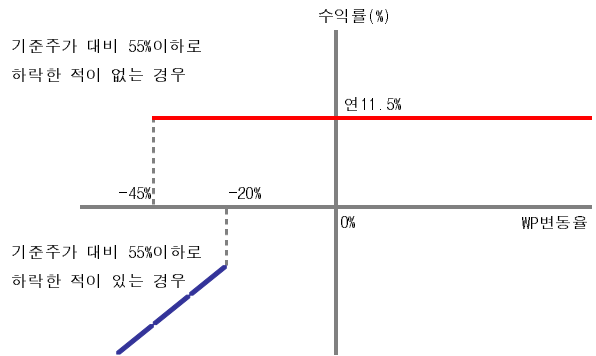
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,304	0	1,304	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512113012 대신증권(ELS)933

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	74.67	62.30	49.92	37.55	25.17	12.80	0.42
	5.33%	63.88	51.51	39.13	26.76	14.38	2.01	(10.37)
	2.67%	51.37	38.99	26.62	14.24	1.87	(10.51)	(22.88)
	0.00%	37.12	24.75	12.37	0.00	(12.37)	(24.75)	(37.12)
	-2.67%	21.15	8.78	(3.60)	(15.97)	(28.35)	(40.72)	(53.10)
	-5.33%	3.45	(8.92)	(21.30)	(33.67)	(46.05)	(58.42)	(70.80)
	-8.00%	(15.98)	(28.35)	(40.73)	(53.10)	(65.48)	(77.85)	(90.23)

최대손실 시나리오

위험액	-90.23
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	91.70
-----	-------

[143] 메리츠2Star사모증권SFSE-5호

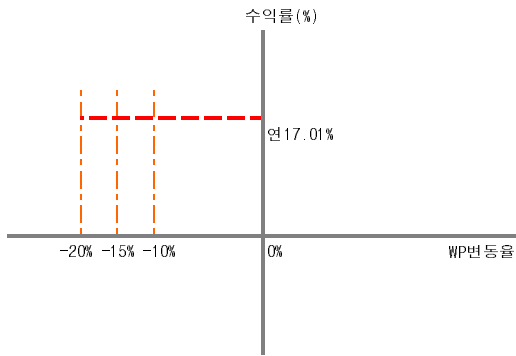
1. 계약금액

단위(백만원)

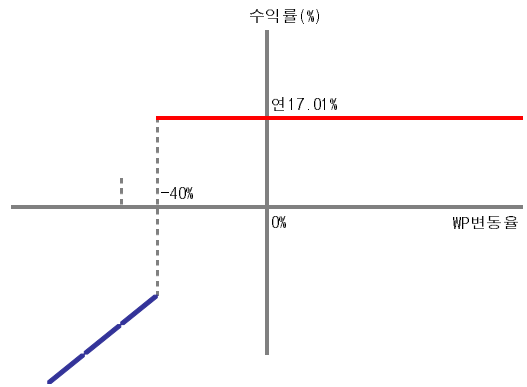
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	533	0	533	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662389WC6 동양(ELS)438

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나 리오	8.00%	18.62	16.02	13.41	10.81	8.20	5.59	2.99
	5.33%	15.49	12.88	10.28	7.67	5.06	2.46	(0.15)
	2.67%	11.89	9.28	6.67	4.07	1.46	(1.14)	(3.75)
	0.00%	7.82	5.21	2.61	0.00	(2.61)	(5.21)	(7.82)
	-2.67%	3.28	0.68	(1.93)	(4.53)	(7.14)	(9.75)	(12.35)
	-5.33%	(1.72)	(4.32)	(6.93)	(9.53)	(12.14)	(14.75)	(17.35)
	-8.00%	(7.18)	(9.79)	(12.39)	(15.00)	(17.61)	(20.21)	(22.82)

최대손실 시나리오

위험액	-22.82
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.94
-----	-------

[144] 메리츠2Star사모증권SFSE-6호

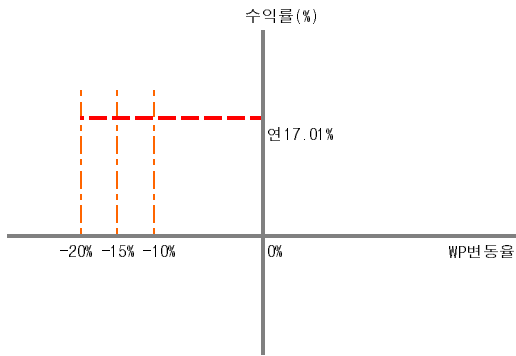
1. 계약금액

단위(백만원)

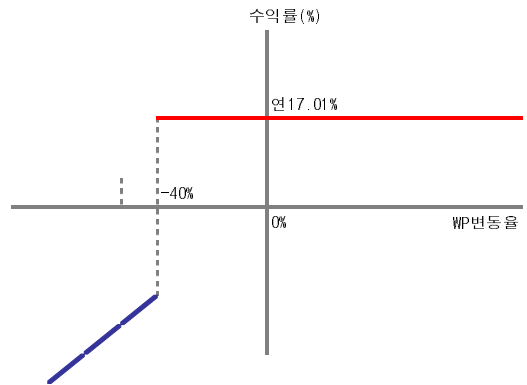
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	214	0	214	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662389WC6 동양(ELS)438

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	7.47	6.42	5.38	4.33	3.29	2.24	1.20
	5.33%	6.21	5.16	4.12	3.08	2.03	0.99	(0.06)
	2.67%	4.77	3.72	2.68	1.63	0.59	(0.46)	(1.50)
	0.00%	3.13	2.09	1.04	0.00	(1.04)	(2.09)	(3.13)
	-2.67%	1.32	0.27	(0.77)	(1.82)	(2.86)	(3.91)	(4.95)
	-5.33%	(0.69)	(1.73)	(2.78)	(3.82)	(4.87)	(5.91)	(6.96)
	-8.00%	(2.88)	(3.92)	(4.97)	(6.01)	(7.06)	(8.10)	(9.15)

최대손실 시나리오

위험액	-9.15
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.00
-----	-------

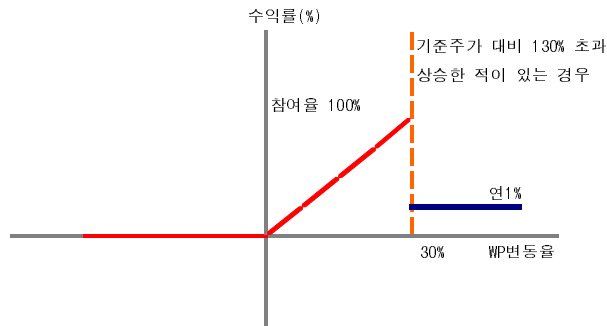
1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	300	0	300	장익

2. 만기시점의 손익구조

만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653315WC2 한화스마트(ELS)246

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	3.74	3.13	2.52	1.91	1.30	0.69	0.09
	5.33%	3.23	2.63	2.02	1.41	0.80	0.19	(0.42)
	2.67%	2.60	1.99	1.38	0.77	0.16	(0.45)	(1.05)
	0.00%	1.83	1.22	0.61	0.00	(0.61)	(1.22)	(1.83)
	-2.67%	0.92	0.31	(0.30)	(0.91)	(1.51)	(2.12)	(2.73)
	-5.33%	(0.12)	(0.73)	(1.34)	(1.95)	(2.56)	(3.16)	(3.77)
	-8.00%	(1.30)	(1.91)	(2.51)	(3.12)	(3.73)	(4.34)	(4.95)

최대손실 시나리오

위험액	-4.95
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.13
-----	------

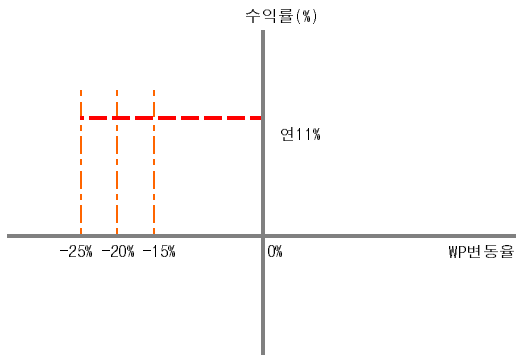
1. 계약금액

단위(백만원)

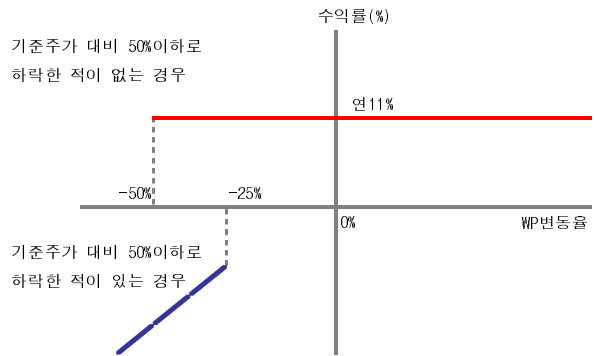
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503327WC9 신한투자(ELS)1275

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	4.27	3.55	2.83	2.12	1.40	0.68	(0.03)
	5.33%	3.78	3.07	2.35	1.63	0.92	0.20	(0.52)
	2.67%	3.08	2.36	1.64	0.93	0.21	(0.51)	(1.22)
	0.00%	2.15	1.43	0.72	0.00	(0.72)	(1.43)	(2.15)
	-2.67%	1.00	0.28	(0.43)	(1.15)	(1.87)	(2.58)	(3.30)
	-5.33%	(0.37)	(1.09)	(1.80)	(2.52)	(3.24)	(3.95)	(4.67)
	-8.00%	(1.96)	(2.68)	(3.39)	(4.11)	(4.83)	(5.54)	(6.26)

최대손실 시나리오

위험액	-6.26
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.95
-----	------

[146-2]

메리츠한중지수연계사모증권제25

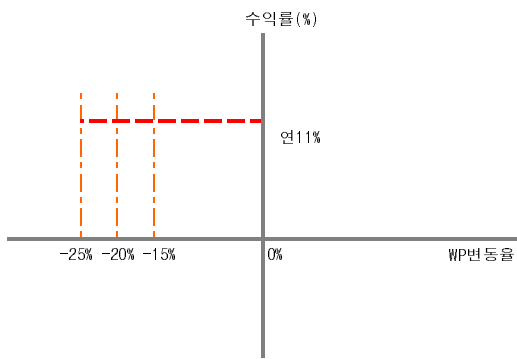
1. 계약금액

단위(백만원)

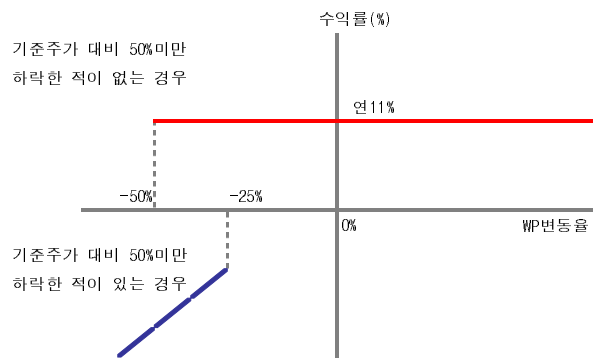
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

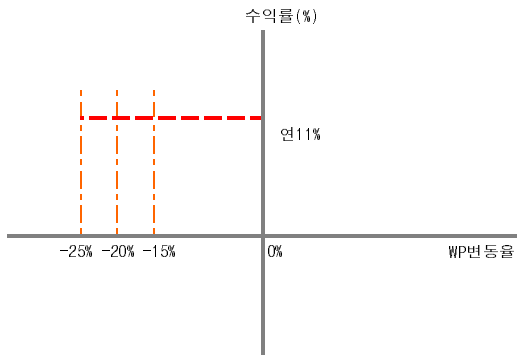
1. 계약금액

단위(백만원)

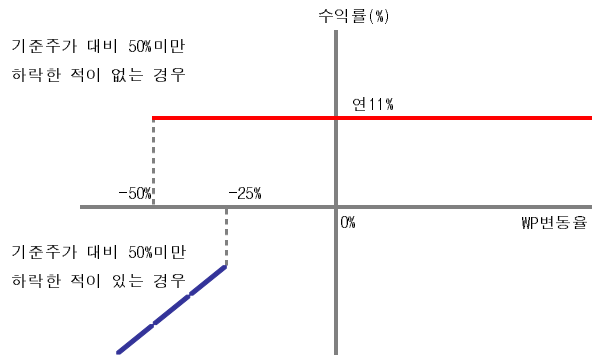
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154



[146-4]

메리츠한중지수연계사모증권제25

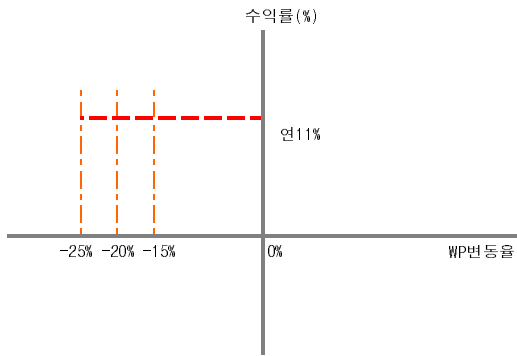
1. 계약금액

단위(백만원)

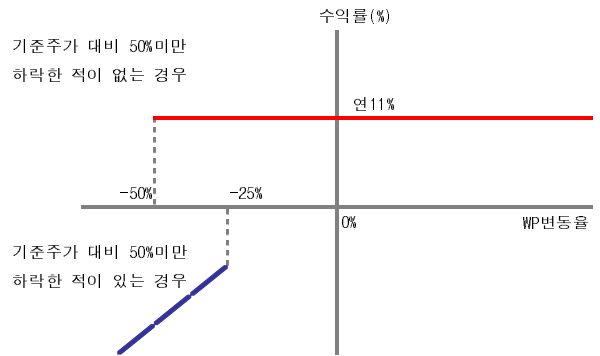
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[147-1]

메리츠한중지수연계사모증권제26

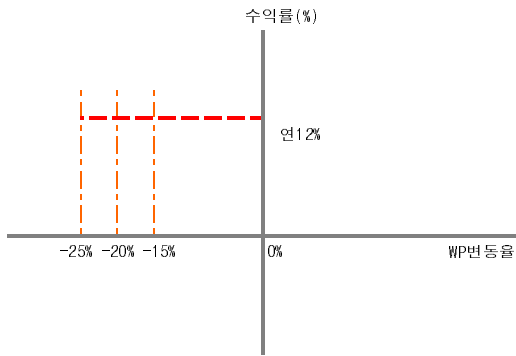
1. 계약금액

단위(백만원)

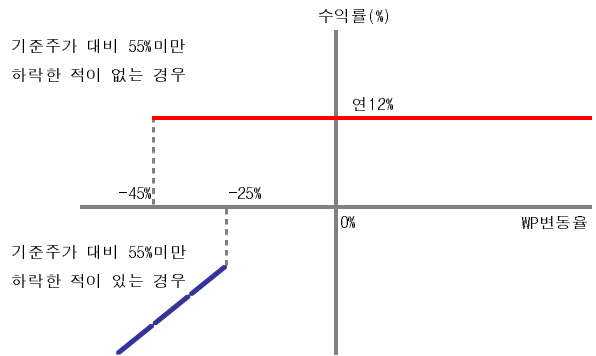
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513340WC0 대신증권(ELS)920

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	3.90	3.29	2.68	2.07	1.46	0.85	0.24
	5.33%	3.37	2.76	2.15	1.54	0.93	0.32	(0.29)
	2.67%	2.68	2.07	1.46	0.85	0.24	(0.37)	(0.98)
	0.00%	1.83	1.22	0.61	0.00	(0.61)	(1.22)	(1.83)
	-2.67%	0.83	0.22	(0.39)	(1.01)	(1.62)	(2.23)	(2.84)
	-5.33%	(0.34)	(0.95)	(1.56)	(2.17)	(2.78)	(3.39)	(4.00)
	-8.00%	(1.66)	(2.27)	(2.88)	(3.49)	(4.10)	(4.71)	(5.32)

최대손실 시나리오

위험액	-5.32
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	5.25
-----	------

[147-2]

메리츠한중지수연계사모증권제26

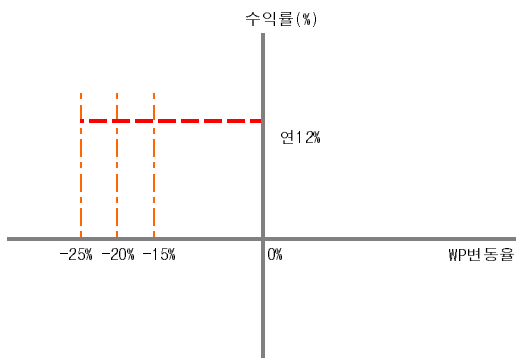
1. 계약금액

단위(백만원)

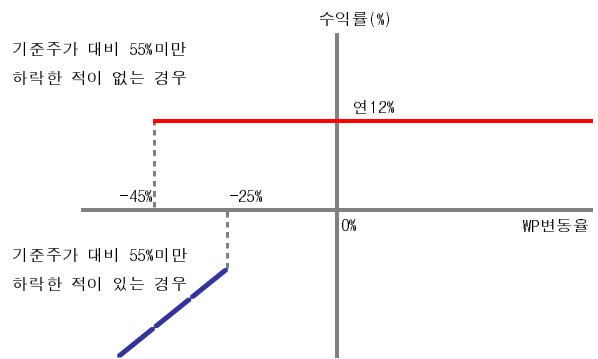
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[147-3]

메리츠한중지수연계사모증권제26

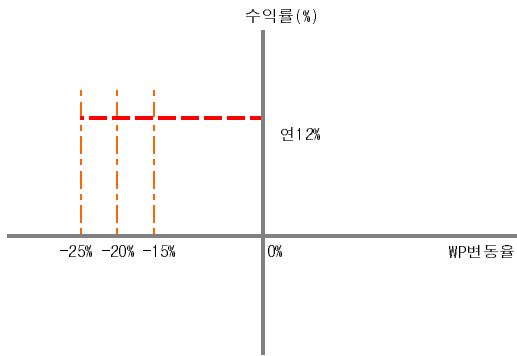
1. 계약금액

단위(백만원)

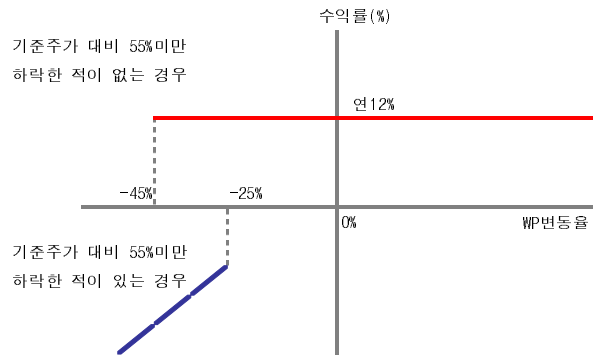
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[147-4]

메리츠한중지수연계사모증권제26

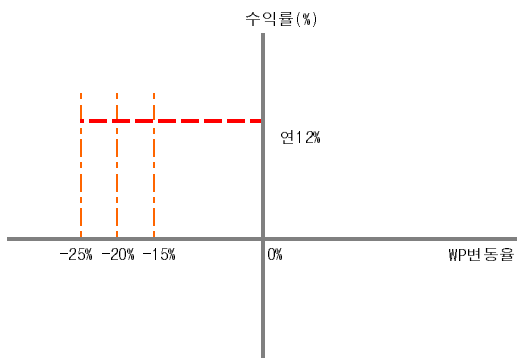
1. 계약금액

단위(백만원)

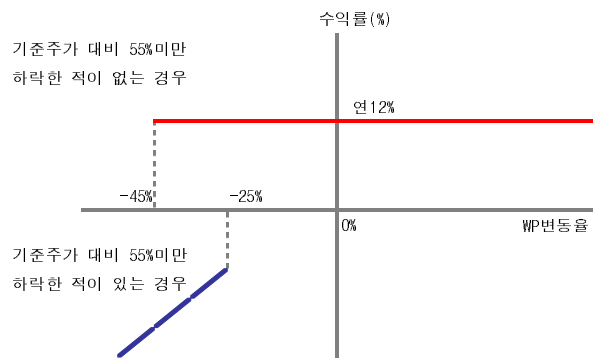
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[148-1]

메리츠한중지수연계증권제2호

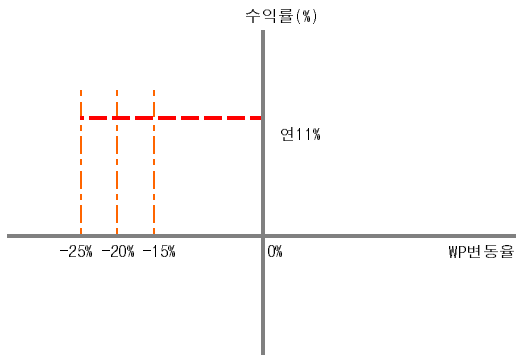
1. 계약금액

단위(백만원)

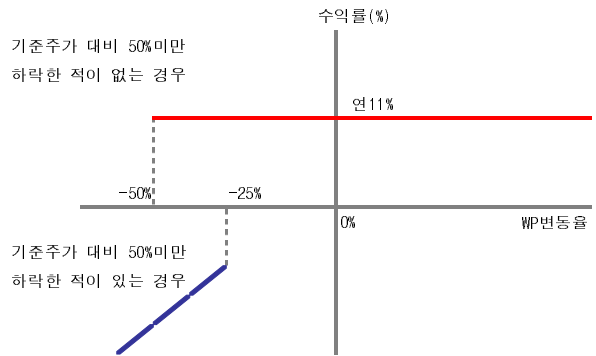
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503327WC9 신한투자(ELS)1275

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	49.49	41.18	32.87	24.56	16.25	7.94	(0.37)
	5.33%	43.87	35.56	27.25	18.94	10.63	2.32	(5.99)
	2.67%	35.68	27.37	19.06	10.75	2.44	(5.87)	(14.18)
	0.00%	24.93	16.62	8.31	0.00	(8.31)	(16.62)	(24.93)
	-2.67%	11.61	3.30	(5.01)	(13.32)	(21.63)	(29.94)	(38.25)
	-5.33%	(4.28)	(12.59)	(20.90)	(29.21)	(37.52)	(45.83)	(54.14)
	-8.00%	(22.74)	(31.05)	(39.36)	(47.67)	(55.98)	(64.29)	(72.60)

최대손실 시나리오

위험액	-72.60
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	69.04
-----	-------

[148-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

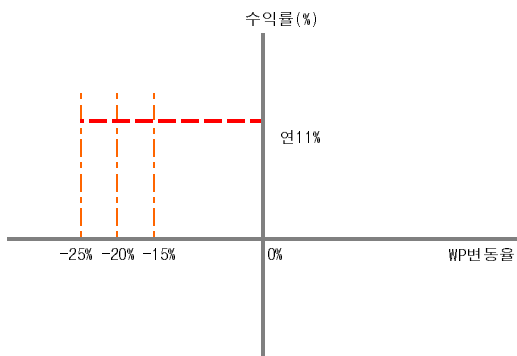
1. 계약금액

단위(백만원)

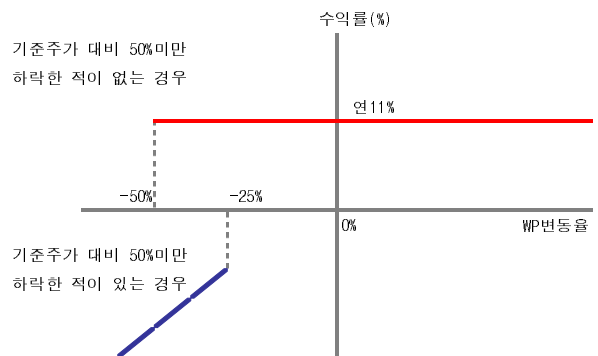
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

[148-3]

메리츠한중지수연계증권제2호

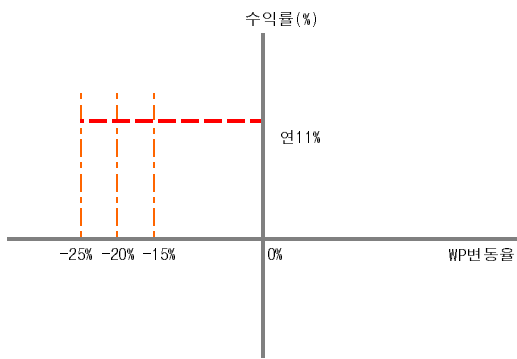
1. 계약금액

단위(백만원)

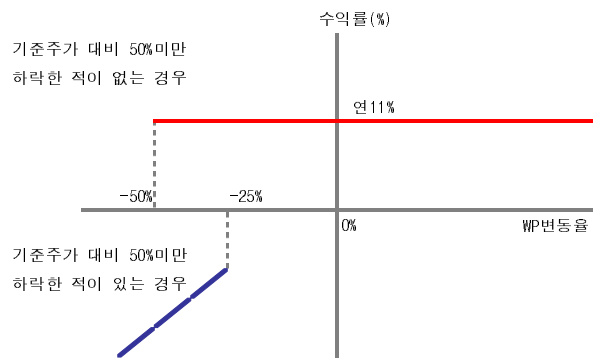
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154



[148-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

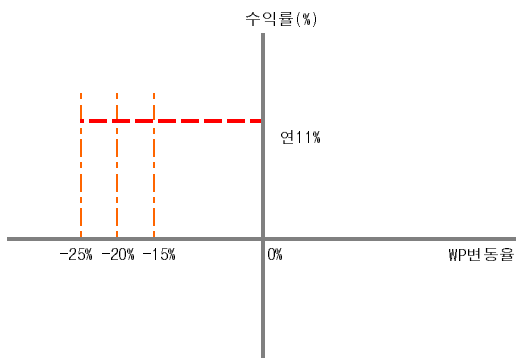
1. 계약금액

단위(백만원)

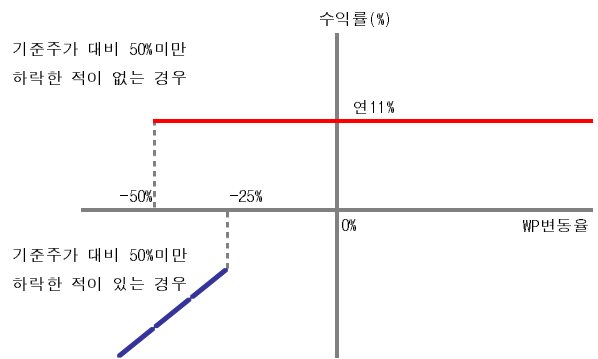
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[149-1]

메리츠한중지수연계증권제3호

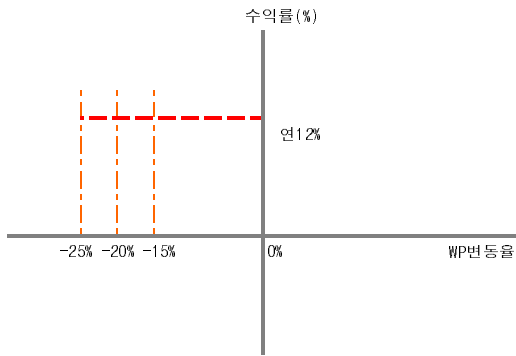
1. 계약금액

단위(백만원)

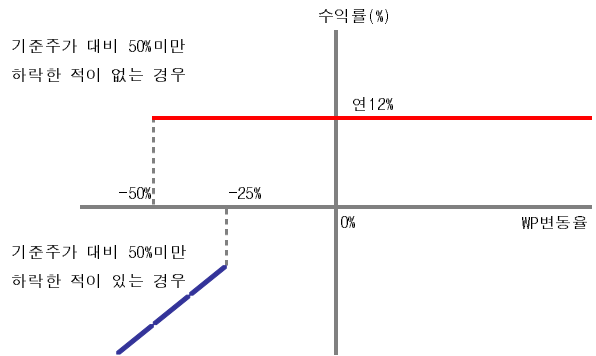
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513340WC0 대신증권(ELS)920

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	57.68	48.65	39.63	30.60	21.58	12.55	3.53
	5.33%	49.81	40.78	31.76	22.73	13.71	4.68	(4.35)
	2.67%	39.61	30.58	21.56	12.53	3.50	(5.52)	(14.55)
	0.00%	27.08	18.05	9.03	0.00	(9.03)	(18.05)	(27.08)
	-2.67%	12.22	3.19	(5.83)	(14.86)	(23.88)	(32.91)	(41.94)
	-5.33%	(4.97)	(14.00)	(23.02)	(32.05)	(41.07)	(50.10)	(59.12)
	-8.00%	(24.49)	(33.51)	(42.54)	(51.56)	(60.59)	(69.61)	(78.64)

최대손실 시나리오

위험액	-78.64
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	77.60
-----	-------

[149-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

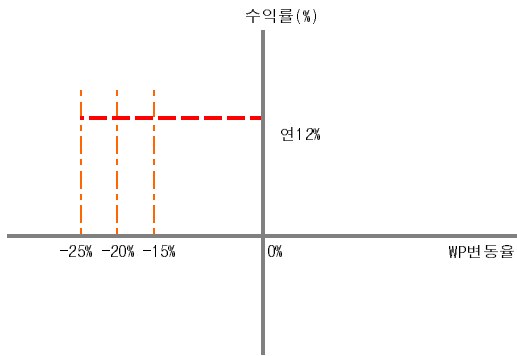
1. 계약금액

단위(백만원)

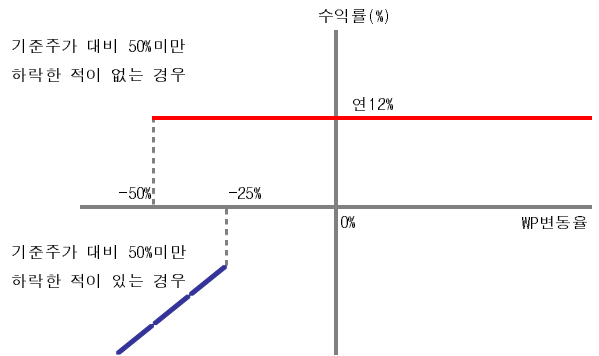
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[149-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

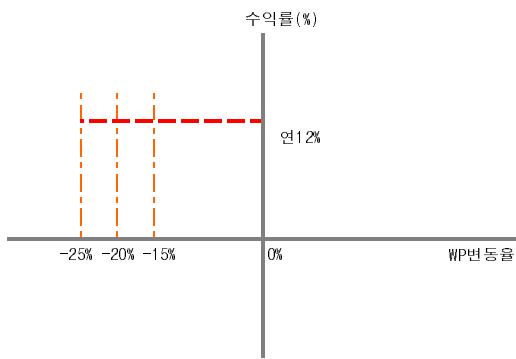
1. 계약금액

단위(백만원)

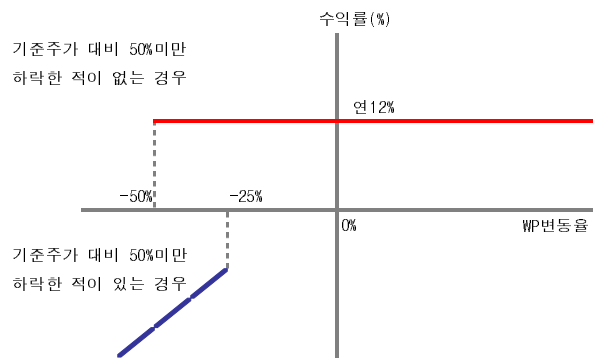
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[149-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

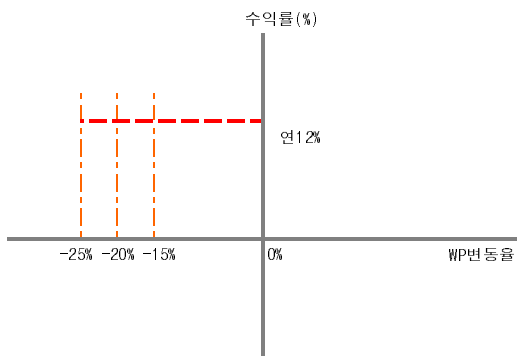
1. 계약금액

단위(백만원)

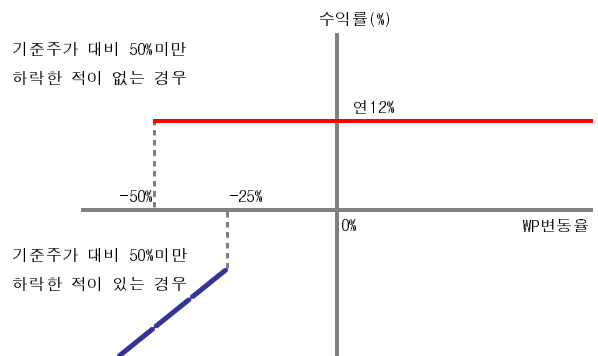
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[150-1]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL

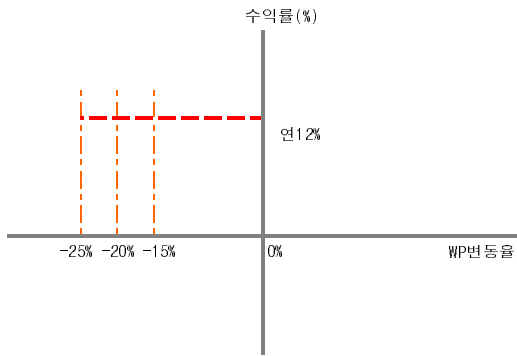
1. 계약금액

단위(백만원)

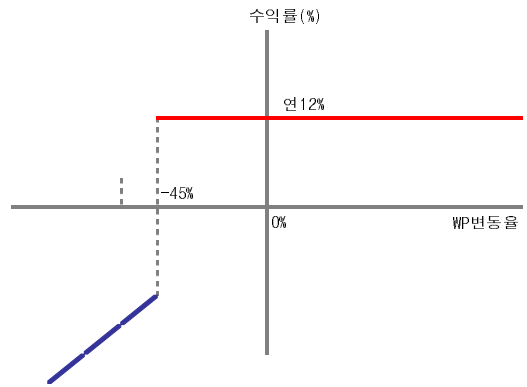
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513340WC0 대신증권(ELS)920

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	57.68	48.65	39.63	30.60	21.58	12.55	3.53
	5.33%	49.81	40.78	31.76	22.73	13.71	4.68	(4.35)
	2.67%	39.61	30.58	21.56	12.53	3.50	(5.52)	(14.55)
	0.00%	27.08	18.05	9.03	0.00	(9.03)	(18.05)	(27.08)
	-2.67%	12.22	3.19	(5.83)	(14.86)	(23.88)	(32.91)	(41.94)
	-5.33%	(4.97)	(14.00)	(23.02)	(32.05)	(41.07)	(50.10)	(59.12)
	-8.00%	(24.49)	(33.51)	(42.54)	(51.56)	(60.59)	(69.61)	(78.64)

최대손실 시나리오

위험액	-78.64
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	77.60
-----	-------

[150-2]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL

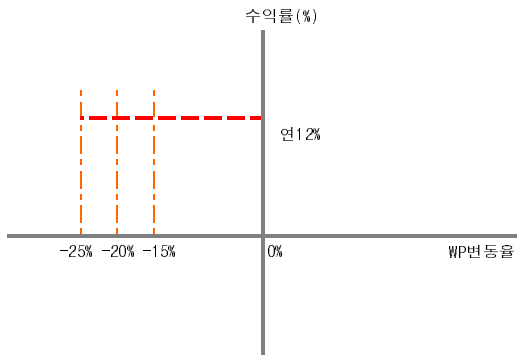
1. 계약금액

단위(백만원)

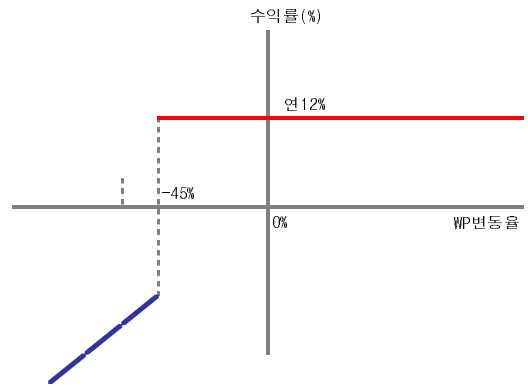
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[150-3]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL]

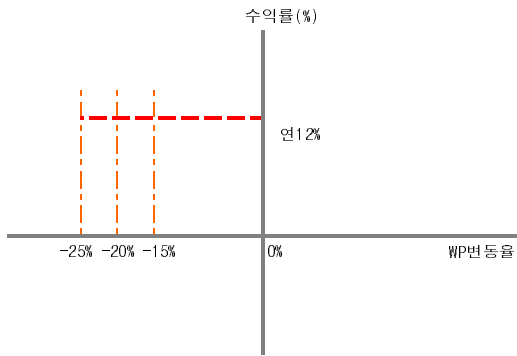
1. 계약금액

단위(백만원)

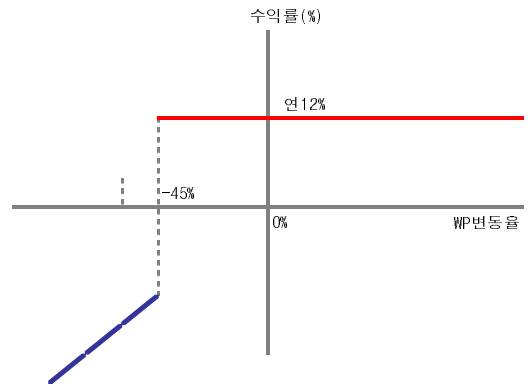
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512



[150-4]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL

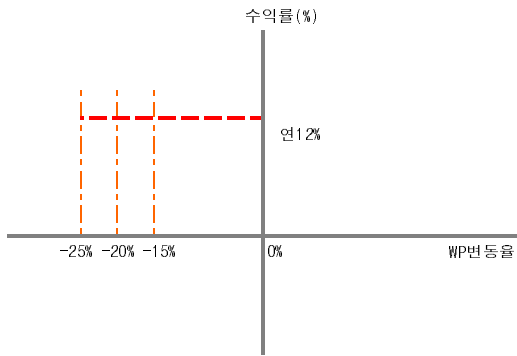
1. 계약금액

단위(백만원)

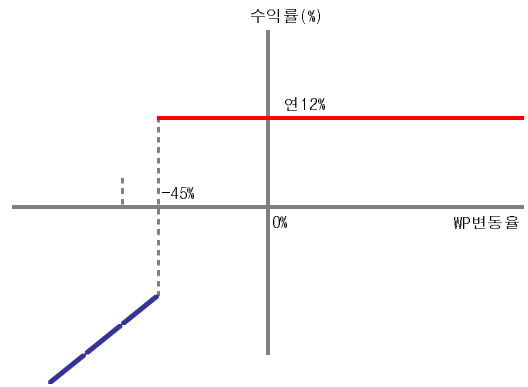
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414