

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권KGSH-1호

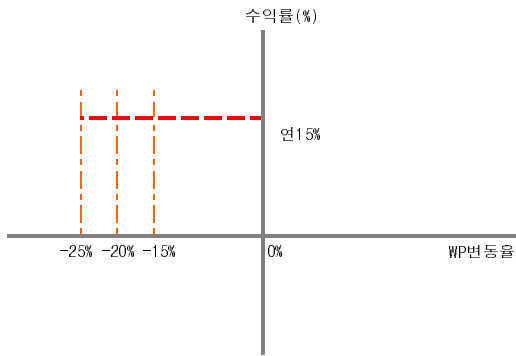
1. 계약금액

단위(백만원)

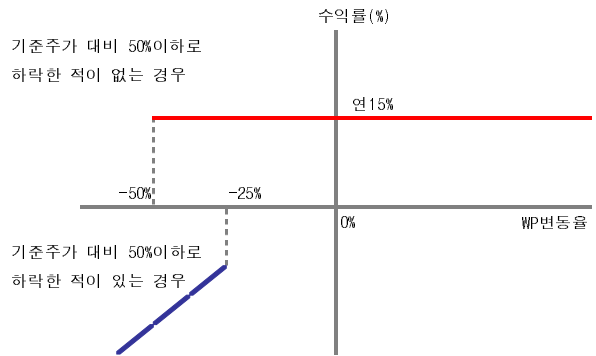
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

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%	175.34	153.82	132.29	110.77	89.25	67.73	46.21
	5.33%	146.10	124.58	103.05	81.53	60.01	38.49	16.97
	2.67%	109.17	87.65	66.13	44.61	23.09	1.57	(19.95)
	0.00%	64.56	43.04	21.52	0.00	(21.52)	(43.04)	(64.56)
	-2.67%	12.27	(9.25)	(30.77)	(52.29)	(73.81)	(95.34)	(116.86)
	-5.33%	(47.71)	(69.23)	(90.75)	(112.27)	(133.79)	(155.31)	(176.83)
	-8.00%	(115.37)	(136.89)	(158.41)	(179.93)	(201.45)	(222.98)	(244.50)

최대손실 시나리오

위험액	-244.50
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	247.79
-----	--------

[1-2]

메리츠2Star증권KGSH-1호

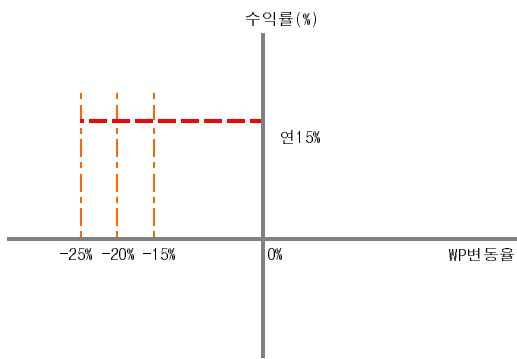
1. 계약금액

단위(백만원)

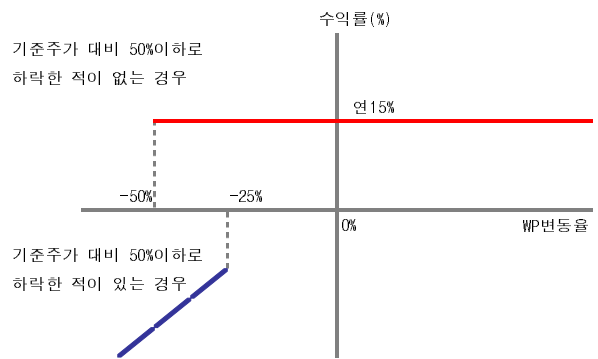
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[1-3]

메리츠2Star증권KGSH-1호

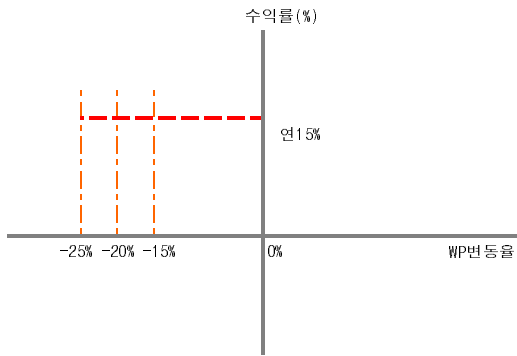
1. 계약금액

단위(백만원)

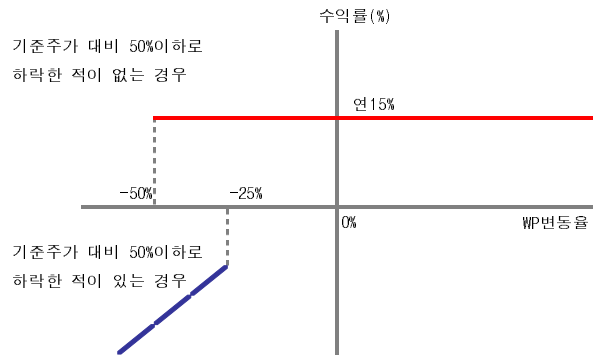
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

[1-4]

메리츠2Star증권KGSH-1호

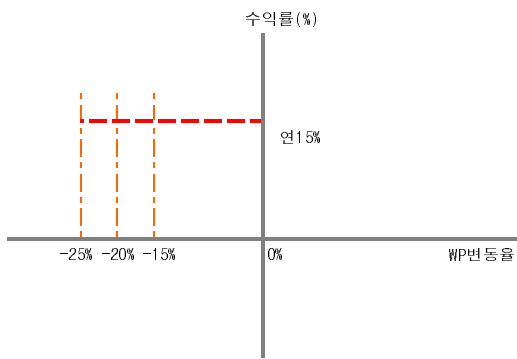
1. 계약금액

단위(백만원)

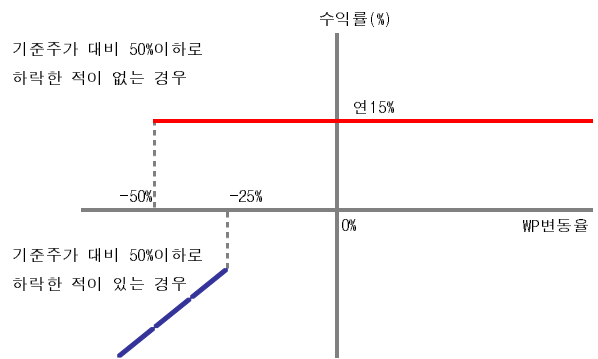
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[2-1] 메리츠2Star증권KISE-1호

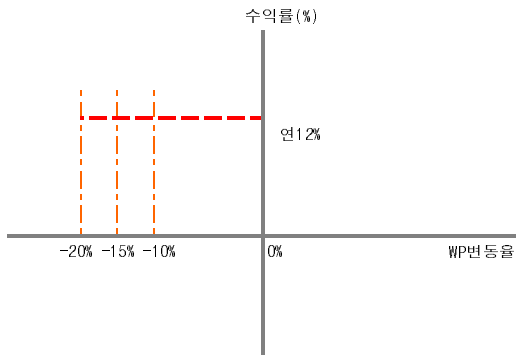
1. 계약금액

단위(백만원)

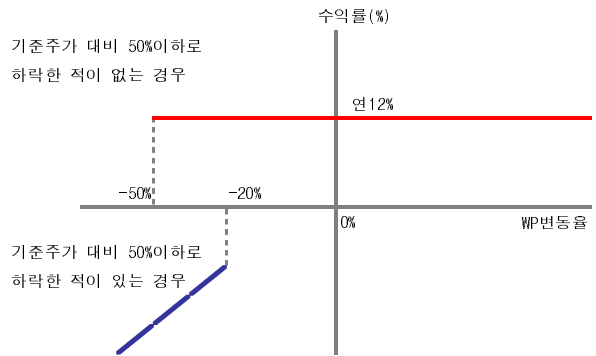
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

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%	(3.28)	(3.38)	(3.48)	(3.59)	(3.69)	(3.79)	(3.89)
	5.33%	(1.21)	(1.32)	(1.42)	(1.52)	(1.62)	(1.72)	(1.82)
	2.67%	(0.02)	(0.12)	(0.22)	(0.32)	(0.43)	(0.53)	(0.63)
	0.00%	0.30	0.20	0.10	0.00	(0.10)	(0.20)	(0.30)
	-2.67%	(0.24)	(0.34)	(0.44)	(0.55)	(0.65)	(0.75)	(0.85)
	-5.33%	(1.66)	(1.76)	(1.86)	(1.96)	(2.06)	(2.17)	(2.27)
	-8.00%	(3.94)	(4.05)	(4.15)	(4.25)	(4.35)	(4.45)	(4.55)

최대손실 시나리오

위험액	-4.55
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	3.61
-----	------

[2-2]

메리츠2Star증권KISE-1호

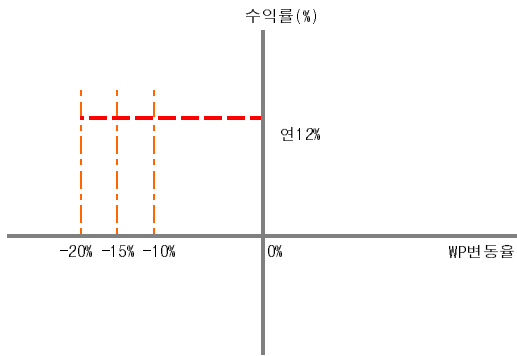
1. 계약금액

단위(백만원)

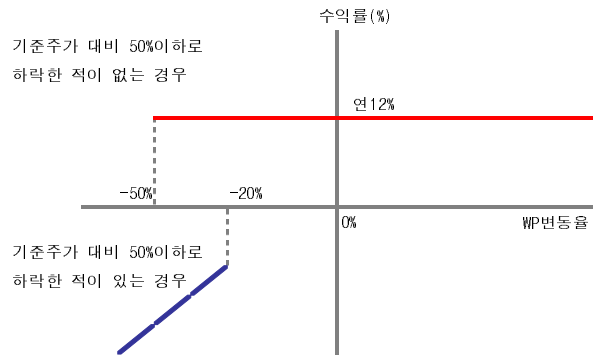
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552329WB7 우리투자증권(ELS)2730

[2-3]

메리츠2Star증권KISE-1호

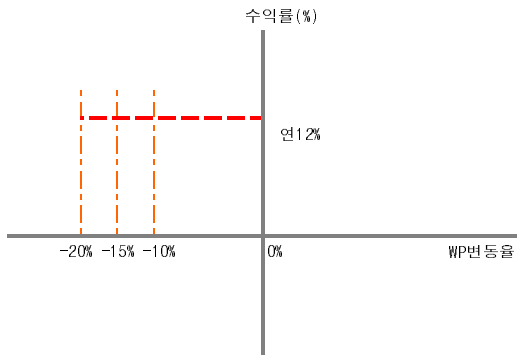
1. 계약금액

단위(백만원)

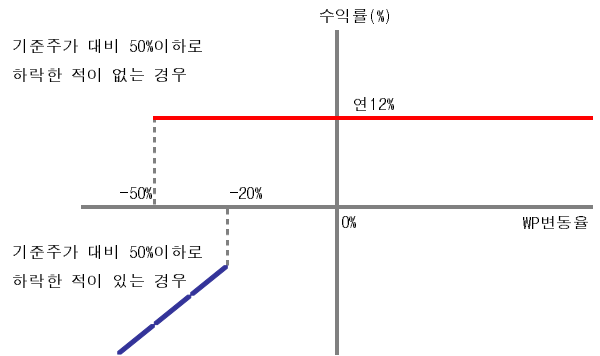
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579318WB9 한국투자증권(ELS)1411

[2-4]

메리츠2Star증권KISE-1호

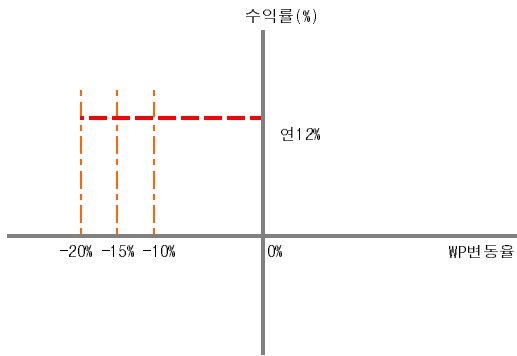
1. 계약금액

단위(백만원)

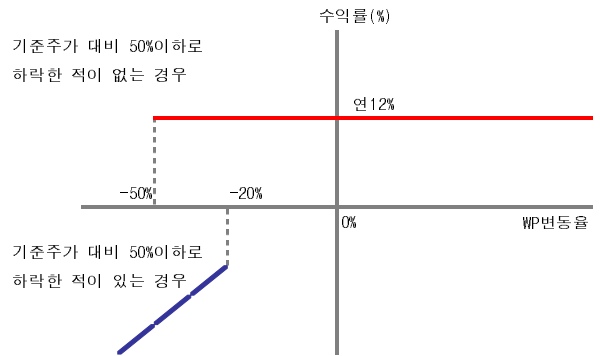
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669313WB1 동양(ELS)347

[3-1] 메리츠2Star증권KISE-2호

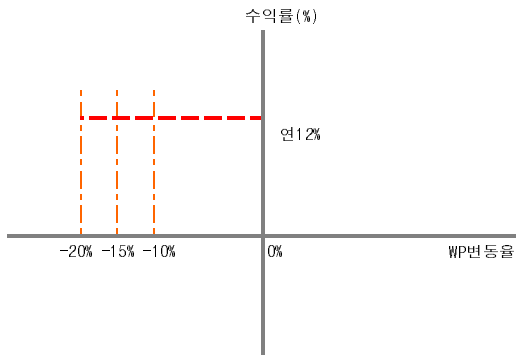
1. 계약금액

단위(백만원)

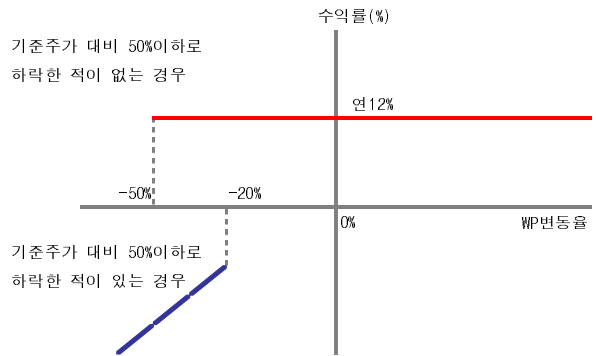
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

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 시나 리오	8.00%	(1.98)	(2.06)	(2.13)	(2.21)	(2.29)	(2.36)	(2.44)
	5.33%	(0.70)	(0.78)	(0.86)	(0.93)	(1.01)	(1.08)	(1.16)
	2.67%	0.03	(0.04)	(0.12)	(0.20)	(0.27)	(0.35)	(0.42)
	0.00%	0.23	0.15	0.08	0.00	(0.08)	(0.15)	(0.23)
	-2.67%	(0.12)	(0.19)	(0.27)	(0.35)	(0.42)	(0.50)	(0.57)
	-5.33%	(1.00)	(1.08)	(1.16)	(1.23)	(1.31)	(1.39)	(1.46)
	-8.00%	(2.43)	(2.51)	(2.59)	(2.66)	(2.74)	(2.81)	(2.89)

최대손실 시나리오

위험액	-2.89
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.27
-----	------

[3-2]

메리츠2Star증권KISE-2호

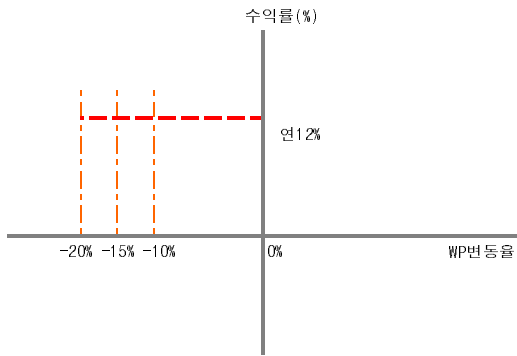
1. 계약금액

단위(백만원)

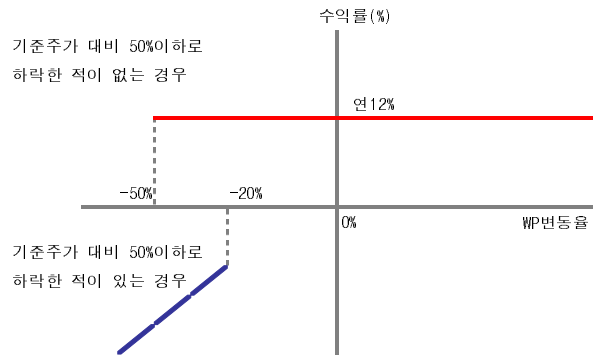
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6549319WB4 신영증권(ELS)1314

[3-3]

메리츠2Star증권KISE-2호

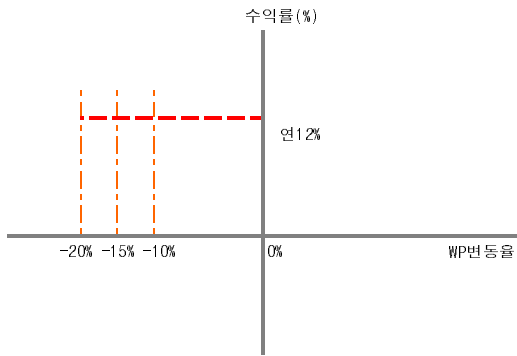
1. 계약금액

단위(백만원)

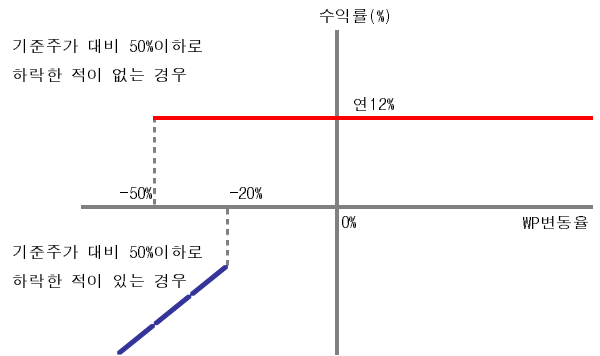
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6589315WB3 현대증권(ELS)2009-1123

[3-4]

메리츠2Star증권KISE-2호

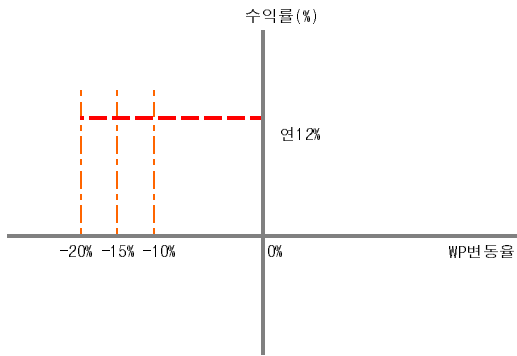
1. 계약금액

단위(백만원)

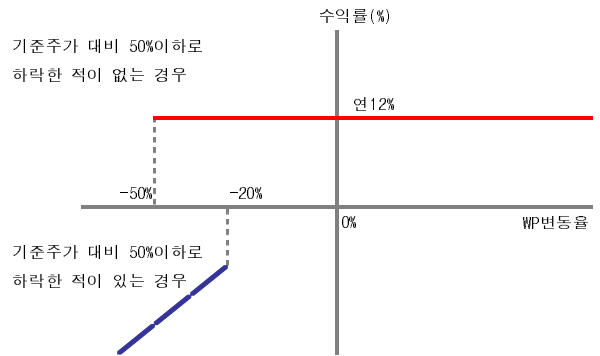
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,053	0	1,053	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669325WB5 동양(ELS)358

[4-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

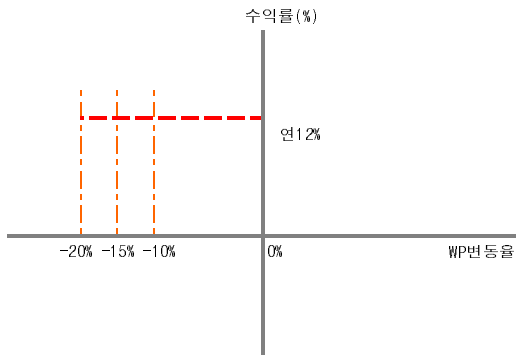
1. 계약금액

단위(백만원)

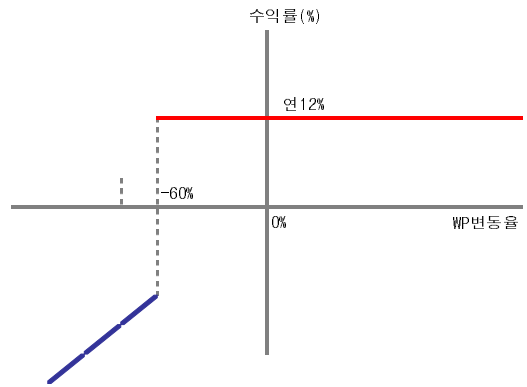
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	8.87	7.00	5.12	3.24	1.37	(0.51)	(2.38)
	5.33%	10.87	8.99	7.12	5.24	3.37	1.49	(0.39)
	2.67%	9.79	7.91	6.04	4.16	2.28	0.41	(1.47)
	0.00%	5.63	3.75	1.88	0.00	(1.88)	(3.75)	(5.63)
	-2.67%	(1.61)	(3.49)	(5.36)	(7.24)	(9.12)	(10.99)	(12.87)
	-5.33%	(11.93)	(13.80)	(15.68)	(17.56)	(19.43)	(21.31)	(23.19)
	-8.00%	(25.32)	(27.20)	(29.08)	(30.95)	(32.83)	(34.71)	(36.58)

최대손실 시나리오

위험액	-36.58
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	31.15
-----	-------

[4-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

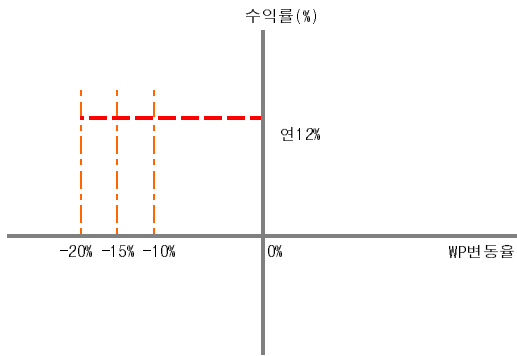
1. 계약금액

단위(백만원)

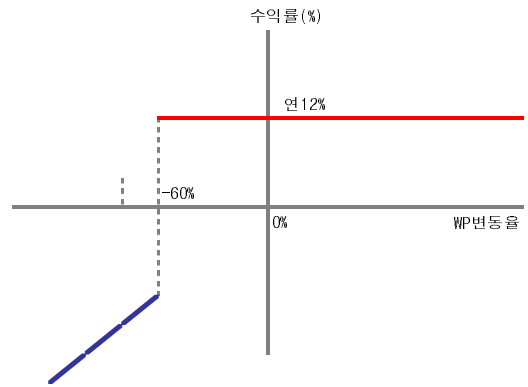
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[4-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

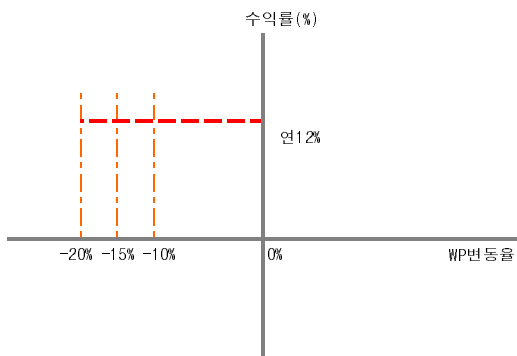
1. 계약금액

단위(백만원)

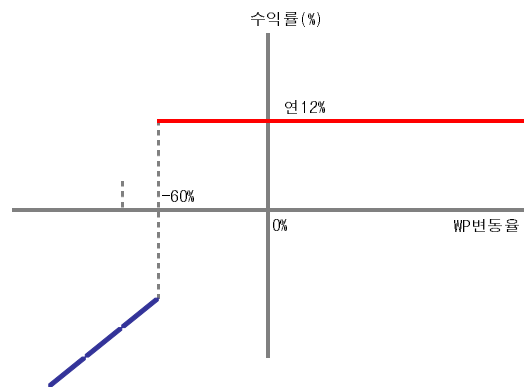
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[4-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

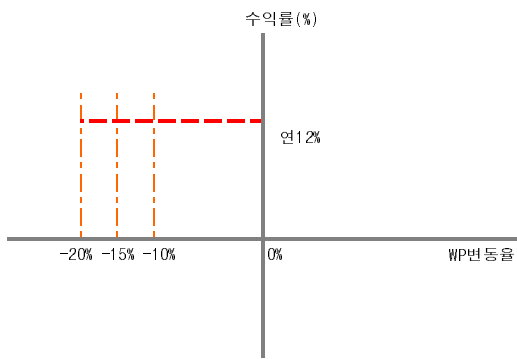
1. 계약금액

단위(백만원)

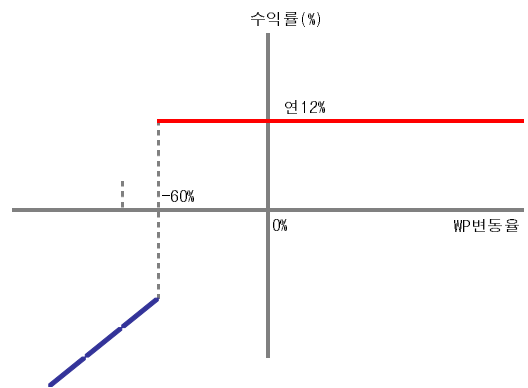
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

[5-1] 메리츠2Star증권SEWF-1호

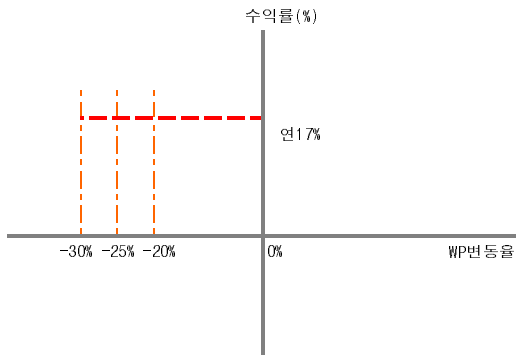
1. 계약금액

단위(백만원)

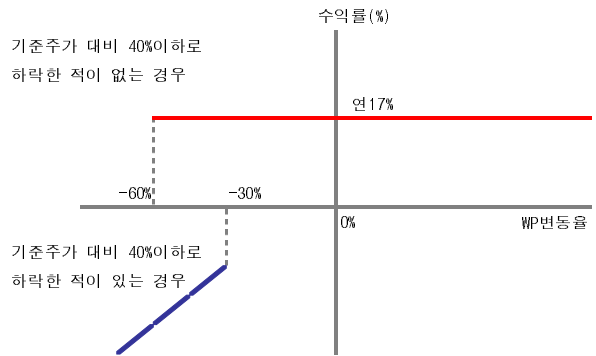
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502301WB7 신한투자(ELS)1206

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	160.29	134.95	109.62	84.28	58.94	33.61	8.27
	5.33%	144.22	118.88	93.55	68.21	42.87	17.54	(7.80)
	2.67%	116.13	90.79	65.45	40.12	14.78	(10.56)	(35.89)
	0.00%	76.01	50.67	25.34	0.00	(25.34)	(50.67)	(76.01)
	-2.67%	23.87	(1.47)	(26.80)	(52.14)	(77.48)	(102.81)	(128.15)
	-5.33%	(40.30)	(65.63)	(90.97)	(116.31)	(141.64)	(166.98)	(192.31)
	-8.00%	(116.49)	(141.82)	(167.16)	(192.49)	(217.83)	(243.17)	(268.50)

최대 손실 시나리오

위험액	-268.50
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	246.62
-----	--------

[5-2]

메리츠2Star증권SEWF-1호

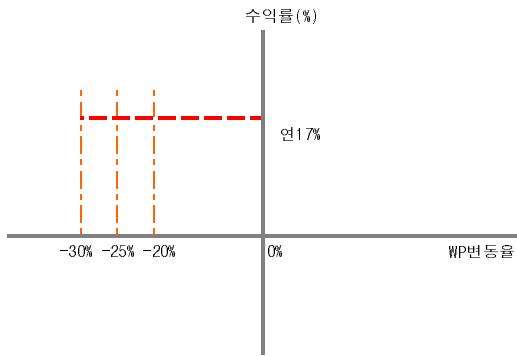
1. 계약금액

단위(백만원)

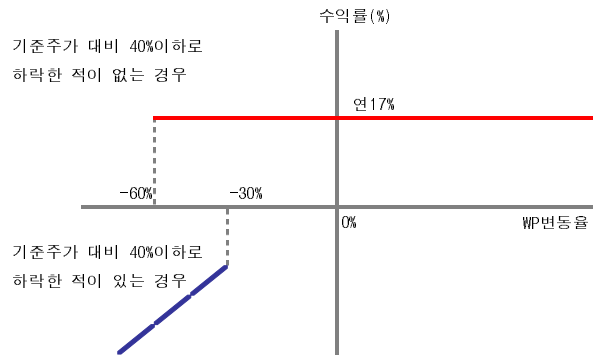
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733

[5-3]

메리츠2Star증권SEWF-1호

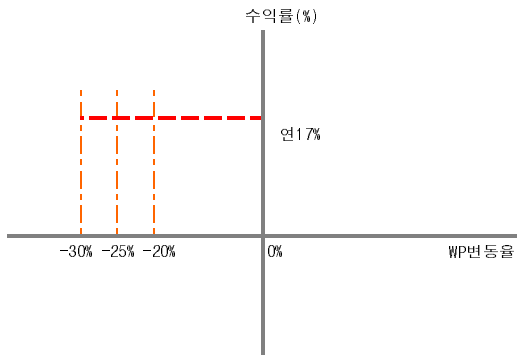
1. 계약금액

단위(백만원)

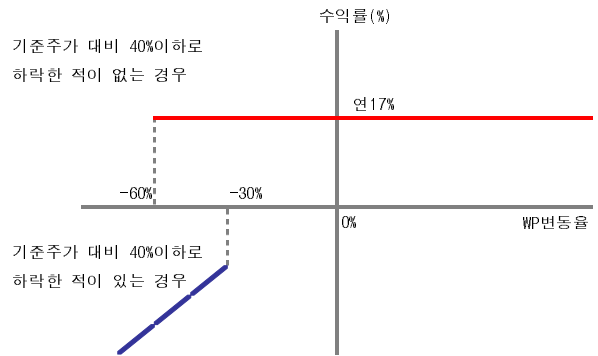
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343

[5-4]

메리츠2Star증권SEWF-1호

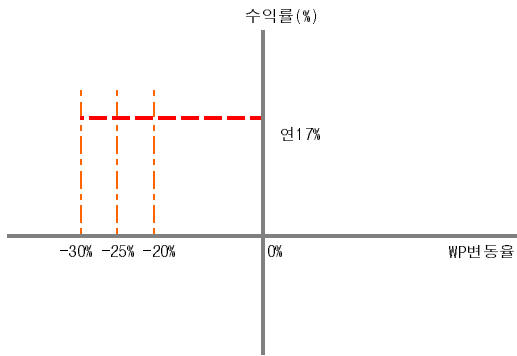
1. 계약금액

단위(백만원)

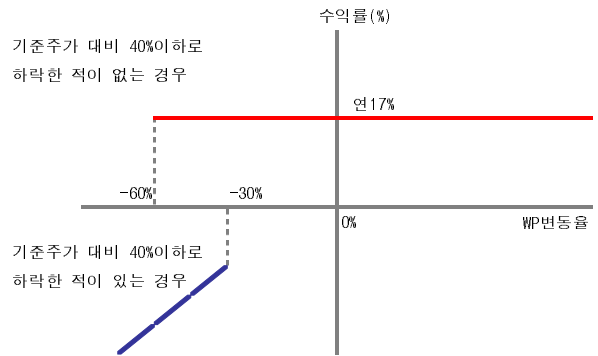
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

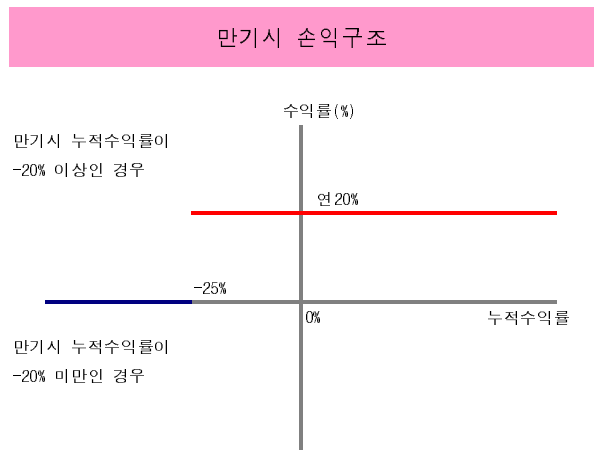
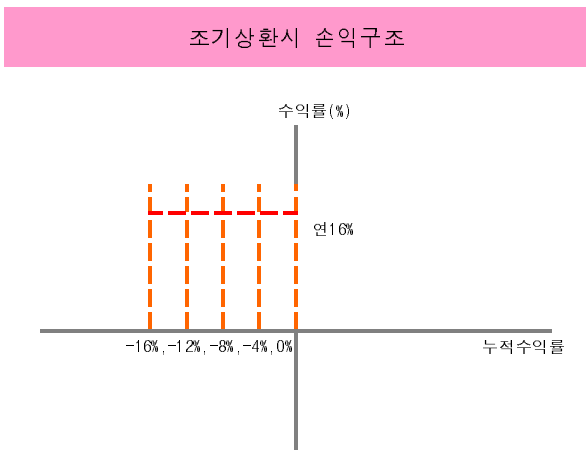
[6] 메리츠클리켓 단위 파생3호

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
-----	------

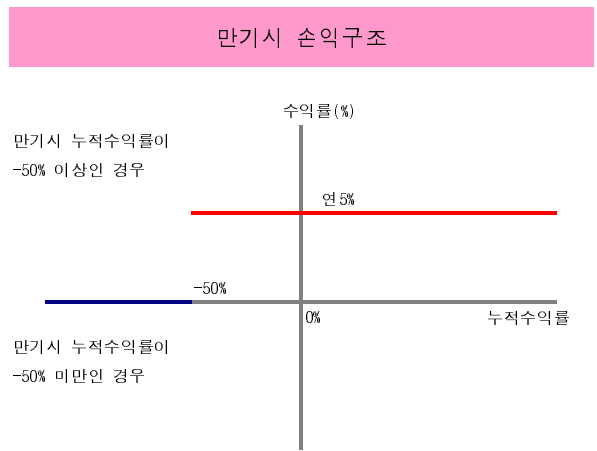
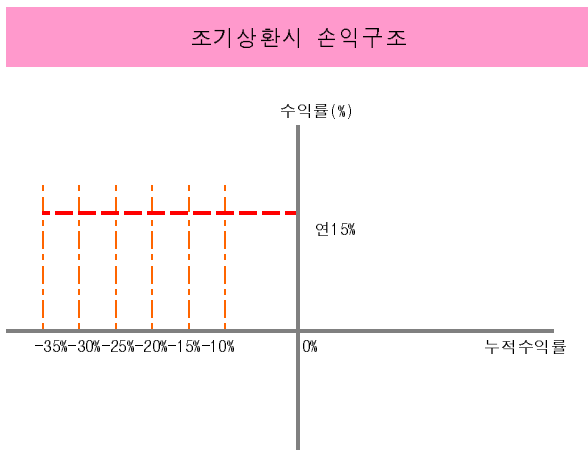
[7] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR603762CT80 미래에셋증권(ELS)191

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-8.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

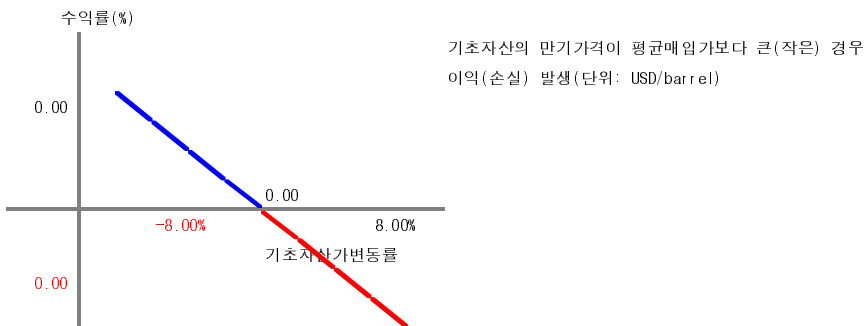
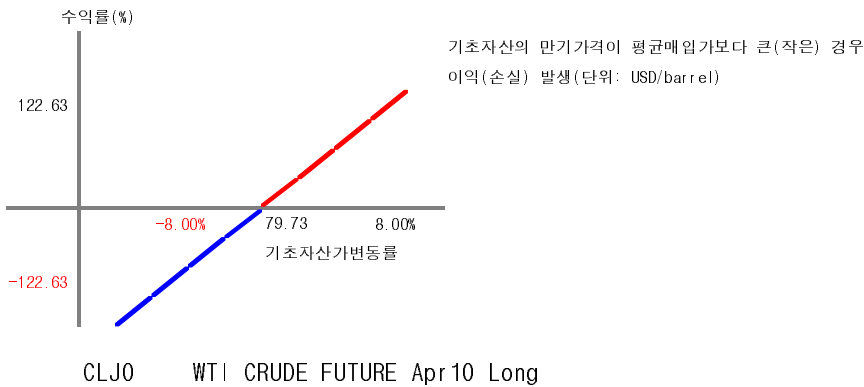
[8] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	19	0	19	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	122.63
	5.33%	81.70
	2.67%	40.93
	0.00%	0.00
	-2.67%	-40.93
	-5.33%	-81.70
	-8.00%	-122.63

최대손실 시나리오	
위험액	-122.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	497
-----	-----

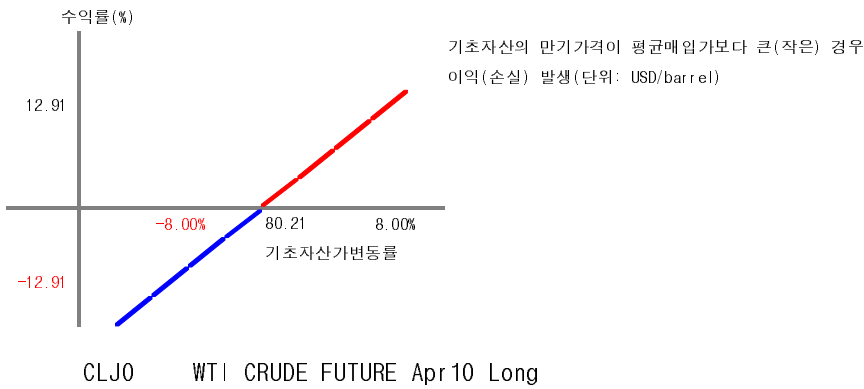
[9] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	12.91
	5.33%	8.60
	2.67%	4.31
	0.00%	0.00
	-2.67%	-4.31
	-5.33%	-8.60
	-8.00%	-12.91

최대손실 시나리오	
위험액	-12.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	51
-----	----

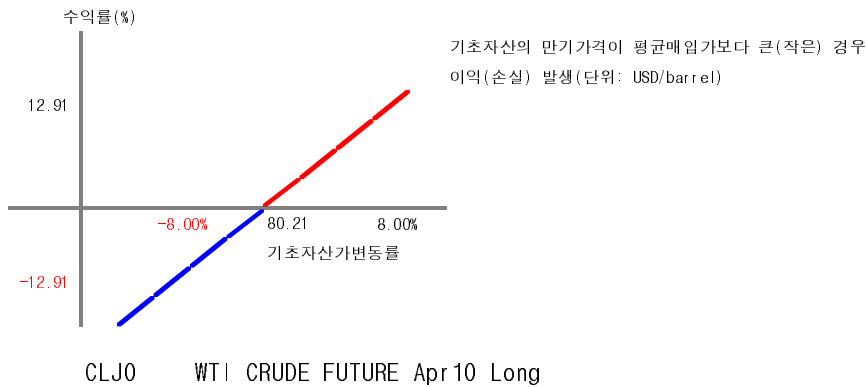
[10-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	42.03
	5.33%	28.00
	2.67%	14.03
	0.00%	0.00
	-2.67%	-14.03
	-5.33%	-28.00
	-8.00%	-42.03

최대손실 시나리오	
위험액	-42.03

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	167
-----	-----

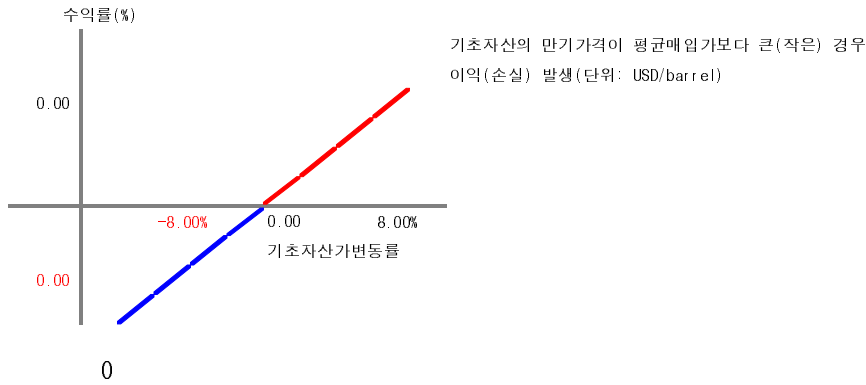
[10-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



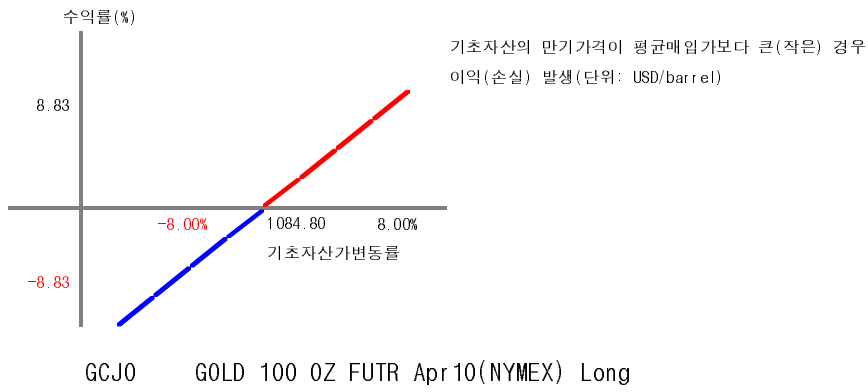
[10-3] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



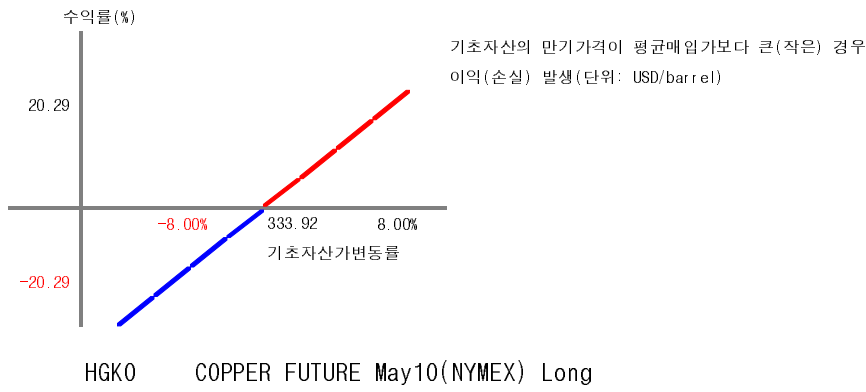
[10-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 만기시점의 손익구조



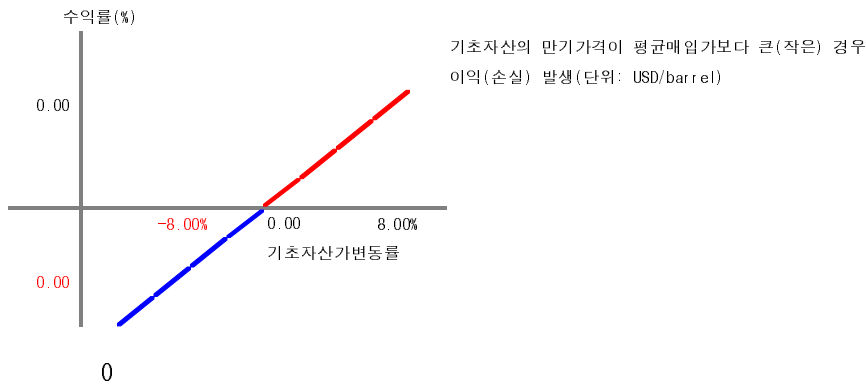
[10-5] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



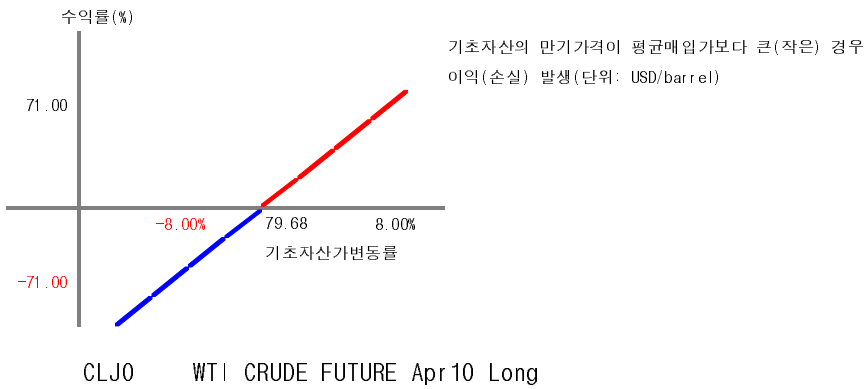
[11] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	71.00
	5.33%	47.30
	2.67%	23.70
	0.00%	0.00
	-2.67%	-23.70
	-5.33%	-47.30
	-8.00%	-71.00

최대손실 시나리오	
위험액	-71.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	267
-----	-----

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

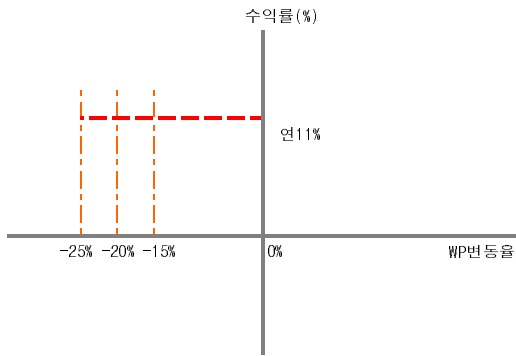
1. 계약금액

단위(백만원)

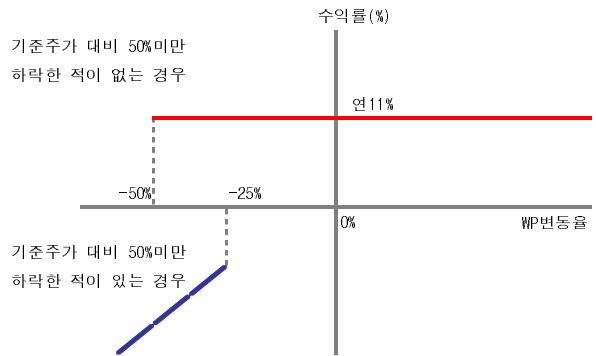
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

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%	18.77	14.83	10.89	6.96	3.02	(0.92)	(4.86)
	5.33%	20.39	16.46	12.52	8.58	4.64	0.70	(3.24)
	2.67%	18.08	14.14	10.20	6.26	2.32	(1.62)	(5.55)
	0.00%	11.81	7.88	3.94	0.00	(3.94)	(7.88)	(11.81)
	-2.67%	1.61	(2.33)	(6.27)	(10.20)	(14.14)	(18.08)	(22.02)
	-5.33%	(12.53)	(16.47)	(20.41)	(24.35)	(28.29)	(32.23)	(36.16)
	-8.00%	(30.62)	(34.56)	(38.50)	(42.44)	(46.38)	(50.31)	(54.25)

최대손실 시나리오

위험액	-54.25
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	50.16
-----	-------

[12-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

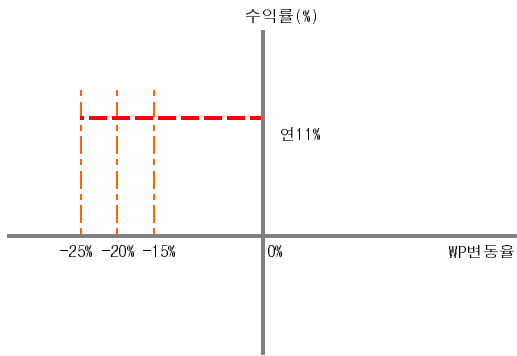
1. 계약금액

단위(백만원)

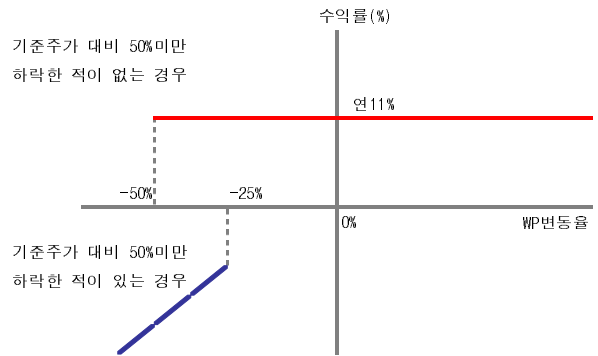
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

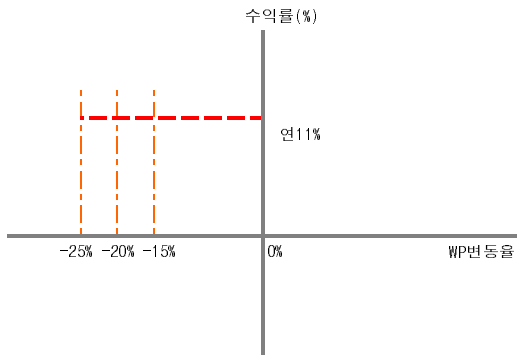
1. 계약금액

단위(백만원)

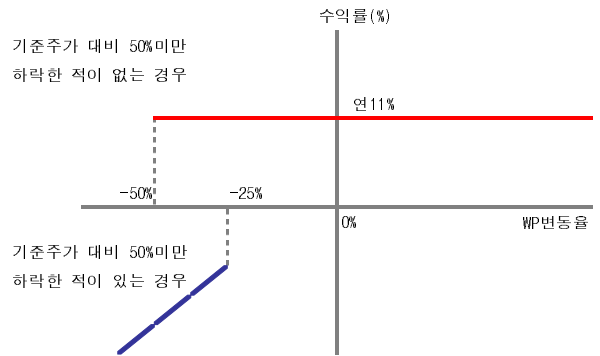
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[12-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

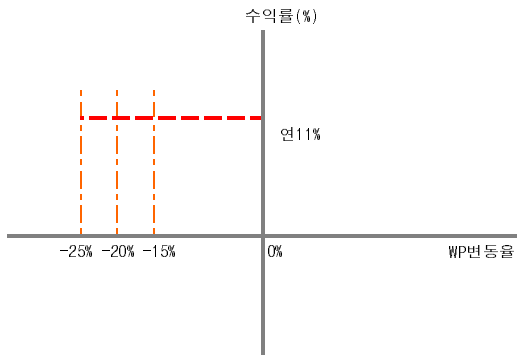
1. 계약금액

단위(백만원)

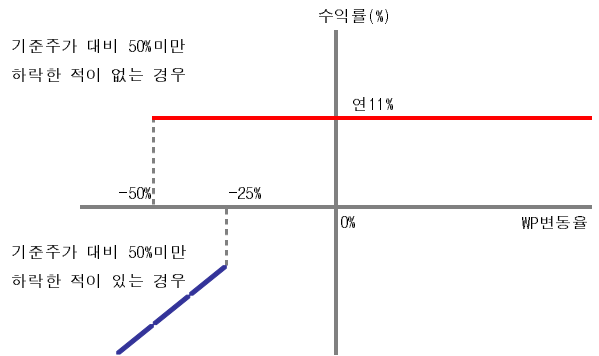
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[13-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

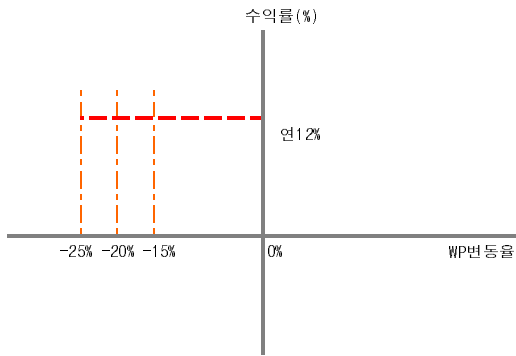
1. 계약금액

단위(백만원)

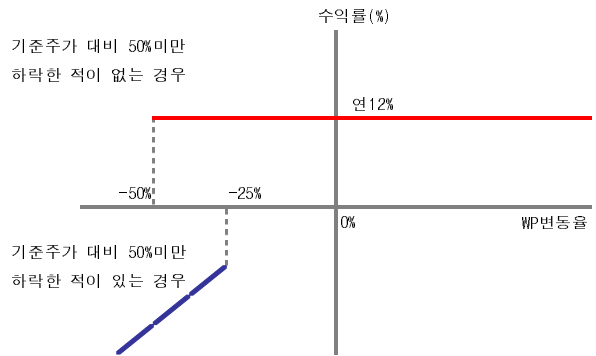
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513340WC0 대신증권(ELS)920

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	34.34	29.36	24.39	19.41	14.44	9.46	4.49
	5.33%	31.31	26.33	21.36	16.38	11.41	6.43	1.46
	2.67%	24.84	19.86	14.89	9.91	4.94	(0.04)	(5.01)
	0.00%	14.92	9.95	4.97	0.00	(4.97)	(9.95)	(14.92)
	-2.67%	1.57	(3.40)	(8.38)	(13.35)	(18.33)	(23.30)	(28.28)
	-5.33%	(15.23)	(20.20)	(25.18)	(30.15)	(35.12)	(40.10)	(45.07)
	-8.00%	(35.46)	(40.44)	(45.41)	(50.39)	(55.36)	(60.34)	(65.31)

최대손실 시나리오

위험액	-65.31
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	61.03
-----	-------

[13-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

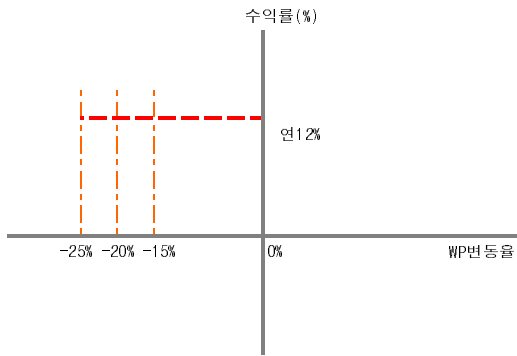
1. 계약금액

단위(백만원)

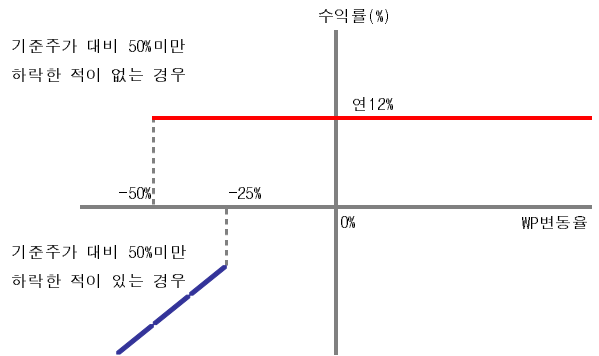
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[13-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

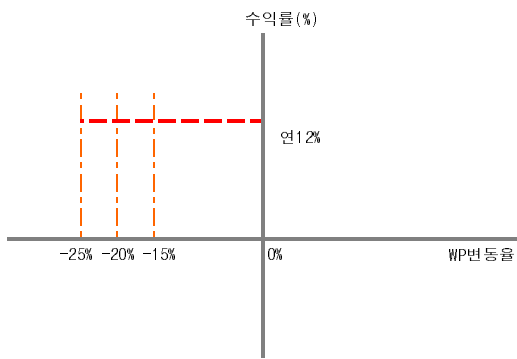
1. 계약금액

단위(백만원)

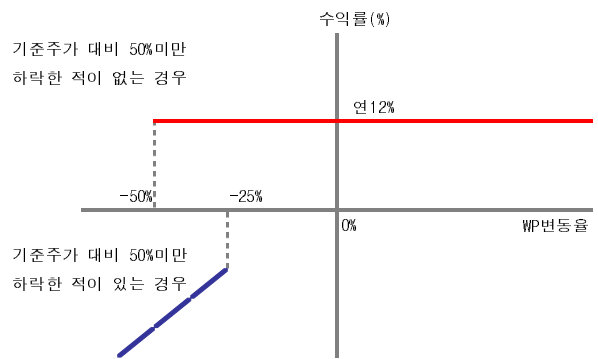
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[13-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

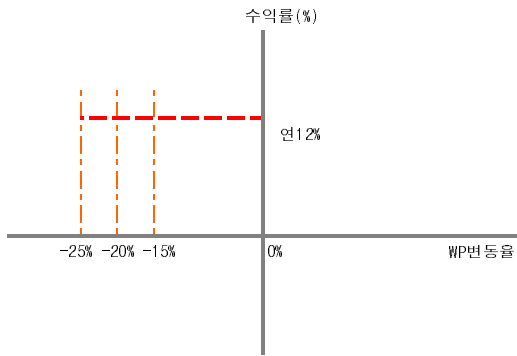
1. 계약금액

단위(백만원)

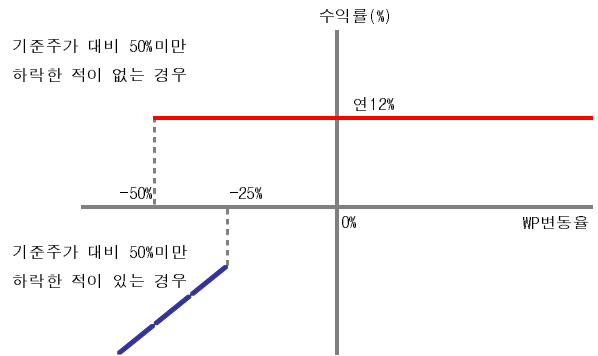
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[14-1] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

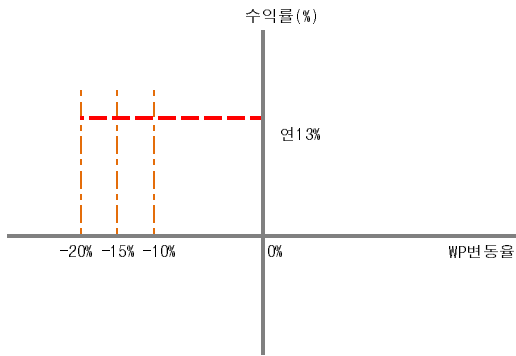
1. 계약금액

단위(백만원)

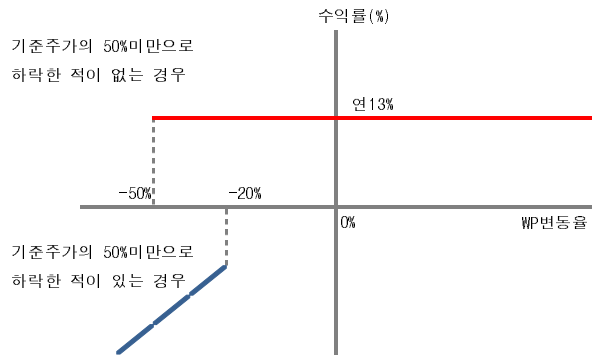
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503338016 신한투자(ELS)1316

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	8.34	6.58	4.81	3.04	1.27	(0.50)	(2.27)
	5.33%	10.41	8.64	6.87	5.10	3.33	1.57	(0.20)
	2.67%	9.40	7.63	5.86	4.09	2.32	0.55	(1.22)
	0.00%	5.31	3.54	1.77	0.00	(1.77)	(3.54)	(5.31)
	-2.67%	(1.86)	(3.63)	(5.40)	(7.17)	(8.94)	(10.71)	(12.48)
	-5.33%	(12.11)	(13.88)	(15.65)	(17.42)	(19.19)	(20.96)	(22.73)
	-8.00%	(25.44)	(27.21)	(28.98)	(30.75)	(32.52)	(34.29)	(36.06)

최대손실 시나리오

위험액	-36.06
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	42.81
-----	-------

[14-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

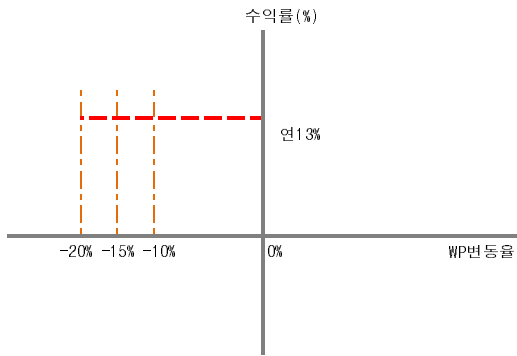
1. 계약금액

단위(백만원)

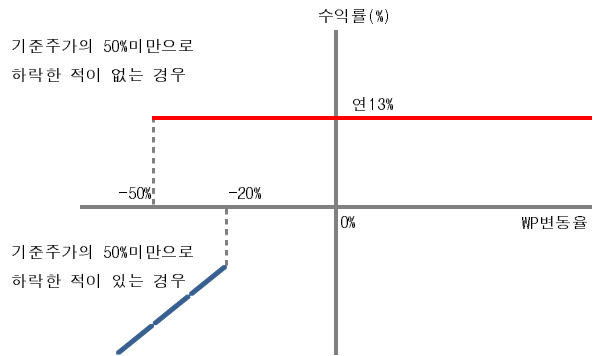
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[14-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

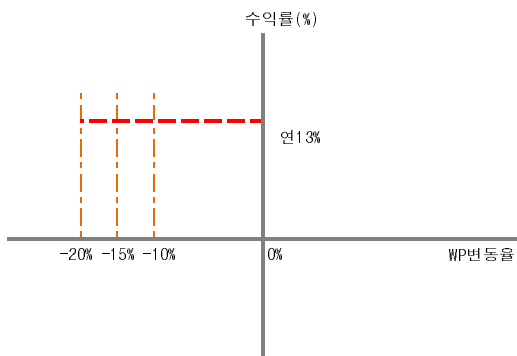
1. 계약금액

단위(백만원)

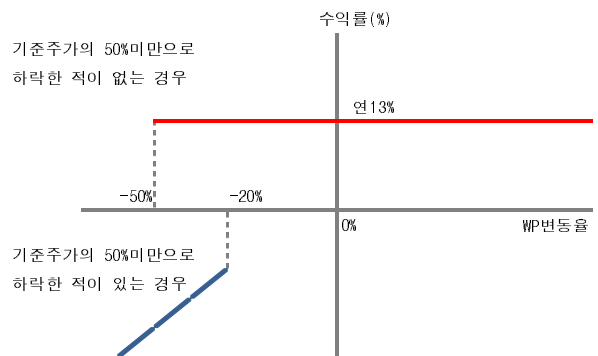
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[14-4] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

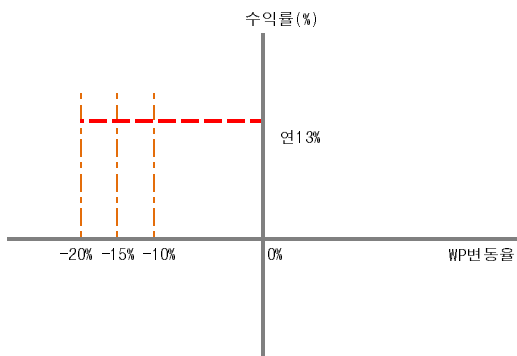
1. 계약금액

단위(백만원)

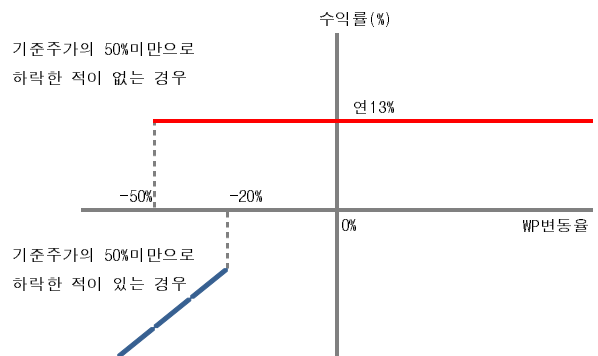
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703338014 H&D증권(ELS)431

[15-1] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

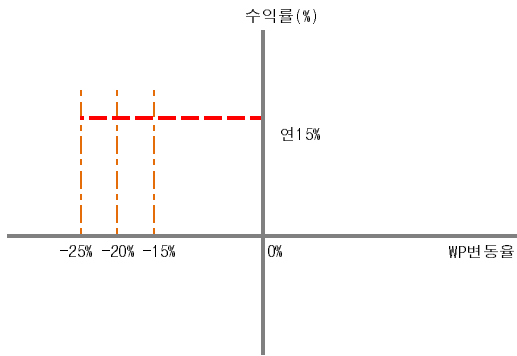
1. 계약금액

단위(백만원)

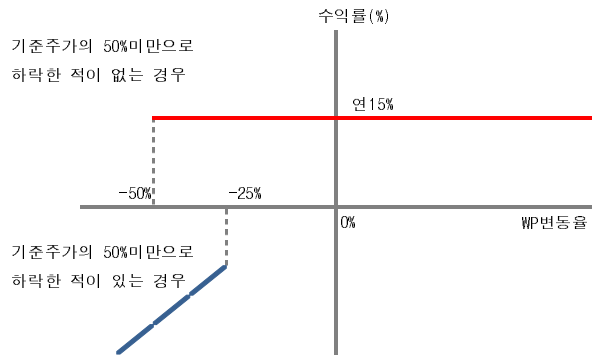
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512111024 대신증권(ELS)966

구분	변동성 시나리오							
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	134.50	110.72	86.93	63.15	39.36	15.58	(8.21)
	5.33%	117.01	93.22	69.44	45.66	21.87	(1.91)	(25.70)
	2.67%	95.96	72.18	48.39	24.61	0.82	(22.96)	(46.75)
	0.00%	71.35	47.57	23.78	0.00	(23.78)	(47.57)	(71.35)
	-2.67%	43.19	19.41	(4.38)	(28.16)	(51.95)	(75.73)	(99.52)
	-5.33%	11.47	(12.32)	(36.10)	(59.89)	(83.67)	(107.45)	(131.24)
	-8.00%	(23.81)	(47.59)	(71.38)	(95.16)	(118.95)	(142.73)	(166.52)

최대손실 시나리오

위험액	-166.52
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	159.72
-----	--------

[15-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

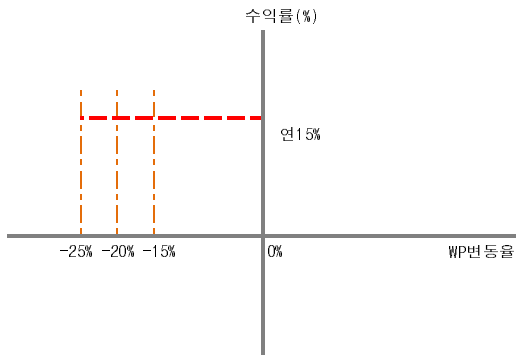
1. 계약금액

단위(백만원)

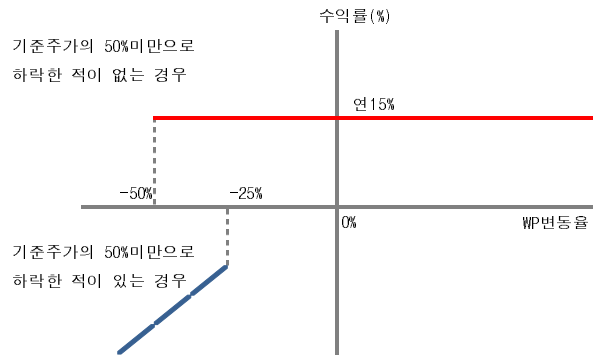
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[15-3]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

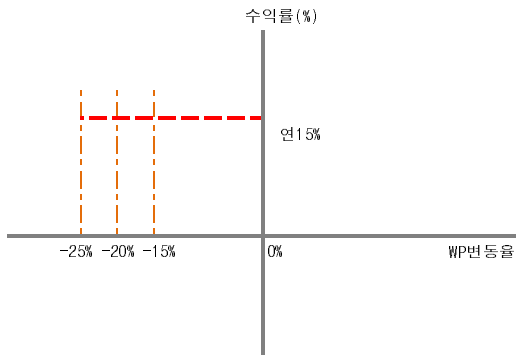
1. 계약금액

단위(백만원)

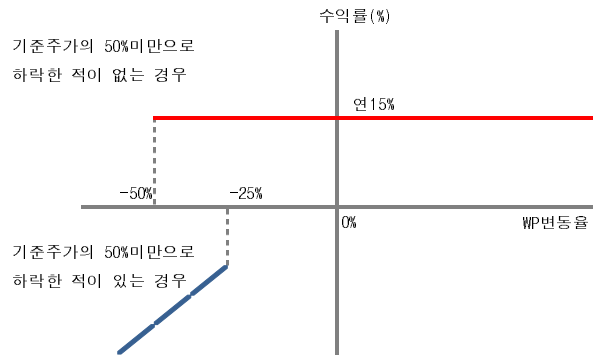
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[15-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

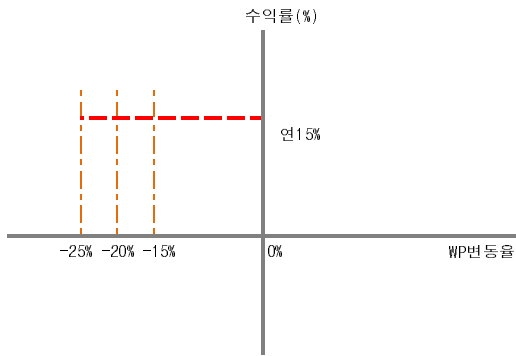
1. 계약금액

단위(백만원)

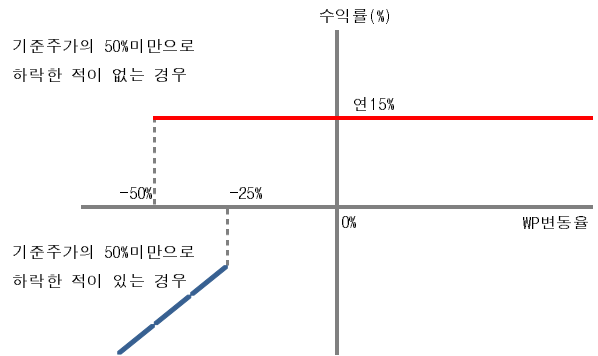
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[16-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

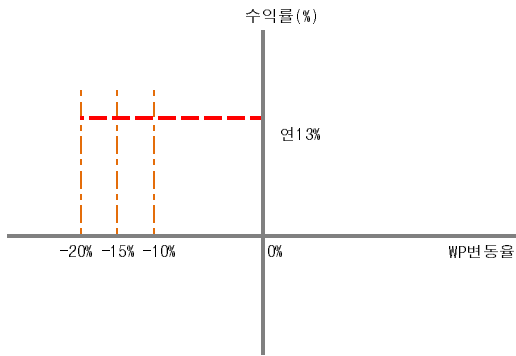
1. 계약금액

단위(백만원)

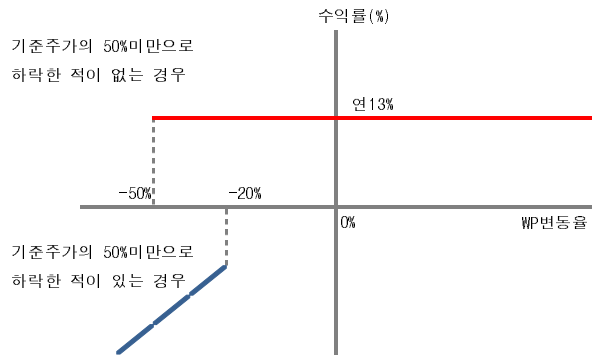
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513101032 대신증권(ELS)993

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	80.83	66.92	53.00	39.09	25.18	11.27	(2.65)
	5.33%	72.99	59.08	45.16	31.25	17.34	3.42	(10.49)
	2.67%	59.96	46.04	32.13	18.22	4.31	(9.61)	(23.52)
	0.00%	41.74	27.83	13.91	0.00	(13.91)	(27.83)	(41.74)
	-2.67%	18.33	4.42	(9.50)	(23.41)	(37.32)	(51.23)	(65.15)
	-5.33%	(10.27)	(24.18)	(38.10)	(52.01)	(65.92)	(79.83)	(93.75)
	-8.00%	(44.06)	(57.97)	(71.88)	(85.80)	(99.71)	(113.62)	(127.53)

최대손실 시나리오

위험액	-127.53
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	111.94
-----	--------

[16-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

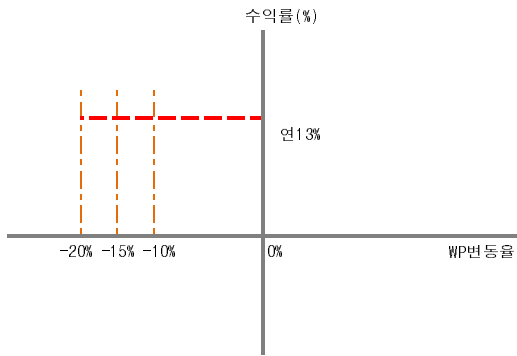
1. 계약금액

단위(백만원)

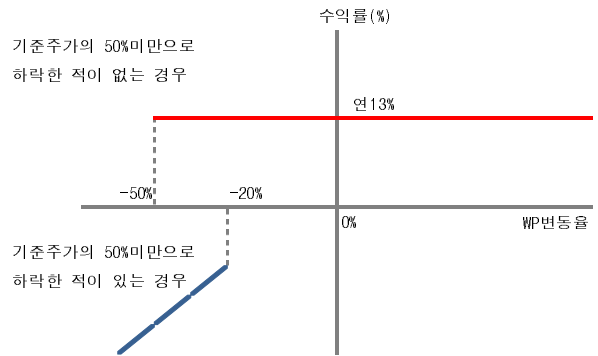
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[16-3] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

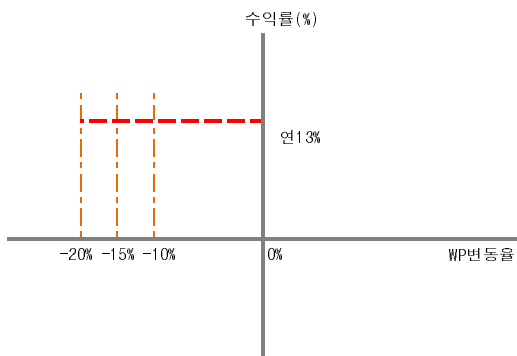
1. 계약금액

단위(백만원)

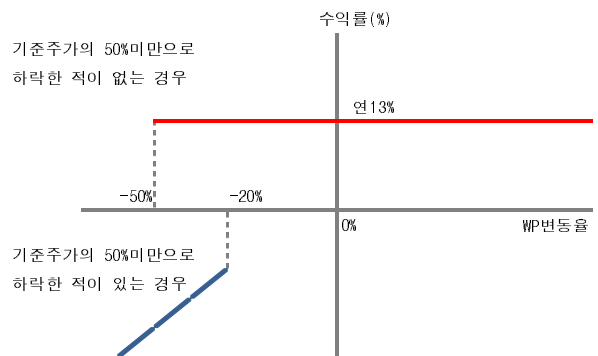
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[16-4] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

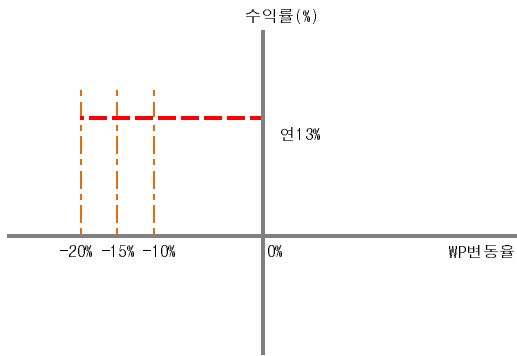
1. 계약금액

단위(백만원)

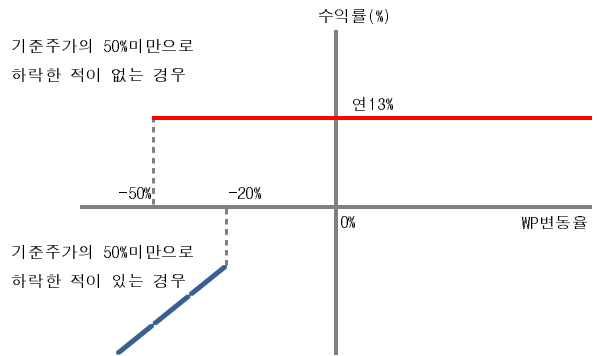
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504