

## 파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

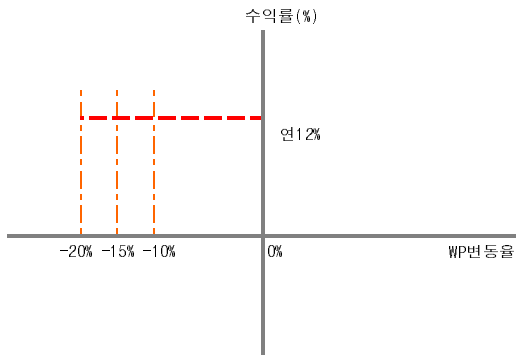
1. 계약금액

단위(백만원)

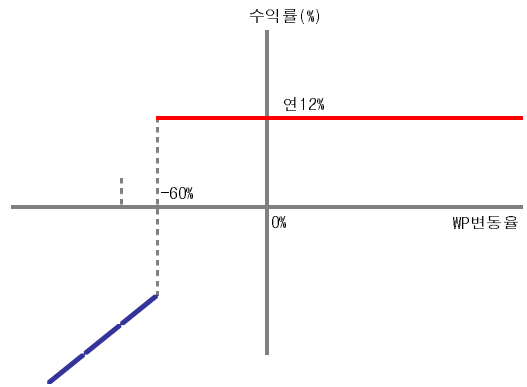
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	(35.98)	(36.47)	(36.96)	(37.44)	(37.93)	(38.42)	(38.91)
	5.33%	(13.73)	(14.22)	(14.71)	(15.20)	(15.68)	(16.17)	(16.66)
	2.67%	(1.25)	(1.74)	(2.23)	(2.71)	(3.20)	(3.69)	(4.18)
	0.00%	1.46	0.98	0.49	0.00	(0.49)	(0.98)	(1.46)
	-2.67%	(5.59)	(6.08)	(6.56)	(7.05)	(7.54)	(8.03)	(8.52)
	-5.33%	(22.41)	(22.90)	(23.38)	(23.87)	(24.36)	(24.85)	(25.33)
	-8.00%	(49.00)	(49.48)	(49.97)	(50.46)	(50.95)	(51.43)	(51.92)

최대손실 시나리오

위험액	-51.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	25.46
-----	-------

[1-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

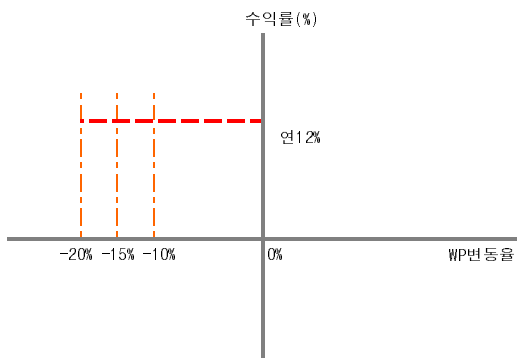
1. 계약금액

단위(백만원)

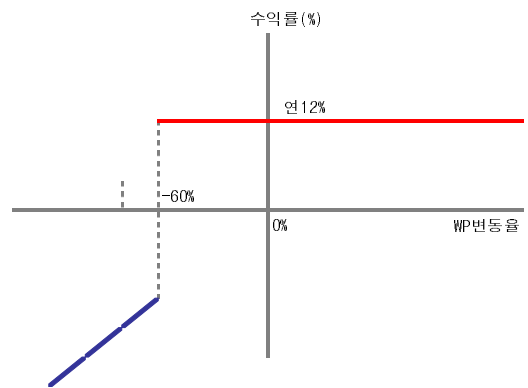
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[1-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

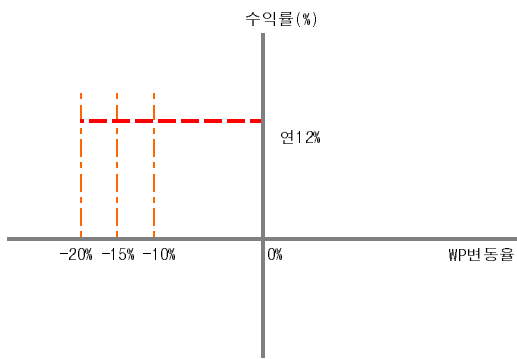
1. 계약금액

단위(백만원)

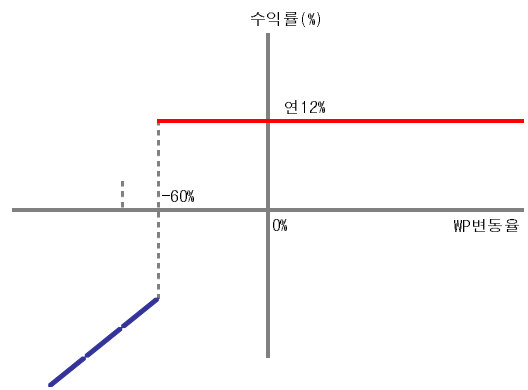
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[1-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

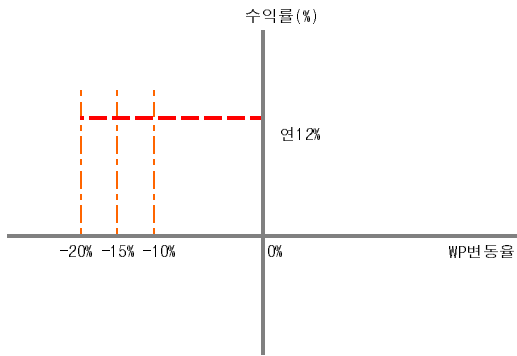
1. 계약금액

단위(백만원)

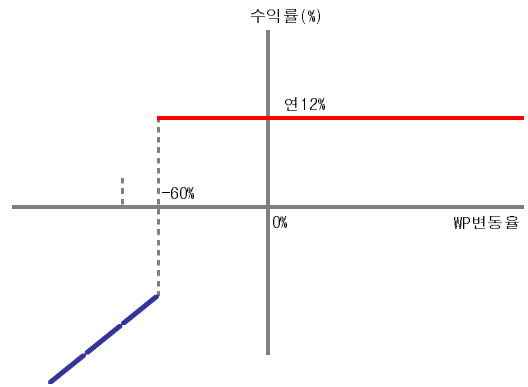
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

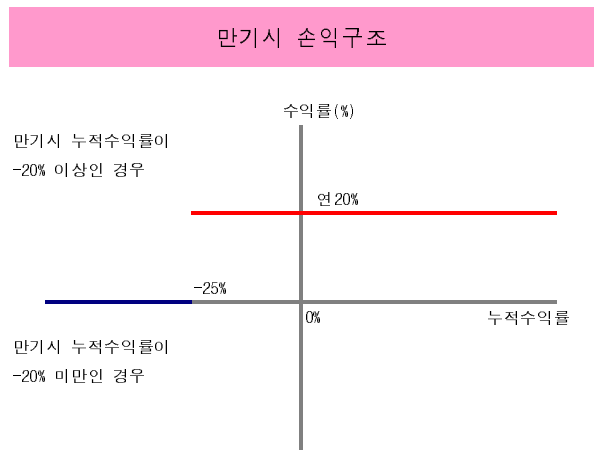
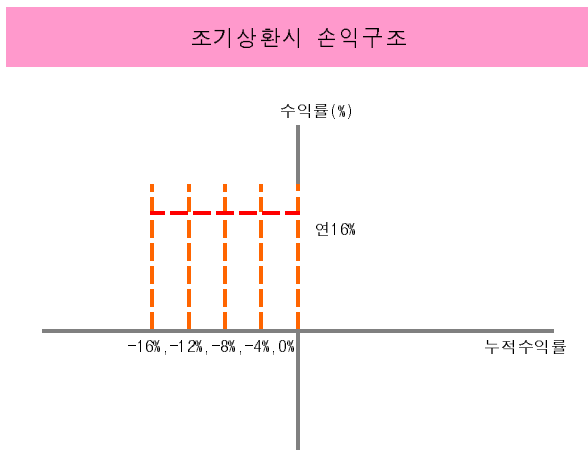
[2] 메리츠클리켓 단위 파생3호

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
-----	------

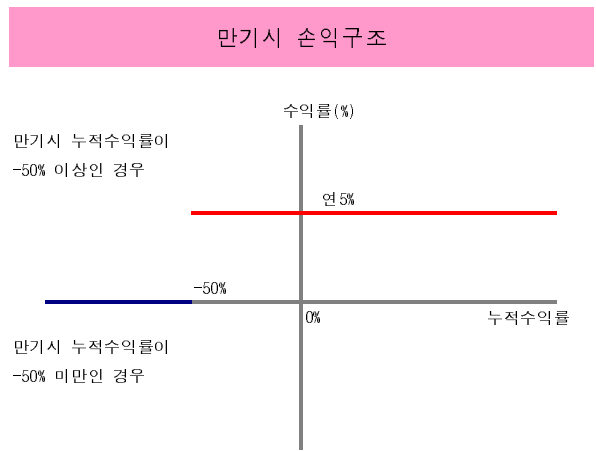
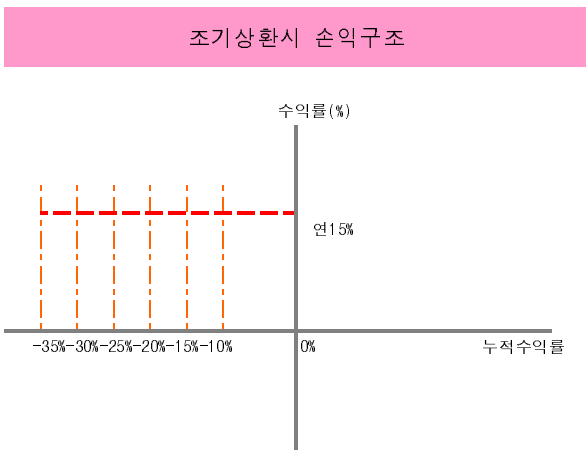
[3] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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
-----	------

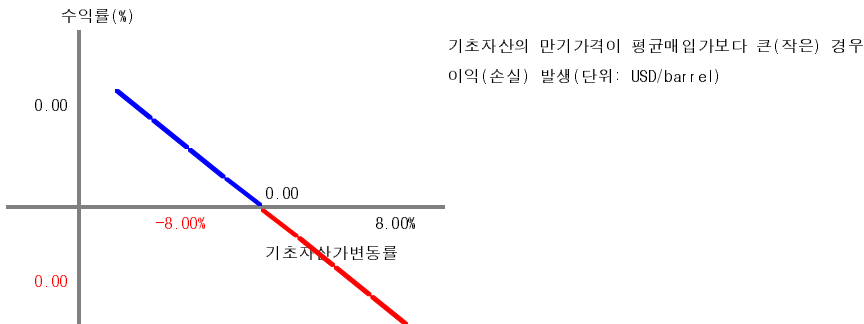
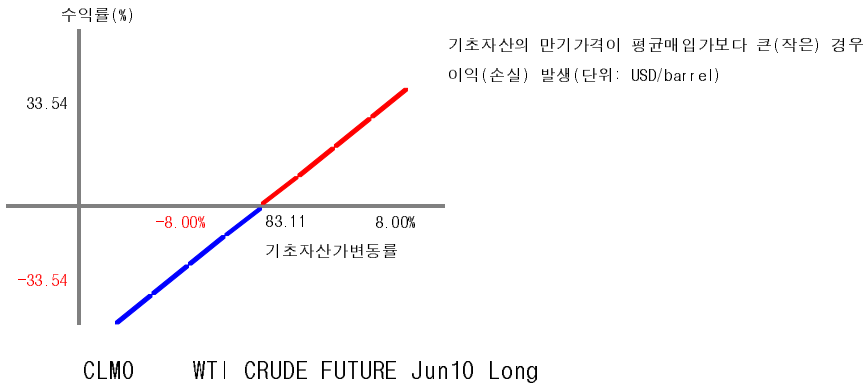
[4] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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	
기초자산시나리오	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
-----	-----



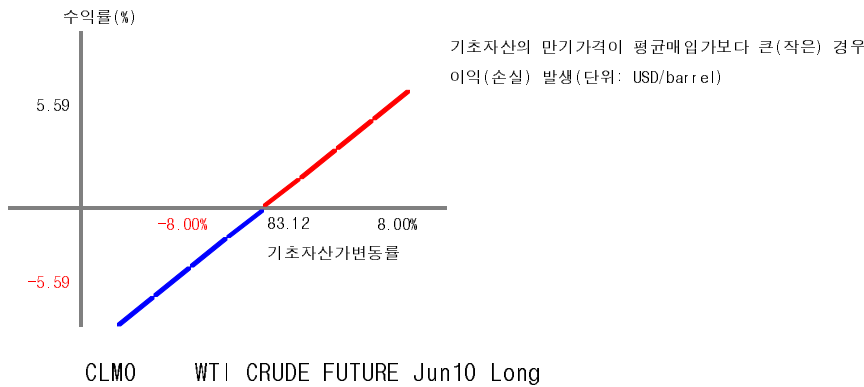
[5] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

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	
기초자산시나리오	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
-----	----

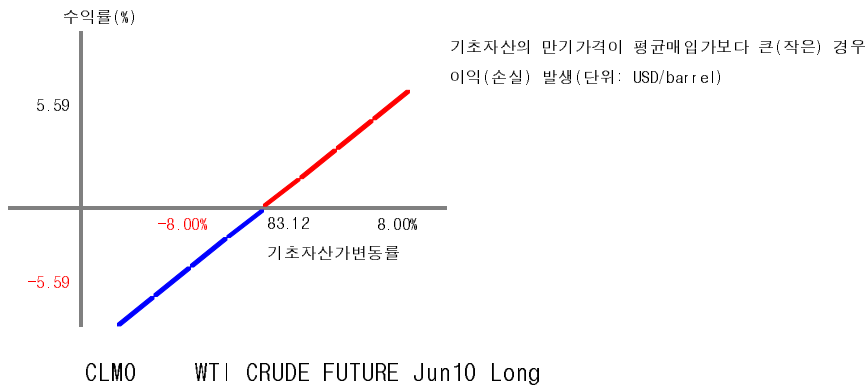
[6-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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%	20.87
	5.33%	13.91
	2.67%	6.97
	0.00%	0.00
	-2.67%	-6.97
	-5.33%	-13.91
	-8.00%	-20.87

최대손실 시나리오	
위험액	-20.87

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	83
-----	----

[6-2]

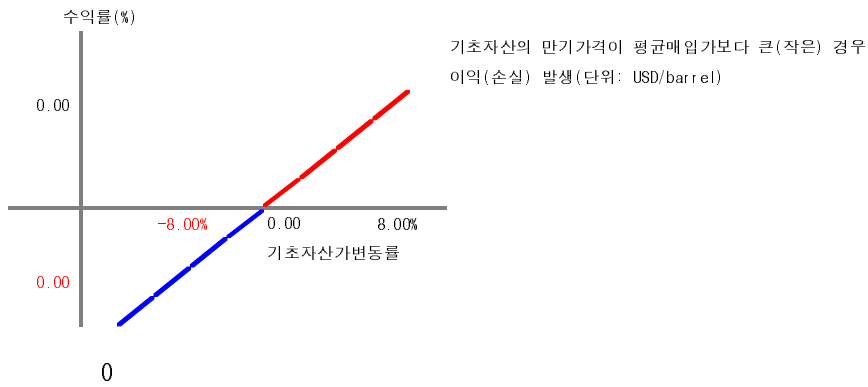
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



[6-3]

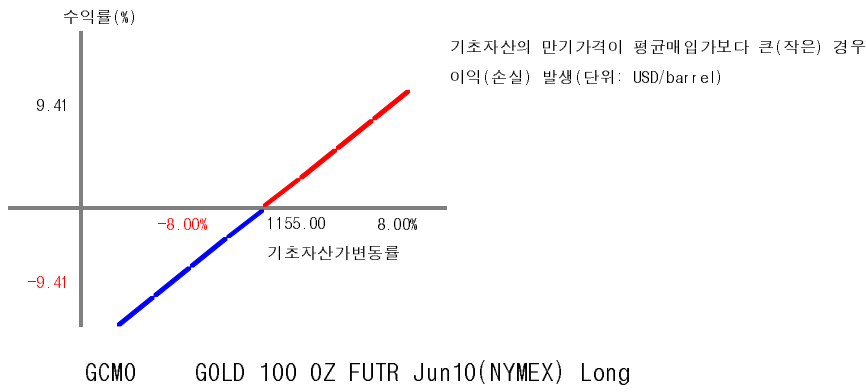
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



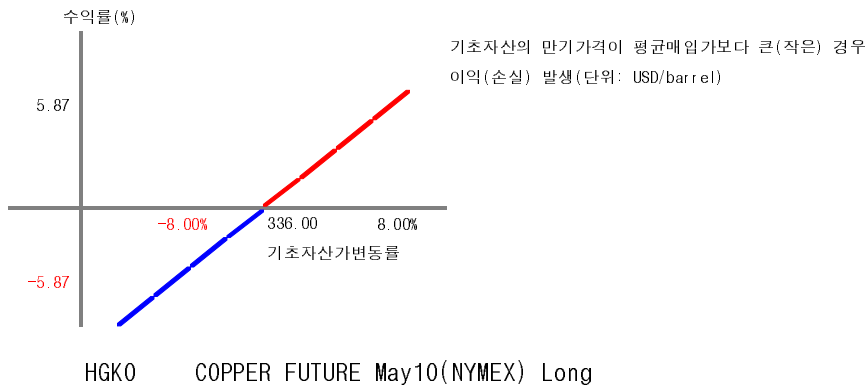
[6-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



[6-5]

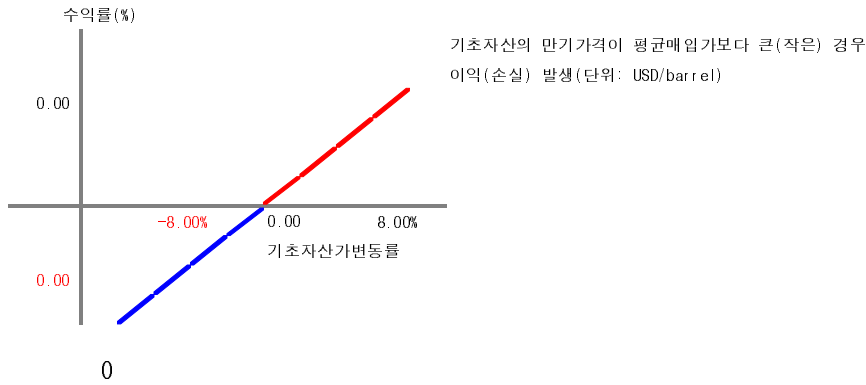
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



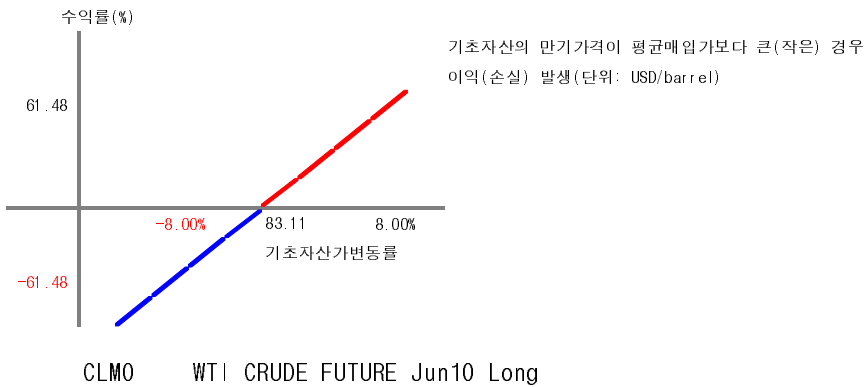
[7] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	61.48
	5.33%	40.96
	2.67%	20.52
	0.00%	0.00
	-2.67%	-20.52
	-5.33%	-40.96
	-8.00%	-61.48

최대손실 시나리오	
위험액	-61.48

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	232
-----	-----

[8-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

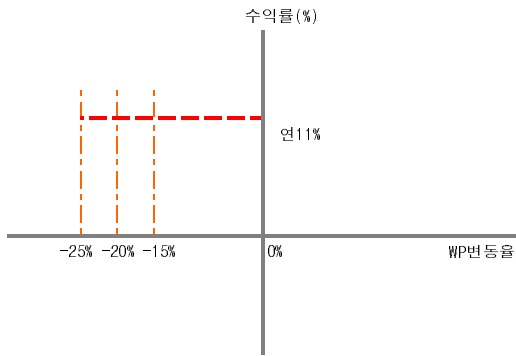
1. 계약금액

단위(백만원)

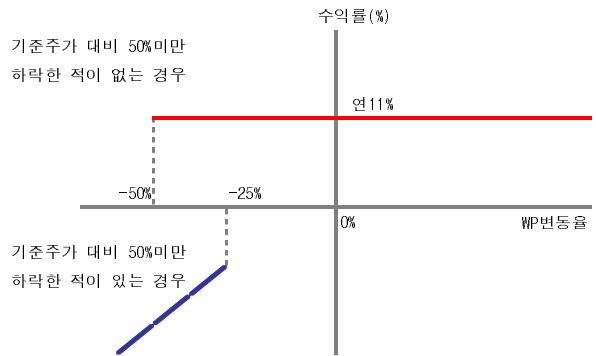
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

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%	10.26	6.50	2.75	(1.00)	(4.75)	(8.51)	(12.26)
	5.33%	18.89	15.14	11.39	7.64	3.88	0.13	(3.62)
	2.67%	19.23	15.47	11.72	7.97	4.22	0.46	(3.29)
	0.00%	11.26	7.51	3.75	0.00	(3.75)	(7.51)	(11.26)
	-2.67%	(5.02)	(8.77)	(12.52)	(16.27)	(20.03)	(23.78)	(27.53)
	-5.33%	(29.59)	(33.34)	(37.10)	(40.85)	(44.60)	(48.35)	(52.11)
	-8.00%	(62.47)	(66.22)	(69.98)	(73.73)	(77.48)	(81.23)	(84.99)

최대손실 시나리오

위험액	-84.99
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	79.38
-----	-------



[8-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

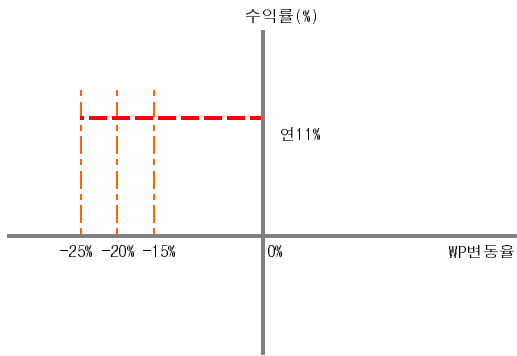
1. 계약금액

단위(백만원)

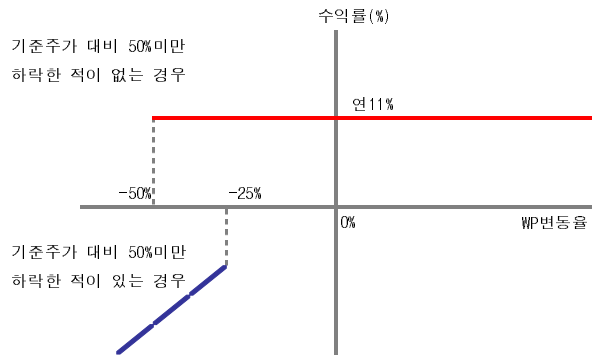
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

[8-3]

메리츠한중지수연계증권제2호

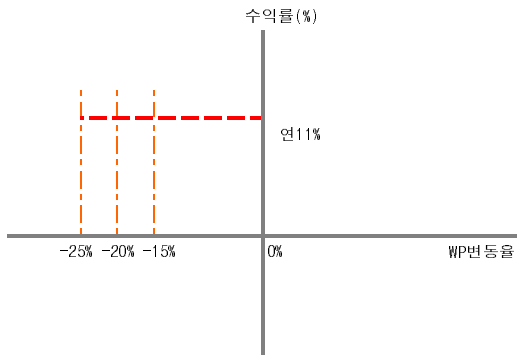
1. 계약금액

단위(백만원)

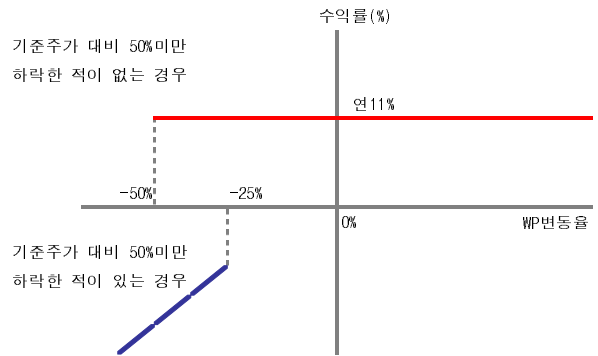
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[8-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

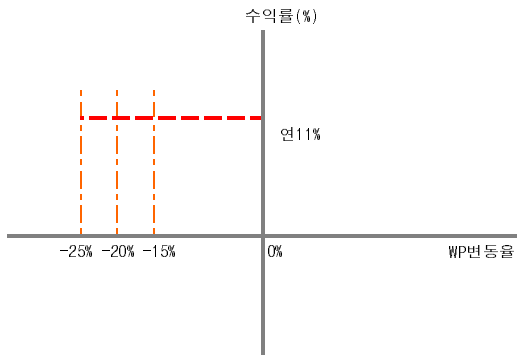
1. 계약금액

단위(백만원)

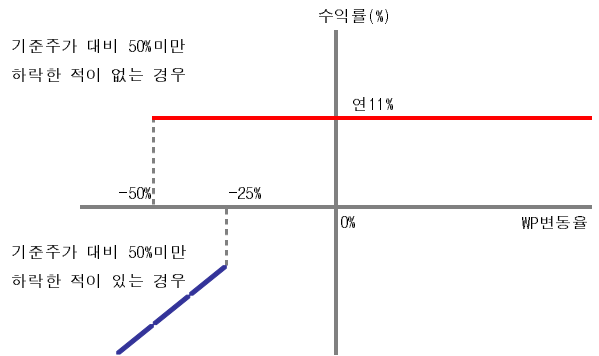
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[9-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

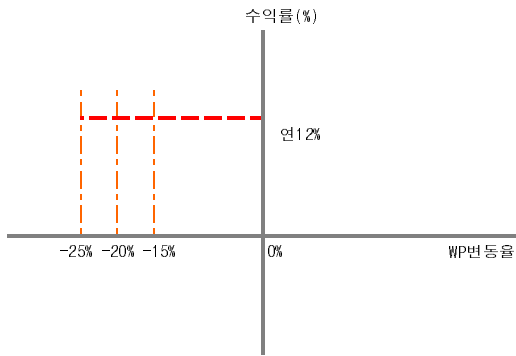
1. 계약금액

단위(백만원)

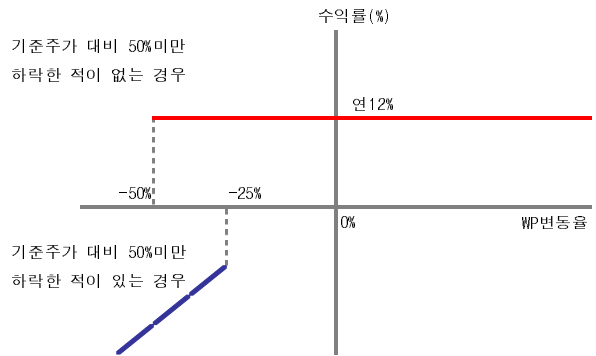
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513340WC0 대신증권(ELS)920

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나 리오	8.00%	54.32	47.61	40.89	34.18	27.46	20.74	14.03
	5.33%	49.29	42.57	35.85	29.14	22.42	15.71	8.99
	2.67%	37.90	31.18	24.46	17.75	11.03	4.31	(2.40)
	0.00%	20.15	13.43	6.72	0.00	(6.72)	(13.43)	(20.15)
	-2.67%	(3.95)	(10.67)	(17.39)	(24.10)	(30.82)	(37.53)	(44.25)
	-5.33%	(34.41)	(41.13)	(47.84)	(54.56)	(61.27)	(67.99)	(74.71)
	-8.00%	(71.22)	(77.94)	(84.65)	(91.37)	(98.08)	(104.80)	(111.52)

최대손실 시나리오

위험액	-111.52
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	116.05
-----	--------

[9-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

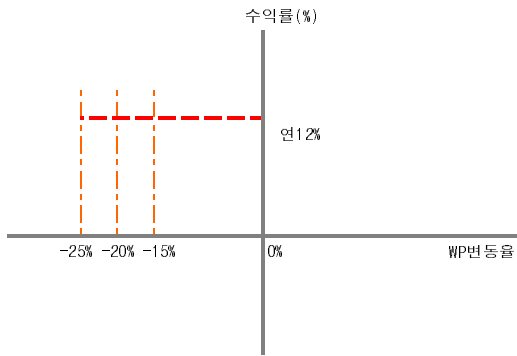
1. 계약금액

단위(백만원)

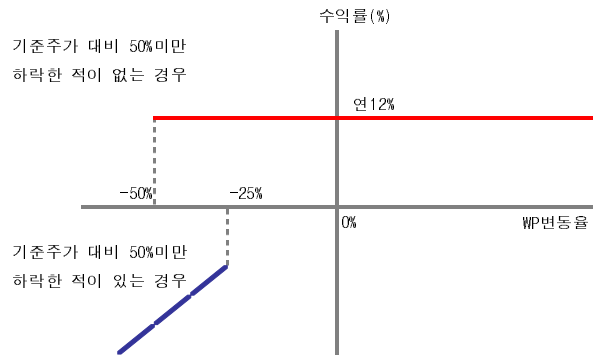
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

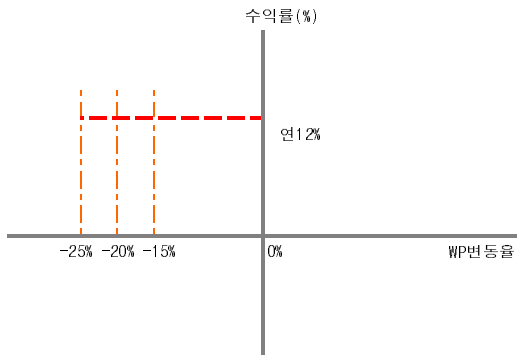
1. 계약금액

단위(백만원)

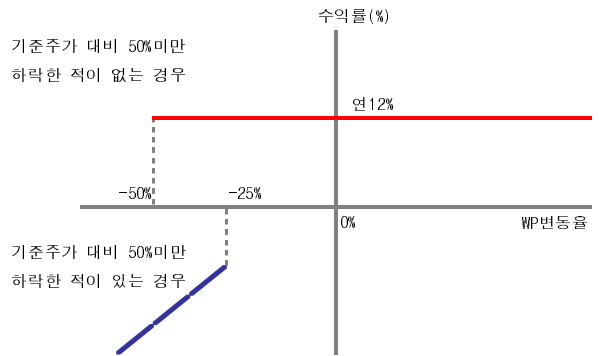
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[9-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

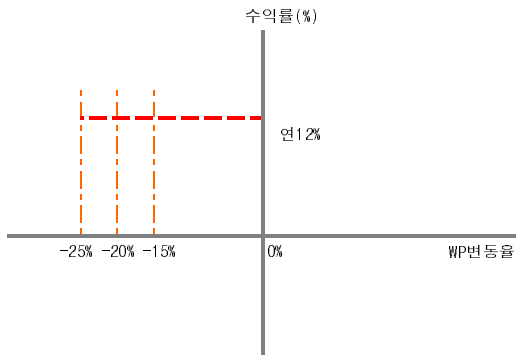
1. 계약금액

단위(백만원)

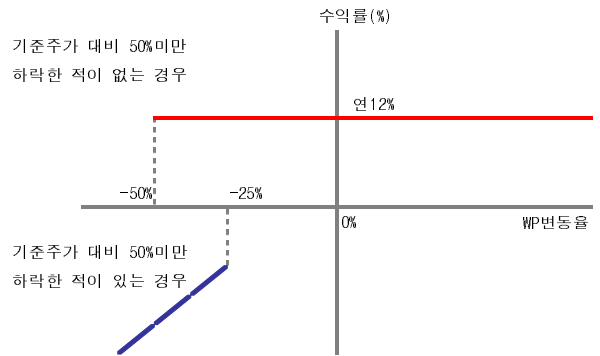
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[10-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

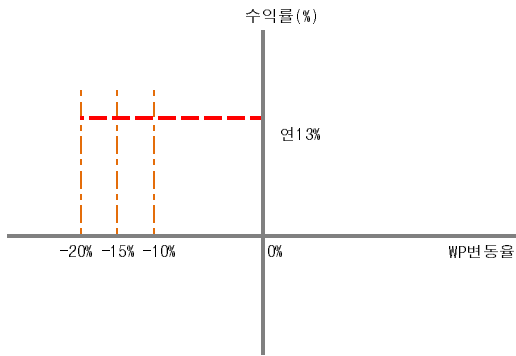
1. 계약금액

단위(백만원)

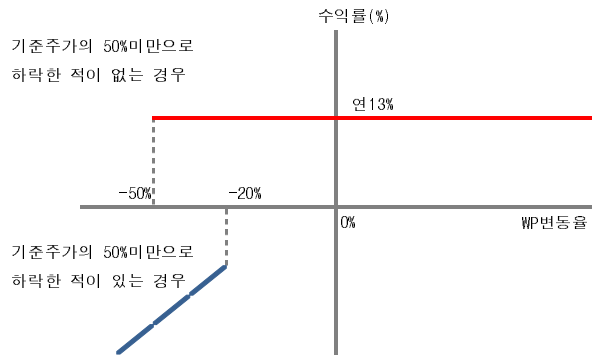
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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%	215.74	180.35	144.97	109.59	74.20	38.82	3.44
	5.33%	197.06	161.68	126.30	90.91	55.53	20.15	(15.24)
	2.67%	160.53	125.15	89.77	54.38	19.00	(16.38)	(51.77)
	0.00%	106.15	70.77	35.38	0.00	(35.38)	(70.77)	(106.15)
	-2.67%	33.91	(1.47)	(36.86)	(72.24)	(107.62)	(143.01)	(178.39)
	-5.33%	(56.18)	(91.57)	(126.95)	(162.33)	(197.72)	(233.10)	(268.48)
	-8.00%	(164.13)	(199.51)	(234.90)	(270.28)	(305.66)	(341.05)	(376.43)

최대손실 시나리오

위험액	-376.43
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	370.42
-----	--------



[10-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

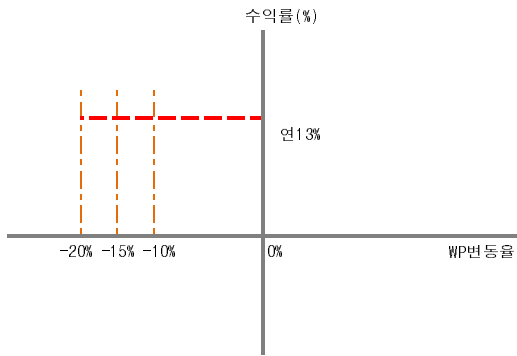
1. 계약금액

단위(백만원)

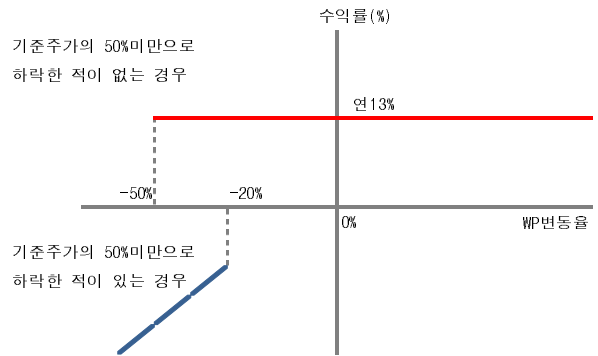
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[10-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

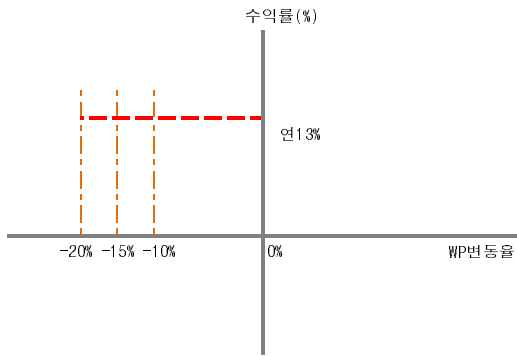
1. 계약금액

단위(백만원)

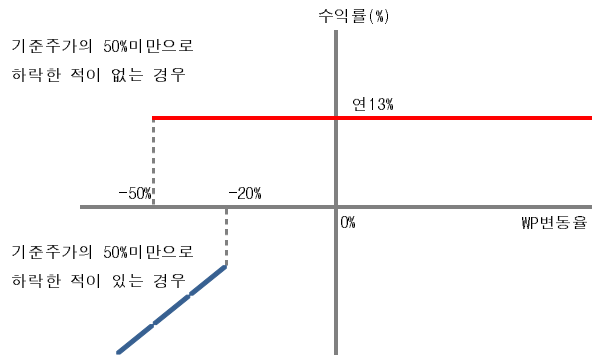
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[10-4] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

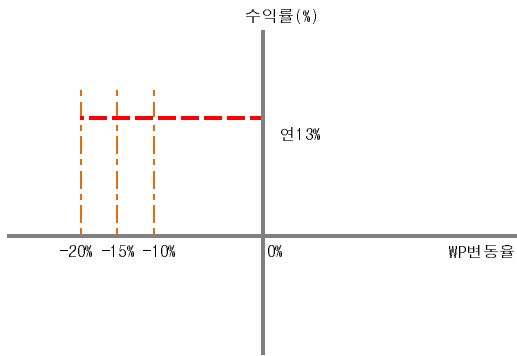
1. 계약금액

단위(백만원)

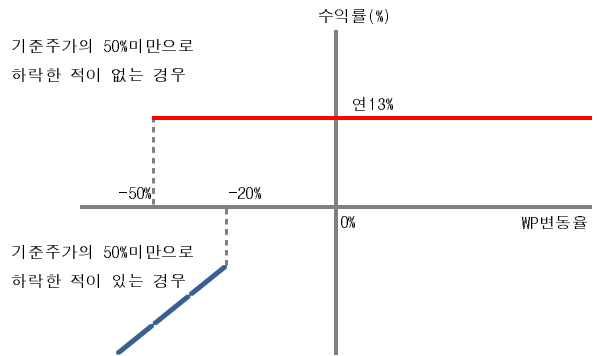
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703338014 H&D증권(ELS)431

[11-1] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

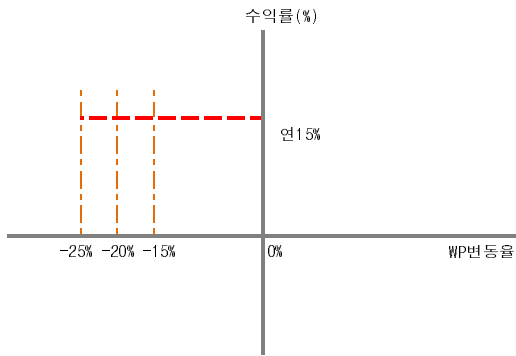
1. 계약금액

단위(백만원)

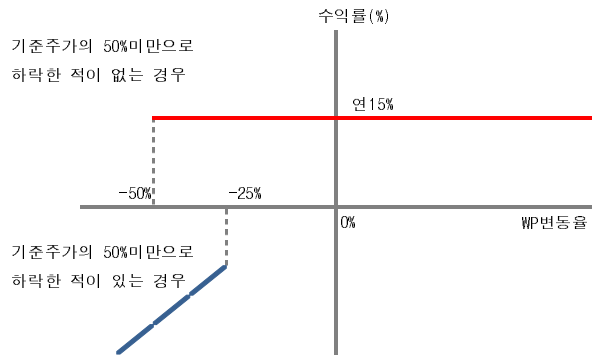
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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 시나 리오	8.00%	149.04	126.56	104.07	81.59	59.10	36.61	14.13
	5.33%	126.76	104.28	81.79	59.31	36.82	14.34	(8.15)
	2.67%	99.57	77.08	54.60	32.11	9.63	(12.86)	(35.35)
	0.00%	67.46	44.97	22.49	0.00	(22.49)	(44.97)	(67.46)
	-2.67%	30.43	7.94	(14.54)	(37.03)	(59.51)	(82.00)	(104.48)
	-5.33%	(11.52)	(34.00)	(56.49)	(78.97)	(101.46)	(123.94)	(146.43)
	-8.00%	(58.38)	(80.86)	(103.35)	(125.83)	(148.32)	(170.80)	(193.29)

최대손실 시나리오

위험액	-193.29
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	174.38
-----	--------

[11-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

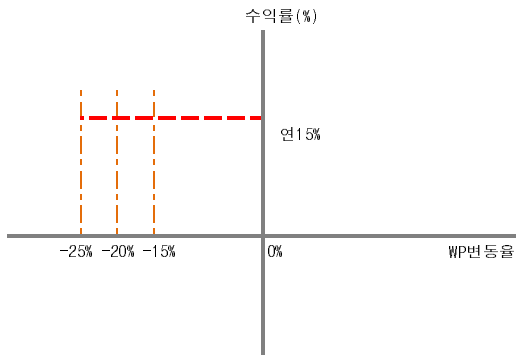
1. 계약금액

단위(백만원)

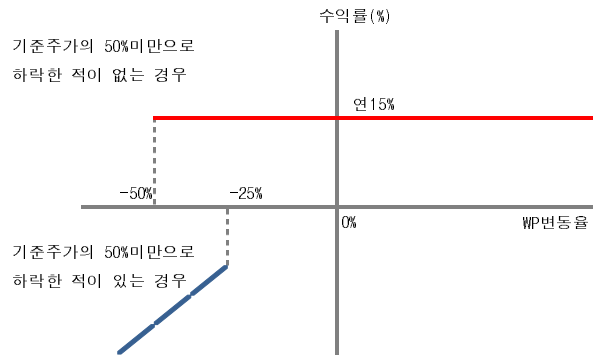
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[11-3]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

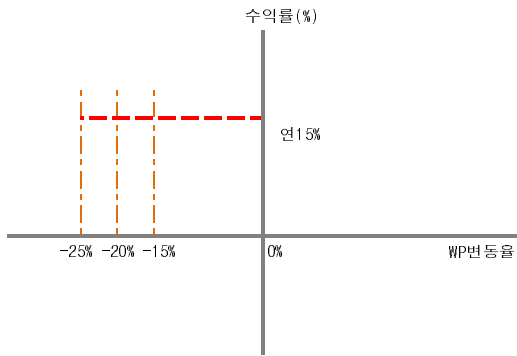
1. 계약금액

단위(백만원)

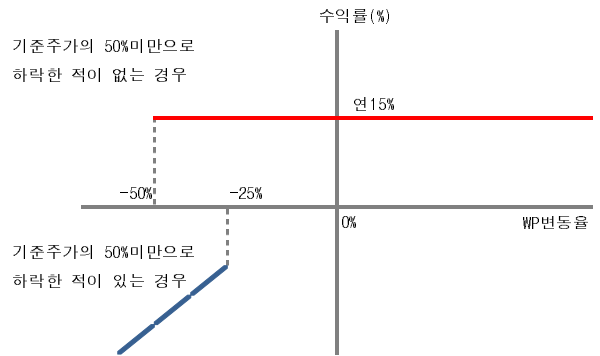
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[11-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

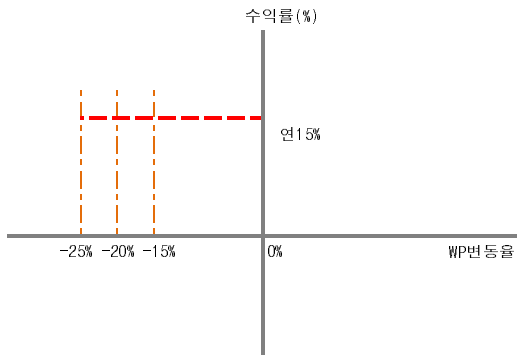
1. 계약금액

단위(백만원)

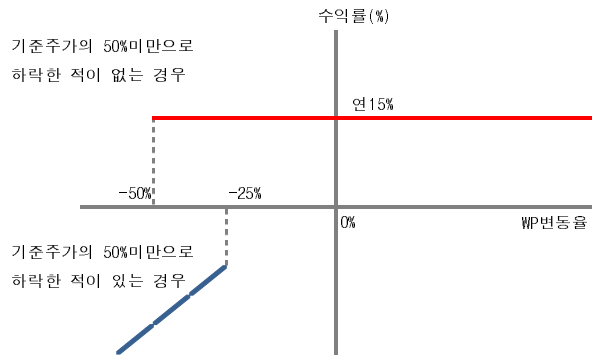
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

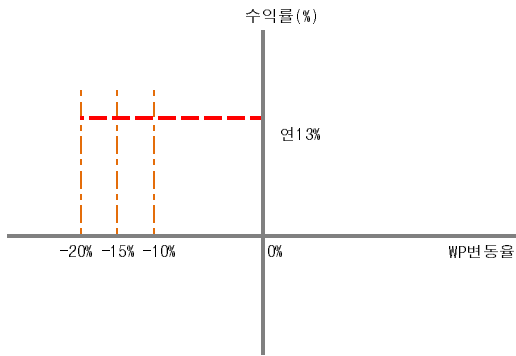
1. 계약금액

단위(백만원)

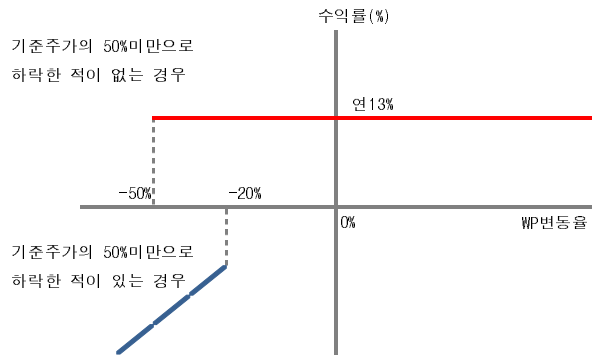
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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%	109.33	92.35	75.37	58.39	41.40	24.42	7.44
	5.33%	97.02	80.04	63.06	46.08	29.10	12.11	(4.87)
	2.67%	77.56	60.58	43.60	26.62	9.63	(7.35)	(24.33)
	0.00%	50.95	33.96	16.98	0.00	(16.98)	(33.96)	(50.95)
	-2.67%	17.18	0.19	(16.79)	(33.77)	(50.75)	(67.73)	(84.71)
	-5.33%	(23.75)	(40.73)	(57.71)	(74.69)	(91.67)	(108.66)	(125.64)
	-8.00%	(71.82)	(88.80)	(105.79)	(122.77)	(139.75)	(156.73)	(173.71)

최대손실 시나리오

위험액	-173.71
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	164.99
-----	--------



[12-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

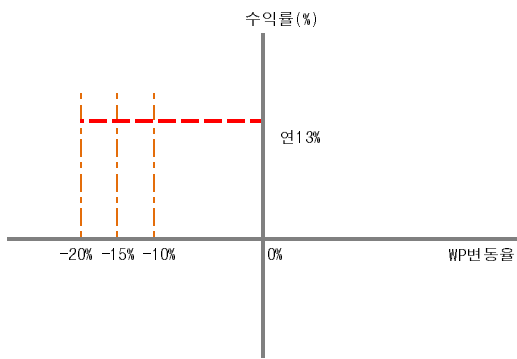
1. 계약금액

단위(백만원)

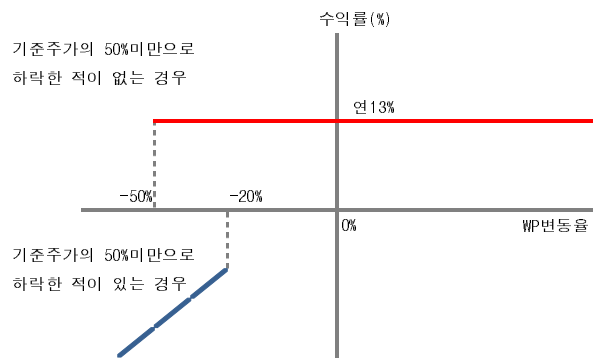
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[12-3]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

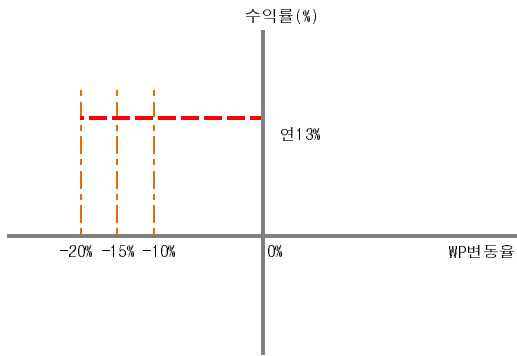
1. 계약금액

단위(백만원)

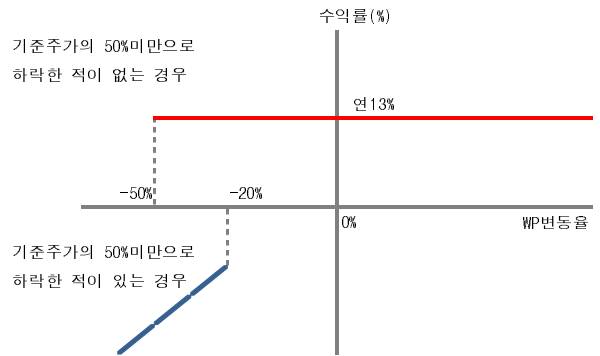
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[12-4]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

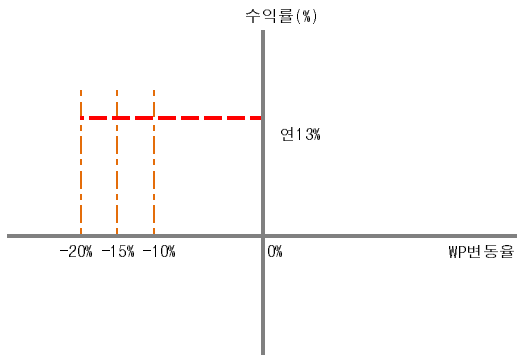
1. 계약금액

단위(백만원)

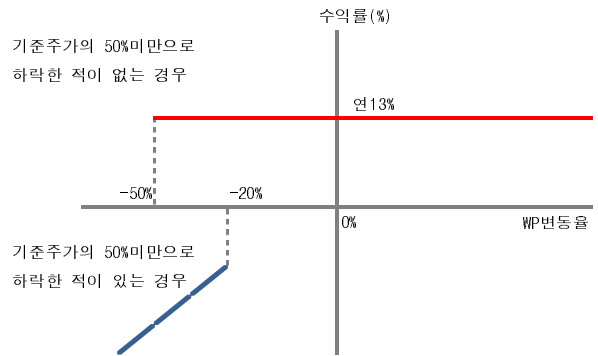
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504

[13] 메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

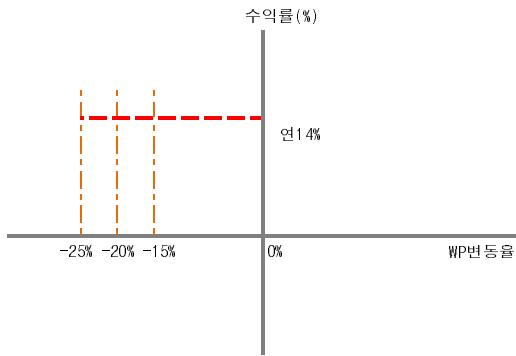
1. 계약금액

단위(백만원)

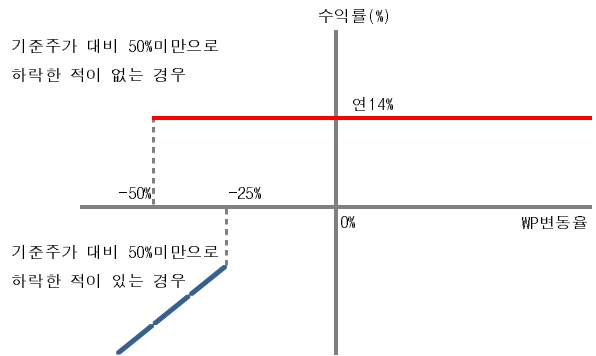
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장익

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%	130.56	112.03	93.51	74.98	56.46	37.93	19.40
	5.33%	110.90	92.37	73.85	55.32	36.79	18.27	(0.26)
	2.67%	85.90	67.38	48.85	30.33	11.80	(6.73)	(25.25)
	0.00%	55.58	37.05	18.53	0.00	(18.53)	(37.05)	(55.58)
	-2.67%	19.92	1.40	(17.13)	(35.66)	(54.18)	(72.71)	(91.24)
	-5.33%	(21.07)	(39.59)	(58.12)	(76.64)	(95.17)	(113.70)	(132.22)
	-8.00%	(67.38)	(85.91)	(104.44)	(122.96)	(141.49)	(160.02)	(178.54)

최대손실 시나리오

위험액	-178.54
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	169.38
-----	--------

[14] 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

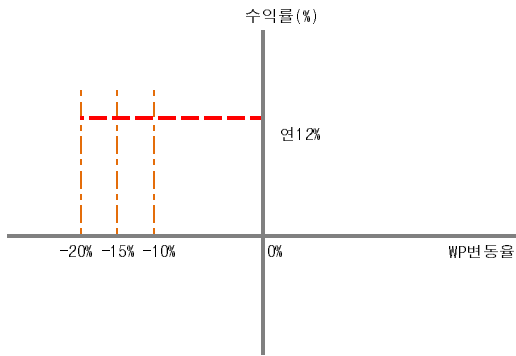
1. 계약금액

단위(백만원)

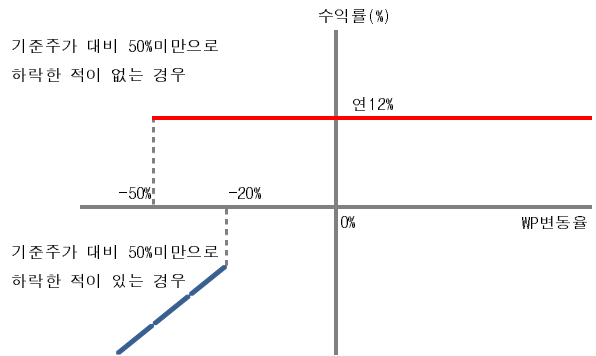
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502348032 신한투자(ELS)1408

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	59.53	51.12	42.70	34.28	25.87	17.45	9.03
	5.33%	50.37	41.95	33.53	25.12	16.70	8.29	(0.13)
	2.67%	38.94	30.52	22.11	13.69	5.27	(3.14)	(11.56)
	0.00%	25.25	16.83	8.42	0.00	(8.42)	(16.83)	(25.25)
	-2.67%	9.30	0.88	(7.54)	(15.95)	(24.37)	(32.79)	(41.20)
	-5.33%	(8.92)	(17.34)	(25.75)	(34.17)	(42.59)	(51.00)	(59.42)
	-8.00%	(29.40)	(37.82)	(46.23)	(54.65)	(63.07)	(71.48)	(79.90)

최대손실 시나리오

위험액	-79.90
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	72.88
-----	-------

[15] 메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

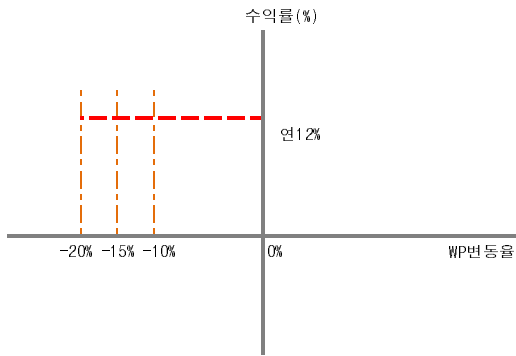
1. 계약금액

단위(백만원)

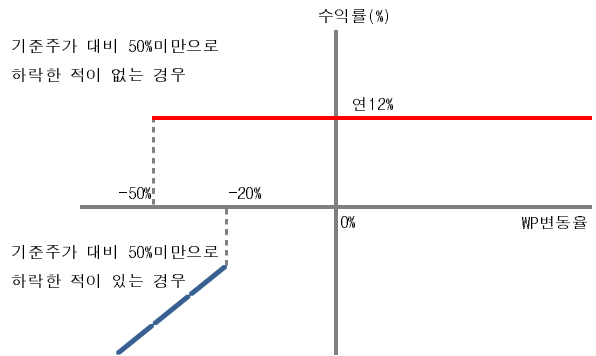
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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 시나리오	8.00%	105.42	89.74	74.05	58.36	42.67	26.98	11.30
	5.33%	88.13	72.44	56.75	41.07	25.38	9.69	(6.00)
	2.67%	68.68	52.99	37.30	21.61	5.92	(9.76)	(25.45)
	0.00%	47.06	31.38	15.69	0.00	(15.69)	(31.38)	(47.06)
	-2.67%	23.29	7.60	(8.08)	(23.77)	(39.46)	(55.15)	(70.84)
	-5.33%	(2.64)	(18.33)	(34.02)	(49.70)	(65.39)	(81.08)	(96.77)
	-8.00%	(30.73)	(46.42)	(62.11)	(77.80)	(93.48)	(109.17)	(124.86)

최대 손실 시나리오

위험액	-124.86
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	120.82
-----	--------