

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권KGSH-1호

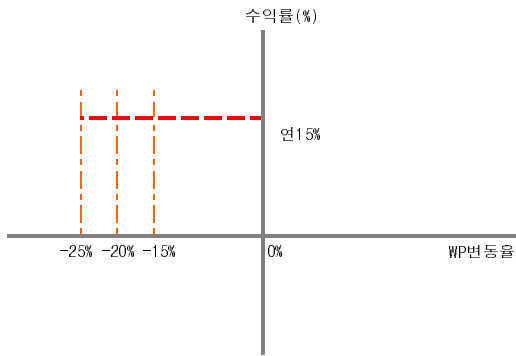
1. 계약금액

단위(백만원)

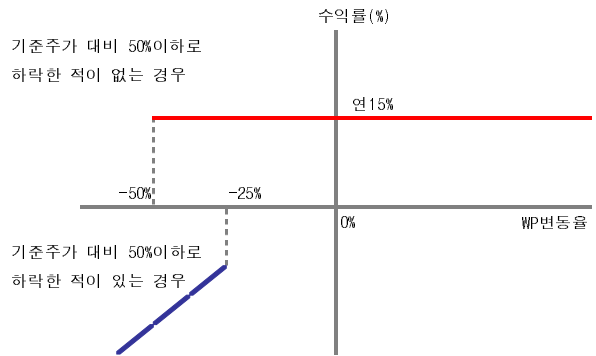
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552359WB4 우리투자증권(ELS)2765

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	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
-----	------

[1-2]

메리츠2Star증권KGSH-1호

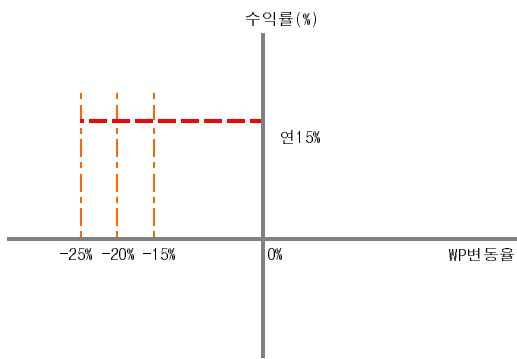
1. 계약금액

단위(백만원)

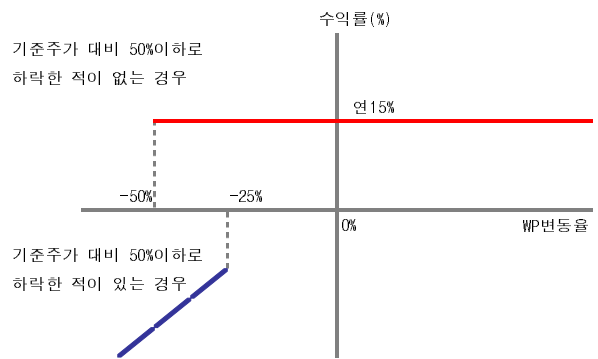
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[1-3]

메리츠2Star증권KGSH-1호

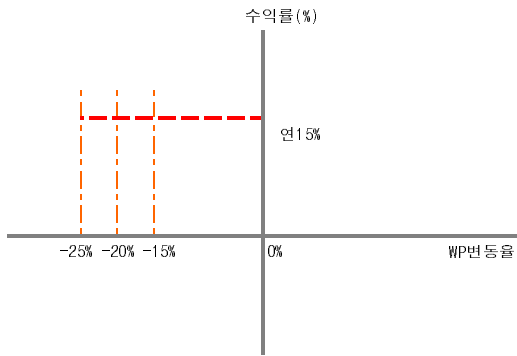
1. 계약금액

단위(백만원)

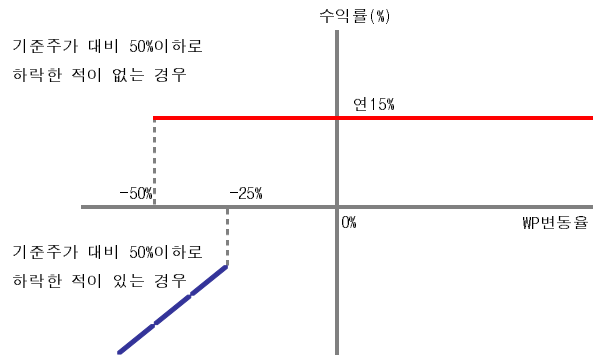
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

[1-4]

메리츠2Star증권KGSH-1호

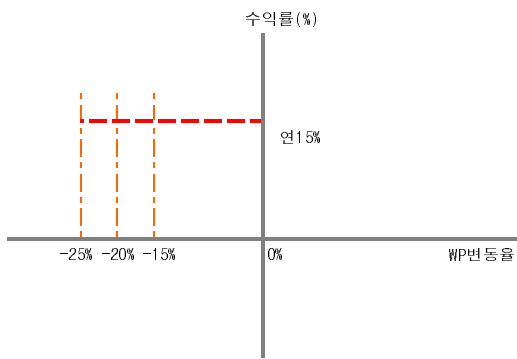
1. 계약금액

단위(백만원)

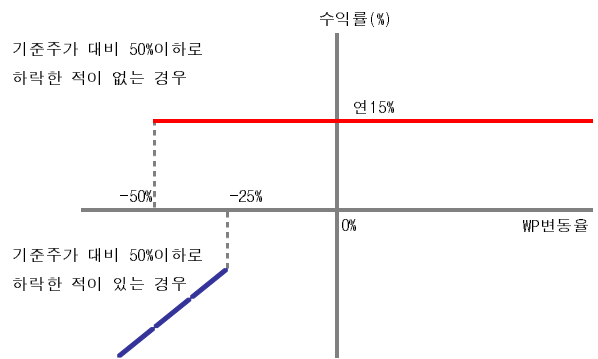
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[3-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

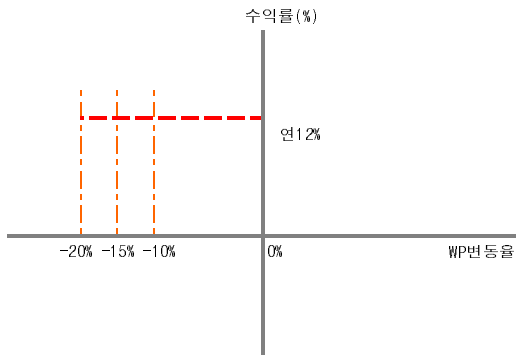
1. 계약금액

단위(백만원)

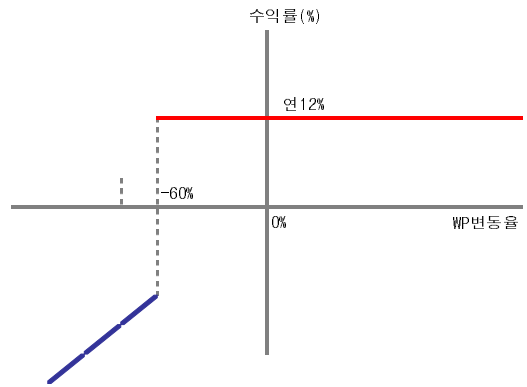
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	(31.46)	(31.75)	(32.05)	(32.34)	(32.63)	(32.93)	(33.22)
	5.33%	(12.91)	(13.20)	(13.50)	(13.79)	(14.08)	(14.38)	(14.67)
	2.67%	(2.13)	(2.42)	(2.72)	(3.01)	(3.30)	(3.60)	(3.89)
	0.00%	0.88	0.59	0.29	0.00	(0.29)	(0.59)	(0.88)
	-2.67%	(3.88)	(4.17)	(4.47)	(4.76)	(5.05)	(5.35)	(5.64)
	-5.33%	(16.41)	(16.71)	(17.00)	(17.29)	(17.59)	(17.88)	(18.17)
	-8.00%	(36.72)	(37.01)	(37.30)	(37.60)	(37.89)	(38.18)	(38.47)

최대손실 시나리오

위험액	-38.47
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	15.20
-----	-------

[3-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

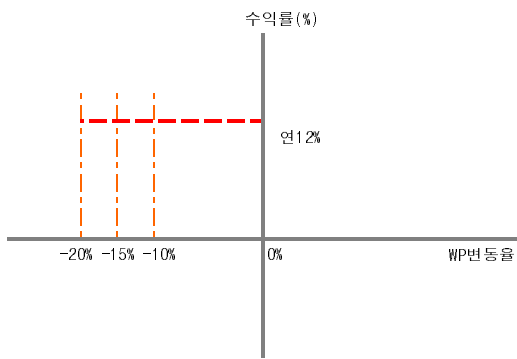
1. 계약금액

단위(백만원)

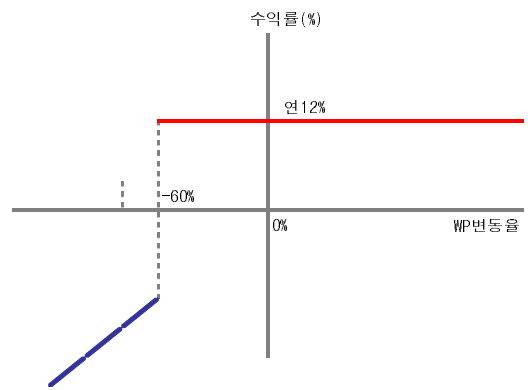
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[3-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

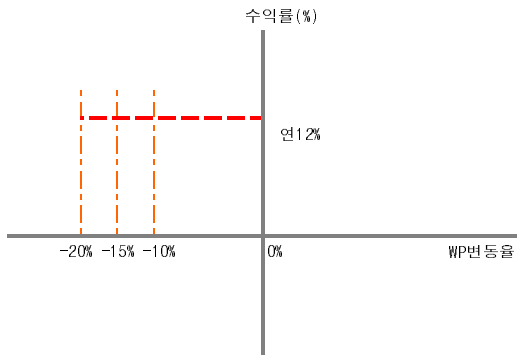
1. 계약금액

단위(백만원)

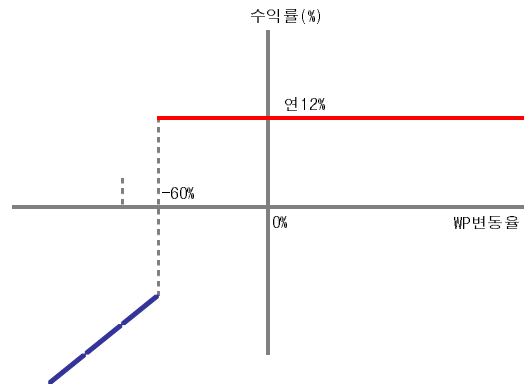
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[3-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

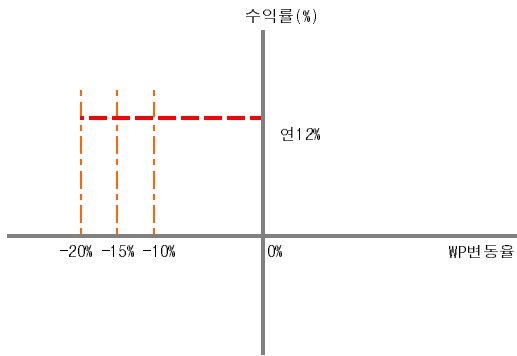
1. 계약금액

단위(백만원)

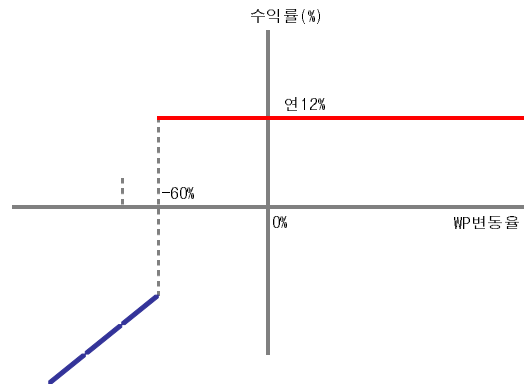
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

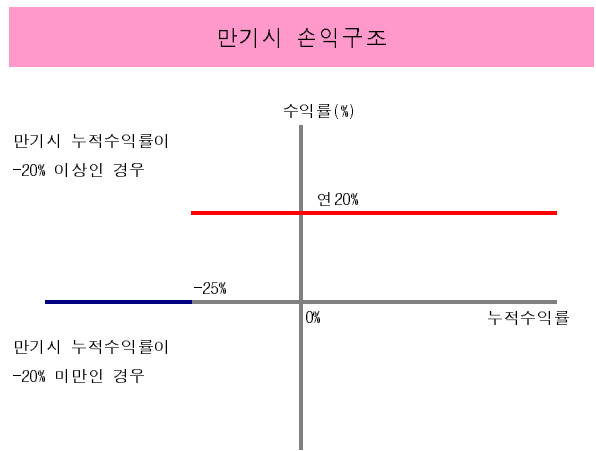
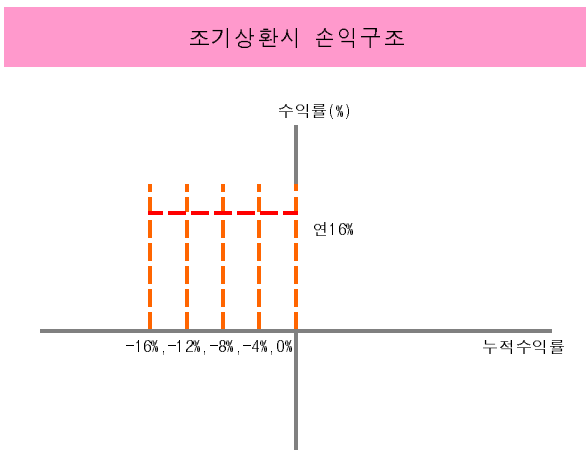
[4] 메리츠클리켓 단위 파생3호

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
-----	------

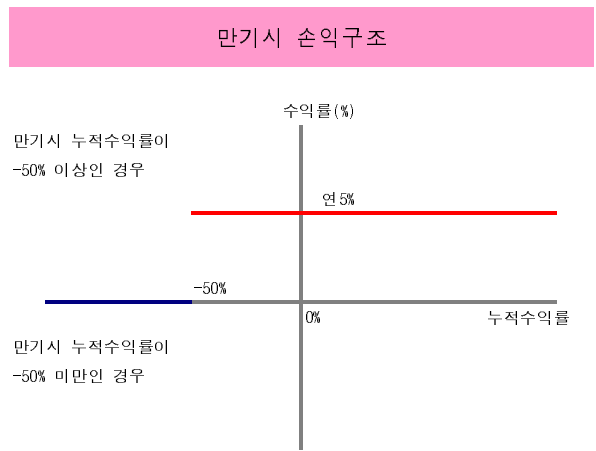
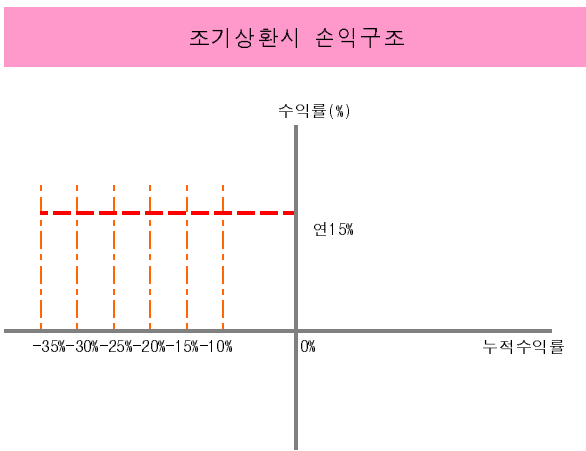
[5] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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
	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

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

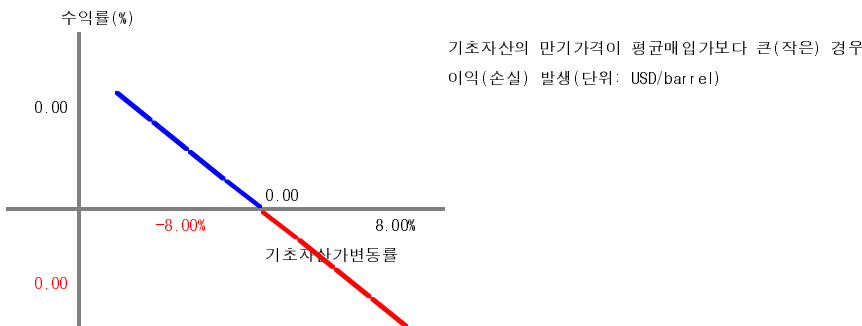
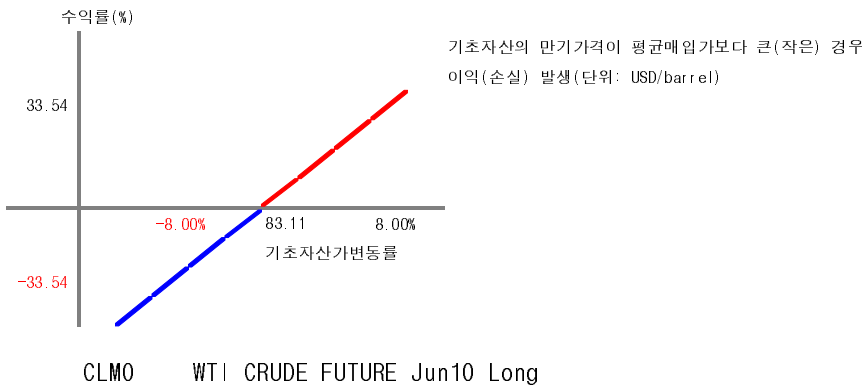
[6] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나 리오	8.00%	33.54
	5.33%	22.34
	2.67%	11.19
	0.00%	0.00
	-2.67%	-11.19
	-5.33%	-22.34
	-8.00%	-33.54

최대손실 시나리오	
위험액	-33.54

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	136
-----	-----

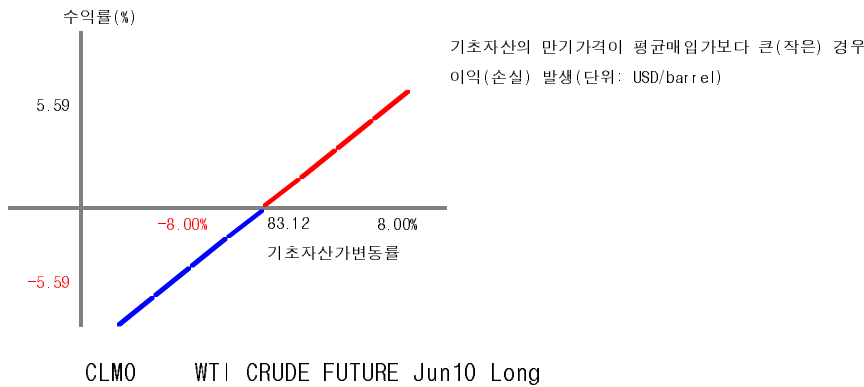
[7] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

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(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나 리오	8.00%	5.59
	5.33%	3.72
	2.67%	1.87
	0.00%	0.00
	-2.67%	-1.87
	-5.33%	-3.72
	-8.00%	-5.59

최대손실 시나리오	
위험액	-5.59

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22
-----	----

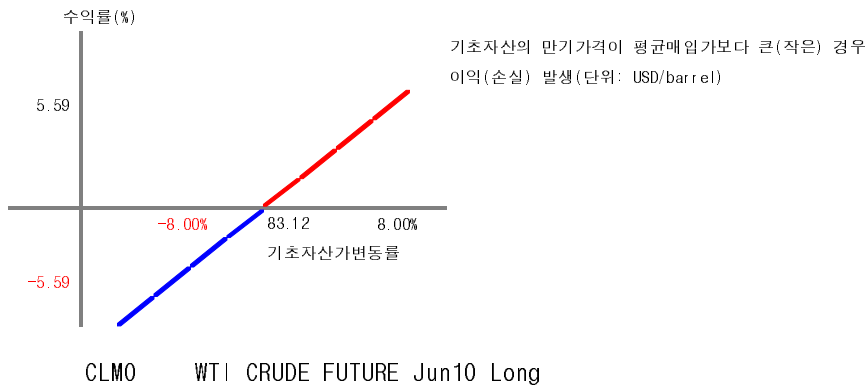
[8-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	21.18
	5.33%	14.11
	2.67%	7.07
	0.00%	0.00
	-2.67%	-7.07
	-5.33%	-14.11
	-8.00%	-21.18

최대손실 시나리오	
위험액	-21.18

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	84
-----	----

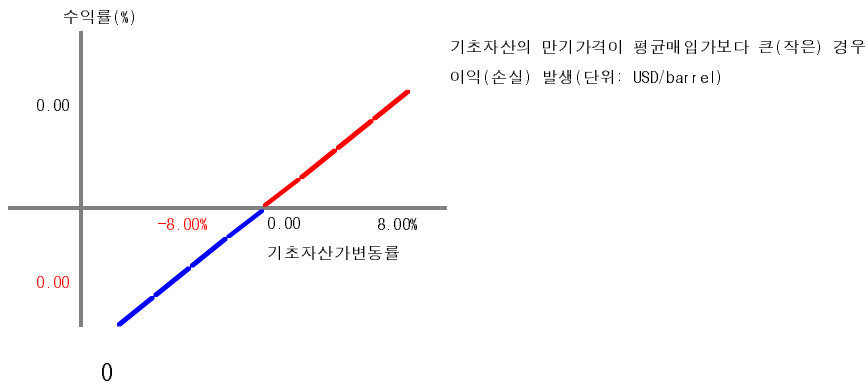
[8-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



[8-3]

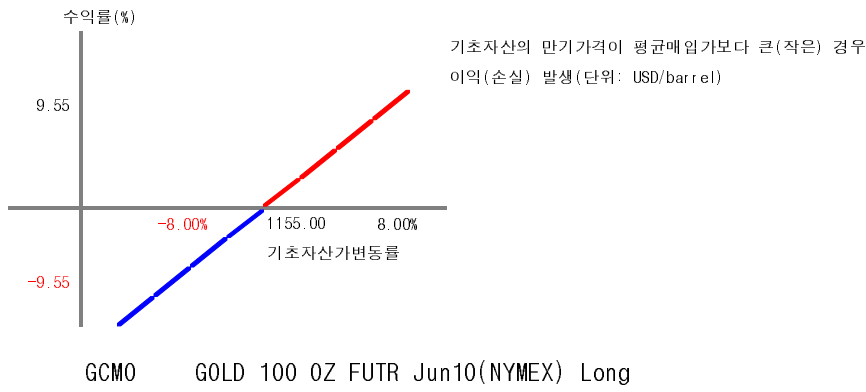
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



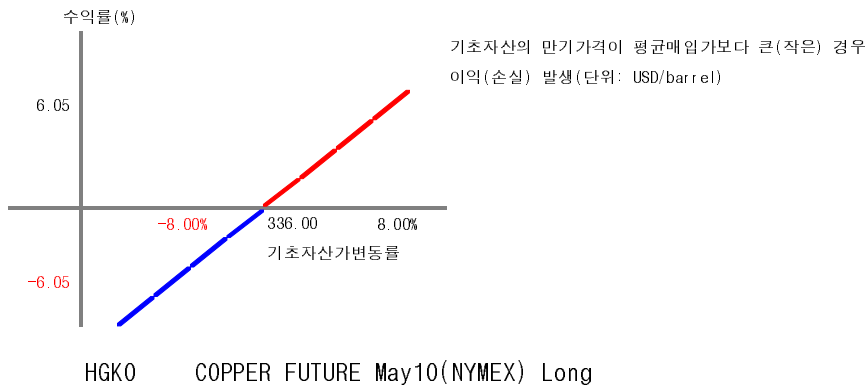
[8-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



[8-5]

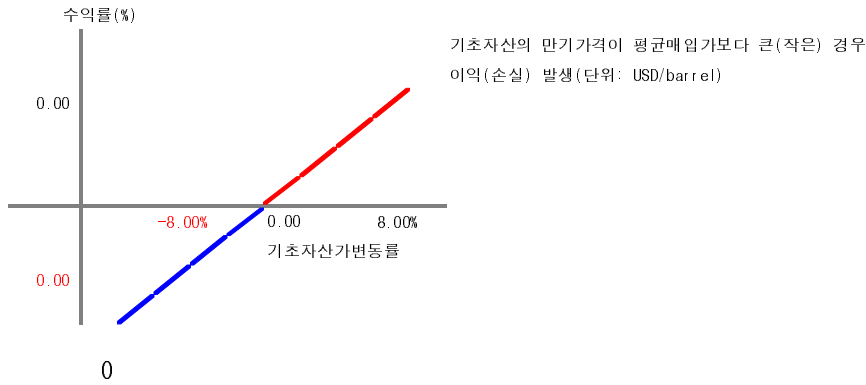
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



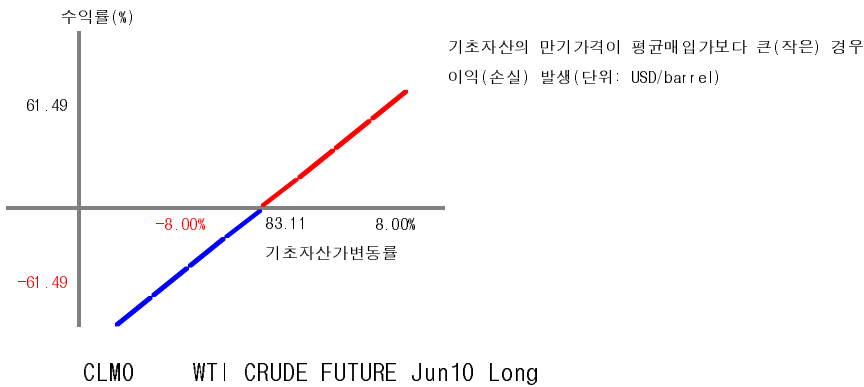
[9] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	61.49
	5.33%	40.97
	2.67%	20.52
	0.00%	0.00
	-2.67%	-20.52
	-5.33%	-40.97
	-8.00%	-61.49

최대손실 시나리오	
위험액	-61.49

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	232
-----	-----

[10-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

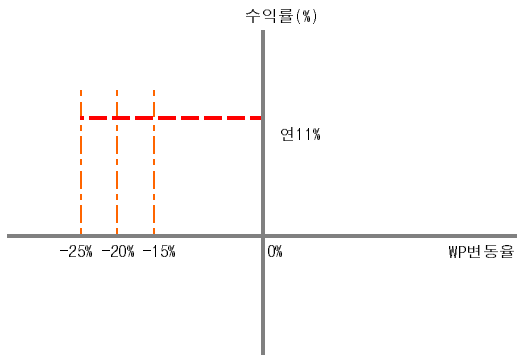
1. 계약금액

단위(백만원)

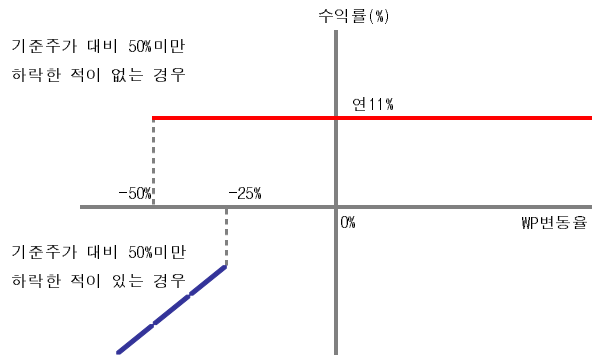
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

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%	11.12	7.65	4.18	0.72	(2.75)	(6.22)	(9.68)
	5.33%	18.13	14.67	11.20	7.73	4.27	0.80	(2.67)
	2.67%	17.90	14.43	10.96	7.49	4.03	0.56	(2.91)
	0.00%	10.40	6.93	3.47	0.00	(3.47)	(6.93)	(10.40)
	-2.67%	(4.35)	(7.82)	(11.28)	(14.75)	(18.22)	(21.68)	(25.15)
	-5.33%	(26.35)	(29.82)	(33.29)	(36.75)	(40.22)	(43.69)	(47.16)
	-8.00%	(55.61)	(59.08)	(62.55)	(66.01)	(69.48)	(72.95)	(76.42)

최대손실 시나리오

위험액	-76.42
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	74.60
-----	-------

[10-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

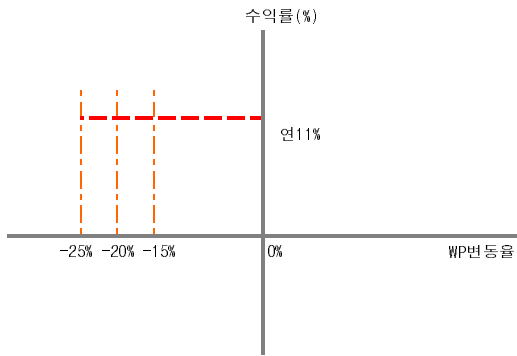
1. 계약금액

단위(백만원)

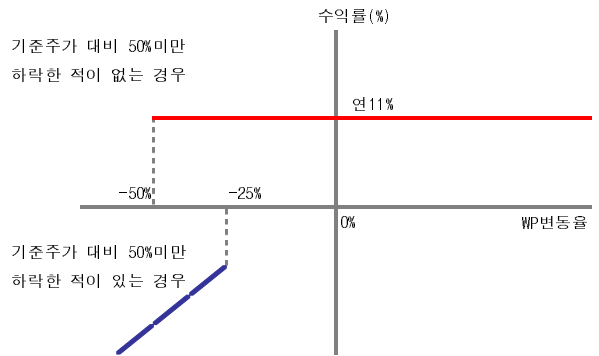
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

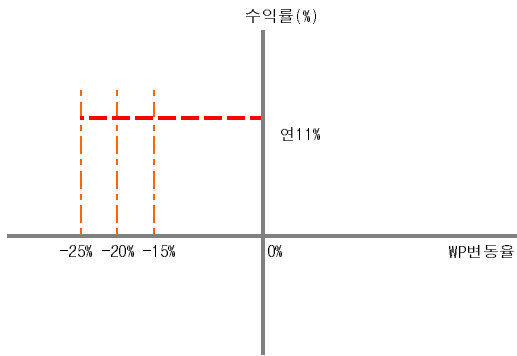
1. 계약금액

단위(백만원)

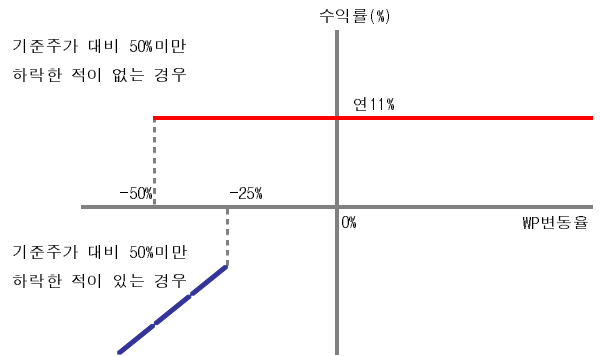
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[10-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

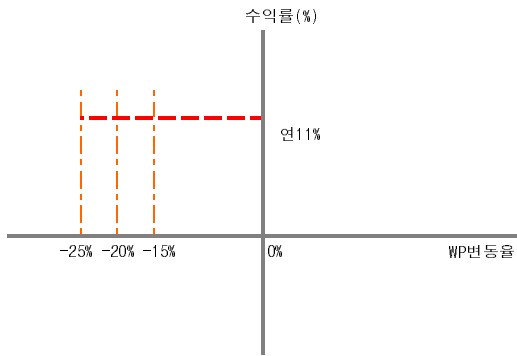
1. 계약금액

단위(백만원)

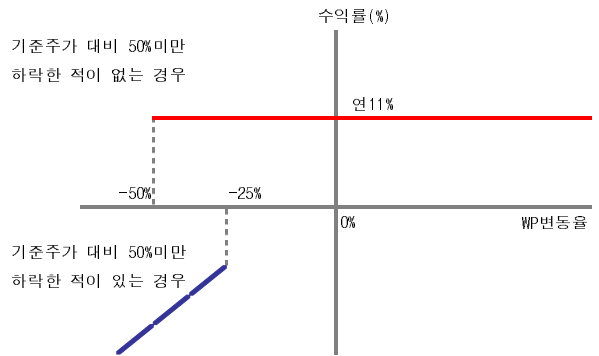
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[11-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

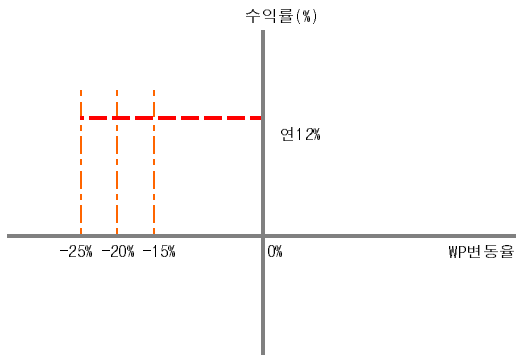
1. 계약금액

단위(백만원)

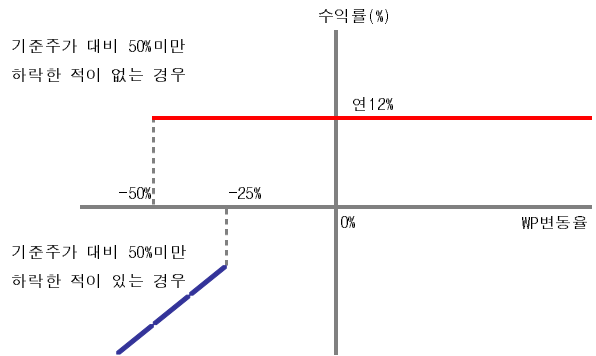
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513340WC0 대신증권(ELS)920

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	50.57	44.63	38.68	32.74	26.79	20.85	14.90
	5.33%	45.57	39.63	33.69	27.74	21.80	15.85	9.91
	2.67%	34.66	28.72	22.77	16.83	10.89	4.94	(1.00)
	0.00%	17.83	11.89	5.94	0.00	(5.94)	(11.89)	(17.83)
	-2.67%	(4.91)	(10.86)	(16.80)	(22.75)	(28.69)	(34.64)	(40.58)
	-5.33%	(33.58)	(39.52)	(45.47)	(51.41)	(57.35)	(63.30)	(69.24)
	-8.00%	(68.16)	(74.10)	(80.05)	(85.99)	(91.94)	(97.88)	(103.82)

최대손실 시나리오

위험액	-103.82
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	102.70
-----	--------

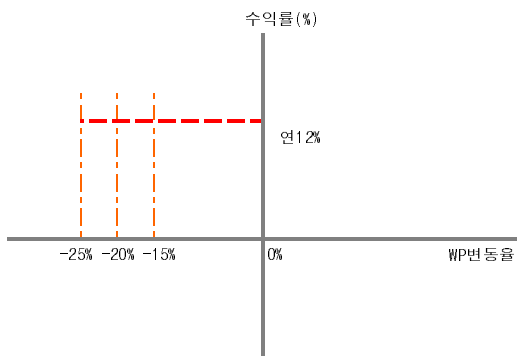
1. 계약금액

단위(백만원)

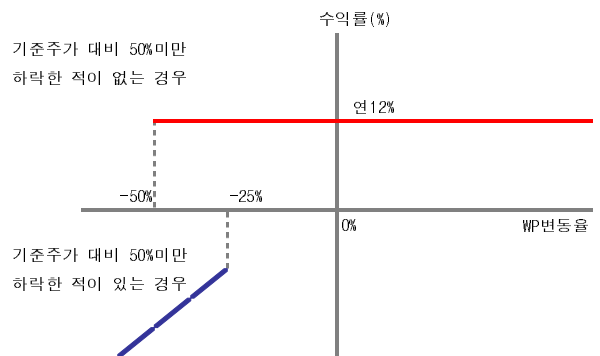
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[11-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

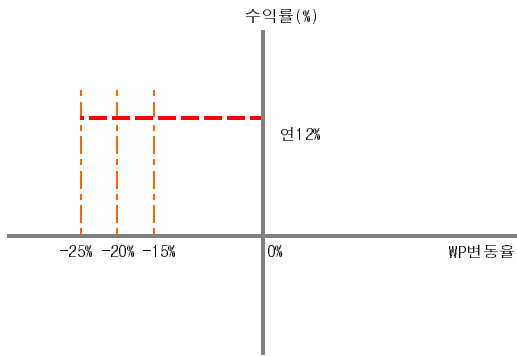
1. 계약금액

단위(백만원)

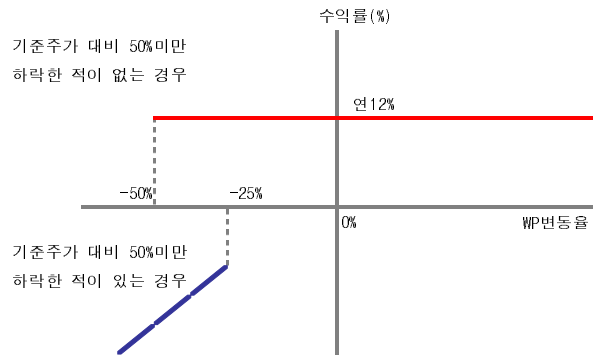
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[11-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

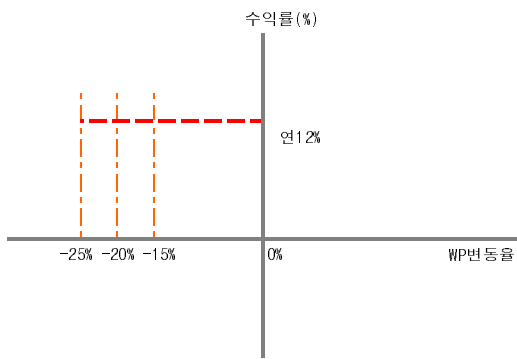
1. 계약금액

단위(백만원)

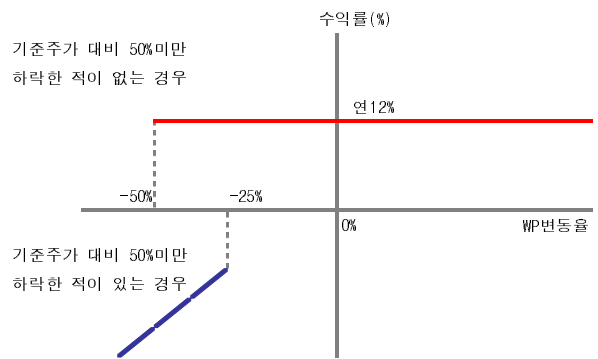
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

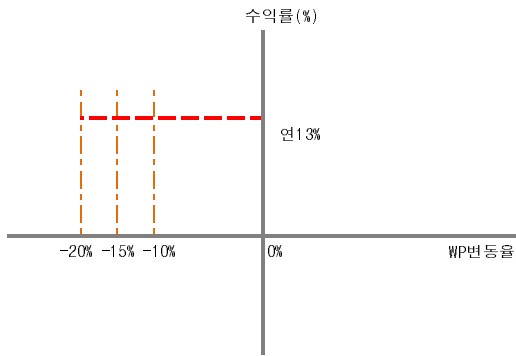
1. 계약금액

단위(백만원)

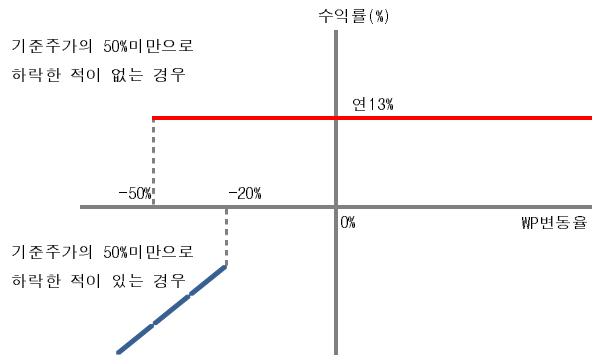
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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%	200.89	170.44	139.98	109.53	79.08	48.62	18.17
	5.33%	180.60	150.14	119.69	89.23	58.78	28.33	(2.13)
	2.67%	144.09	113.63	83.18	52.72	22.27	(8.18)	(38.64)
	0.00%	91.36	60.91	30.45	0.00	(30.45)	(60.91)	(91.36)
	-2.67%	22.42	(8.03)	(38.48)	(68.94)	(99.39)	(129.85)	(160.30)
	-5.33%	(62.73)	(93.18)	(123.64)	(154.09)	(184.55)	(215.00)	(245.45)
	-8.00%	(164.10)	(194.55)	(225.00)	(255.46)	(285.91)	(316.37)	(346.82)

최대 손실 시나리오

위험액	-346.82
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	341.71
-----	--------

[12-2]

메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

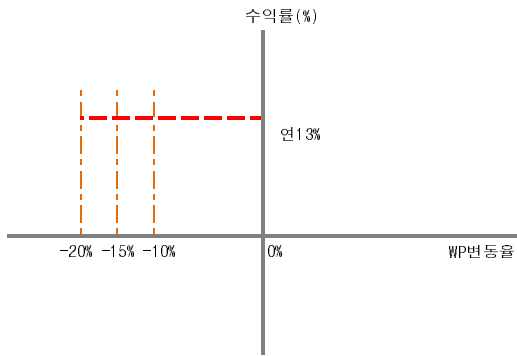
1. 계약금액

단위(백만원)

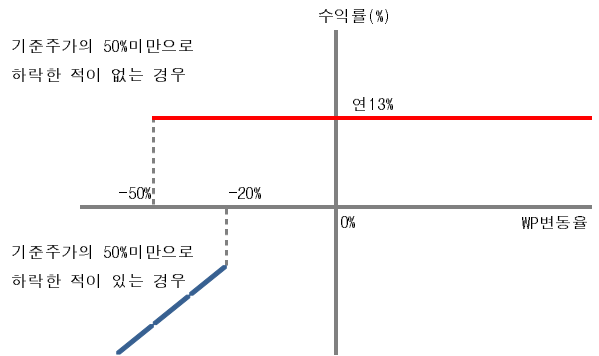
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[12-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

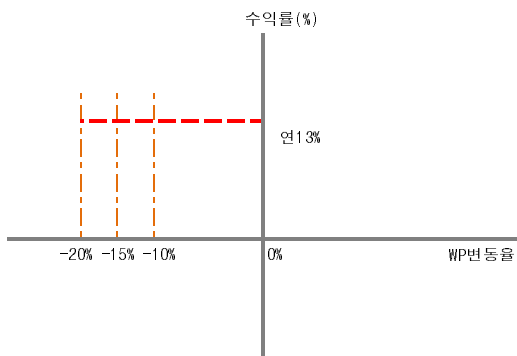
1. 계약금액

단위(백만원)

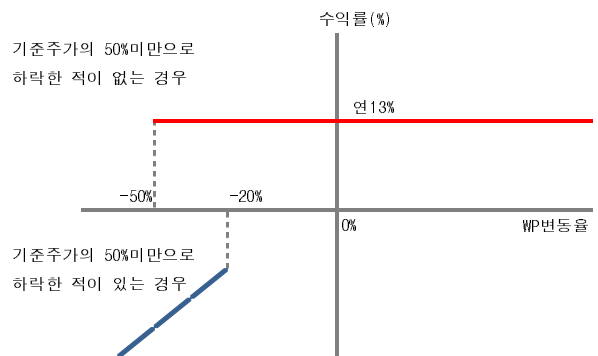
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[12-4] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

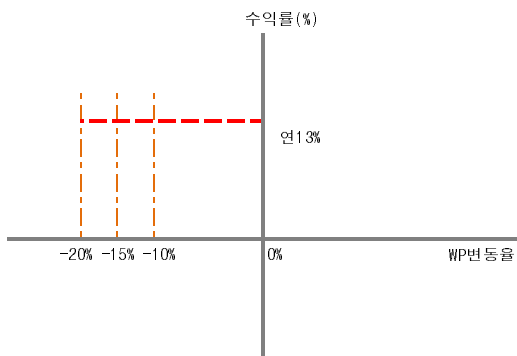
1. 계약금액

단위(백만원)

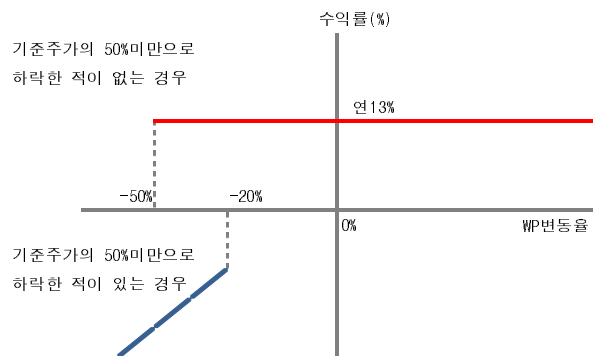
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703338014 H&D증권(ELS)431

[13-1] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

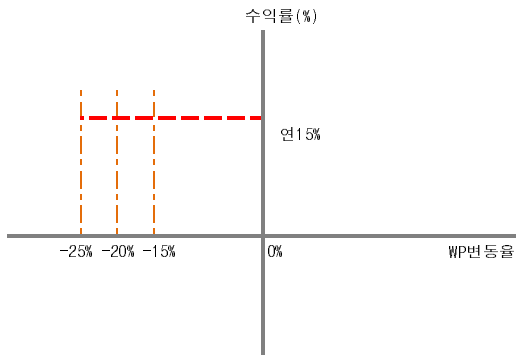
1. 계약금액

단위(백만원)

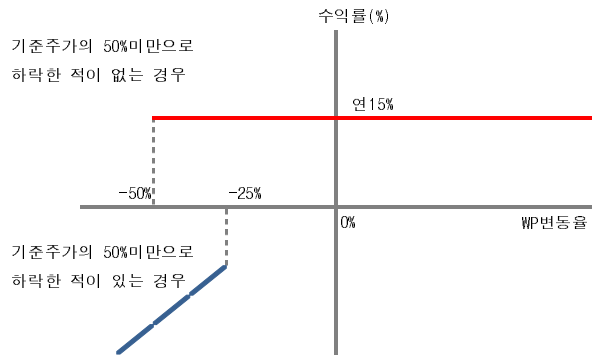
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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%	139.67	118.90	98.14	77.38	56.61	35.85	15.09
	5.33%	118.48	97.72	76.96	56.19	35.43	14.67	(6.10)
	2.67%	92.69	71.93	51.17	30.40	9.64	(11.12)	(31.89)
	0.00%	62.29	41.53	20.76	0.00	(20.76)	(41.53)	(62.29)
	-2.67%	27.28	6.51	(14.25)	(35.01)	(55.78)	(76.54)	(97.30)
	-5.33%	(12.34)	(33.11)	(53.87)	(74.63)	(95.40)	(116.16)	(136.92)
	-8.00%	(56.58)	(77.34)	(98.10)	(118.87)	(139.63)	(160.39)	(181.16)

최대손실 시나리오

위험액	-181.16
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	183.65
-----	--------

[13-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

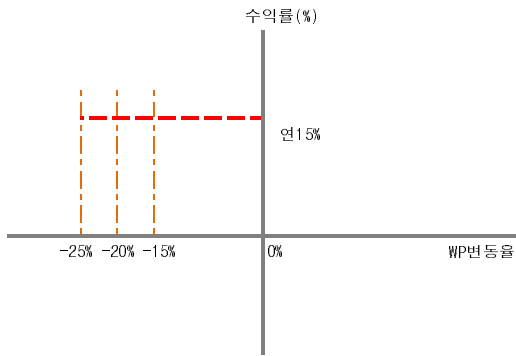
1. 계약금액

단위(백만원)

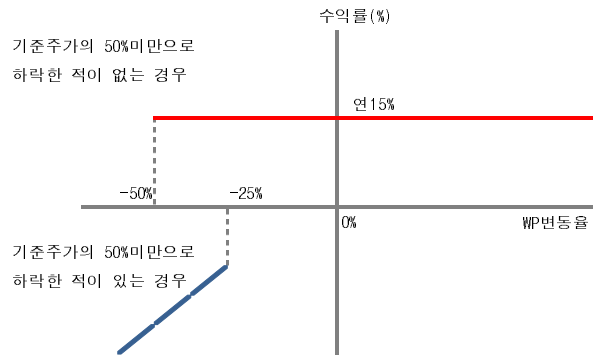
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[13-3]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

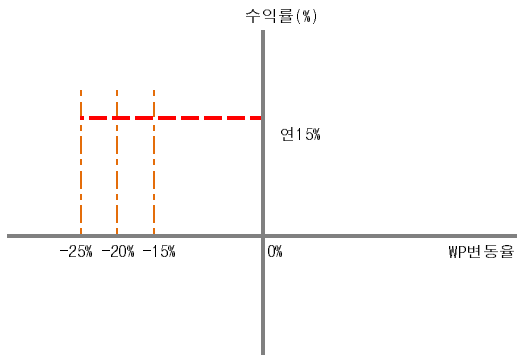
1. 계약금액

단위(백만원)

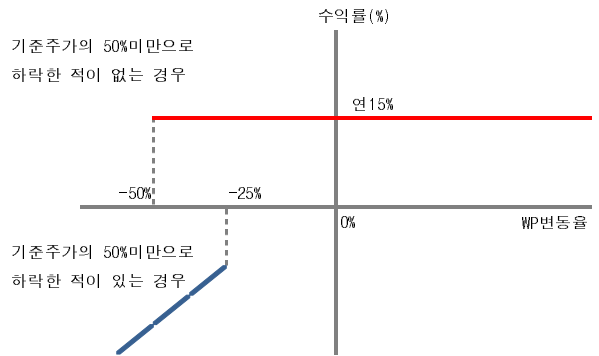
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[13-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

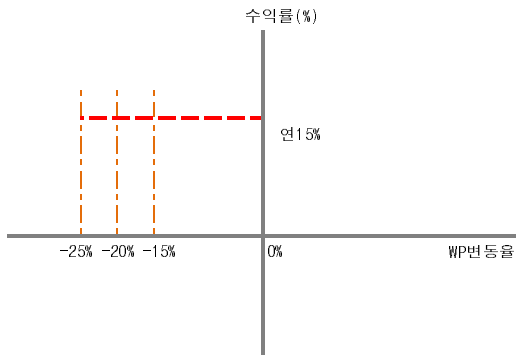
1. 계약금액

단위(백만원)

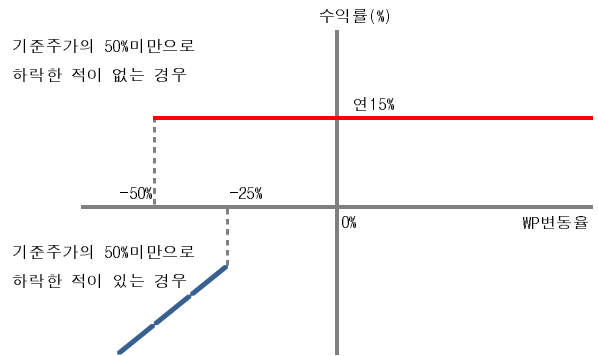
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[14-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

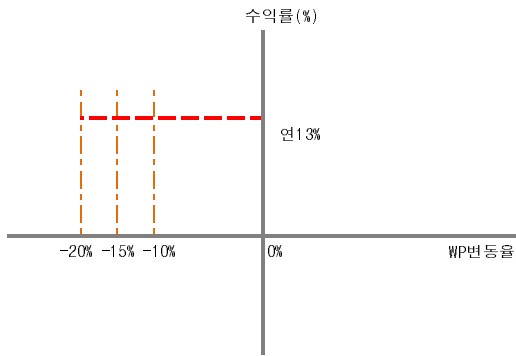
1. 계약금액

단위(백만원)

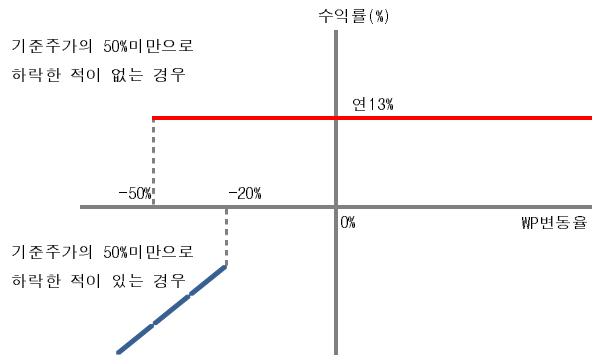
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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%	98.95	83.48	68.01	52.54	37.08	21.61	6.14
	5.33%	88.64	73.17	57.70	42.23	26.77	11.30	(4.17)
	2.67%	71.12	55.65	40.19	24.72	9.25	(6.22)	(21.69)
	0.00%	46.40	30.94	15.47	0.00	(15.47)	(30.94)	(46.40)
	-2.67%	14.48	(0.99)	(16.45)	(31.92)	(47.39)	(62.86)	(78.33)
	-5.33%	(24.64)	(40.11)	(55.58)	(71.05)	(86.52)	(101.98)	(117.45)
	-8.00%	(70.97)	(86.44)	(101.91)	(117.38)	(132.85)	(148.31)	(163.78)

최대손실 시나리오

위험액	-163.78
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	155.25
-----	--------

[14-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

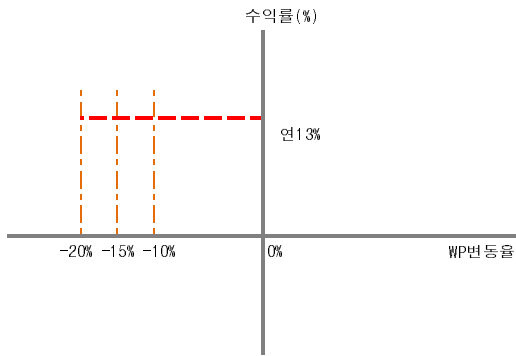
1. 계약금액

단위(백만원)

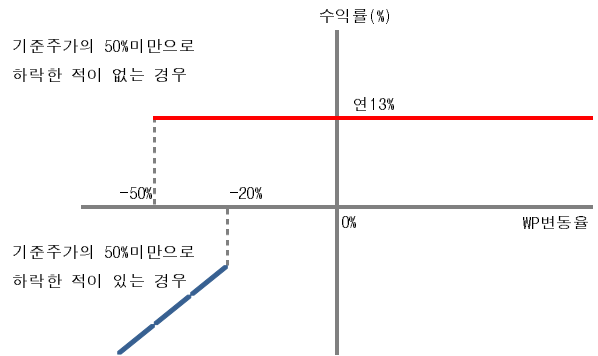
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[14-3] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

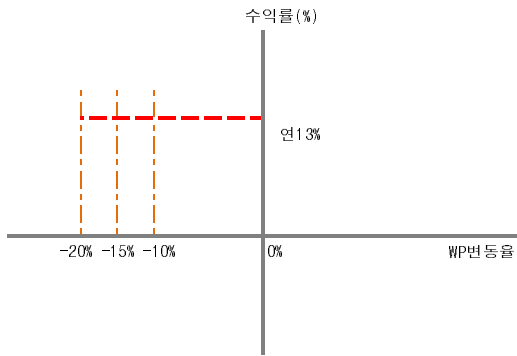
1. 계약금액

단위(백만원)

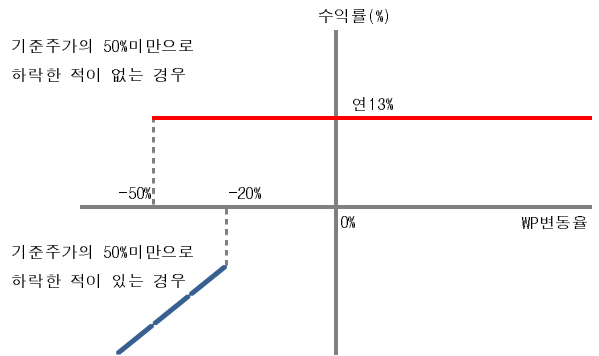
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[14-4] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

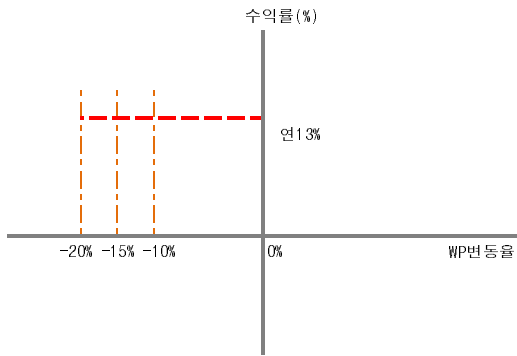
1. 계약금액

단위(백만원)

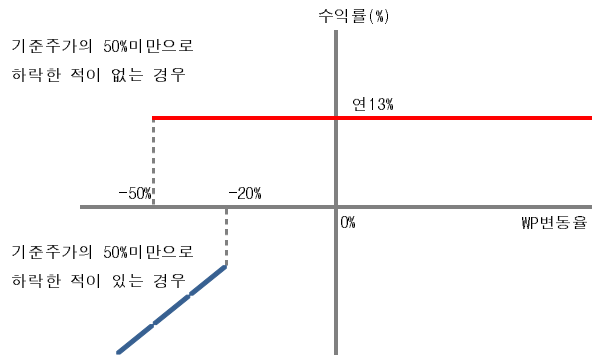
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504

[15] 메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

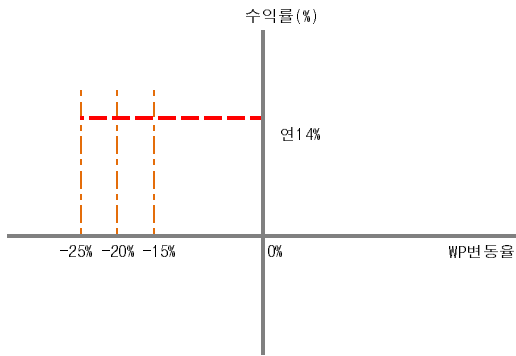
1. 계약금액

단위(백만원)

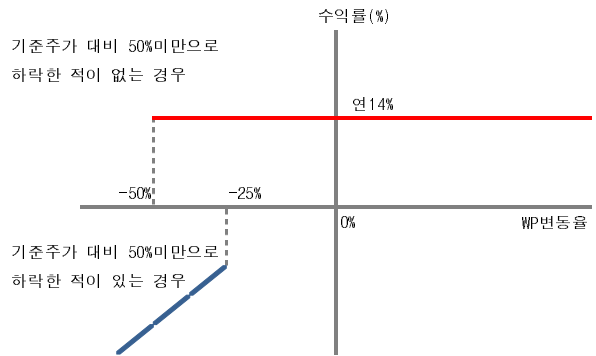
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502333034 신한투자(ELS)1395

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	120.00	103.37	86.74	70.12	53.49	36.86	20.23
	5.33%	101.52	84.89	68.26	51.63	35.01	18.38	1.75
	2.67%	78.14	61.52	44.89	28.26	11.64	(4.99)	(21.62)
	0.00%	49.88	33.25	16.63	0.00	(16.63)	(33.25)	(49.88)
	-2.67%	16.73	0.10	(16.53)	(33.15)	(49.78)	(66.41)	(83.03)
	-5.33%	(21.32)	(37.94)	(54.57)	(71.20)	(87.82)	(104.45)	(121.08)
	-8.00%	(64.25)	(80.88)	(97.50)	(114.13)	(130.76)	(147.39)	(164.01)

최대손실 시나리오

위험액	-164.01
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	173.11
-----	--------

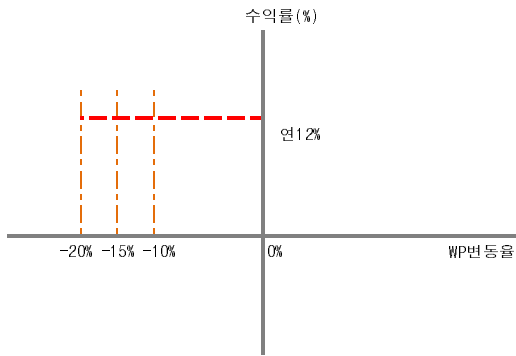
1. 계약금액

단위(백만원)

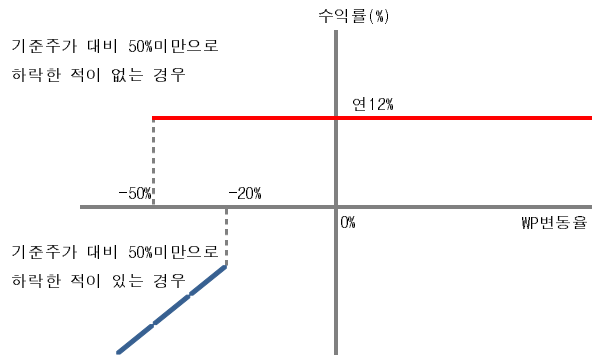
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502348032 신한투자(ELS)1408

구분	변동성 시나리오							
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	63.85	55.00	46.15	37.30	28.44	19.59	10.74
	5.33%	53.58	44.72	35.87	27.02	18.17	9.32	0.47
	2.67%	41.14	32.29	23.44	14.59	5.74	(3.11)	(11.96)
	0.00%	26.55	17.70	8.85	0.00	(8.85)	(17.70)	(26.55)
	-2.67%	9.80	0.95	(7.90)	(16.75)	(25.60)	(34.45)	(43.30)
	-5.33%	(9.12)	(17.97)	(26.82)	(35.67)	(44.52)	(53.37)	(62.22)
	-8.00%	(30.19)	(39.04)	(47.89)	(56.74)	(65.59)	(74.44)	(83.29)

최대손실 시나리오

위험액	-83.29
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	81.15
-----	-------

[17] 메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

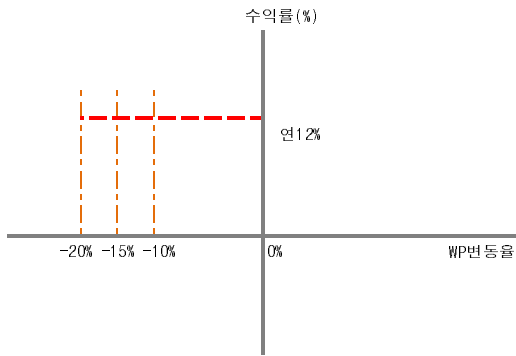
1. 계약금액

단위(백만원)

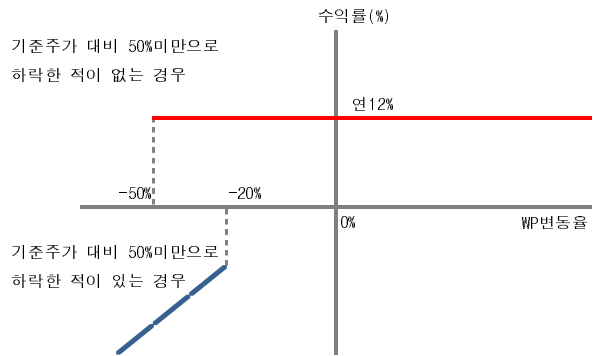
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512107048 대신증권(ELS)1029

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	98.87	83.53	68.19	52.85	37.51	22.17	6.83
	5.33%	83.74	68.40	53.06	37.72	22.38	7.04	(8.30)
	2.67%	66.12	50.78	35.44	20.10	4.76	(10.58)	(25.92)
	0.00%	46.02	30.68	15.34	0.00	(15.34)	(30.68)	(46.02)
	-2.67%	23.43	8.09	(7.25)	(22.59)	(37.93)	(53.27)	(68.60)
	-5.33%	(1.64)	(16.98)	(32.32)	(47.66)	(63.00)	(78.34)	(93.68)
	-8.00%	(29.20)	(44.54)	(59.88)	(75.22)	(90.56)	(105.89)	(121.23)

최대손실 시나리오

위험액	-121.23
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	115.11
-----	--------