

## 파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1] 메리츠2Star사모증권GCWF-1호

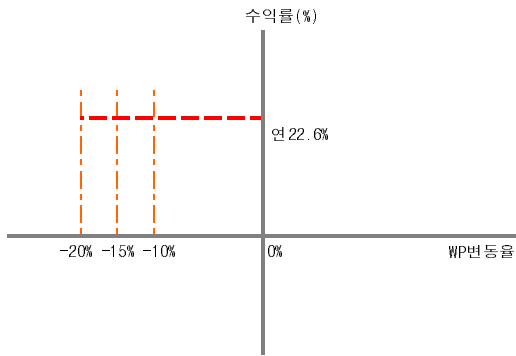
1. 계약금액

단위(백만원)

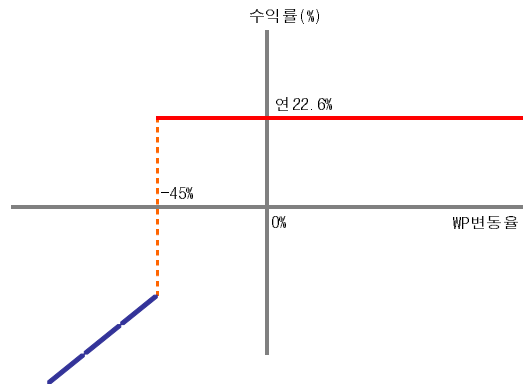
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	198	0	198	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6622316W80 교보증권(ELS)386

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	(0.54)	(1.19)	(1.83)	(2.48)	(3.13)	(3.77)	(4.42)
	5.33%	1.44	0.79	0.14	(0.50)	(1.15)	(1.80)	(2.45)
	2.67%	2.26	1.62	0.97	0.32	(0.32)	(0.97)	(1.62)
	0.00%	1.94	1.29	0.65	0.00	(0.65)	(1.29)	(1.94)
	-2.67%	0.47	(0.18)	(0.82)	(1.47)	(2.12)	(2.76)	(3.41)
	-5.33%	(2.15)	(2.80)	(3.44)	(4.09)	(4.74)	(5.38)	(6.03)
	-8.00%	(5.92)	(6.57)	(7.21)	(7.86)	(8.51)	(9.15)	(9.80)

최대손실 시나리오

위험액	-9.80
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	11.54
-----	-------

[2] 메리츠2Star사모증권HCSV-1

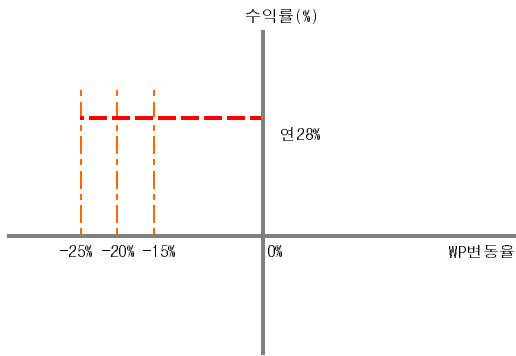
1. 계약금액

단위(백만원)

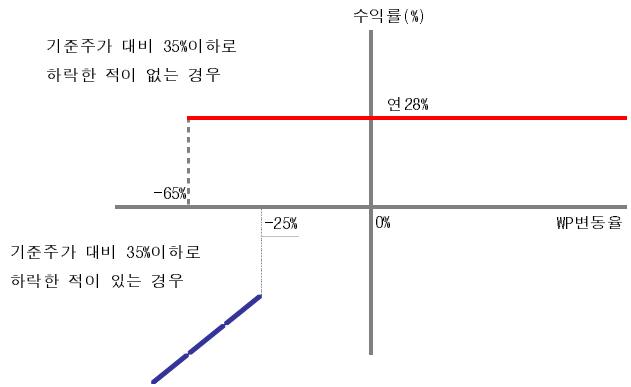
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	821	0	821	장익

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 시나 리오	8.00%	3.86	(3.01)	(9.88)	(16.75)	(23.62)	(30.49)	(37.36)
	5.33%	10.90	4.03	(2.84)	(9.71)	(16.58)	(23.45)	(30.32)
	2.67%	16.49	9.61	2.74	(4.13)	(11.00)	(17.87)	(24.74)
	0.00%	20.61	13.74	6.87	0.00	(6.87)	(13.74)	(20.61)
	-2.67%	23.28	16.41	9.54	2.67	(4.20)	(11.07)	(17.94)
	-5.33%	24.49	17.62	10.75	3.88	(2.99)	(9.86)	(16.73)
	-8.00%	24.25	17.38	10.51	3.64	(3.23)	(10.10)	(16.98)

최대손실 시나리오

위험액	-16.98
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.89
-----	-------

[4] 메리츠2Star사모증권HMSE-1호

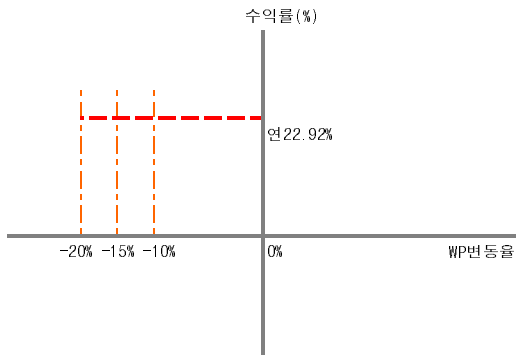
1. 계약금액

단위(백만원)

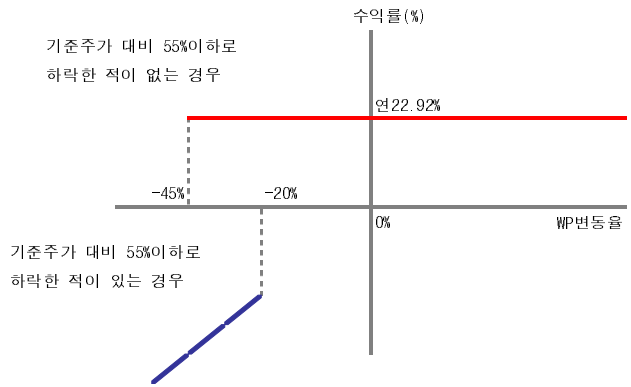
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	411	0	411	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 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%	5.17	4.18	3.19	2.20	1.21	0.22	(0.77)
	5.33%	5.15	4.16	3.17	2.17	1.18	0.19	(0.80)
	2.67%	4.41	3.42	2.43	1.44	0.45	(0.54)	(1.53)
	0.00%	2.97	1.98	0.99	0.00	(0.99)	(1.98)	(2.97)
	-2.67%	0.82	(0.17)	(1.16)	(2.15)	(3.14)	(4.13)	(5.12)
	-5.33%	(2.03)	(3.03)	(4.02)	(5.01)	(6.00)	(6.99)	(7.98)
	-8.00%	(5.60)	(6.59)	(7.58)	(8.57)	(9.56)	(10.55)	(11.54)

최대 손실 시나리오

위험액	-11.54
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.83
-----	-------

[5] 메리츠2Star사모증권HMSE-2호

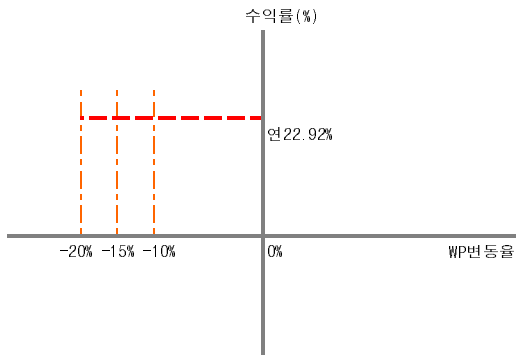
1. 계약금액

단위(백만원)

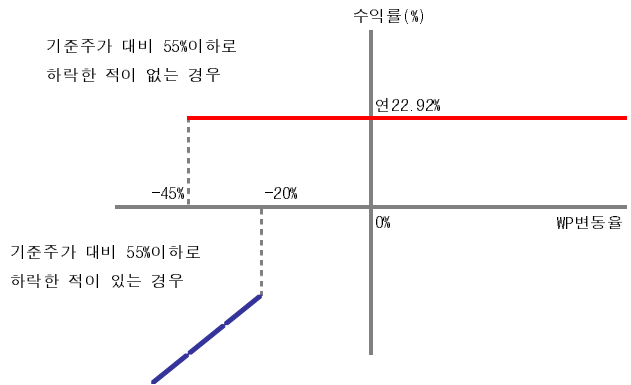
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	683	0	683	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 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%	8.59	6.94	5.30	3.65	2.01	0.37	(1.28)
	5.33%	8.54	6.90	5.26	3.61	1.97	0.32	(1.32)
	2.67%	7.33	5.68	4.04	2.39	0.75	(0.90)	(2.54)
	0.00%	4.93	3.29	1.64	0.00	(1.64)	(3.29)	(4.93)
	-2.67%	1.36	(0.28)	(1.92)	(3.57)	(5.21)	(6.86)	(8.50)
	-5.33%	(3.38)	(5.02)	(6.67)	(8.31)	(9.96)	(11.60)	(13.24)
	-8.00%	(9.30)	(10.94)	(12.59)	(14.23)	(15.87)	(17.52)	(19.16)

최대손실 시나리오

위험액	-19.16
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	26.28
-----	-------

[6] 메리츠2Star사모증권HSLC-1호

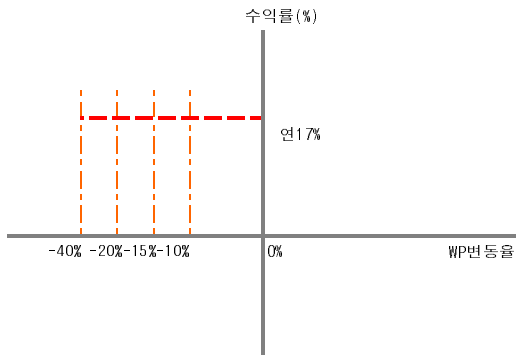
1. 계약금액

단위(백만원)

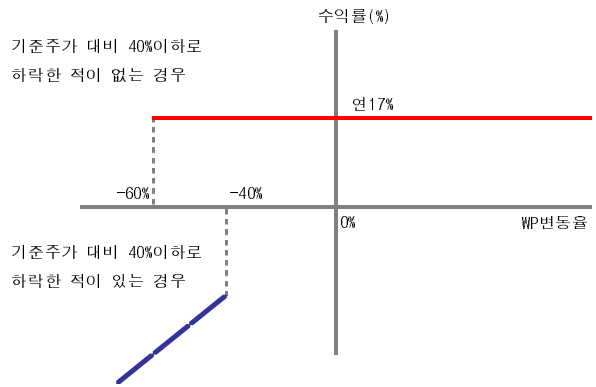
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	211	0	211	장익

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 시나리오	8.00%	12.31	9.82	7.33	4.84	2.35	(0.14)	(2.63)
	5.33%	10.89	8.40	5.91	3.42	0.93	(1.56)	(4.05)
	2.67%	9.28	6.79	4.30	1.81	(0.68)	(3.17)	(5.66)
	0.00%	7.47	4.98	2.49	0.00	(2.49)	(4.98)	(7.47)
	-2.67%	5.47	2.98	0.49	(2.00)	(4.49)	(6.98)	(9.47)
	-5.33%	3.26	0.77	(1.72)	(4.21)	(6.70)	(9.19)	(11.68)
	-8.00%	0.87	(1.62)	(4.11)	(6.60)	(9.09)	(11.58)	(14.07)

최대손실 시나리오

위험액	-14.07
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.55
-----	-------

[8] 메리츠2Star사모증권HVSE-1호

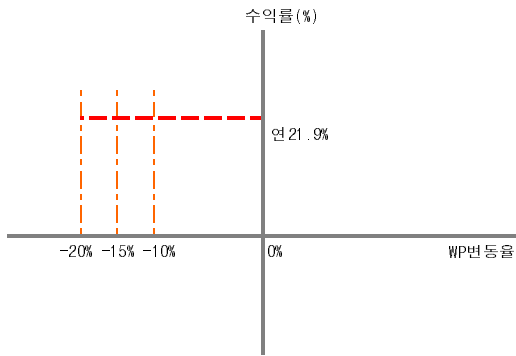
1. 계약금액

단위(백만원)

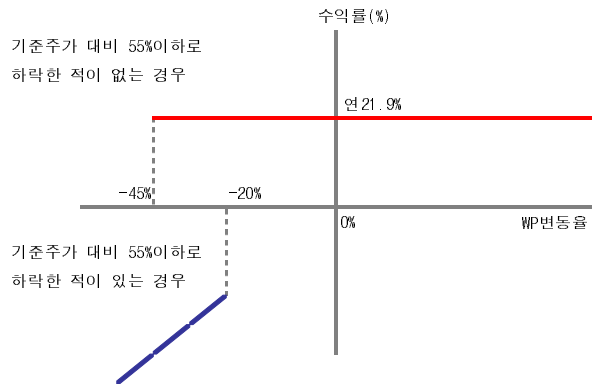
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	90	0	90	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6572337W74 한국투자증권(ELS)1271

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	(0.25)	(0.27)	(0.29)	(0.31)	(0.33)	(0.35)	(0.37)
	5.33%	(0.04)	(0.06)	(0.08)	(0.10)	(0.12)	(0.14)	(0.16)
	2.67%	0.07	0.05	0.03	0.01	(0.01)	(0.03)	(0.05)
	0.00%	0.06	0.04	0.02	0.00	(0.02)	(0.04)	(0.06)
	-2.67%	(0.06)	(0.08)	(0.10)	(0.12)	(0.14)	(0.16)	(0.18)
	-5.33%	(0.28)	(0.30)	(0.32)	(0.34)	(0.36)	(0.38)	(0.40)
	-8.00%	(0.61)	(0.63)	(0.65)	(0.67)	(0.69)	(0.71)	(0.74)

최대손실 시나리오

위험액	-0.74
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.81
-----	------

[9] 메리츠2Star사모증권HVWF-1호

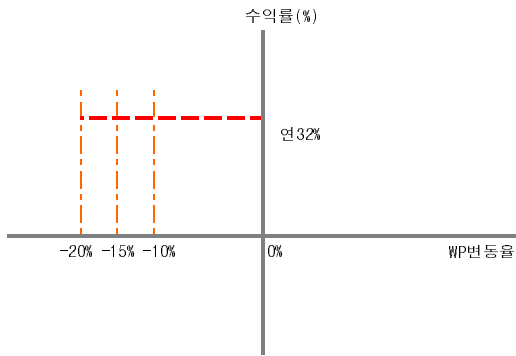
1. 계약금액

단위(백만원)

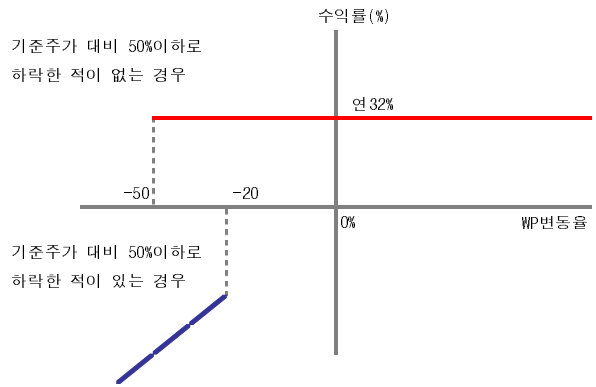
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	200	0	200	장익

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%	4.85	3.95	3.06	2.16	1.26	0.37	(0.53)
	5.33%	4.29	3.39	2.50	1.60	0.70	(0.19)	(1.09)
	2.67%	3.57	2.67	1.78	0.88	(0.02)	(0.91)	(1.81)
	0.00%	2.69	1.79	0.90	0.00	(0.90)	(1.79)	(2.69)
	-2.67%	1.65	0.75	(0.14)	(1.04)	(1.94)	(2.83)	(3.73)
	-5.33%	0.45	(0.44)	(1.34)	(2.24)	(3.13)	(4.03)	(4.93)
	-8.00%	(0.90)	(1.80)	(2.70)	(3.59)	(4.49)	(5.39)	(6.28)

최대손실 시나리오

위험액	-6.28
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	5.58
-----	------



[10] 메리츠2Star사모증권KBST-1호

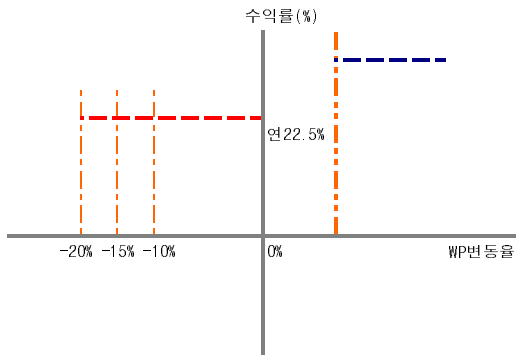
1. 계약금액

단위(백만원)

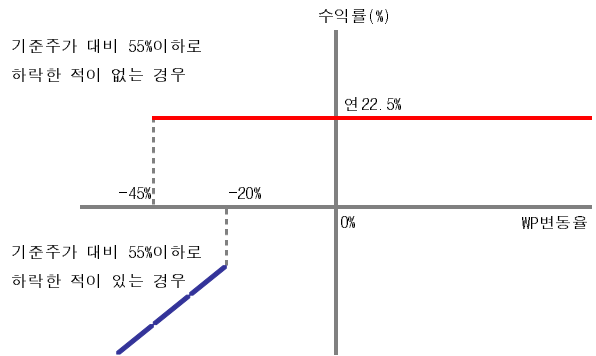
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	197	0	197	장익

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 시나리오	8.00%	13.89	11.74	9.58	7.42	5.27	3.11	0.95
	5.33%	11.63	9.48	7.32	5.16	3.01	0.85	(1.31)
	2.67%	9.16	7.00	4.85	2.69	0.53	(1.62)	(3.78)
	0.00%	6.47	4.31	2.16	0.00	(2.16)	(4.31)	(6.47)
	-2.67%	3.57	1.41	(0.75)	(2.90)	(5.06)	(7.22)	(9.38)
	-5.33%	0.45	(1.71)	(3.87)	(6.02)	(8.18)	(10.34)	(12.49)
	-8.00%	(2.89)	(5.04)	(7.20)	(9.36)	(11.51)	(13.67)	(15.83)

최대손실 시나리오

위험액	-15.83
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.40
-----	-------

[11] 메리츠2Star사모증권KEGL-1호

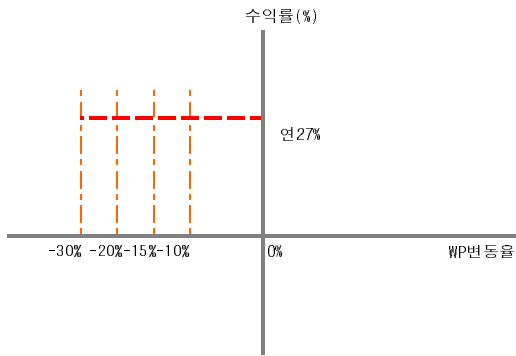
1. 계약금액

단위(백만원)

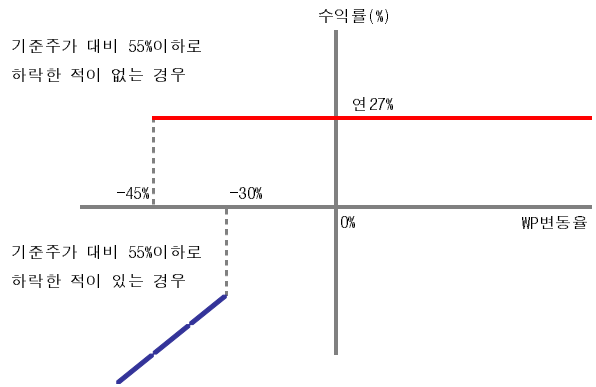
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	4,950	0	4,950	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(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 시나 리오	8.00%	759.08	577.33	395.58	213.84	32.09	(149.66)	(331.41)
	5.33%	690.89	509.14	327.40	145.65	(36.10)	(217.85)	(399.60)
	2.67%	619.61	437.87	256.12	74.37	(107.38)	(289.13)	(470.87)
	0.00%	545.24	363.50	181.75	0.00	(181.75)	(363.50)	(545.24)
	-2.67%	467.78	286.04	104.29	(77.46)	(259.21)	(440.96)	(622.71)
	-5.33%	387.23	205.48	23.73	(158.01)	(339.76)	(521.51)	(703.26)
	-8.00%	303.59	121.84	(59.91)	(241.66)	(423.41)	(605.15)	(786.90)

최대손실 시나리오

위험액	-786.90
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	793.42
-----	--------

[12] 메리츠2Star사모증권KEGL-2호

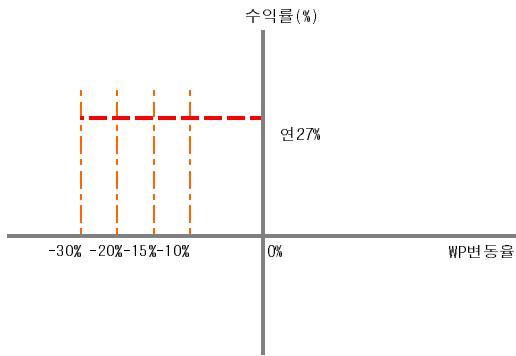
1. 계약금액

단위(백만원)

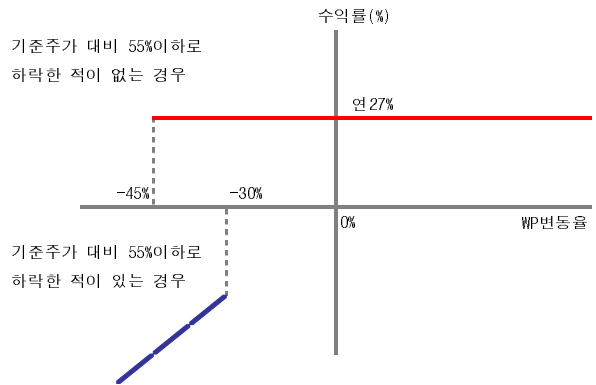
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,982	0	1,982	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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 시나리오	8.00%	303.80	231.50	159.20	86.90	14.60	(57.70)	(130.00)
	5.33%	275.89	203.59	131.29	58.99	(13.31)	(85.61)	(157.91)
	2.67%	246.92	174.62	102.32	30.02	(42.28)	(114.58)	(186.88)
	0.00%	216.90	144.60	72.30	0.00	(72.30)	(144.60)	(216.90)
	-2.67%	185.82	113.52	41.22	(31.08)	(103.38)	(175.68)	(247.98)
	-5.33%	153.69	81.39	9.09	(63.21)	(135.51)	(207.81)	(280.11)
	-8.00%	120.50	48.20	(24.10)	(96.40)	(168.70)	(241.00)	(313.30)

최대 손실 시나리오

위험액	-313.30
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	270.83
-----	--------

[13] 메리츠2Star사모증권KEGL-3호

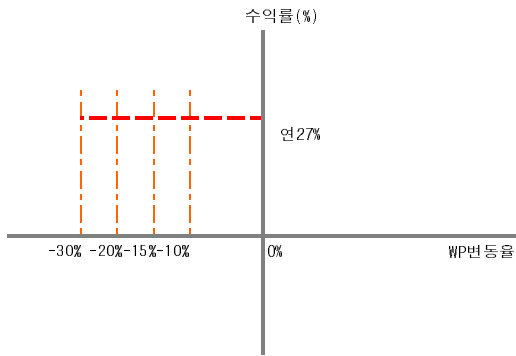
1. 계약금액

단위(백만원)

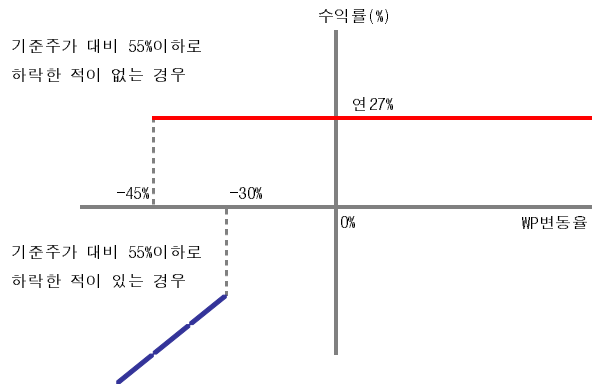
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,986	0	1,986	장익

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 시나 리오	8.00%	312.36	238.90	165.45	91.99	18.53	(54.93)	(128.39)
	5.33%	282.38	208.92	135.46	62.00	(11.46)	(84.92)	(158.38)
	2.67%	251.72	178.26	104.80	31.34	(42.12)	(115.58)	(189.04)
	0.00%	220.38	146.92	73.46	0.00	(73.46)	(146.92)	(220.38)
	-2.67%	188.36	114.90	41.44	(32.02)	(105.48)	(178.94)	(252.40)
	-5.33%	155.66	82.20	8.74	(64.72)	(138.18)	(211.63)	(285.09)
	-8.00%	122.29	48.83	(24.63)	(98.09)	(171.55)	(245.01)	(318.47)

최대손실 시나리오

위험액	-318.47
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	287.40
-----	--------

[14] 메리츠2Star사모증권KEGL-4호

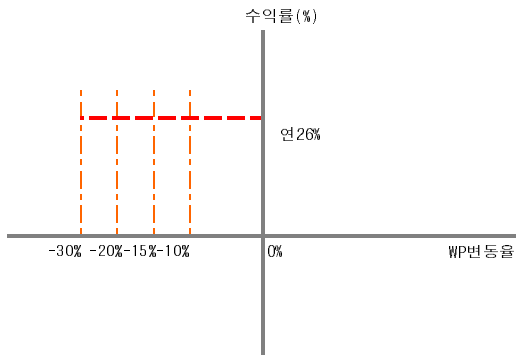
1. 계약금액

단위(백만원)

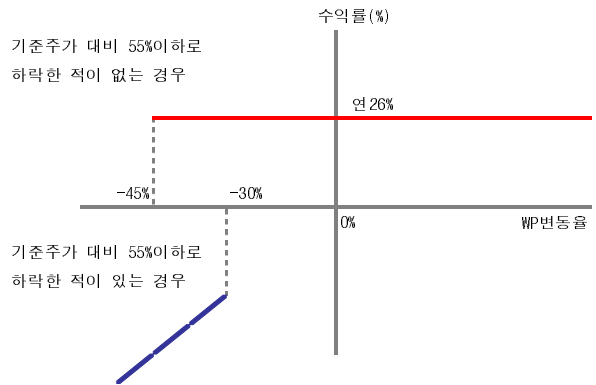
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,982	0	2,982	장익

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%	469.93	355.37	240.82	126.26	11.70	(102.85)	(217.41)
	5.33%	430.32	315.76	201.20	86.65	(27.91)	(142.47)	(257.03)
	2.67%	388.23	273.67	159.12	44.56	(70.00)	(184.56)	(299.11)
	0.00%	343.67	229.11	114.56	0.00	(114.56)	(229.11)	(343.67)
	-2.67%	296.64	182.08	67.53	(47.03)	(161.59)	(276.14)	(390.70)
	-5.33%	247.14	132.58	18.02	(96.53)	(211.09)	(325.65)	(440.20)
	-8.00%	195.16	80.61	(33.95)	(148.51)	(263.06)	(377.62)	(492.18)

최대손실 시나리오

위험액	-492.18
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	438.27
-----	--------

[17] 메리츠2Star사모증권KEKT-2호

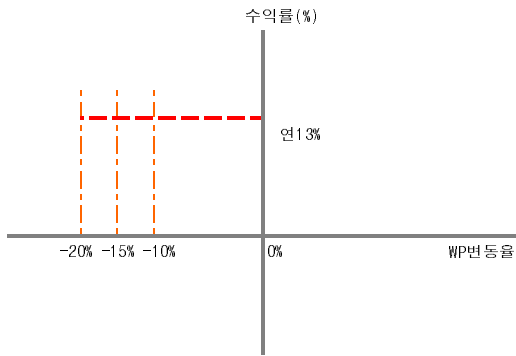
1. 계약금액

단위(백만원)

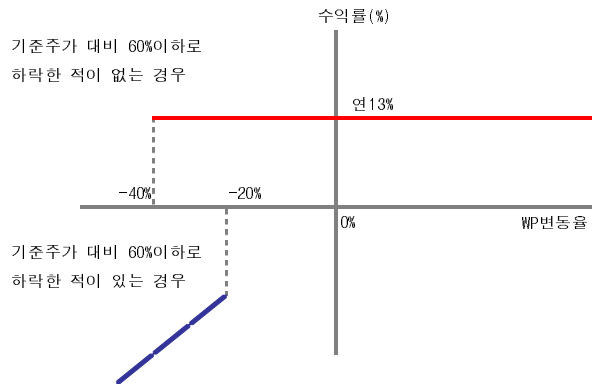
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	198	0	198	장익

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
-----	------

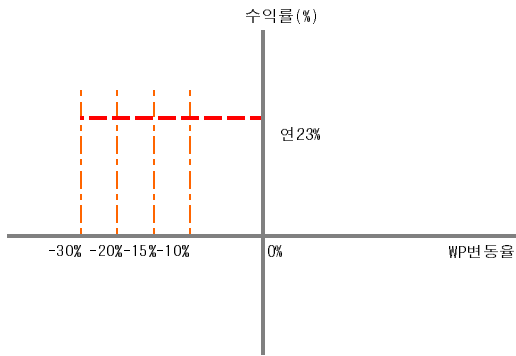
1. 계약금액

단위(백만원)

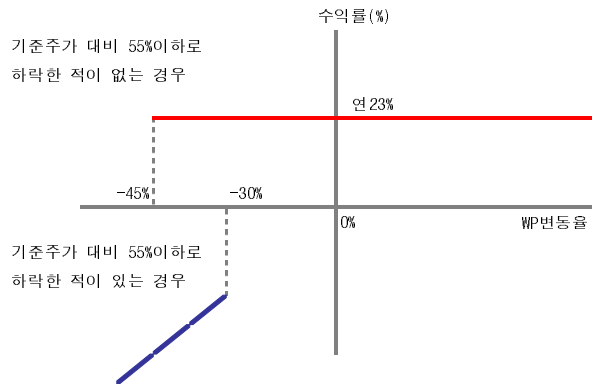
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,092	0	2,092	장익

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%	(8.72)	(16.97)	(25.22)	(33.47)	(41.72)	(49.97)	(58.22)
	5.33%	15.80	7.55	(0.70)	(8.95)	(17.20)	(25.46)	(33.71)
	2.67%	26.96	18.71	10.46	2.20	(6.05)	(14.30)	(22.55)
	0.00%	24.75	16.50	8.25	0.00	(8.25)	(16.50)	(24.75)
	-2.67%	9.19	0.94	(7.31)	(15.57)	(23.82)	(32.07)	(40.32)
	-5.33%	(19.74)	(27.99)	(36.24)	(44.49)	(52.74)	(60.99)	(69.25)
	-8.00%	(62.03)	(70.28)	(78.53)	(86.78)	(95.03)	(103.28)	(111.53)

최대손실 시나리오

위험액	-111.53
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	108.83
-----	--------

[21] 메리츠2Star사모증권KESB-5호

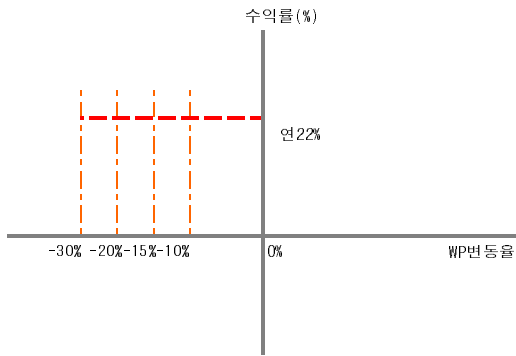
1. 계약금액

단위(백만원)

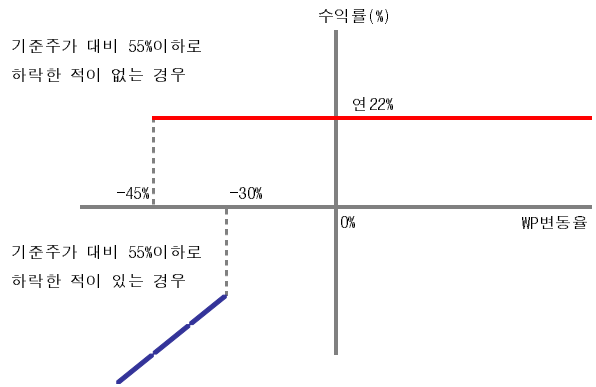
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,988	0	1,988	장익

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 시나 리오	8.00%	18.70	7.67	(3.36)	(14.39)	(25.42)	(36.45)	(47.48)
	5.33%	36.04	25.00	13.97	2.94	(8.09)	(19.12)	(30.15)
	2.67%	40.83	29.80	18.77	7.74	(3.29)	(14.32)	(25.35)
	0.00%	33.09	22.06	11.03	0.00	(11.03)	(22.06)	(33.09)
	-2.67%	12.82	1.79	(9.25)	(20.28)	(31.31)	(42.34)	(53.37)
	-5.33%	(20.00)	(31.03)	(42.06)	(53.09)	(64.12)	(75.15)	(86.18)
	-8.00%	(65.35)	(76.38)	(87.41)	(98.44)	(109.47)	(120.50)	(131.53)

최대손실 시나리오

위험액	-131.53
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	124.37
-----	--------



[22-1] 메리츠2Star사모증권KGSH-1호

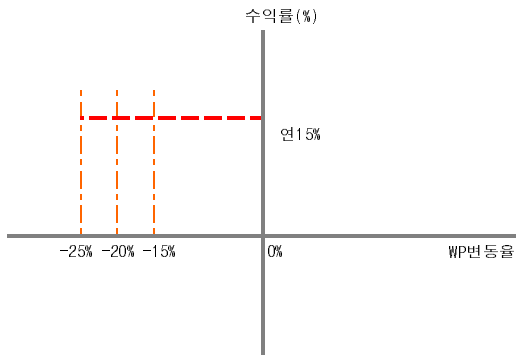
1. 계약금액

단위(백만원)

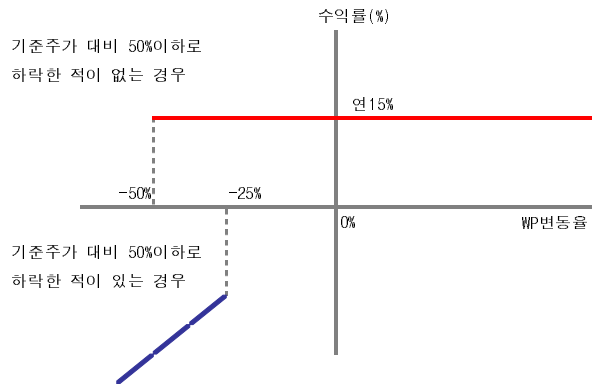
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552359WB4 우리투자증권(ELS)2765

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	1.00	0.85	0.70	0.55	0.40	0.25	0.11
	5.33%	0.84	0.69	0.54	0.39	0.24	0.09	(0.06)
	2.67%	0.65	0.50	0.36	0.21	0.06	(0.09)	(0.24)
	0.00%	0.45	0.30	0.15	0.00	(0.15)	(0.30)	(0.45)
	-2.67%	0.22	0.07	(0.08)	(0.23)	(0.38)	(0.53)	(0.68)
	-5.33%	(0.04)	(0.19)	(0.33)	(0.48)	(0.63)	(0.78)	(0.93)
	-8.00%	(0.31)	(0.46)	(0.61)	(0.76)	(0.91)	(1.06)	(1.21)

최대손실 시나리오

위험액	-1.21
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1.10
-----	------

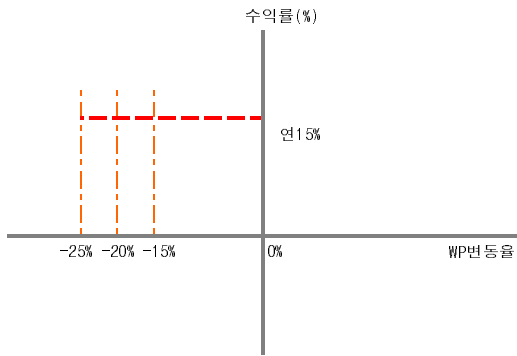
1. 계약금액

단위(백만원)

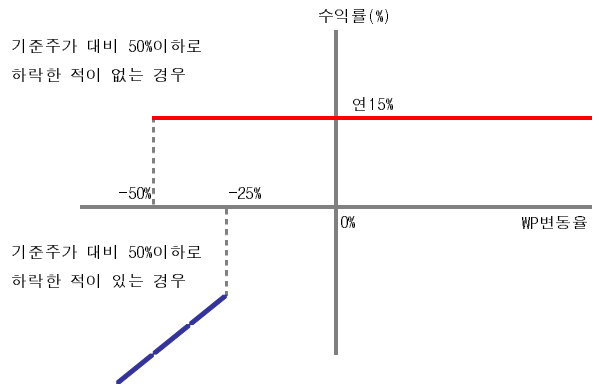
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

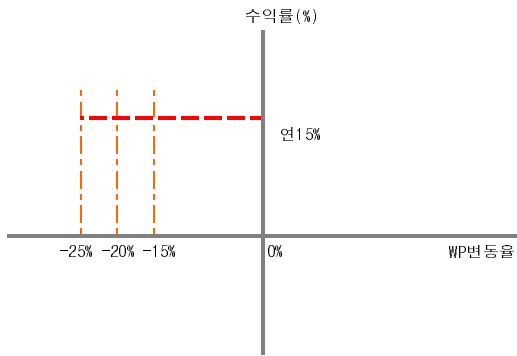
1. 계약금액

단위(백만원)

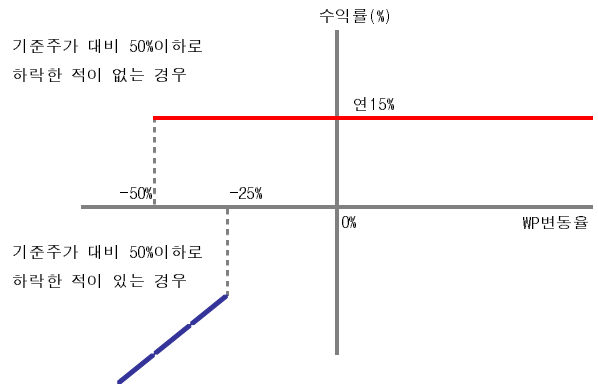
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

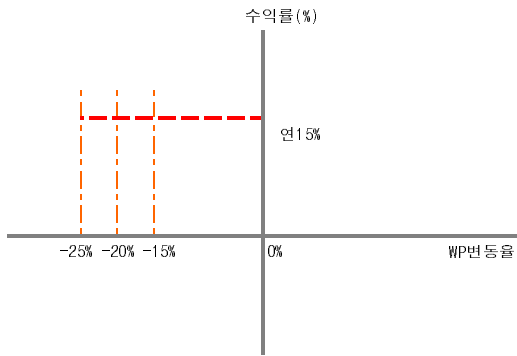
1. 계약금액

단위(백만원)

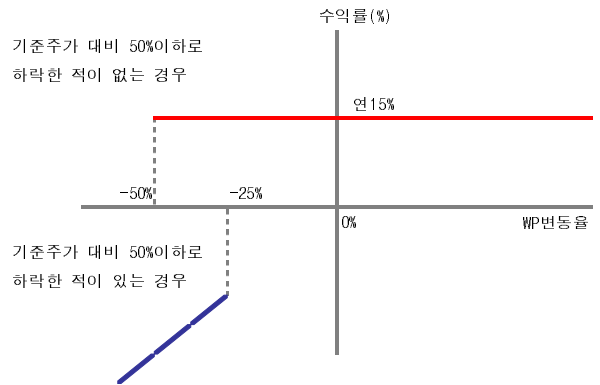
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5	0	5	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[24] 메리츠2Star사모증권KISE-2호

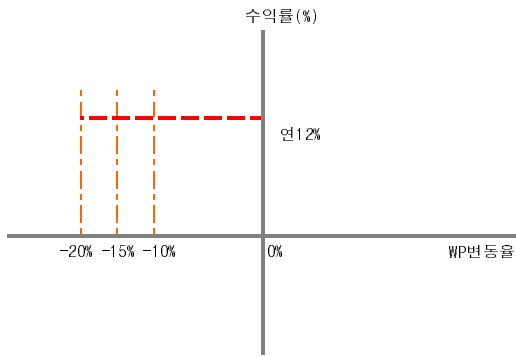
1. 계약금액

단위(백만원)

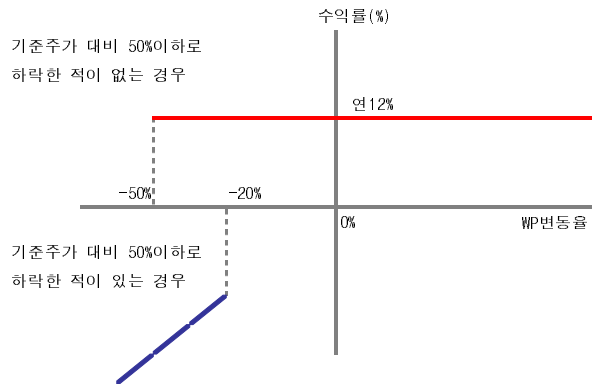
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,412	0	1,412	장익

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 시나리오	8.00%	3.67	3.52	3.37	3.22	3.07	2.92	2.77
	5.33%	1.39	1.24	1.09	0.94	0.79	0.64	0.49
	2.67%	0.32	0.17	0.02	(0.13)	(0.28)	(0.43)	(0.58)
	0.00%	0.45	0.30	0.15	0.00	(0.15)	(0.30)	(0.45)
	-2.67%	1.79	1.64	1.49	1.34	1.19	1.04	0.89
	-5.33%	4.33	4.18	4.03	3.88	3.73	3.58	3.43
	-8.00%	8.08	7.93	7.78	7.63	7.48	7.33	7.18

최대손실 시나리오

위험액	7.18
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.60
-----	------

[25] 메리츠2Star사모증권KISE-3호

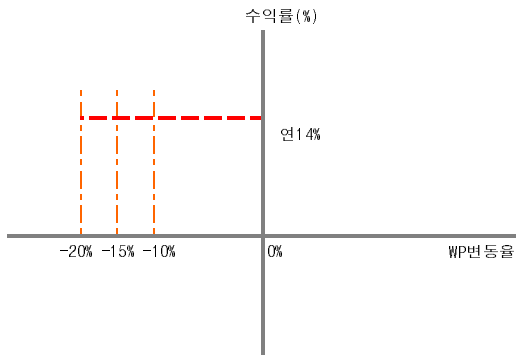
1. 계약금액

단위(백만원)

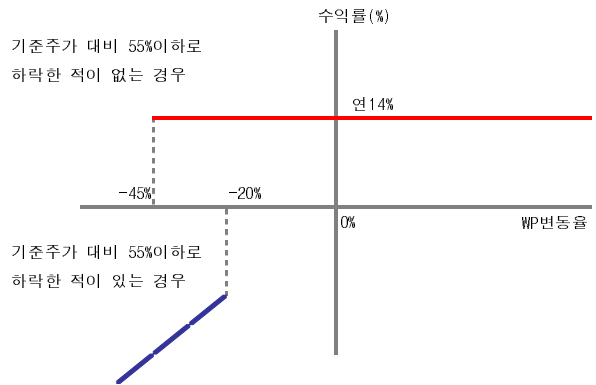
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	285	0	285	장익

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 시나 리오	8.00%	0.35	0.29	0.22	0.16	0.09	0.03	(0.04)
	5.33%	0.23	0.17	0.10	0.04	(0.03)	(0.09)	(0.16)
	2.67%	0.18	0.11	0.05	(0.02)	(0.08)	(0.15)	(0.21)
	0.00%	0.19	0.13	0.06	0.00	(0.06)	(0.13)	(0.19)
	-2.67%	0.28	0.22	0.15	0.09	0.02	(0.04)	(0.11)
	-5.33%	0.44	0.37	0.31	0.24	0.18	0.11	0.05
	-8.00%	0.67	0.60	0.54	0.47	0.41	0.34	0.28

최대손실 시나리오

위험액	0.28
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.43
-----	------

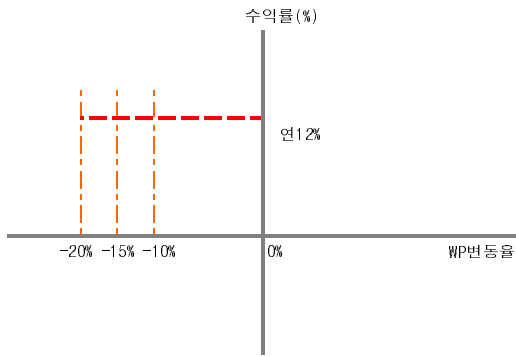
1. 계약금액

단위(백만원)

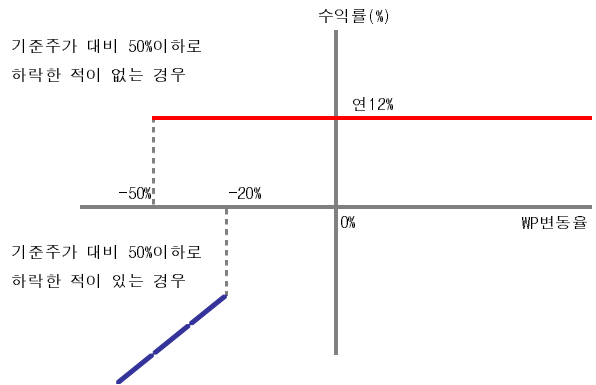
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	452	0	452	장익

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%	0.76	0.75	0.74	0.73	0.72	0.71	0.70
	5.33%	0.31	0.30	0.29	0.29	0.28	0.27	0.26
	2.67%	0.07	0.06	0.05	0.04	0.03	0.02	0.01
	0.00%	0.03	0.02	0.01	0.00	(0.01)	(0.02)	(0.03)
	-2.67%	0.19	0.18	0.17	0.16	0.15	0.14	0.13
	-5.33%	0.55	0.54	0.53	0.52	0.51	0.50	0.50
	-8.00%	1.12	1.11	1.10	1.09	1.08	1.07	1.06

최대손실 시나리오

위험액	1.06
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.93
-----	------

[27] 메리츠2Star사모증권KISE-5호

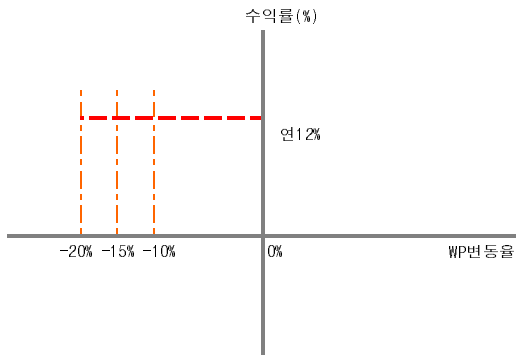
1. 계약금액

단위(백만원)

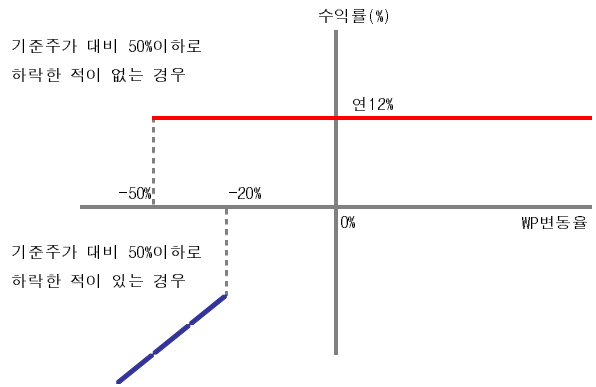
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	983	0	983	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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%	1.65	1.63	1.61	1.59	1.57	1.55	1.53
	5.33%	0.68	0.66	0.64	0.62	0.60	0.58	0.56
	2.67%	0.15	0.13	0.11	0.09	0.07	0.05	0.03
	0.00%	0.06	0.04	0.02	0.00	(0.02)	(0.04)	(0.06)
	-2.67%	0.41	0.39	0.37	0.35	0.33	0.31	0.29
	-5.33%	1.20	1.18	1.16	1.14	1.12	1.10	1.08
	-8.00%	2.43	2.41	2.38	2.36	2.34	2.32	2.30

최대 손실 시나리오

위험액	2.30
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.01
-----	------



[28] 메리츠2Star사모증권KIST-1호

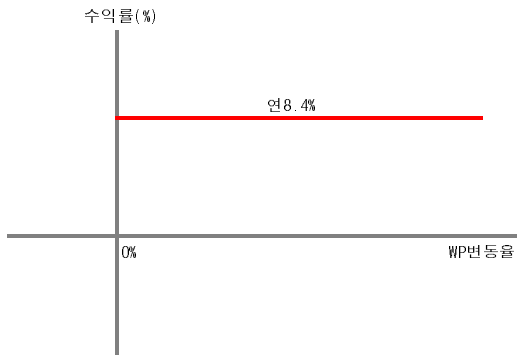
1. 계약금액

단위(백만원)

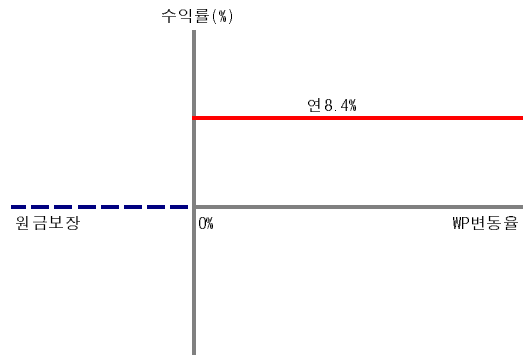
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	9,910	0	9,910	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(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 시나리오	8.00%	(29.79)	(32.46)	(35.13)	(37.79)	(40.46)	(43.13)	(45.79)
	5.33%	(19.26)	(21.93)	(24.59)	(27.26)	(29.93)	(32.60)	(35.26)
	2.67%	(6.66)	(9.33)	(12.00)	(14.66)	(17.33)	(20.00)	(22.67)
	0.00%	8.00	5.33	2.67	0.00	(2.67)	(5.33)	(8.00)
	-2.67%	24.73	22.06	19.40	16.73	14.06	11.40	8.73
	-5.33%	43.53	40.86	38.19	35.53	32.86	30.19	27.52
	-8.00%	64.39	61.72	59.06	56.39	53.72	51.05	48.39

최대손실 시나리오

위험액	48.39
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	247.11
-----	--------

[29] 메리츠2Star사모증권LCHF-1호

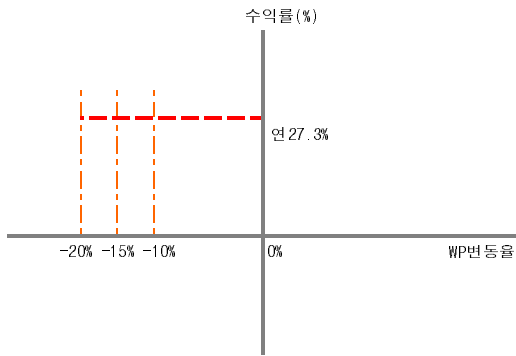
1. 계약금액

단위(백만원)

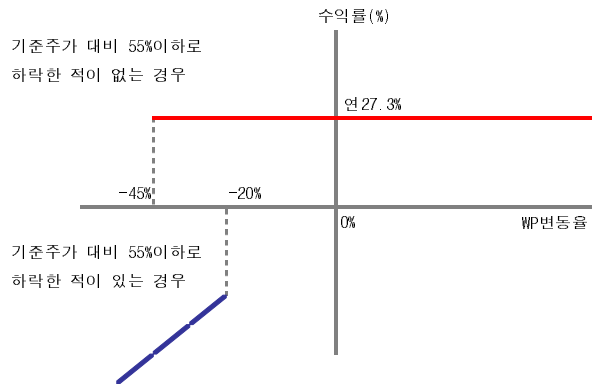
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	632	0	632	장익

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 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
-----	------

[30] 메리츠2Star사모증권LEHC-6호

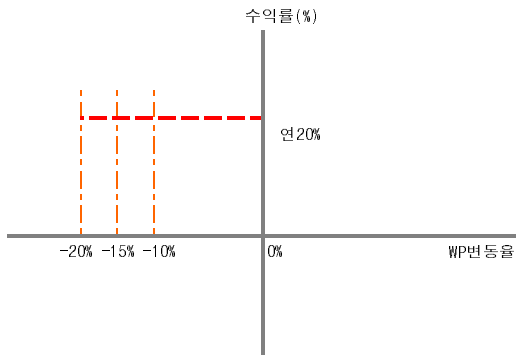
1. 계약금액

단위(백만원)

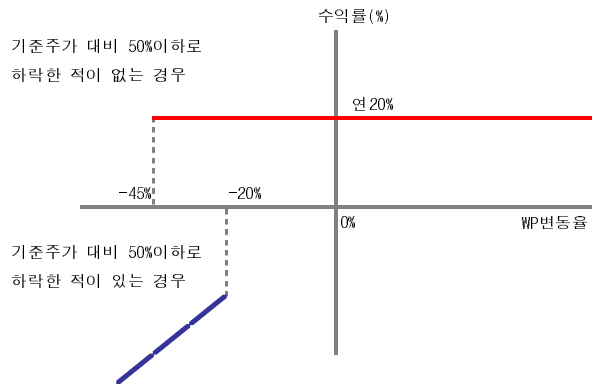
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	506	0	506	장익

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%	13.94	11.67	9.39	7.11	4.84	2.56	0.28
	5.33%	12.17	9.90	7.62	5.34	3.06	0.79	(1.49)
	2.67%	9.80	7.52	5.25	2.97	0.69	(1.58)	(3.86)
	0.00%	6.83	4.55	2.28	0.00	(2.28)	(4.55)	(6.83)
	-2.67%	3.26	0.99	(1.29)	(3.57)	(5.85)	(8.12)	(10.40)
	-5.33%	(0.90)	(3.18)	(5.46)	(7.74)	(10.01)	(12.29)	(14.57)
	-8.00%	(5.67)	(7.95)	(10.23)	(12.50)	(14.78)	(17.06)	(19.34)

최대손실 시나리오

위험액	-19.34
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	19.74
-----	-------

[31] 메리츠2Star사모증권LEKG-1호

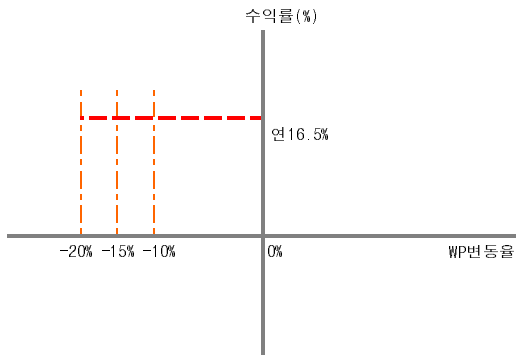
1. 계약금액

단위(백만원)

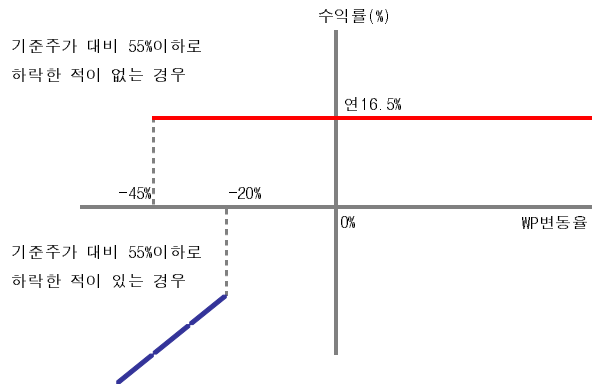
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	572	0	572	장익

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 시나 리오	8.00%	9.96	8.37	6.77	5.18	3.59	2.00	0.41
	5.33%	9.37	7.77	6.18	4.59	3.00	1.41	(0.19)
	2.67%	7.64	6.05	4.45	2.86	1.27	(0.32)	(1.91)
	0.00%	4.78	3.18	1.59	0.00	(1.59)	(3.18)	(4.78)
	-2.67%	0.78	(0.81)	(2.40)	(4.00)	(5.59)	(7.18)	(8.77)
	-5.33%	(4.35)	(5.94)	(7.53)	(9.13)	(10.72)	(12.31)	(13.90)
	-8.00%	(10.61)	(12.20)	(13.80)	(15.39)	(16.98)	(18.57)	(20.17)

최대손실 시나리오

위험액	-20.17
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.53
-----	-------

[32] 메리츠2Star사모증권LEKM-1호

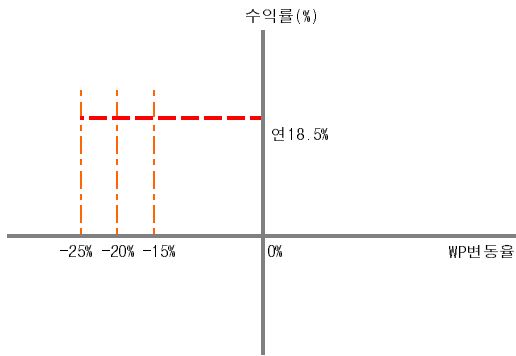
1. 계약금액

단위(백만원)

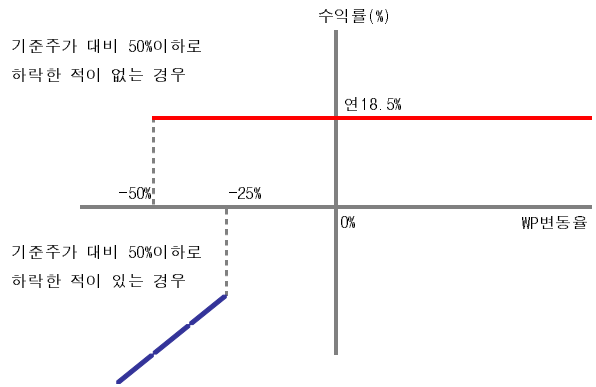
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	362	0	362	장익

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%	3.12	2.36	1.59	0.83	0.06	(0.70)	(1.47)
	5.33%	3.18	2.42	1.66	0.89	0.13	(0.64)	(1.40)
	2.67%	2.91	2.14	1.38	0.62	(0.15)	(0.91)	(1.68)
	0.00%	2.29	1.53	0.76	0.00	(0.76)	(1.53)	(2.29)
	-2.67%	1.34	0.57	(0.19)	(0.95)	(1.72)	(2.48)	(3.25)
	-5.33%	0.05	(0.72)	(1.48)	(2.25)	(3.01)	(3.78)	(4.54)
	-8.00%	(1.59)	(2.35)	(3.12)	(3.88)	(4.64)	(5.41)	(6.17)

최대손실 시나리오

위험액	-6.17
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.63
-----	------

[33] 메리츠2Star사모증권LESE-1호

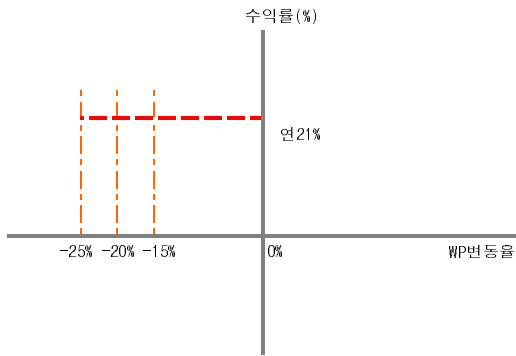
1. 계약금액

단위(백만원)

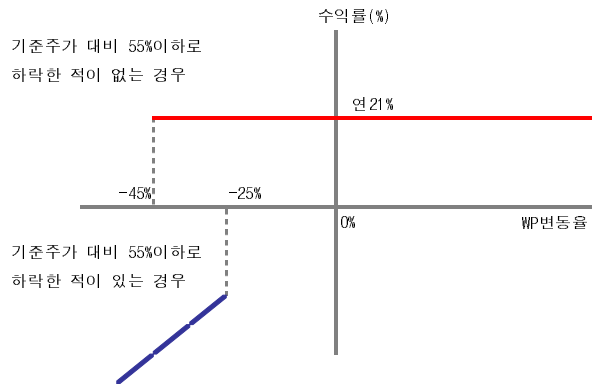
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	748	0	748	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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%	(4.92)	(4.98)	(5.05)	(5.11)	(5.18)	(5.25)	(5.31)
	5.33%	(1.95)	(2.02)	(2.08)	(2.15)	(2.22)	(2.28)	(2.35)
	2.67%	(0.25)	(0.31)	(0.38)	(0.45)	(0.51)	(0.58)	(0.64)
	0.00%	0.20	0.13	0.07	0.00	(0.07)	(0.13)	(0.20)
	-2.67%	(0.62)	(0.68)	(0.75)	(0.81)	(0.88)	(0.95)	(1.01)
	-5.33%	(2.69)	(2.76)	(2.82)	(2.89)	(2.95)	(3.02)	(3.09)
	-8.00%	(6.03)	(6.09)	(6.16)	(6.22)	(6.29)	(6.35)	(6.42)

최대 손실 시나리오

위험액	-6.42
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.52
-----	------

[34] 메리츠2Star사모증권LESH-3호

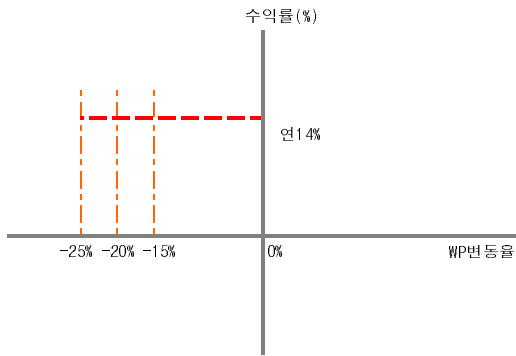
1. 계약금액

단위(백만원)

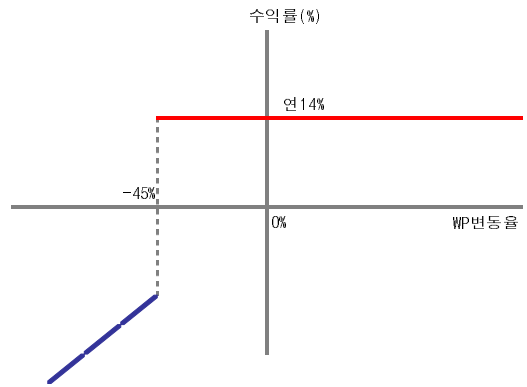
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,104	0	1,104	장익

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%	20.80	16.85	12.91	8.96	5.02	1.07	(2.87)
	5.33%	19.61	15.66	11.72	7.77	3.83	(0.12)	(4.06)
	2.67%	16.62	12.68	8.73	4.78	0.84	(3.11)	(7.05)
	0.00%	11.84	7.89	3.95	0.00	(3.95)	(7.89)	(11.84)
	-2.67%	5.25	1.31	(2.64)	(6.58)	(10.53)	(14.47)	(18.42)
	-5.33%	(3.13)	(7.07)	(11.02)	(14.96)	(18.91)	(22.85)	(26.80)
	-8.00%	(13.31)	(17.25)	(21.20)	(25.14)	(29.09)	(33.03)	(36.98)

최대손실 시나리오

위험액	-36.98
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	37.28
-----	-------

[35] 메리츠2Star사모증권LESH-4호

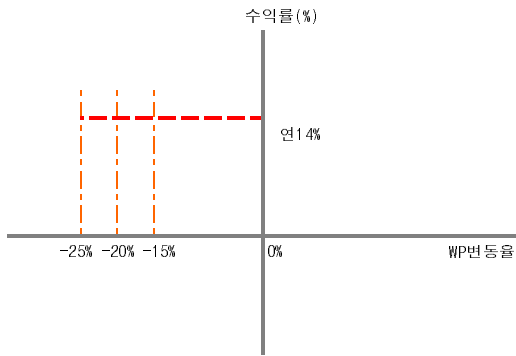
1. 계약금액

단위(백만원)

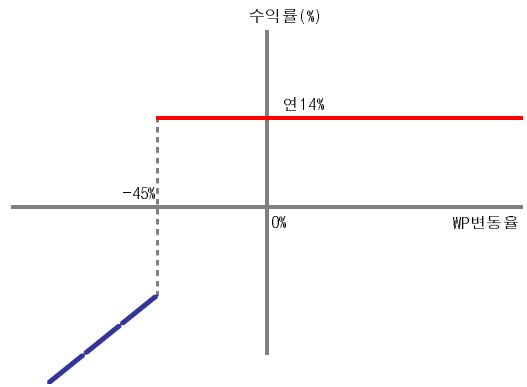
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	487	0	487	장익

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%	9.18	7.44	5.70	3.96	2.21	0.47	(1.27)
	5.33%	8.65	6.91	5.17	3.43	1.69	(0.05)	(1.79)
	2.67%	7.34	5.59	3.85	2.11	0.37	(1.37)	(3.11)
	0.00%	5.22	3.48	1.74	0.00	(1.74)	(3.48)	(5.22)
	-2.67%	2.32	0.58	(1.16)	(2.91)	(4.65)	(6.39)	(8.13)
	-5.33%	(1.38)	(3.12)	(4.86)	(6.60)	(8.35)	(10.09)	(11.83)
	-8.00%	(5.87)	(7.61)	(9.36)	(11.10)	(12.84)	(14.58)	(16.32)

최대손실 시나리오

위험액	-16.32
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.45
-----	-------



[37] 메리츠2Star사모증권SEDM-1호

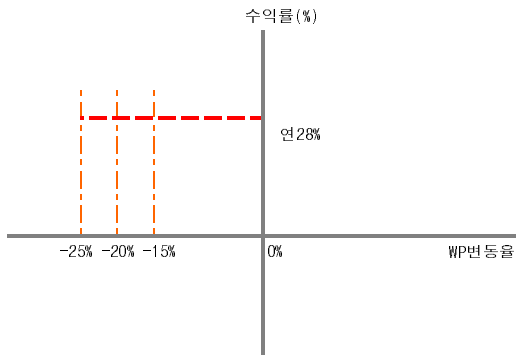
1. 계약금액

단위(백만원)

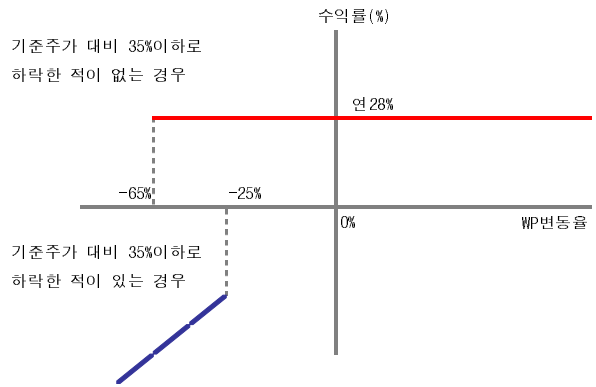
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	445	0	445	장익

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%	22.80	16.85	10.90	4.95	(1.00)	(6.96)	(12.91)
	5.33%	21.83	15.87	9.92	3.97	(1.98)	(7.93)	(13.89)
	2.67%	20.18	14.22	8.27	2.32	(3.63)	(9.58)	(15.54)
	0.00%	17.86	11.90	5.95	0.00	(5.95)	(11.90)	(17.86)
	-2.67%	14.86	8.91	2.96	(2.99)	(8.94)	(14.89)	(20.85)
	-5.33%	11.20	5.25	(0.70)	(6.65)	(12.60)	(18.56)	(24.51)
	-8.00%	6.87	0.92	(5.03)	(10.99)	(16.94)	(22.89)	(28.84)

최대손실 시나리오

위험액	-28.84
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	21.46
-----	-------

[38] 메리츠2Star사모증권SELE-2호

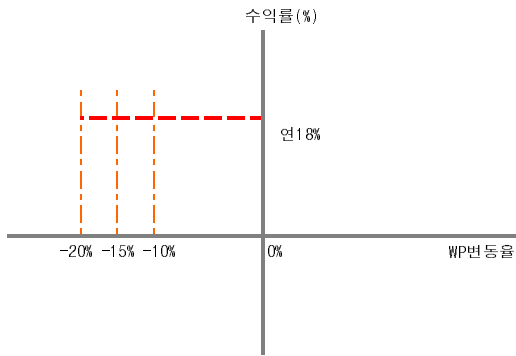
1. 계약금액

단위(백만원)

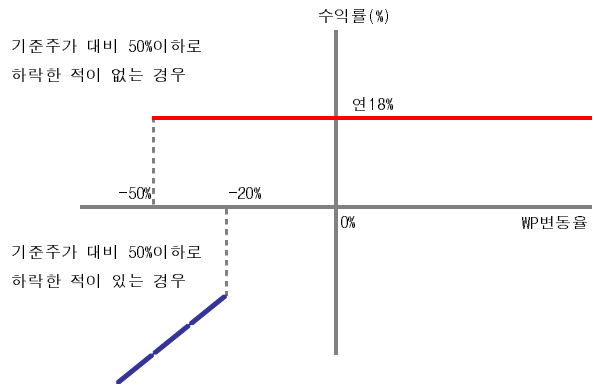
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	644	0	644	장익

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%	14.69	11.95	9.20	6.46	3.72	0.98	(1.76)
	5.33%	13.50	10.76	8.01	5.27	2.53	(0.21)	(2.96)
	2.67%	11.34	8.60	5.86	3.12	0.38	(2.37)	(5.11)
	0.00%	8.23	5.48	2.74	0.00	(2.74)	(5.48)	(8.23)
	-2.67%	4.15	1.40	(1.34)	(4.08)	(6.82)	(9.57)	(12.31)
	-5.33%	(0.90)	(3.64)	(6.38)	(9.13)	(11.87)	(14.61)	(17.35)
	-8.00%	(6.91)	(9.65)	(12.39)	(15.13)	(17.88)	(20.62)	(23.36)

최대손실 시나리오

위험액	-23.36
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.88
-----	-------

[39] 메리츠2Star사모증권SELE-3호

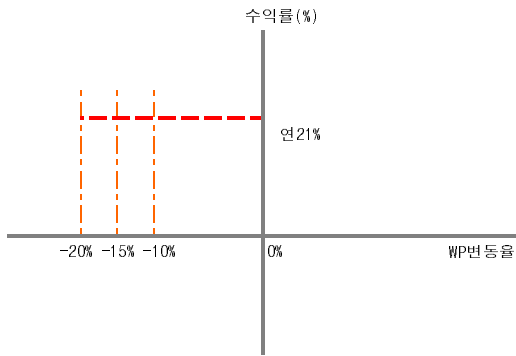
1. 계약금액

단위(백만원)

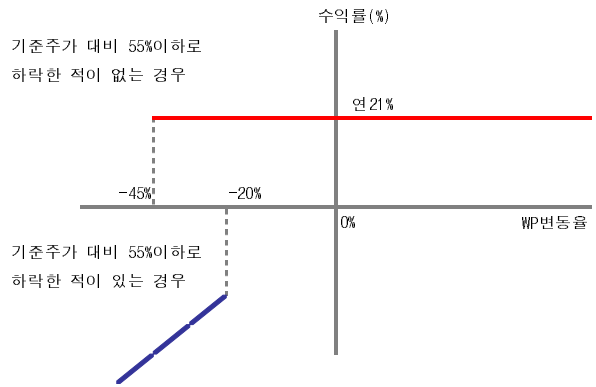
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,890	0	1,890	장익

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%	18.49	14.47	10.46	6.45	2.44	(1.57)	(5.58)
	5.33%	18.47	14.46	10.45	6.44	2.43	(1.58)	(5.59)
	2.67%	16.32	12.31	8.30	4.29	0.28	(3.73)	(7.74)
	0.00%	12.03	8.02	4.01	0.00	(4.01)	(8.02)	(12.03)
	-2.67%	5.61	1.60	(2.41)	(6.43)	(10.44)	(14.45)	(18.46)
	-5.33%	(2.96)	(6.97)	(10.98)	(14.99)	(19.00)	(23.01)	(27.02)
	-8.00%	(13.65)	(17.67)	(21.68)	(25.69)	(29.70)	(33.71)	(37.72)

최대손실 시나리오

위험액	-37.72
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	38.29
-----	-------

[ 40 ]                      메리츠2Star사모증권SELE-4호

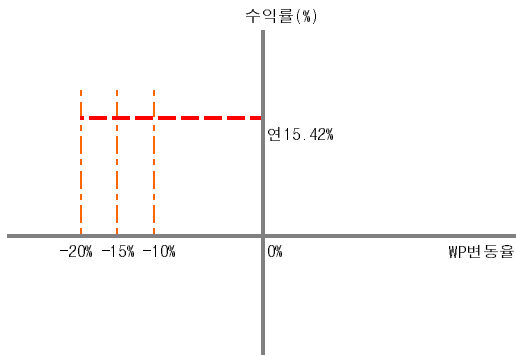
1. 계약금액

단위(백만원)

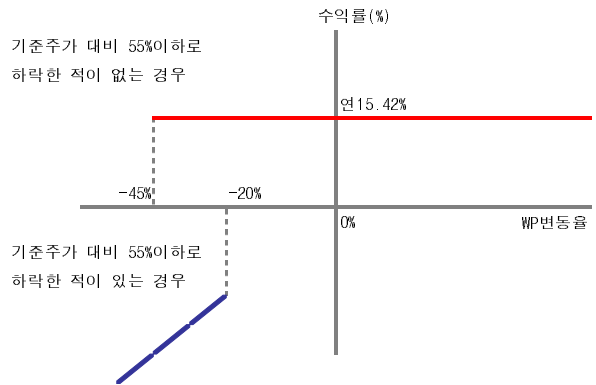
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	937	0	937	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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 시나리오	8.00%	(1.16)	(1.30)	(1.45)	(1.59)	(1.74)	(1.88)	(2.03)
	5.33%	(0.01)	(0.15)	(0.29)	(0.44)	(0.58)	(0.73)	(0.87)
	2.67%	0.53	0.38	0.24	0.09	(0.05)	(0.20)	(0.34)
	0.00%	0.43	0.29	0.14	0.00	(0.14)	(0.29)	(0.43)
	-2.67%	(0.28)	(0.42)	(0.57)	(0.71)	(0.86)	(1.00)	(1.15)
	-5.33%	(1.61)	(1.76)	(1.90)	(2.05)	(2.19)	(2.34)	(2.48)
	-8.00%	(3.57)	(3.71)	(3.86)	(4.00)	(4.15)	(4.29)	(4.44)

최대 손실 시나리오

위험액	-4.44
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	4.36
-----	------

[41] 메리츠2Star사모증권SELE-5호

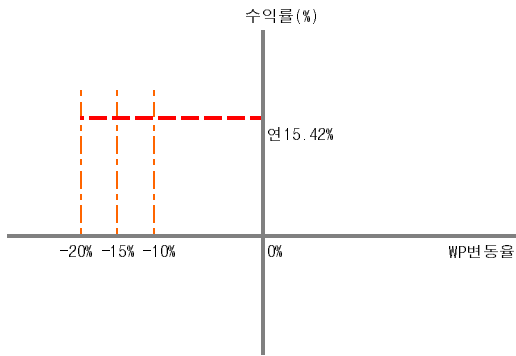
1. 계약금액

단위(백만원)

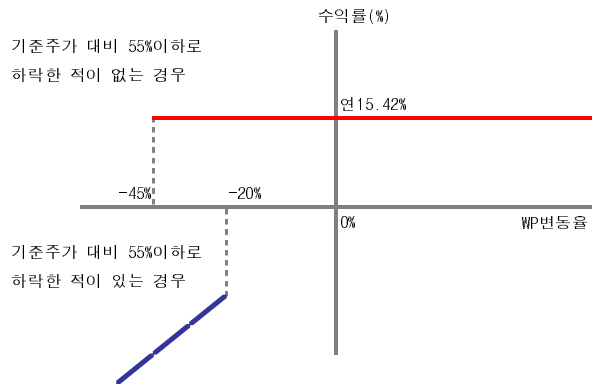
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	158	0	158	장익

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%	(0.20)	(0.22)	(0.24)	(0.27)	(0.29)	(0.32)	(0.34)
	5.33%	(0.00)	(0.03)	(0.05)	(0.07)	(0.10)	(0.12)	(0.15)
	2.67%	0.09	0.06	0.04	0.02	(0.01)	(0.03)	(0.06)
	0.00%	0.07	0.05	0.02	0.00	(0.02)	(0.05)	(0.07)
	-2.67%	(0.05)	(0.07)	(0.10)	(0.12)	(0.14)	(0.17)	(0.19)
	-5.33%	(0.27)	(0.30)	(0.32)	(0.35)	(0.37)	(0.40)	(0.42)
	-8.00%	(0.60)	(0.63)	(0.65)	(0.68)	(0.70)	(0.73)	(0.75)

최대손실 시나리오

위험액	-0.75
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.74
-----	------

[ 42 ]                      메리츠2Star사모증권SEPO-3호

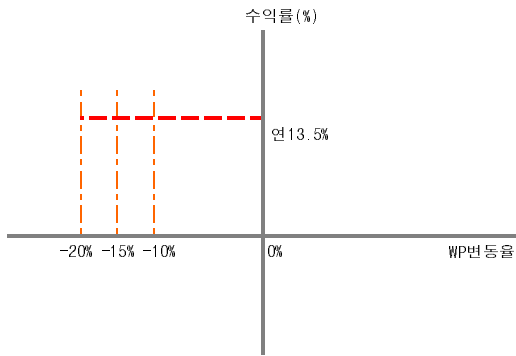
1. 계약금액

단위(백만원)

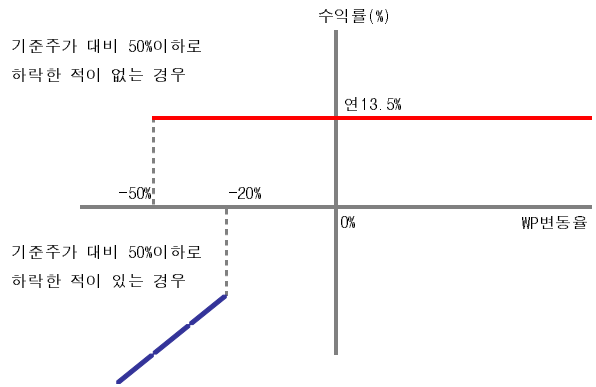
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,030	0	2,030	장익

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 시나 리오	8.00%	(1.32)	(1.32)	(1.33)	(1.33)	(1.34)	(1.34)	(1.34)
	5.33%	(0.52)	(0.52)	(0.52)	(0.53)	(0.53)	(0.54)	(0.54)
	2.67%	(0.07)	(0.08)	(0.08)	(0.08)	(0.09)	(0.09)	(0.10)
	0.00%	0.01	0.01	0.00	0.00	(0.00)	(0.01)	(0.01)
	-2.67%	(0.26)	(0.27)	(0.27)	(0.28)	(0.28)	(0.28)	(0.29)
	-5.33%	(0.90)	(0.90)	(0.91)	(0.91)	(0.92)	(0.92)	(0.92)
	-8.00%	(1.90)	(1.90)	(1.90)	(1.91)	(1.91)	(1.91)	(1.92)

최대손실 시나리오

위험액	-1.92
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.15
-----	------

[43] 메리츠2Star사모증권SEPO-4호

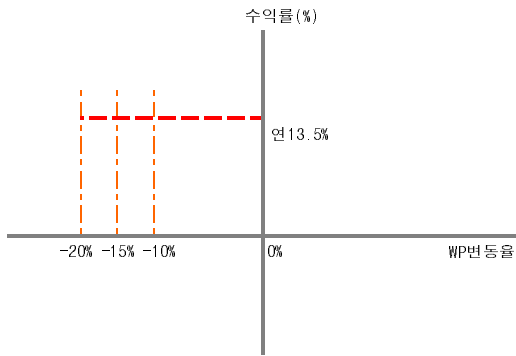
1. 계약금액

단위(백만원)

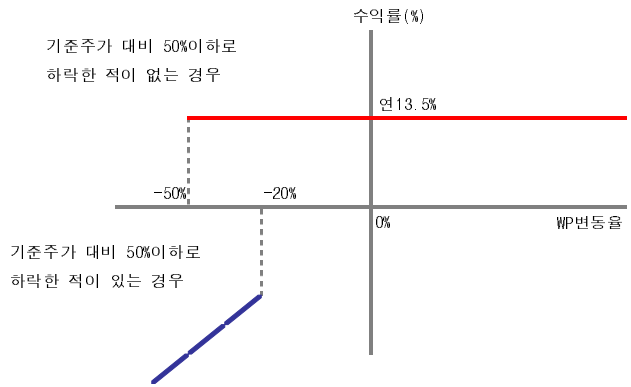
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	49	0	49	장익

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%	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)	(0.03)
	5.33%	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)
	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%	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)
	-5.33%	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)
	-8.00%	(0.05)	(0.05)	(0.05)	(0.05)	(0.05)	(0.05)	(0.05)

최대손실 시나리오

위험액	-0.05
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.05
-----	------

[44] 메리츠2Star사모증권SEPO-5호

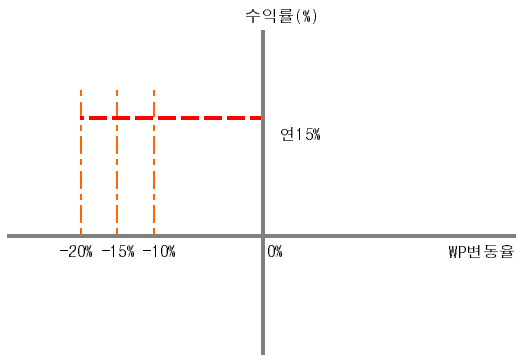
1. 계약금액

단위(백만원)

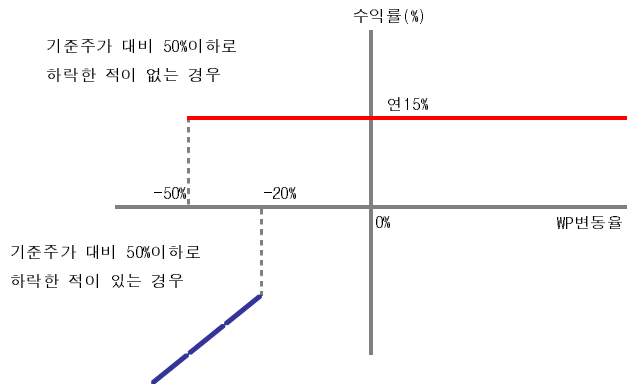
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,044	0	1,044	장익

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%	6.58	4.82	3.06	1.31	(0.45)	(2.21)	(3.97)
	5.33%	7.05	5.29	3.53	1.77	0.01	(1.74)	(3.50)
	2.67%	6.61	4.85	3.10	1.34	(0.42)	(2.18)	(3.94)
	0.00%	5.28	3.52	1.76	0.00	(1.76)	(3.52)	(5.28)
	-2.67%	3.03	1.28	(0.48)	(2.24)	(4.00)	(5.76)	(7.52)
	-5.33%	(0.11)	(1.87)	(3.63)	(5.38)	(7.14)	(8.90)	(10.66)
	-8.00%	(4.15)	(5.91)	(7.67)	(9.43)	(11.19)	(12.95)	(14.71)

최대손실 시나리오

위험액	-14.71
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.73
-----	-------



[45-1] 메리츠2Star사모증권SESH-5호

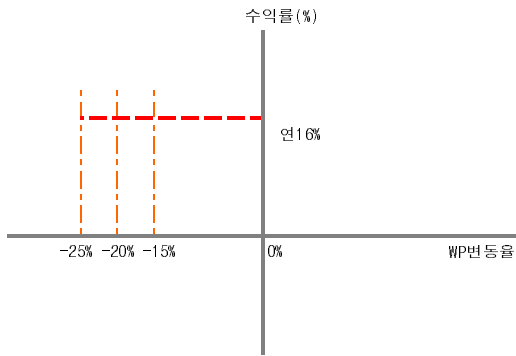
1. 계약금액

단위(백만원)

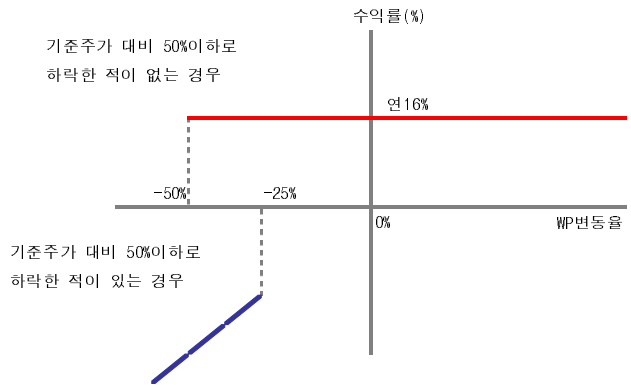
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	225	0	225	장익

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%	(4.80)	(4.80)	(4.80)	(4.80)	(4.80)	(4.80)	(4.79)
	5.33%	(2.13)	(2.13)	(2.13)	(2.13)	(2.13)	(2.13)	(2.12)
	2.67%	(0.53)	(0.53)	(0.53)	(0.53)	(0.53)	(0.53)	(0.53)
	0.00%	(0.00)	(0.00)	(0.00)	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	(0.55)	(0.54)	(0.54)	(0.54)	(0.54)	(0.54)	(0.54)
	-5.33%	(2.16)	(2.16)	(2.16)	(2.16)	(2.16)	(2.16)	(2.16)
	-8.00%	(4.85)	(4.85)	(4.85)	(4.85)	(4.84)	(4.84)	(4.84)

최대손실 시나리오

위험액	-4.84
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

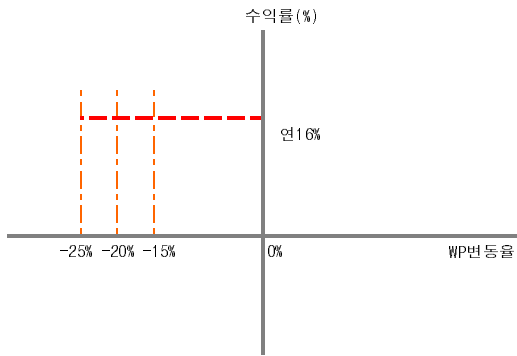
1. 계약금액

단위(백만원)

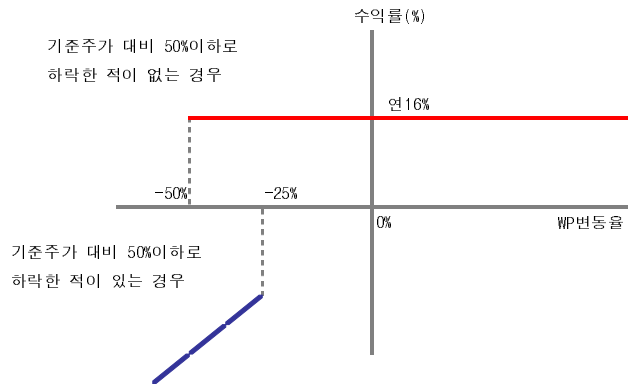
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	225	0	225	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552333W96 우리투자증권(ELS)2619

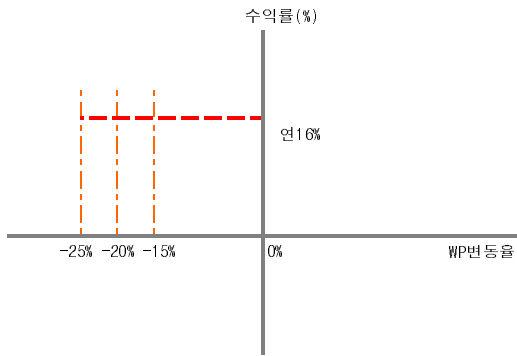
1. 계약금액

단위(백만원)

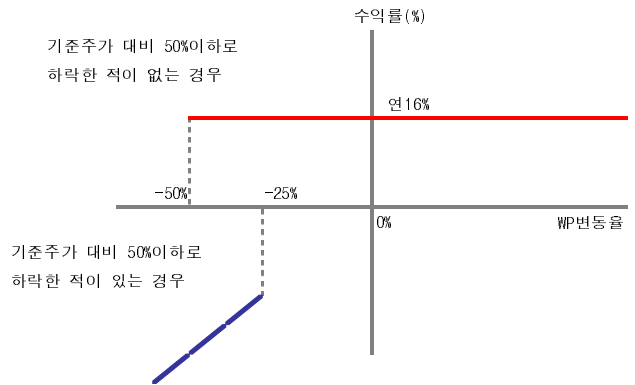
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	224	0	224	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572319W92 한국투자증권(ELS)1327

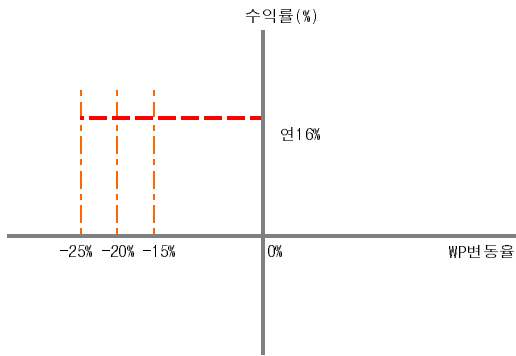
1. 계약금액

단위(백만원)

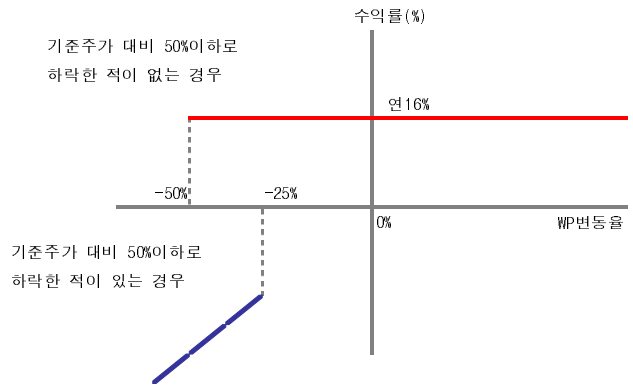
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	225	0	225	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702324W98 H&D증권(ELS)223

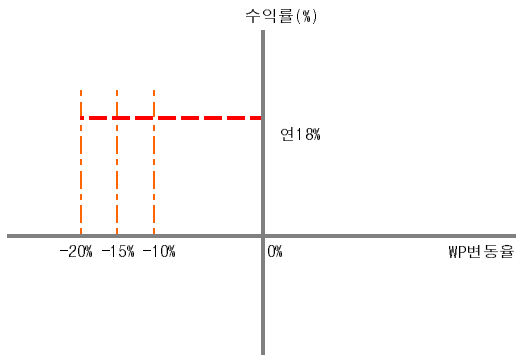
1. 계약금액

단위(백만원)

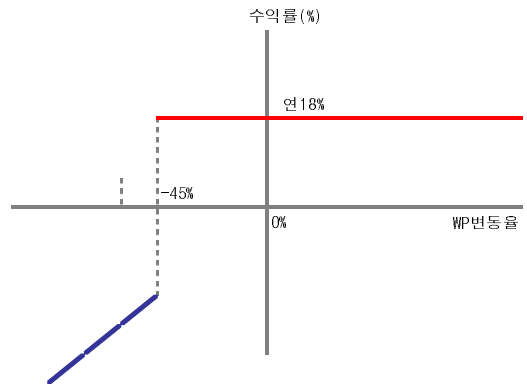
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,012	0	1,012	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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 시나리오	8.00%	(27.10)	(28.75)	(30.40)	(32.05)	(33.69)	(35.34)	(36.99)
	5.33%	(15.95)	(17.60)	(19.24)	(20.89)	(22.54)	(24.18)	(25.83)
	2.67%	(5.27)	(6.91)	(8.56)	(10.21)	(11.86)	(13.50)	(15.15)
	0.00%	4.94	3.29	1.65	0.00	(1.65)	(3.29)	(4.94)
	-2.67%	14.68	13.03	11.38	9.73	8.09	6.44	4.79
	-5.33%	23.94	22.29	20.64	19.00	17.35	15.70	14.06
	-8.00%	32.73	31.08	29.43	27.78	26.14	24.49	22.84

최대 손실 시나리오

위험액	22.84
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	39.99
-----	-------

[47] 메리츠2Star사모증권SEST-10호

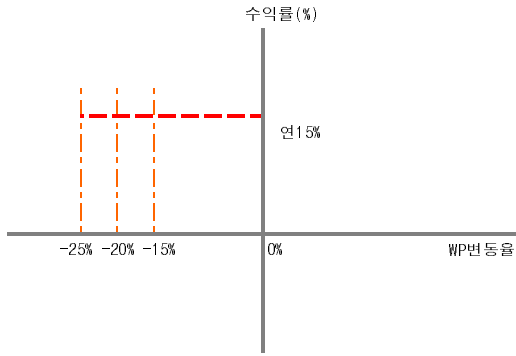
1. 계약금액

단위(백만원)

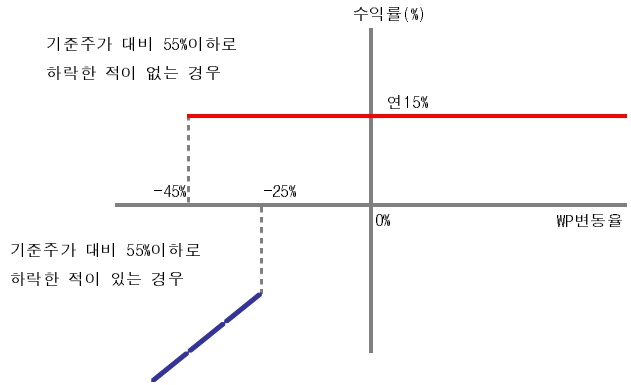
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	889	0	889	장익

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 시나 리오	8.00%	0.84	0.33	(0.17)	(0.68)	(1.19)	(1.69)	(2.20)
	5.33%	2.16	1.66	1.15	0.64	0.14	(0.37)	(0.88)
	2.67%	2.39	1.88	1.38	0.87	0.36	(0.14)	(0.65)
	0.00%	1.52	1.01	0.51	0.00	(0.51)	(1.01)	(1.52)
	-2.67%	(0.45)	(0.95)	(1.46)	(1.96)	(2.47)	(2.98)	(3.48)
	-5.33%	(3.50)	(4.01)	(4.52)	(5.02)	(5.53)	(6.04)	(6.54)
	-8.00%	(7.66)	(8.17)	(8.67)	(9.18)	(9.68)	(10.19)	(10.70)

최대손실 시나리오

위험액	-10.70
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.06
-----	-------

[48] 메리츠2Star사모증권SEST-11호

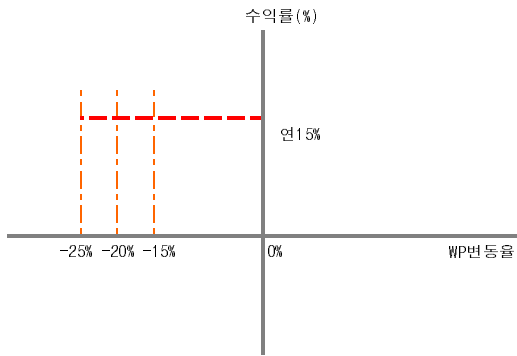
1. 계약금액

단위(백만원)

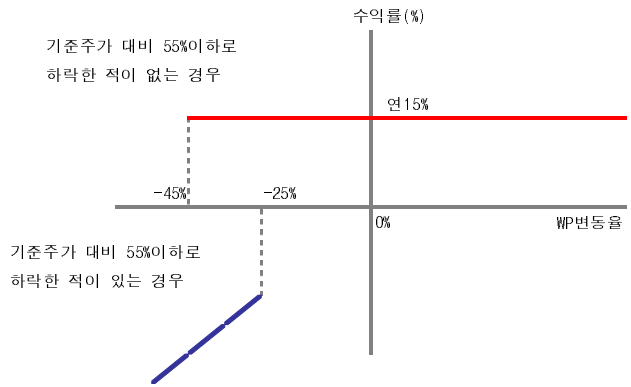
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	395	0	395	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(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%	0.37	0.15	(0.08)	(0.30)	(0.53)	(0.75)	(0.98)
	5.33%	0.96	0.74	0.51	0.29	0.06	(0.16)	(0.39)
	2.67%	1.06	0.84	0.61	0.39	0.16	(0.06)	(0.29)
	0.00%	0.68	0.45	0.23	0.00	(0.23)	(0.45)	(0.68)
	-2.67%	(0.20)	(0.42)	(0.65)	(0.87)	(1.10)	(1.32)	(1.55)
	-5.33%	(1.56)	(1.78)	(2.01)	(2.23)	(2.46)	(2.68)	(2.91)
	-8.00%	(3.40)	(3.63)	(3.85)	(4.08)	(4.30)	(4.53)	(4.75)

최대손실 시나리오

위험액	-4.75
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.47
-----	------

[49] 메리츠2Star사모증권SEST-12호

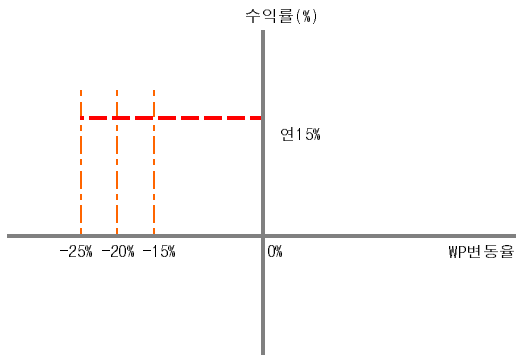
1. 계약금액

단위(백만원)

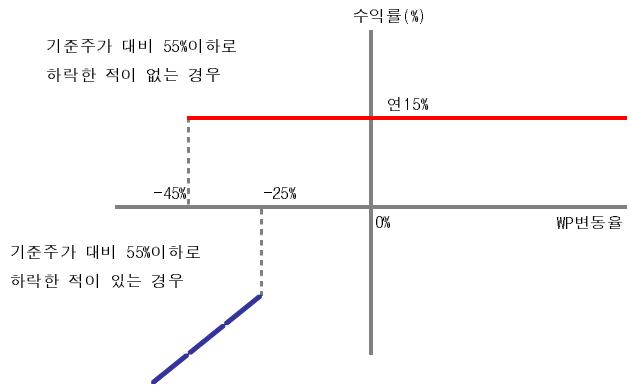
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	610	0	610	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6692308WB2 NH투자증권(ELS)205

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	0.58	0.23	(0.12)	(0.47)	(0.81)	(1.16)	(1.51)
	5.33%	1.48	1.13	0.79	0.44	0.09	(0.25)	(0.60)
	2.67%	1.64	1.29	0.94	0.60	0.25	(0.10)	(0.45)
	0.00%	1.04	0.69	0.35	0.00	(0.35)	(0.69)	(1.04)
	-2.67%	(0.31)	(0.65)	(1.00)	(1.35)	(1.69)	(2.04)	(2.39)
	-5.33%	(2.40)	(2.75)	(3.10)	(3.44)	(3.79)	(4.14)	(4.49)
	-8.00%	(5.25)	(5.60)	(5.95)	(6.29)	(6.64)	(6.99)	(7.33)

최대손실 시나리오

위험액	-7.33
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	6.90
-----	------



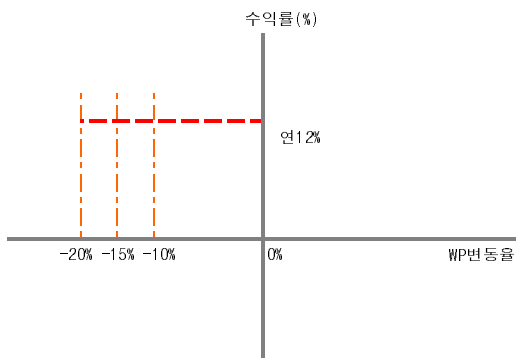
1. 계약금액

단위(백만원)

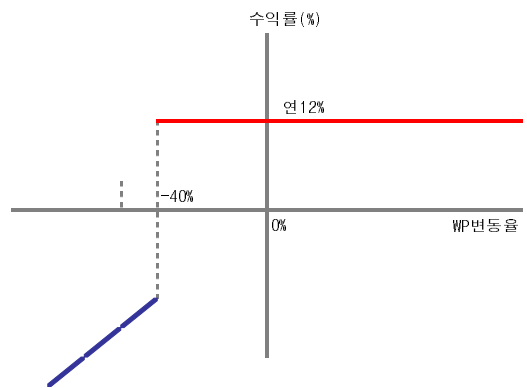
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

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%	2.49	1.93	1.36	0.80	0.24	(0.33)	(0.89)
	5.33%	2.37	1.81	1.25	0.68	0.12	(0.45)	(1.01)
	2.67%	2.11	1.54	0.98	0.42	(0.15)	(0.71)	(1.28)
	0.00%	1.69	1.13	0.56	0.00	(0.56)	(1.13)	(1.69)
	-2.67%	1.13	0.56	(0.00)	(0.56)	(1.13)	(1.69)	(2.26)
	-5.33%	0.41	(0.15)	(0.71)	(1.28)	(1.84)	(2.41)	(2.97)
	-8.00%	(0.45)	(1.01)	(1.58)	(2.14)	(2.71)	(3.27)	(3.83)

최대손실 시나리오

위험액	-3.83
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.12
-----	------

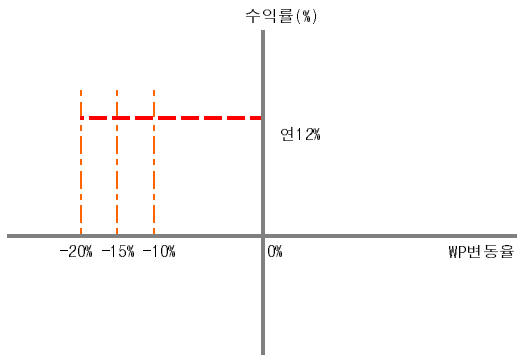
1. 계약금액

단위(백만원)

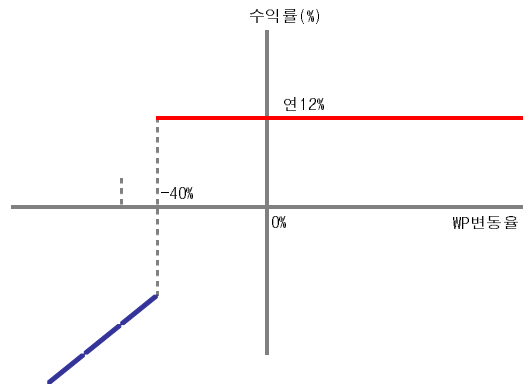
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

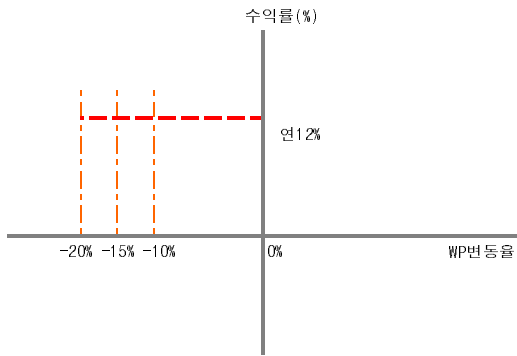
1. 계약금액

단위(백만원)

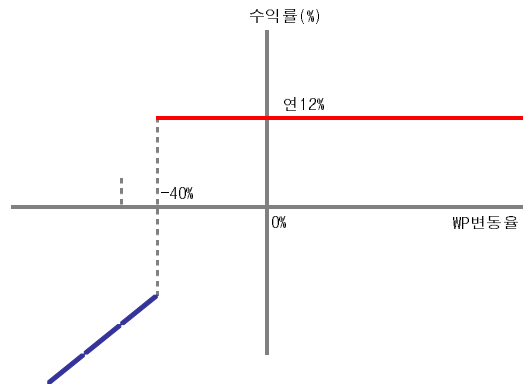
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

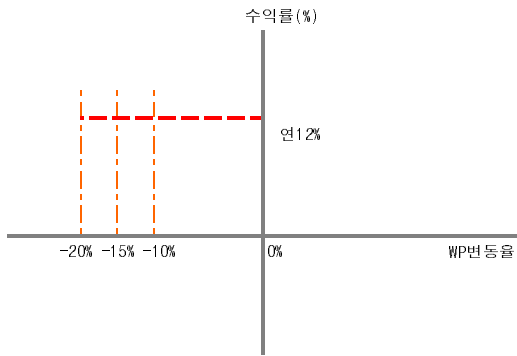
1. 계약금액

단위(백만원)

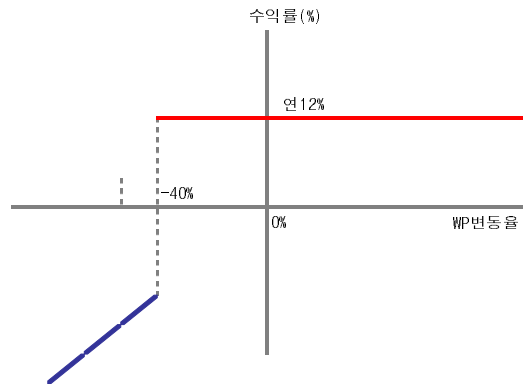
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	43	0	43	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

[51-1] 메리츠2Star사모증권SEST-14호

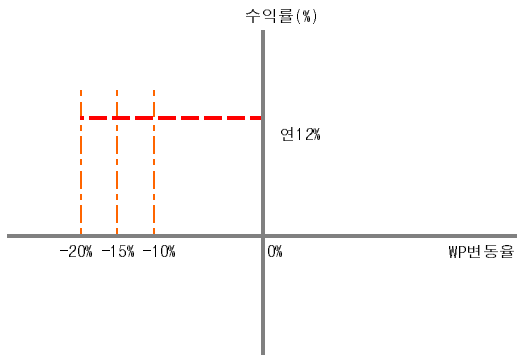
1. 계약금액

단위(백만원)

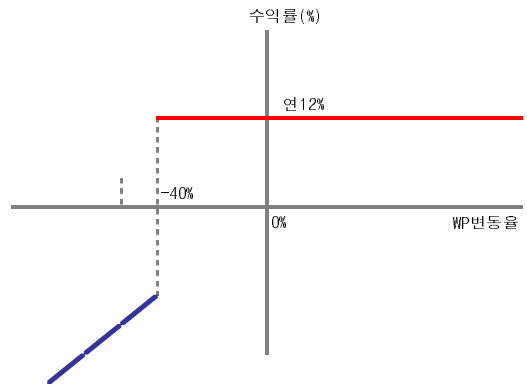
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

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%	2.21	1.71	1.21	0.71	0.21	(0.29)	(0.79)
	5.33%	2.11	1.61	1.11	0.60	0.10	(0.40)	(0.90)
	2.67%	1.87	1.37	0.87	0.37	(0.13)	(0.63)	(1.13)
	0.00%	1.50	1.00	0.50	0.00	(0.50)	(1.00)	(1.50)
	-2.67%	1.00	0.50	(0.00)	(0.50)	(1.00)	(1.50)	(2.00)
	-5.33%	0.37	(0.13)	(0.63)	(1.13)	(1.63)	(2.13)	(2.64)
	-8.00%	(0.40)	(0.90)	(1.40)	(1.90)	(2.40)	(2.90)	(3.40)

최대손실 시나리오

위험액	-3.40
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.43
-----	------

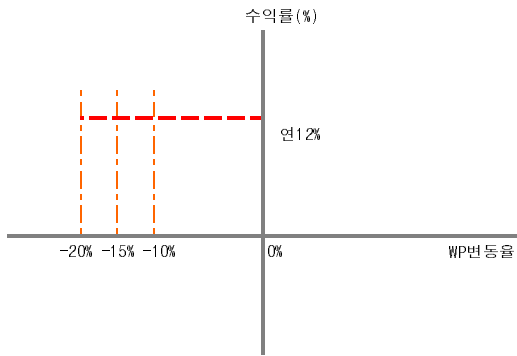
1. 계약금액

단위(백만원)

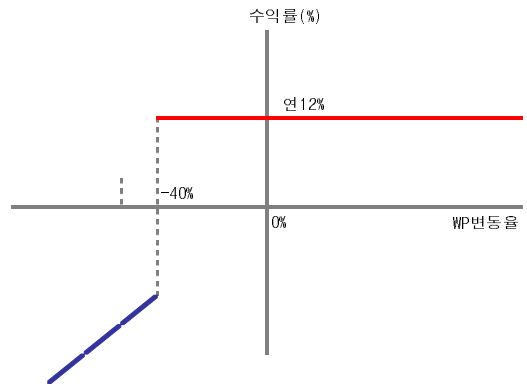
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

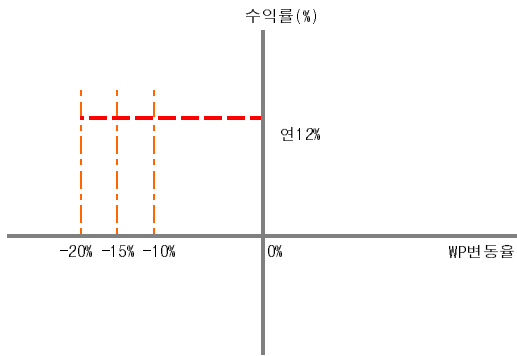
1. 계약금액

단위(백만원)

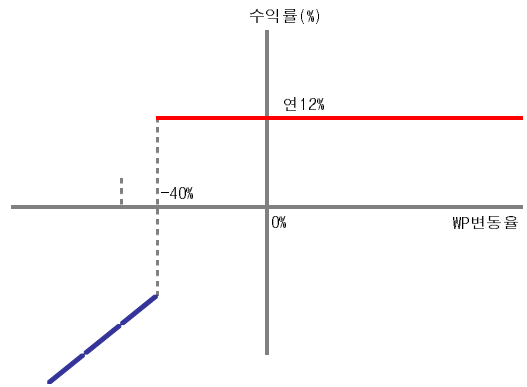
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

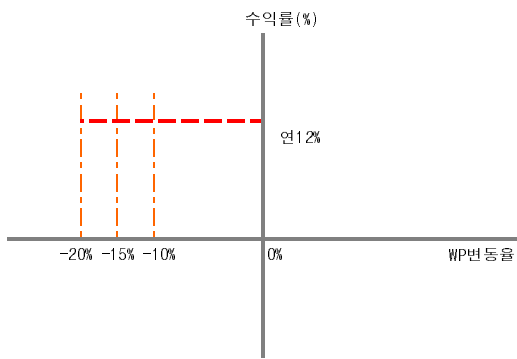
1. 계약금액

단위(백만원)

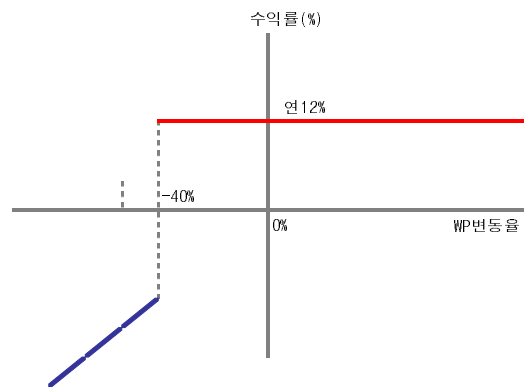
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211



[52] 메리츠2Star사모증권SEST-7호

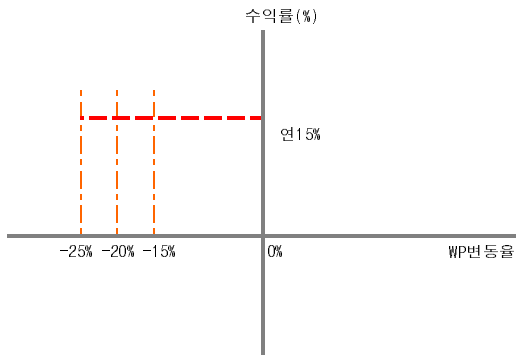
1. 계약금액

단위(백만원)

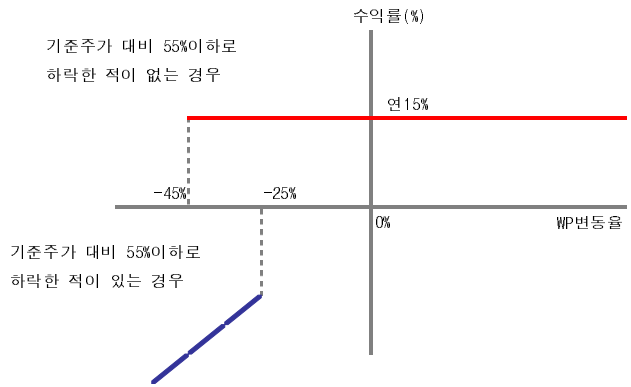
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	919	0	919	장익

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%	0.87	0.35	(0.18)	(0.70)	(1.22)	(1.75)	(2.27)
	5.33%	2.23	1.71	1.19	0.66	0.14	(0.38)	(0.91)
	2.67%	2.47	1.94	1.42	0.90	0.37	(0.15)	(0.67)
	0.00%	1.57	1.05	0.52	0.00	(0.52)	(1.05)	(1.57)
	-2.67%	(0.46)	(0.98)	(1.51)	(2.03)	(2.55)	(3.08)	(3.60)
	-5.33%	(3.62)	(4.14)	(4.67)	(5.19)	(5.71)	(6.24)	(6.76)
	-8.00%	(7.92)	(8.44)	(8.96)	(9.49)	(10.01)	(10.53)	(11.06)

최대손실 시나리오

위험액	-11.06
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	10.40
-----	-------

[53] 메리츠2Star사모증권SEST-8호

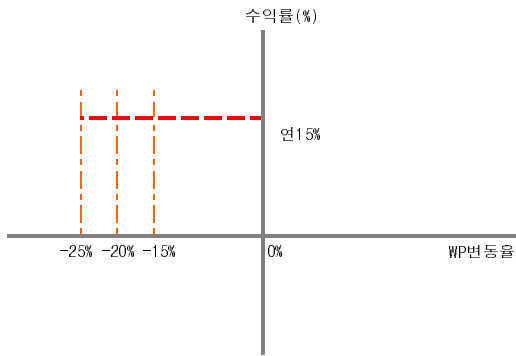
1. 계약금액

단위(백만원)

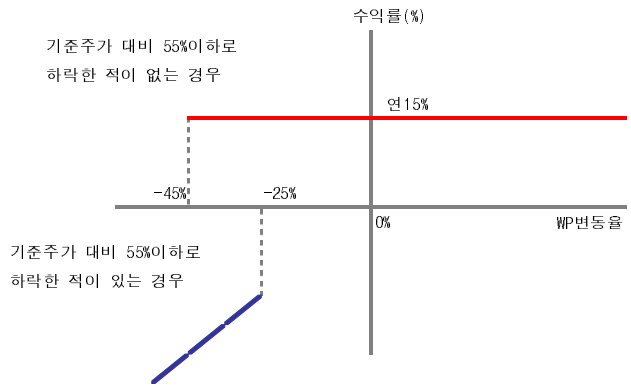
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,651	0	1,651	장익

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 시나 리오	8.00%	1.56	0.62	(0.32)	(1.26)	(2.20)	(3.14)	(4.08)
	5.33%	4.02	3.07	2.13	1.19	0.25	(0.69)	(1.63)
	2.67%	4.44	3.49	2.55	1.61	0.67	(0.27)	(1.21)
	0.00%	2.82	1.88	0.94	0.00	(0.94)	(1.88)	(2.82)
	-2.67%	(0.83)	(1.77)	(2.71)	(3.65)	(4.59)	(5.53)	(6.47)
	-5.33%	(6.51)	(7.45)	(8.39)	(9.33)	(10.27)	(11.21)	(12.15)
	-8.00%	(14.22)	(15.17)	(16.11)	(17.05)	(17.99)	(18.93)	(19.87)

최대손실 시나리오

위험액	-19.87
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	18.69
-----	-------

[54] 메리츠2Star사모증권SEST-9호

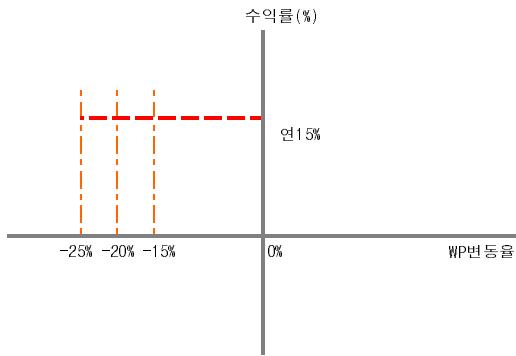
1. 계약금액

단위(백만원)

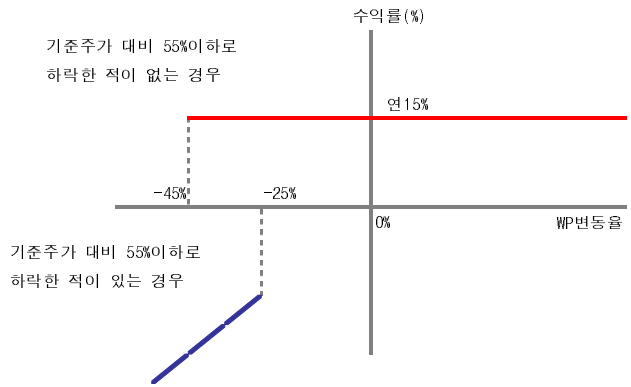
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,589	0	1,589	장익

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 시나리오	8.00%	1.50	0.60	(0.31)	(1.21)	(2.12)	(3.02)	(3.93)
	5.33%	3.86	2.96	2.05	1.15	0.24	(0.66)	(1.57)
	2.67%	4.27	3.36	2.46	1.55	0.65	(0.26)	(1.16)
	0.00%	2.72	1.81	0.91	0.00	(0.91)	(1.81)	(2.72)
	-2.67%	(0.80)	(1.70)	(2.61)	(3.51)	(4.42)	(5.32)	(6.23)
	-5.33%	(6.26)	(7.17)	(8.07)	(8.98)	(9.88)	(10.79)	(11.69)
	-8.00%	(13.69)	(14.59)	(15.50)	(16.40)	(17.31)	(18.21)	(19.12)

최대손실 시나리오

위험액	-19.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	17.98
-----	-------

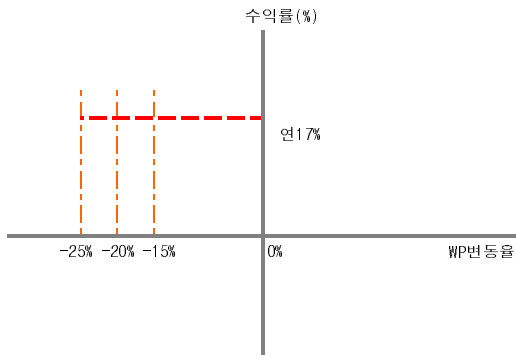
1. 계약금액

단위(백만원)

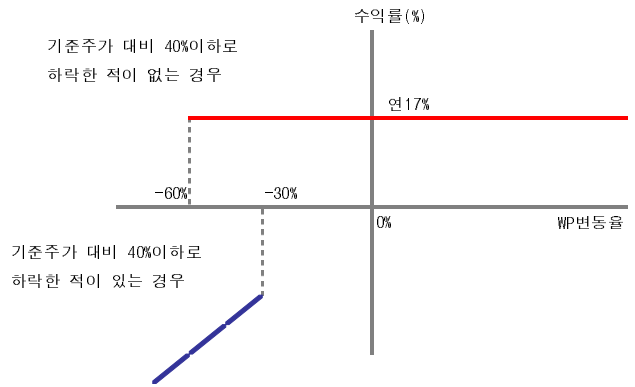
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장익

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%	74.59	59.54	44.49	29.45	14.40	(0.65)	(15.69)
	5.33%	66.18	51.13	36.08	21.03	5.99	(9.06)	(24.11)
	2.67%	56.36	41.31	26.27	11.22	(3.83)	(18.87)	(33.92)
	0.00%	45.14	30.09	15.05	0.00	(15.05)	(30.09)	(45.14)
	-2.67%	32.52	17.47	2.42	(12.62)	(27.67)	(42.72)	(57.76)
	-5.33%	18.49	3.44	(11.60)	(26.65)	(41.70)	(56.74)	(71.79)
	-8.00%	3.06	(11.99)	(27.03)	(42.08)	(57.13)	(72.17)	(87.22)

최대손실 시나리오

위험액	-87.22
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	73.79
-----	-------

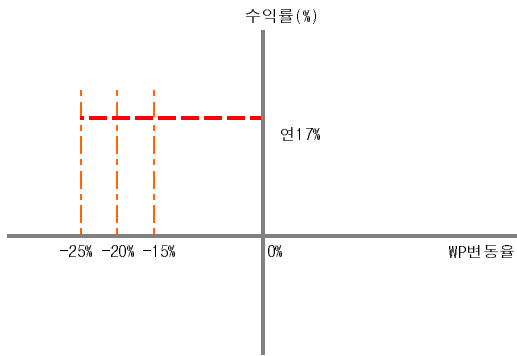
1. 계약금액

단위(백만원)

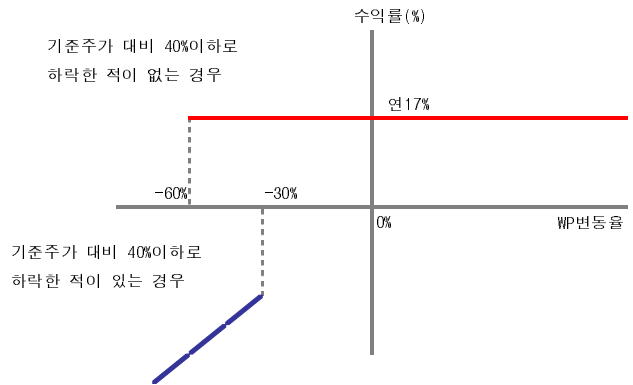
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733

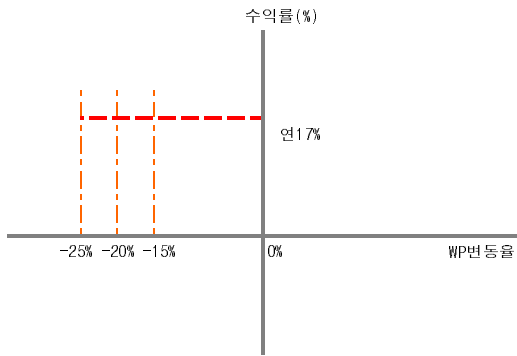
1. 계약금액

단위(백만원)

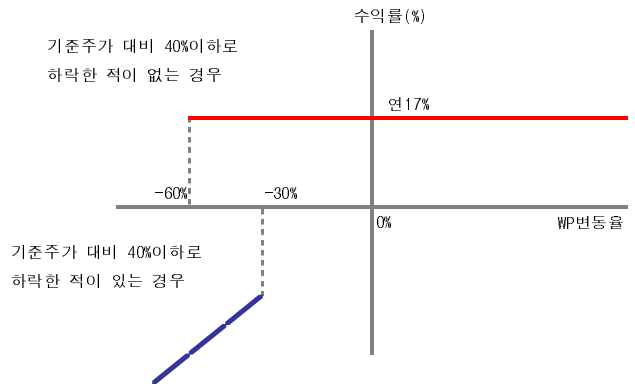
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343

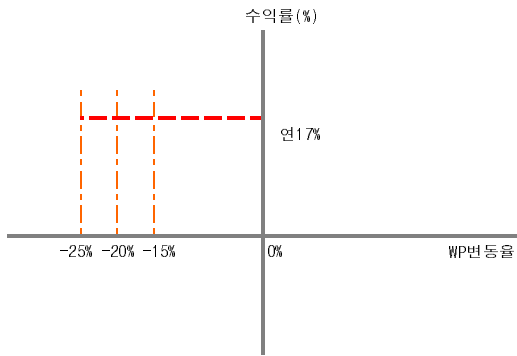
1. 계약금액

단위(백만원)

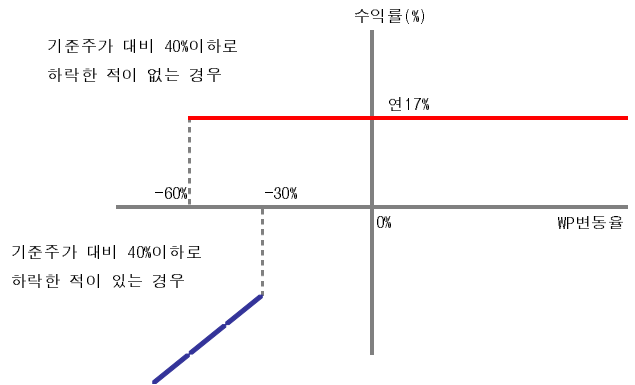
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	252	0	252	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

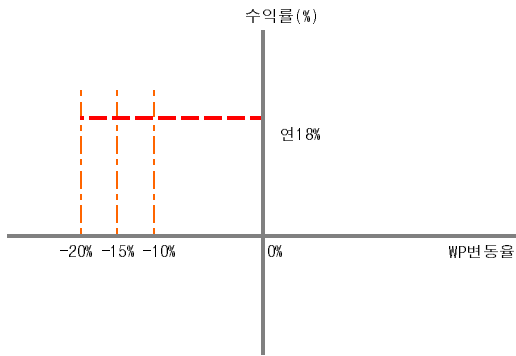
1. 계약금액

단위(백만원)

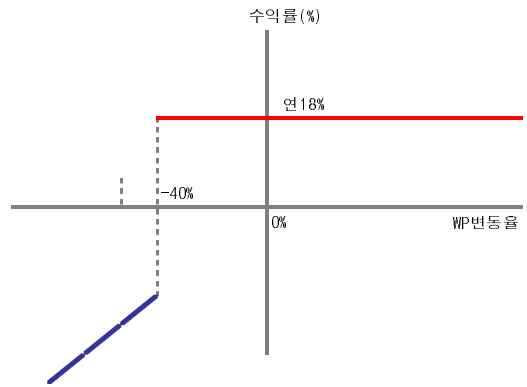
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,512	0	1,512	장익

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 시나리오	8.00%	38.30	31.89	25.48	19.07	12.66	6.26	(0.15)
	5.33%	34.20	27.79	21.38	14.97	8.56	2.15	(4.26)
	2.67%	27.84	21.43	15.02	8.61	2.20	(4.21)	(10.62)
	0.00%	19.23	12.82	6.41	0.00	(6.41)	(12.82)	(19.23)
	-2.67%	8.36	1.95	(4.46)	(10.86)	(17.27)	(23.68)	(30.09)
	-5.33%	(4.75)	(11.16)	(17.57)	(23.98)	(30.39)	(36.80)	(43.21)
	-8.00%	(20.12)	(26.53)	(32.94)	(39.35)	(45.76)	(52.17)	(58.58)

최대손실 시나리오

위험액	-58.58
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	59.25
-----	-------



[57] 메리츠2Star사모증권SFSE-2호

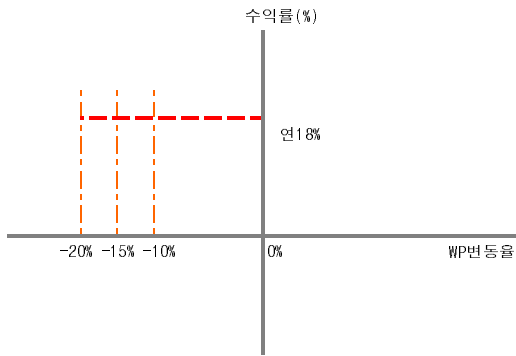
1. 계약금액

단위(백만원)

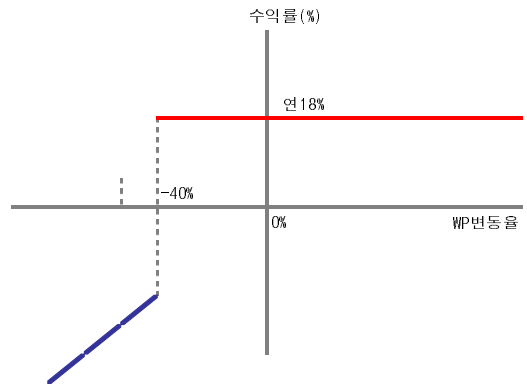
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,720	0	1,720	장익

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%	43.56	36.27	28.98	21.69	14.40	7.11	(0.17)
	5.33%	38.89	31.60	24.31	17.02	9.73	2.45	(4.84)
	2.67%	31.66	24.37	17.08	9.79	2.50	(4.78)	(12.07)
	0.00%	21.87	14.58	7.29	0.00	(7.29)	(14.58)	(21.87)
	-2.67%	9.51	2.22	(5.07)	(12.36)	(19.64)	(26.93)	(34.22)
	-5.33%	(5.41)	(12.70)	(19.98)	(27.27)	(34.56)	(41.85)	(49.14)
	-8.00%	(22.89)	(30.18)	(37.47)	(44.75)	(52.04)	(59.33)	(66.62)

최대손실 시나리오

위험액	-66.62
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	67.38
-----	-------

[58] 메리츠2Star사모증권SFSE-3호

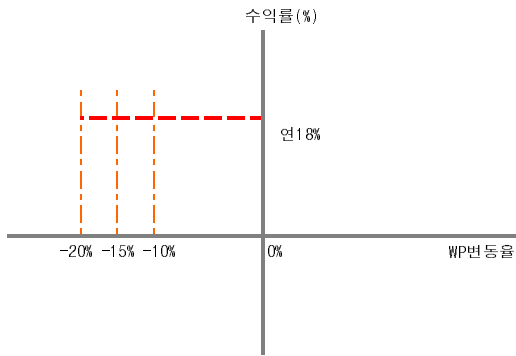
1. 계약금액

단위(백만원)

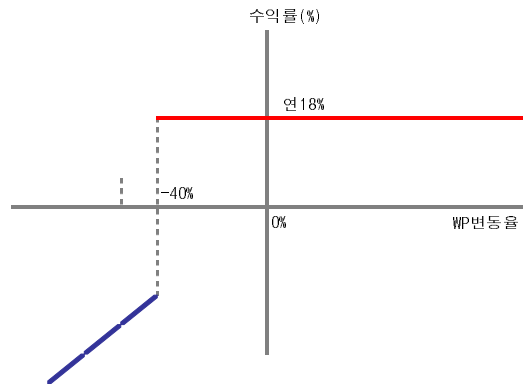
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,177	0	1,177	장익

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%	29.81	24.82	19.83	14.84	9.86	4.87	(0.12)
	5.33%	26.61	21.62	16.64	11.65	6.66	1.67	(3.31)
	2.67%	21.66	16.68	11.69	6.70	1.71	(3.27)	(8.26)
	0.00%	14.96	9.97	4.99	0.00	(4.99)	(9.97)	(14.96)
	-2.67%	6.51	1.52	(3.47)	(8.45)	(13.44)	(18.43)	(23.42)
	-5.33%	(3.70)	(8.69)	(13.67)	(18.66)	(23.65)	(28.64)	(33.62)
	-8.00%	(15.66)	(20.65)	(25.64)	(30.62)	(35.61)	(40.60)	(45.59)

최대손실 시나리오

위험액	-45.59
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46.10
-----	-------

[59] 메리츠2Star사모증권SFSE-4호

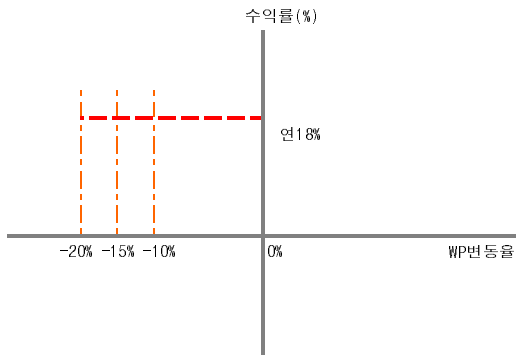
1. 계약금액

단위(백만원)

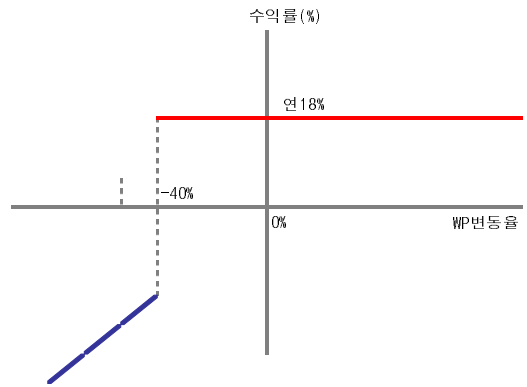
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	332	0	332	장익

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%	8.41	7.00	5.59	4.19	2.78	1.37	(0.03)
	5.33%	7.51	6.10	4.69	3.29	1.88	0.47	(0.93)
	2.67%	6.11	4.70	3.30	1.89	0.48	(0.92)	(2.33)
	0.00%	4.22	2.81	1.41	0.00	(1.41)	(2.81)	(4.22)
	-2.67%	1.84	0.43	(0.98)	(2.38)	(3.79)	(5.20)	(6.61)
	-5.33%	(1.04)	(2.45)	(3.86)	(5.26)	(6.67)	(8.08)	(9.48)
	-8.00%	(4.42)	(5.82)	(7.23)	(8.64)	(10.04)	(11.45)	(12.86)

최대손실 시나리오

위험액	-12.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.00
-----	-------

[60] 메리츠2Star사모증권SNKG-1호

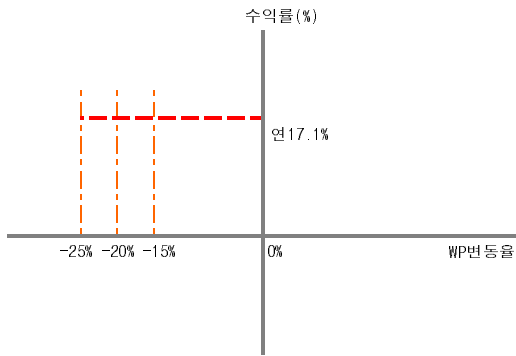
1. 계약금액

단위(백만원)

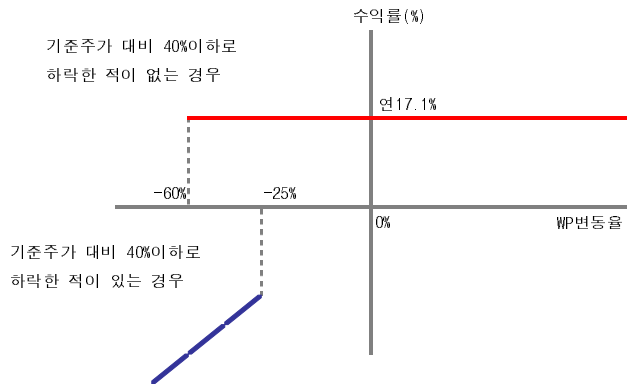
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,503	0	1,503	장익

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%	93.70	75.97	58.24	40.51	22.78	5.05	(12.68)
	5.33%	82.30	64.57	46.84	29.11	11.38	(6.35)	(24.08)
	2.67%	68.80	51.07	33.34	15.61	(2.12)	(19.85)	(37.58)
	0.00%	53.19	35.46	17.73	0.00	(17.73)	(35.46)	(53.19)
	-2.67%	35.48	17.75	0.02	(17.71)	(35.44)	(53.17)	(70.90)
	-5.33%	15.66	(2.07)	(19.80)	(37.53)	(55.26)	(72.99)	(90.72)
	-8.00%	(6.26)	(23.99)	(41.72)	(59.45)	(77.17)	(94.90)	(112.63)

최대손실 시나리오

위험액	-112.63
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	117.09
-----	--------

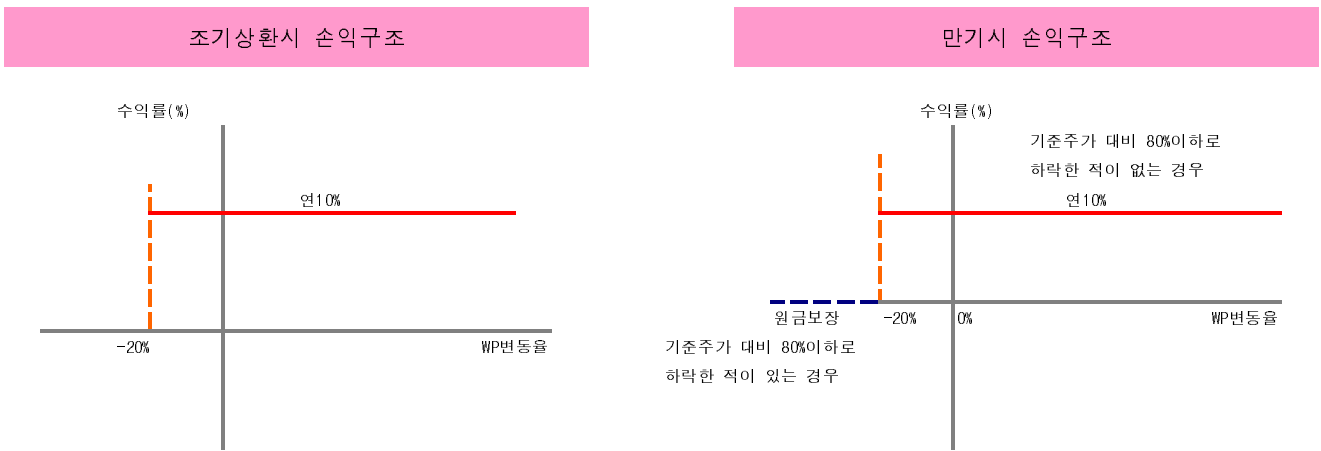
[61] 메리츠2Star사모증권STS0-1호

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%	6.17	5.72	5.27	4.83	4.38	3.93	3.49
	5.33%	4.52	4.08	3.63	3.18	2.73	2.29	1.84
	2.67%	2.91	2.47	2.02	1.57	1.13	0.68	0.23
	0.00%	1.34	0.89	0.45	0.00	(0.45)	(0.89)	(1.34)
	-2.67%	(0.19)	(0.64)	(1.09)	(1.54)	(1.98)	(2.43)	(2.88)
	-5.33%	(1.69)	(2.14)	(2.59)	(3.03)	(3.48)	(3.93)	(4.37)
	-8.00%	(3.15)	(3.60)	(4.05)	(4.49)	(4.94)	(5.39)	(5.83)

최대손실 시나리오

위험액	-5.83
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7.38
-----	------

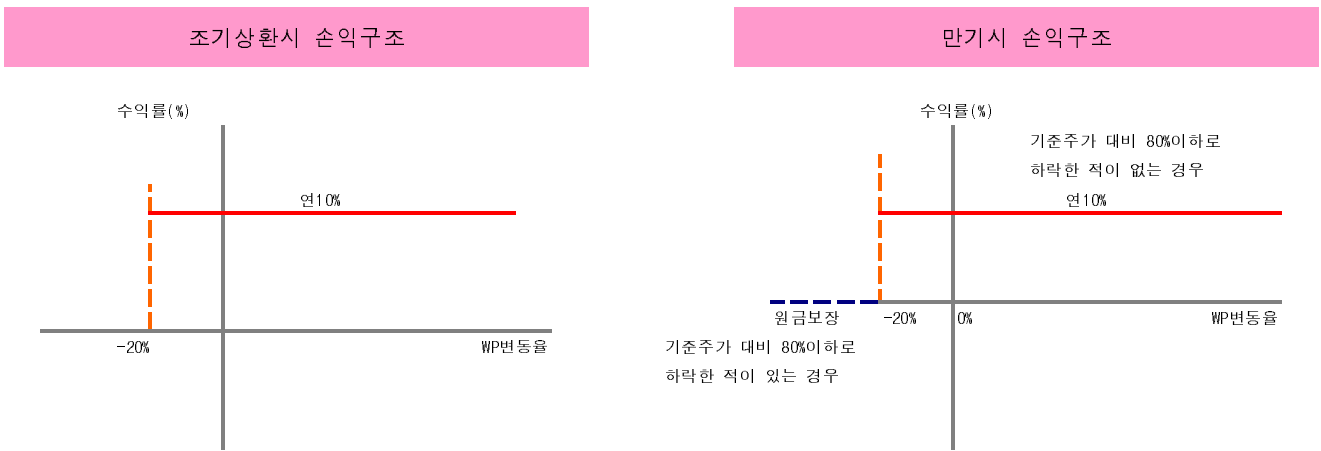
[62] 메리츠2Star사모증권STS0-2호

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 시나리오	8.00%	2.48	2.30	2.12	1.94	1.76	1.58	1.40
	5.33%	1.82	1.64	1.46	1.28	1.10	0.92	0.74
	2.67%	1.17	0.99	0.81	0.63	0.45	0.27	0.09
	0.00%	0.54	0.36	0.18	0.00	(0.18)	(0.36)	(0.54)
	-2.67%	(0.08)	(0.26)	(0.44)	(0.62)	(0.80)	(0.97)	(1.15)
	-5.33%	(0.68)	(0.86)	(1.04)	(1.22)	(1.40)	(1.58)	(1.76)
	-8.00%	(1.27)	(1.45)	(1.62)	(1.80)	(1.98)	(2.16)	(2.34)

최대손실 시나리오

위험액	-2.34
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.96
-----	------

[63] 메리츠2Star사모파생상품G-11호

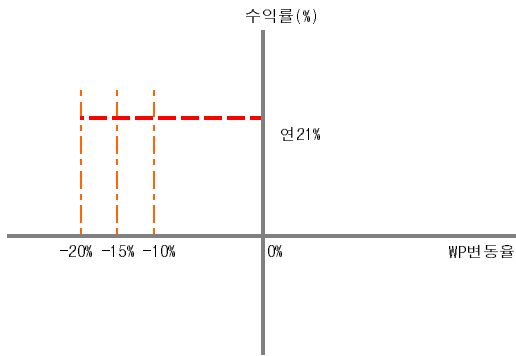
1. 계약금액

단위(백만원)

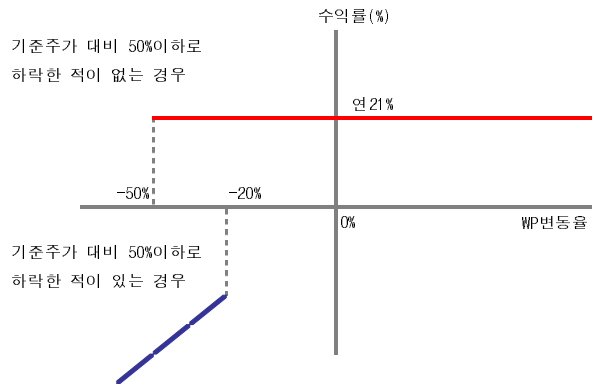
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	235	0	235	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552326W20 우리투자증권(ELS)2315

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	0.33	(0.43)	(1.18)	(1.93)	(2.68)	(3.44)	(4.19)
	5.33%	1.52	0.77	0.02	(0.73)	(1.49)	(2.24)	(2.99)
	2.67%	2.17	1.42	0.66	(0.09)	(0.84)	(1.59)	(2.35)
	0.00%	2.26	1.50	0.75	0.00	(0.75)	(1.50)	(2.26)
	-2.67%	1.79	1.04	0.29	(0.46)	(1.22)	(1.97)	(2.72)
	-5.33%	0.77	0.02	(0.73)	(1.48)	(2.24)	(2.99)	(3.74)
	-8.00%	(0.80)	(1.55)	(2.30)	(3.06)	(3.81)	(4.56)	(5.31)

최대손실 시나리오

위험액	-5.31
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.28
-----	------

[64] 메리츠2Star사모HVCJ-1호

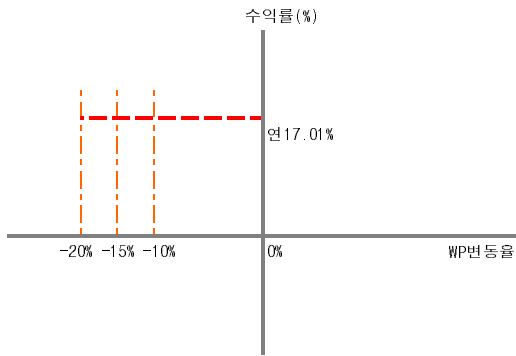
1. 계약금액

단위(백만원)

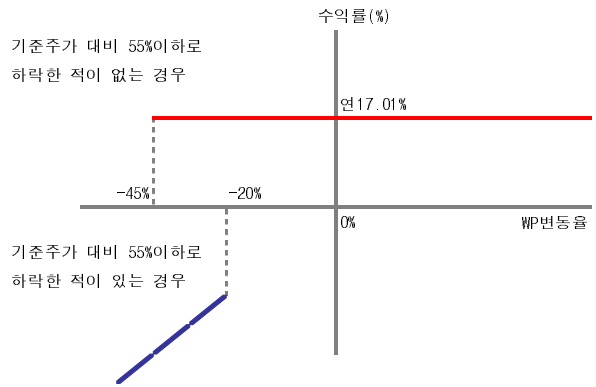
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	660	0	660	장익

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 시나 리오	8.00%	7.30	5.99	4.68	3.37	2.06	0.75	(0.56)
	5.33%	7.14	5.83	4.52	3.21	1.90	0.59	(0.72)
	2.67%	6.02	4.71	3.40	2.09	0.78	(0.53)	(1.84)
	0.00%	3.93	2.62	1.31	0.00	(1.31)	(2.62)	(3.93)
	-2.67%	0.88	(0.43)	(1.74)	(3.05)	(4.36)	(5.67)	(6.98)
	-5.33%	(3.13)	(4.45)	(5.76)	(7.07)	(8.38)	(9.69)	(11.00)
	-8.00%	(8.11)	(9.42)	(10.74)	(12.05)	(13.36)	(14.67)	(15.98)

최대손실 시나리오

위험액	-15.98
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.87
-----	-------



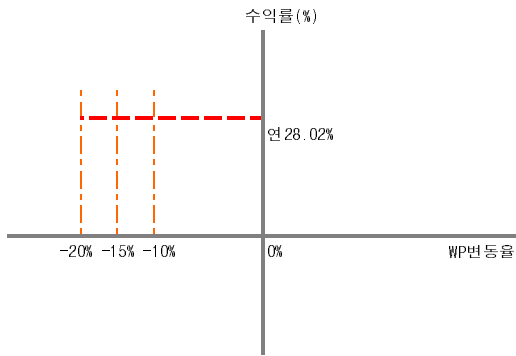
1. 계약금액

단위(백만원)

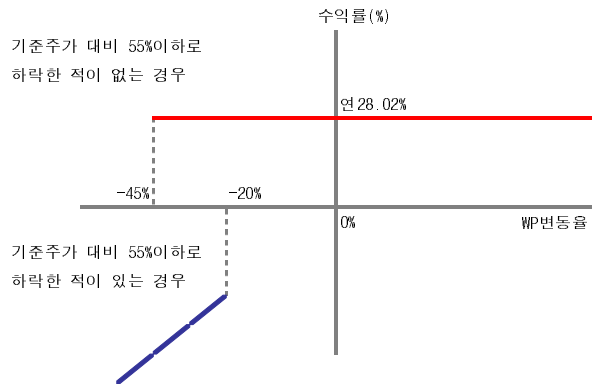
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	786	0	786	장익

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 시나리오	8.00%	6.98	5.60	4.22	2.84	1.46	0.08	(1.30)
	5.33%	7.21	5.83	4.45	3.07	1.69	0.31	(1.07)
	2.67%	6.26	4.88	3.50	2.12	0.75	(0.63)	(2.01)
	0.00%	4.14	2.76	1.38	0.00	(1.38)	(2.76)	(4.14)
	-2.67%	0.84	(0.54)	(1.92)	(3.30)	(4.68)	(6.06)	(7.44)
	-5.33%	(3.64)	(5.02)	(6.40)	(7.78)	(9.16)	(10.54)	(11.92)
	-8.00%	(9.30)	(10.68)	(12.06)	(13.44)	(14.82)	(16.20)	(17.57)

최대손실 시나리오

위험액	-17.57
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.62
-----	-------

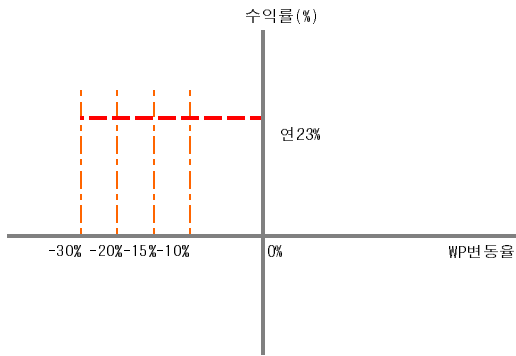
1. 계약금액

단위(백만원)

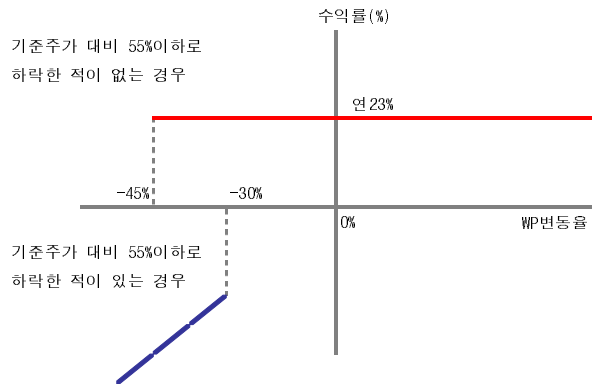
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	4,985	0	4,985	장익

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 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
-----	------

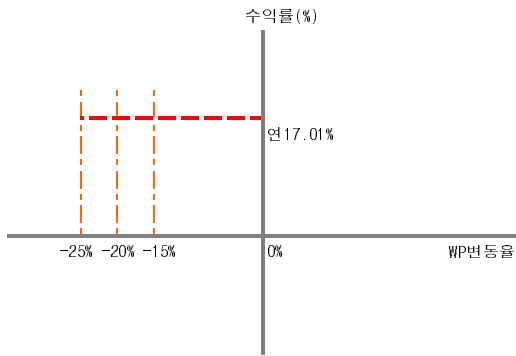
1. 계약금액

단위(백만원)

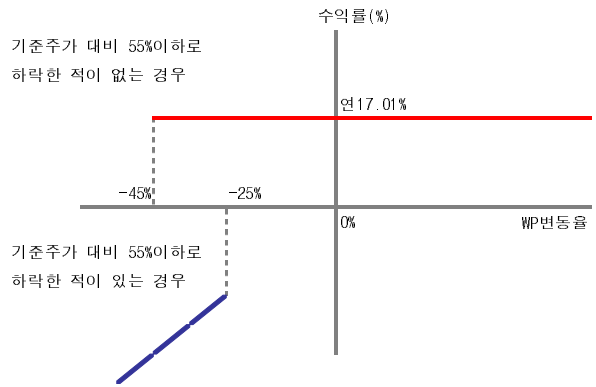
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	226	0	226	장익

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%	13.83	12.05	10.27	8.50	6.72	4.94	3.16
	5.33%	11.48	9.71	7.93	6.15	4.38	2.60	0.82
	2.67%	8.65	6.88	5.10	3.32	1.54	(0.23)	(2.01)
	0.00%	5.33	3.55	1.78	0.00	(1.78)	(3.55)	(5.33)
	-2.67%	1.52	(0.25)	(2.03)	(3.81)	(5.59)	(7.36)	(9.14)
	-5.33%	(2.78)	(4.55)	(6.33)	(8.11)	(9.88)	(11.66)	(13.44)
	-8.00%	(7.56)	(9.34)	(11.12)	(12.89)	(14.67)	(16.45)	(18.23)

최대손실 시나리오

위험액	-18.23
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	16.04
-----	-------

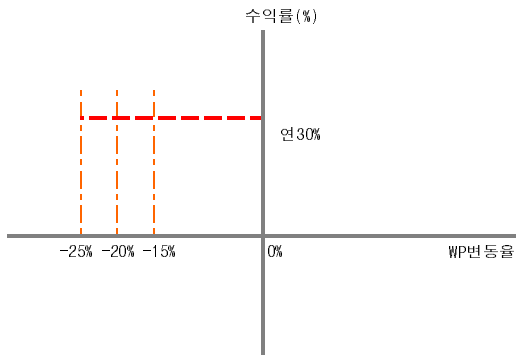
1. 계약금액

단위(백만원)

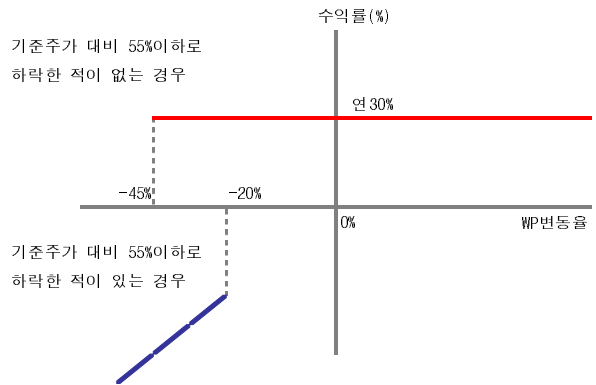
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	241	0	241	장익

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%	4.59	3.85	3.11	2.37	1.62	0.88	0.14
	5.33%	4.56	3.82	3.08	2.33	1.59	0.85	0.11
	2.67%	3.77	3.03	2.29	1.55	0.80	0.06	(0.68)
	0.00%	2.23	1.48	0.74	0.00	(0.74)	(1.48)	(2.23)
	-2.67%	(0.08)	(0.82)	(1.56)	(2.30)	(3.04)	(3.79)	(4.53)
	-5.33%	(3.14)	(3.88)	(4.62)	(5.36)	(6.10)	(6.85)	(7.59)
	-8.00%	(6.95)	(7.70)	(8.44)	(9.18)	(9.92)	(10.66)	(11.41)

최대손실 시나리오

위험액	-11.41
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.40
-----	------

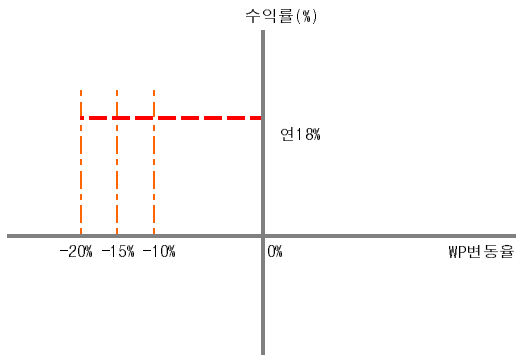
1. 계약금액

단위(백만원)

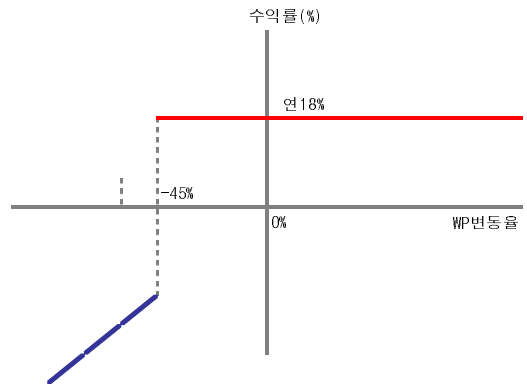
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	557	0	557	장익

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%	(14.91)	(15.82)	(16.72)	(17.63)	(18.53)	(19.44)	(20.35)
	5.33%	(8.77)	(9.68)	(10.59)	(11.49)	(12.40)	(13.30)	(14.21)
	2.67%	(2.90)	(3.80)	(4.71)	(5.62)	(6.52)	(7.43)	(8.33)
	0.00%	2.72	1.81	0.91	0.00	(0.91)	(1.81)	(2.72)
	-2.67%	8.07	7.17	6.26	5.36	4.45	3.54	2.64
	-5.33%	13.17	12.26	11.36	10.45	9.54	8.64	7.73
	-8.00%	18.00	17.10	16.19	15.28	14.38	13.47	12.57

최대손실 시나리오

위험액	12.57
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.00
-----	-------

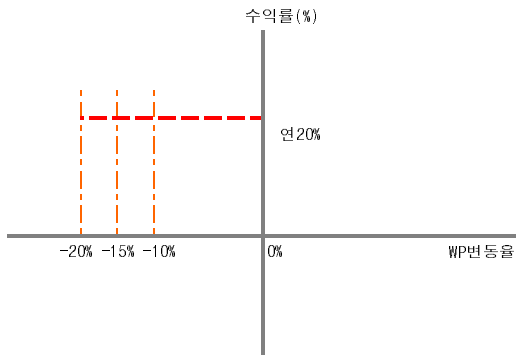
1. 계약금액

단위(백만원)

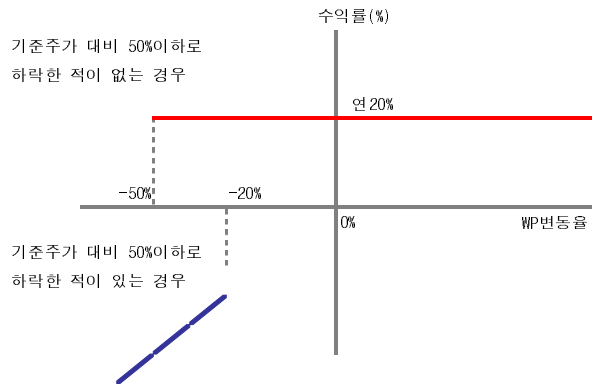
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	239	0	239	장익

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%	(7.02)	(7.42)	(7.81)	(8.21)	(8.61)	(9.00)	(9.40)
	5.33%	(4.12)	(4.52)	(4.92)	(5.31)	(5.71)	(6.10)	(6.50)
	2.67%	(1.39)	(1.78)	(2.18)	(2.58)	(2.97)	(3.37)	(3.76)
	0.00%	1.19	0.79	0.40	0.00	(0.40)	(0.79)	(1.19)
	-2.67%	3.60	3.21	2.81	2.41	2.02	1.62	1.23
	-5.33%	5.86	5.46	5.07	4.67	4.27	3.88	3.48
	-8.00%	7.95	7.55	7.16	6.76	6.37	5.97	5.57

최대 손실 시나리오

위험액	5.57
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	12.10
-----	-------

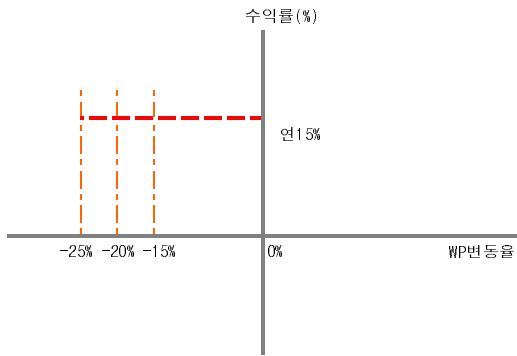
1. 계약금액

단위(백만원)

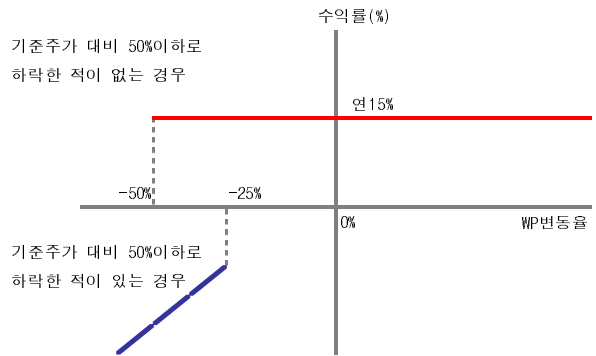
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

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%	175.14	149.03	122.91	96.79	70.67	44.55	18.44
	5.33%	146.94	120.82	94.71	68.59	42.47	16.35	(9.77)
	2.67%	114.68	88.56	62.44	36.32	10.21	(15.91)	(42.03)
	0.00%	78.35	52.24	26.12	0.00	(26.12)	(52.24)	(78.35)
	-2.67%	37.97	11.85	(14.27)	(40.38)	(66.50)	(92.62)	(118.74)
	-5.33%	(6.48)	(32.59)	(58.71)	(84.83)	(110.95)	(137.07)	(163.18)
	-8.00%	(54.98)	(81.10)	(107.22)	(133.34)	(159.46)	(185.57)	(211.69)

최대 손실 시나리오

위험액	-211.69
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	193.51
-----	--------

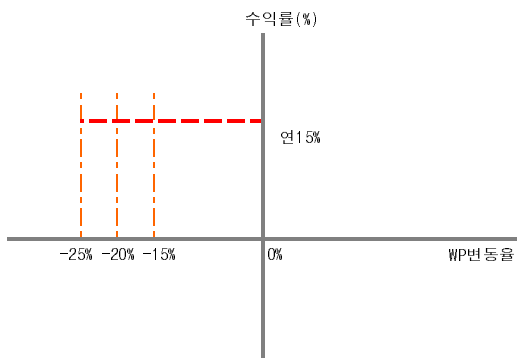
1. 계약금액

단위(백만원)

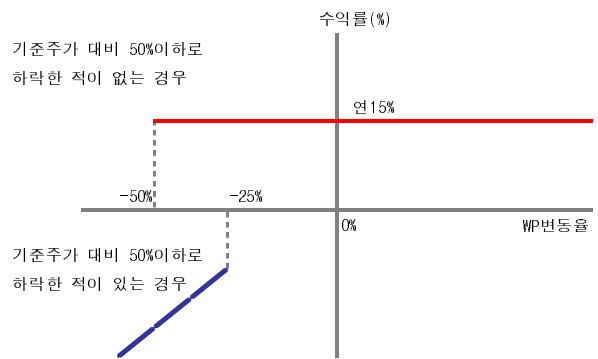
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138



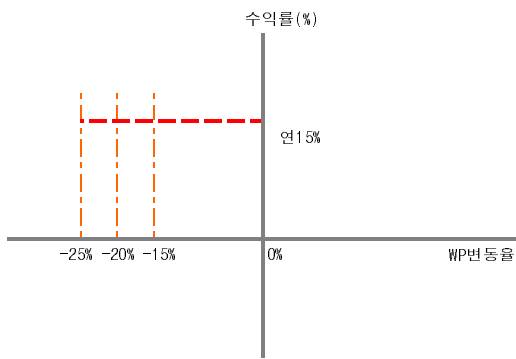
1. 계약금액

단위(백만원)

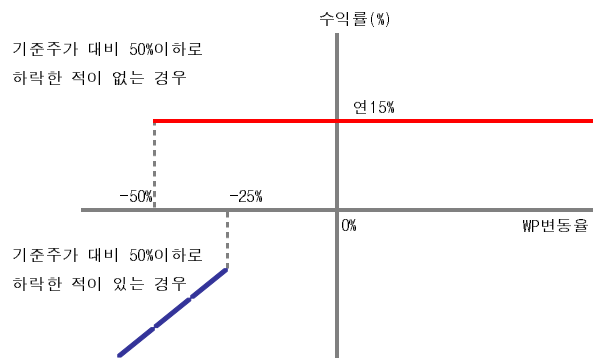
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

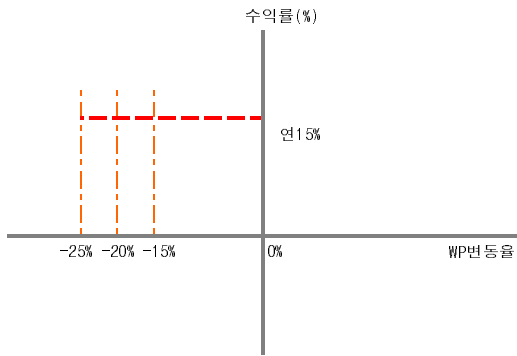
1. 계약금액

단위(백만원)

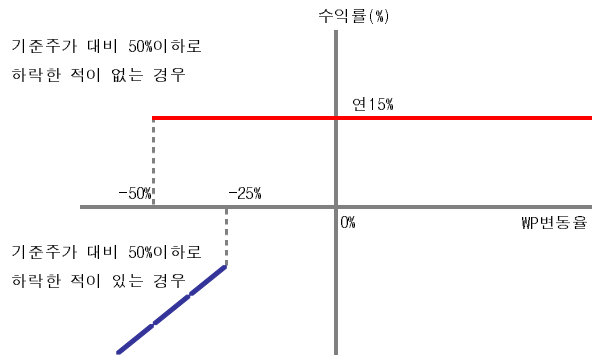
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[78-1] 메리츠2Star증권KISE-1호

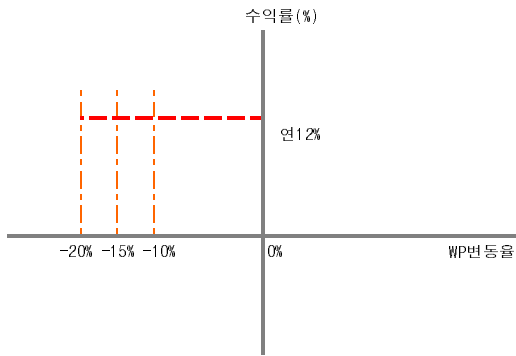
1. 계약금액

단위(백만원)

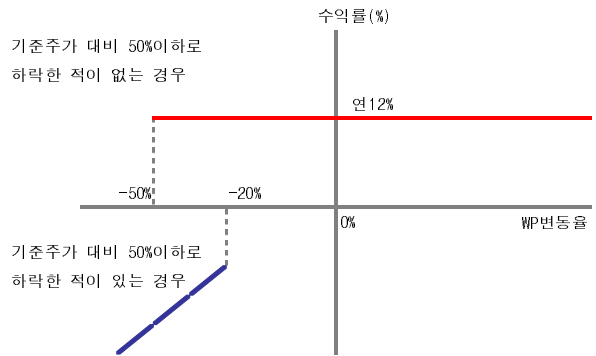
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(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%	26.19	25.74	25.29	24.84	24.39	23.94	23.49
	5.33%	12.05	11.60	11.15	10.70	10.25	9.80	9.35
	2.67%	3.77	3.32	2.87	2.42	1.97	1.52	1.07
	0.00%	1.35	0.90	0.45	0.00	(0.45)	(0.90)	(1.35)
	-2.67%	4.80	4.35	3.90	3.44	2.99	2.54	2.09
	-5.33%	14.10	13.65	13.20	12.75	12.30	11.85	11.40
	-8.00%	29.27	28.82	28.37	27.92	27.47	27.02	26.57

최대손실 시나리오

위험액	26.57
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7.14
-----	------

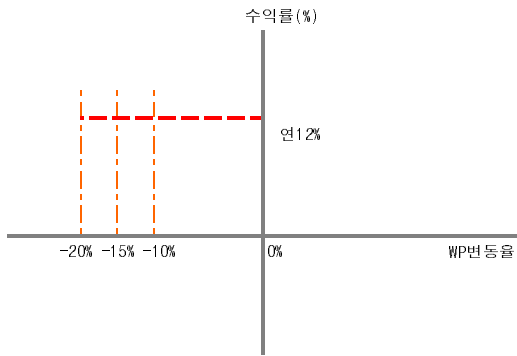
1. 계약금액

단위(백만원)

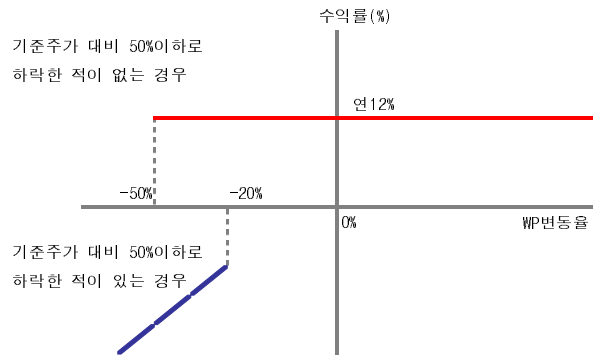
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552329WB7 우리투자증권(ELS)2730

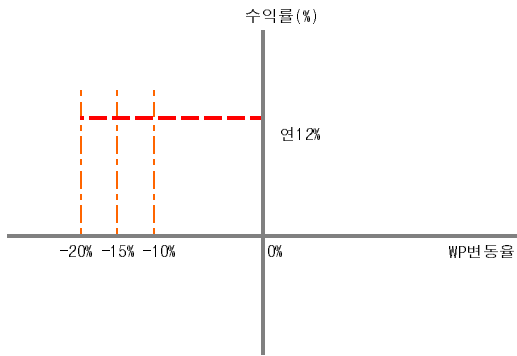
1. 계약금액

단위(백만원)

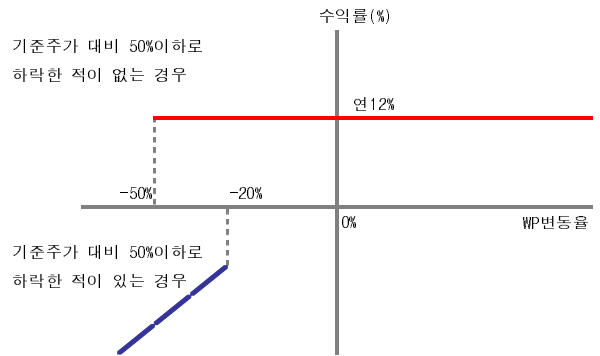
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579318WB9 한국투자증권(ELS)1411

[78-4]

메리츠2Star증권KISE-1호

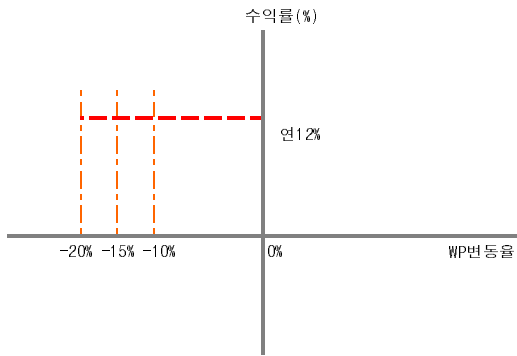
1. 계약금액

단위(백만원)

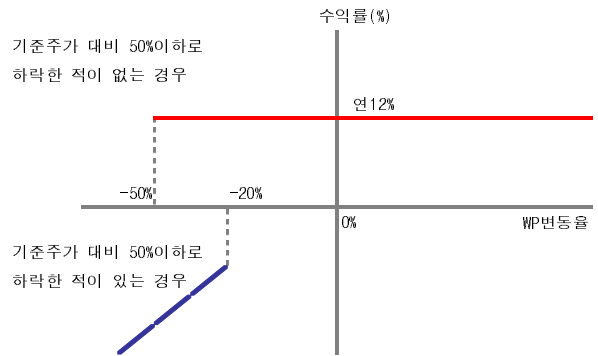
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669313WB1 동양(ELS)347

[79-1] 메리츠2Star증권KISE-2호

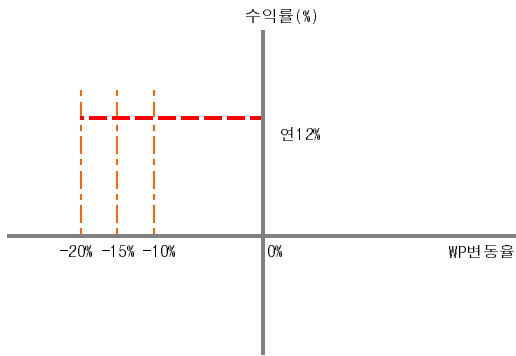
1. 계약금액

단위(백만원)

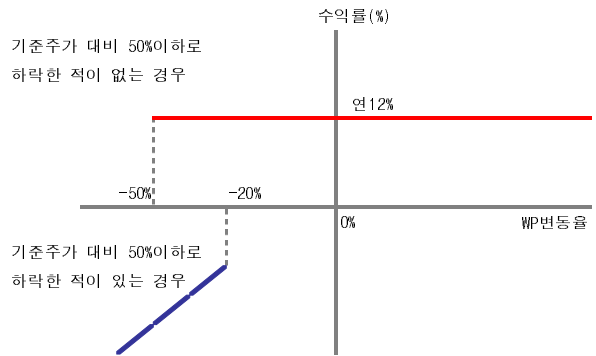
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

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%	11.27	11.23	11.20	11.16	11.12	11.08	11.04
	5.33%	4.42	4.38	4.34	4.30	4.26	4.23	4.19
	2.67%	0.70	0.66	0.62	0.58	0.55	0.51	0.47
	0.00%	0.11	0.08	0.04	0.00	(0.04)	(0.08)	(0.11)
	-2.67%	2.67	2.63	2.59	2.55	2.52	2.48	2.44
	-5.33%	8.36	8.32	8.28	8.24	8.20	8.17	8.13
	-8.00%	17.18	17.14	17.11	17.07	17.03	16.99	16.95

최대손실 시나리오

위험액	16.95
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.07
-----	------

[79-2]

메리츠2Star증권KISE-2호

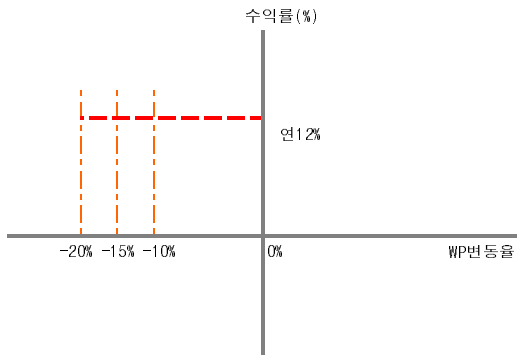
1. 계약금액

단위(백만원)

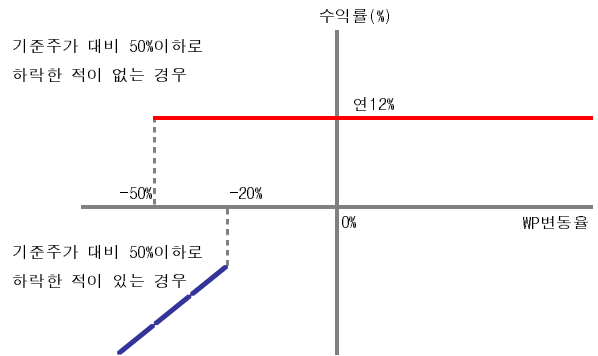
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6549319WB4 신영증권(ELS)1314



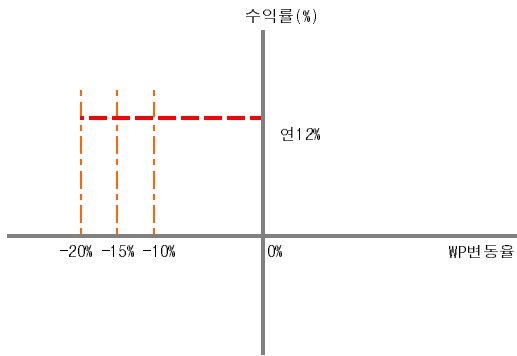
1. 계약금액

단위(백만원)

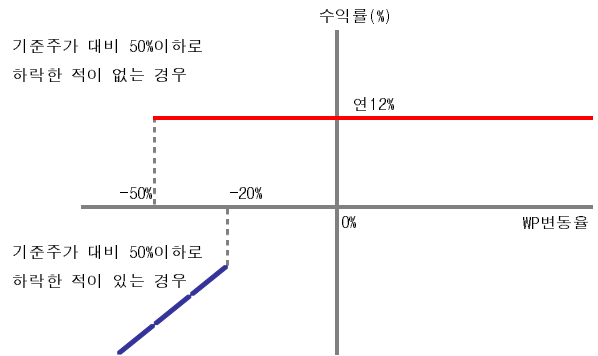
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589315WB3 현대증권(ELS)2009-1123

[79-4]

메리츠2Star증권KISE-2호

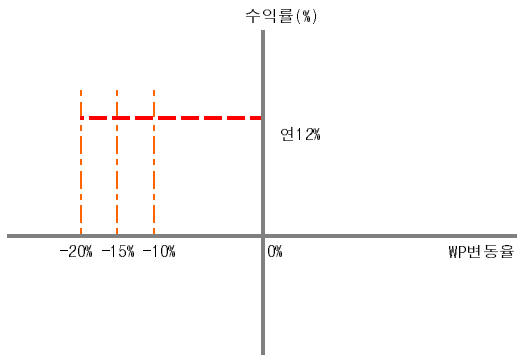
1. 계약금액

단위(백만원)

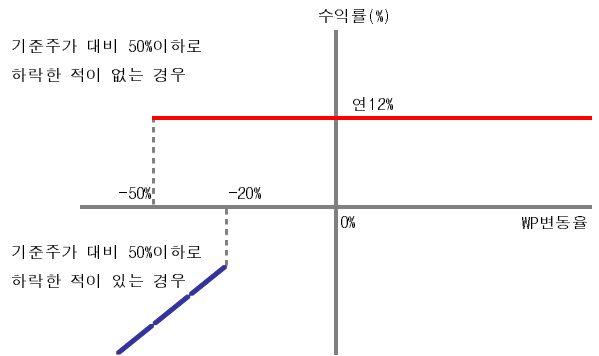
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,053	0	1,053	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669325WB5 동양(ELS)358

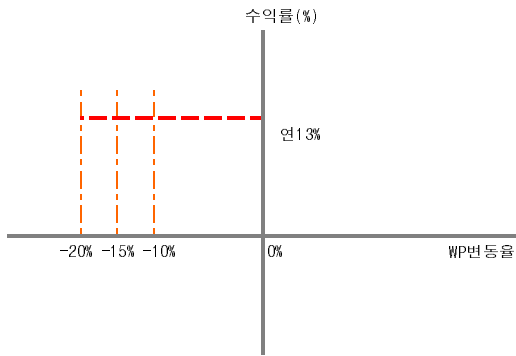
1. 계약금액

단위(백만원)

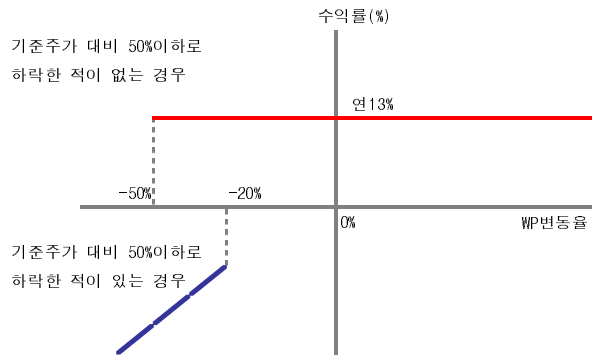
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

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%	11.94	5.21	(1.51)	(8.24)	(14.96)	(21.69)	(28.42)
	5.33%	21.76	15.04	8.31	1.59	(5.14)	(11.86)	(18.59)
	2.67%	24.51	17.79	11.06	4.33	(2.39)	(9.12)	(15.84)
	0.00%	20.18	13.45	6.73	0.00	(6.73)	(13.45)	(20.18)
	-2.67%	8.76	2.04	(4.69)	(11.41)	(18.14)	(24.87)	(31.59)
	-5.33%	(9.73)	(16.46)	(23.18)	(29.91)	(36.63)	(43.36)	(50.09)
	-8.00%	(35.31)	(42.03)	(48.76)	(55.48)	(62.21)	(68.93)	(75.66)

최대손실 시나리오

위험액	-75.66
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	59.88
-----	-------

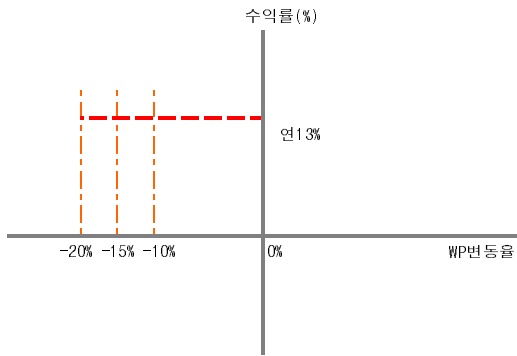
1. 계약금액

단위(백만원)

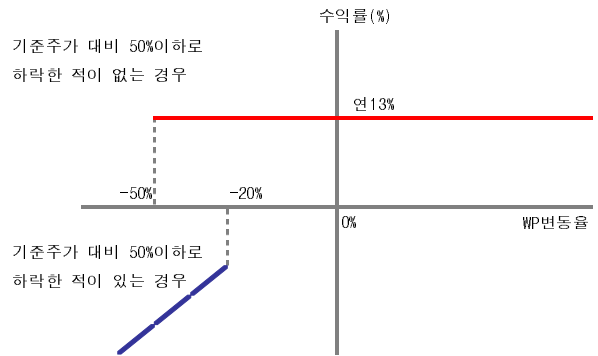
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552375W95 우리투자증권(ELS)2658

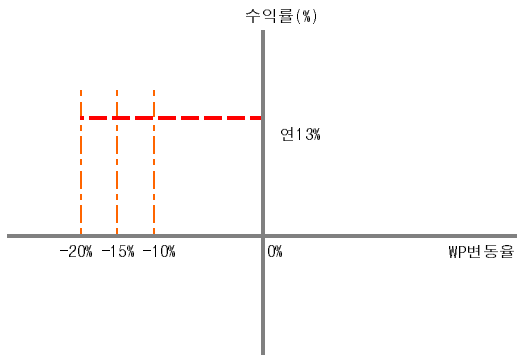
1. 계약금액

단위(백만원)

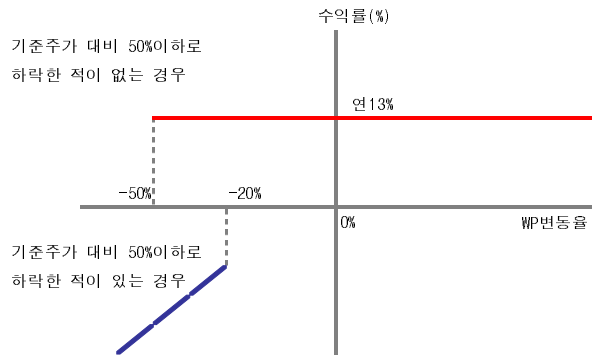
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582137W91 현대증권(ELS)2009-1092

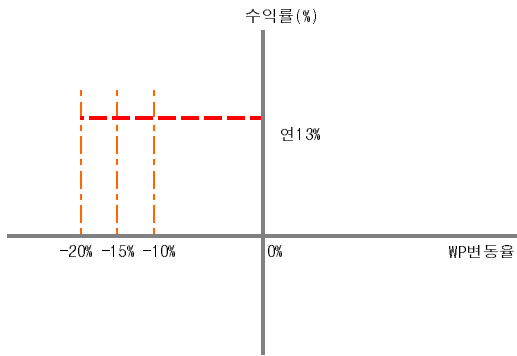
1. 계약금액

단위(백만원)

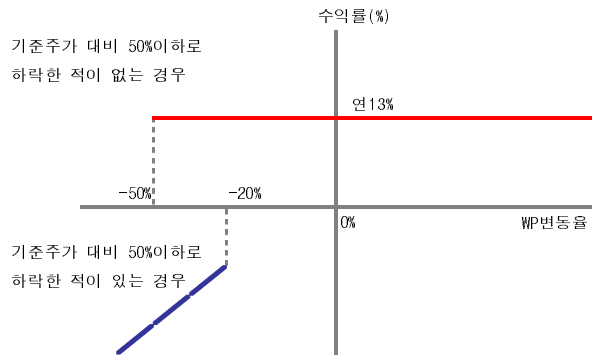
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662339W97 동양(ELS)308

[81-1] 메리츠2Star증권SESH-1호

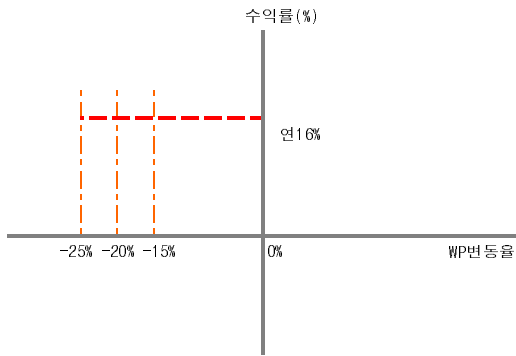
1. 계약금액

단위(백만원)

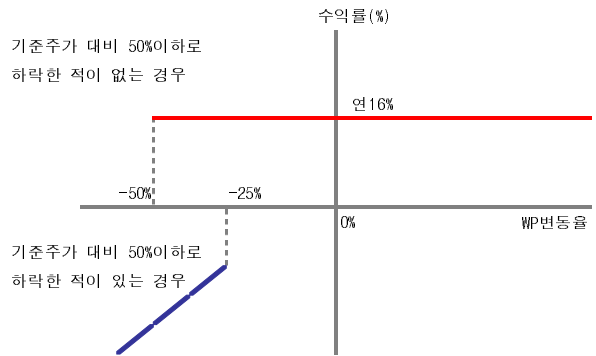
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,484	0	1,484	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502305W95 신한투자(ELS)1144

구분	변동성 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	(31.70)	(31.70)	(31.69)	(31.69)	(31.69)	(31.68)	(31.68)
	5.33%	(14.06)	(14.06)	(14.05)	(14.05)	(14.04)	(14.04)	(14.04)
	2.67%	(3.50)	(3.49)	(3.49)	(3.49)	(3.48)	(3.48)	(3.47)
	0.00%	(0.01)	(0.01)	(0.00)	0.00	0.00	0.01	0.01
	-2.67%	(3.60)	(3.60)	(3.60)	(3.59)	(3.59)	(3.58)	(3.58)
	-5.33%	(14.27)	(14.27)	(14.27)	(14.26)	(14.26)	(14.26)	(14.25)
	-8.00%	(32.02)	(32.02)	(32.02)	(32.01)	(32.01)	(32.00)	(32.00)

최대손실 시나리오

위험액	-32.00
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[81-2]

메리츠2Star증권SESH-1호

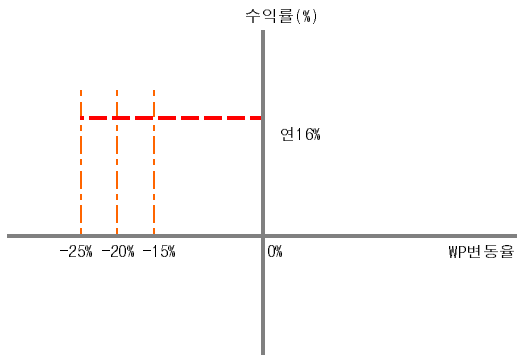
1. 계약금액

단위(백만원)

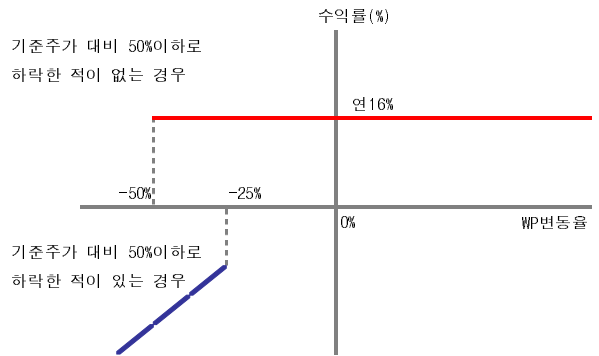
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,485	0	1,485	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552333W96 우리투자증권(ELS)2619



[81-3]

메리츠2Star증권SESH-1호

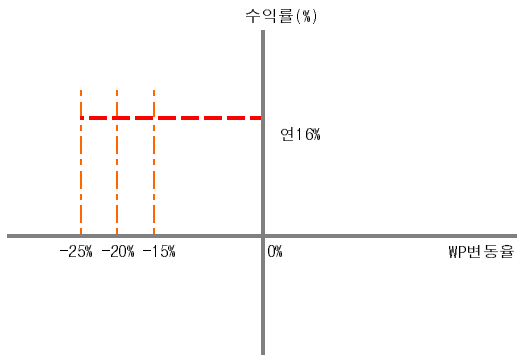
1. 계약금액

단위(백만원)

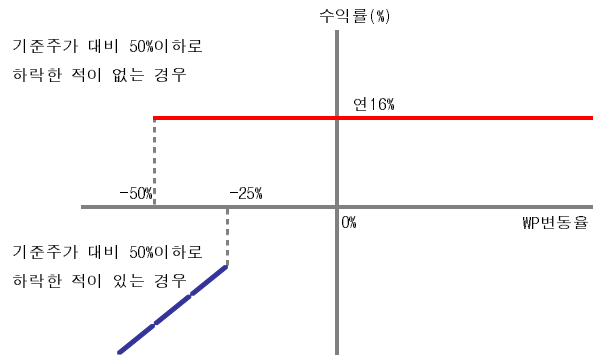
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,483	0	1,483	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572319W92 한국투자증권(ELS)1327

[81-4]

메리츠2Star증권SESH-1호

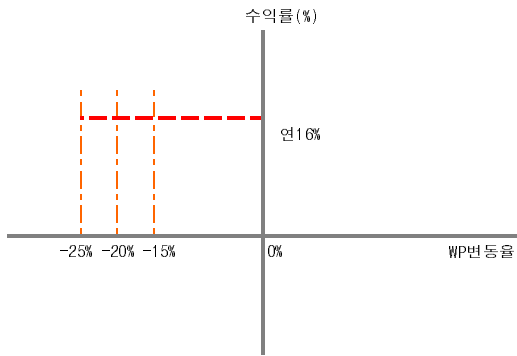
1. 계약금액

단위(백만원)

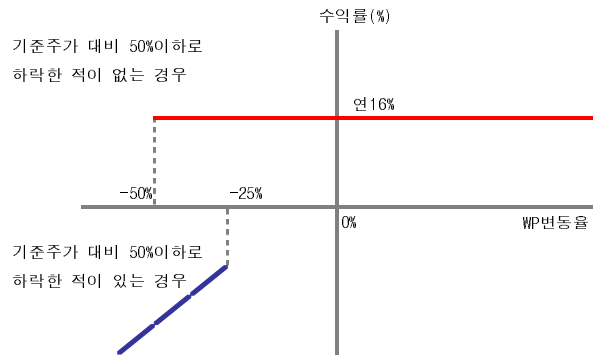
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,484	0	1,484	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6702324W98 H&D증권(ELS)223

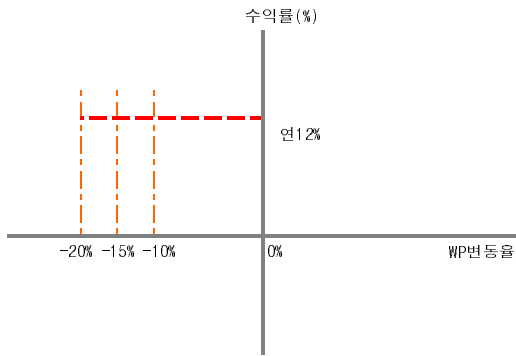
1. 계약금액

단위(백만원)

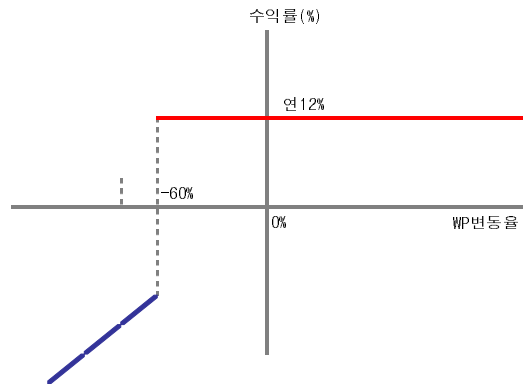
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	18.76	14.52	10.27	6.02	1.77	(2.48)	(6.73)
	5.33%	17.88	13.63	9.38	5.14	0.89	(3.36)	(7.61)
	2.67%	15.88	11.63	7.38	3.13	(1.12)	(5.37)	(9.62)
	0.00%	12.75	8.50	4.25	0.00	(4.25)	(8.50)	(12.75)
	-2.67%	8.49	4.25	(0.00)	(4.25)	(8.50)	(12.75)	(17.00)
	-5.33%	3.12	(1.13)	(5.38)	(9.63)	(13.88)	(18.12)	(22.37)
	-8.00%	(3.38)	(7.63)	(11.88)	(16.12)	(20.37)	(24.62)	(28.87)

최대손실 시나리오

위험액	-28.87
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	46.11
-----	-------

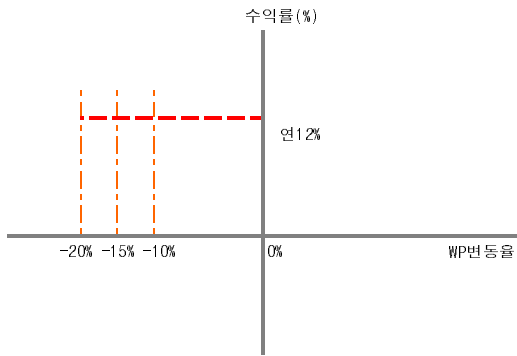
1. 계약금액

단위(백만원)

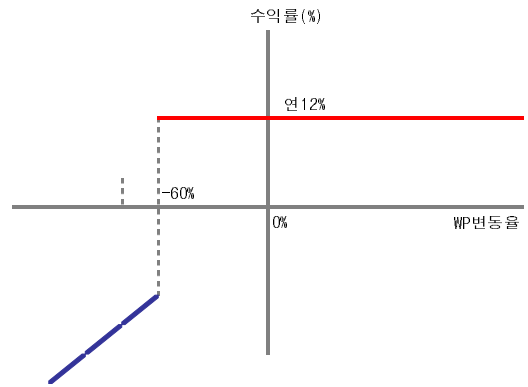
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

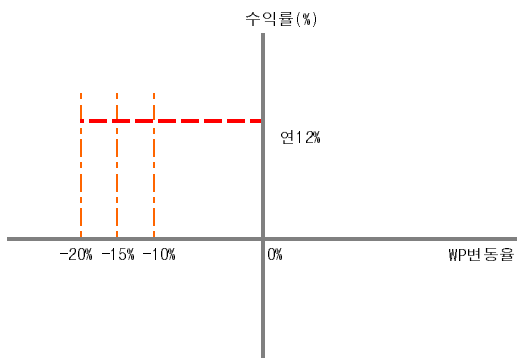
1. 계약금액

단위(백만원)

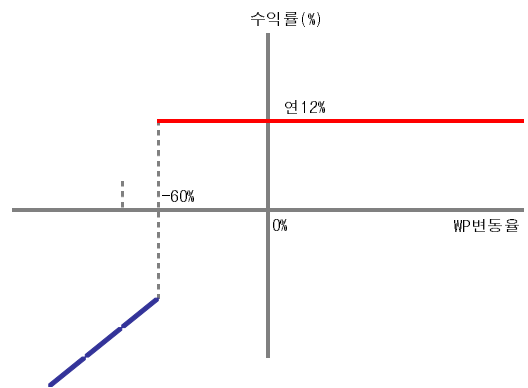
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

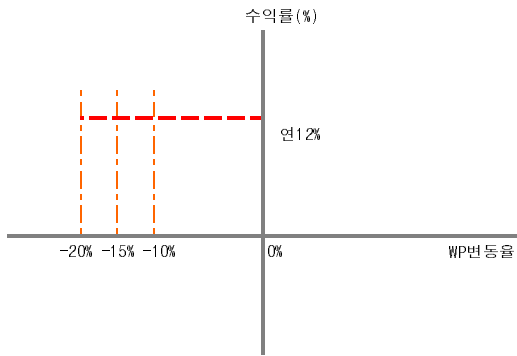
1. 계약금액

단위(백만원)

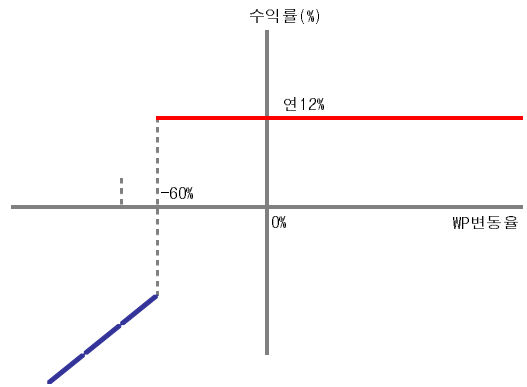
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

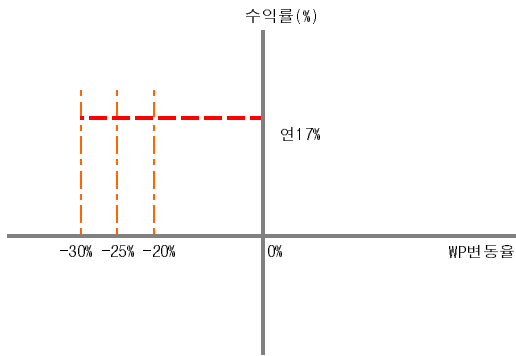
1. 계약금액

단위(백만원)

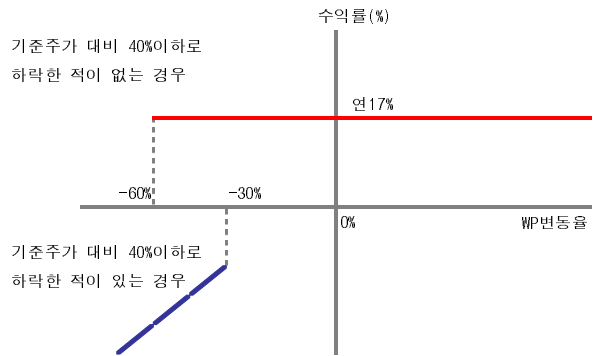
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

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 시나 리오	8.00%	393.42	314.05	234.69	155.32	75.95	(3.42)	(82.78)
	5.33%	349.05	269.68	190.32	110.95	31.58	(47.78)	(127.15)
	2.67%	297.28	217.91	138.54	59.18	(20.19)	(99.56)	(178.92)
	0.00%	238.10	158.73	79.37	0.00	(79.37)	(158.73)	(238.10)
	-2.67%	171.52	92.15	12.78	(66.58)	(145.95)	(225.32)	(304.68)
	-5.33%	97.53	18.16	(61.20)	(140.57)	(219.94)	(299.30)	(378.67)
	-8.00%	16.14	(63.23)	(142.60)	(221.96)	(301.33)	(380.70)	(460.07)

최대 손실 시나리오

위험액	-460.07
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	389.23
-----	--------

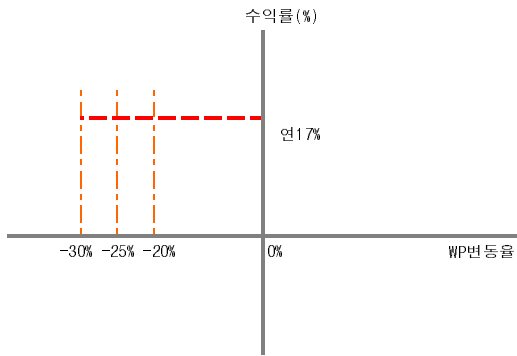
1. 계약금액

단위(백만원)

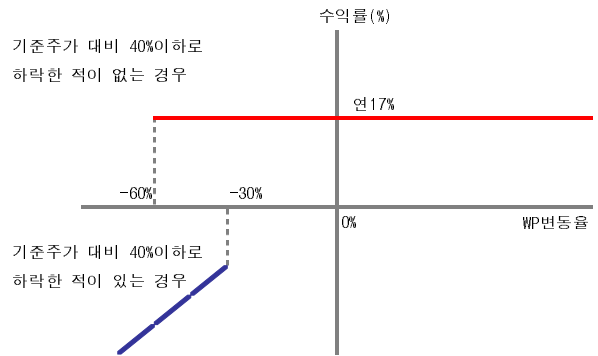
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733



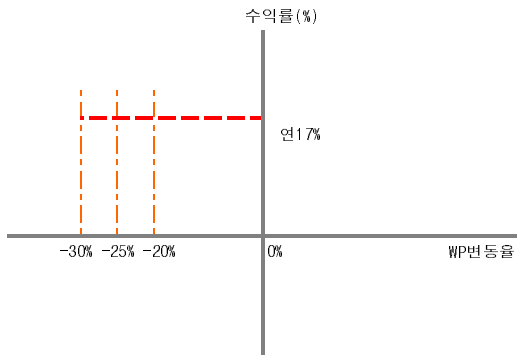
1. 계약금액

단위(백만원)

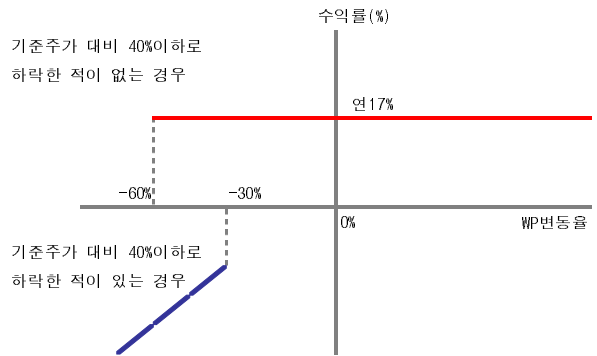
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343

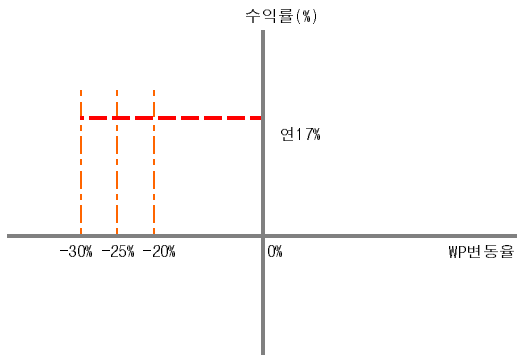
1. 계약금액

단위(백만원)

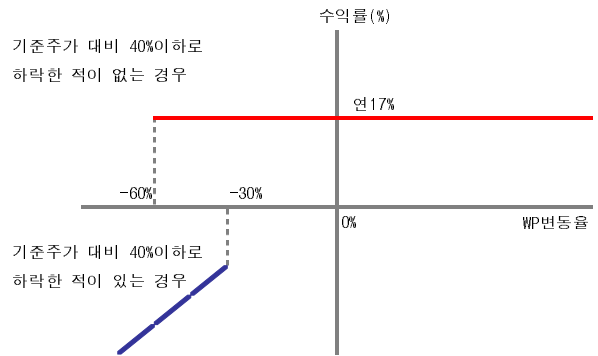
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

[84] 메리츠일종지수연계 사모파생 1호

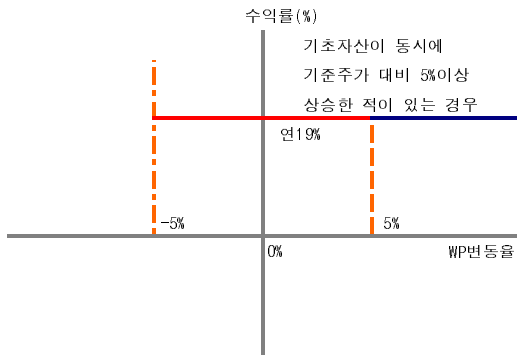
1. 계약금액

단위(백만원)

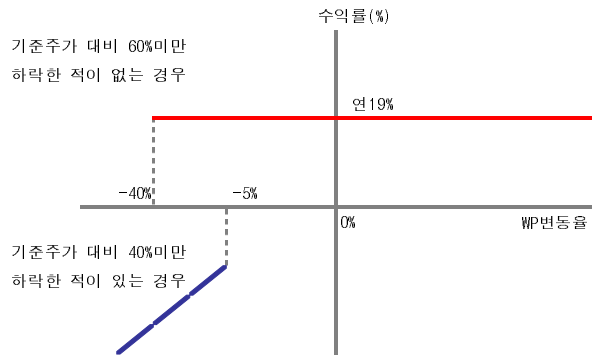
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,268	0	1,268	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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%
	8.00%	141.52	138.86	136.19	133.53	130.86	128.19	125.53
	5.33%	94.75	92.08	89.42	86.75	84.08	81.42	78.75
	2.67%	50.24	47.57	44.91	42.24	39.58	36.91	34.24
	0.00%	8.00	5.33	2.67	0.00	(2.67)	(5.33)	(8.00)
	-2.67%	(31.98)	(34.64)	(37.31)	(39.98)	(42.64)	(45.31)	(47.97)
	-5.33%	(69.69)	(72.35)	(75.02)	(77.69)	(80.35)	(83.02)	(85.68)
	-8.00%	(105.13)	(107.80)	(110.46)	(113.13)	(115.80)	(118.46)	(121.13)

최대 손실 시나리오

위험액	-121.13
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	122.45
-----	--------

[85-1] 메리츠주가지수연계사모6호

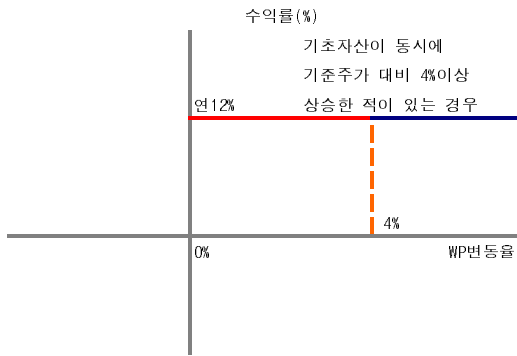
1. 계약금액

단위(백만원)

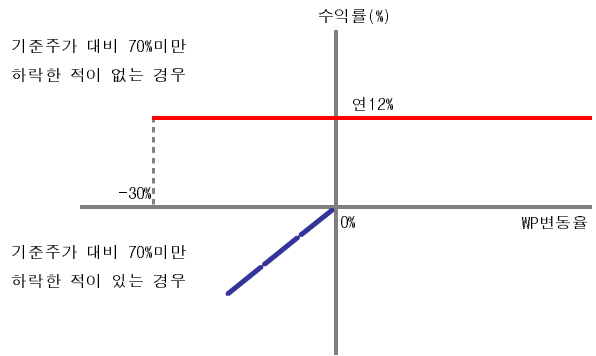
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,278	0	3,278	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(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%	8392.01	8201.34	8010.67	7820.00	7629.33	7438.66	7247.99
	5.33%	5673.18	5482.51	5291.84	5101.17	4910.50	4719.83	4529.16
	2.67%	3066.52	2875.85	2685.18	2494.51	2303.84	2113.17	1922.50
	0.00%	572.01	381.34	190.67	0.00	(190.67)	(381.34)	(572.01)
	-2.67%	(1810.34)	(2001.01)	(2191.67)	(2382.34)	(2573.01)	(2763.68)	(2954.35)
	-5.33%	(4080.52)	(4271.19)	(4461.86)	(4652.53)	(4843.20)	(5033.87)	(5224.54)
	-8.00%	(6238.54)	(6429.21)	(6619.88)	(6810.55)	(7001.22)	(7191.89)	(7382.56)

최대손실 시나리오

위험액	-7,382.56
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7,549.18
-----	----------

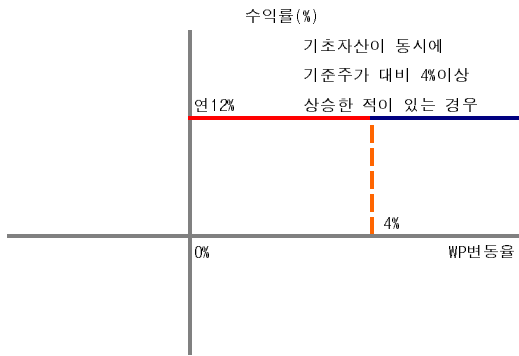
1. 계약금액

단위(백만원)

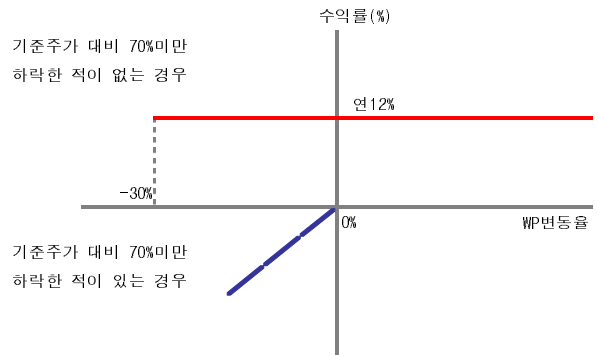
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,480	0	3,480	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6005946TP7 우리투자증권(ELS)1497

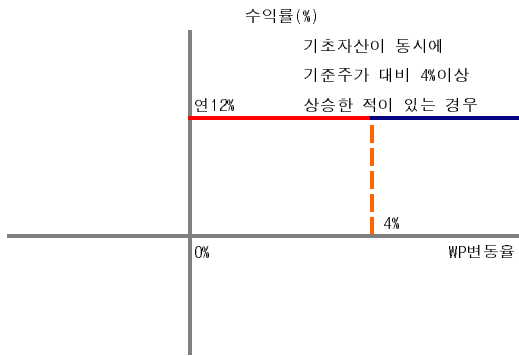
1. 계약금액

단위(백만원)

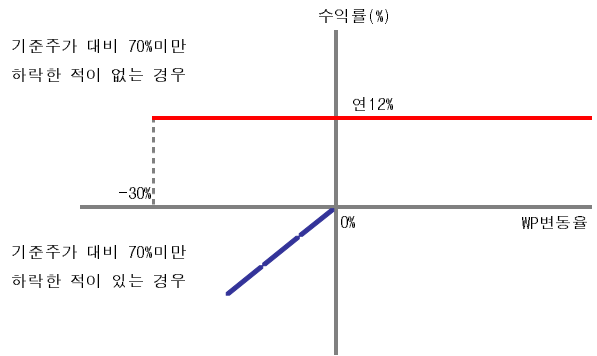
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6,782	0	6,782	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600594LTB9 우리투자증권(ELS)1475

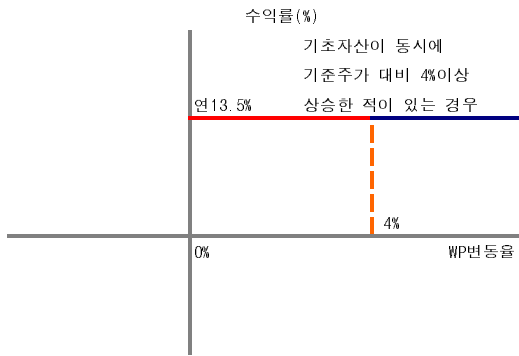
1. 계약금액

단위(백만원)

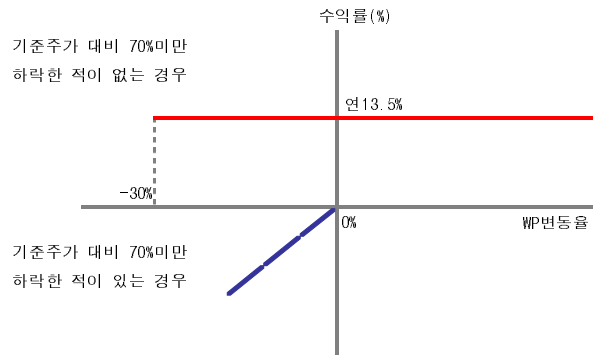
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,485	0	3,485	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600594PTC8 우리투자증권(ELS)1533

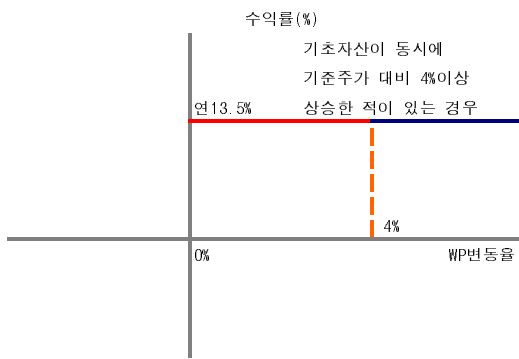
1. 계약금액

단위(백만원)

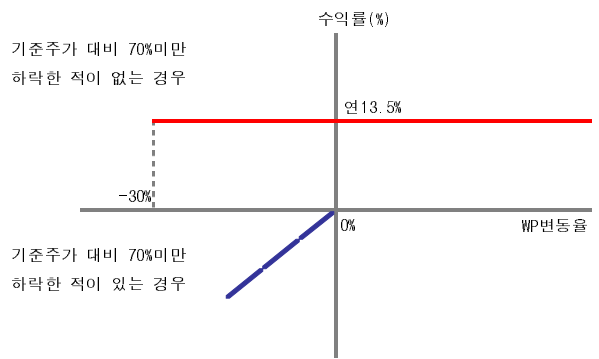
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,514	0	3,514	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600594TTC0 우리투자증권(ELS)1535



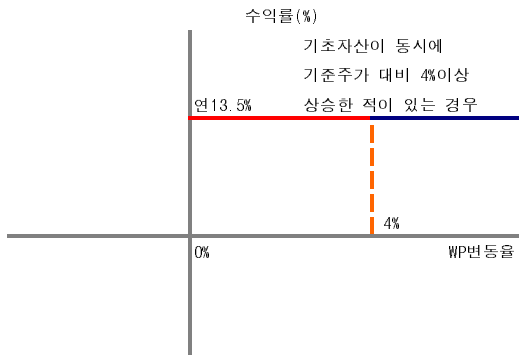
1. 계약금액

단위(백만원)

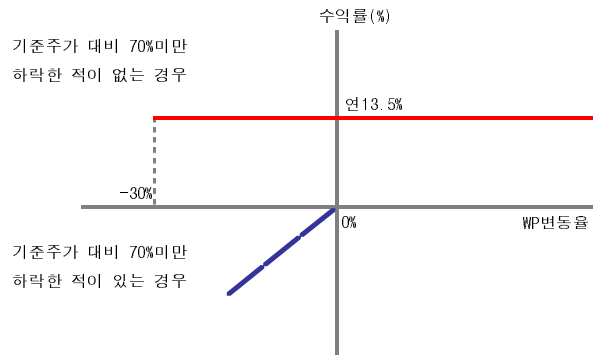
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,056	0	7,056	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6008675TC7 신한투자(ELS)809

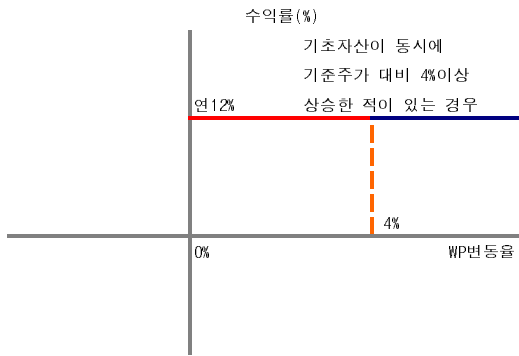
1. 계약금액

단위(백만원)

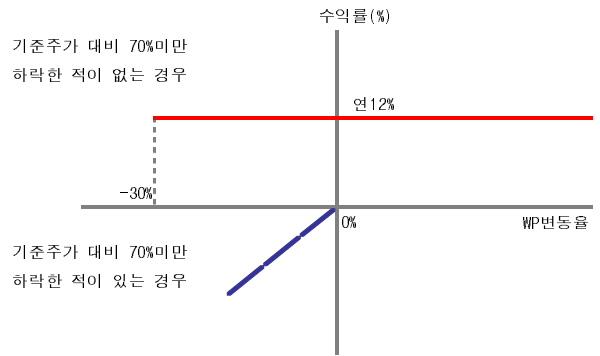
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	6,813	0	6,813	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6008676TB7 신한투자(ELS)797

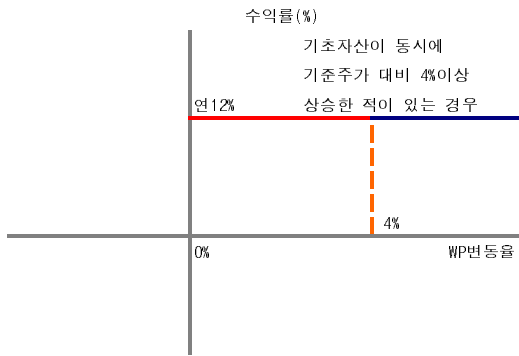
1. 계약금액

단위(백만원)

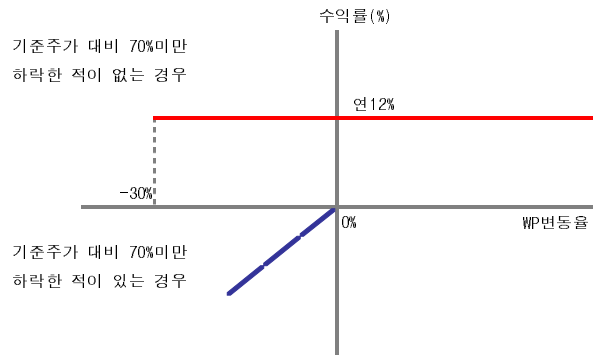
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,288	0	3,288	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6008679TA3 신한투자(ELS)786

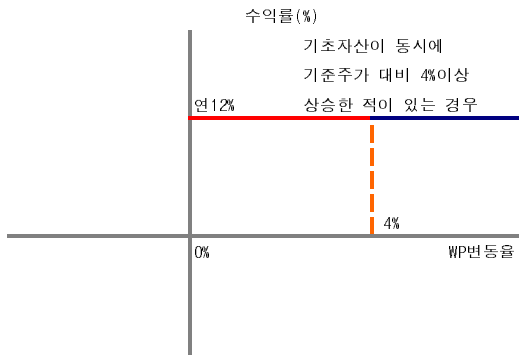
1. 계약금액

단위(백만원)

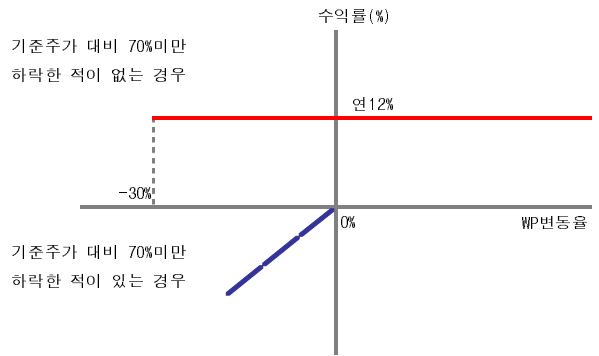
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,495	0	3,495	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR600867CTB8 신한투자(ELS)804

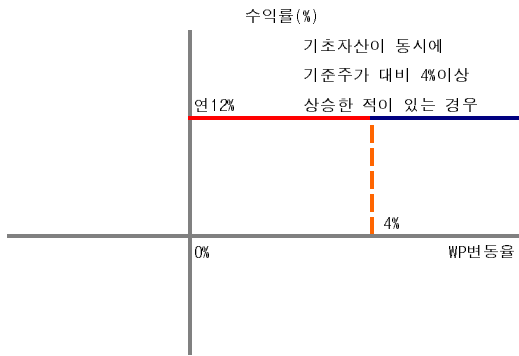
1. 계약금액

단위(백만원)

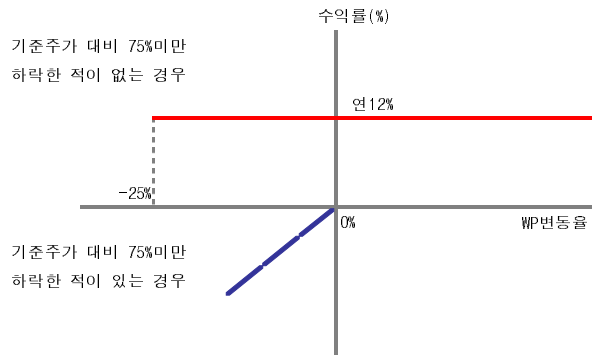
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,385	0	3,385	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6030613TB2 교보증권(ELS)82

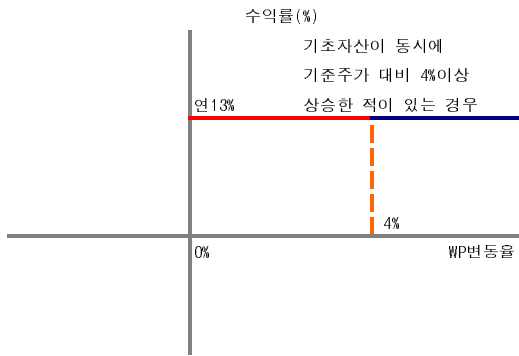
1. 계약금액

단위(백만원)

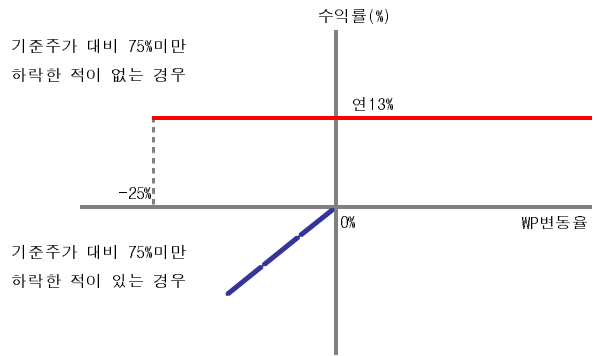
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,013	0	7,013	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6030614TC8 교보증권(ELS)100

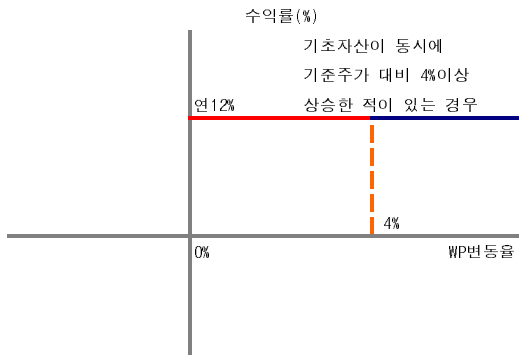
1. 계약금액

단위(백만원)

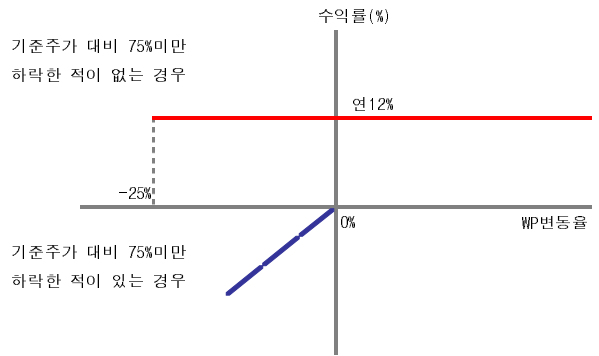
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,485	0	3,485	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR603061ATB9 교보증권(ELS)87

[86] 메리츠주가지수연계사모증권10호

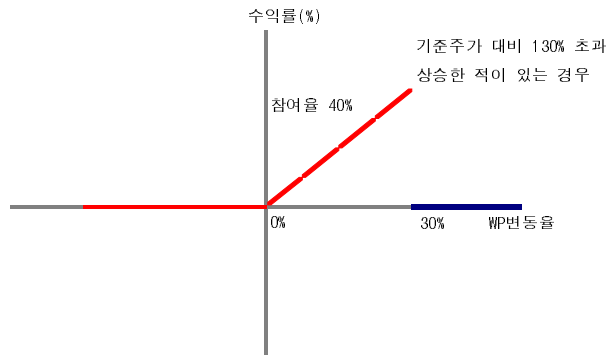
1. 계약금액

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 시나 리오	8.00%	(92.60)	(101.33)	(110.07)	(118.80)	(127.54)	(136.27)	(145.01)
	5.33%	(43.14)	(51.87)	(60.61)	(69.34)	(78.07)	(86.81)	(95.54)
	2.67%	(3.54)	(12.27)	(21.01)	(29.74)	(38.47)	(47.21)	(55.94)
	0.00%	26.20	17.47	8.73	0.00	(8.73)	(17.47)	(26.20)
	-2.67%	46.08	37.35	28.61	19.88	11.14	2.41	(6.32)
	-5.33%	56.10	47.36	38.63	29.90	21.16	12.43	3.69
	-8.00%	56.25	47.52	38.79	30.05	21.32	12.58	3.85

최대손실 시나리오

위험액	3.85
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	72.76
-----	-------



[90] 메리츠주가지수연계사모증권29호

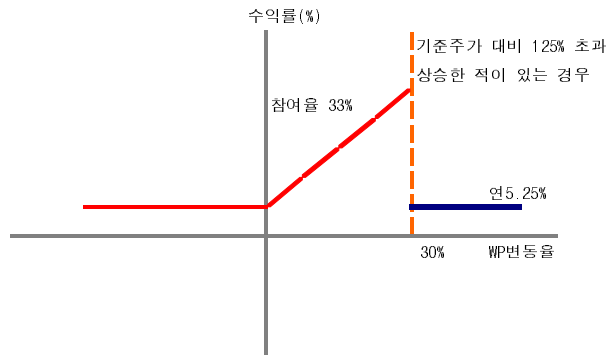
1. 계약금액

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%	(0.24)	(0.62)	(1.01)	(1.40)	(1.78)	(2.17)	(2.56)
	5.33%	0.31	(0.08)	(0.46)	(0.85)	(1.24)	(1.62)	(2.01)
	2.67%	0.78	0.39	0.00	(0.38)	(0.77)	(1.16)	(1.54)
	0.00%	1.16	0.77	0.39	0.00	(0.39)	(0.77)	(1.16)
	-2.67%	1.46	1.08	0.69	0.30	(0.08)	(0.47)	(0.86)
	-5.33%	1.68	1.30	0.91	0.52	0.14	(0.25)	(0.64)
	-8.00%	1.82	1.44	1.05	0.66	0.28	(0.11)	(0.50)

최대손실 시나리오

위험액	-0.50
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	2.30
-----	------

[91-1] 메리츠주가지수연계사모증권2호

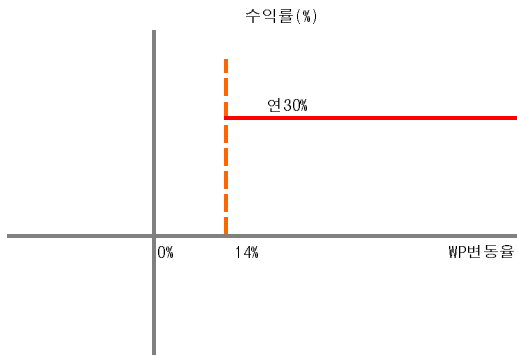
1. 계약금액

단위(백만원)

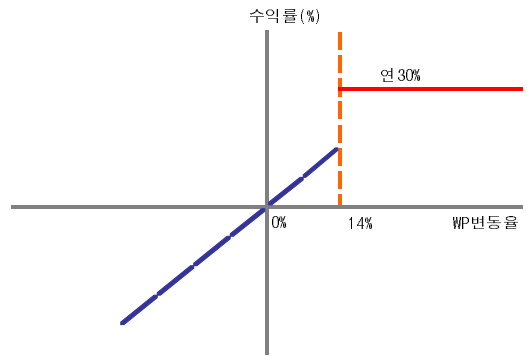
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	4,100	0	4,100	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553351WA2 우리투자증권(ELS)2714

구분	변동성 시나리오							
	8.00%	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	1072.40	983.85	895.31	806.76	718.22	629.68	541.13	
	814.30	725.75	637.21	548.67	460.12	371.58	283.03	
	545.37	456.83	368.29	279.74	191.20	102.66	14.11	
	265.63	177.09	88.54	0.00	(88.54)	(177.09)	(265.63)	
	(24.94)	(113.48)	(202.02)	(290.57)	(379.11)	(467.65)	(556.20)	
	(326.32)	(414.87)	(503.41)	(591.95)	(680.50)	(769.04)	(857.59)	
	(638.53)	(727.08)	(815.62)	(904.17)	(992.71)	(1081.25)	(1169.80)	

최대손실 시나리오

위험액	-1,169.80
-----	-----------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	1,206.63
-----	----------

[91-2]

메리츠주가지수연계사모증권2호

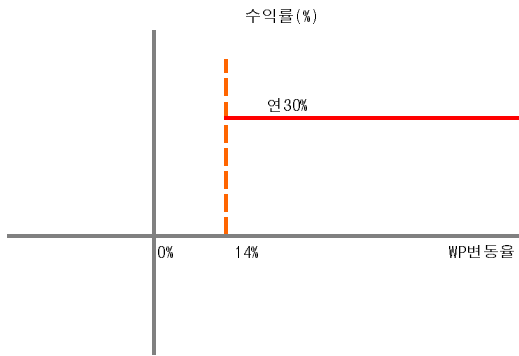
1. 계약금액

단위(백만원)

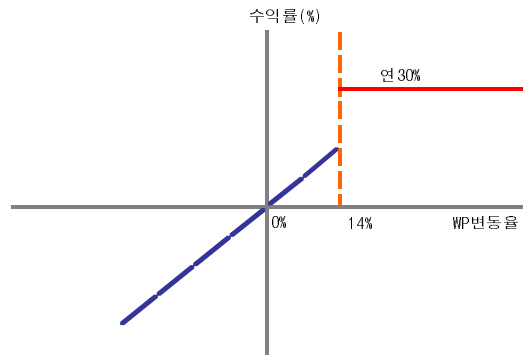
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	7,800	0	7,800	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553378W90 우리투자증권(ELS)2662

[92] 메리츠주가지수연계사모증권31호

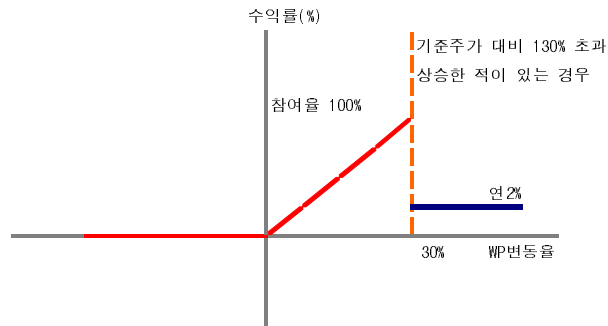
1. 계약금액

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%	6.92	1.99	(2.94)	(7.87)	(12.80)	(17.73)	(22.65)
	5.33%	11.13	6.21	1.28	(3.65)	(8.58)	(13.51)	(18.44)
	2.67%	13.76	8.83	3.90	(1.03)	(5.96)	(10.89)	(15.82)
	0.00%	14.79	9.86	4.93	0.00	(4.93)	(9.86)	(14.79)
	-2.67%	14.23	9.30	4.37	(0.56)	(5.49)	(10.42)	(15.35)
	-5.33%	12.08	7.15	2.22	(2.71)	(7.64)	(12.57)	(17.50)
	-8.00%	8.34	3.41	(1.52)	(6.45)	(11.38)	(16.31)	(21.24)

최대손실 시나리오

위험액	-21.24
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	24.65
-----	-------

[93] 메리츠주가지수연계사모증권5호

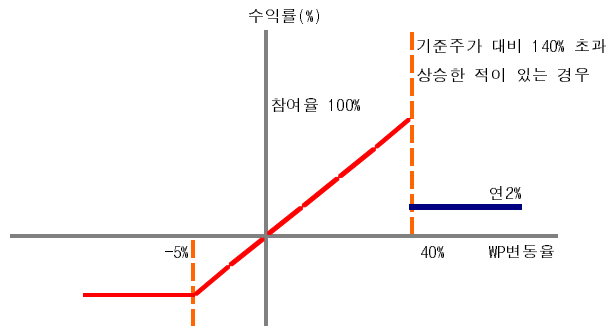
1. 계약금액

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 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
-----	------

[94] 메리츠주가지수연계사모증권제28

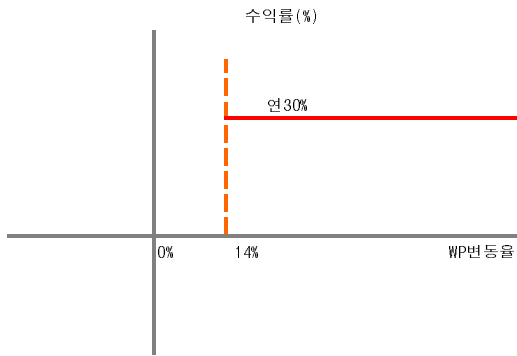
1. 계약금액

단위(백만원)

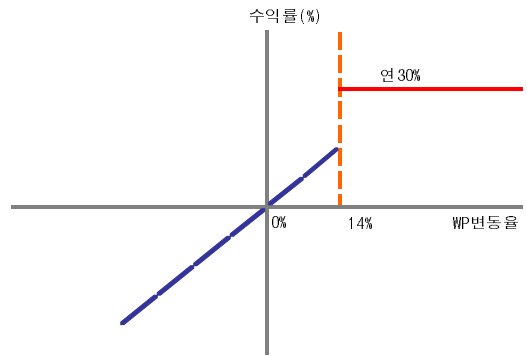
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,945	0	3,945	장익

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%	364.55	336.30	308.06	279.81	251.57	223.32	195.07
	5.33%	273.52	245.28	217.03	188.78	160.54	132.29	104.04
	2.67%	180.25	152.00	123.76	95.51	67.27	39.02	10.77
	0.00%	84.74	56.49	28.25	0.00	(28.25)	(56.49)	(84.74)
	-2.67%	(13.01)	(41.26)	(69.51)	(97.75)	(126.00)	(154.25)	(182.49)
	-5.33%	(113.01)	(141.25)	(169.50)	(197.75)	(225.99)	(254.24)	(282.49)
	-8.00%	(215.24)	(243.49)	(271.74)	(299.98)	(328.23)	(356.47)	(384.72)

최대손실 시나리오

위험액	-384.72
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	393.35
-----	--------

[95] 메리트주가지수연계사모증권제30

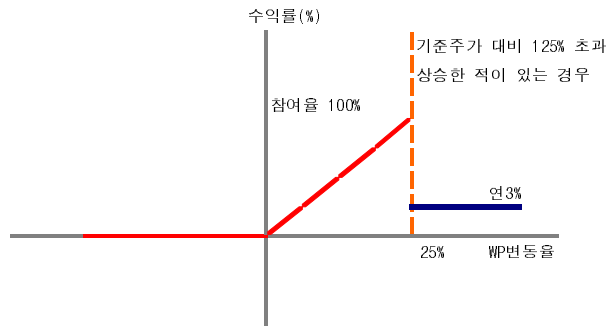
1. 계약금액

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%	3.81	3.09	2.36	1.64	0.91	0.19	(0.53)
	5.33%	3.48	2.76	2.03	1.31	0.59	(0.14)	(0.86)
	2.67%	2.94	2.21	1.49	0.76	0.04	(0.69)	(1.41)
	0.00%	2.17	1.45	0.72	0.00	(0.72)	(1.45)	(2.17)
	-2.67%	1.19	0.47	(0.26)	(0.98)	(1.71)	(2.43)	(3.16)
	-5.33%	(0.01)	(0.73)	(1.46)	(2.18)	(2.91)	(3.63)	(4.35)
	-8.00%	(1.42)	(2.15)	(2.87)	(3.60)	(4.32)	(5.05)	(5.77)

최대손실 시나리오

위험액	-5.77
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	6.37
-----	------

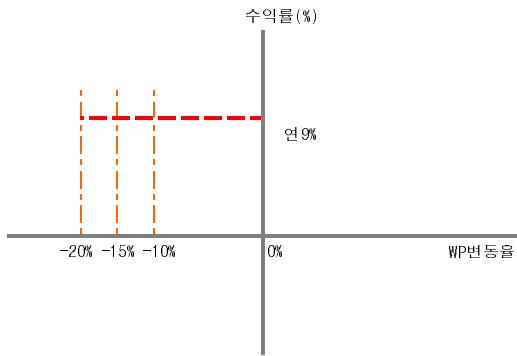
1. 계약금액

단위(백만원)

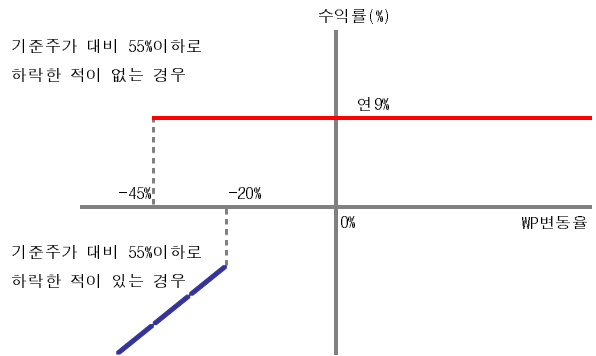
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	685	0	685	장익

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%	1.69	1.67	1.64	1.61	1.59	1.56	1.53
	5.33%	0.44	0.41	0.39	0.36	0.33	0.31	0.28
	2.67%	(0.10)	(0.12)	(0.15)	(0.18)	(0.20)	(0.23)	(0.26)
	0.00%	0.08	0.05	0.03	0.00	(0.03)	(0.05)	(0.08)
	-2.67%	0.97	0.95	0.92	0.89	0.87	0.84	0.81
	-5.33%	2.58	2.55	2.53	2.50	2.47	2.45	2.42
	-8.00%	4.90	4.87	4.85	4.82	4.79	4.77	4.74

최대손실 시나리오

위험액	4.74
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	3.83
-----	------



[97] 메리츠주가지수연계사모증권제33

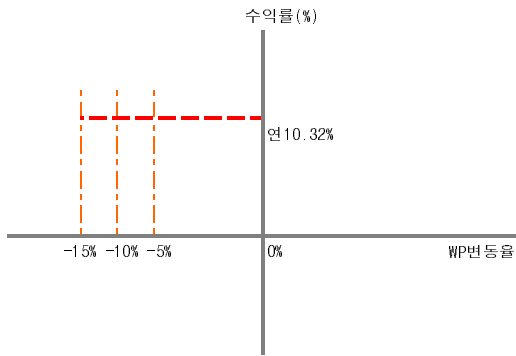
1. 계약금액

단위(백만원)

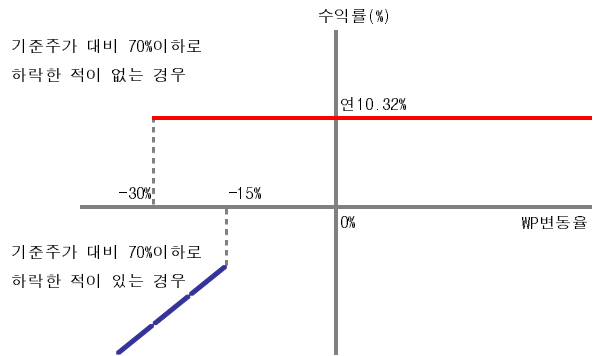
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	507	0	507	장익

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 시나 리오	8.00%	(3.24)	(3.34)	(3.44)	(3.55)	(3.65)	(3.76)	(3.86)
	5.33%	(1.45)	(1.55)	(1.65)	(1.76)	(1.86)	(1.97)	(2.07)
	2.67%	(0.26)	(0.37)	(0.47)	(0.58)	(0.68)	(0.78)	(0.89)
	0.00%	0.31	0.21	0.10	0.00	(0.10)	(0.21)	(0.31)
	-2.67%	0.28	0.18	0.07	(0.03)	(0.13)	(0.24)	(0.34)
	-5.33%	(0.36)	(0.46)	(0.56)	(0.67)	(0.77)	(0.88)	(0.98)
	-8.00%	(1.60)	(1.70)	(1.81)	(1.91)	(2.02)	(2.12)	(2.22)

최대손실 시나리오

위험액	-2.22
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.00
-----	------

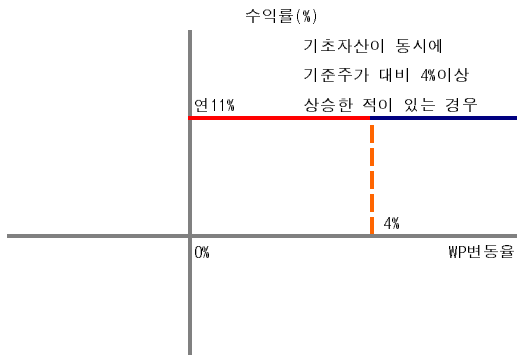
1. 계약금액

단위(백만원)

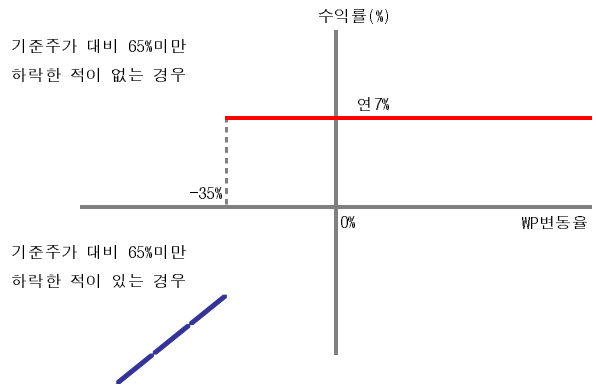
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,263	0	3,263	장익

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%	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
-----	------

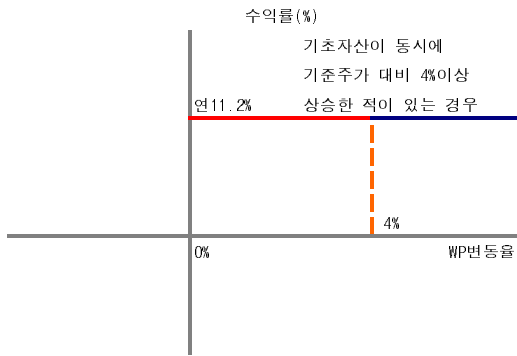
1. 계약금액

단위(백만원)

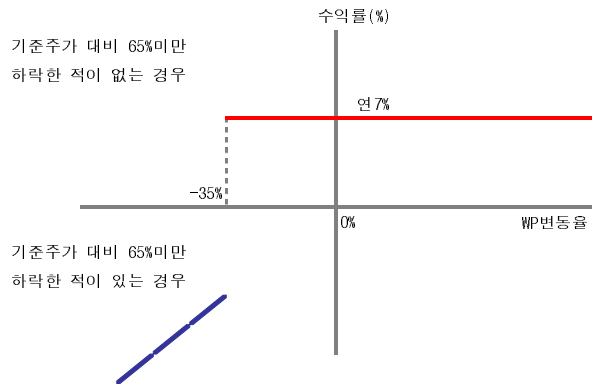
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	234	0	234	장익

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%	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
-----	------

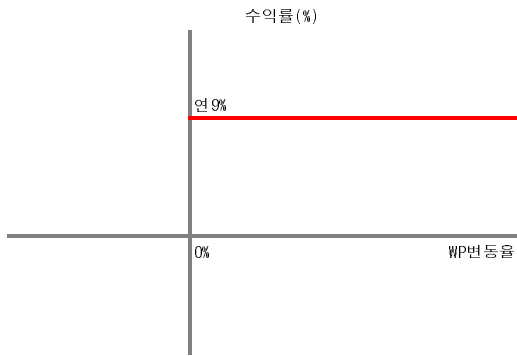
1. 계약금액

단위(백만원)

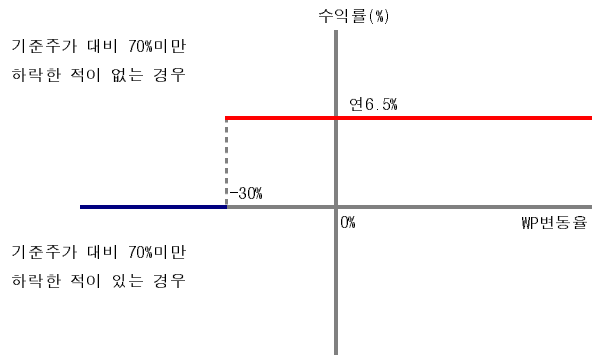
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	850	0	850	장익

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%	29.53	28.38	27.24	26.09	24.95	23.80	22.66
	5.33%	21.82	20.67	19.53	18.38	17.24	16.09	14.95
	2.67%	13.12	11.98	10.83	9.69	8.54	7.39	6.25
	0.00%	3.44	2.29	1.15	0.00	(1.15)	(2.29)	(3.44)
	-2.67%	(7.24)	(8.38)	(9.53)	(10.67)	(11.82)	(12.96)	(14.11)
	-5.33%	(18.90)	(20.04)	(21.19)	(22.33)	(23.48)	(24.62)	(25.77)
	-8.00%	(31.55)	(32.69)	(33.84)	(34.98)	(36.13)	(37.27)	(38.42)

최대손실 시나리오

위험액	-38.42
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	351.81
-----	--------

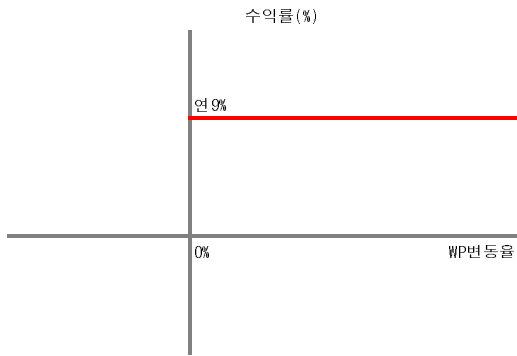
1. 계약금액

단위(백만원)

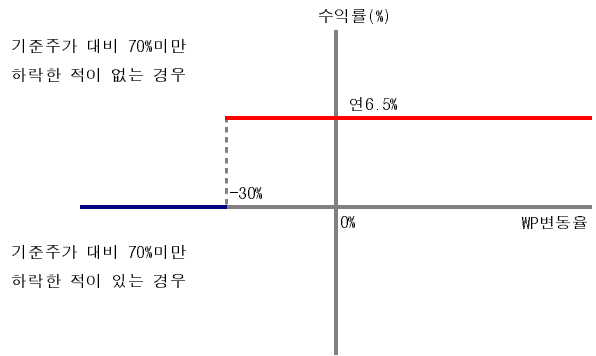
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	794	0	794	장익

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%	27.56	26.49	25.42	24.35	23.28	22.21	21.15
	5.33%	20.36	19.30	18.23	17.16	16.09	15.02	13.95
	2.67%	12.25	11.18	10.11	9.04	7.97	6.90	5.83
	0.00%	3.21	2.14	1.07	0.00	(1.07)	(2.14)	(3.21)
	-2.67%	(6.75)	(7.82)	(8.89)	(9.96)	(11.03)	(12.10)	(13.17)
	-5.33%	(17.64)	(18.71)	(19.78)	(20.84)	(21.91)	(22.98)	(24.05)
	-8.00%	(29.44)	(30.51)	(31.58)	(32.65)	(33.72)	(34.79)	(35.86)

최대손실 시나리오

위험액	-35.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	328.35
-----	--------

[104] 메리츠천연가스연계사모증권1호

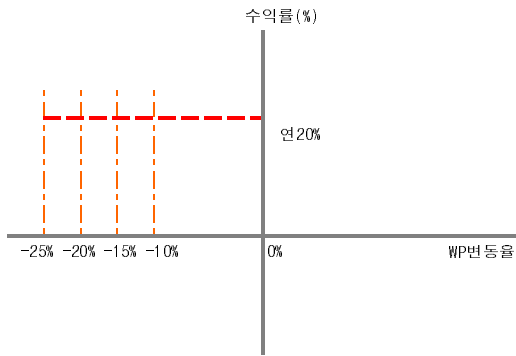
1. 계약금액

단위(백만원)

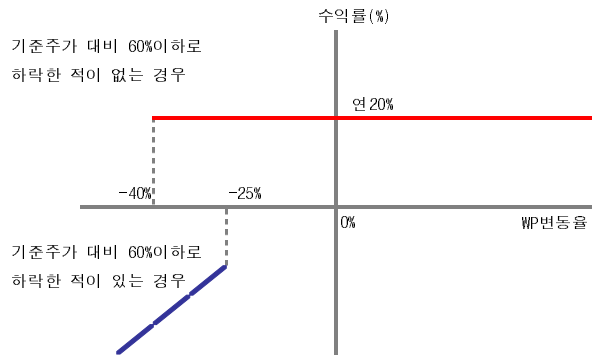
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,503	0	1,503	장익

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 시나 리오	8.00%	66.14	59.67	53.19	46.71	40.23	33.76	27.28
	5.33%	55.84	49.37	42.89	36.41	29.93	23.46	16.98
	2.67%	40.27	33.80	27.32	20.84	14.36	7.89	1.41
	0.00%	19.43	12.95	6.48	0.00	(6.48)	(12.95)	(19.43)
	-2.67%	(6.68)	(13.16)	(19.63)	(26.11)	(32.59)	(39.07)	(45.54)
	-5.33%	(38.06)	(44.54)	(51.01)	(57.49)	(63.97)	(70.45)	(76.92)
	-8.00%	(74.71)	(81.19)	(87.66)	(94.14)	(100.62)	(107.10)	(113.57)

최대손실 시나리오

위험액	-113.57
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	113.06
-----	--------

[105] 메리츠천 연가스연계 사모증권2호

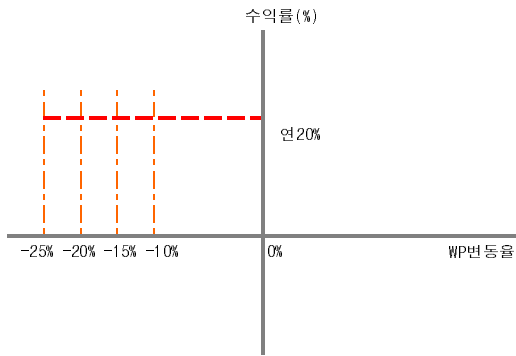
1. 계약금액

단위(백만원)

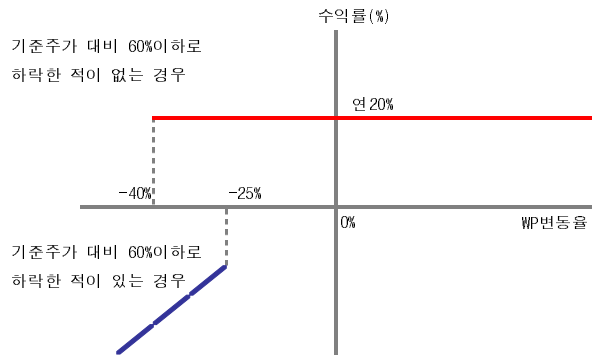
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	979	0	979	장익

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 시나 리오	8.00%	68.28	61.70	55.11	48.52	41.94	35.35	28.76
	5.33%	54.22	47.63	41.04	34.46	27.87	21.28	14.70
	2.67%	38.04	31.46	24.87	18.28	11.70	5.11	(1.48)
	0.00%	19.76	13.17	6.59	0.00	(6.59)	(13.17)	(19.76)
	-2.67%	(0.63)	(7.22)	(13.80)	(20.39)	(26.98)	(33.57)	(40.15)
	-5.33%	(23.13)	(29.72)	(36.31)	(42.89)	(49.48)	(56.07)	(62.65)
	-8.00%	(47.74)	(54.33)	(60.91)	(67.50)	(74.09)	(80.68)	(87.26)

최대손실 시나리오

위험액	-87.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

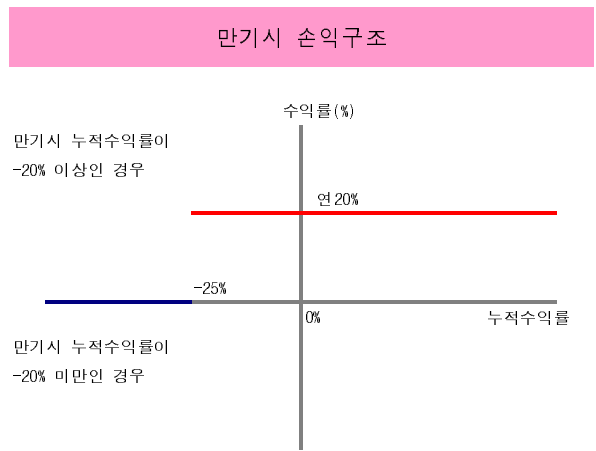
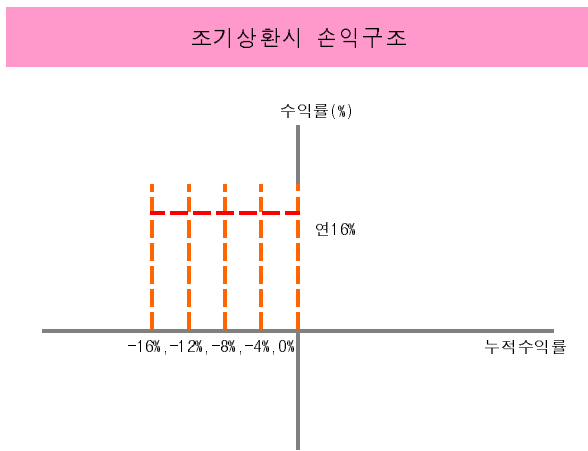
위험액	83.02
-----	-------

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
-----	------



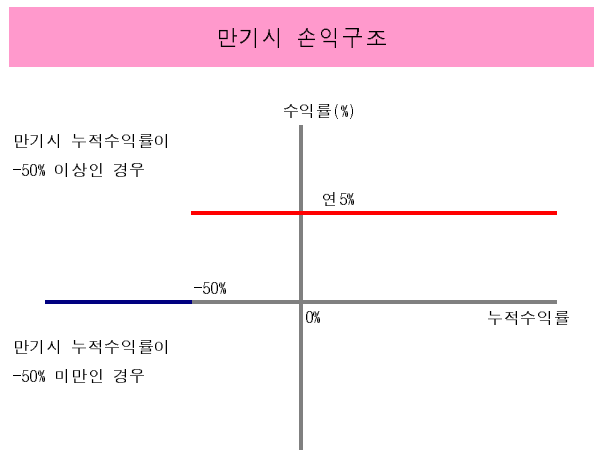
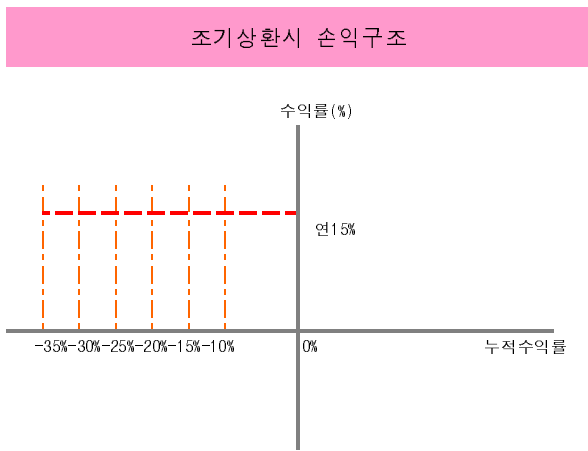
[107] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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(최대손실가능금액(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

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

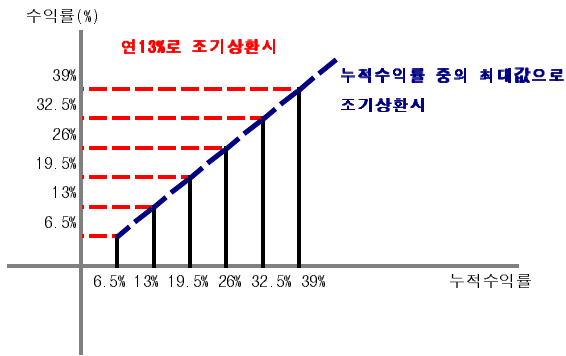
1. 계약금액

단위(백만원)

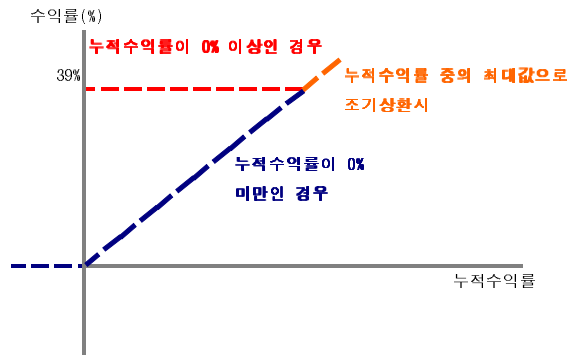
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	5,631	0	5,631	장익

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
	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)

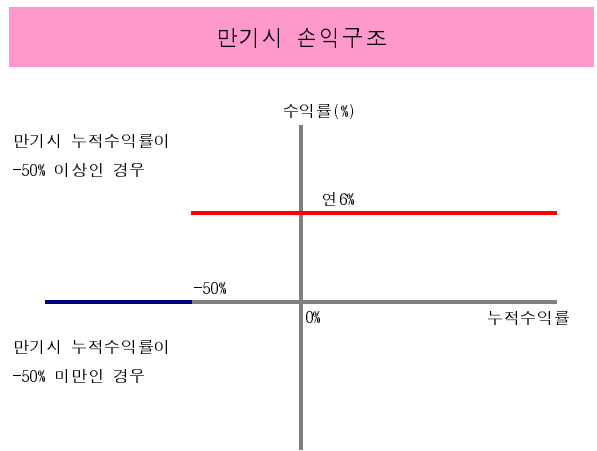
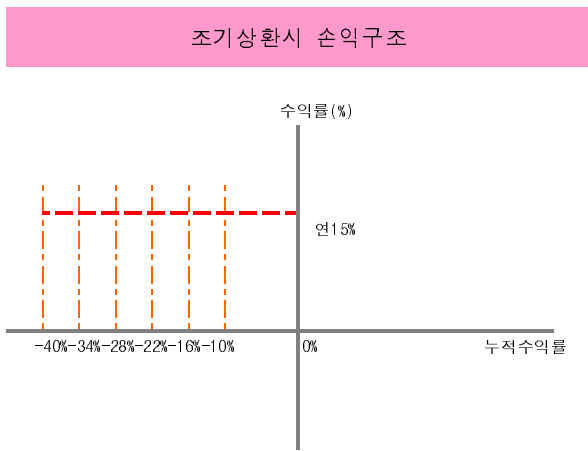
위험액	0.00
-----	------

1. 계약금액

단위(백만원)

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

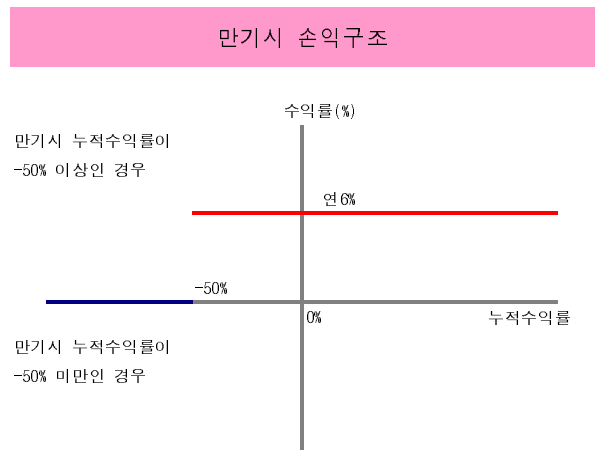
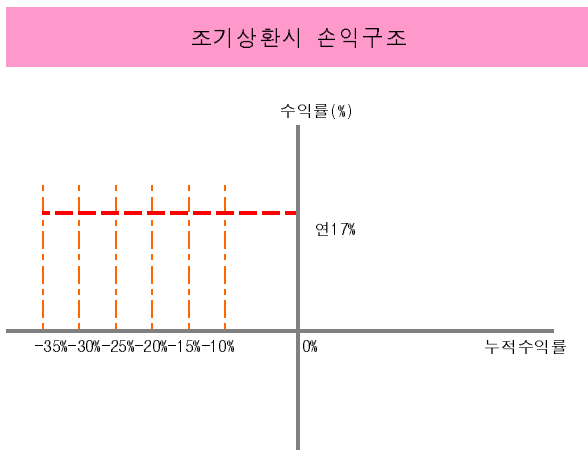
위험액	0.00
-----	------

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 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
-----	------

[116] 메리츠한중지수연계사모증권11호

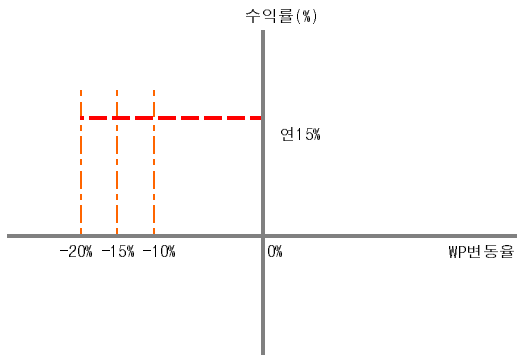
1. 계약금액

단위(백만원)

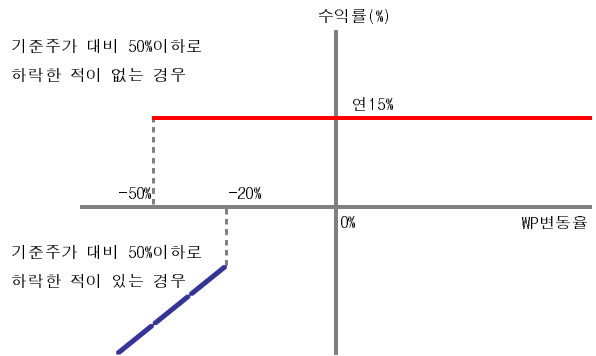
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	956	0	956	장익

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 시나리오	8.00%	16.84	12.18	7.51	2.84	(1.82)	(6.49)	(11.16)
	5.33%	17.83	13.16	8.50	3.83	(0.83)	(5.50)	(10.17)
	2.67%	16.88	12.22	7.55	2.88	(1.78)	(6.45)	(11.12)
	0.00%	14.00	9.33	4.67	0.00	(4.67)	(9.33)	(14.00)
	-2.67%	9.18	4.51	(0.15)	(4.82)	(9.49)	(14.15)	(18.82)
	-5.33%	2.42	(2.24)	(6.91)	(11.57)	(16.24)	(20.91)	(25.57)
	-8.00%	(6.27)	(10.93)	(15.60)	(20.27)	(24.93)	(29.60)	(34.26)

최대손실 시나리오

위험액	-34.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	30.27
-----	-------

[117] 메리츠한중지수연계사모증권12호

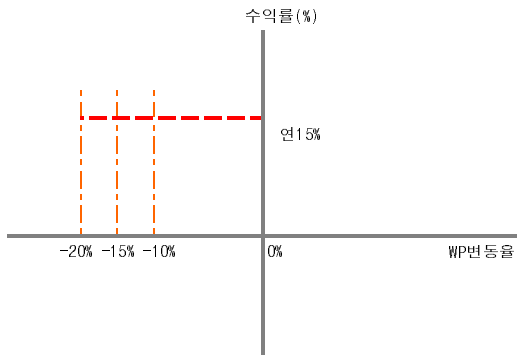
1. 계약금액

단위(백만원)

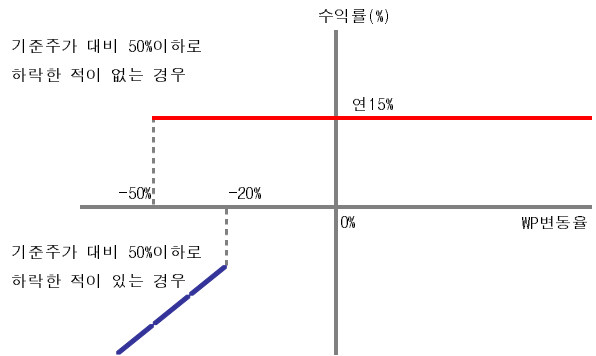
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	454	0	454	장익

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%	8.01	5.79	3.57	1.35	(0.87)	(3.08)	(5.30)
	5.33%	8.48	6.26	4.04	1.82	(0.40)	(2.62)	(4.83)
	2.67%	8.03	5.81	3.59	1.37	(0.85)	(3.07)	(5.28)
	0.00%	6.66	4.44	2.22	0.00	(2.22)	(4.44)	(6.66)
	-2.67%	4.36	2.15	(0.07)	(2.29)	(4.51)	(6.73)	(8.95)
	-5.33%	1.15	(1.07)	(3.28)	(5.50)	(7.72)	(9.94)	(12.16)
	-8.00%	(2.98)	(5.20)	(7.42)	(9.63)	(11.85)	(14.07)	(16.29)

최대손실 시나리오

위험액	-16.29
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.39
-----	-------

[118] 메리츠한중지수연계사모증권17호

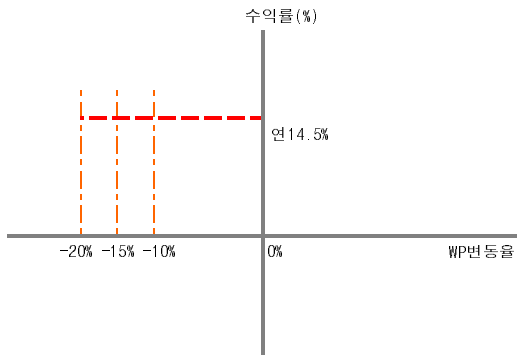
1. 계약금액

단위(백만원)

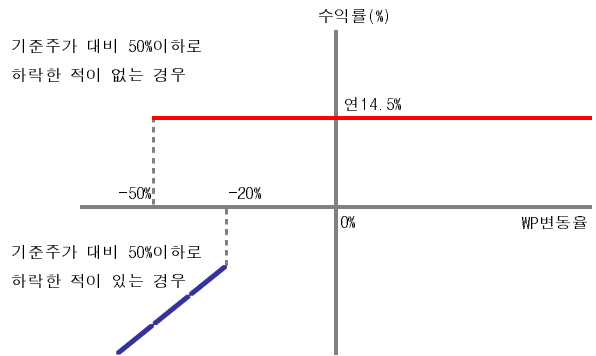
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,135	0	1,135	장익

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 시나 리오	8.00%	51.83	41.58	31.33	21.08	10.82	0.57	(9.68)
	5.33%	47.26	37.00	26.75	16.50	6.25	(4.01)	(14.26)
	2.67%	40.23	29.98	19.73	9.47	(0.78)	(11.03)	(21.29)
	0.00%	30.76	20.51	10.25	0.00	(10.25)	(20.51)	(30.76)
	-2.67%	18.84	8.58	(1.67)	(11.92)	(22.17)	(32.43)	(42.68)
	-5.33%	4.47	(5.78)	(16.04)	(26.29)	(36.54)	(46.80)	(57.05)
	-8.00%	(12.35)	(22.60)	(32.85)	(43.11)	(53.36)	(63.61)	(73.87)

최대손실 시나리오

위험액	-73.87
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	69.79
-----	-------

[119]

메리츠한중지수연계사모증권18호

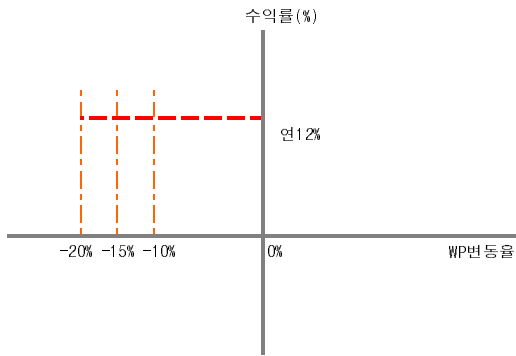
1. 계약금액

단위(백만원)

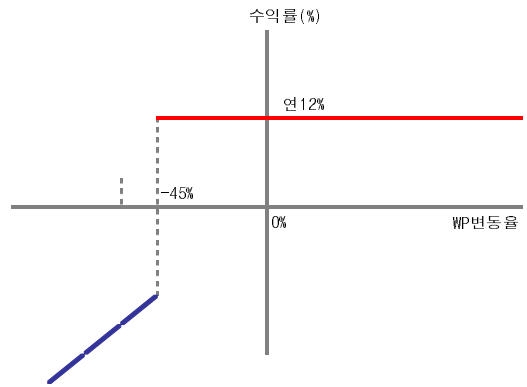
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	297	0	297	장익

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%	10.22	7.79	5.36	2.93	0.50	(1.93)	(4.35)
	5.33%	9.69	7.27	4.84	2.41	(0.02)	(2.45)	(4.88)
	2.67%	8.72	6.29	3.86	1.43	(1.00)	(3.43)	(5.85)
	0.00%	7.29	4.86	2.43	0.00	(2.43)	(4.86)	(7.29)
	-2.67%	5.40	2.97	0.54	(1.88)	(4.31)	(6.74)	(9.17)
	-5.33%	3.06	0.63	(1.80)	(4.22)	(6.65)	(9.08)	(11.51)
	-8.00%	0.27	(2.16)	(4.59)	(7.02)	(9.44)	(11.87)	(14.30)

최대손실 시나리오

위험액	-14.30
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	13.36
-----	-------



[120]

메리츠한중지수연계사모증권20호

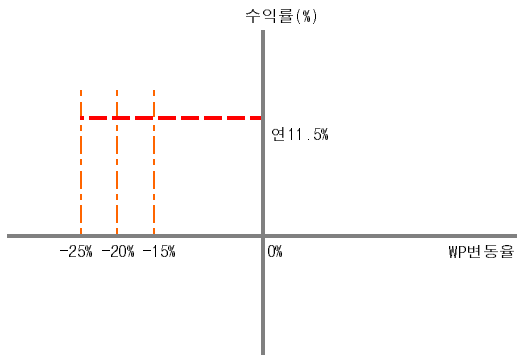
1. 계약금액

단위(백만원)

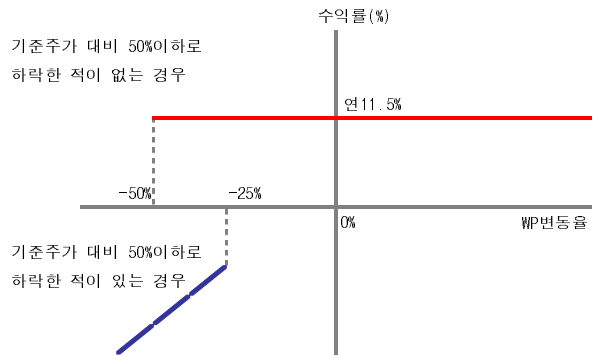
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	41	0	41	장익

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%	0.88	0.73	0.57	0.42	0.26	0.11	(0.05)
	5.33%	0.82	0.66	0.51	0.35	0.20	0.04	(0.11)
	2.67%	0.68	0.52	0.37	0.21	0.06	(0.10)	(0.25)
	0.00%	0.46	0.31	0.15	0.00	(0.15)	(0.31)	(0.46)
	-2.67%	0.18	0.03	(0.13)	(0.28)	(0.44)	(0.59)	(0.75)
	-5.33%	(0.17)	(0.33)	(0.48)	(0.64)	(0.79)	(0.95)	(1.10)
	-8.00%	(0.59)	(0.75)	(0.90)	(1.06)	(1.21)	(1.37)	(1.52)

최대손실 시나리오

위험액	-1.52
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	1.44
-----	------

[121]

메리츠한중지수연계사모증권제13

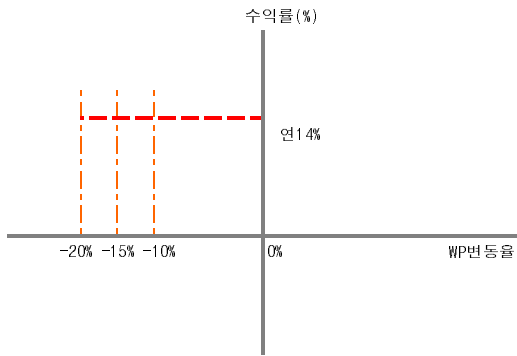
1. 계약금액

단위(백만원)

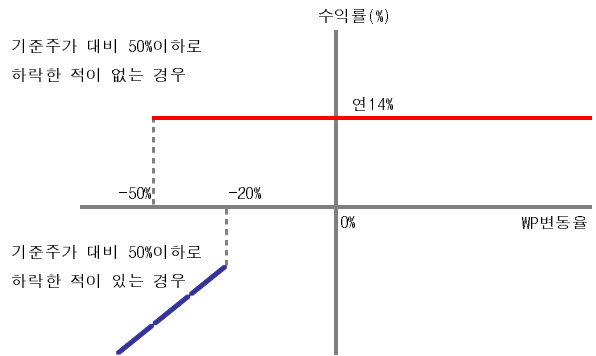
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,517	0	1,517	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6523360WA0 대우증권(ELS)3320

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	41.97	32.76	23.55	14.34	5.13	(4.07)	(13.28)
	5.33%	40.32	31.11	21.90	12.70	3.49	(5.72)	(14.93)
	2.67%	35.54	26.33	17.12	7.92	(1.29)	(10.50)	(19.71)
	0.00%	27.62	18.42	9.21	0.00	(9.21)	(18.42)	(27.62)
	-2.67%	16.57	7.37	(1.84)	(11.05)	(20.26)	(29.47)	(38.67)
	-5.33%	2.39	(6.82)	(16.02)	(25.23)	(34.44)	(43.65)	(52.86)
	-8.00%	(14.93)	(24.13)	(33.34)	(42.55)	(51.76)	(60.97)	(70.17)

최대손실 시나리오

위험액	-70.17
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	67.72
-----	-------

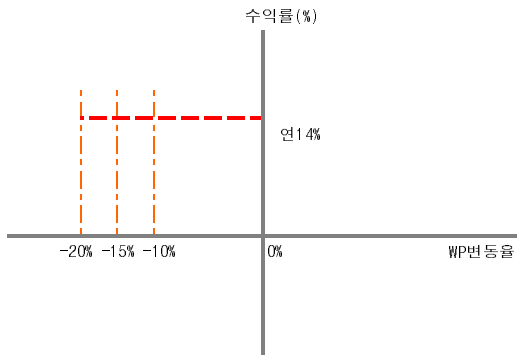
1. 계약금액

단위(백만원)

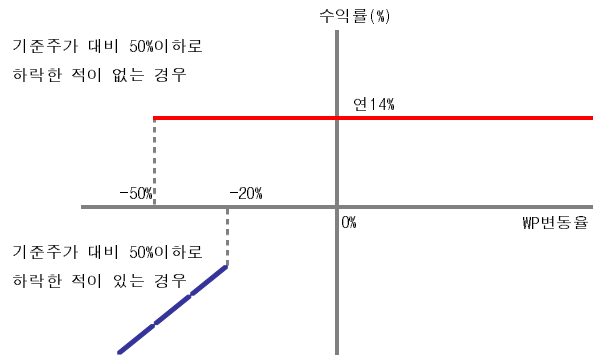
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	215	0	215	장익

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%	5.95	4.65	3.34	2.04	0.73	(0.58)	(1.88)
	5.33%	5.72	4.41	3.11	1.80	0.49	(0.81)	(2.12)
	2.67%	5.04	3.74	2.43	1.12	(0.18)	(1.49)	(2.80)
	0.00%	3.92	2.61	1.31	0.00	(1.31)	(2.61)	(3.92)
	-2.67%	2.35	1.05	(0.26)	(1.57)	(2.87)	(4.18)	(5.49)
	-5.33%	0.34	(0.97)	(2.27)	(3.58)	(4.89)	(6.19)	(7.50)
	-8.00%	(2.12)	(3.42)	(4.73)	(6.04)	(7.34)	(8.65)	(9.96)

최대손실 시나리오

위험액	-9.96
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	9.61
-----	------

[123]

메리츠한중지수연계사모증권제15

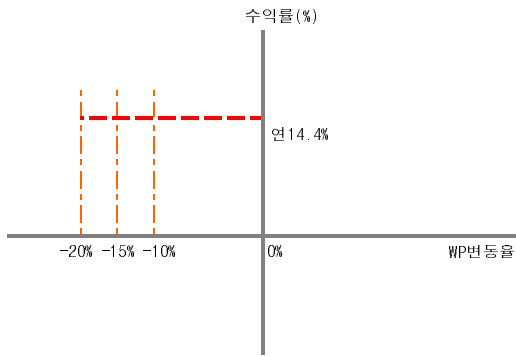
1. 계약금액

단위(백만원)

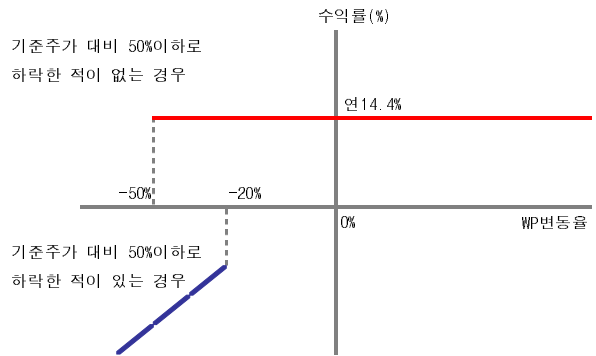
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	598	0	598	장익

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%	18.38	14.40	10.41	6.43	2.45	(1.53)	(5.52)
	5.33%	17.42	13.43	9.45	5.47	1.49	(2.50)	(6.48)
	2.67%	15.27	11.29	7.31	3.32	(0.66)	(4.64)	(8.62)
	0.00%	11.95	7.97	3.98	0.00	(3.98)	(7.97)	(11.95)
	-2.67%	7.44	3.46	(0.52)	(4.51)	(8.49)	(12.47)	(16.45)
	-5.33%	1.76	(2.23)	(6.21)	(10.19)	(14.17)	(18.16)	(22.14)
	-8.00%	(5.11)	(9.09)	(13.07)	(17.06)	(21.04)	(25.02)	(29.00)

최대손실 시나리오

위험액	-29.00
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	25.40
-----	-------

[124]

메리츠한중지수연계사모증권제16

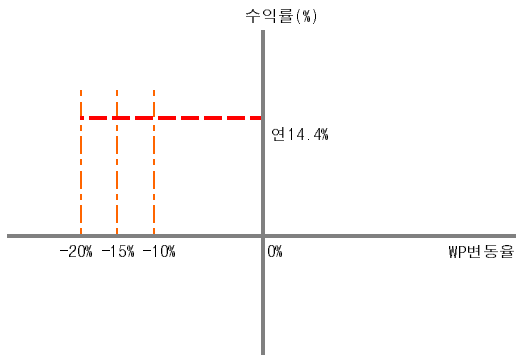
1. 계약금액

단위(백만원)

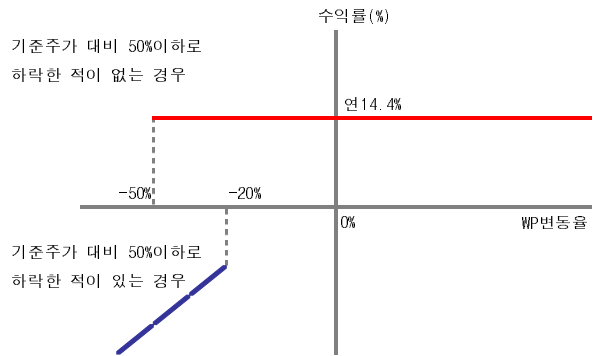
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	520	0	520	장익

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 시나리오	8.00%	15.98	12.52	9.06	5.59	2.13	(1.33)	(4.80)
	5.33%	15.15	11.68	8.22	4.76	1.29	(2.17)	(5.64)
	2.67%	13.28	9.82	6.35	2.89	(0.57)	(4.04)	(7.50)
	0.00%	10.39	6.93	3.46	0.00	(3.46)	(6.93)	(10.39)
	-2.67%	6.47	3.01	(0.45)	(3.92)	(7.38)	(10.85)	(14.31)
	-5.33%	1.53	(1.94)	(5.40)	(8.86)	(12.33)	(15.79)	(19.25)
	-8.00%	(4.44)	(7.91)	(11.37)	(14.83)	(18.30)	(21.76)	(25.22)

최대손실 시나리오

위험액	-25.22
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22.09
-----	-------

[125]

메리츠한중지수연계사모증권제19

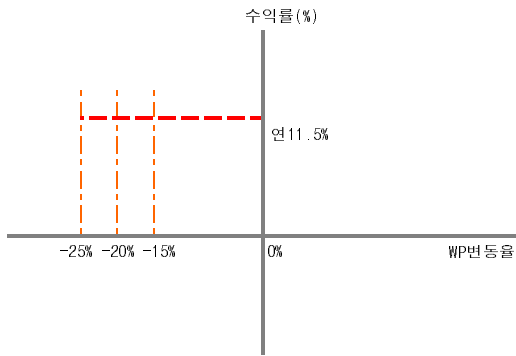
1. 계약금액

단위(백만원)

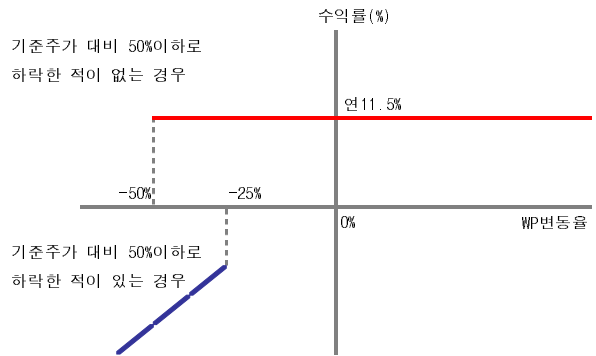
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,212	0	1,212	장익

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%	26.12	21.54	16.97	12.40	7.82	3.25	(1.33)
	5.33%	24.08	19.51	14.94	10.36	5.79	1.21	(3.36)
	2.67%	19.95	15.38	10.80	6.23	1.65	(2.92)	(7.50)
	0.00%	13.72	9.15	4.57	0.00	(4.57)	(9.15)	(13.72)
	-2.67%	5.40	0.82	(3.75)	(8.33)	(12.90)	(17.48)	(22.05)
	-5.33%	(5.03)	(9.60)	(14.18)	(18.75)	(23.32)	(27.90)	(32.47)
	-8.00%	(17.55)	(22.12)	(26.70)	(31.27)	(35.85)	(40.42)	(44.99)

최대손실 시나리오

위험액	-44.99
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	42.51
-----	-------

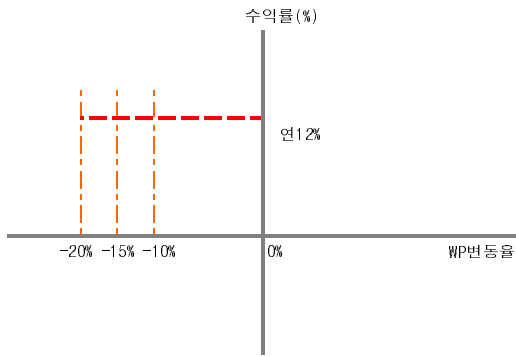
1. 계약금액

단위(백만원)

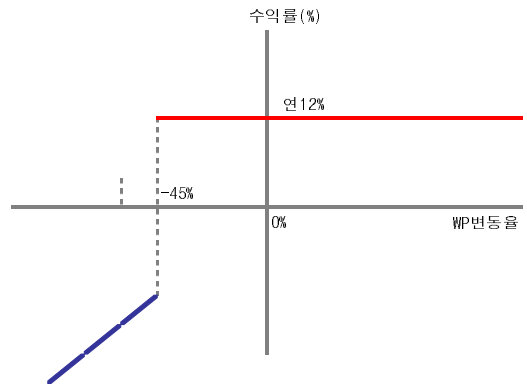
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	199	0	199	장익

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%	7.32	5.59	3.87	2.15	0.43	(1.29)	(3.01)
	5.33%	6.92	5.20	3.48	1.76	0.04	(1.68)	(3.40)
	2.67%	6.20	4.48	2.76	1.04	(0.68)	(2.40)	(4.12)
	0.00%	5.16	3.44	1.72	0.00	(1.72)	(3.44)	(5.16)
	-2.67%	3.80	2.08	0.36	(1.36)	(3.08)	(4.80)	(6.53)
	-5.33%	2.11	0.39	(1.33)	(3.05)	(4.77)	(6.49)	(8.21)
	-8.00%	0.10	(1.62)	(3.34)	(5.06)	(6.78)	(8.50)	(10.22)

최대손실 시나리오

위험액	-10.22
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.48
-----	------

[127] 메리트한중지수연계사모증권제22

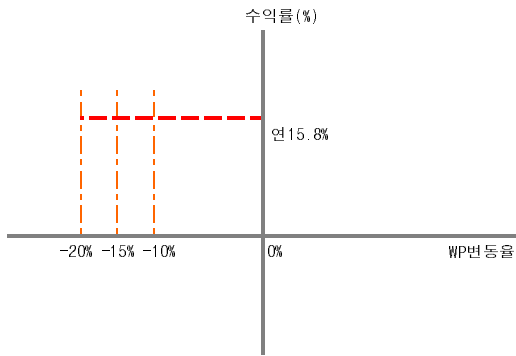
1. 계약금액

단위(백만원)

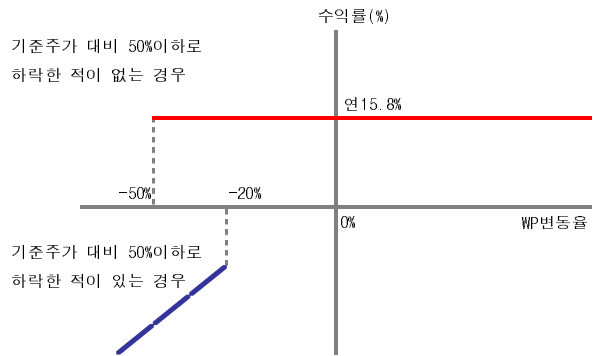
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	666	0	666	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653310WC3 한화스마트(ELS)242

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	26.49	21.32	16.15	10.97	5.80	0.63	(4.54)
	5.33%	23.90	18.72	13.55	8.38	3.21	(1.97)	(7.14)
	2.67%	20.24	15.07	9.89	4.72	(0.45)	(5.62)	(10.80)
	0.00%	15.52	10.35	5.17	0.00	(5.17)	(10.35)	(15.52)
	-2.67%	9.74	4.56	(0.61)	(5.78)	(10.95)	(16.13)	(21.30)
	-5.33%	2.89	(2.28)	(7.45)	(12.63)	(17.80)	(22.97)	(28.14)
	-8.00%	(5.01)	(10.19)	(15.36)	(20.53)	(25.71)	(30.88)	(36.05)

최대손실 시나리오

위험액	-36.05
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	34.26
-----	-------



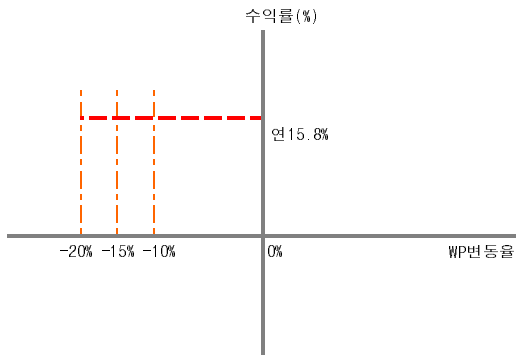
1. 계약금액

단위(백만원)

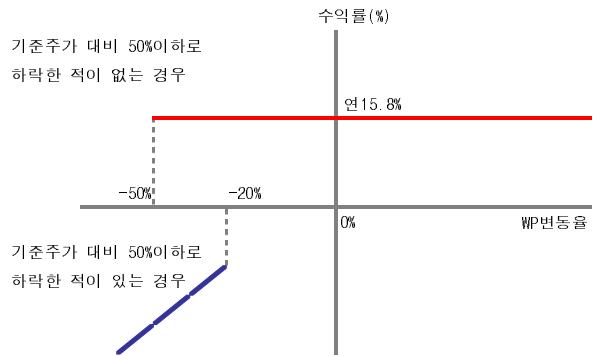
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	91	0	91	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6653310WC3 한화스마트(ELS)242

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	3.62	2.91	2.21	1.50	0.79	0.09	(0.62)
	5.33%	3.27	2.56	1.85	1.15	0.44	(0.27)	(0.98)
	2.67%	2.77	2.06	1.35	0.65	(0.06)	(0.77)	(1.48)
	0.00%	2.12	1.41	0.71	0.00	(0.71)	(1.41)	(2.12)
	-2.67%	1.33	0.62	(0.08)	(0.79)	(1.50)	(2.20)	(2.91)
	-5.33%	0.40	(0.31)	(1.02)	(1.73)	(2.43)	(3.14)	(3.85)
	-8.00%	(0.69)	(1.39)	(2.10)	(2.81)	(3.51)	(4.22)	(4.93)

최대손실 시나리오

위험액	-4.93
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	4.68
-----	------

[129]

메리츠한중지수연계사모증권제24

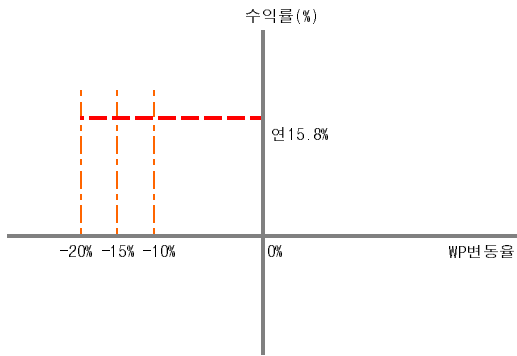
1. 계약금액

단위(백만원)

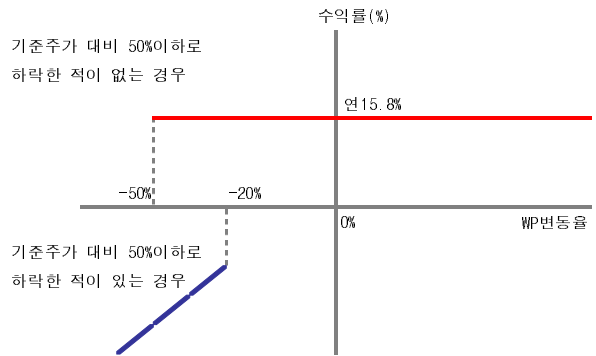
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	570	0	570	장익

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%	22.68	18.25	13.82	9.39	4.97	0.54	(3.89)
	5.33%	20.46	16.03	11.60	7.17	2.74	(1.68)	(6.11)
	2.67%	17.32	12.90	8.47	4.04	(0.39)	(4.82)	(9.24)
	0.00%	13.28	8.86	4.43	0.00	(4.43)	(8.86)	(13.28)
	-2.67%	8.33	3.91	(0.52)	(4.95)	(9.38)	(13.81)	(18.23)
	-5.33%	2.47	(1.95)	(6.38)	(10.81)	(15.24)	(19.66)	(24.09)
	-8.00%	(4.29)	(8.72)	(13.15)	(17.58)	(22.00)	(26.43)	(30.86)

최대손실 시나리오

위험액	-30.86
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	29.32
-----	-------

[131]

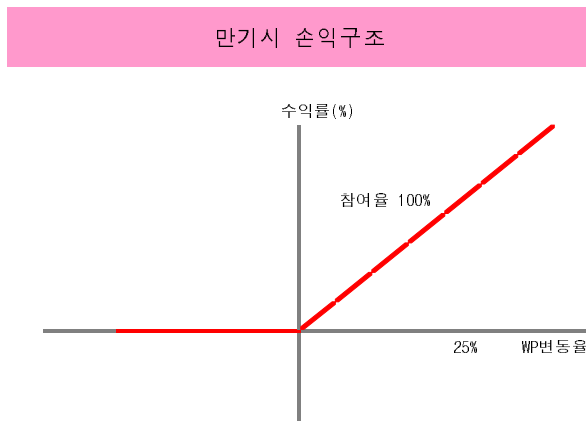
메리츠MLCXALS연계사모증권제1호

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%	90.89	91.01	91.12	91.24	91.35	91.47	91.58
	5.33%	54.90	55.01	55.13	55.25	55.36	55.48	55.59
	2.67%	24.49	24.60	24.72	24.83	24.95	25.06	25.18
	0.00%	(0.35)	(0.23)	(0.12)	0.00	0.12	0.23	0.35
	-2.67%	(19.60)	(19.48)	(19.37)	(19.25)	(19.14)	(19.02)	(18.91)
	-5.33%	(33.27)	(33.16)	(33.04)	(32.93)	(32.81)	(32.69)	(32.58)
	-8.00%	(41.37)	(41.25)	(41.14)	(41.02)	(40.90)	(40.79)	(40.67)

최대손실 시나리오

위험액	-40.67
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	68.55
-----	-------

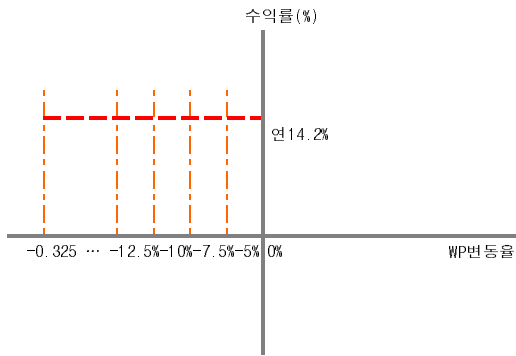
1. 계약금액

단위(백만원)

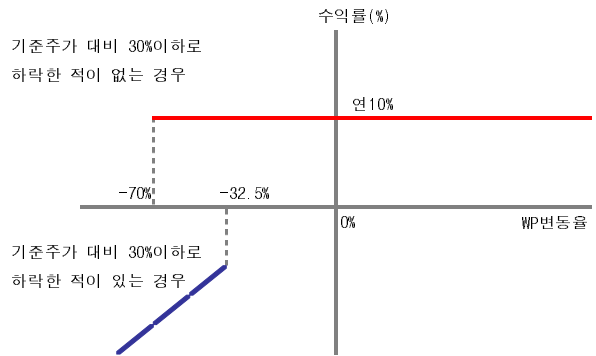
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,087	0	1,087	장익

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%	95.17	87.89	80.62	73.34	66.07	58.79	51.51
	5.33%	74.37	67.10	59.82	52.55	45.27	37.99	30.72
	2.67%	49.93	42.65	35.37	28.10	20.82	13.55	6.27
	0.00%	21.83	14.55	7.28	0.00	(7.28)	(14.55)	(21.83)
	-2.67%	(9.92)	(17.20)	(24.47)	(31.75)	(39.03)	(46.30)	(53.58)
	-5.33%	(45.32)	(52.60)	(59.87)	(67.15)	(74.43)	(81.70)	(88.98)
	-8.00%	(84.37)	(91.65)	(98.93)	(106.20)	(113.48)	(120.75)	(128.03)

최대 손실 시나리오

위험액	-128.03
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

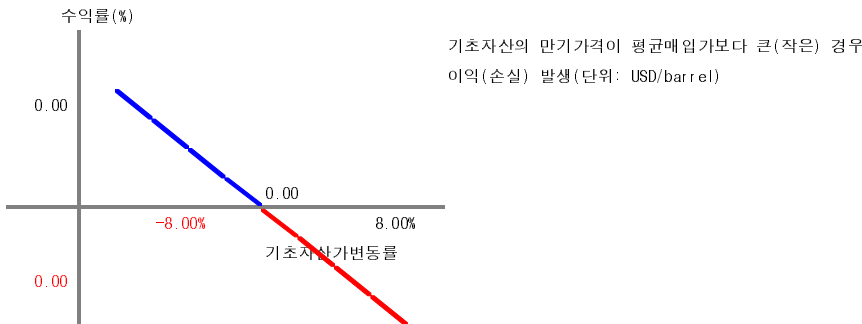
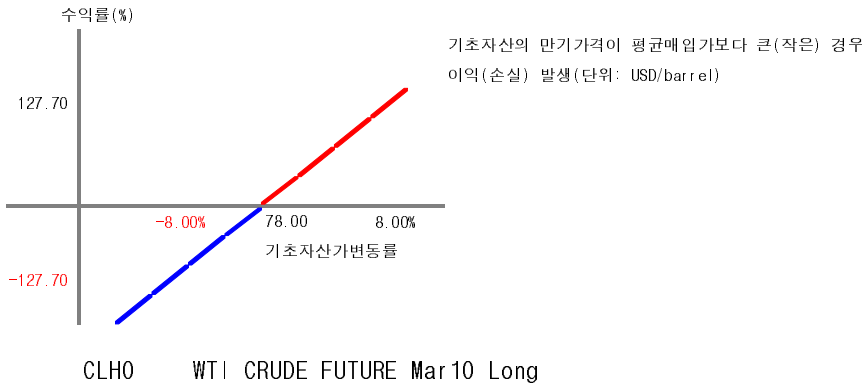
위험액	155.25
-----	--------

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(최대 손실 가능금액(단위:1000USD))

CLHO WTI CRUDE FUTURE Mar 10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	127.70
	5.33%	85.08
	2.67%	42.62
	0.00%	0.00
	-2.67%	-42.62
	-5.33%	-85.08
	-8.00%	-127.70

최대손실 시나리오	
위험액	-127.70

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	517
-----	-----

[136]

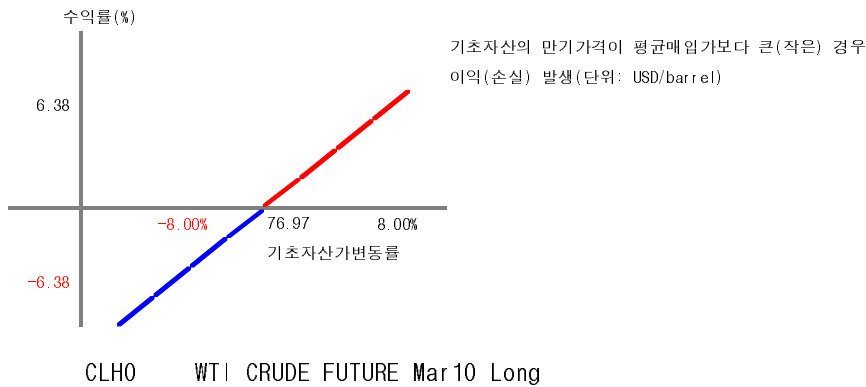
메리츠WTIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

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%	6.38
	5.33%	4.25
	2.67%	2.13
	0.00%	0.00
	-2.67%	-2.13
	-5.33%	-4.25
	-8.00%	-6.38

최대손실 시나리오	
위험액	-6.38

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25
-----	----

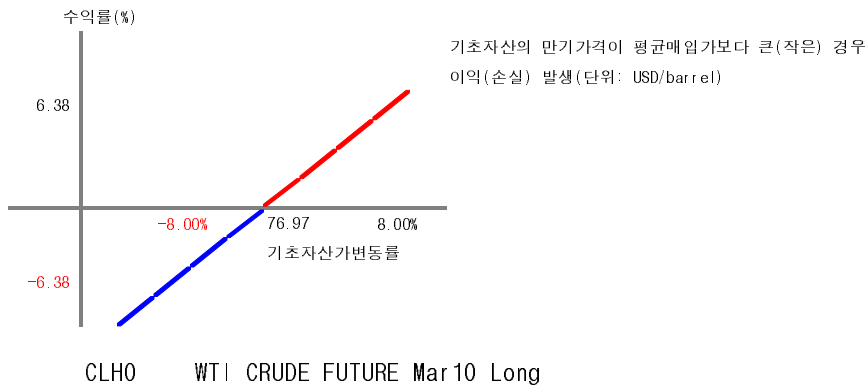
[137-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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(최대 손실 가능금액(단위:1000USD))

CLHO WTI CRUDE FUTURE Mar10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	21.90
	5.33%	14.59
	2.67%	7.31
	0.00%	0.00
	-2.67%	-7.31
	-5.33%	-14.59
	-8.00%	-21.90

최대손실 시나리오	
위험액	-21.90

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	87
-----	----

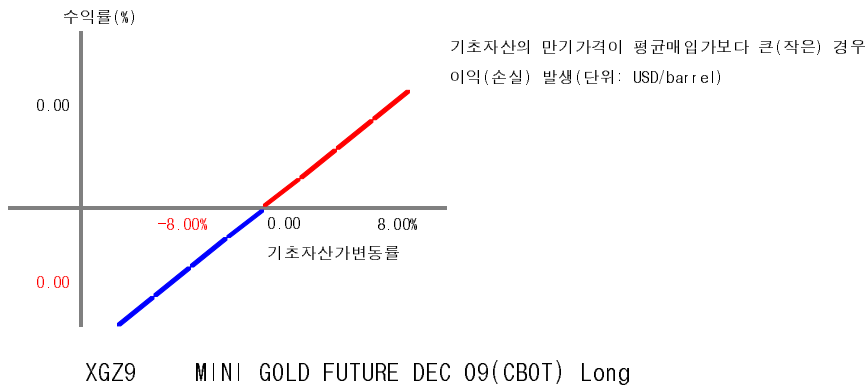
[137-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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





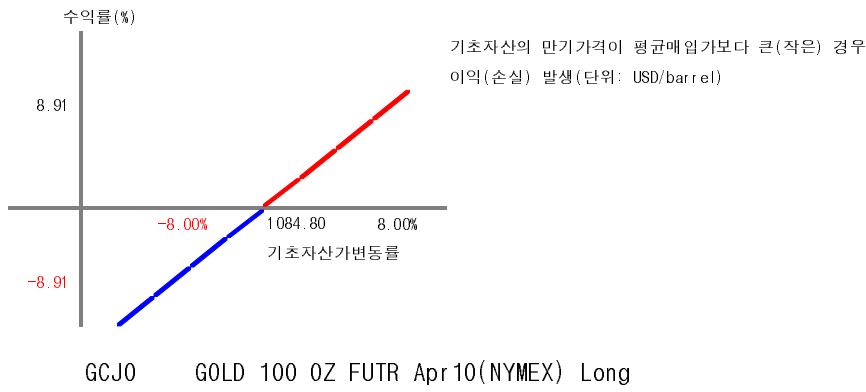
[137-3] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



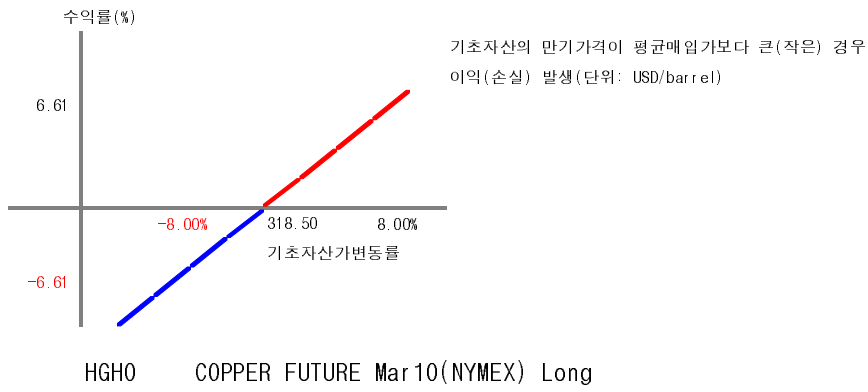
[137-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



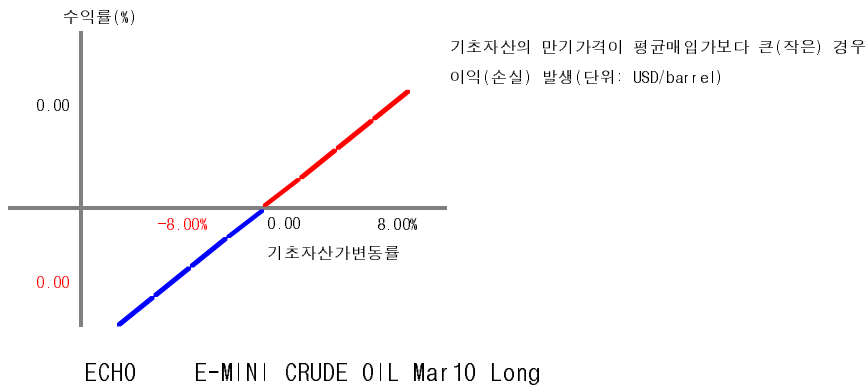
[137-5] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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

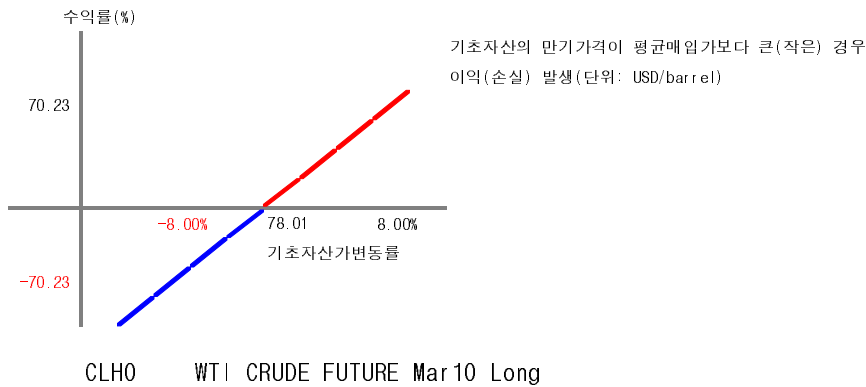


1. 계약금액

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 손실 가능금액 (단위:1000USD))

CLHO WTI CRUDE FUTURE Mar10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	70.23
	5.33%	46.79
	2.67%	23.44
	0.00%	0.00
	-2.67%	-23.44
	-5.33%	-46.79
	-8.00%	-70.23

최대손실 시나리오	
위험액	-70.23

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	265
-----	-----

[139]

메리츠2Star사모증권HSSS-1호

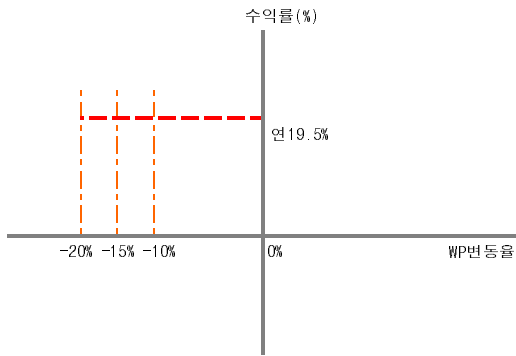
1. 계약금액

단위(백만원)

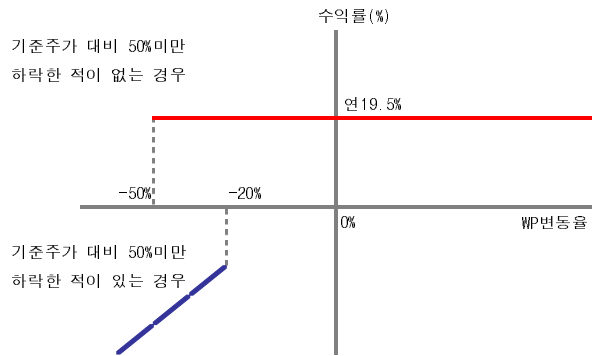
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,000	0	1,000	장익

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%	21.42	18.25	15.09	11.93	8.76	5.60	2.44
	5.33%	18.74	15.58	12.42	9.25	6.09	2.93	(0.24)
	2.67%	14.77	11.61	8.44	5.28	2.12	(1.05)	(4.21)
	0.00%	9.49	6.33	3.16	0.00	(3.16)	(6.33)	(9.49)
	-2.67%	2.91	(0.25)	(3.42)	(6.58)	(9.74)	(12.91)	(16.07)
	-5.33%	(4.97)	(8.14)	(11.30)	(14.46)	(17.63)	(20.79)	(23.95)
	-8.00%	(14.16)	(17.32)	(20.49)	(23.65)	(26.81)	(29.98)	(33.14)

최대손실 시나리오

위험액	-33.14
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	34.17
-----	-------

[140]

메리츠2Star사모증권LESE-2호

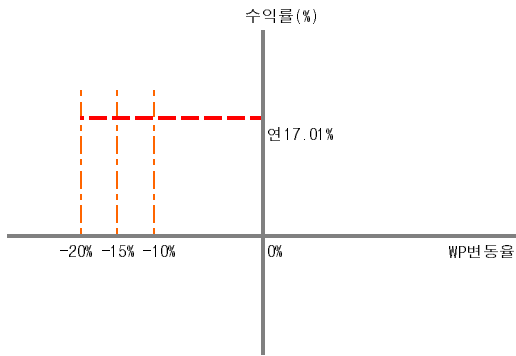
1. 계약금액

단위(백만원)

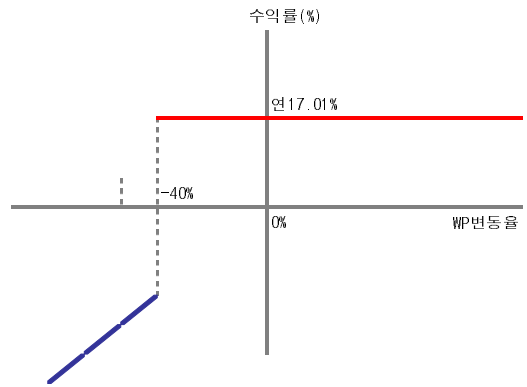
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,436	0	1,436	장익

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%	36.43	29.68	22.93	16.18	9.43	2.69	(4.06)
	5.33%	33.23	26.48	19.73	12.98	6.23	(0.52)	(7.27)
	2.67%	27.83	21.08	14.33	7.59	0.84	(5.91)	(12.66)
	0.00%	20.25	13.50	6.75	0.00	(6.75)	(13.50)	(20.25)
	-2.67%	10.47	3.72	(3.03)	(9.78)	(16.53)	(23.27)	(30.02)
	-5.33%	(1.50)	(8.25)	(15.00)	(21.75)	(28.50)	(35.24)	(41.99)
	-8.00%	(15.67)	(22.41)	(29.16)	(35.91)	(42.66)	(49.41)	(56.16)

최대손실 시나리오

위험액	-56.16
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	56.51
-----	-------

[141] 메리츠2Star사모증권LESE-3호

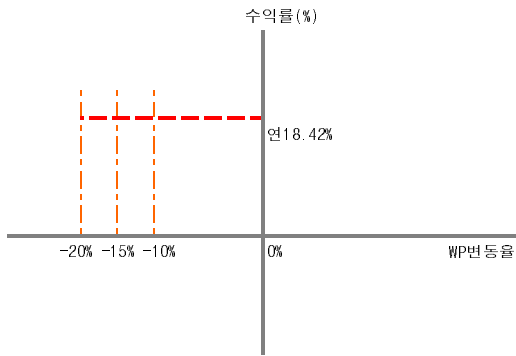
1. 계약금액

단위(백만원)

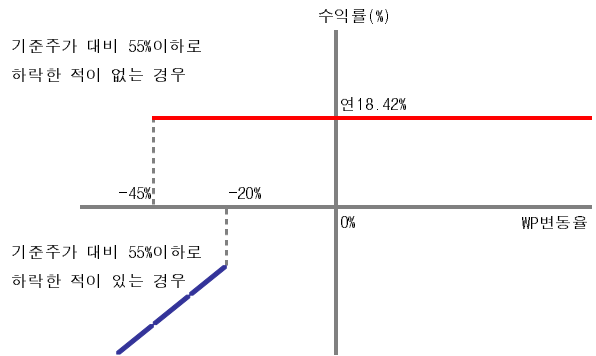
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,000	0	2,000	장익

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 시나 리오	8.00%	102.53	87.86	73.20	58.53	43.86	29.20	14.53
	5.33%	85.11	70.44	55.78	41.11	26.44	11.78	(2.89)
	2.67%	65.60	50.93	36.27	21.60	6.93	(7.73)	(22.40)
	0.00%	44.00	29.33	14.67	0.00	(14.67)	(29.33)	(44.00)
	-2.67%	20.31	5.64	(9.02)	(23.69)	(38.36)	(53.02)	(67.69)
	-5.33%	(5.47)	(20.14)	(34.80)	(49.47)	(64.14)	(78.80)	(93.47)
	-8.00%	(33.34)	(48.01)	(62.68)	(77.34)	(92.01)	(106.67)	(121.34)

최대손실 시나리오

위험액	-121.34
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	127.99
-----	--------

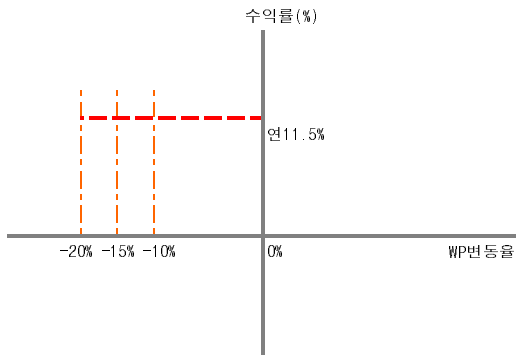
1. 계약금액

단위(백만원)

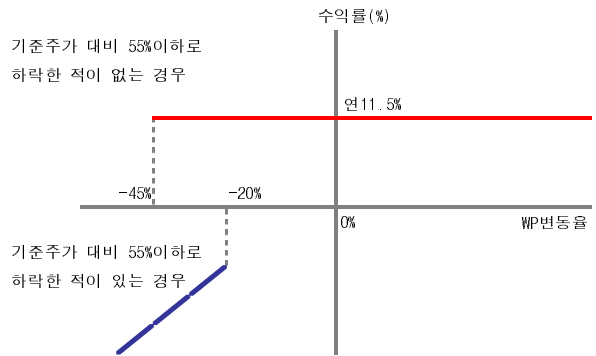
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,304	0	1,304	장익

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 시나 리오	8.00%	62.72	53.06	43.40	33.75	24.09	14.43	4.77
	5.33%	52.93	43.27	33.61	23.95	14.30	4.64	(5.02)
	2.67%	41.68	32.02	22.36	12.71	3.05	(6.61)	(16.27)
	0.00%	28.97	19.31	9.66	0.00	(9.66)	(19.31)	(28.97)
	-2.67%	14.81	5.15	(4.51)	(14.16)	(23.82)	(33.48)	(43.13)
	-5.33%	(0.81)	(10.47)	(20.12)	(29.78)	(39.44)	(49.10)	(58.75)
	-8.00%	(17.89)	(27.54)	(37.20)	(46.86)	(56.52)	(66.17)	(75.83)

최대손실 시나리오

위험액	-75.83
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	76.54
-----	-------



[143] 메리츠2Star사모증권SFSE-5호

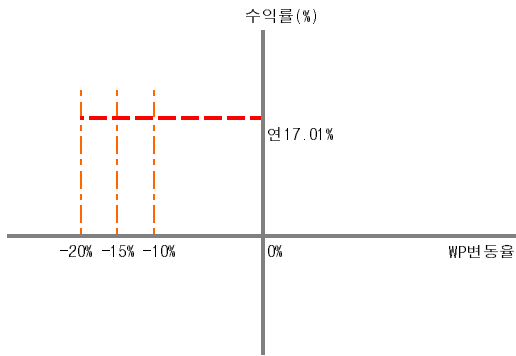
1. 계약금액

단위(백만원)

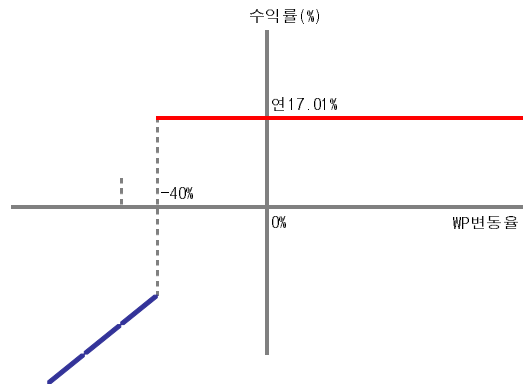
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	533	0	533	장익

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%	21.41	17.42	13.42	9.43	5.44	1.44	(2.55)
	5.33%	19.00	15.00	11.01	7.01	3.02	(0.97)	(4.97)
	2.67%	15.85	11.86	7.86	3.87	(0.12)	(4.12)	(8.11)
	0.00%	11.98	7.99	3.99	0.00	(3.99)	(7.99)	(11.98)
	-2.67%	7.38	3.39	(0.60)	(4.60)	(8.59)	(12.59)	(16.58)
	-5.33%	2.06	(1.94)	(5.93)	(9.92)	(13.92)	(17.91)	(21.91)
	-8.00%	(3.99)	(7.99)	(11.98)	(15.98)	(19.97)	(23.96)	(27.96)

최대손실 시나리오

위험액	-27.96
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	28.99
-----	-------

[144] 메리츠2Star사모증권SFSE-6호

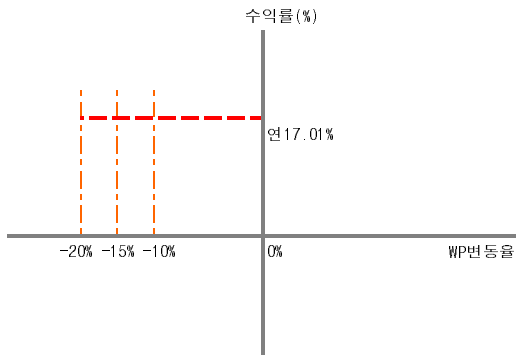
1. 계약금액

단위(백만원)

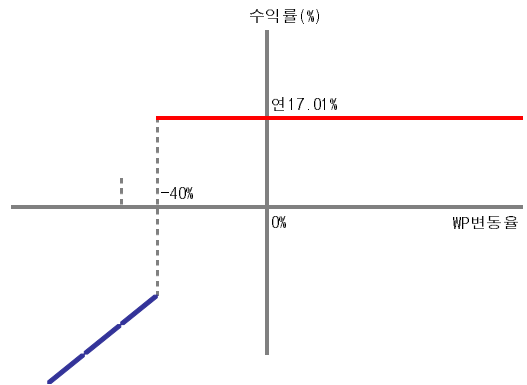
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	214	0	214	장익

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%	8.59	6.98	5.38	3.78	2.18	0.58	(1.02)
	5.33%	7.62	6.01	4.41	2.81	1.21	(0.39)	(1.99)
	2.67%	6.36	4.75	3.15	1.55	(0.05)	(1.65)	(3.25)
	0.00%	4.80	3.20	1.60	0.00	(1.60)	(3.20)	(4.80)
	-2.67%	2.96	1.36	(0.24)	(1.84)	(3.44)	(5.05)	(6.65)
	-5.33%	0.83	(0.78)	(2.38)	(3.98)	(5.58)	(7.18)	(8.78)
	-8.00%	(1.60)	(3.20)	(4.80)	(6.41)	(8.01)	(9.61)	(11.21)

최대손실 시나리오

위험액	-11.21
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	11.62
-----	-------

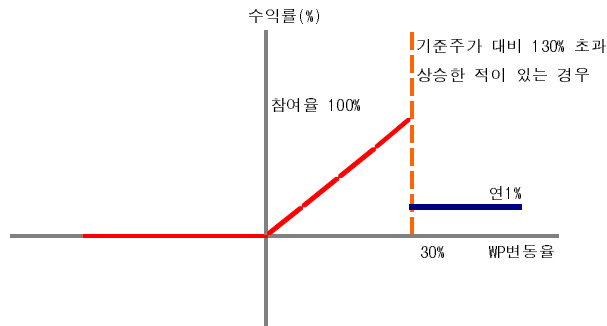
1. 계약금액

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%	3.55	2.82	2.08	1.35	0.61	(0.12)	(0.86)
	5.33%	3.29	2.55	1.81	1.08	0.34	(0.39)	(1.13)
	2.67%	2.84	2.10	1.37	0.63	(0.11)	(0.84)	(1.58)
	0.00%	2.21	1.47	0.74	0.00	(0.74)	(1.47)	(2.21)
	-2.67%	1.40	0.66	(0.08)	(0.81)	(1.55)	(2.28)	(3.02)
	-5.33%	0.40	(0.33)	(1.07)	(1.80)	(2.54)	(3.27)	(4.01)
	-8.00%	(0.77)	(1.50)	(2.24)	(2.97)	(3.71)	(4.44)	(5.18)

최대손실 시나리오

위험액	-5.18
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.48
-----	------

[146-1]

메리츠한중지수연계사모증권제25

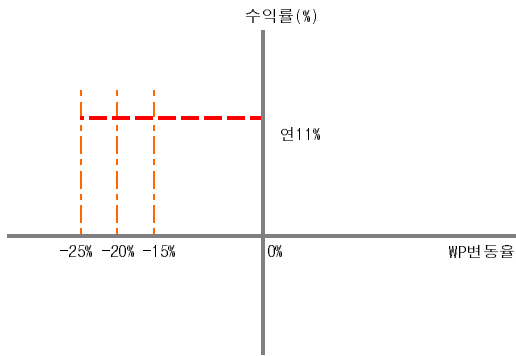
1. 계약금액

단위(백만원)

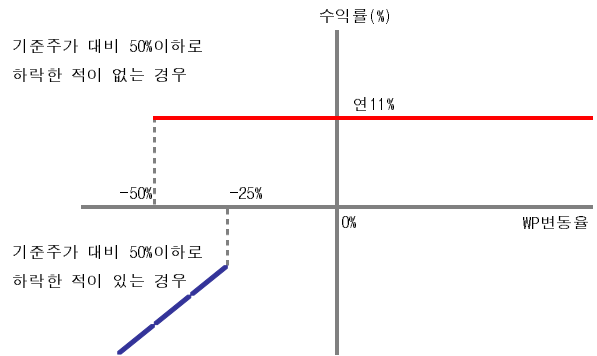
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

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%	3.75	3.07	2.39	1.72	1.04	0.37	(0.31)
	5.33%	3.40	2.73	2.05	1.37	0.70	0.02	(0.65)
	2.67%	2.83	2.15	1.48	0.80	0.13	(0.55)	(1.23)
	0.00%	2.03	1.35	0.68	0.00	(0.68)	(1.35)	(2.03)
	-2.67%	1.00	0.32	(0.36)	(1.03)	(1.71)	(2.38)	(3.06)
	-5.33%	(0.27)	(0.94)	(1.62)	(2.29)	(2.97)	(3.64)	(4.32)
	-8.00%	(1.76)	(2.43)	(3.11)	(3.78)	(4.46)	(5.13)	(5.81)

최대손실 시나리오

위험액	-5.81
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	5.45
-----	------

[146-2]

메리츠한중지수연계사모증권제25

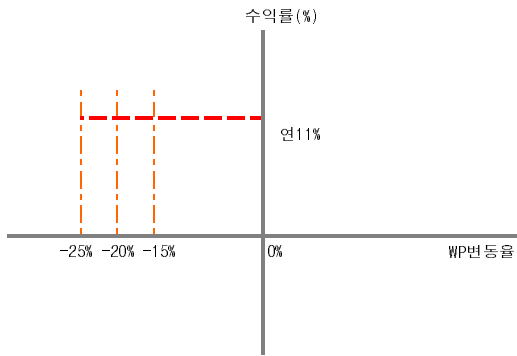
1. 계약금액

단위(백만원)

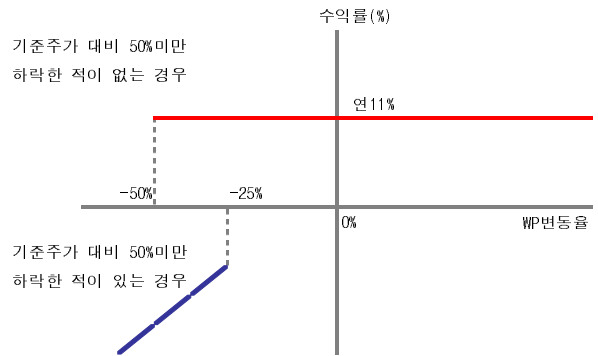
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

[146-3]

메리츠한중지수연계사모증권제25

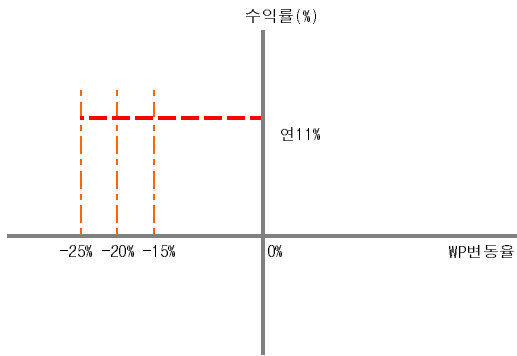
1. 계약금액

단위(백만원)

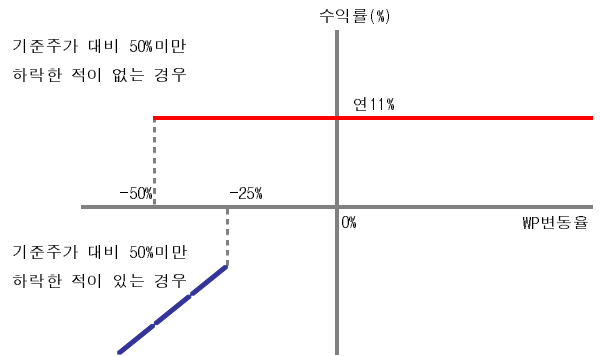
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[146-4]

메리츠한중지수연계사모증권제25

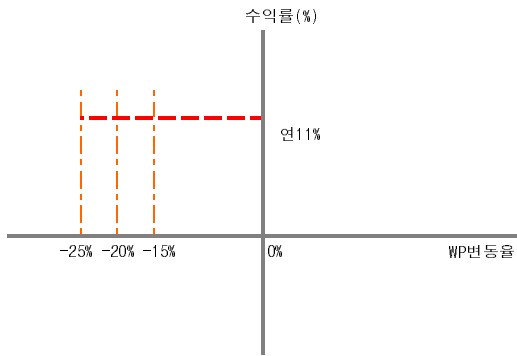
1. 계약금액

단위(백만원)

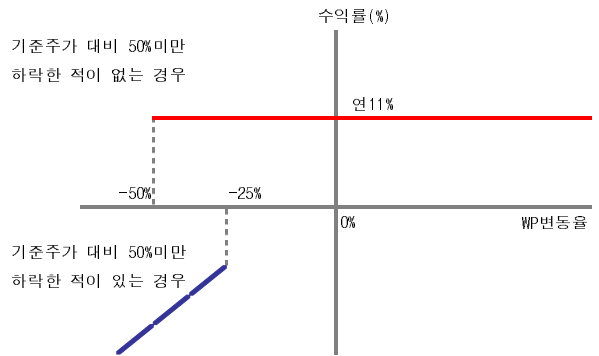
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	38	0	38	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[147-1]

메리츠한중지수연계사모증권제26

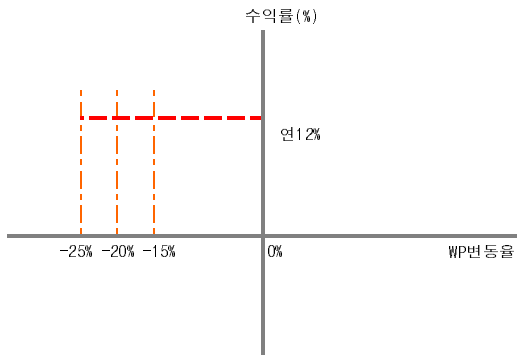
1. 계약금액

단위(백만원)

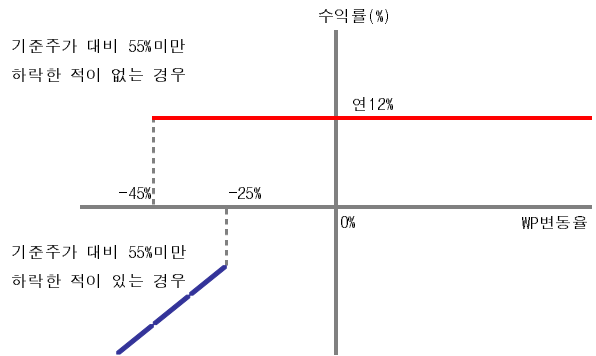
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

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%	3.56	2.94	2.32	1.69	1.07	0.45	(0.18)
	5.33%	3.21	2.59	1.96	1.34	0.72	0.09	(0.53)
	2.67%	2.64	2.02	1.40	0.78	0.15	(0.47)	(1.09)
	0.00%	1.87	1.25	0.62	0.00	(0.62)	(1.25)	(1.87)
	-2.67%	0.88	0.26	(0.36)	(0.99)	(1.61)	(2.23)	(2.86)
	-5.33%	(0.31)	(0.93)	(1.56)	(2.18)	(2.80)	(3.43)	(4.05)
	-8.00%	(1.72)	(2.34)	(2.96)	(3.59)	(4.21)	(4.83)	(5.46)

최대손실 시나리오

위험액	-5.46
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	5.20
-----	------



[147-2]

메리츠한중지수연계사모증권제26

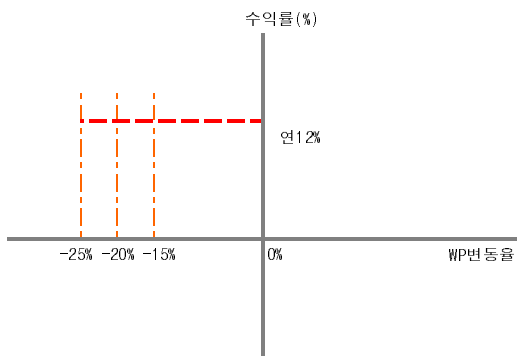
1. 계약금액

단위(백만원)

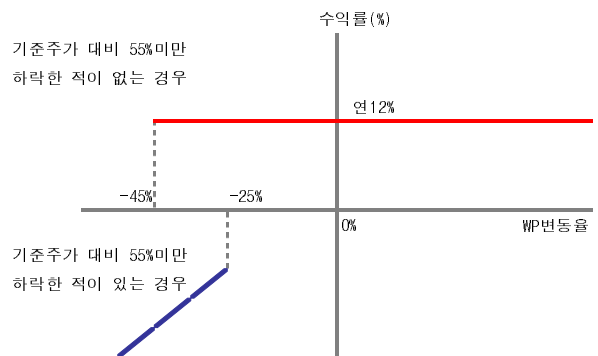
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[147-3]

메리츠한중지수연계사모증권제26

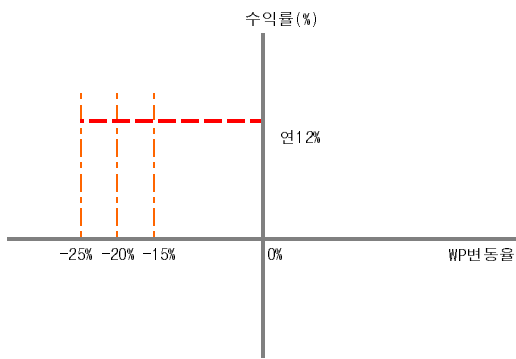
1. 계약금액

단위(백만원)

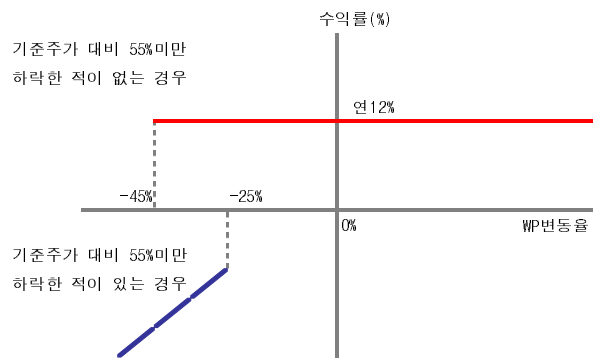
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[147-4]

메리츠한중지수연계사모증권제26

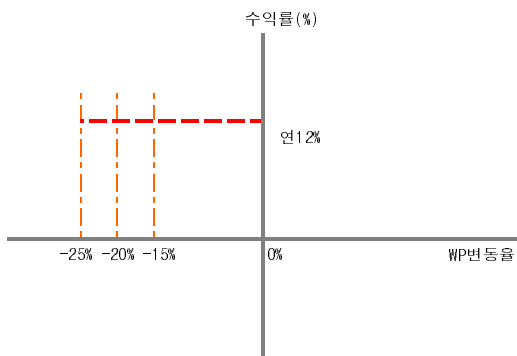
1. 계약금액

단위(백만원)

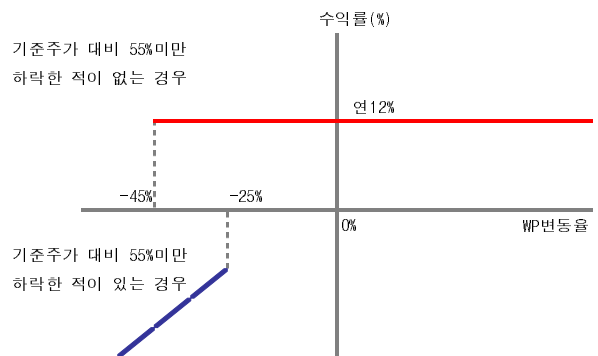
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	27	0	27	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[148-1]

메리츠한중지수연계증권제2호

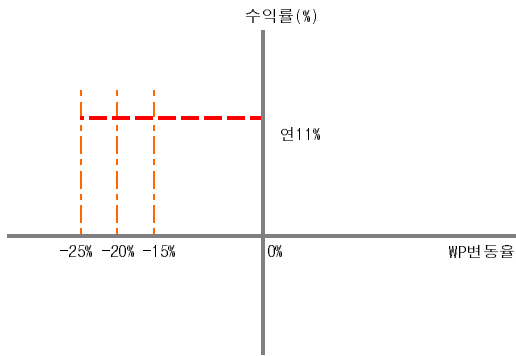
1. 계약금액

단위(백만원)

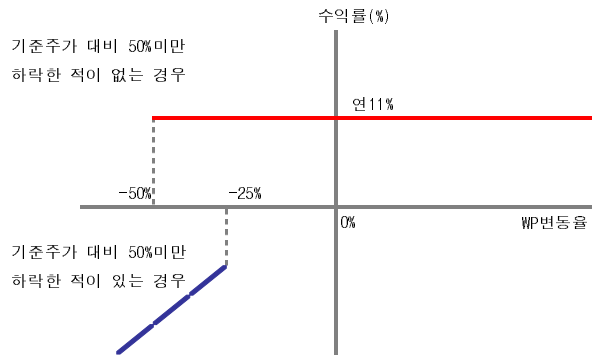
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

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 시나리오	8.00%	43.44	35.60	27.77	19.93	12.09	4.26	(3.58)
	5.33%	39.46	31.62	23.78	15.95	8.11	0.27	(7.57)
	2.67%	32.81	24.98	17.14	9.30	1.47	(6.37)	(14.21)
	0.00%	23.51	15.67	7.84	0.00	(7.84)	(15.67)	(23.51)
	-2.67%	11.55	3.71	(4.13)	(11.96)	(19.80)	(27.64)	(35.47)
	-5.33%	(3.07)	(10.91)	(18.75)	(26.58)	(34.42)	(42.26)	(50.10)
	-8.00%	(20.36)	(28.19)	(36.03)	(43.87)	(51.70)	(59.54)	(67.38)

최대손실 시나리오

위험액	-67.38
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	63.20
-----	-------

[148-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

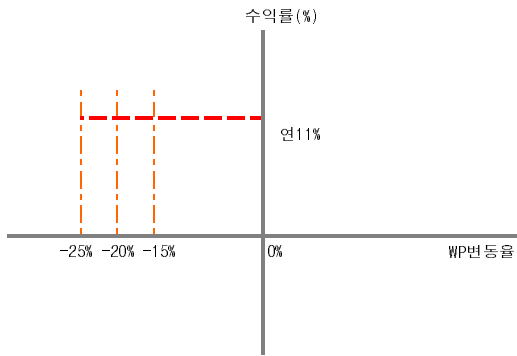
1. 계약금액

단위(백만원)

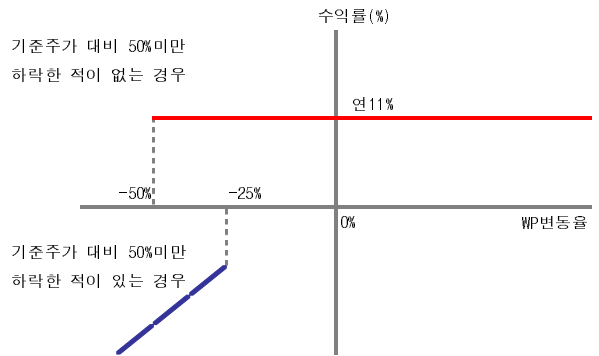
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

[148-3]

메리츠한중지수연계증권제2호

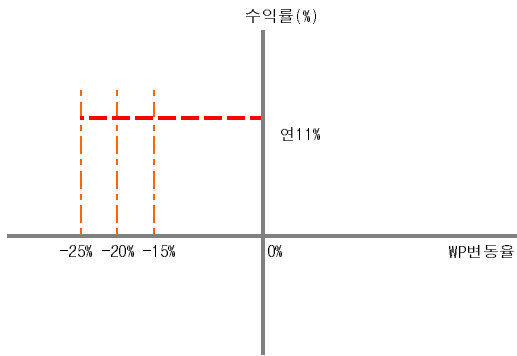
1. 계약금액

단위(백만원)

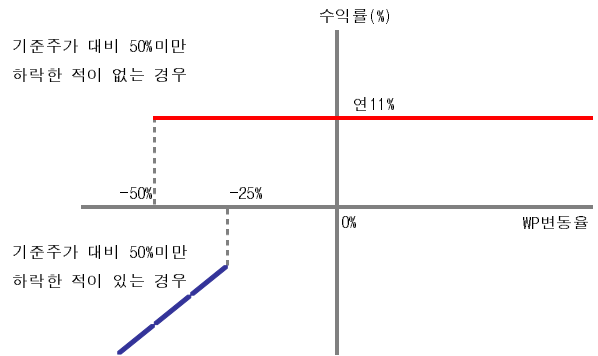
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[148-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

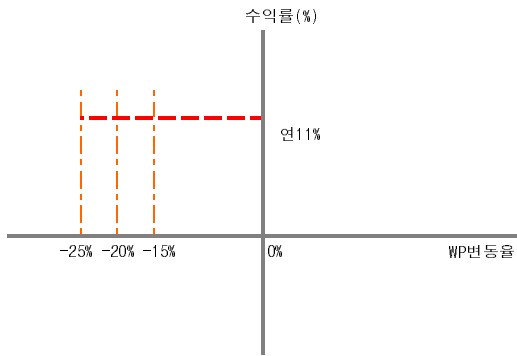
1. 계약금액

단위(백만원)

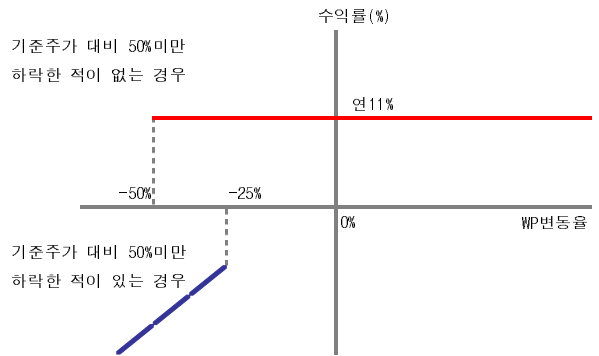
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[149-1]

메리츠한중지수연계증권제3호

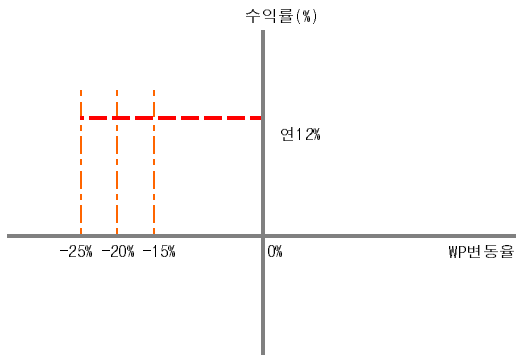
1. 계약금액

단위(백만원)

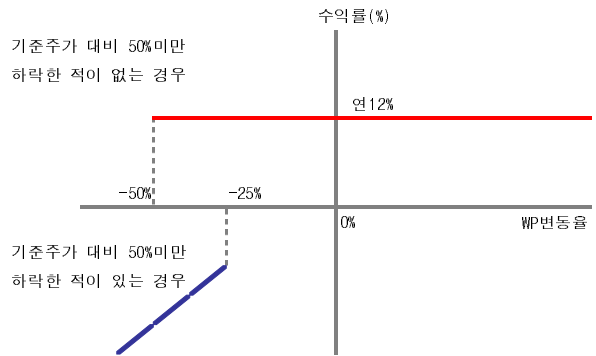
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

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 시나 리오	8.00%	52.66	43.45	34.24	25.03	15.83	6.62	(2.59)
	5.33%	47.42	38.21	29.01	19.80	10.59	1.38	(7.83)
	2.67%	39.08	29.87	20.66	11.45	2.24	(6.96)	(16.17)
	0.00%	27.62	18.42	9.21	0.00	(9.21)	(18.42)	(27.62)
	-2.67%	13.06	3.86	(5.35)	(14.56)	(23.77)	(32.98)	(42.19)
	-5.33%	(4.61)	(13.81)	(23.02)	(32.23)	(41.44)	(50.65)	(59.85)
	-8.00%	(25.38)	(34.59)	(43.80)	(53.01)	(62.21)	(71.42)	(80.63)

최대손실 시나리오

위험액	-80.63
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	76.84
-----	-------



[149-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

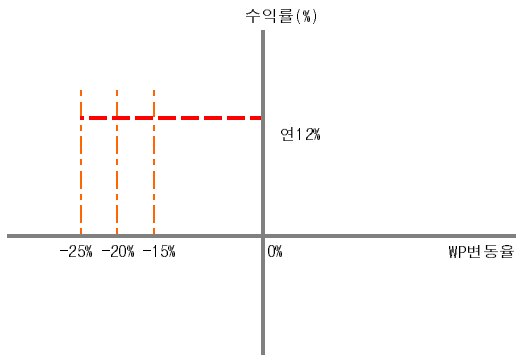
1. 계약금액

단위(백만원)

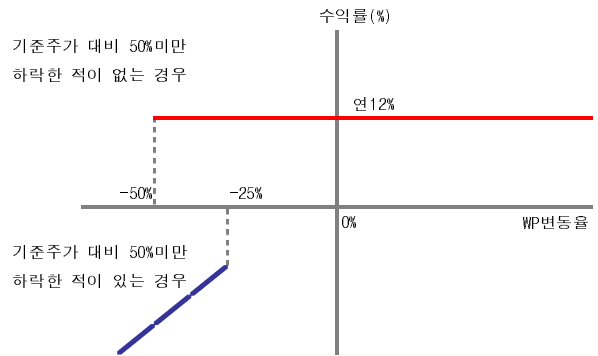
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[149-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

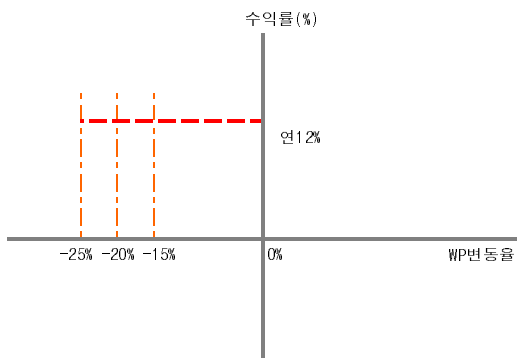
1. 계약금액

단위(백만원)

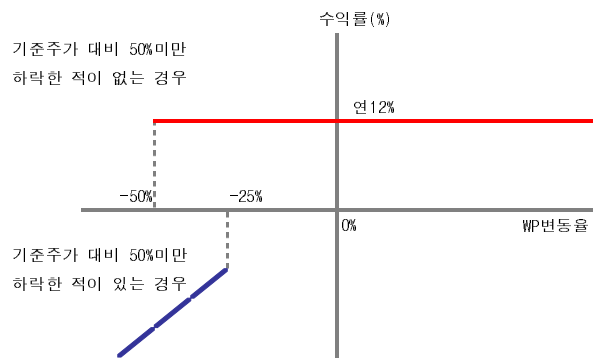
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[149-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

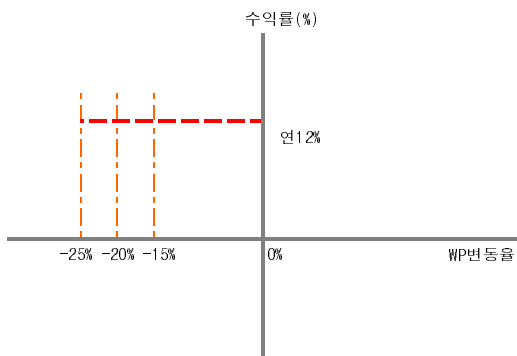
1. 계약금액

단위(백만원)

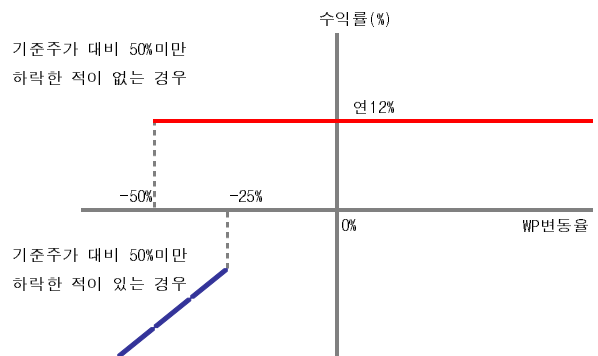
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[150-1]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL]

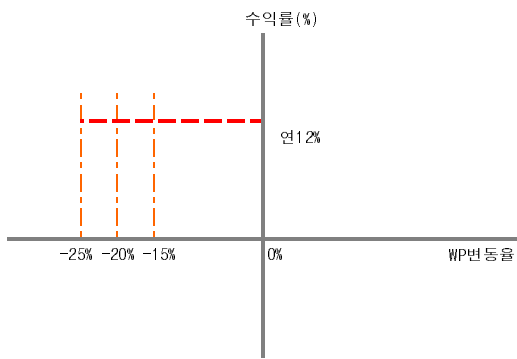
1. 계약금액

단위(백만원)

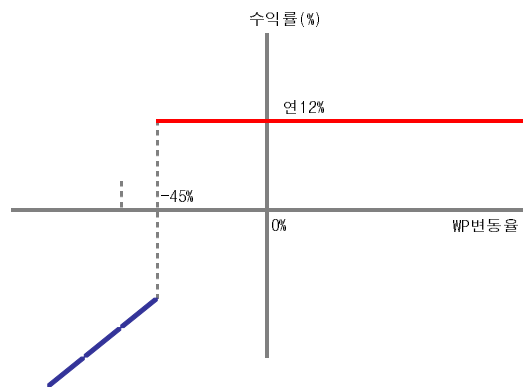
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

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%	52.66	43.45	34.24	25.03	15.83	6.62	(2.59)
	5.33%	47.42	38.21	29.01	19.80	10.59	1.38	(7.83)
	2.67%	39.08	29.87	20.66	11.45	2.24	(6.96)	(16.17)
	0.00%	27.62	18.42	9.21	0.00	(9.21)	(18.42)	(27.62)
	-2.67%	13.06	3.86	(5.35)	(14.56)	(23.77)	(32.98)	(42.19)
	-5.33%	(4.61)	(13.81)	(23.02)	(32.23)	(41.44)	(50.65)	(59.85)
	-8.00%	(25.38)	(34.59)	(43.80)	(53.01)	(62.21)	(71.42)	(80.63)

최대손실 시나리오

위험액	-80.63
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	76.84
-----	-------

[150-2]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL

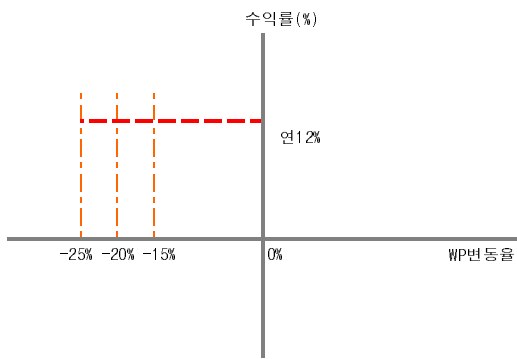
1. 계약금액

단위(백만원)

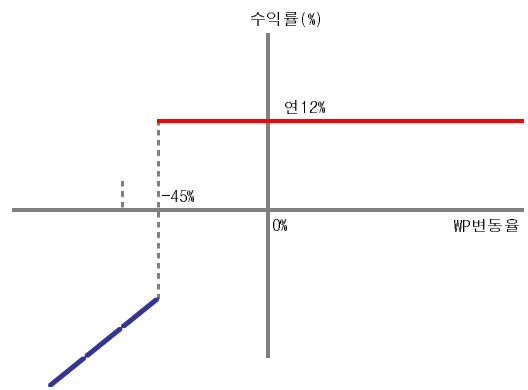
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[150-3]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL

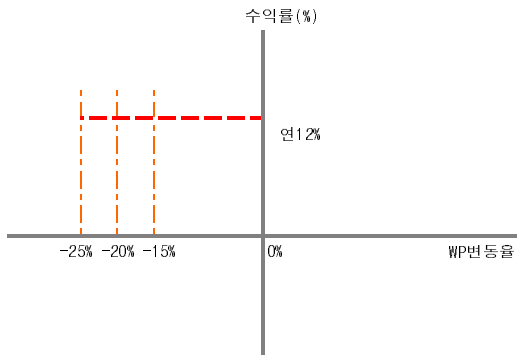
1. 계약금액

단위(백만원)

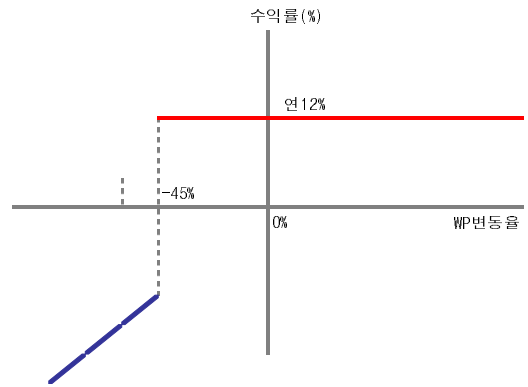
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[150-4]

메리츠한중지수연계증권제3호[EL

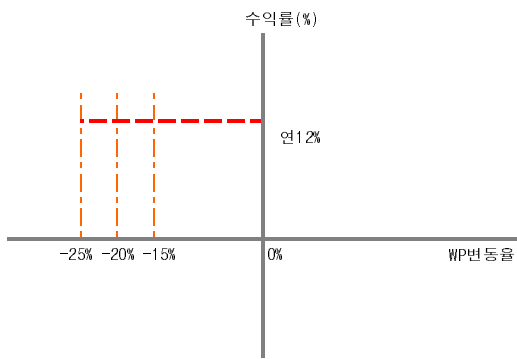
1. 계약금액

단위(백만원)

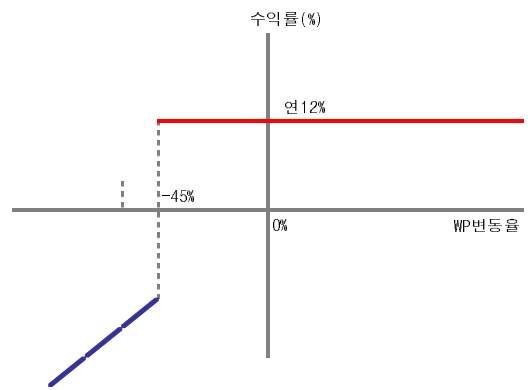
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414