

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권KGSH-1호

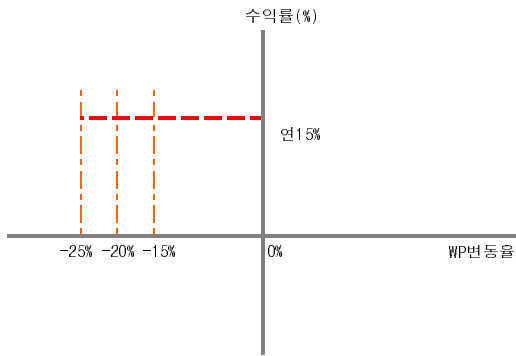
1. 계약금액

단위(백만원)

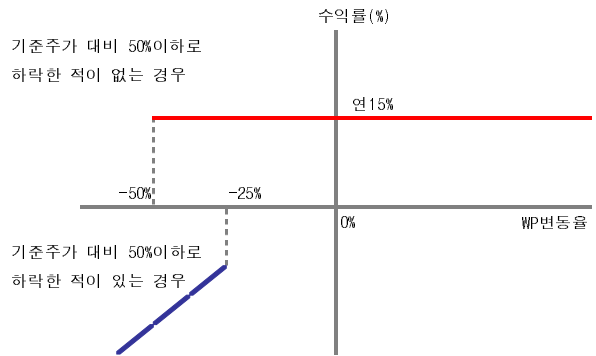
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

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%	127.81	111.18	94.56	77.93	61.31	44.68	28.05
	5.33%	110.99	94.37	77.74	61.11	44.49	27.86	11.24
	2.67%	85.02	68.39	51.76	35.14	18.51	1.88	(14.74)
	0.00%	49.88	33.25	16.63	0.00	(16.63)	(33.25)	(49.88)
	-2.67%	5.58	(11.04)	(27.67)	(44.30)	(60.92)	(77.55)	(94.18)
	-5.33%	(47.88)	(64.50)	(81.13)	(97.75)	(114.38)	(131.01)	(147.63)
	-8.00%	(110.49)	(127.12)	(143.75)	(160.37)	(177.00)	(193.62)	(210.25)

최대손실 시나리오

위험액	-210.25
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	233.25
-----	--------

[1-2]

메리츠2Star증권KGSH-1호

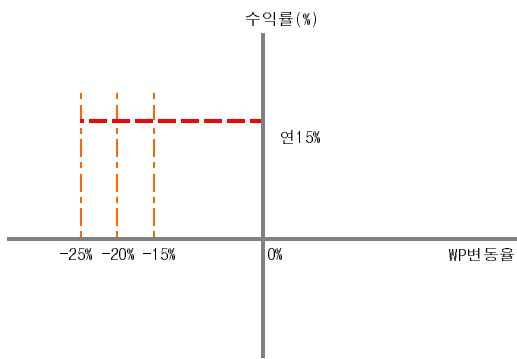
1. 계약금액

단위(백만원)

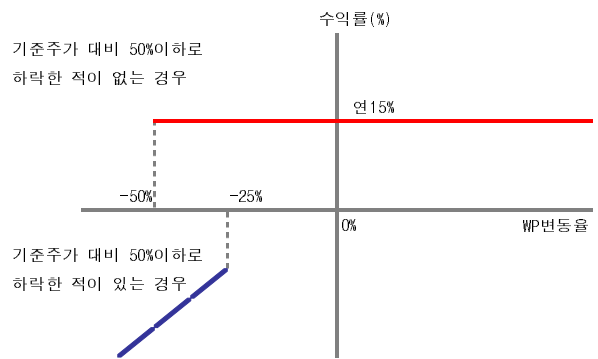
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[1-3]

메리츠2Star증권KGSH-1호

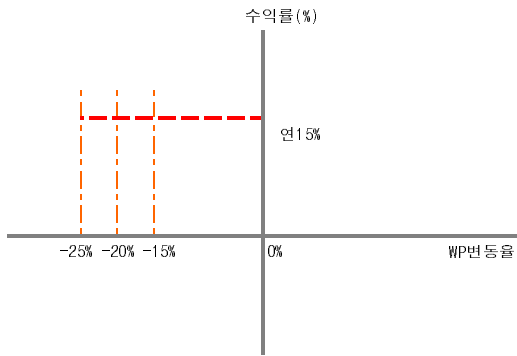
1. 계약금액

단위(백만원)

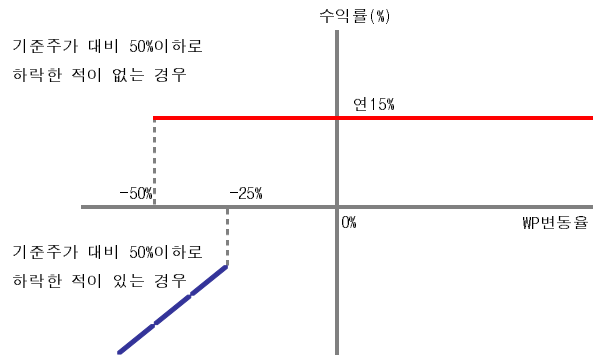
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

[1-4]

메리츠2Star증권KGSH-1호

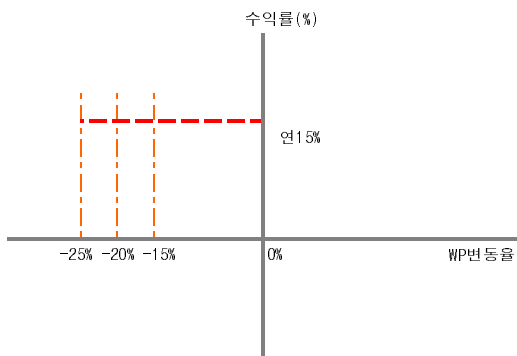
1. 계약금액

단위(백만원)

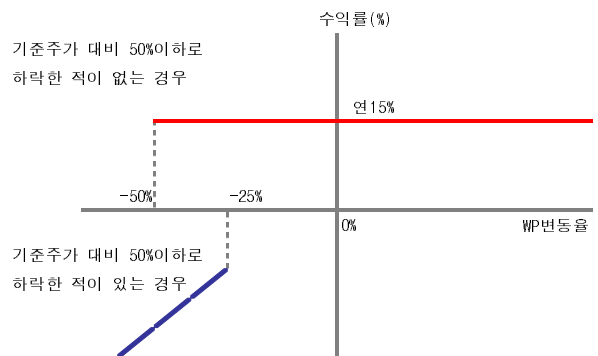
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[2-1] 메리츠2Star증권KISE-1호

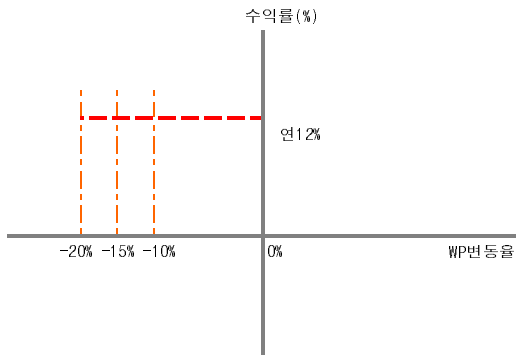
1. 계약금액

단위(백만원)

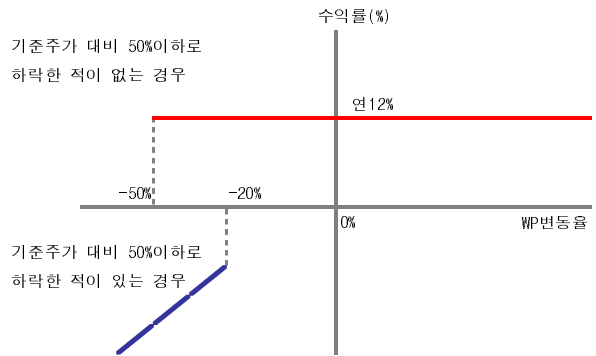
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6509307WB7 신한투자(ELS)1211

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07
	5.33%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	2.67%	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)	(0.02)
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07
	-5.33%	0.18	0.18	0.18	0.18	0.18	0.18	0.18
	-8.00%	0.34	0.34	0.34	0.34	0.34	0.34	0.34

최대 손실 시나리오

위험액	-0.02
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.96
-----	------

[2-2]

메리츠2Star증권KISE-1호

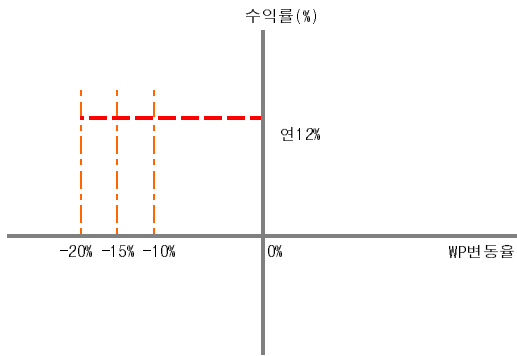
1. 계약금액

단위(백만원)

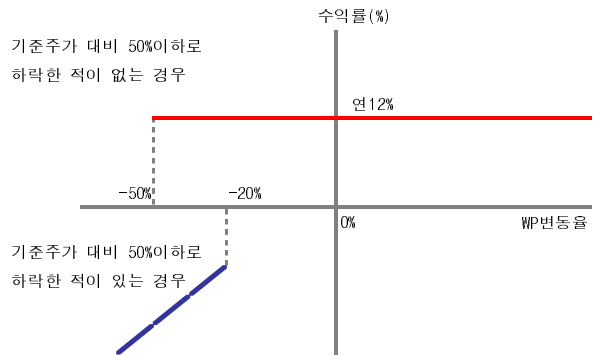
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552329WB7 우리투자증권(ELS)2730

[2-3]

메리츠2Star증권KISE-1호

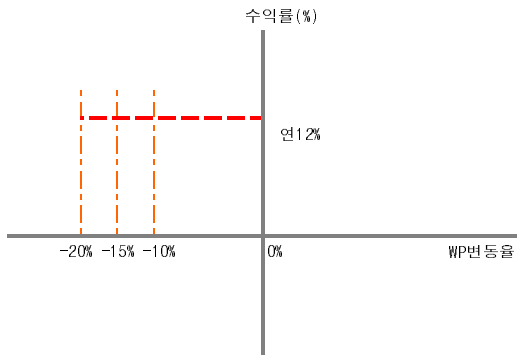
1. 계약금액

단위(백만원)

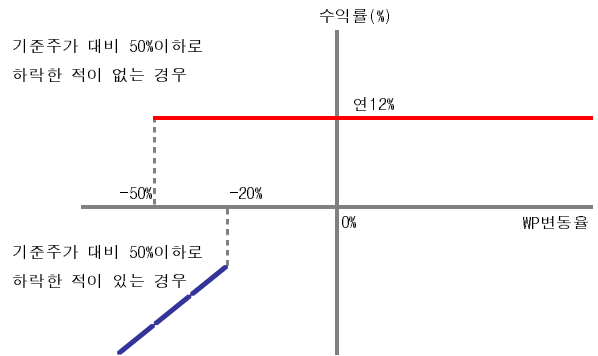
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579318WB9 한국투자증권(ELS)1411

[2-4]

메리츠2Star증권KISE-1호

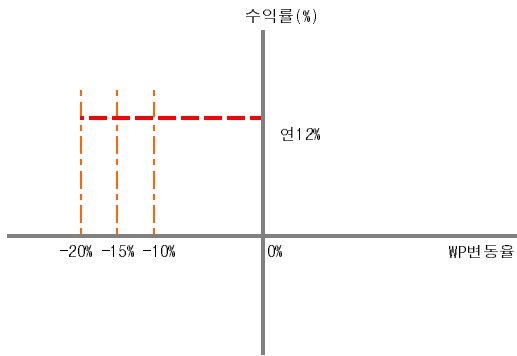
1. 계약금액

단위(백만원)

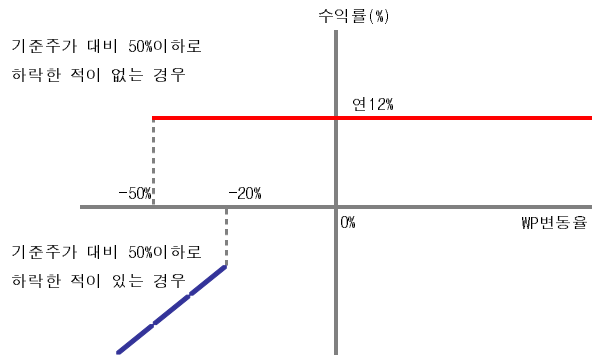
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669313WB1 동양(ELS)347

[3-1] 메리츠2Star증권KISE-2호

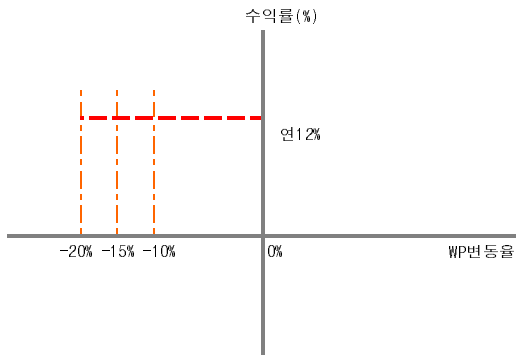
1. 계약금액

단위(백만원)

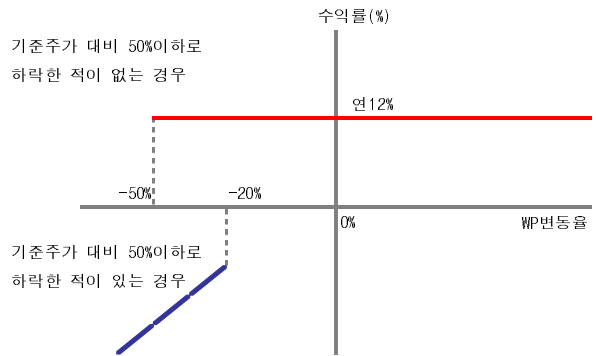
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6509318WB4 신한투자(ELS)1219

구분	기초 자산 시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	0.98	0.99	1.01	1.02	1.04	1.05	1.07
	5.33%	0.42	0.44	0.45	0.47	0.48	0.50	0.51
	2.67%	0.08	0.10	0.11	0.13	0.14	0.15	0.17
	0.00%	(0.04)	(0.03)	(0.01)	0.00	0.01	0.03	0.04
	-2.67%	0.05	0.06	0.08	0.09	0.11	0.12	0.13
	-5.33%	0.35	0.37	0.38	0.40	0.41	0.43	0.44
	-8.00%	0.88	0.89	0.91	0.92	0.94	0.95	0.96

최대 손실 시나리오

위험액	-0.04
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.88
-----	------

[3-2]

메리츠2Star증권KISE-2호

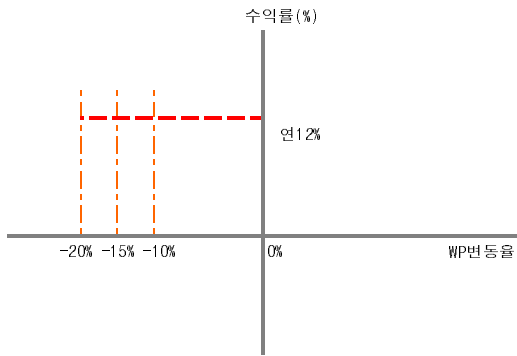
1. 계약금액

단위(백만원)

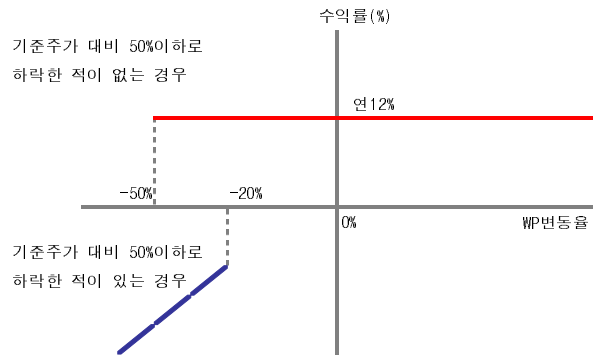
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6549319WB4 신영증권(ELS)1314

[3-3]

메리츠2Star증권KISE-2호

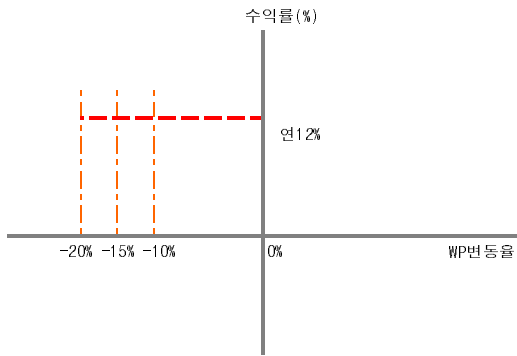
1. 계약금액

단위(백만원)

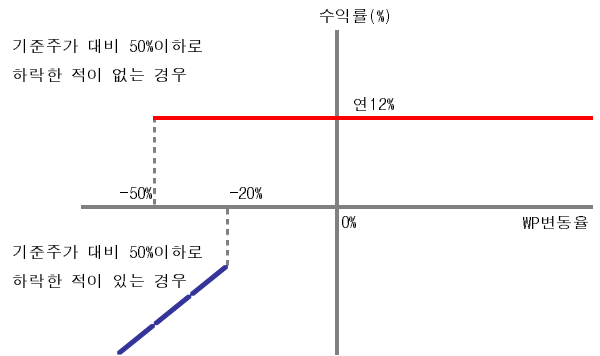
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589315WB3 현대증권(ELS)2009-1123

[3-4]

메리츠2Star증권KISE-2호

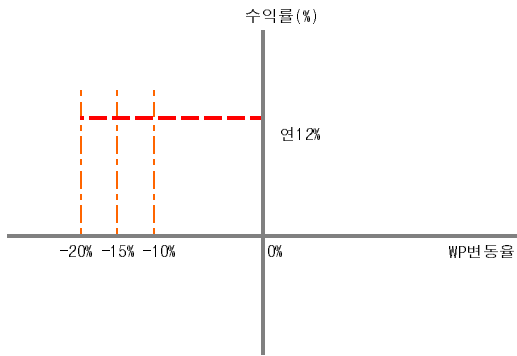
1. 계약금액

단위(백만원)

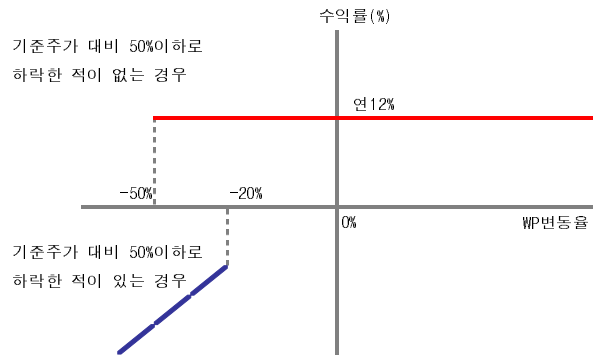
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,053	0	1,053	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669325WB5 동양(ELS)358

[4-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

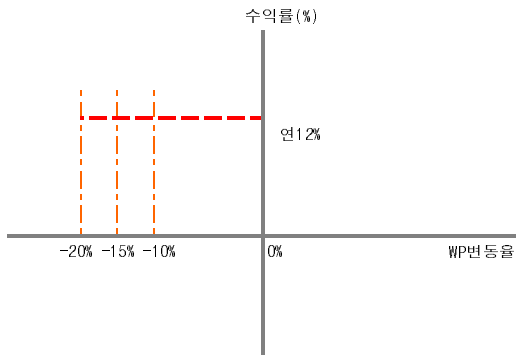
1. 계약금액

단위(백만원)

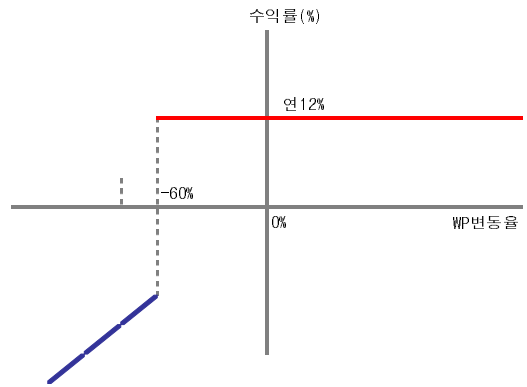
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	4.25	2.66	1.07	(0.52)	(2.11)	(3.70)	(5.29)
	5.33%	7.52	5.93	4.34	2.75	1.16	(0.43)	(2.02)
	2.67%	7.69	6.10	4.51	2.92	1.33	(0.26)	(1.85)
	0.00%	4.77	3.18	1.59	0.00	(1.59)	(3.18)	(4.77)
	-2.67%	(1.25)	(2.84)	(4.43)	(6.02)	(7.61)	(9.20)	(10.79)
	-5.33%	(10.36)	(11.95)	(13.54)	(15.13)	(16.72)	(18.31)	(19.90)
	-8.00%	(22.57)	(24.16)	(25.75)	(27.34)	(28.94)	(30.53)	(32.12)

최대손실 시나리오

위험액	-32.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	35.21
-----	-------

[4-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

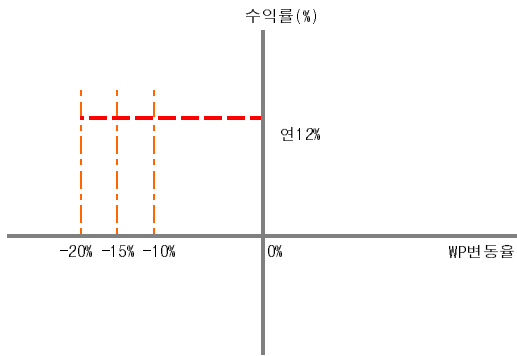
1. 계약금액

단위(백만원)

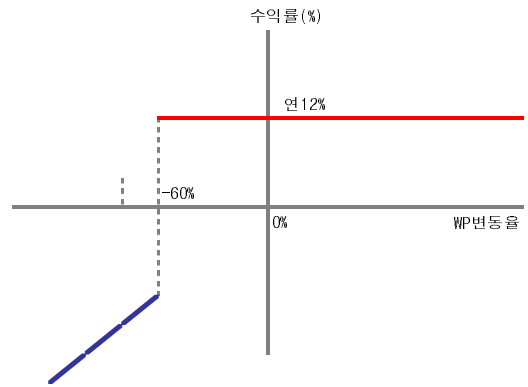
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[4-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

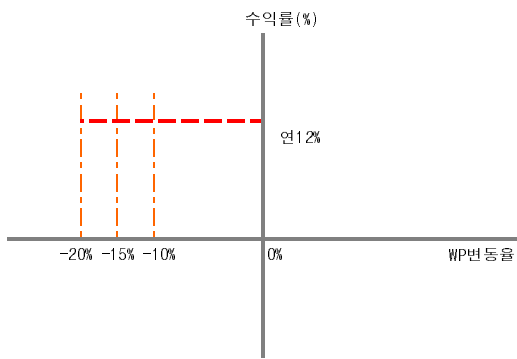
1. 계약금액

단위(백만원)

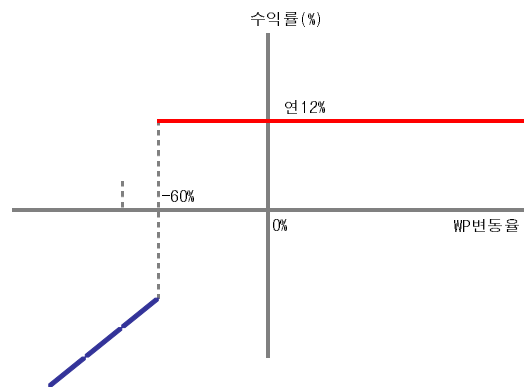
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[4-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

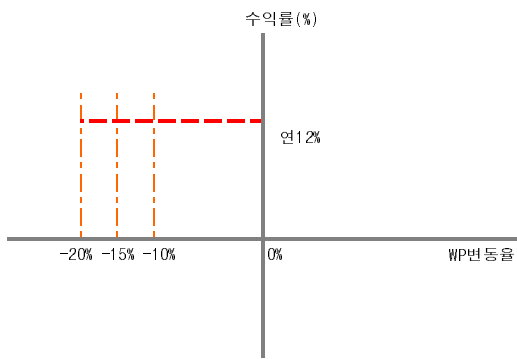
1. 계약금액

단위(백만원)

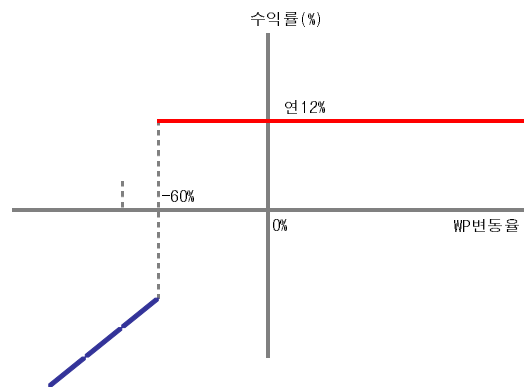
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

[5-1] 메리츠2Star증권SEWF-1호

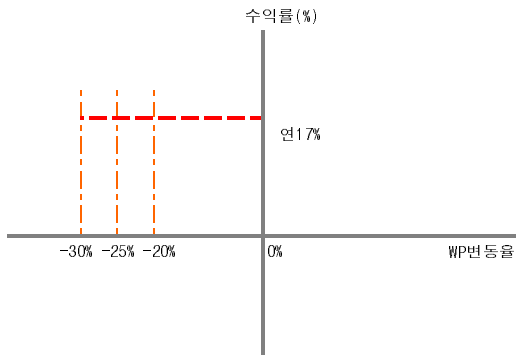
1. 계약금액

단위(백만원)

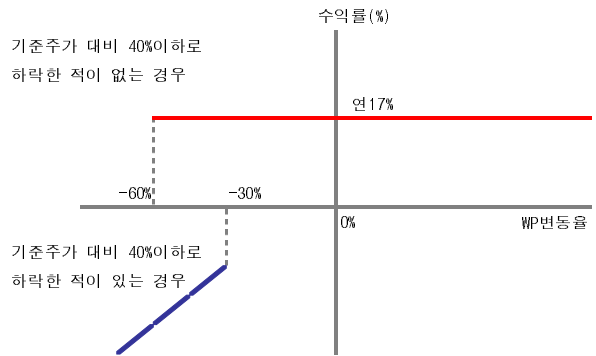
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(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 시나리오	8.00%	30.75	21.03	11.32	1.60	(8.11)	(17.83)	(27.54)
	5.33%	41.86	32.14	22.43	12.71	3.00	(6.71)	(16.43)
	2.67%	41.32	31.61	21.90	12.18	2.47	(7.25)	(16.96)
	0.00%	29.14	19.43	9.71	0.00	(9.71)	(19.43)	(29.14)
	-2.67%	5.32	(4.40)	(14.11)	(23.83)	(33.54)	(43.26)	(52.97)
	-5.33%	(30.16)	(39.87)	(49.59)	(59.30)	(69.02)	(78.73)	(88.45)
	-8.00%	(77.28)	(86.99)	(96.71)	(106.42)	(116.14)	(125.85)	(135.57)

최대손실 시나리오

위험액	-135.57
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	126.57
-----	--------

[5-2]

메리츠2Star증권SEWF-1호

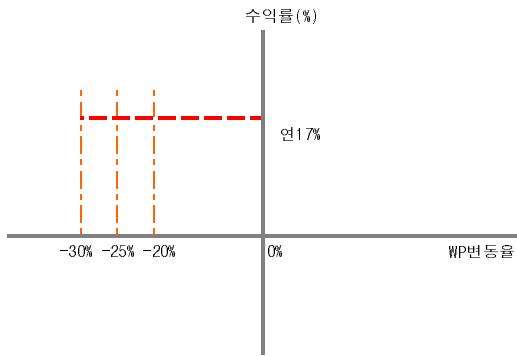
1. 계약금액

단위(백만원)

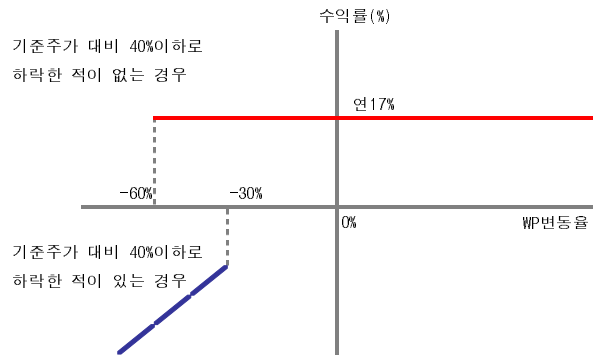
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733

[5-3]

메리츠2Star증권SEWF-1호

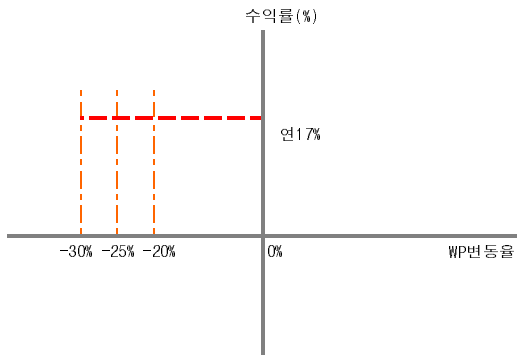
1. 계약금액

단위(백만원)

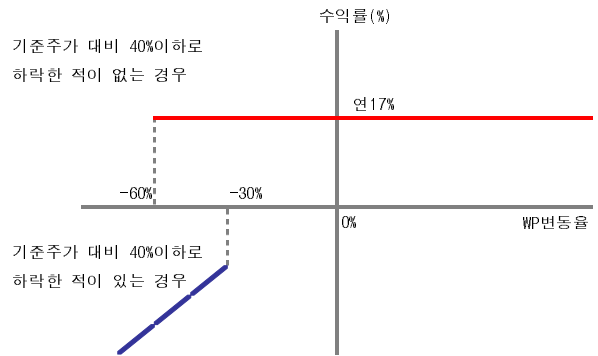
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343

[5-4]

메리츠2Star증권SEWF-1호

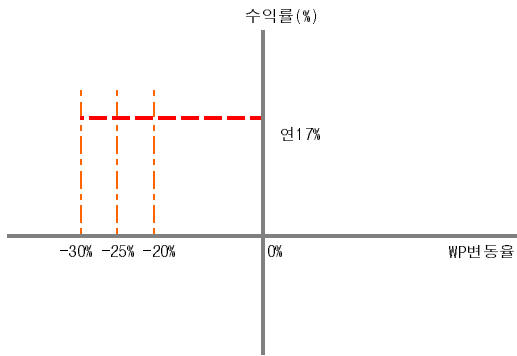
1. 계약금액

단위(백만원)

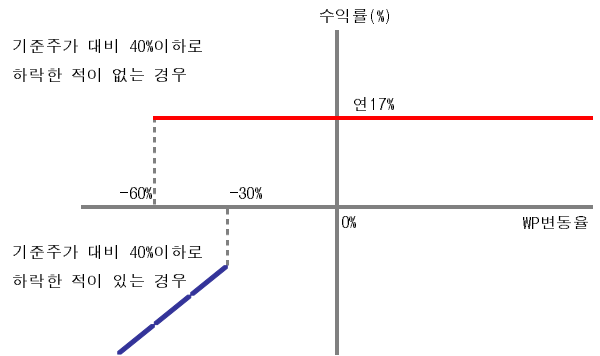
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

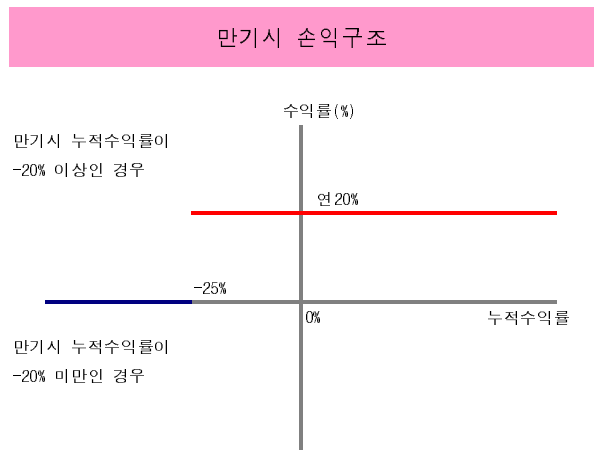
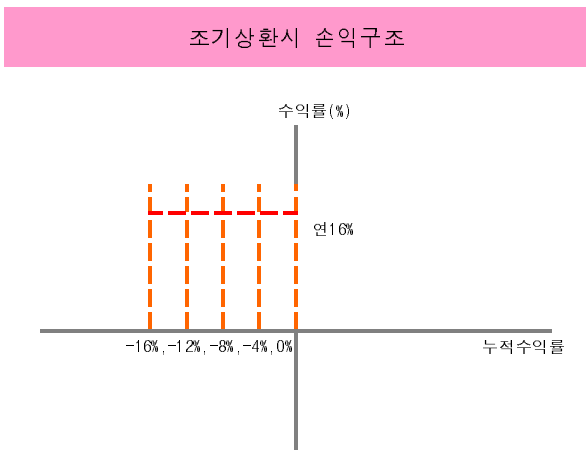
[6] 메리츠크리켓 단위 파생3호

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
-----	------

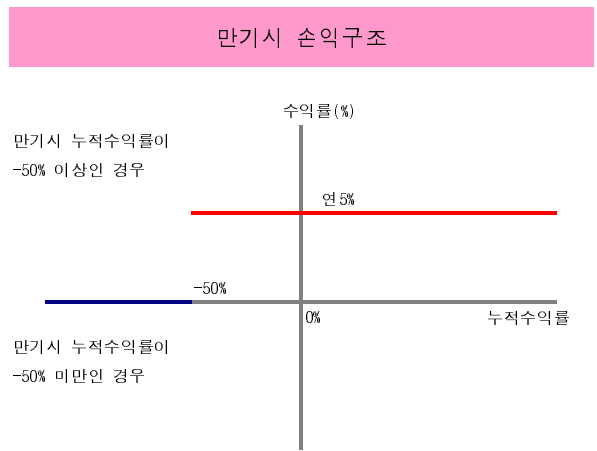
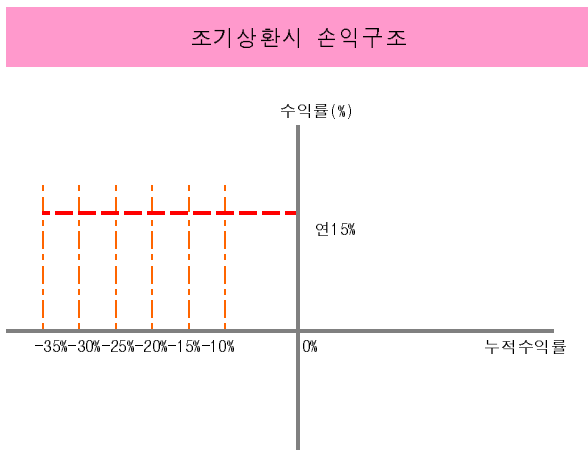
[7] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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(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
-----	------

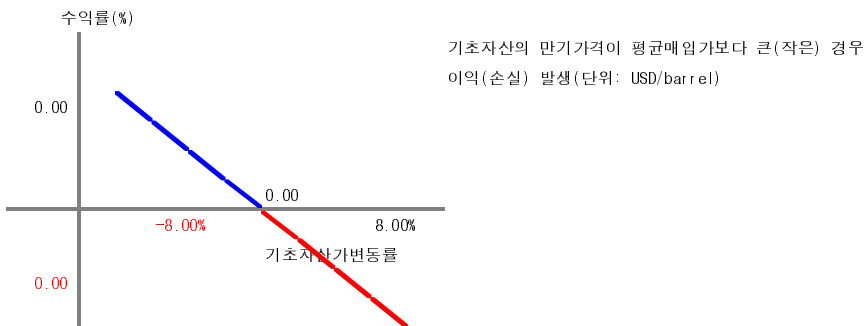
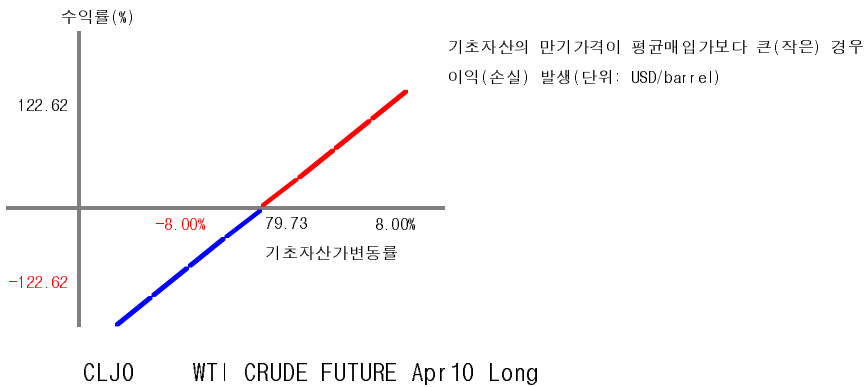
[8] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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%	122.62
	5.33%	81.70
	2.67%	40.92
	0.00%	0.00
	-2.67%	-40.92
	-5.33%	-81.70
	-8.00%	-122.62

최대손실 시나리오	
위험액	-122.62

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	497
-----	-----

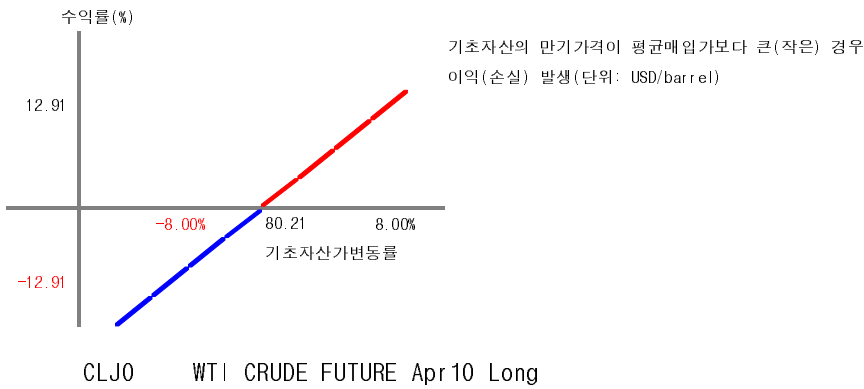
[9] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

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
-----	----

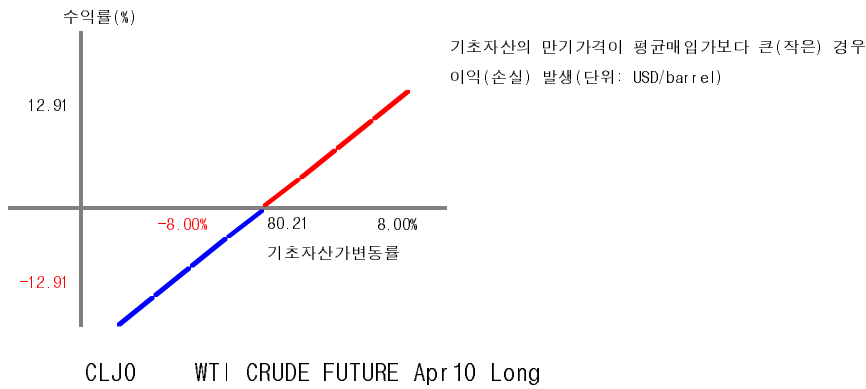
[10-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	43.15
	5.33%	28.75
	2.67%	14.40
	0.00%	0.00
	-2.67%	-14.40
	-5.33%	-28.75
	-8.00%	-43.15

최대손실 시나리오	
위험액	-43.15

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	172
-----	-----

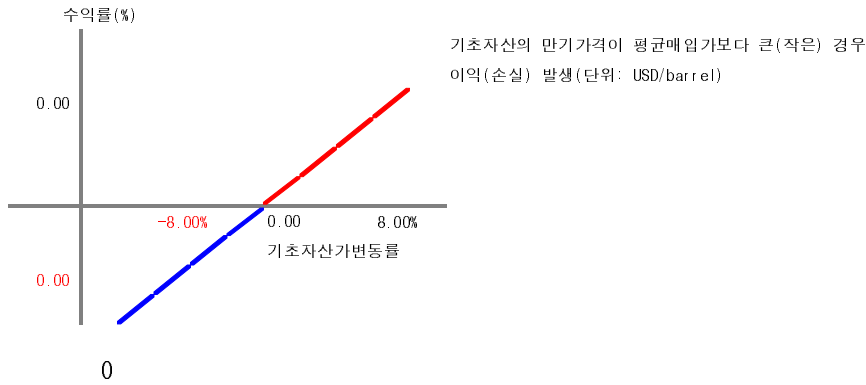
[10-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



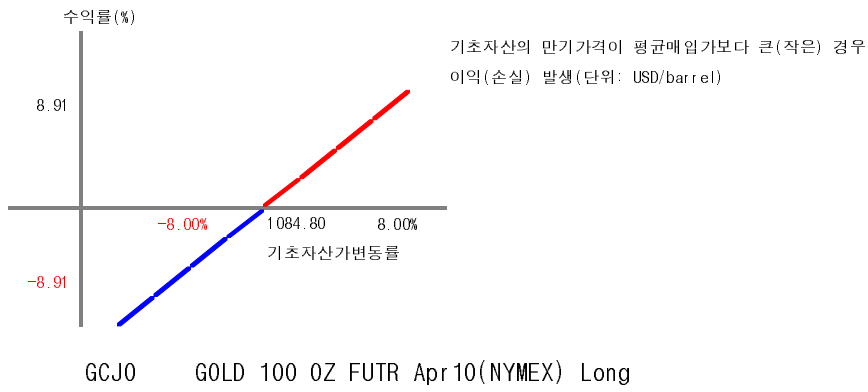
[10-3] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



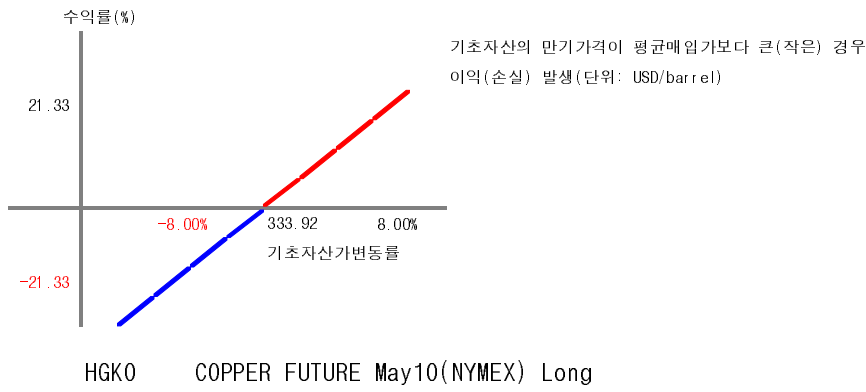
[10-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



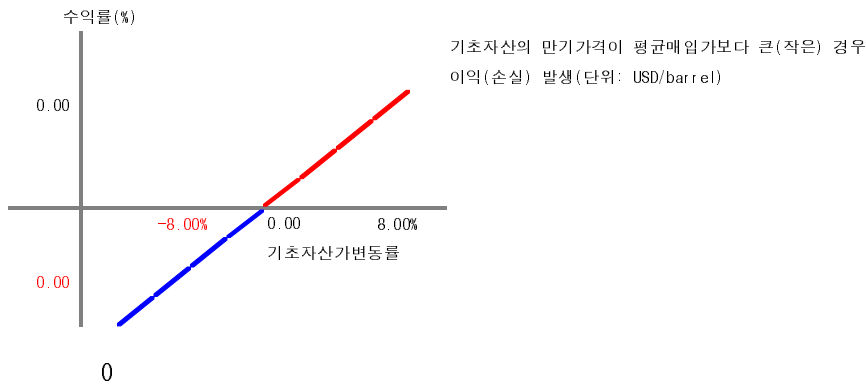
[10-5] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



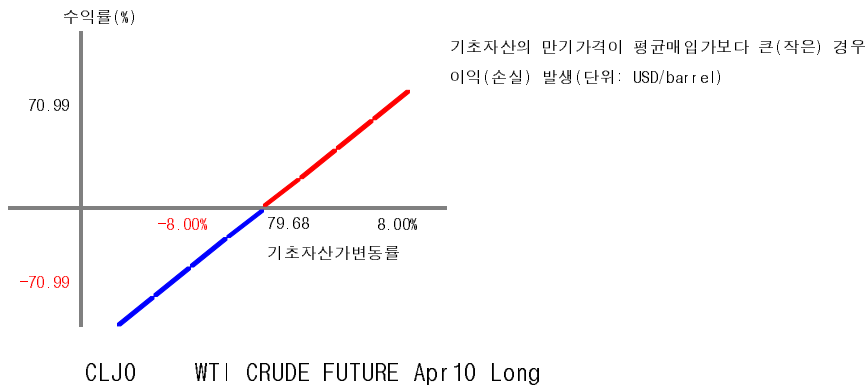
[11] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	70.99
	5.33%	47.30
	2.67%	23.69
	0.00%	0.00
	-2.67%	-23.69
	-5.33%	-47.30
	-8.00%	-70.99

최대손실 시나리오	
위험액	-70.99

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	267
-----	-----

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

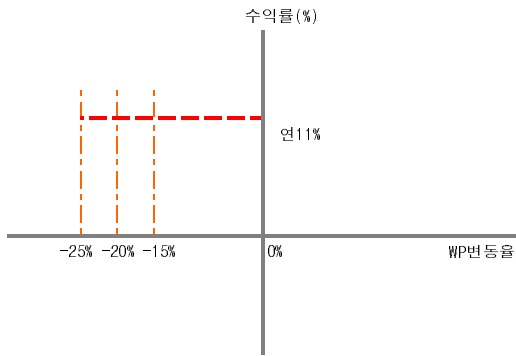
1. 계약금액

단위(백만원)

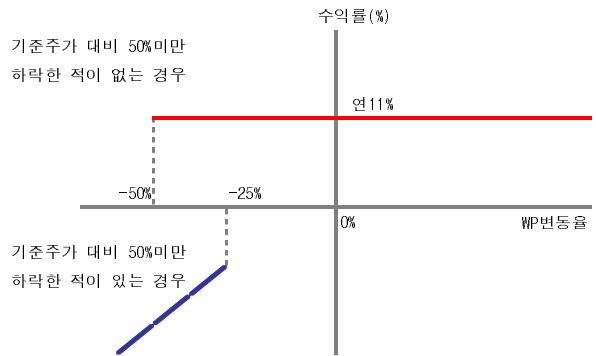
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

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%	9.38	7.08	4.77	2.47	0.17	(2.13)	(4.44)
	5.33%	11.34	9.03	6.73	4.43	2.12	(0.18)	(2.48)
	2.67%	10.51	8.21	5.91	3.60	1.30	(1.00)	(3.31)
	0.00%	6.91	4.61	2.30	0.00	(2.30)	(4.61)	(6.91)
	-2.67%	0.53	(1.78)	(4.08)	(6.38)	(8.69)	(10.99)	(13.29)
	-5.33%	(8.64)	(10.94)	(13.24)	(15.55)	(17.85)	(20.15)	(22.46)
	-8.00%	(20.58)	(22.88)	(25.19)	(27.49)	(29.79)	(32.10)	(34.40)

최대손실 시나리오

위험액	-34.40
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	32.81
-----	-------

[12-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

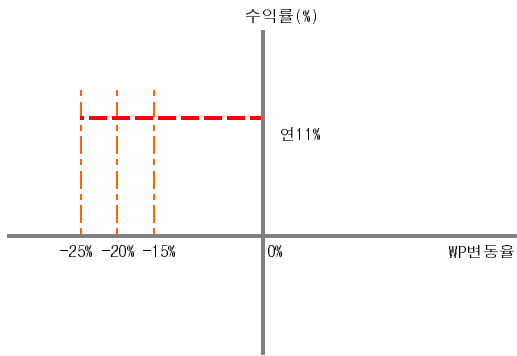
1. 계약금액

단위(백만원)

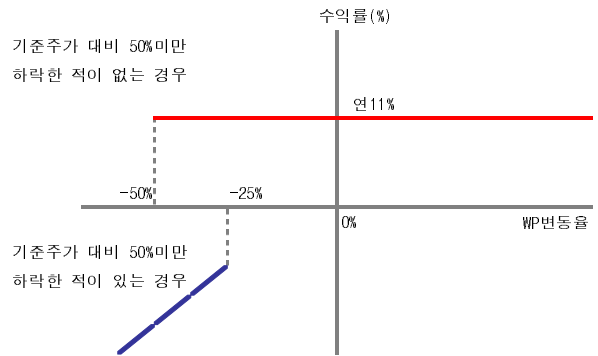
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

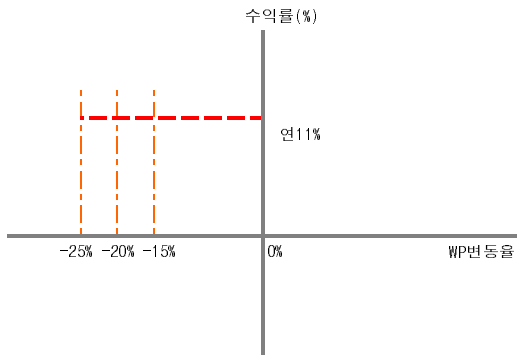
1. 계약금액

단위(백만원)

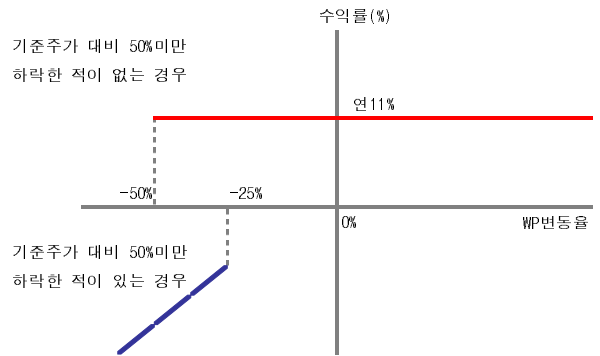
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[12-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

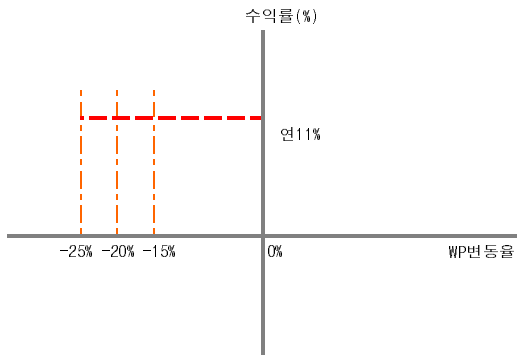
1. 계약금액

단위(백만원)

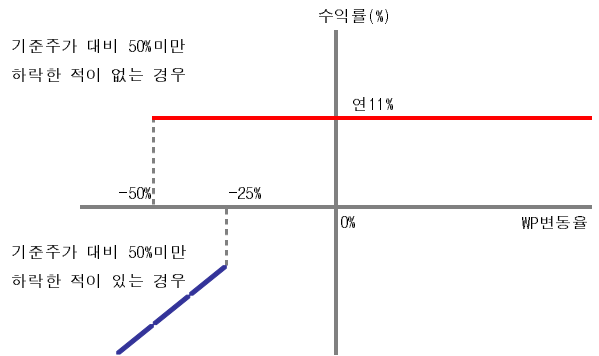
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[13-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

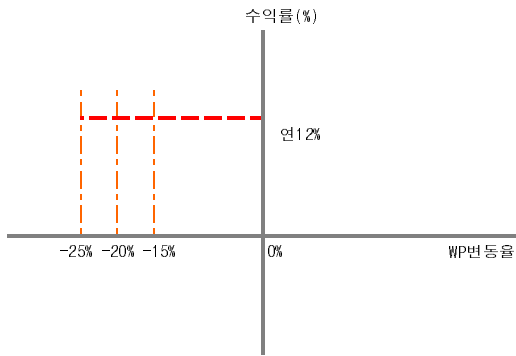
1. 계약금액

단위(백만원)

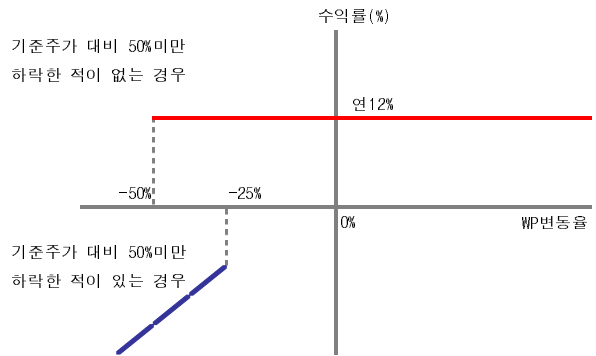
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

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%	22.38	19.17	15.95	12.73	9.51	6.29	3.08
	5.33%	20.85	17.63	14.42	11.20	7.98	4.76	1.54
	2.67%	16.61	13.39	10.17	6.96	3.74	0.52	(2.70)
	0.00%	9.65	6.44	3.22	0.00	(3.22)	(6.44)	(9.65)
	-2.67%	(0.01)	(3.23)	(6.45)	(9.67)	(12.88)	(16.10)	(19.32)
	-5.33%	(12.39)	(15.61)	(18.83)	(22.05)	(25.26)	(28.48)	(31.70)
	-8.00%	(27.48)	(30.70)	(33.92)	(37.14)	(40.36)	(43.57)	(46.79)

최대손실 시나리오

위험액	-46.79
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	42.63
-----	-------

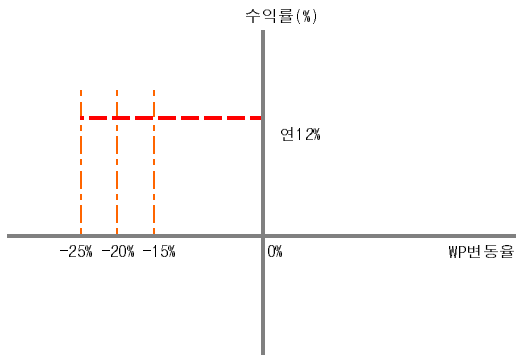
1. 계약금액

단위(백만원)

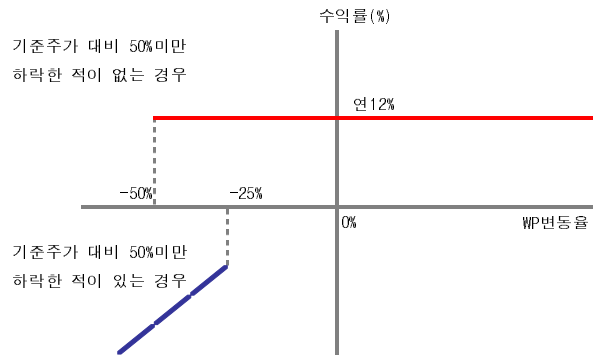
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[13-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

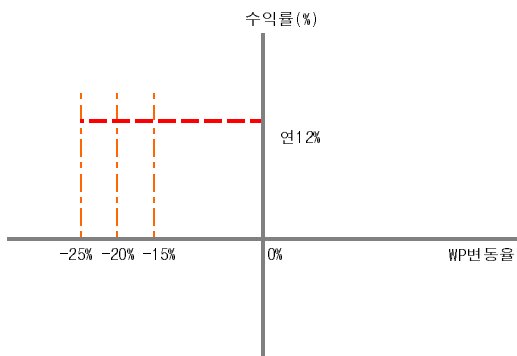
1. 계약금액

단위(백만원)

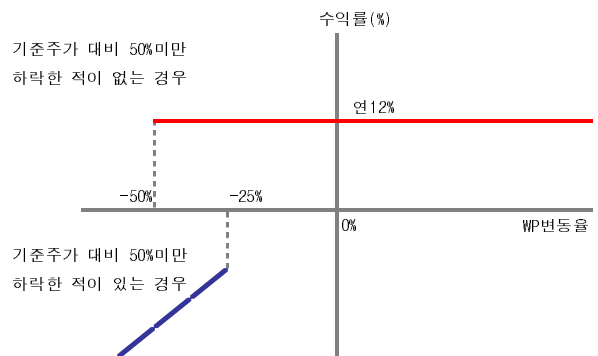
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[13-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

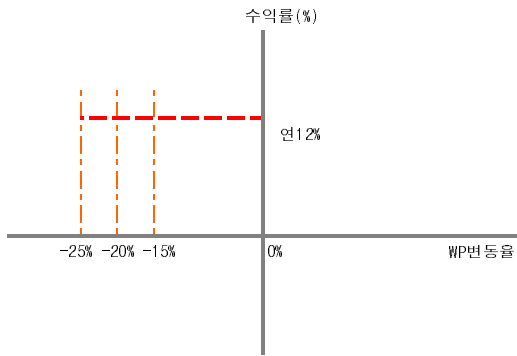
1. 계약금액

단위(백만원)

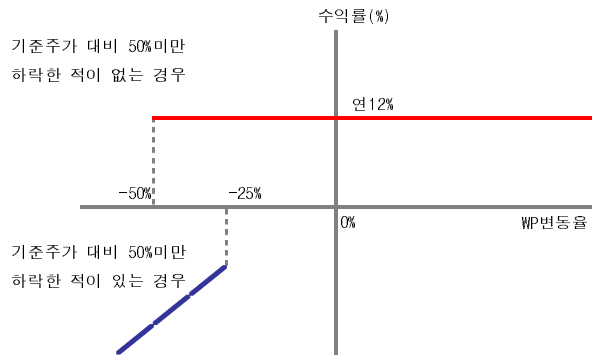
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[14-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

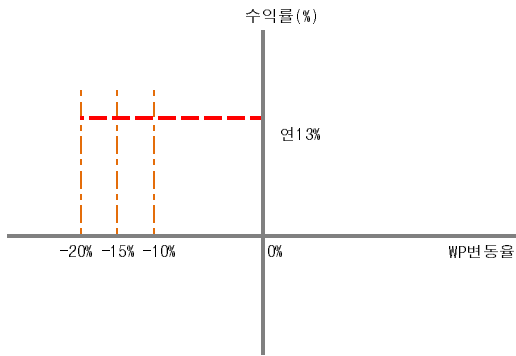
1. 계약금액

단위(백만원)

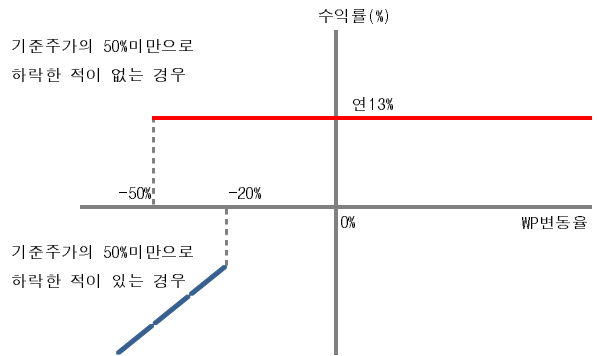
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503338016 신한투자(ELS)1316

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	1.99	1.09	0.20	(0.70)	(1.59)	(2.48)	(3.38)
	5.33%	3.55	2.65	1.76	0.87	(0.03)	(0.92)	(1.81)
	2.67%	3.78	2.89	1.99	1.10	0.20	(0.69)	(1.58)
	0.00%	2.68	1.79	0.89	0.00	(0.89)	(1.79)	(2.68)
	-2.67%	0.25	(0.64)	(1.54)	(2.43)	(3.32)	(4.22)	(5.11)
	-5.33%	(3.51)	(4.40)	(5.29)	(6.19)	(7.08)	(7.98)	(8.87)
	-8.00%	(8.60)	(9.49)	(10.38)	(11.28)	(12.17)	(13.07)	(13.96)

최대손실 시나리오

위험액	-13.96
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	10.55
-----	-------

[14-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

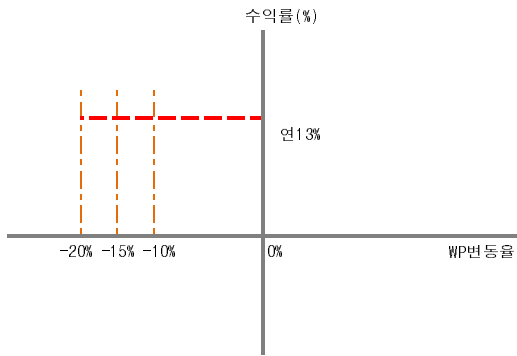
1. 계약금액

단위(백만원)

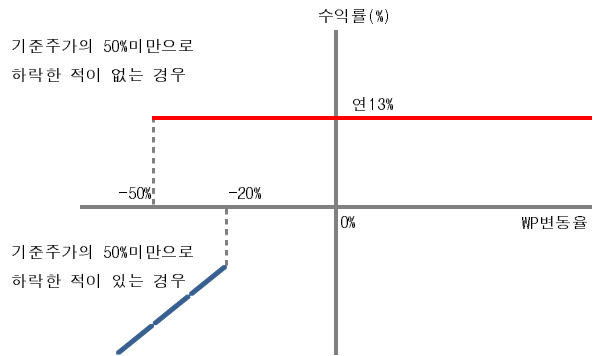
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[14-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

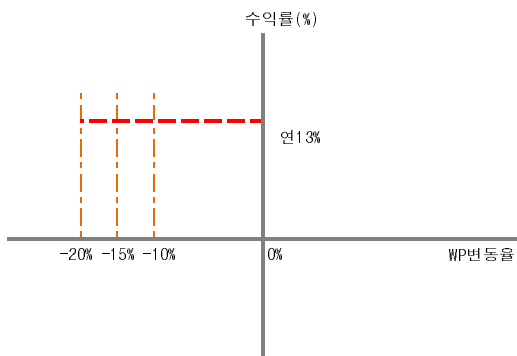
1. 계약금액

단위(백만원)

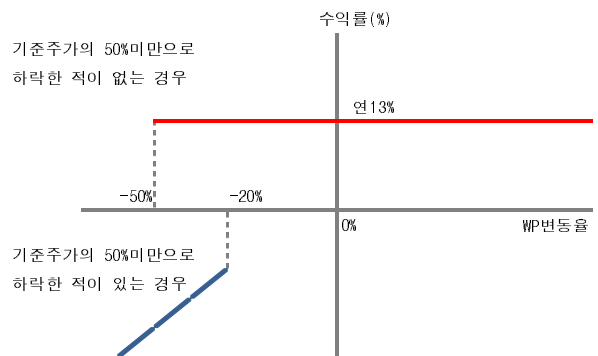
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[14-4] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

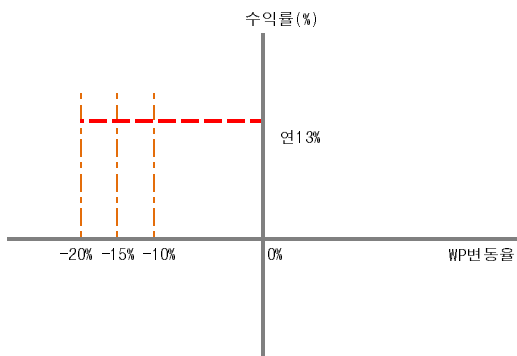
1. 계약금액

단위(백만원)

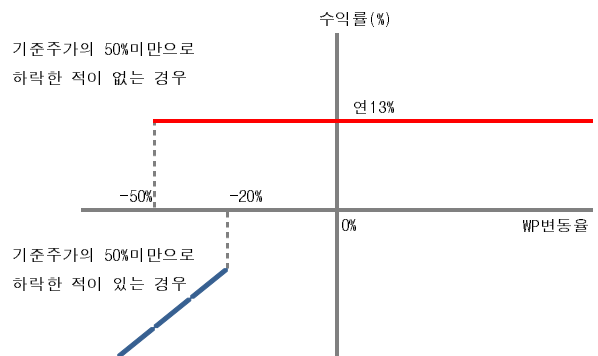
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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]

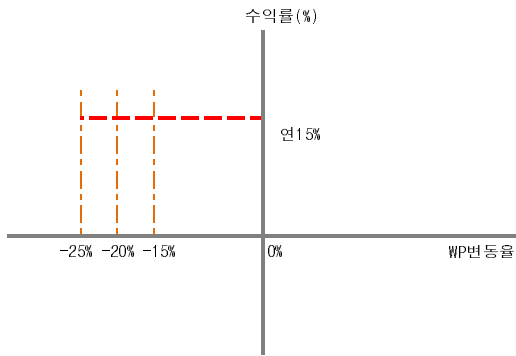
1. 계약금액

단위(백만원)

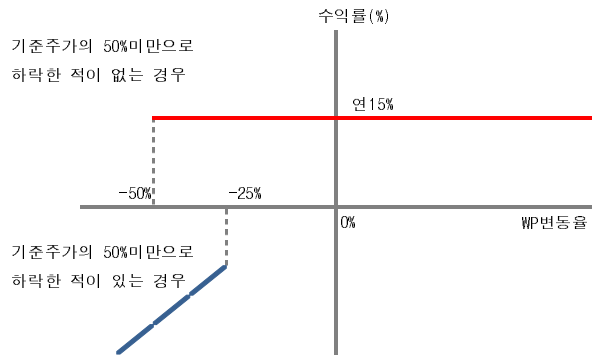
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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%	100.74	84.04	67.34	50.64	33.94	17.24	0.54
	5.33%	86.72	70.02	53.32	36.62	19.92	3.22	(13.48)
	2.67%	69.84	53.14	36.44	19.74	3.04	(13.66)	(30.36)
	0.00%	50.10	33.40	16.70	0.00	(16.70)	(33.40)	(50.10)
	-2.67%	27.49	10.79	(5.91)	(22.61)	(39.31)	(56.01)	(72.71)
	-5.33%	2.02	(14.68)	(31.38)	(48.08)	(64.78)	(81.48)	(98.18)
	-8.00%	(26.32)	(43.02)	(59.71)	(76.41)	(93.11)	(109.81)	(126.51)

최대 손실 시나리오

위험액	-126.51
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	125.86
-----	--------

[15-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

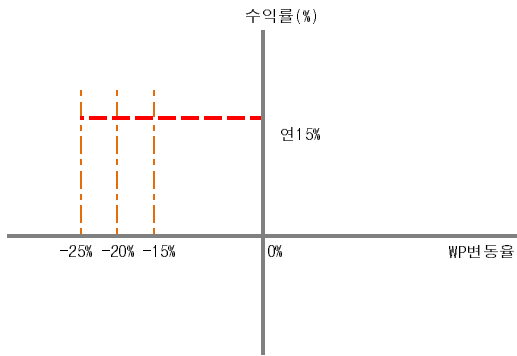
1. 계약금액

단위(백만원)

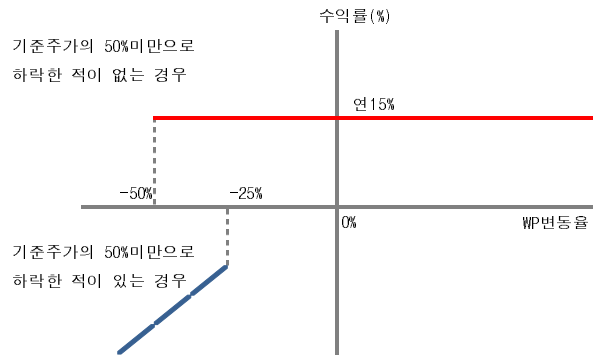
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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]

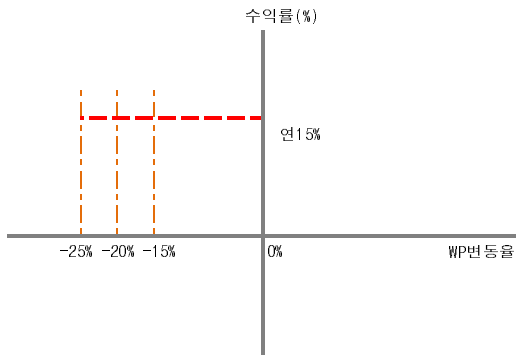
1. 계약금액

단위(백만원)

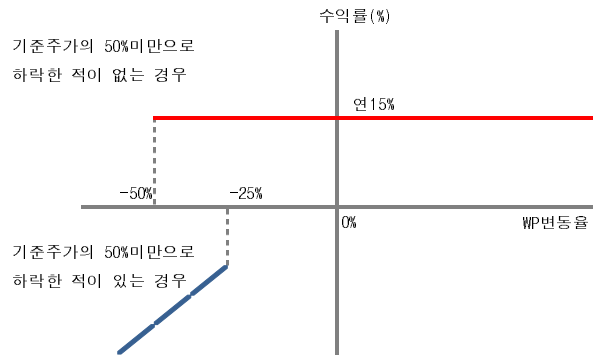
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[15-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

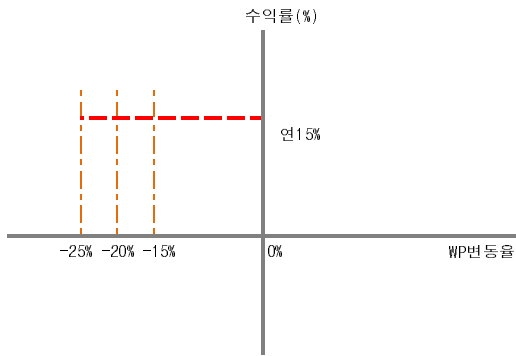
1. 계약금액

단위(백만원)

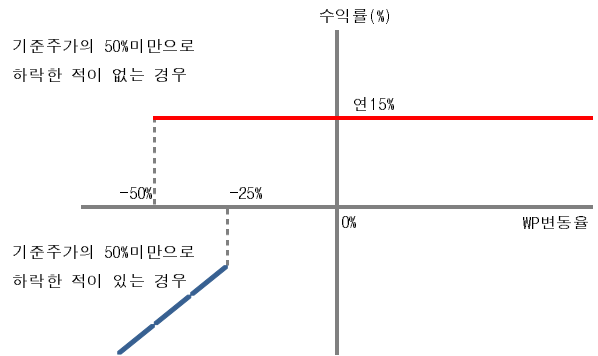
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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]

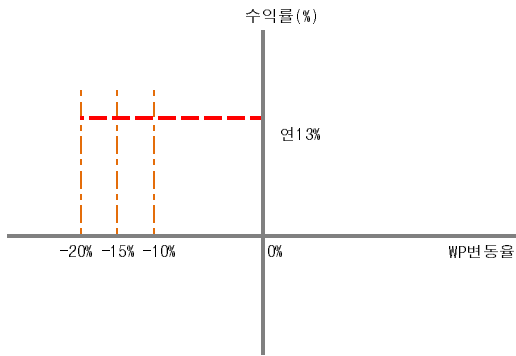
1. 계약금액

단위(백만원)

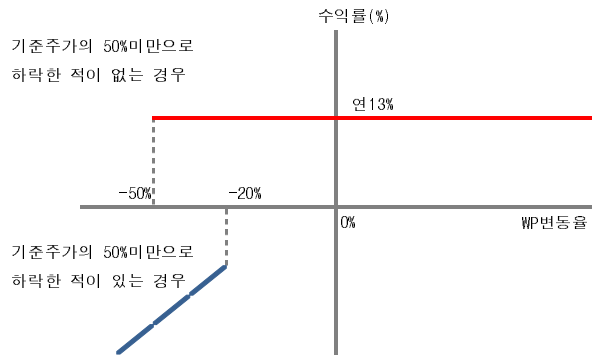
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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%	3.07	2.38	1.70	1.01	0.32	(0.37)	(1.06)
	5.33%	3.24	2.55	1.86	1.18	0.49	(0.20)	(0.89)
	2.67%	2.91	2.22	1.53	0.84	0.15	(0.54)	(1.23)
	0.00%	2.07	1.38	0.69	0.00	(0.69)	(1.38)	(2.07)
	-2.67%	0.72	0.03	(0.66)	(1.34)	(2.03)	(2.72)	(3.41)
	-5.33%	(1.13)	(1.82)	(2.51)	(3.19)	(3.88)	(4.57)	(5.26)
	-8.00%	(3.48)	(4.17)	(4.86)	(5.55)	(6.24)	(6.93)	(7.62)

최대손실 시나리오

위험액	-7.62
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	8.06
-----	------

[16-2] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

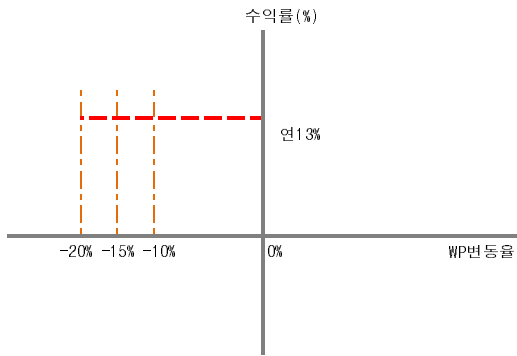
1. 계약금액

단위(백만원)

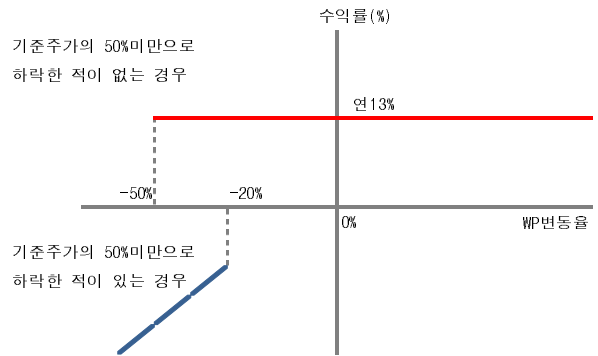
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[16-3] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

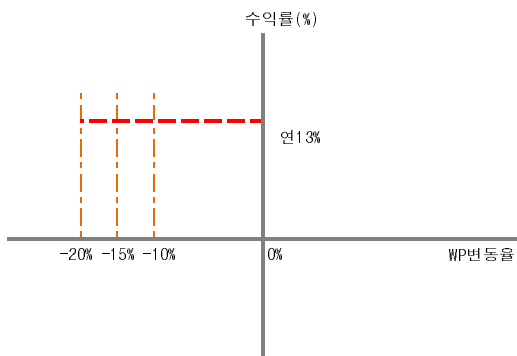
1. 계약금액

단위(백만원)

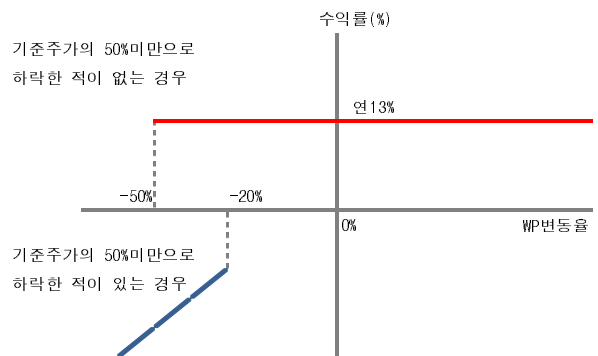
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[16-4] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

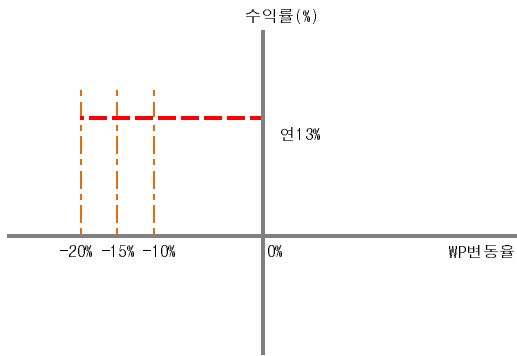
1. 계약금액

단위(백만원)

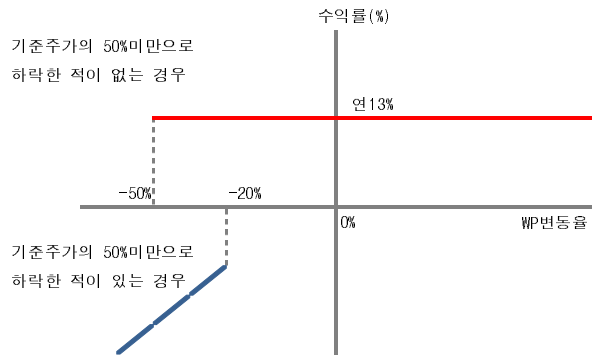
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504