

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

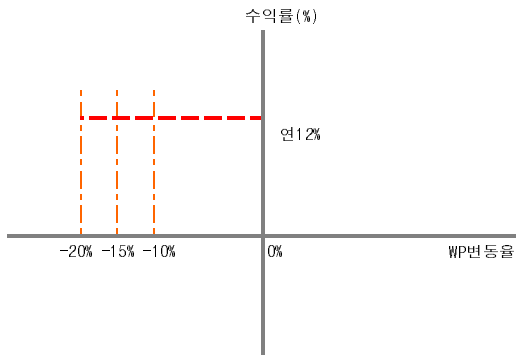
1. 계약금액

단위(백만원)

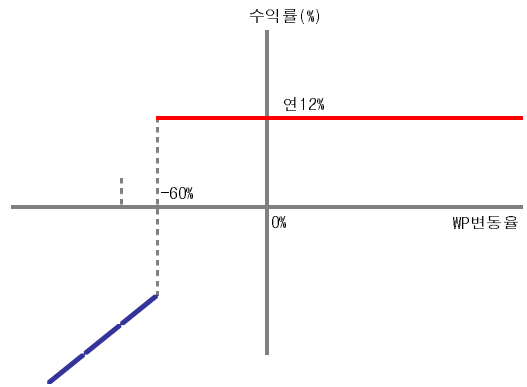
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	(30.33)	(31.57)	(32.81)	(34.05)	(35.29)	(36.52)	(37.76)
	5.33%	(7.10)	(8.33)	(9.57)	(10.81)	(12.05)	(13.29)	(14.53)
	2.67%	4.25	3.01	1.78	0.54	(0.70)	(1.94)	(3.18)
	0.00%	3.71	2.48	1.24	0.00	(1.24)	(2.48)	(3.71)
	-2.67%	(8.71)	(9.95)	(11.19)	(12.42)	(13.66)	(14.90)	(16.14)
	-5.33%	(33.02)	(34.26)	(35.50)	(36.74)	(37.97)	(39.21)	(40.45)
	-8.00%	(69.22)	(70.46)	(71.70)	(72.94)	(74.17)	(75.41)	(76.65)

최대손실 시나리오

위험액	-76.65
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	75.90
-----	-------

[1-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

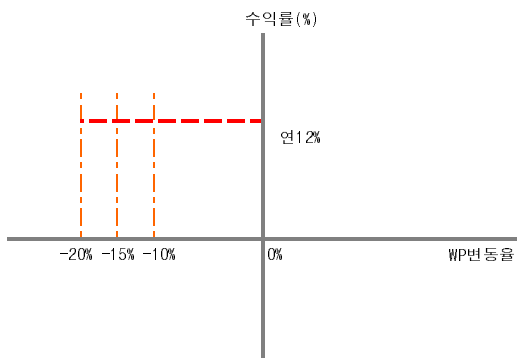
1. 계약금액

단위(백만원)

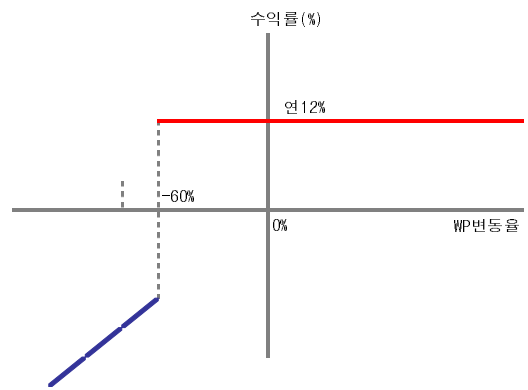
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[1-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

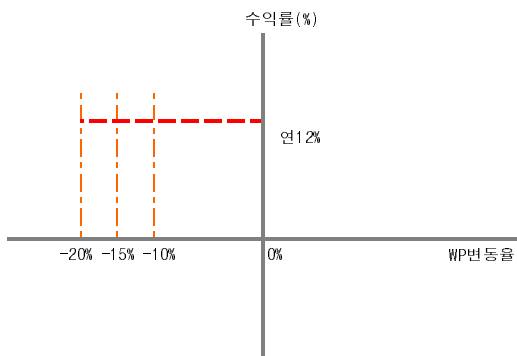
1. 계약금액

단위(백만원)

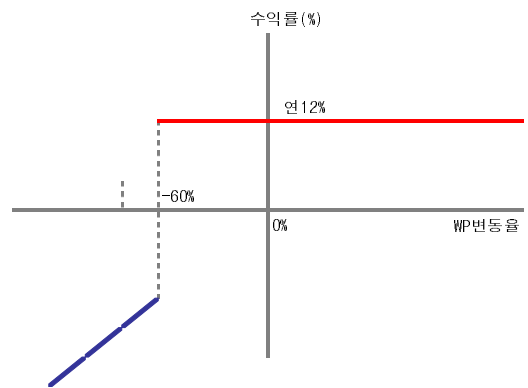
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[1-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

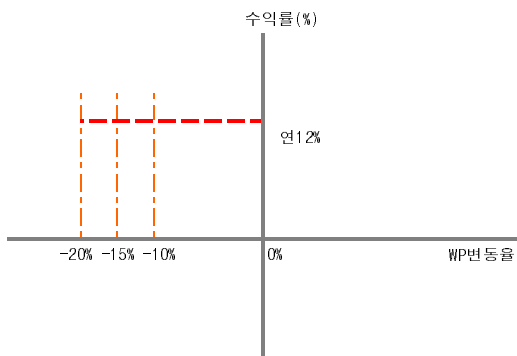
1. 계약금액

단위(백만원)

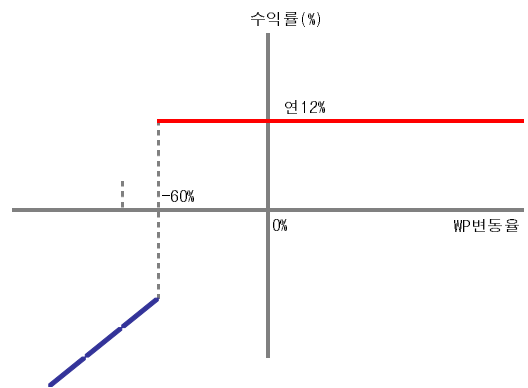
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

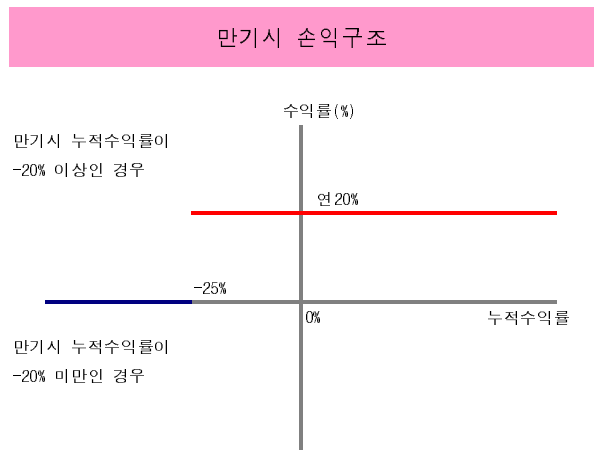
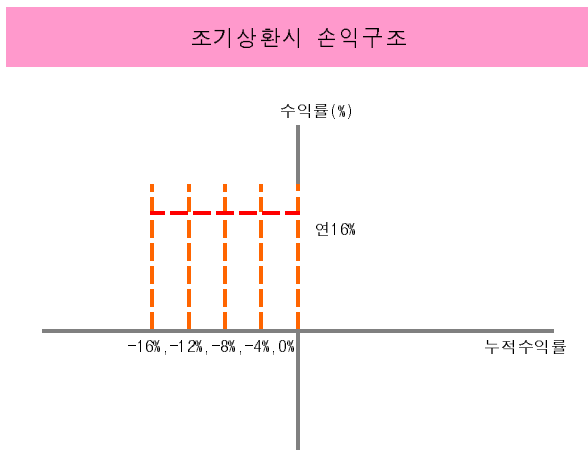
[2] 메리츠크리켓 단위 파생3호

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
-----	------

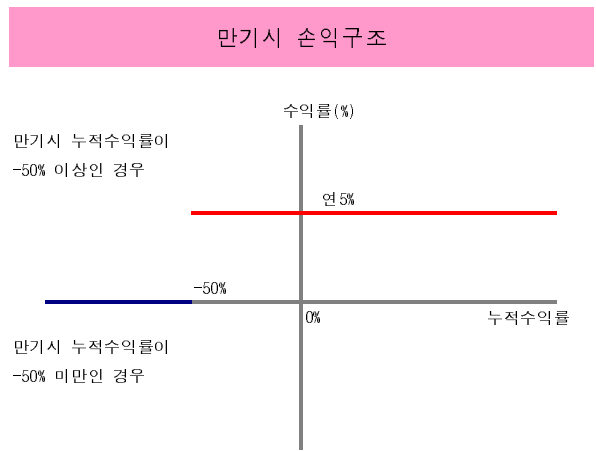
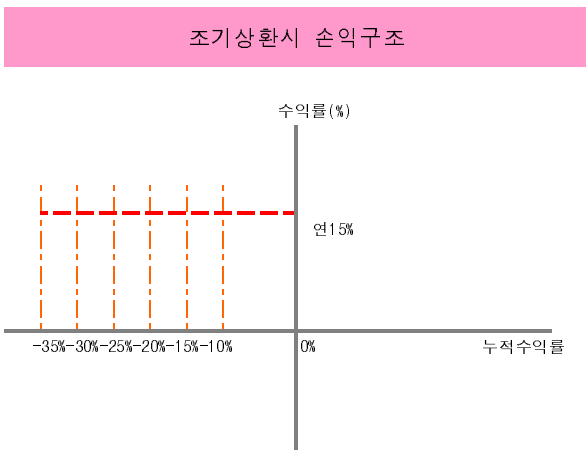
[3] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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
-----	------

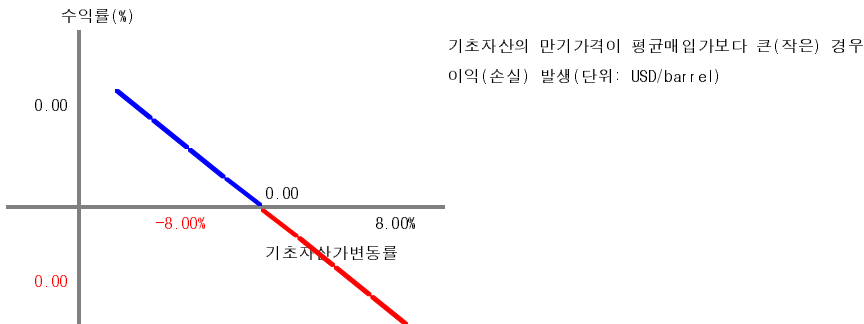
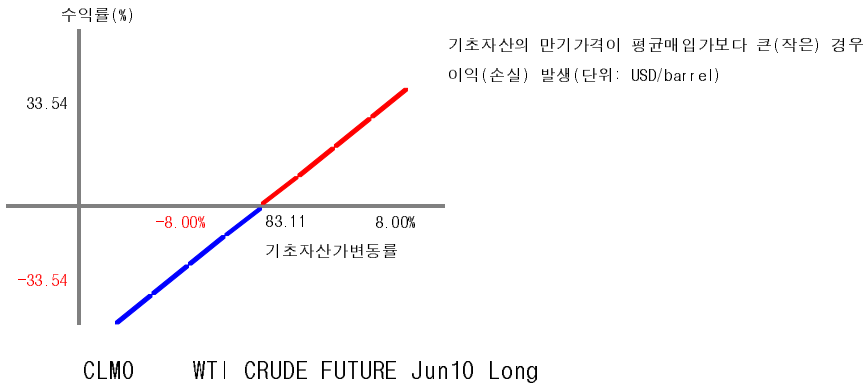
[4] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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	
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
-----	-----

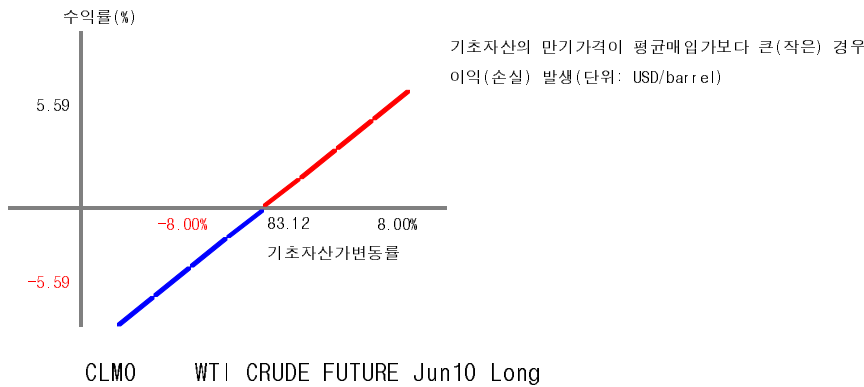
[5] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

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	
기초 자산 시나리오	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
-----	----

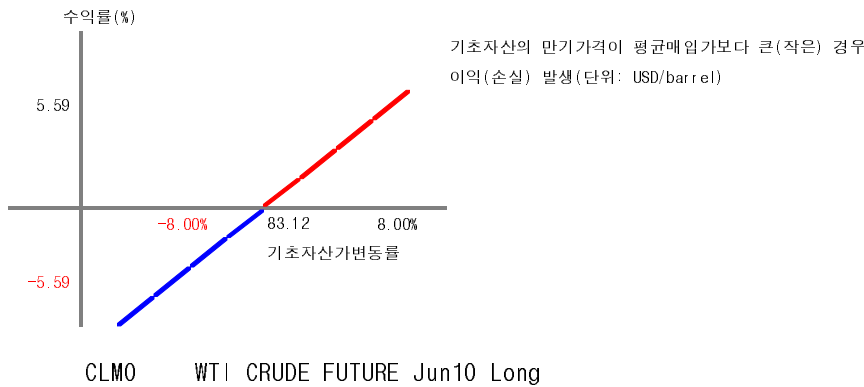
[6-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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%	21.24
	5.33%	14.15
	2.67%	7.09
	0.00%	0.00
	-2.67%	-7.09
	-5.33%	-14.15
	-8.00%	-21.24

최대손실 시나리오	
위험액	-21.24

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	85
-----	----

[6-2]

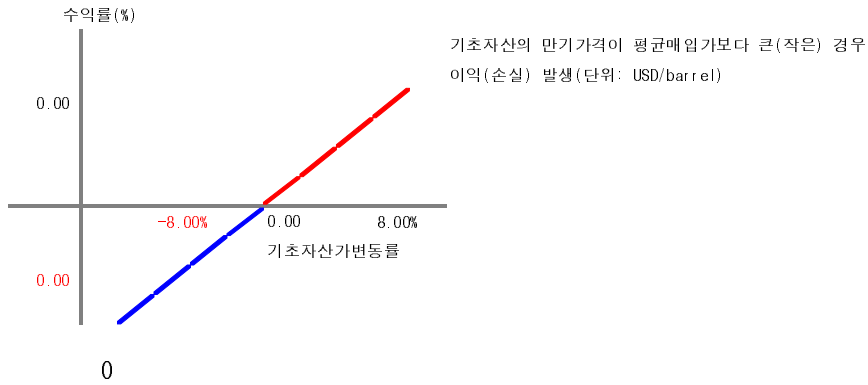
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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

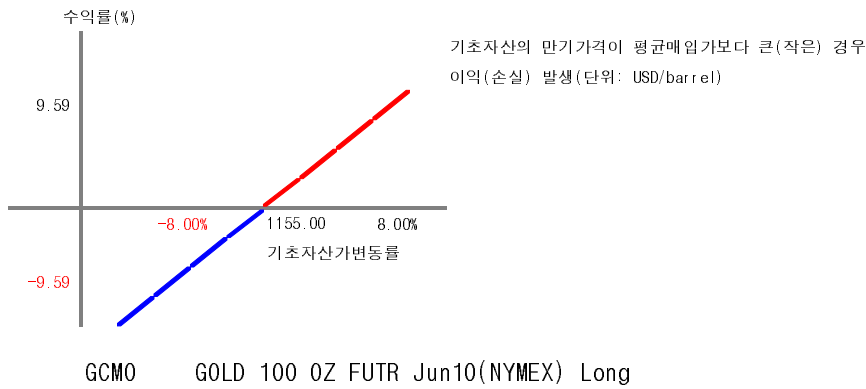


1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



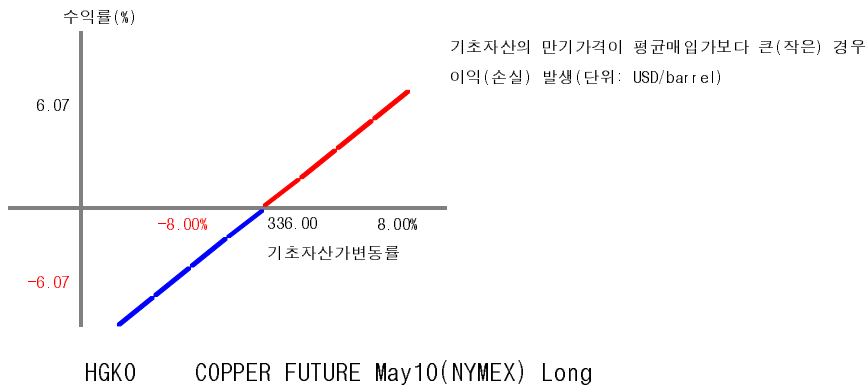
[6-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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

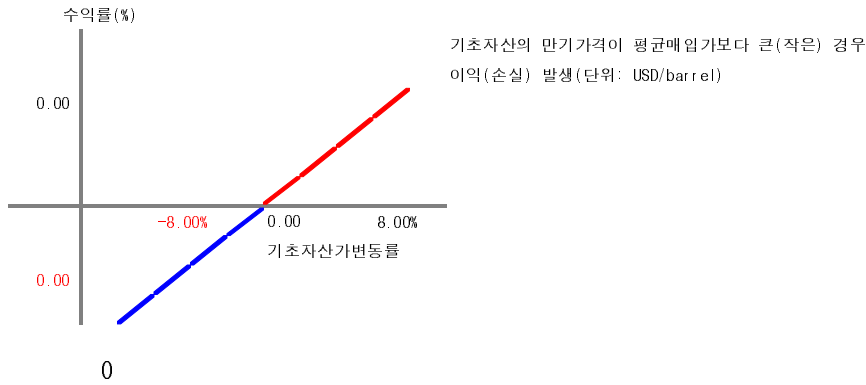


1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



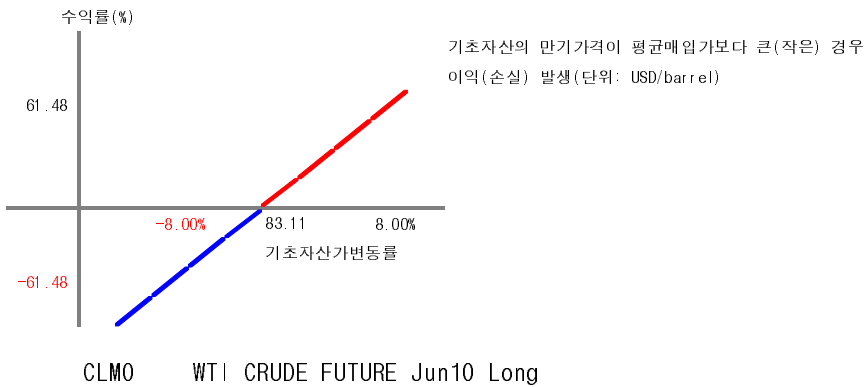
[7] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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(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] 메리트한중지수연계증권제2호

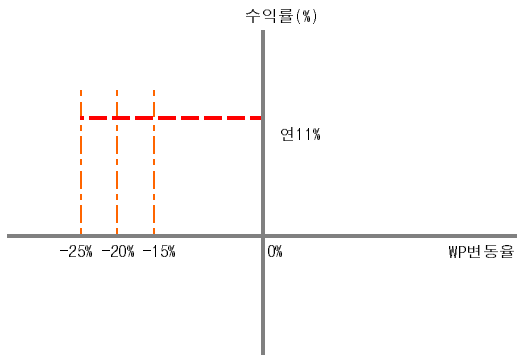
1. 계약금액

단위(백만원)

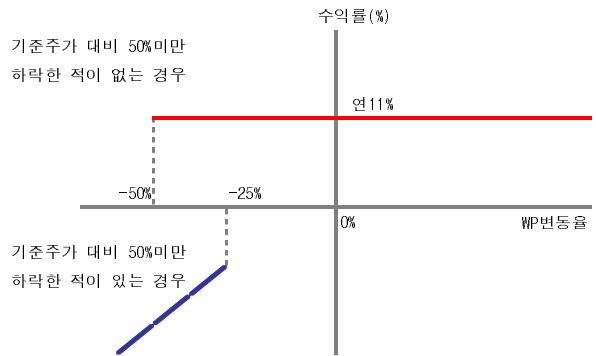
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

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 시나 리오	8.00%	42.36	36.15	29.95	23.74	17.54	11.33	5.12
	5.33%	42.19	35.98	29.78	23.57	17.36	11.16	4.95
	2.67%	34.27	28.07	21.86	15.66	9.45	3.24	(2.96)
	0.00%	18.62	12.41	6.21	0.00	(6.21)	(12.41)	(18.62)
	-2.67%	(4.78)	(10.98)	(17.19)	(23.40)	(29.60)	(35.81)	(42.01)
	-5.33%	(35.92)	(42.12)	(48.33)	(54.53)	(60.74)	(66.95)	(73.15)
	-8.00%	(74.79)	(81.00)	(87.21)	(93.41)	(99.62)	(105.82)	(112.03)

최대손실 시나리오

위험액	-112.03
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	119.00
-----	--------

[8-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

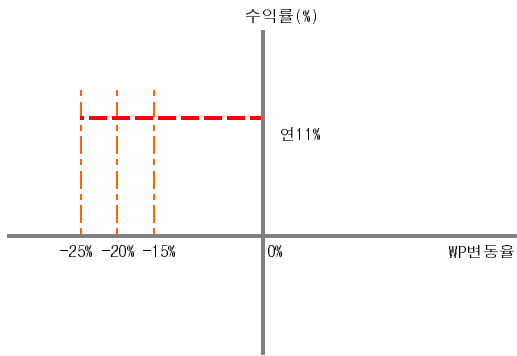
1. 계약금액

단위(백만원)

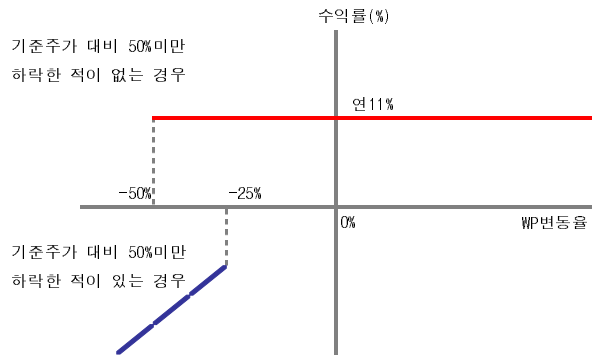
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

[8-3]

메리츠한중지수연계증권제2호

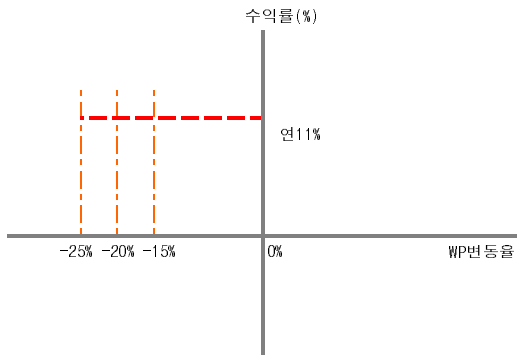
1. 계약금액

단위(백만원)

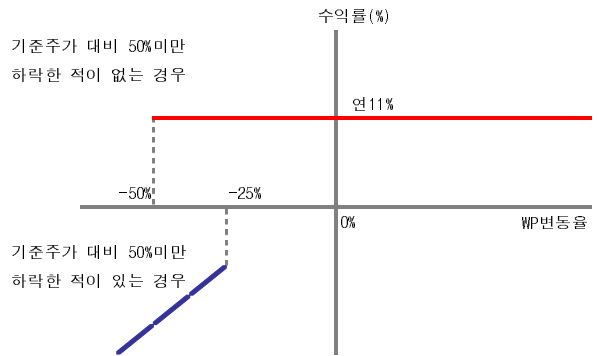
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[8-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

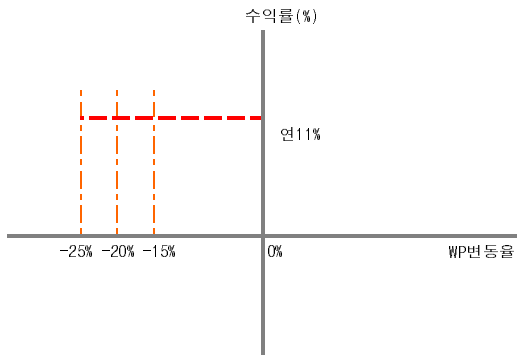
1. 계약금액

단위(백만원)

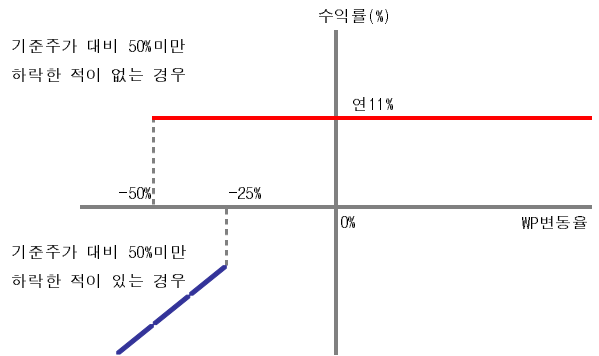
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[9-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

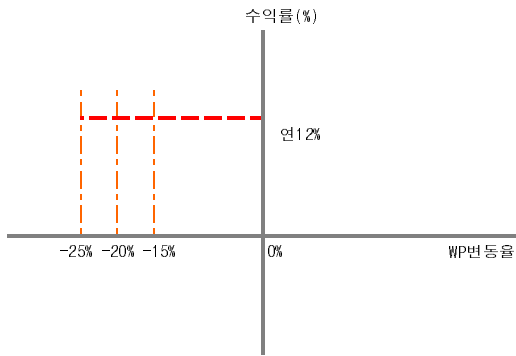
1. 계약금액

단위(백만원)

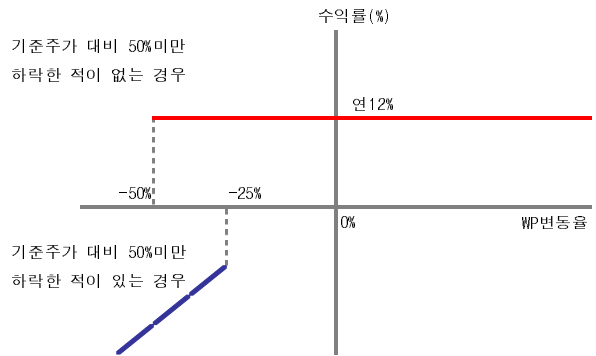
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

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%	83.93	75.09	66.25	57.41	48.57	39.73	30.89
	5.33%	70.11	61.27	52.43	43.59	34.75	25.91	17.07
	2.67%	50.97	42.13	33.29	24.45	15.61	6.77	(2.07)
	0.00%	26.52	17.68	8.84	0.00	(8.84)	(17.68)	(26.52)
	-2.67%	(3.25)	(12.09)	(20.93)	(29.77)	(38.61)	(47.45)	(56.29)
	-5.33%	(38.33)	(47.17)	(56.01)	(64.85)	(73.69)	(82.53)	(91.37)
	-8.00%	(78.73)	(87.57)	(96.41)	(105.25)	(114.09)	(122.93)	(131.77)

최대손실 시나리오

위험액	-131.77
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	139.64
-----	--------

[9-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

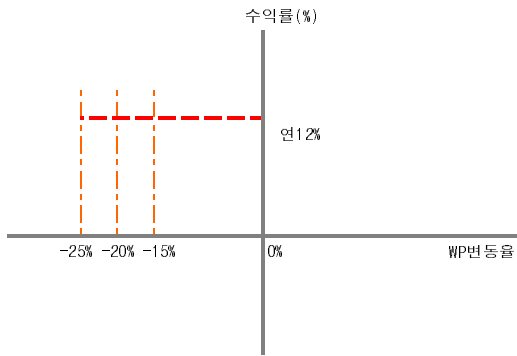
1. 계약금액

단위(백만원)

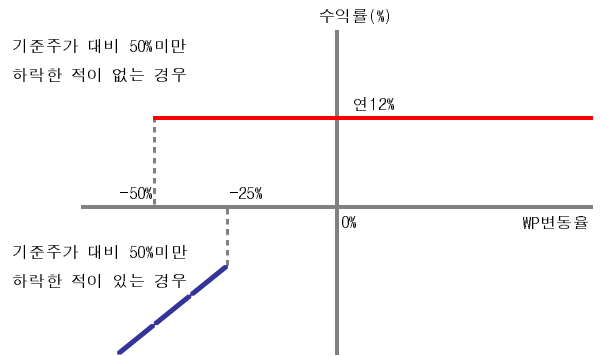
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[9-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

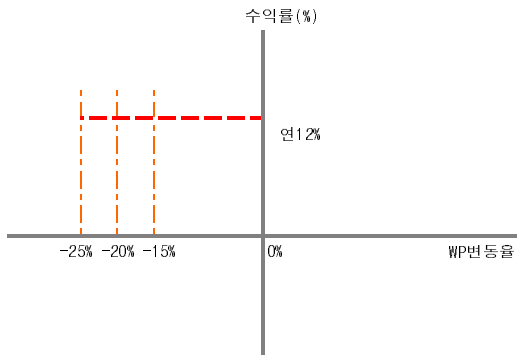
1. 계약금액

단위(백만원)

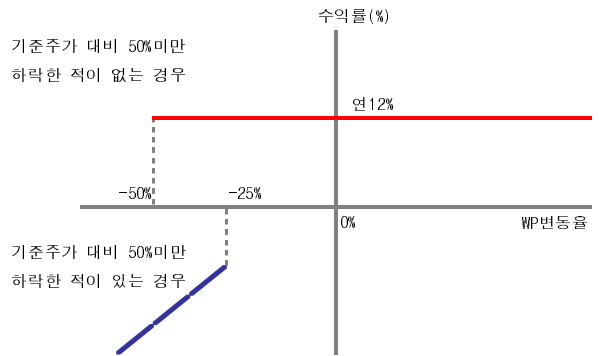
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[9-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

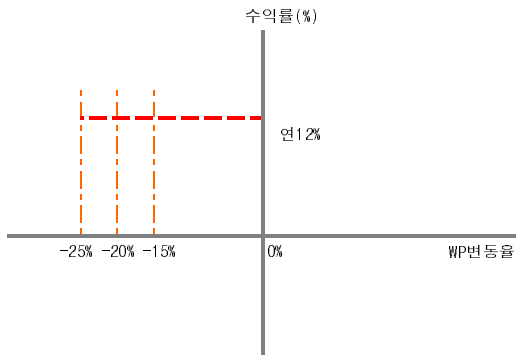
1. 계약금액

단위(백만원)

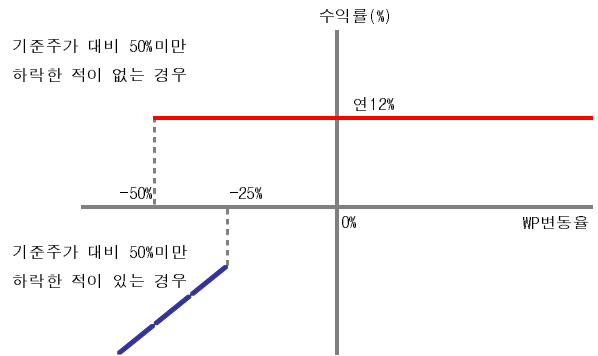
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[10-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

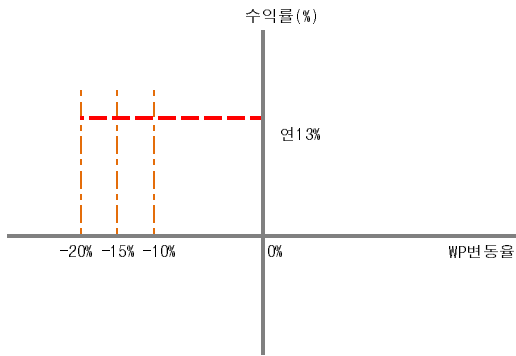
1. 계약금액

단위(백만원)

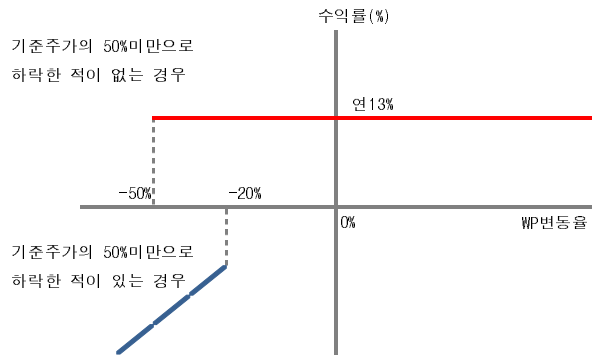
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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%	301.54	257.85	214.15	170.46	126.76	83.07	39.37
	5.33%	261.36	217.67	173.98	130.28	86.59	42.89	(0.80)
	2.67%	204.55	160.85	117.16	73.46	29.77	(13.93)	(57.62)
	0.00%	131.08	87.39	43.69	0.00	(43.69)	(87.39)	(131.08)
	-2.67%	40.98	(2.71)	(46.41)	(90.10)	(133.80)	(177.49)	(221.19)
	-5.33%	(65.77)	(109.46)	(153.15)	(196.85)	(240.54)	(284.24)	(327.93)
	-8.00%	(189.15)	(232.85)	(276.54)	(320.24)	(363.93)	(407.63)	(451.32)

최대 손실 시나리오

위험액	-451.32
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	460.67
-----	--------

[10-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

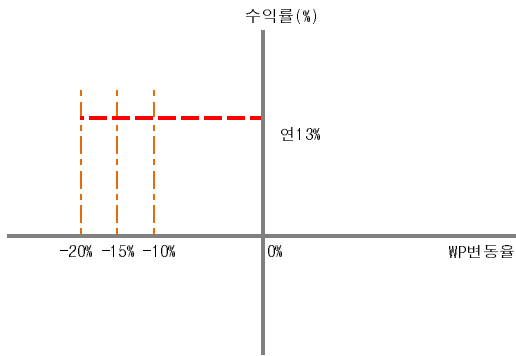
1. 계약금액

단위(백만원)

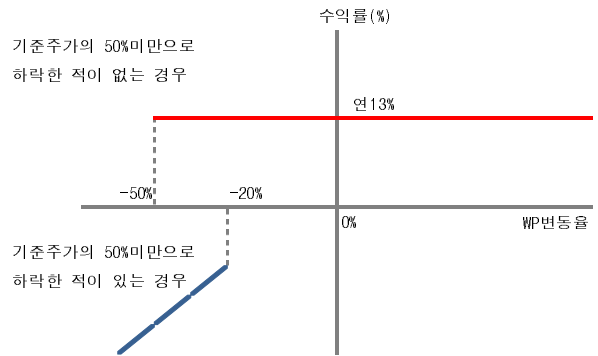
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[10-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

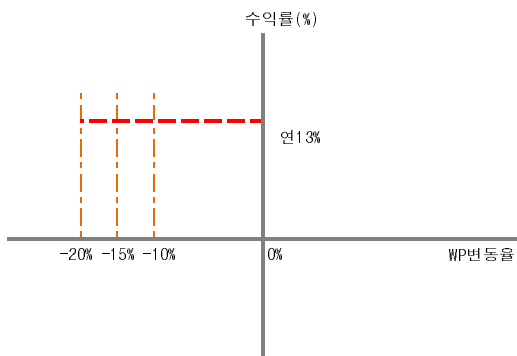
1. 계약금액

단위(백만원)

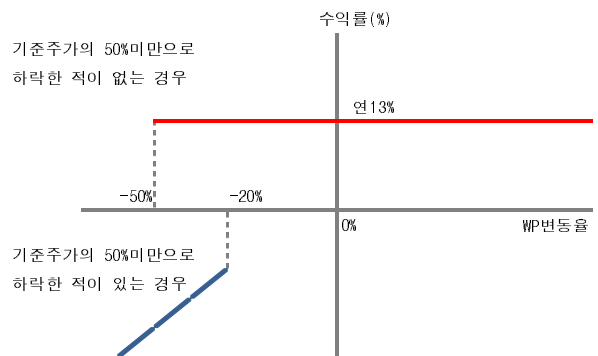
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[10-4] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

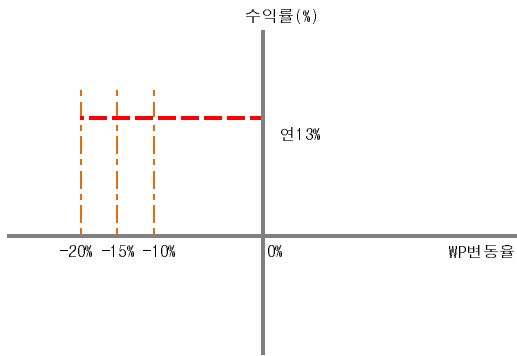
1. 계약금액

단위(백만원)

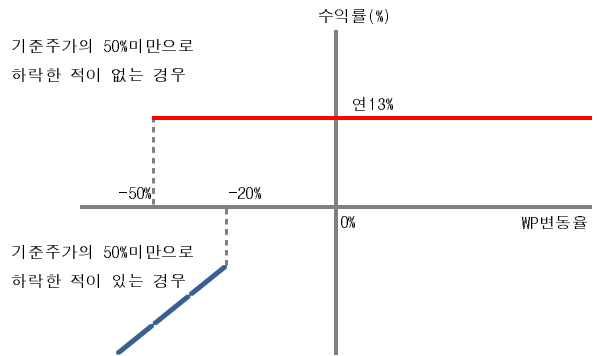
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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]

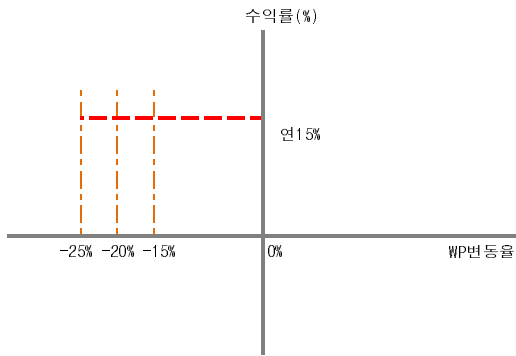
1. 계약금액

단위(백만원)

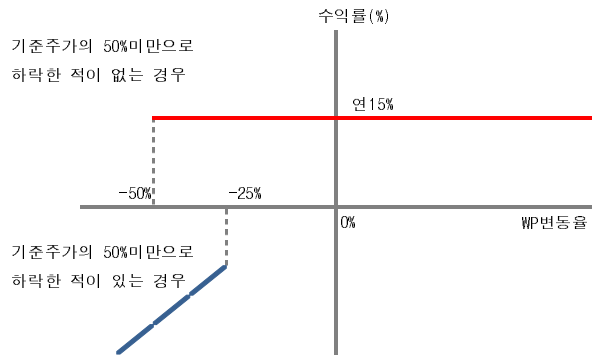
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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%	169.51	145.55	121.59	97.63	73.67	49.71	25.75
	5.33%	141.28	117.32	93.36	69.40	45.44	21.48	(2.48)
	2.67%	108.73	84.77	60.81	36.85	12.89	(11.07)	(35.03)
	0.00%	71.88	47.92	23.96	0.00	(23.96)	(47.92)	(71.88)
	-2.67%	30.72	6.76	(17.20)	(41.16)	(65.12)	(89.08)	(113.04)
	-5.33%	(14.75)	(38.71)	(62.67)	(86.63)	(110.59)	(134.55)	(158.51)
	-8.00%	(64.52)	(88.48)	(112.44)	(136.40)	(160.36)	(184.32)	(208.28)

최대손실 시나리오

위험액	-208.28
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	290.46
-----	--------

[11-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

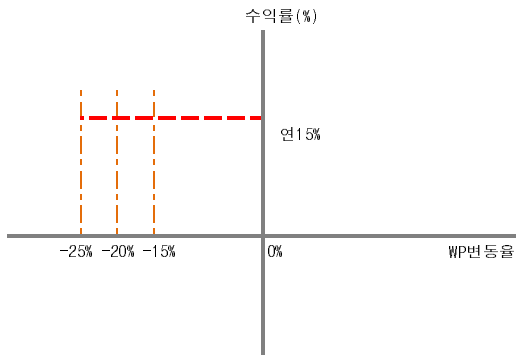
1. 계약금액

단위(백만원)

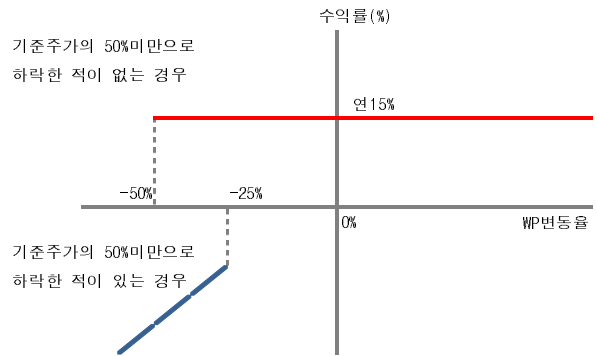
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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]

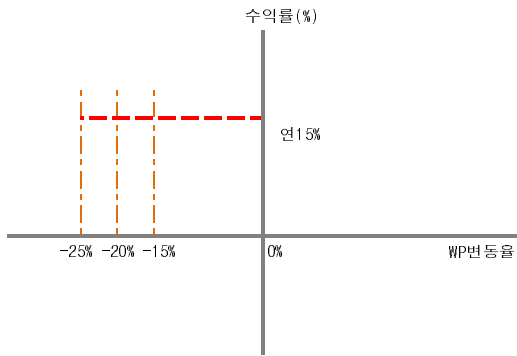
1. 계약금액

단위(백만원)

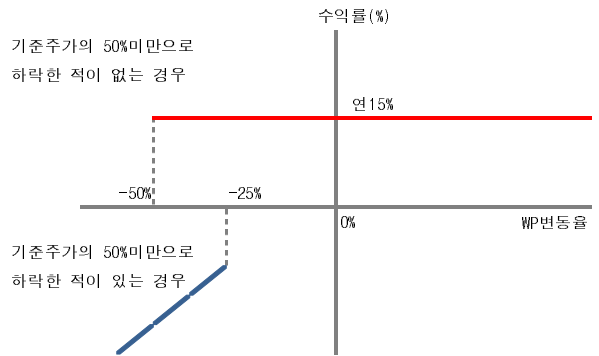
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[11-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

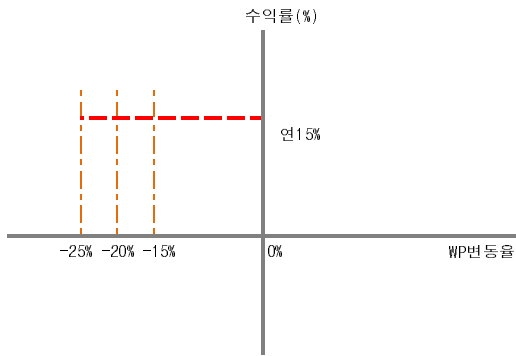
1. 계약금액

단위(백만원)

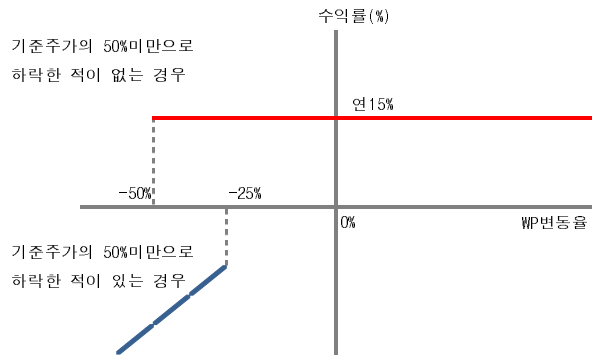
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

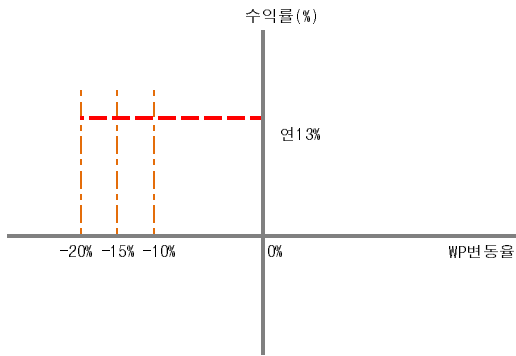
1. 계약금액

단위(백만원)

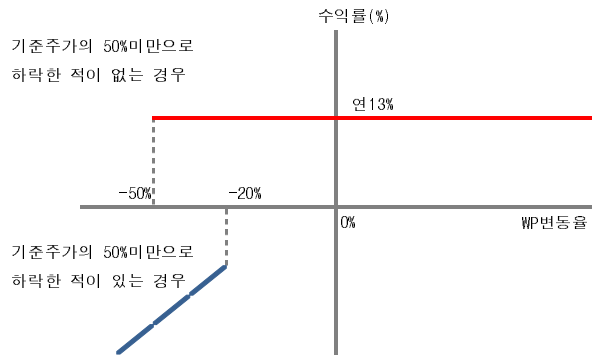
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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 시나리오	8.00%	134.63	113.35	92.07	70.78	49.50	28.22	6.94
	5.33%	119.55	98.27	76.99	55.71	34.43	13.15	(8.13)
	2.67%	95.95	74.67	53.39	32.11	10.83	(10.45)	(31.73)
	0.00%	63.84	42.56	21.28	0.00	(21.28)	(42.56)	(63.84)
	-2.67%	23.21	1.93	(19.35)	(40.63)	(61.91)	(83.19)	(104.47)
	-5.33%	(25.93)	(47.21)	(68.49)	(89.77)	(111.05)	(132.33)	(153.61)
	-8.00%	(83.59)	(104.87)	(126.15)	(147.43)	(168.71)	(189.99)	(211.27)

최대손실 시나리오

위험액	-211.27
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	197.25
-----	--------

[12-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

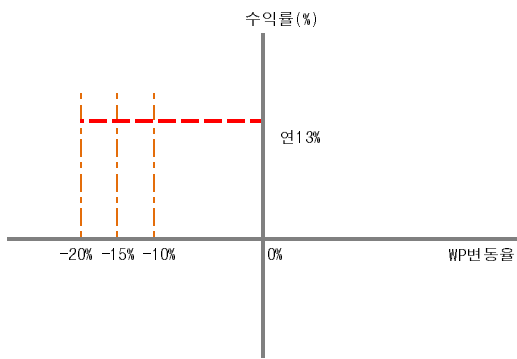
1. 계약금액

단위(백만원)

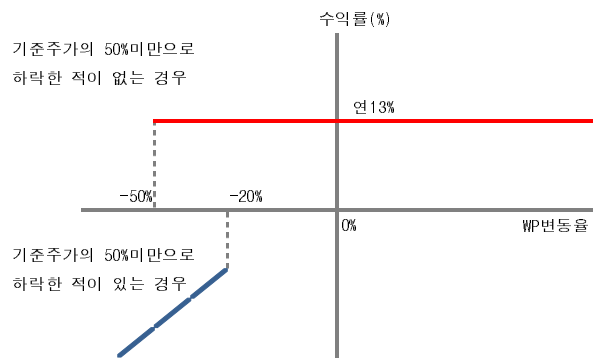
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[12-3]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

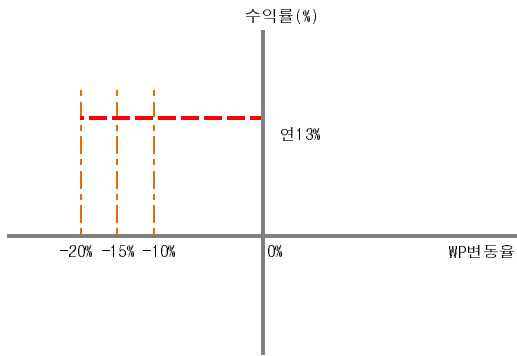
1. 계약금액

단위(백만원)

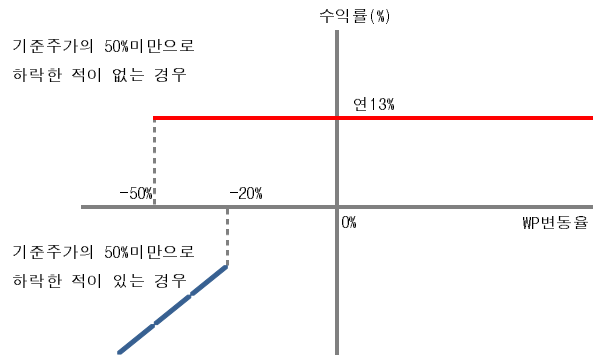
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[12-4]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

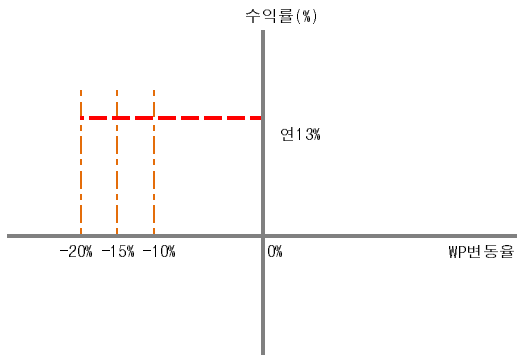
1. 계약금액

단위(백만원)

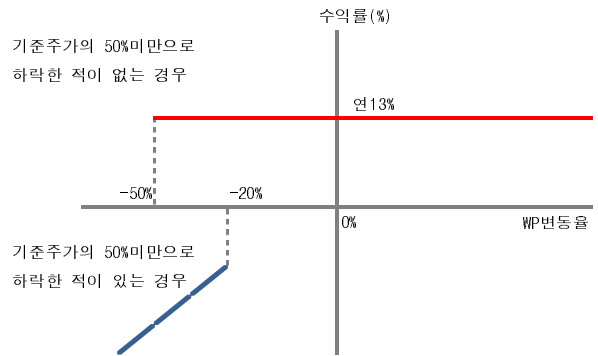
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504

[13] 메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

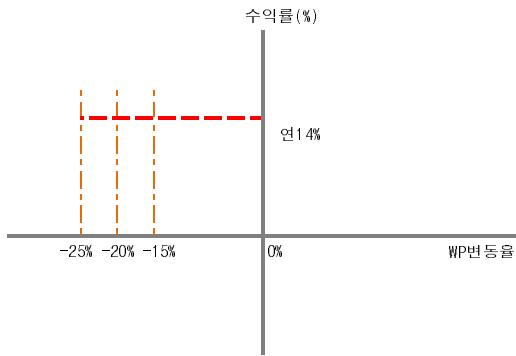
1. 계약금액

단위(백만원)

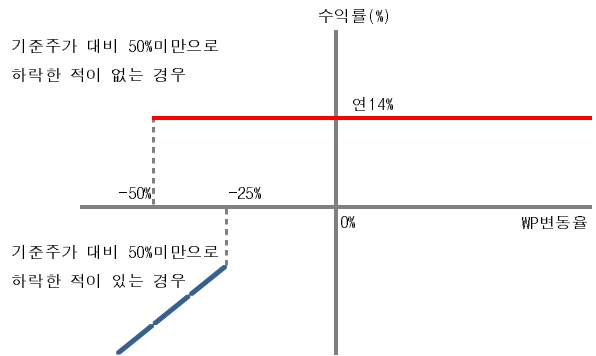
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502333034 신한투자(ELS)1395

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	159.01	138.45	117.89	97.34	76.78	56.22	35.66
	5.33%	131.20	110.64	90.08	69.52	48.97	28.41	7.85
	2.67%	98.75	78.20	57.64	37.08	16.52	(4.04)	(24.60)
	0.00%	61.68	41.12	20.56	0.00	(20.56)	(41.12)	(61.68)
	-2.67%	19.96	(0.60)	(21.15)	(41.71)	(62.27)	(82.83)	(103.39)
	-5.33%	(26.39)	(46.94)	(67.50)	(88.06)	(108.62)	(129.18)	(149.74)
	-8.00%	(77.37)	(97.92)	(118.48)	(139.04)	(159.60)	(180.16)	(200.72)

최대손실 시나리오

위험액	-200.72
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	198.17
-----	--------

[14] 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

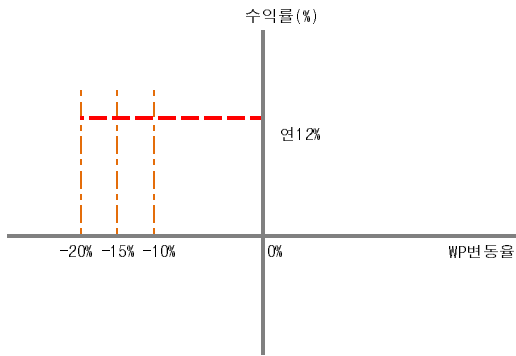
1. 계약금액

단위(백만원)

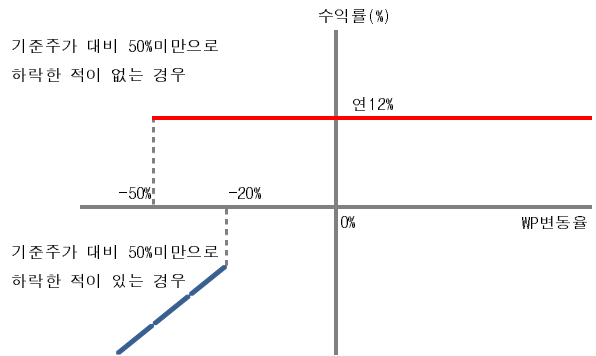
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장익

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 시나 리오	8.00%	76.68	65.75	54.81	43.88	32.94	22.01	11.08
	5.33%	64.07	53.13	42.20	31.27	20.33	9.40	(1.54)
	2.67%	49.44	38.51	27.57	16.64	5.71	(5.23)	(16.16)
	0.00%	32.80	21.87	10.93	0.00	(10.93)	(21.87)	(32.80)
	-2.67%	14.15	3.21	(7.72)	(18.65)	(29.59)	(40.52)	(51.46)
	-5.33%	(6.52)	(17.45)	(28.39)	(39.32)	(50.26)	(61.19)	(72.12)
	-8.00%	(29.20)	(40.14)	(51.07)	(62.00)	(72.94)	(83.87)	(94.81)

최대손실 시나리오

위험액	-94.81
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	98.49
-----	-------

[15] 메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

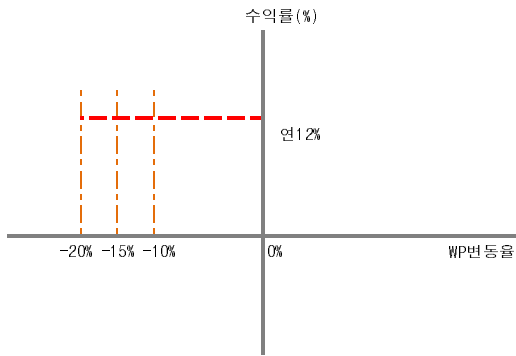
1. 계약금액

단위(백만원)

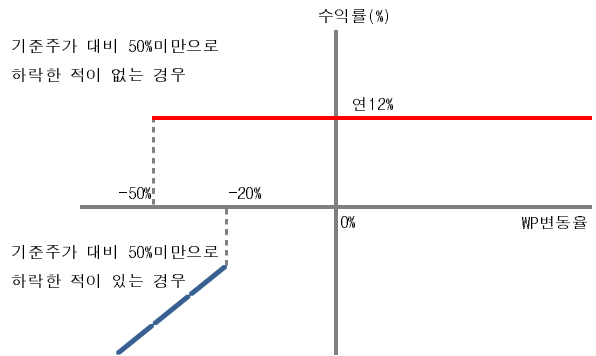
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장익

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%	100.03	84.77	69.51	54.25	38.99	23.73	8.47
	5.33%	83.99	68.73	53.47	38.21	22.95	7.69	(7.57)
	2.67%	65.91	50.65	35.38	20.12	4.86	(10.40)	(25.66)
	0.00%	45.78	30.52	15.26	0.00	(15.26)	(30.52)	(45.78)
	-2.67%	23.62	8.36	(6.90)	(22.16)	(37.42)	(52.68)	(67.95)
	-5.33%	(0.58)	(15.85)	(31.11)	(46.37)	(61.63)	(76.89)	(92.15)
	-8.00%	(26.83)	(42.09)	(57.35)	(72.61)	(87.87)	(103.13)	(118.39)

최대손실 시나리오

위험액	-118.39
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	137.37
-----	--------