

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

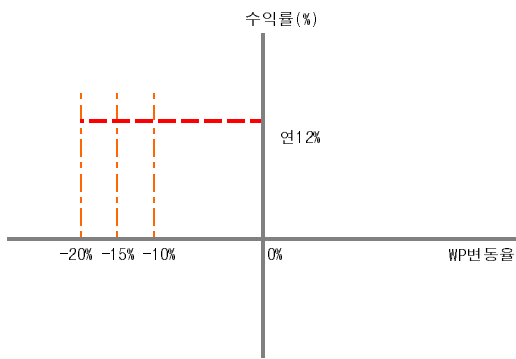
1. 계약금액

단위(백만원)

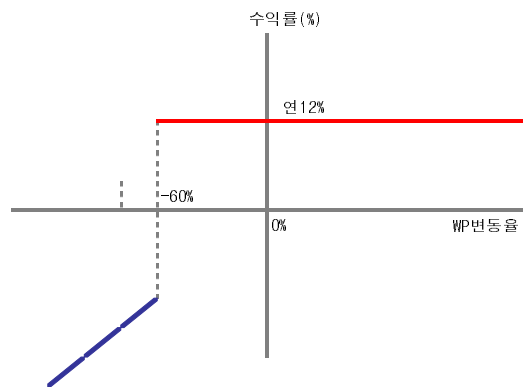
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	(10.51)	(10.69)	(10.87)	(11.05)	(11.22)	(11.40)	(11.58)
	5.33%	(4.10)	(4.28)	(4.45)	(4.63)	(4.81)	(4.99)	(5.16)
	2.67%	(0.42)	(0.59)	(0.77)	(0.95)	(1.13)	(1.30)	(1.48)
	0.00%	0.53	0.36	0.18	0.00	(0.18)	(0.36)	(0.53)
	-2.67%	(1.25)	(1.43)	(1.61)	(1.79)	(1.96)	(2.14)	(2.32)
	-5.33%	(5.77)	(5.95)	(6.13)	(6.30)	(6.48)	(6.66)	(6.84)
	-8.00%	(13.02)	(13.20)	(13.38)	(13.56)	(13.73)	(13.91)	(14.09)

최대손실 시나리오

위험액	-14.09
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	3.45
-----	------

[1-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

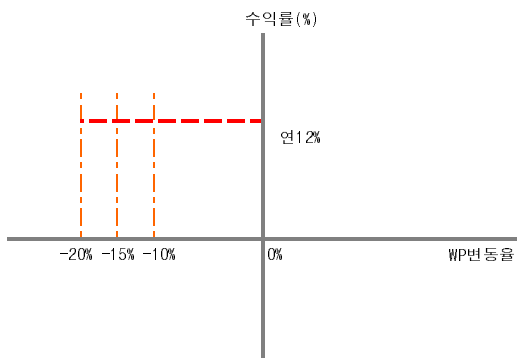
1. 계약금액

단위(백만원)

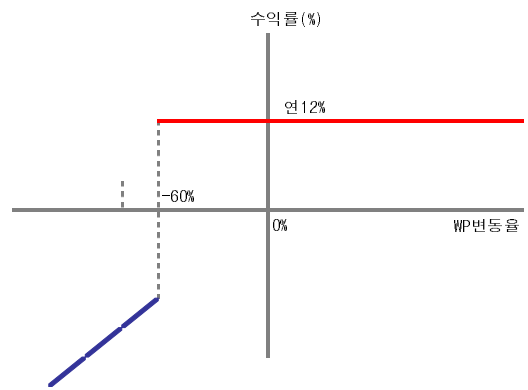
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[1-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

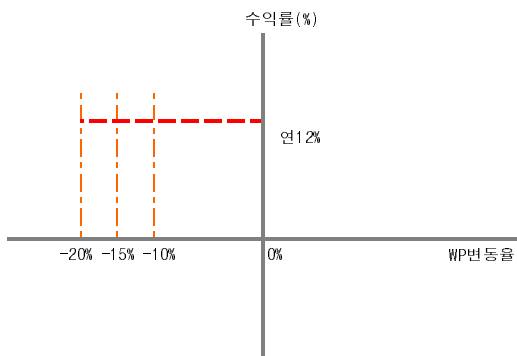
1. 계약금액

단위(백만원)

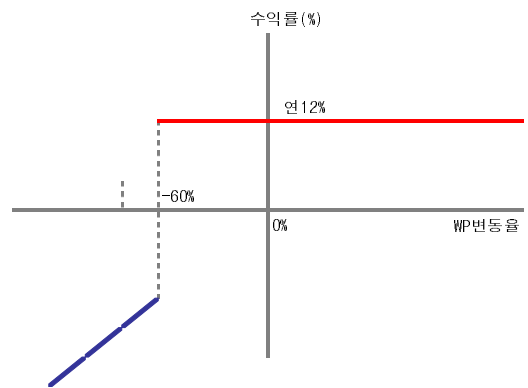
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[1-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

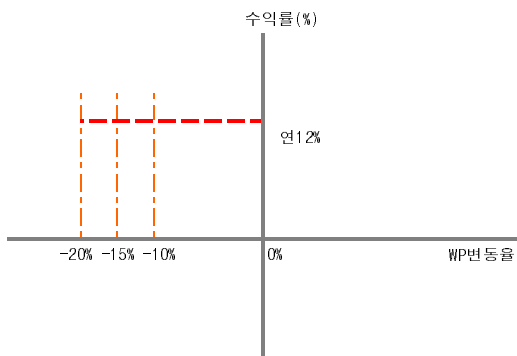
1. 계약금액

단위(백만원)

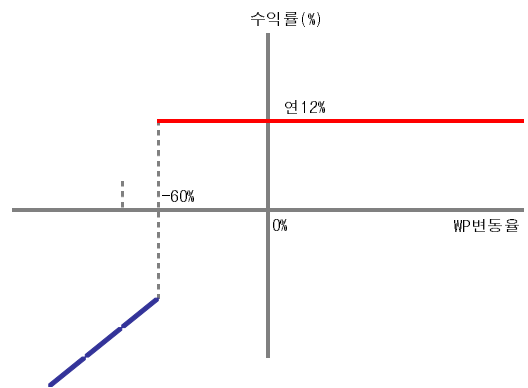
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

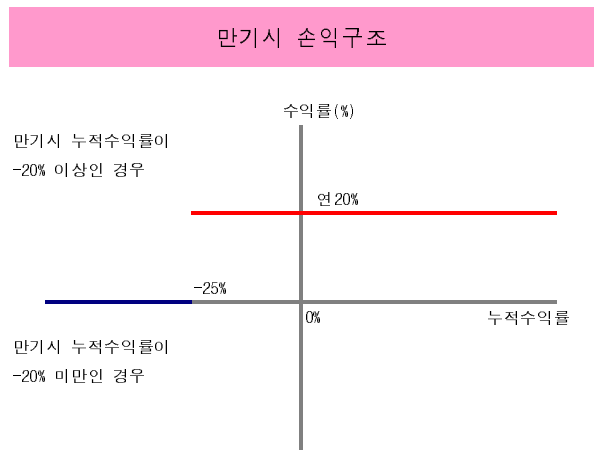
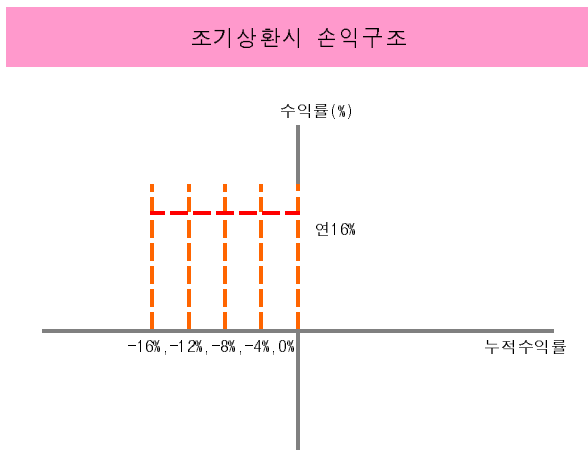
[2] 메리츠크리켓 단위 파생3호

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
-----	------

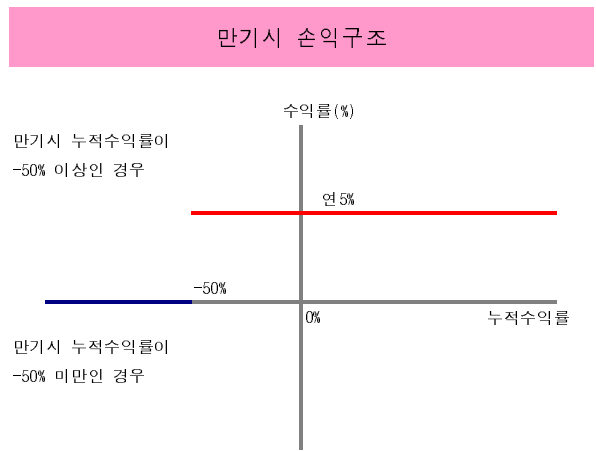
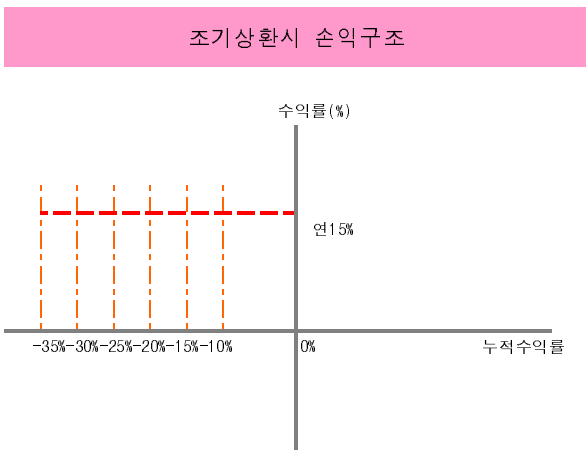
[3] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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	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
-----	------

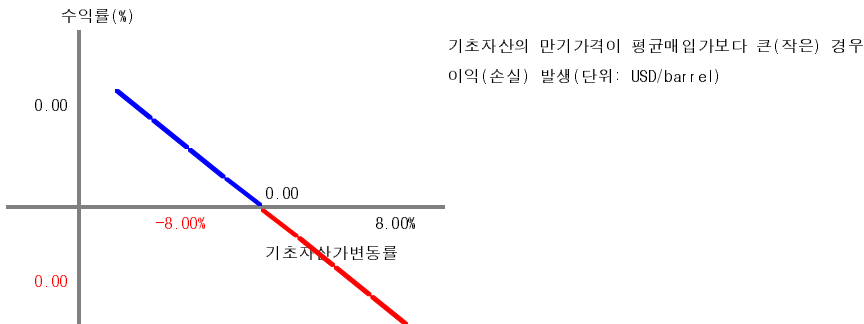
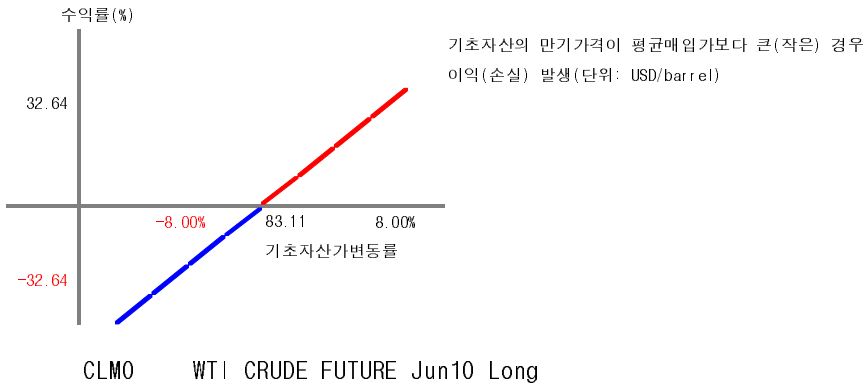
[4] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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	
기초 자산 시나 리오	8.00%	32.64
	5.33%	21.75
	2.67%	10.89
	0.00%	0.00
	-2.67%	-10.89
	-5.33%	-21.75
	-8.00%	-32.64

최대손실 시나리오	
위험액	-32.64

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	132
-----	-----

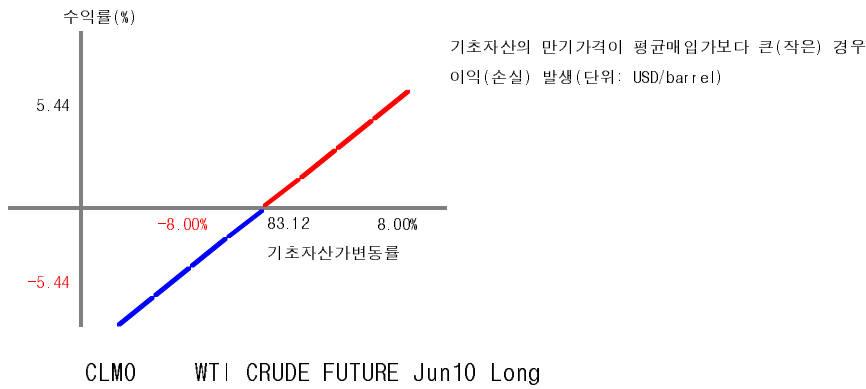
[5] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

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%	5.44
	5.33%	3.62
	2.67%	1.82
	0.00%	0.00
	-2.67%	-1.82
	-5.33%	-3.62
	-8.00%	-5.44

최대손실 시나리오	
위험액	-5.44

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	22
-----	----

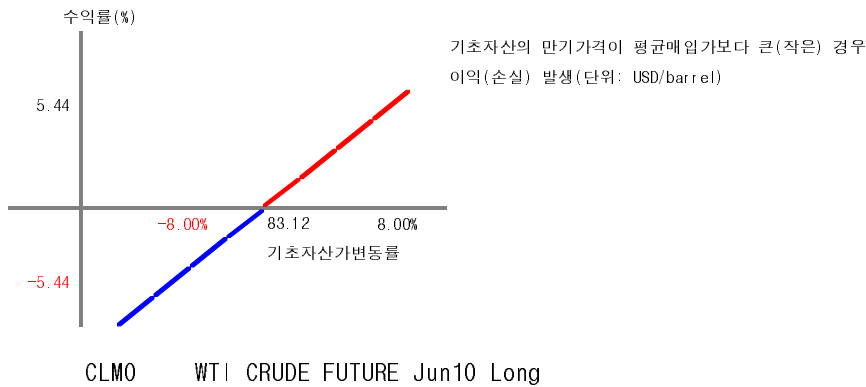
[6-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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(최대 손실 가능금액(단위:1000USD))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	21.10
	5.33%	14.06
	2.67%	7.04
	0.00%	0.00
	-2.67%	-7.04
	-5.33%	-14.06
	-8.00%	-21.10

최대손실 시나리오	
위험액	-21.10

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	84
-----	----

[6-2]

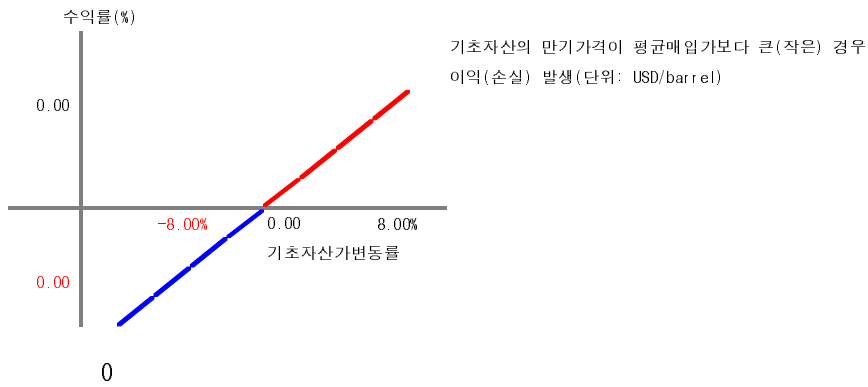
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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]

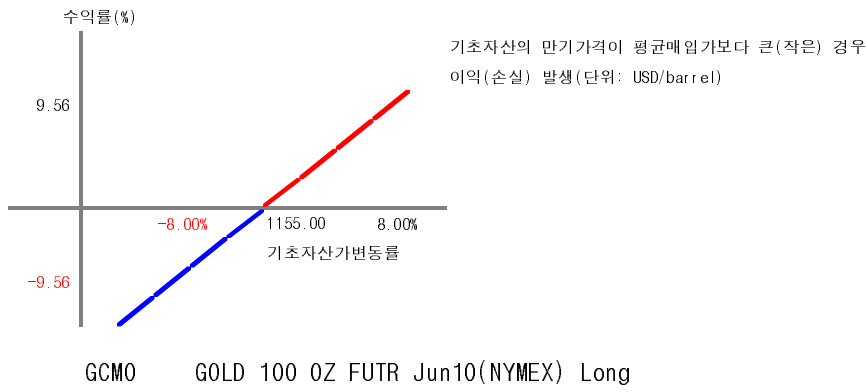
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



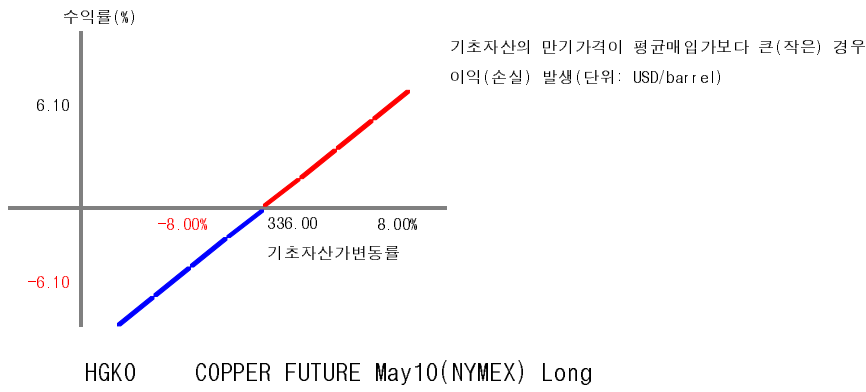
[6-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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

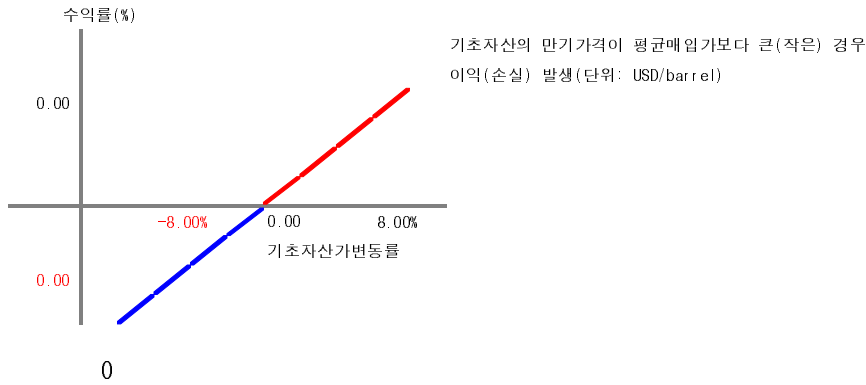


1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



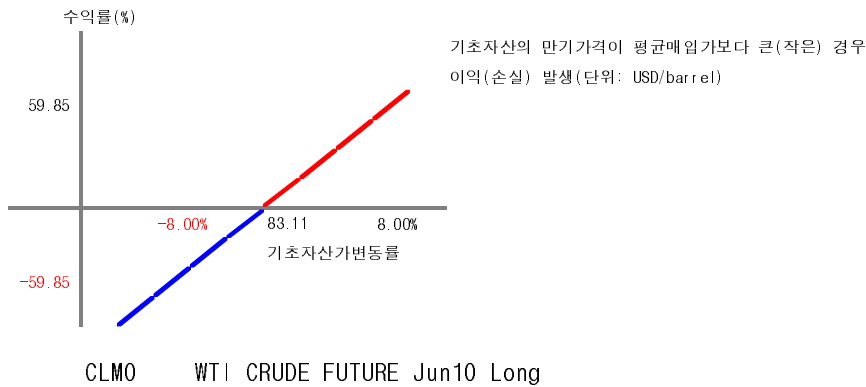
[7] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	59.85
	5.33%	39.87
	2.67%	19.97
	0.00%	0.00
	-2.67%	-19.97
	-5.33%	-39.87
	-8.00%	-59.85

최대손실 시나리오	
위험액	-59.85

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	225
-----	-----

[8-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

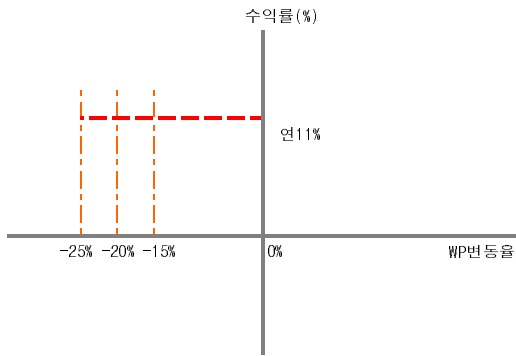
1. 계약금액

단위(백만원)

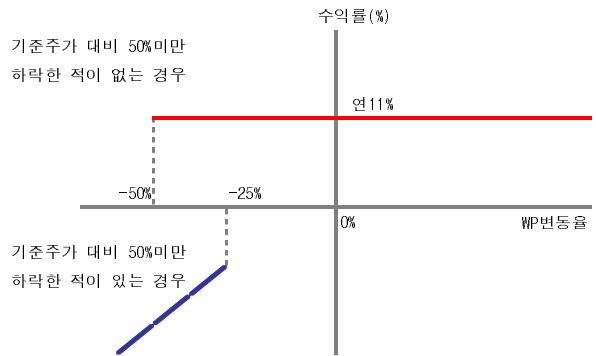
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503327WC9 신한투자(ELS)1275

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	(3.98)	(6.23)	(8.48)	(10.74)	(12.99)	(15.24)	(17.50)
	5.33%	4.30	2.05	(0.20)	(2.46)	(4.71)	(6.96)	(9.22)
	2.67%	7.88	5.63	3.38	1.12	(1.13)	(3.38)	(5.64)
	0.00%	6.76	4.51	2.25	0.00	(2.25)	(4.51)	(6.76)
	-2.67%	0.94	(1.32)	(3.57)	(5.82)	(8.08)	(10.33)	(12.58)
	-5.33%	(9.59)	(11.84)	(14.10)	(16.35)	(18.60)	(20.86)	(23.11)
	-8.00%	(24.82)	(27.07)	(29.32)	(31.58)	(33.83)	(36.08)	(38.34)

최대손실 시나리오

위험액	-38.34
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	29.20
-----	-------

[8-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

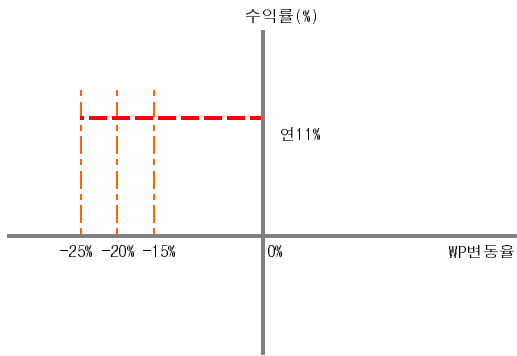
1. 계약금액

단위(백만원)

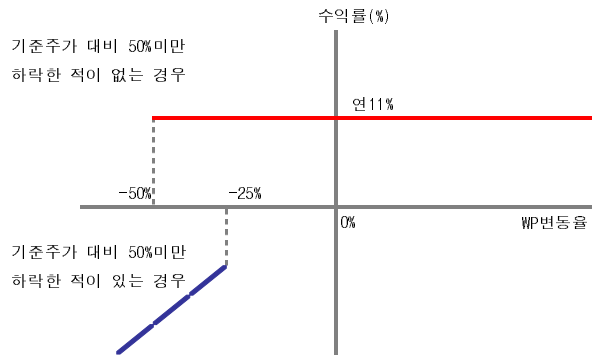
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

[8-3]

메리츠한중지수연계증권제2호

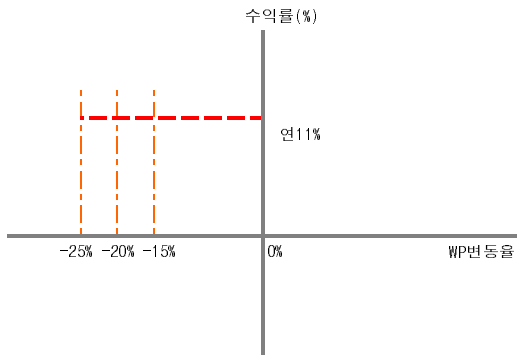
1. 계약금액

단위(백만원)

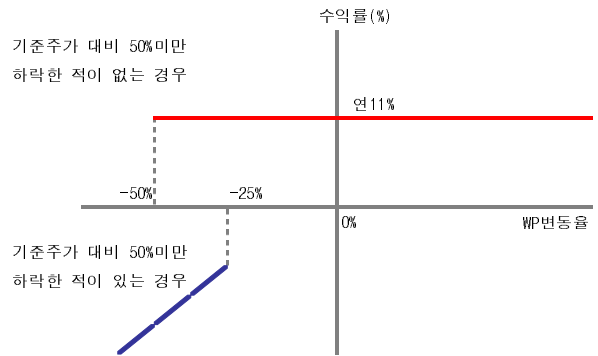
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[8-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

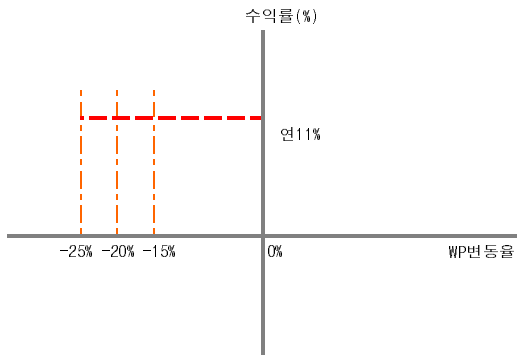
1. 계약금액

단위(백만원)

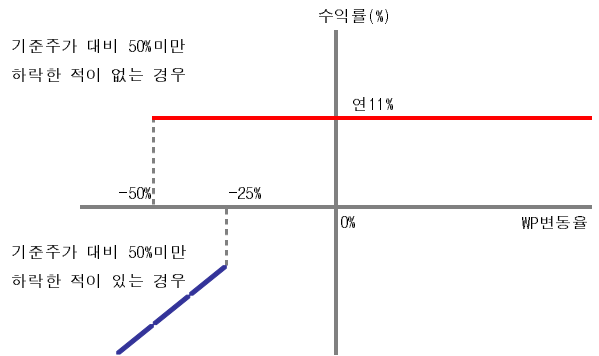
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[9-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

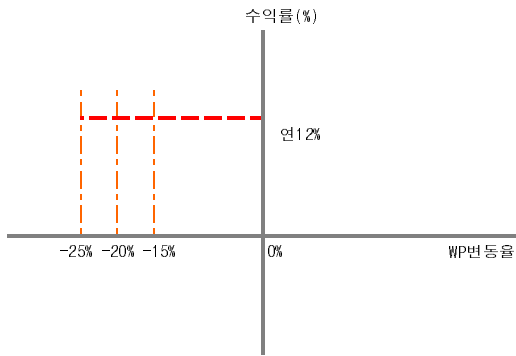
1. 계약금액

단위(백만원)

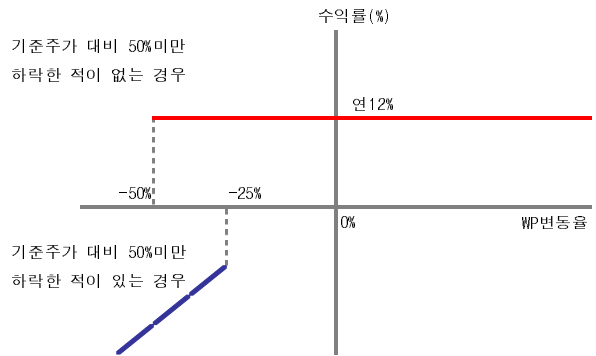
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

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 시나리오	8.00%	18.28	13.24	8.21	3.17	(1.87)	(6.91)	(11.94)
	5.33%	22.65	17.61	12.58	7.54	2.50	(2.54)	(7.57)
	2.67%	21.59	16.56	11.52	6.48	1.45	(3.59)	(8.63)
	0.00%	15.11	10.07	5.04	0.00	(5.04)	(10.07)	(15.11)
	-2.67%	3.20	(1.83)	(6.87)	(11.91)	(16.95)	(21.98)	(27.02)
	-5.33%	(14.13)	(19.17)	(24.21)	(29.24)	(34.28)	(39.32)	(44.36)
	-8.00%	(36.90)	(41.93)	(46.97)	(52.01)	(57.04)	(62.08)	(67.12)

최대손실 시나리오

위험액	-67.12
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	59.47
-----	-------

[9-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

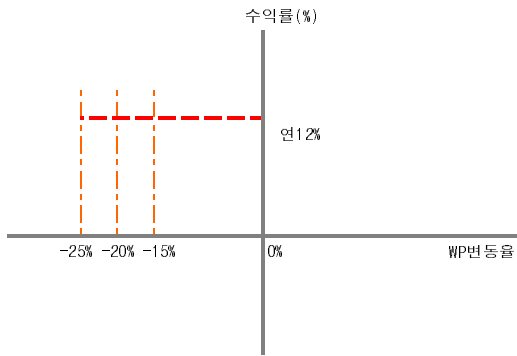
1. 계약금액

단위(백만원)

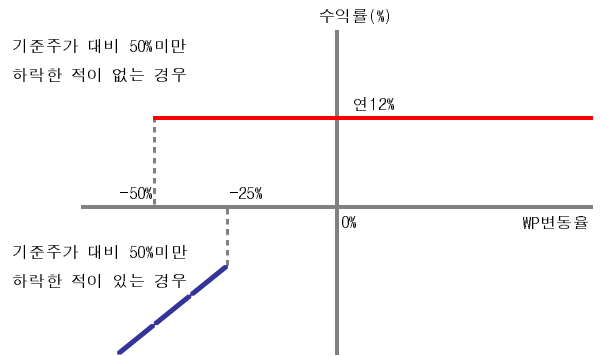
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[9-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

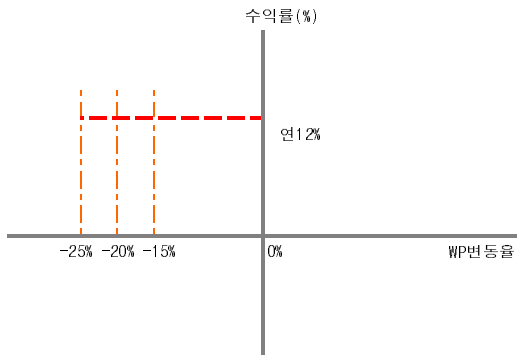
1. 계약금액

단위(백만원)

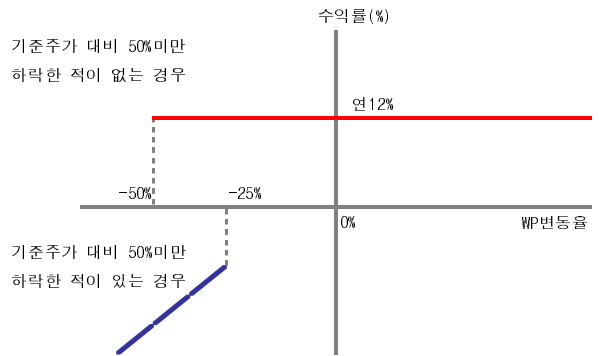
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[9-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

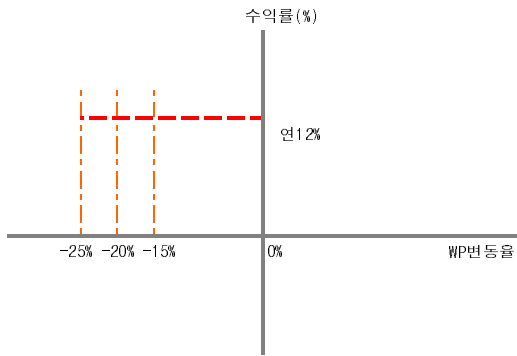
1. 계약금액

단위(백만원)

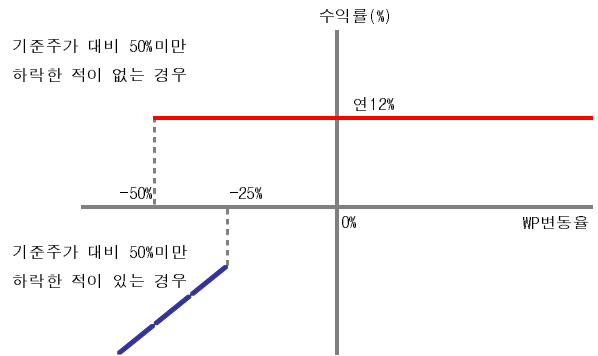
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[10-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

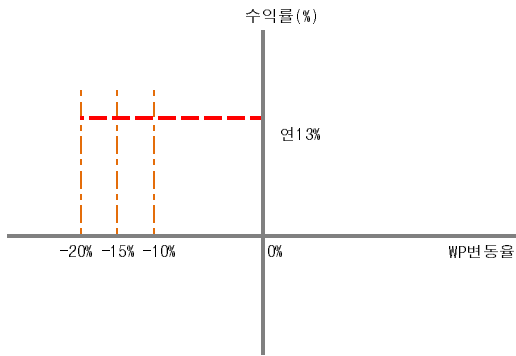
1. 계약금액

단위(백만원)

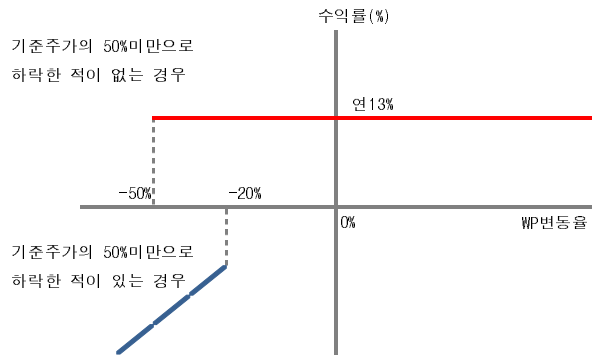
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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%	136.65	106.58	76.51	46.44	16.37	(13.70)	(43.77)
	5.33%	130.46	100.39	70.32	40.25	10.18	(19.88)	(49.95)
	2.67%	114.98	84.91	54.84	24.77	(5.30)	(35.36)	(65.43)
	0.00%	90.21	60.14	30.07	0.00	(30.07)	(60.14)	(90.21)
	-2.67%	56.14	26.07	(4.00)	(34.07)	(64.14)	(94.21)	(124.28)
	-5.33%	12.78	(17.29)	(47.36)	(77.43)	(107.50)	(137.57)	(167.64)
	-8.00%	(39.88)	(69.94)	(100.01)	(130.08)	(160.15)	(190.22)	(220.29)

최대손실 시나리오

위험액	-220.29
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	201.11
-----	--------

[10-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

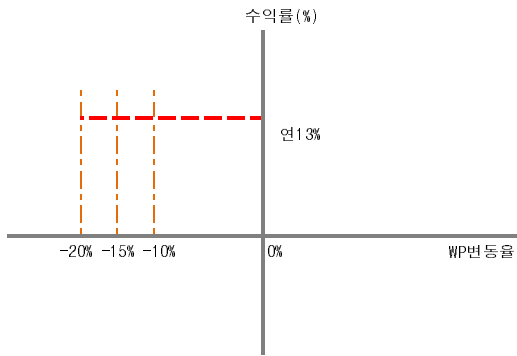
1. 계약금액

단위(백만원)

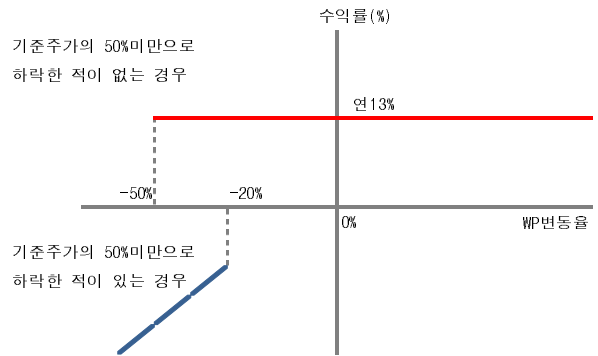
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[10-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

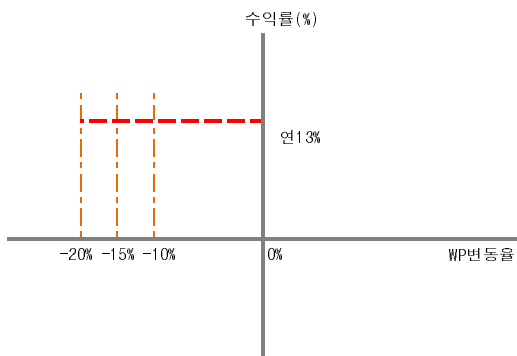
1. 계약금액

단위(백만원)

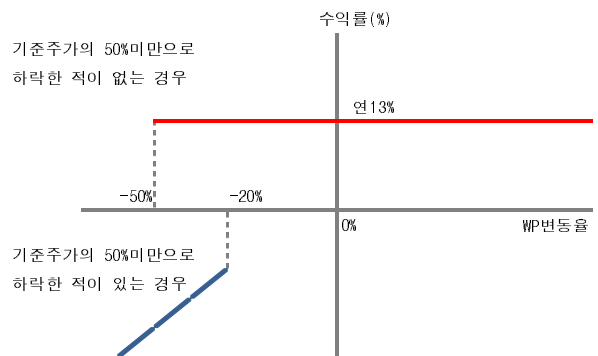
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[10-4] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

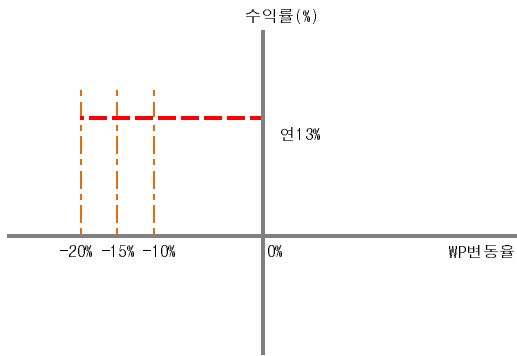
1. 계약금액

단위(백만원)

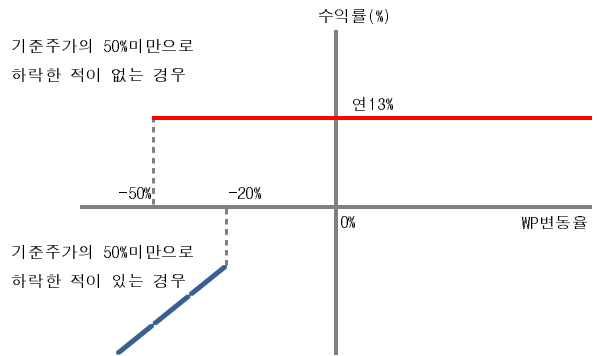
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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]

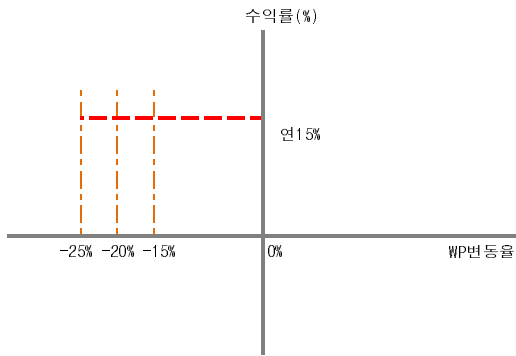
1. 계약금액

단위(백만원)

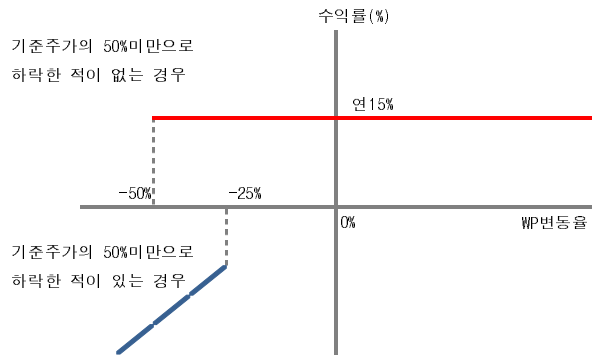
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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 시나리오	8.00%	124.77	103.68	82.59	61.49	40.40	19.31	(1.78)
	5.33%	108.51	87.42	66.33	45.24	24.14	3.05	(18.04)
	2.67%	88.02	66.92	45.83	24.74	3.65	(17.45)	(38.54)
	0.00%	63.28	42.19	21.09	0.00	(21.09)	(42.19)	(63.28)
	-2.67%	34.30	13.20	(7.89)	(28.98)	(50.07)	(71.17)	(92.26)
	-5.33%	1.07	(20.02)	(41.11)	(62.20)	(83.30)	(104.39)	(125.48)
	-8.00%	(36.39)	(57.48)	(78.57)	(99.67)	(120.76)	(141.85)	(162.94)

최대손실 시나리오

위험액	-162.94
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	157.78
-----	--------

[11-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

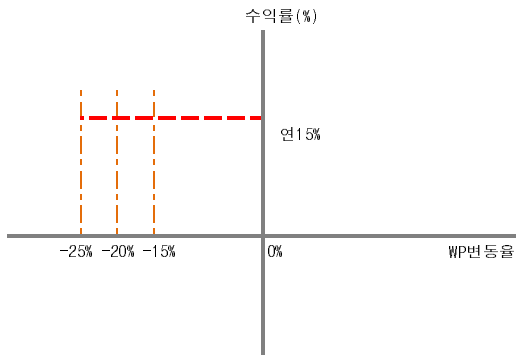
1. 계약금액

단위(백만원)

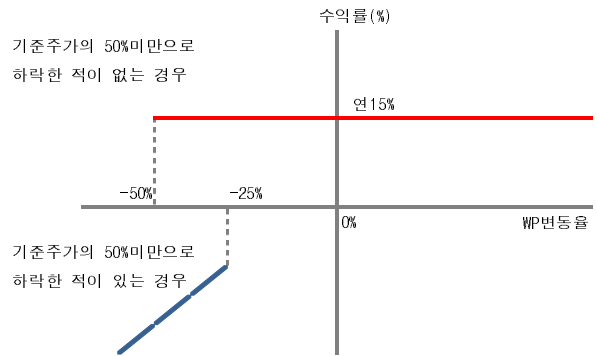
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[11-3]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

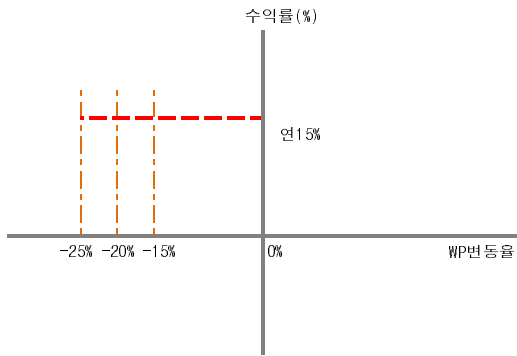
1. 계약금액

단위(백만원)

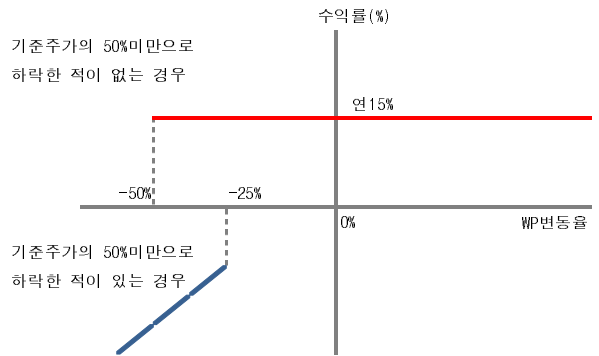
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[11-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

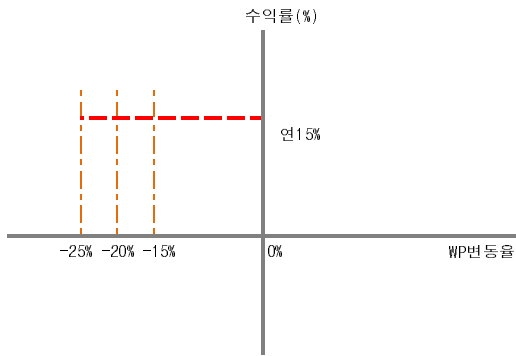
1. 계약금액

단위(백만원)

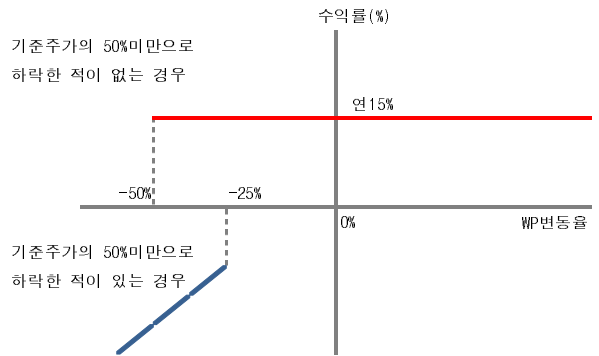
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

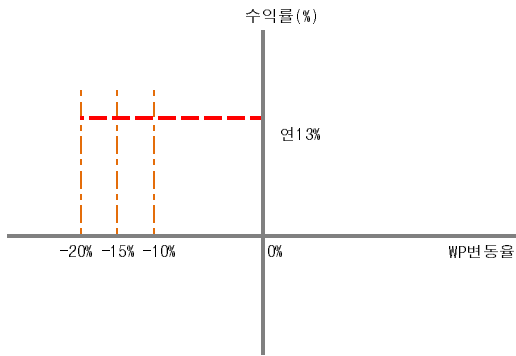
1. 계약금액

단위(백만원)

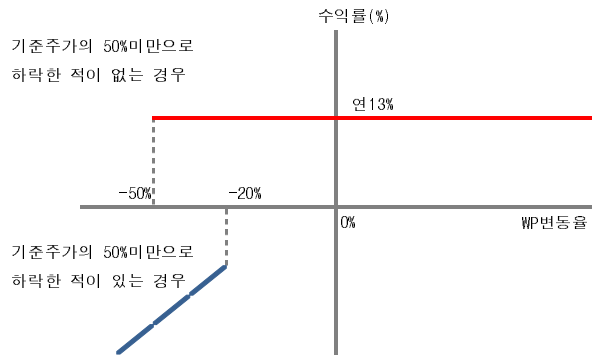
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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 시나 리오	8.00%	51.61	38.09	24.57	11.05	(2.47)	(15.99)	(29.50)
	5.33%	52.74	39.22	25.70	12.19	(1.33)	(14.85)	(28.37)
	2.67%	49.06	35.54	22.02	8.50	(5.02)	(18.54)	(32.05)
	0.00%	40.56	27.04	13.52	0.00	(13.52)	(27.04)	(40.56)
	-2.67%	27.24	13.72	0.20	(13.32)	(26.84)	(40.36)	(53.88)
	-5.33%	9.10	(4.42)	(17.94)	(31.46)	(44.98)	(58.50)	(72.01)
	-8.00%	(13.86)	(27.38)	(40.90)	(54.41)	(67.93)	(81.45)	(94.97)

최대손실 시나리오

위험액	-94.97
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	82.45
-----	-------

[12-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

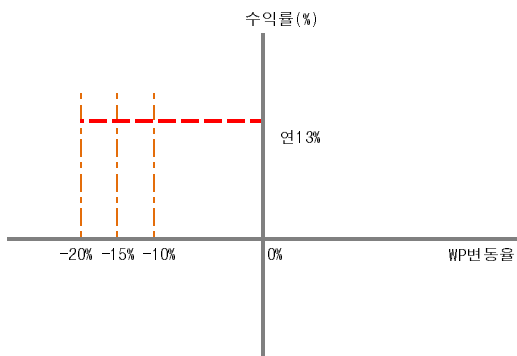
1. 계약금액

단위(백만원)

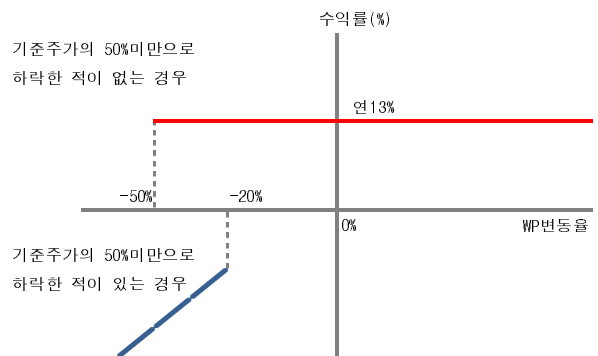
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[12-3]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

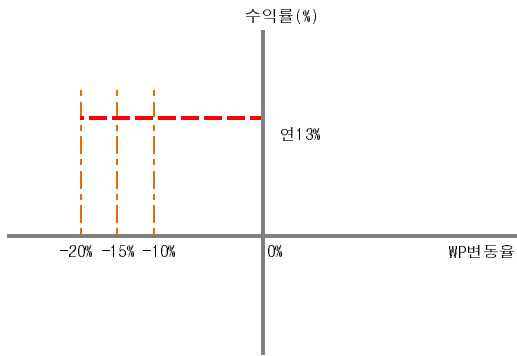
1. 계약금액

단위(백만원)

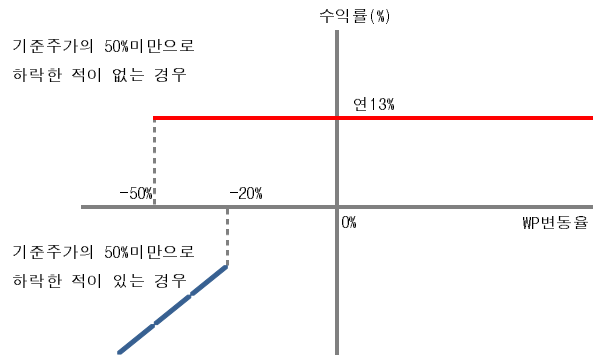
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[12-4]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

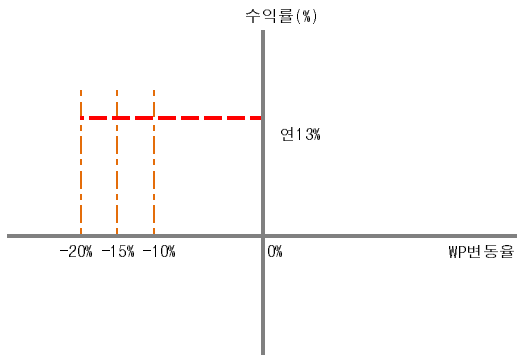
1. 계약금액

단위(백만원)

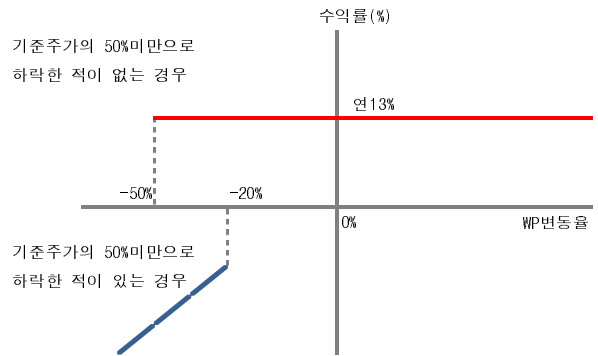
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504

[13] 메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

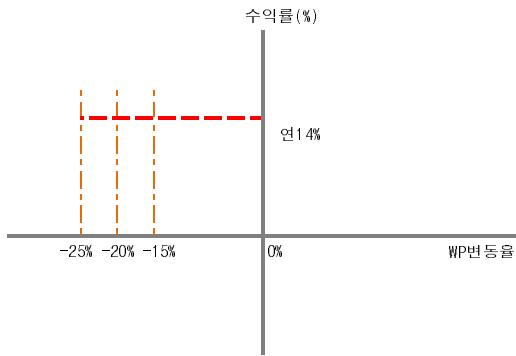
1. 계약금액

단위(백만원)

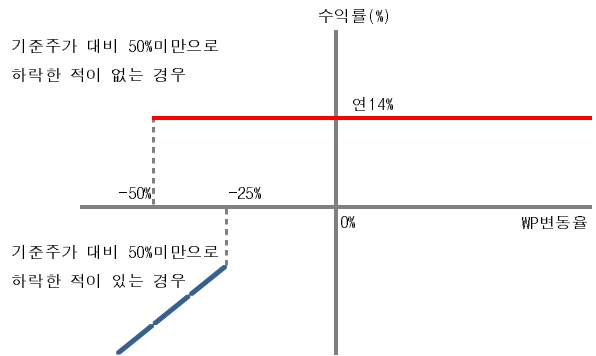
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502333034 신한투자(ELS)1395

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	113.46	94.91	76.36	57.81	39.26	20.71	2.16
	5.33%	99.10	80.55	62.00	43.45	24.90	6.35	(12.20)
	2.67%	79.83	61.28	42.73	24.18	5.63	(12.92)	(31.47)
	0.00%	55.65	37.10	18.55	0.00	(18.55)	(37.10)	(55.65)
	-2.67%	26.56	8.01	(10.54)	(29.09)	(47.64)	(66.19)	(84.74)
	-5.33%	(7.44)	(25.99)	(44.54)	(63.09)	(81.64)	(100.19)	(118.74)
	-8.00%	(46.35)	(64.90)	(83.45)	(102.00)	(120.55)	(139.10)	(157.65)

최대 손실 시나리오

위험액	-157.65
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	163.58
-----	--------

[14] 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

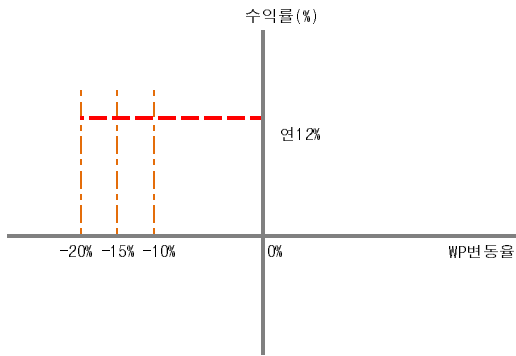
1. 계약금액

단위(백만원)

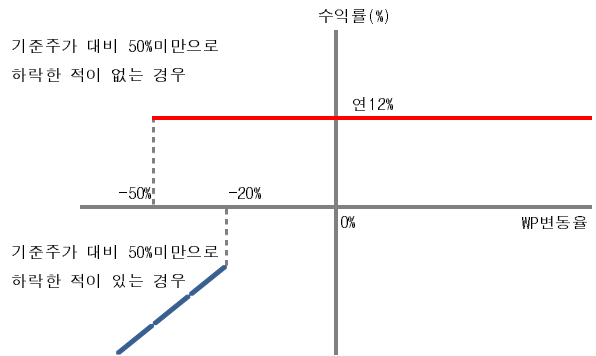
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502348032 신한투자(ELS)1408

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	42.82	34.52	26.23	17.93	9.64	1.35	(6.95)
	5.33%	39.07	30.78	22.49	14.19	5.90	(2.40)	(10.69)
	2.67%	33.10	24.80	16.51	8.21	(0.08)	(8.38)	(16.67)
	0.00%	24.88	16.59	8.29	0.00	(8.29)	(16.59)	(24.88)
	-2.67%	14.44	6.14	(2.15)	(10.45)	(18.74)	(27.04)	(35.33)
	-5.33%	1.76	(6.54)	(14.83)	(23.13)	(31.42)	(39.72)	(48.01)
	-8.00%	(13.16)	(21.45)	(29.75)	(38.04)	(46.33)	(54.63)	(62.92)

최대손실 시나리오

위험액	-62.92
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	68.02
-----	-------

[15] 메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

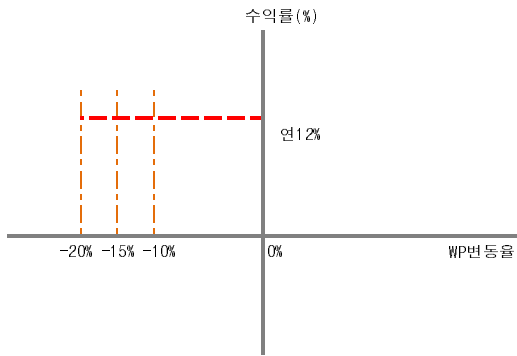
1. 계약금액

단위(백만원)

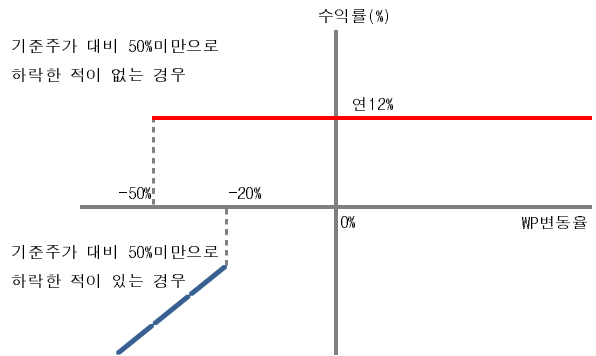
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(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%	81.28	66.56	51.85	37.13	22.41	7.70	(7.02)
	5.33%	71.56	56.84	42.13	27.41	12.69	(2.02)	(16.74)
	2.67%	59.18	44.46	29.75	15.03	0.32	(14.40)	(29.12)
	0.00%	44.15	29.43	14.72	0.00	(14.72)	(29.43)	(44.15)
	-2.67%	26.46	11.74	(2.97)	(17.69)	(32.40)	(47.12)	(61.84)
	-5.33%	6.12	(8.60)	(23.32)	(38.03)	(52.75)	(67.47)	(82.18)
	-8.00%	(16.88)	(31.60)	(46.32)	(61.03)	(75.75)	(90.47)	(105.18)

최대손실 시나리오

위험액	-105.18
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	97.66
-----	-------