

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

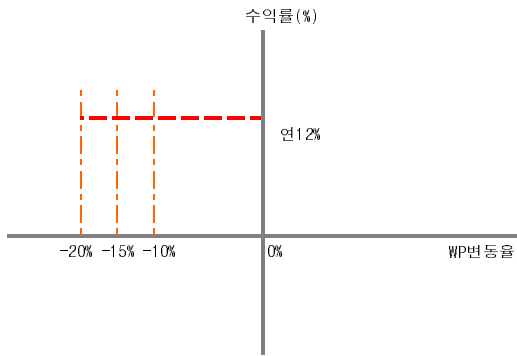
1. 계약금액

단위(백만원)

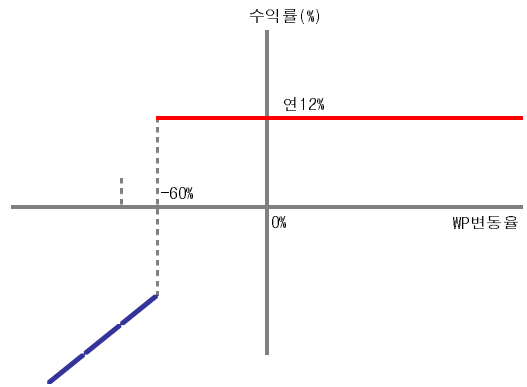
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	(33.57)	(34.77)	(35.98)	(37.19)	(38.40)	(39.61)	(40.82)
	5.33%	(8.74)	(9.95)	(11.16)	(12.37)	(13.58)	(14.79)	(15.99)
	2.67%	3.65	2.45	1.24	0.03	(1.18)	(2.39)	(3.60)
	0.00%	3.63	2.42	1.21	0.00	(1.21)	(2.42)	(3.63)
	-2.67%	(8.83)	(10.04)	(11.25)	(12.45)	(13.66)	(14.87)	(16.08)
	-5.33%	(33.71)	(34.92)	(36.12)	(37.33)	(38.54)	(39.75)	(40.96)
	-8.00%	(71.01)	(72.22)	(73.43)	(74.64)	(75.85)	(77.05)	(78.26)

최대손실 시나리오

위험액	-78.26
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	101.78
-----	--------

[1-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

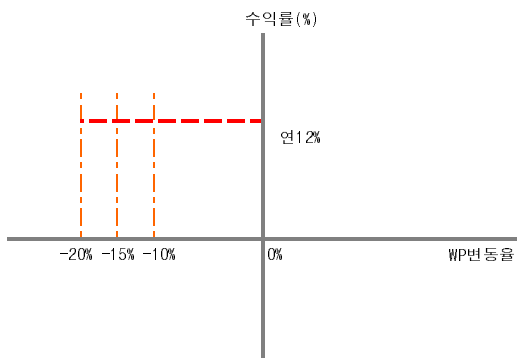
1. 계약금액

단위(백만원)

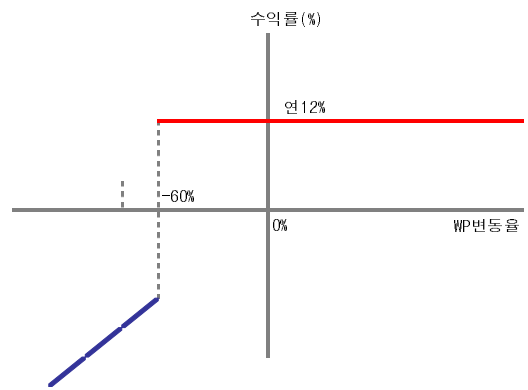
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[1-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

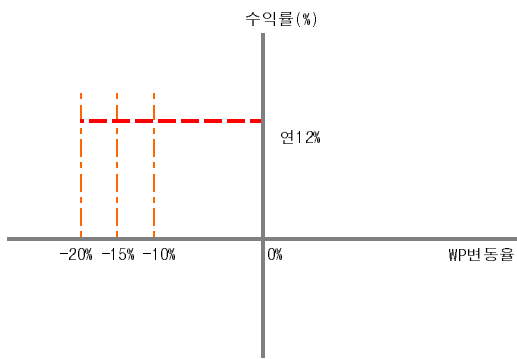
1. 계약금액

단위(백만원)

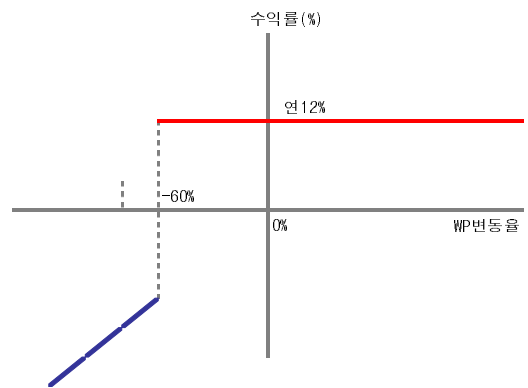
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[1-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

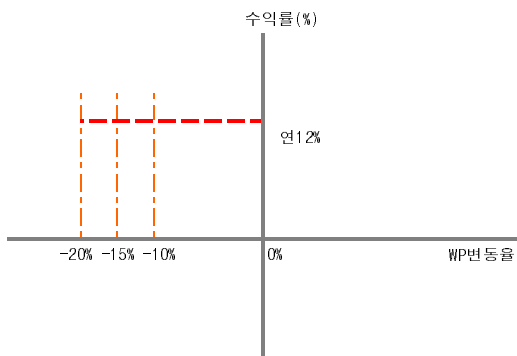
1. 계약금액

단위(백만원)

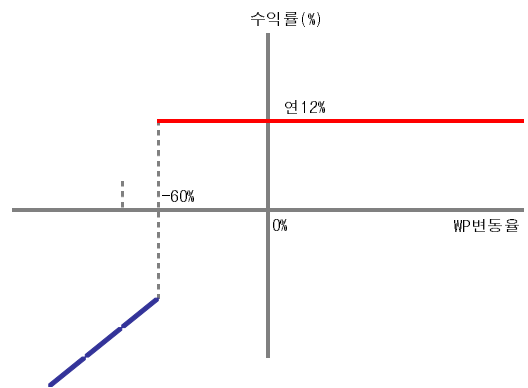
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

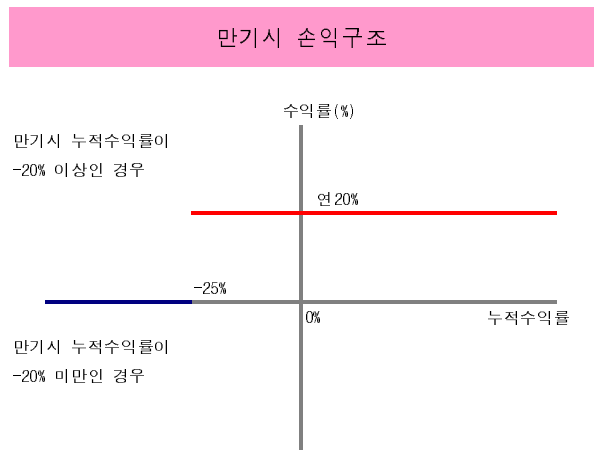
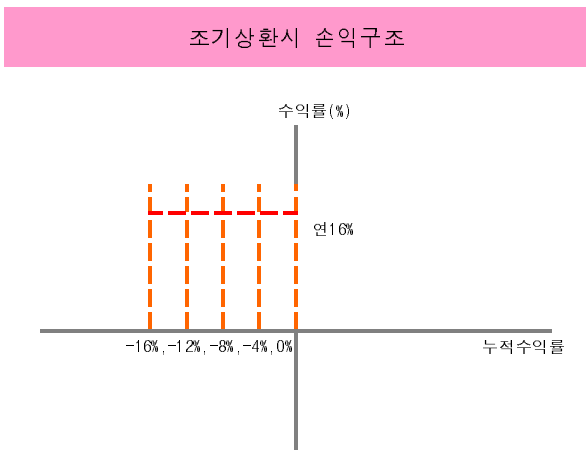
[2] 메리츠클리켓 단위 파생3호

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
-----	------

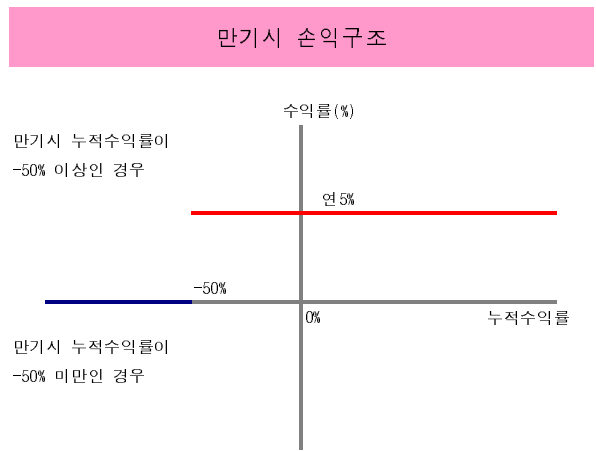
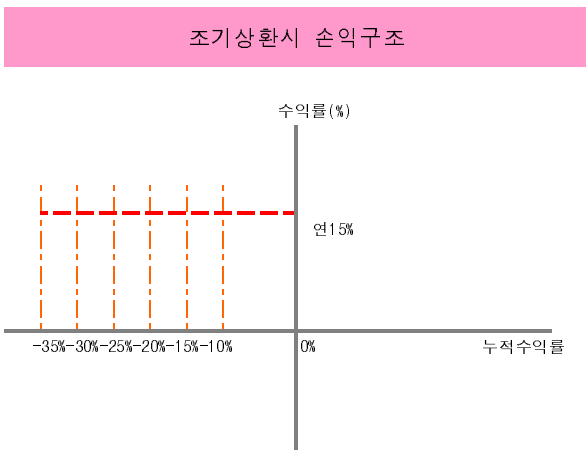
[3] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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	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
-----	------

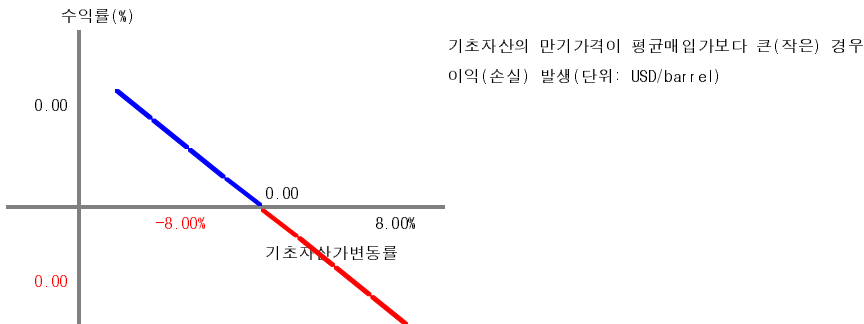
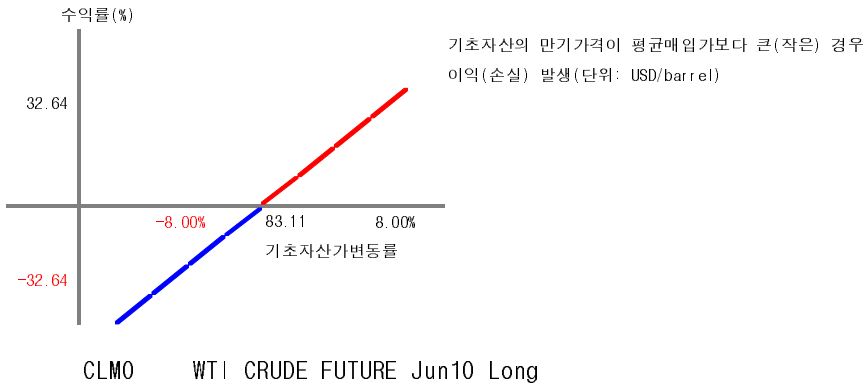
[4] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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%	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
-----	-----

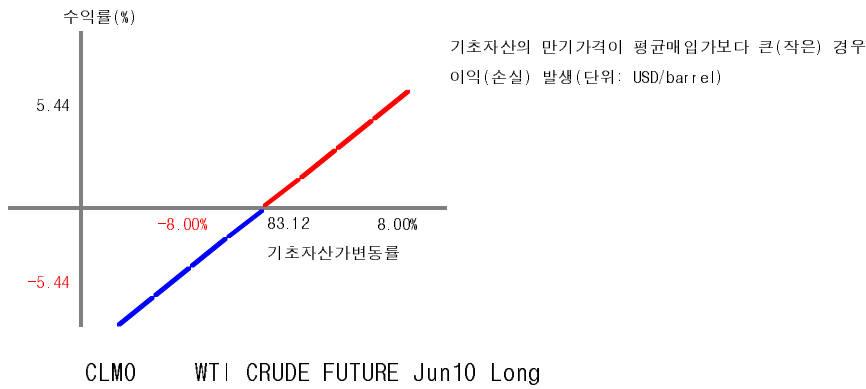
[5] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

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
-----	----

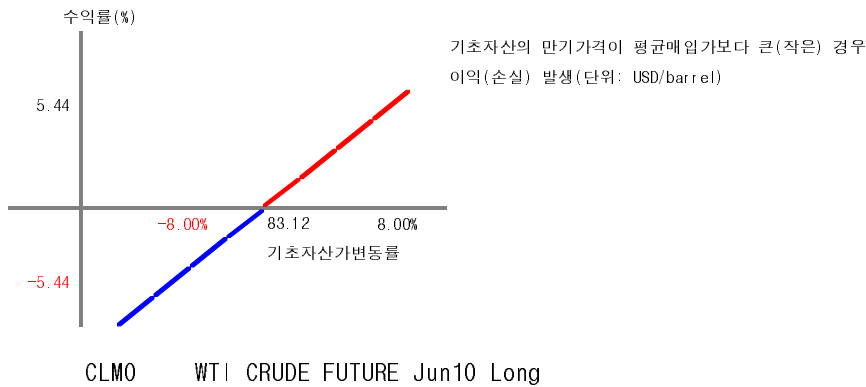
[6-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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%	21.27
	5.33%	14.17
	2.67%	7.10
	0.00%	0.00
	-2.67%	-7.10
	-5.33%	-14.17
	-8.00%	-21.27

최대손실 시나리오	
위험액	-21.27

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	85
-----	----

[6-2]

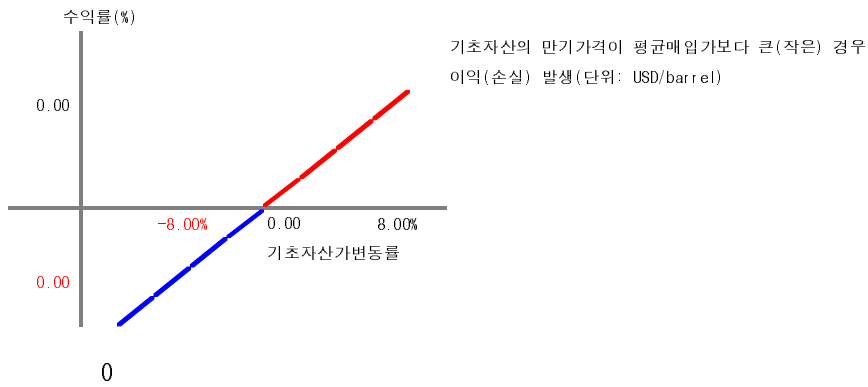
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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

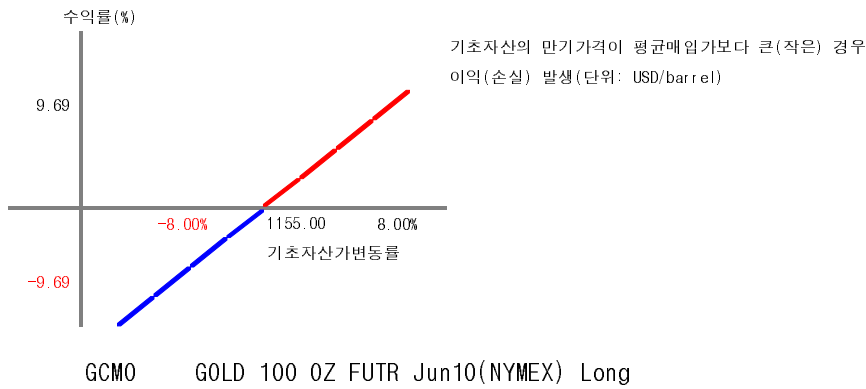


1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



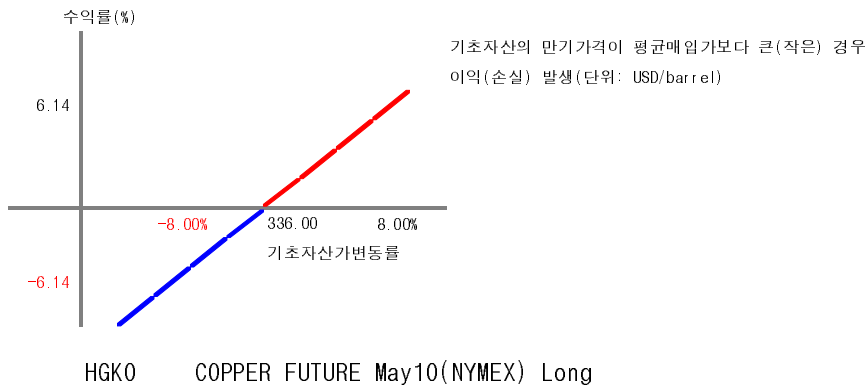
[6-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



[6-5]

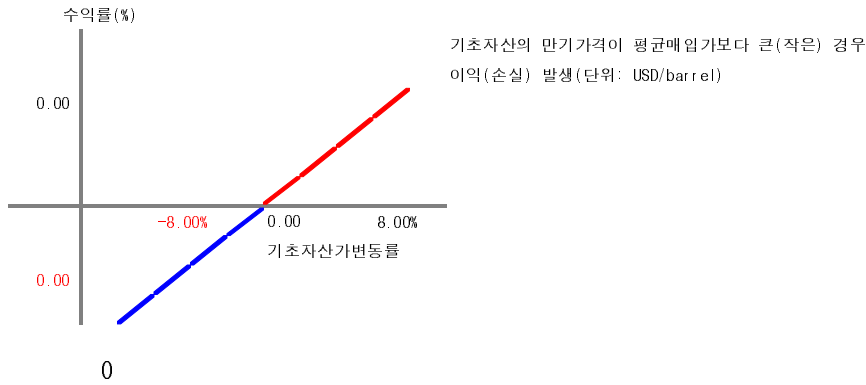
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



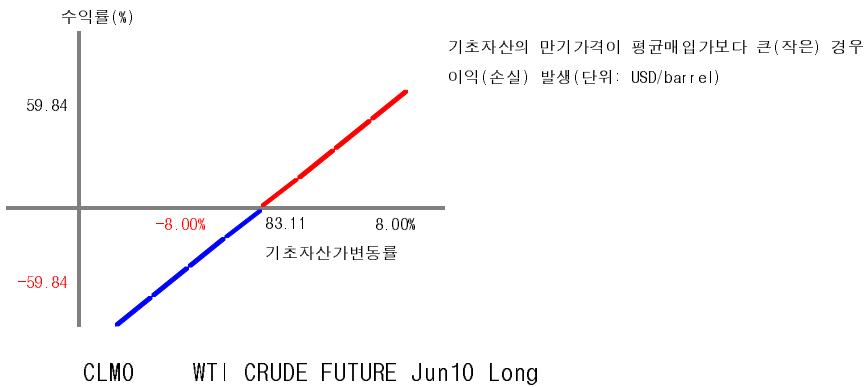
[7] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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%	59.84
	5.33%	39.87
	2.67%	19.97
	0.00%	0.00
	-2.67%	-19.97
	-5.33%	-39.87
	-8.00%	-59.84

최대손실 시나리오	
위험액	-59.84

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	225
-----	-----

[8-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

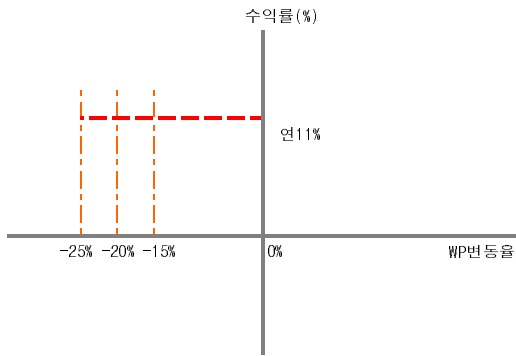
1. 계약금액

단위(백만원)

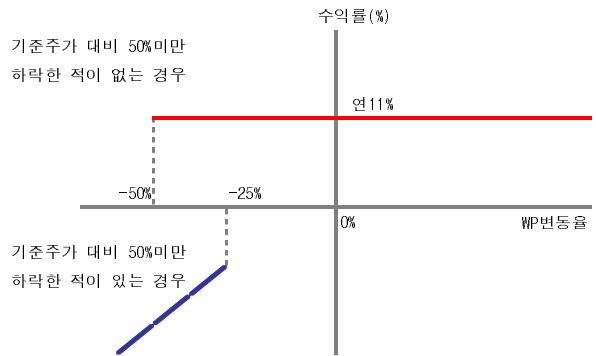
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503327WC9 신한투자(ELS)1275

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	(8.26)	(10.50)	(12.73)	(14.96)	(17.19)	(19.43)	(21.66)
	5.33%	5.11	2.87	0.64	(1.59)	(3.82)	(6.06)	(8.29)
	2.67%	10.09	7.86	5.63	3.40	1.16	(1.07)	(3.30)
	0.00%	6.70	4.46	2.23	0.00	(2.23)	(4.46)	(6.70)
	-2.67%	(5.08)	(7.31)	(9.55)	(11.78)	(14.01)	(16.24)	(18.48)
	-5.33%	(25.24)	(27.47)	(29.71)	(31.94)	(34.17)	(36.40)	(38.64)
	-8.00%	(53.79)	(56.02)	(58.25)	(60.48)	(62.72)	(64.95)	(67.18)

최대손실 시나리오

위험액	-67.18
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	56.90
-----	-------

[8-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

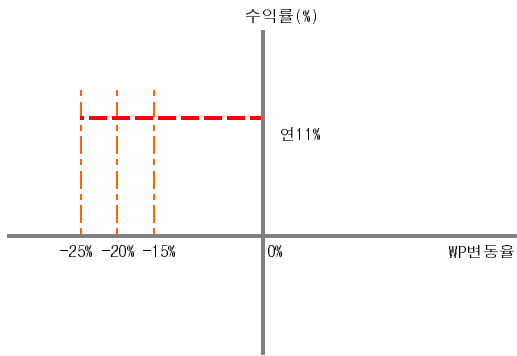
1. 계약금액

단위(백만원)

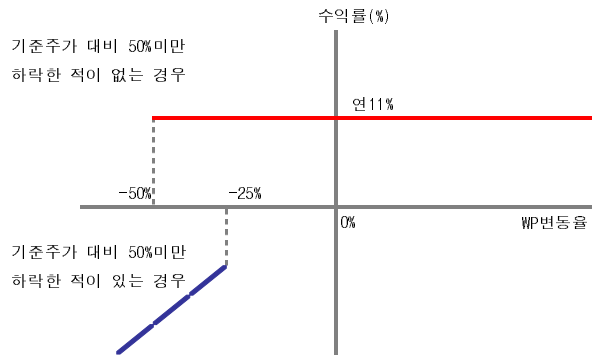
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

[8-3]

메리츠한중지수연계증권제2호

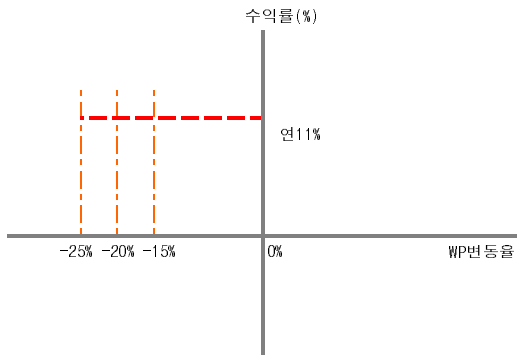
1. 계약금액

단위(백만원)

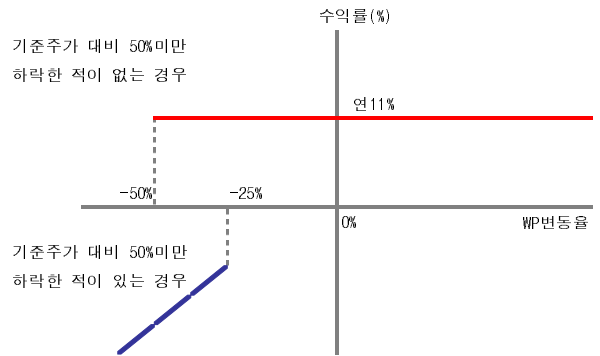
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[8-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

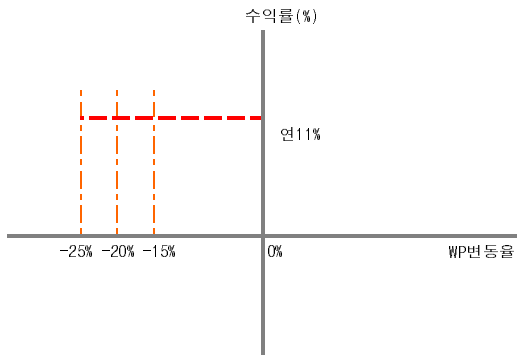
1. 계약금액

단위(백만원)

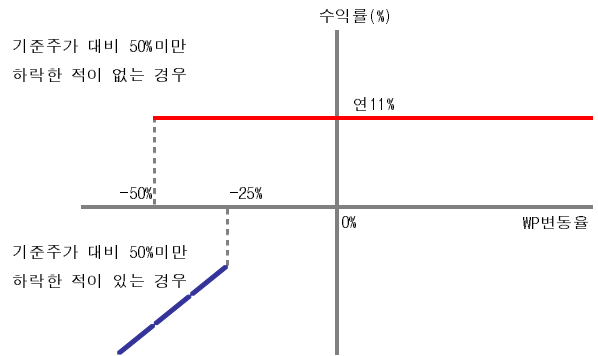
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[9-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

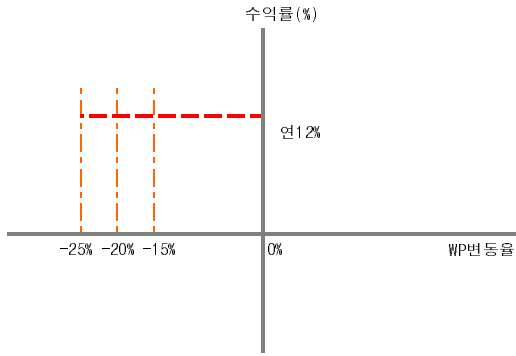
1. 계약금액

단위(백만원)

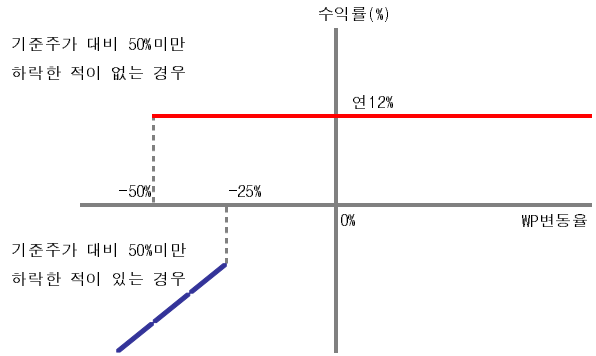
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513340WC0 대신증권(ELS)920

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	32.20	27.20	22.21	17.21	12.21	7.21	2.21
	5.33%	33.45	28.45	23.45	18.45	13.45	8.45	3.46
	2.67%	27.71	22.72	17.72	12.72	7.72	2.72	(2.28)
	0.00%	15.00	10.00	5.00	0.00	(5.00)	(10.00)	(15.00)
	-2.67%	(4.70)	(9.70)	(14.70)	(19.70)	(24.70)	(29.70)	(34.70)
	-5.33%	(31.38)	(36.38)	(41.38)	(46.38)	(51.38)	(56.38)	(61.38)
	-8.00%	(65.05)	(70.05)	(75.04)	(80.04)	(85.04)	(90.04)	(95.04)

최대손실 시나리오

위험액	-95.04
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	90.15
-----	-------

[9-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

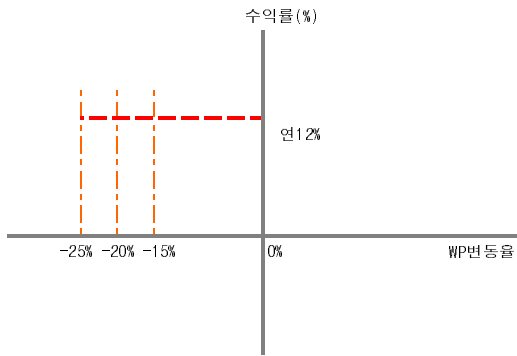
1. 계약금액

단위(백만원)

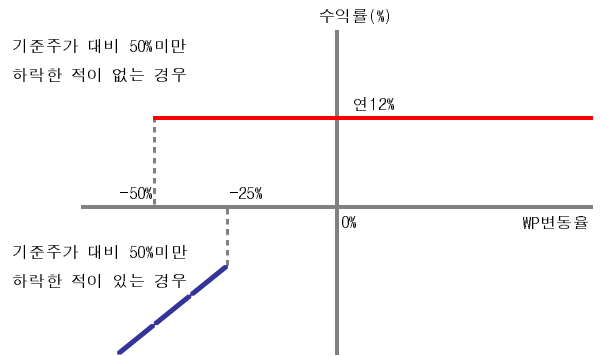
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[9-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

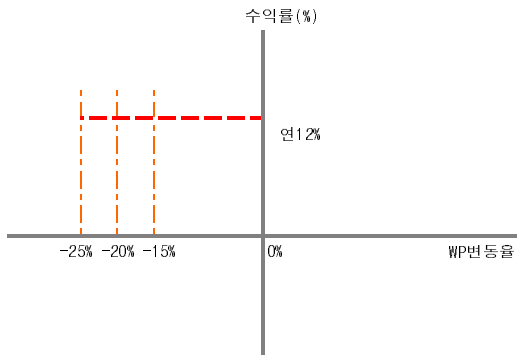
1. 계약금액

단위(백만원)

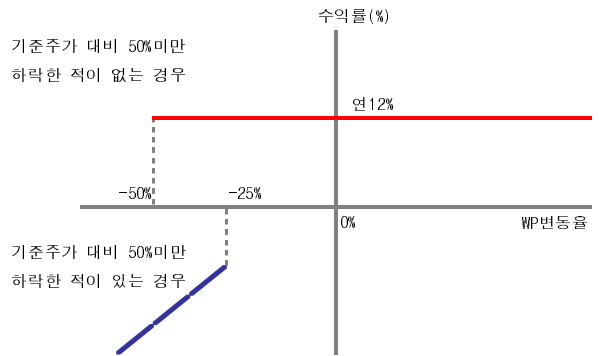
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[9-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

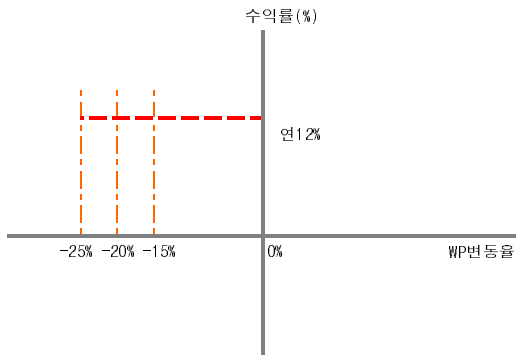
1. 계약금액

단위(백만원)

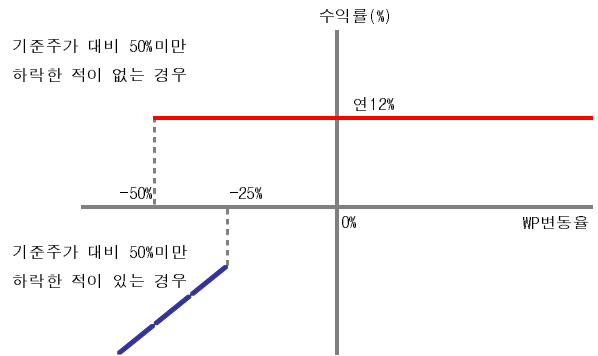
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[10-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

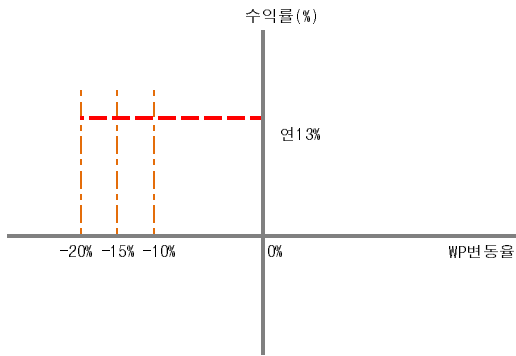
1. 계약금액

단위(백만원)

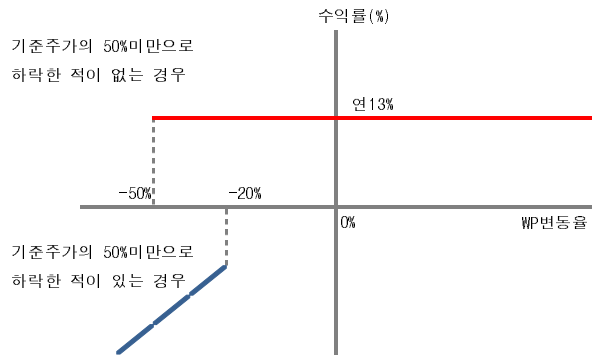
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503338016 신한투자(ELS)1316

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	166.28	135.62	104.97	74.32	43.66	13.01	(17.65)
	5.33%	160.43	129.77	99.12	68.46	37.81	7.15	(23.50)
	2.67%	135.66	105.00	74.35	43.69	13.04	(17.62)	(48.27)
	0.00%	91.96	61.31	30.65	0.00	(30.65)	(61.31)	(91.96)
	-2.67%	29.35	(1.30)	(31.96)	(62.61)	(93.27)	(123.92)	(154.58)
	-5.33%	(52.18)	(82.83)	(113.49)	(144.14)	(174.80)	(205.45)	(236.11)
	-8.00%	(152.63)	(183.28)	(213.94)	(244.59)	(275.25)	(305.90)	(336.56)

최대손실 시나리오

위험액	-336.56
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	306.93
-----	--------

[10-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

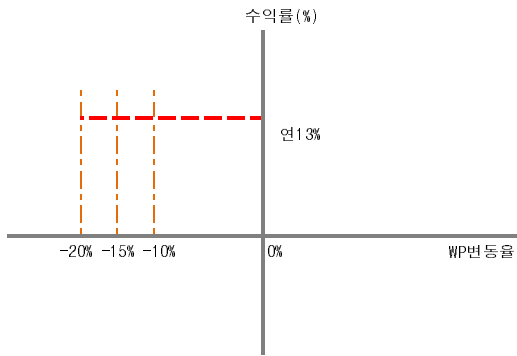
1. 계약금액

단위(백만원)

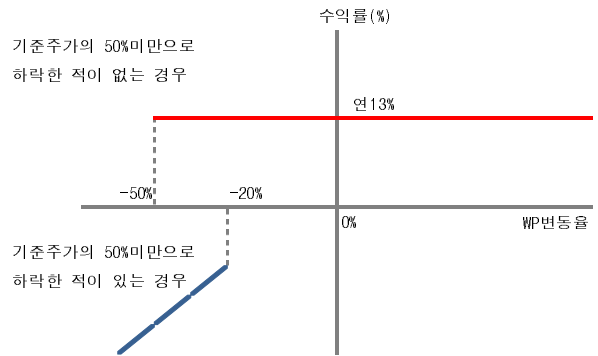
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[10-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

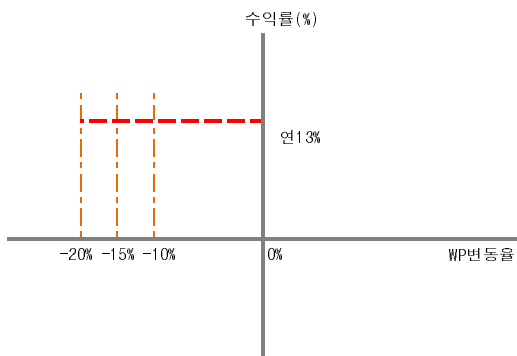
1. 계약금액

단위(백만원)

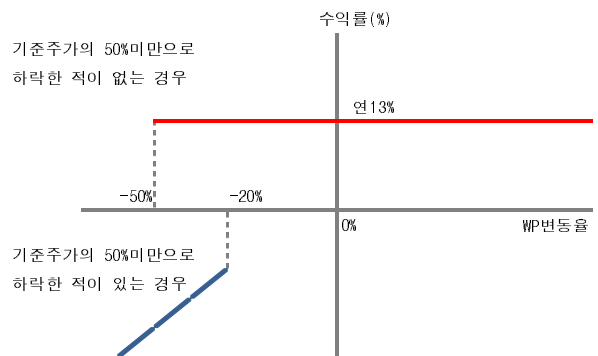
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[10-4] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

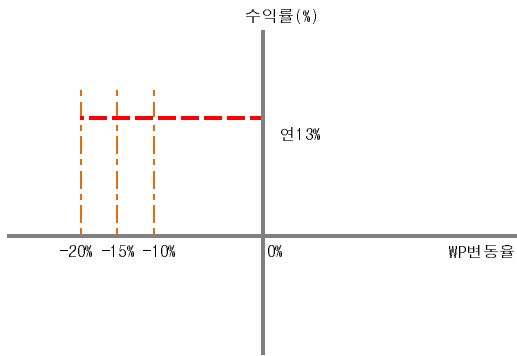
1. 계약금액

단위(백만원)

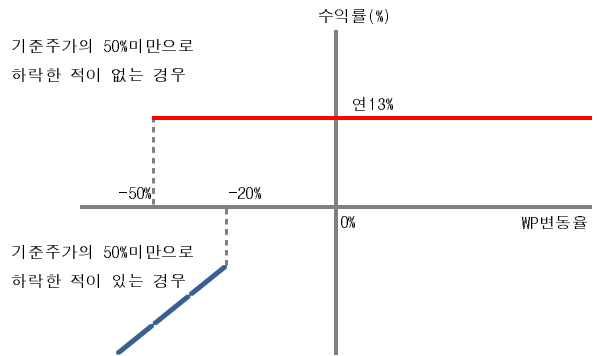
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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]

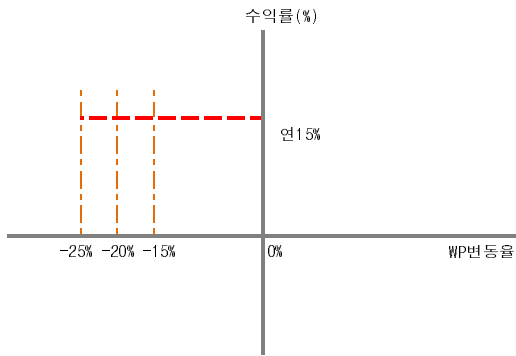
1. 계약금액

단위(백만원)

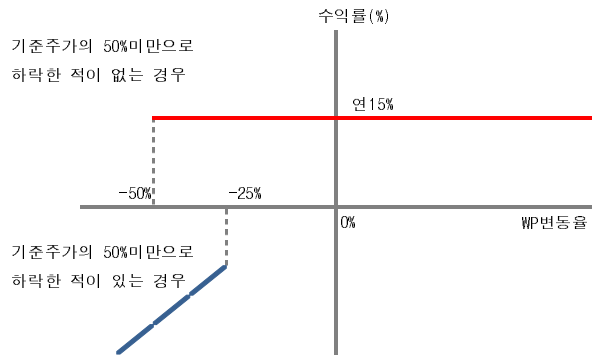
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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%	145.03	125.44	105.85	86.26	66.67	47.08	27.49
	5.33%	120.38	100.79	81.20	61.61	42.02	22.43	2.84
	2.67%	91.63	72.04	52.45	32.86	13.27	(6.32)	(25.91)
	0.00%	58.77	39.18	19.59	0.00	(19.59)	(39.18)	(58.77)
	-2.67%	21.81	2.22	(17.37)	(36.96)	(56.55)	(76.14)	(95.73)
	-5.33%	(19.26)	(38.85)	(58.44)	(78.03)	(97.62)	(117.21)	(136.80)
	-8.00%	(64.43)	(84.02)	(103.61)	(123.20)	(142.79)	(162.38)	(181.97)

최대손실 시나리오

위험액	-181.97
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	165.48
-----	--------

[11-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

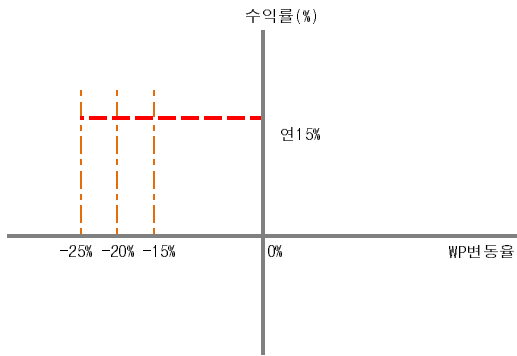
1. 계약금액

단위(백만원)

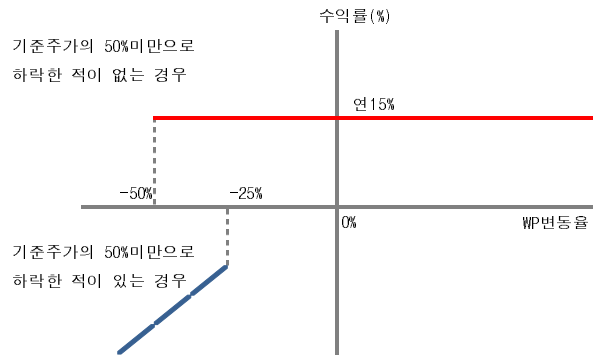
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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]

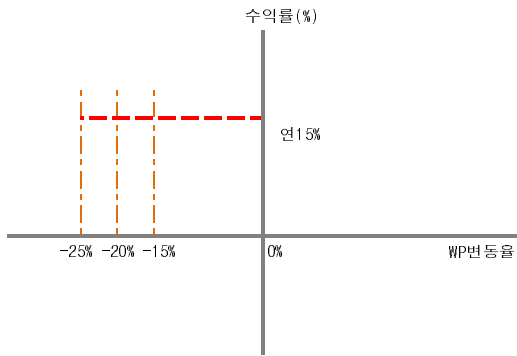
1. 계약금액

단위(백만원)

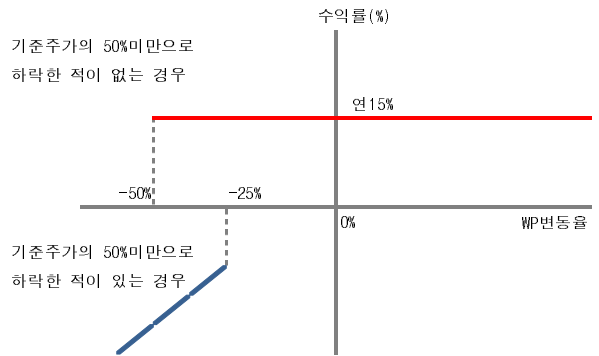
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[11-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

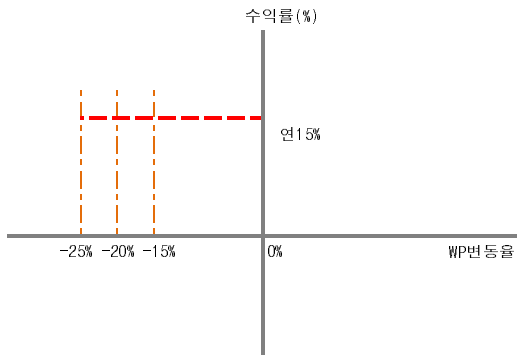
1. 계약금액

단위(백만원)

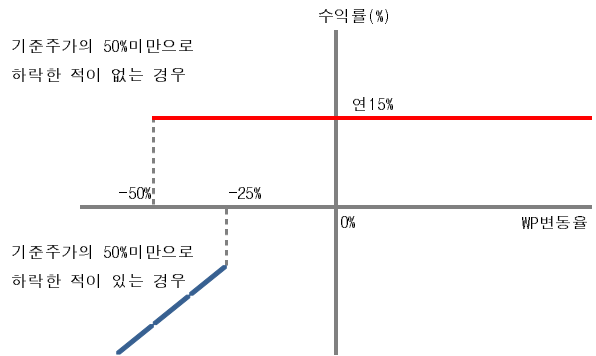
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

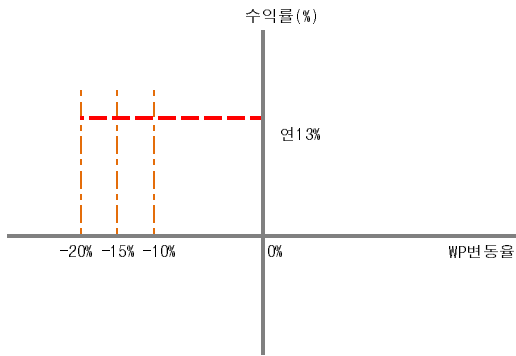
1. 계약금액

단위(백만원)

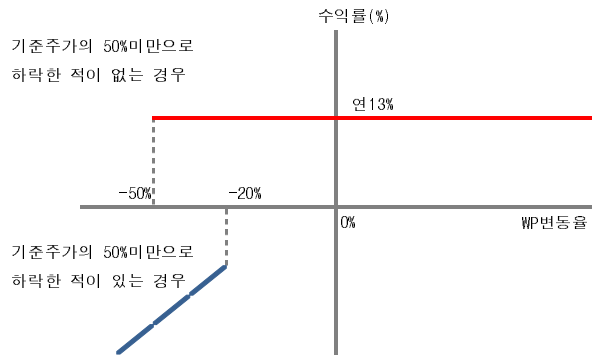
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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%	83.91	70.13	56.35	42.57	28.79	15.01	1.23
	5.33%	77.27	63.49	49.71	35.93	22.15	8.37	(5.41)
	2.67%	63.08	49.30	35.52	21.74	7.96	(5.82)	(19.60)
	0.00%	41.34	27.56	13.78	0.00	(13.78)	(27.56)	(41.34)
	-2.67%	12.05	(1.73)	(15.51)	(29.29)	(43.07)	(56.85)	(70.63)
	-5.33%	(24.79)	(38.57)	(52.35)	(66.13)	(79.91)	(93.69)	(107.47)
	-8.00%	(69.17)	(82.95)	(96.73)	(110.51)	(124.29)	(138.07)	(151.85)

최대손실 시나리오

위험액	-151.85
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	165.00
-----	--------

[12-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

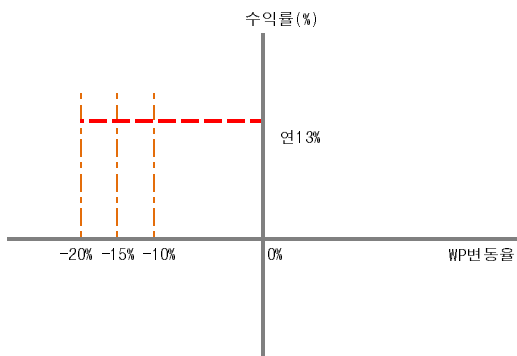
1. 계약금액

단위(백만원)

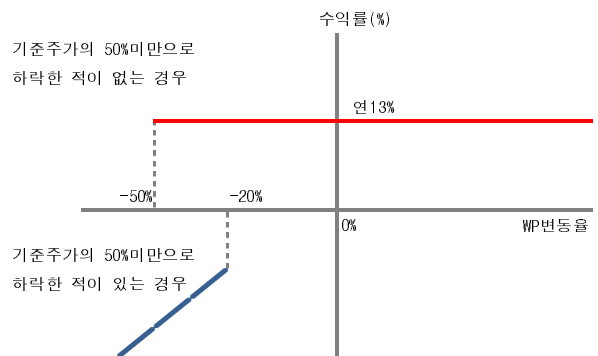
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[12-3]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

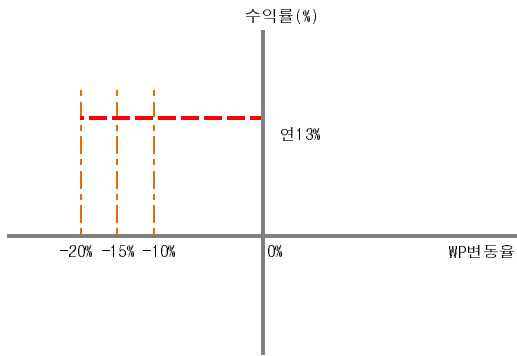
1. 계약금액

단위(백만원)

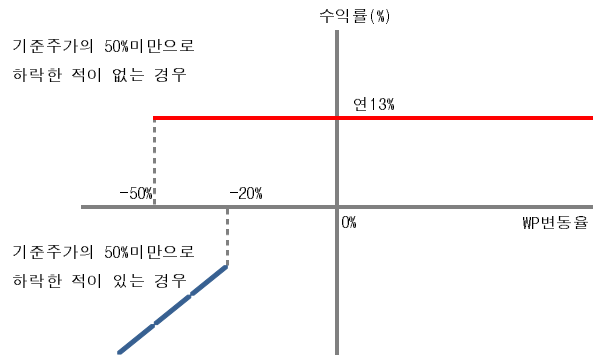
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[12-4]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

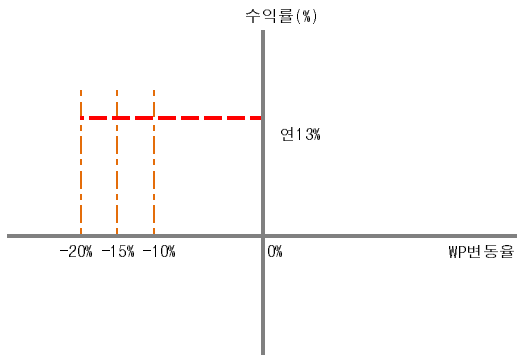
1. 계약금액

단위(백만원)

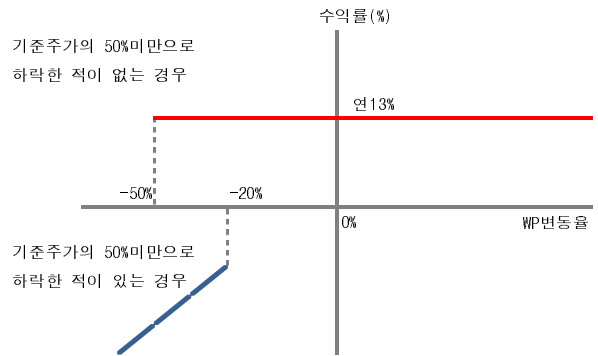
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504

[13] 메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

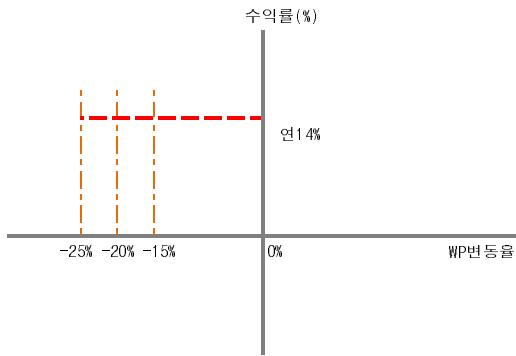
1. 계약금액

단위(백만원)

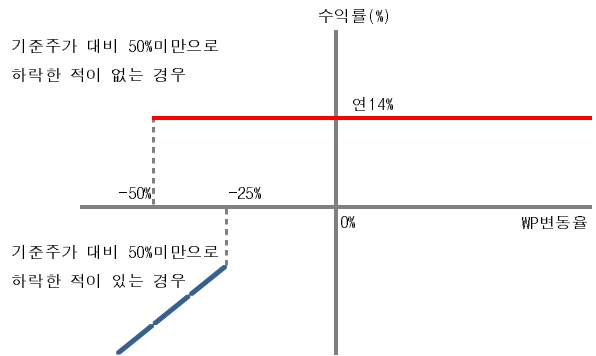
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장익

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%	163.52	140.45	117.39	94.32	71.26	48.19	25.13
	5.33%	137.67	114.60	91.54	68.47	45.41	22.34	(0.72)
	2.67%	106.23	83.16	60.10	37.03	13.97	(9.10)	(32.16)
	0.00%	69.19	46.13	23.06	0.00	(23.06)	(46.13)	(69.19)
	-2.67%	26.57	3.51	(19.56)	(42.62)	(65.69)	(88.75)	(111.82)
	-5.33%	(21.64)	(44.70)	(67.77)	(90.83)	(113.90)	(136.96)	(160.03)
	-8.00%	(75.44)	(98.51)	(121.57)	(144.64)	(167.70)	(190.77)	(213.83)

최대손실 시나리오

위험액	-213.83
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	220.43
-----	--------

[14] 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

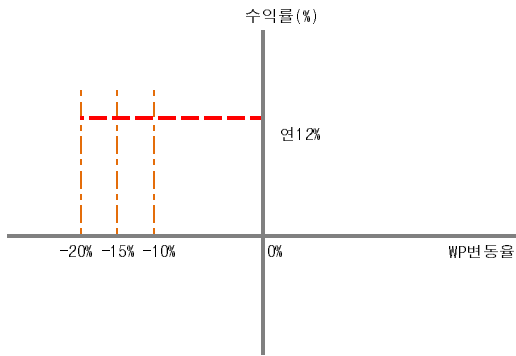
1. 계약금액

단위(백만원)

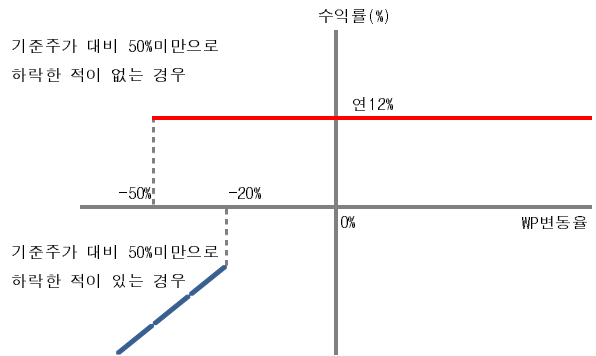
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장익

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%	72.90	62.90	52.90	42.90	32.90	22.90	12.90
	5.33%	60.77	50.77	40.77	30.77	20.77	10.77	0.77
	2.67%	46.47	36.47	26.47	16.47	6.47	(3.53)	(13.53)
	0.00%	30.00	20.00	10.00	0.00	(10.00)	(20.00)	(30.00)
	-2.67%	11.36	1.36	(8.64)	(18.64)	(28.64)	(38.64)	(48.64)
	-5.33%	(9.46)	(19.46)	(29.46)	(39.46)	(49.46)	(59.46)	(69.46)
	-8.00%	(32.45)	(42.45)	(52.45)	(62.45)	(72.45)	(82.45)	(92.45)

최대손실 시나리오

위험액	-92.45
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	89.71
-----	-------

[15] 메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

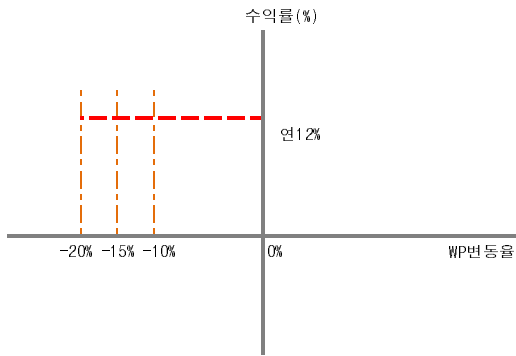
1. 계약금액

단위(백만원)

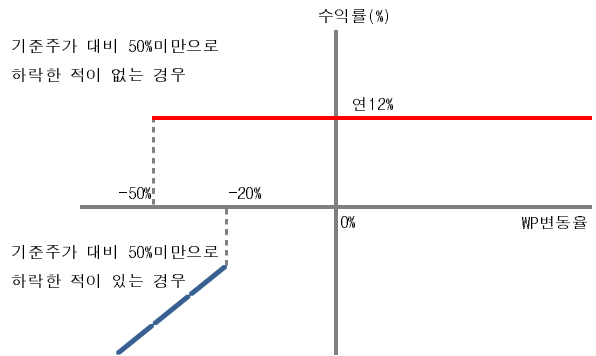
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장익

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%	87.28	73.18	59.07	44.97	30.86	16.76	2.65
	5.33%	75.11	61.00	46.90	32.79	18.69	4.58	(9.53)
	2.67%	60.12	46.01	31.91	17.80	3.70	(10.41)	(24.51)
	0.00%	42.32	28.21	14.11	0.00	(14.11)	(28.21)	(42.32)
	-2.67%	21.70	7.59	(6.51)	(20.62)	(34.72)	(48.83)	(62.93)
	-5.33%	(1.73)	(15.84)	(29.94)	(44.05)	(58.15)	(72.26)	(86.36)
	-8.00%	(27.98)	(42.08)	(56.19)	(70.29)	(84.40)	(98.50)	(112.61)

최대손실 시나리오

위험액	-112.61
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	102.86
-----	--------