

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

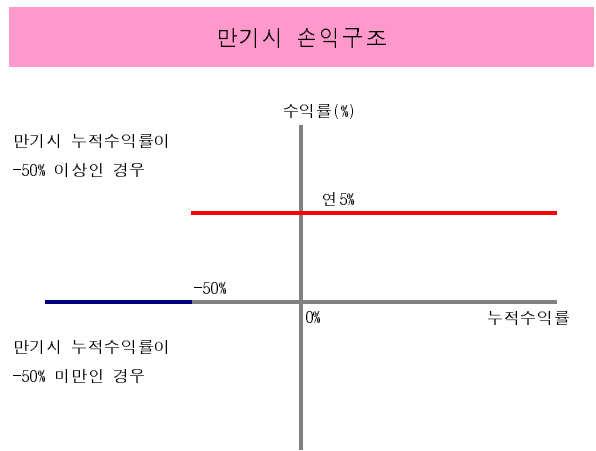
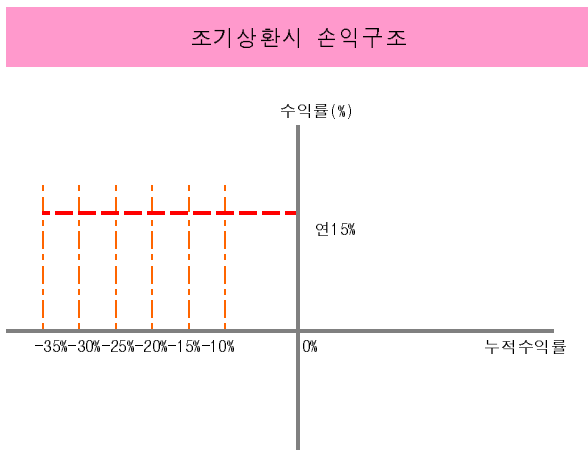
[1] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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
-----	------

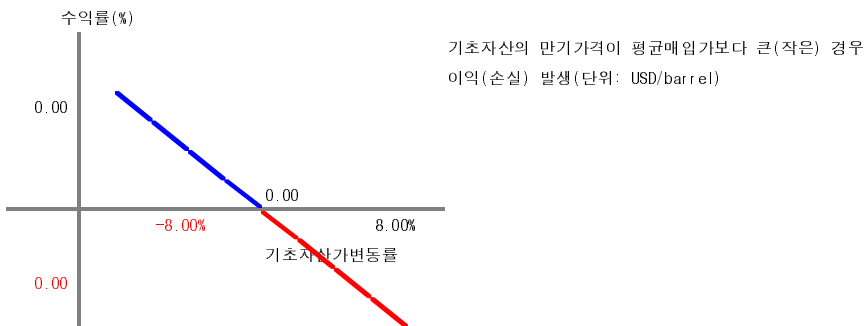
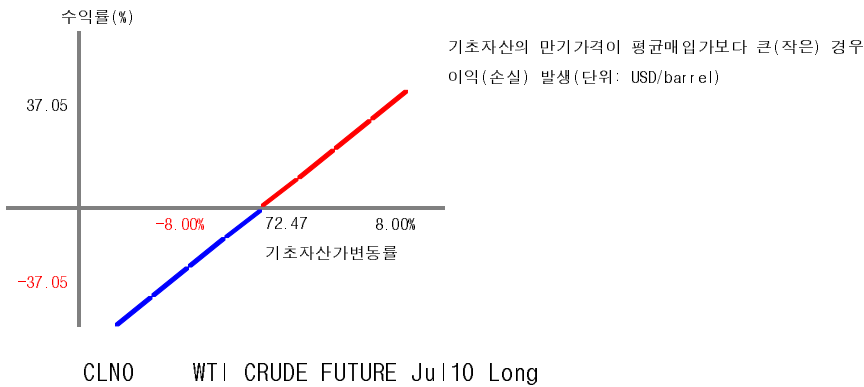
[2] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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))

CLNO WTI CRUDE FUTURE Jul10 Long

구분	시나리오	
기초자산 시나리오	8.00%	37.05
	5.33%	24.69
	2.67%	12.37
	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.37
	-5.33%	-24.69
	-8.00%	-37.05

최대손실 시나리오	
위험액	-37.05

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	150
-----	-----

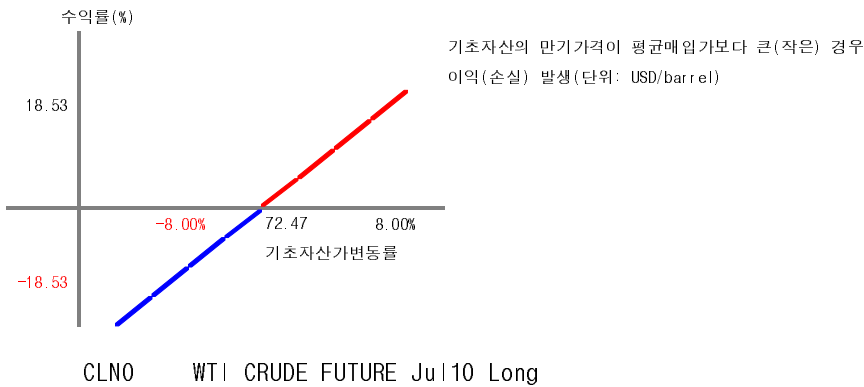
[3-1] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:1000USD))

CLNO WTI CRUDE FUTURE Jul10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	37.05
	5.33%	24.69
	2.67%	12.37
	0.00%	0.00
	-2.67%	-12.37
	-5.33%	-24.69
	-8.00%	-37.05

최대손실 시나리오	
위험액	-37.05

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	98
-----	----

[3-2]

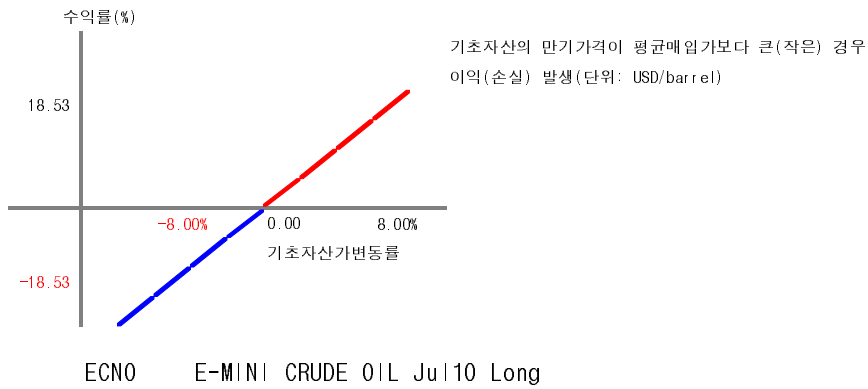
메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

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



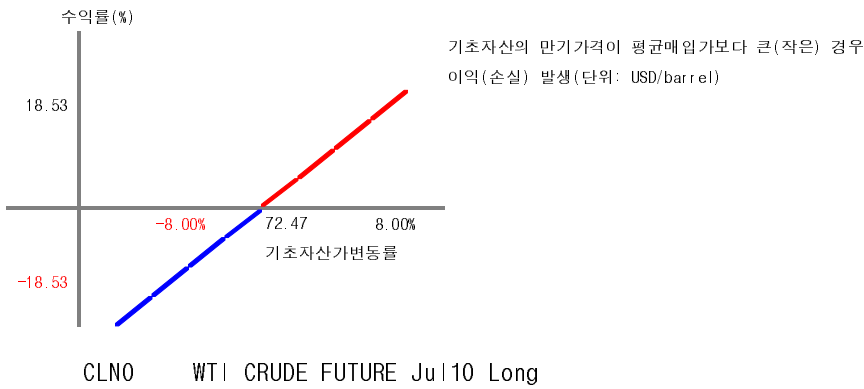
[4-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	3	0	3	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:1000USD))

CLNO WTI CRUDE FUTURE Jul10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	40.28
	5.33%	26.84
	2.67%	13.44
	0.00%	0.00
	-2.67%	-13.44
	-5.33%	-26.84
	-8.00%	-40.28

최대손실 시나리오	
위험액	-40.28

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	160
-----	-----

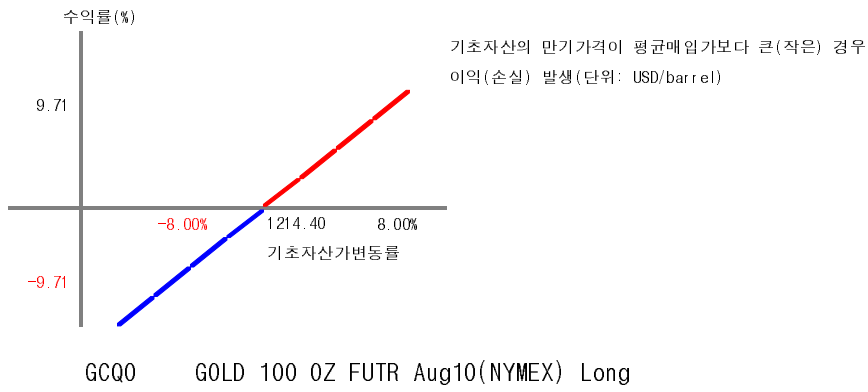
[4-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



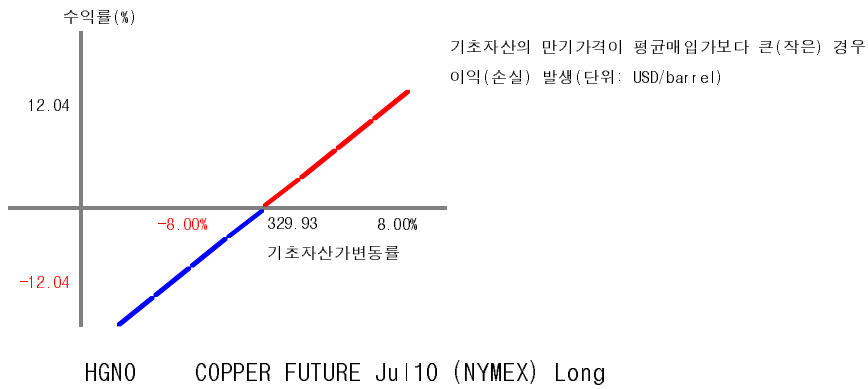
[4-3] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

1. 계약금액

단위(백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



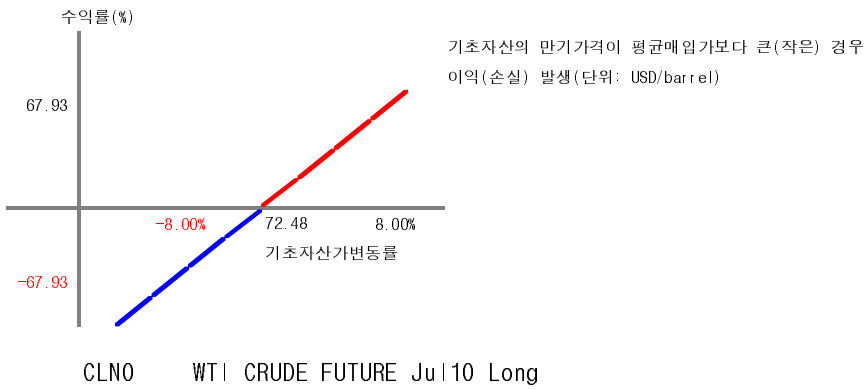
[5] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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))

CLNO WTI CRUDE FUTURE Jul10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	67.93
	5.33%	45.26
	2.67%	22.67
	0.00%	0.00
	-2.67%	-22.67
	-5.33%	-45.26
	-8.00%	-67.93

최대손실 시나리오	
위험액	-67.93

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	256
-----	-----

[6-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

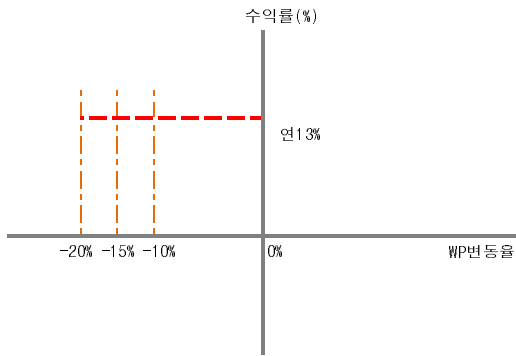
1. 계약금액

단위(백만원)

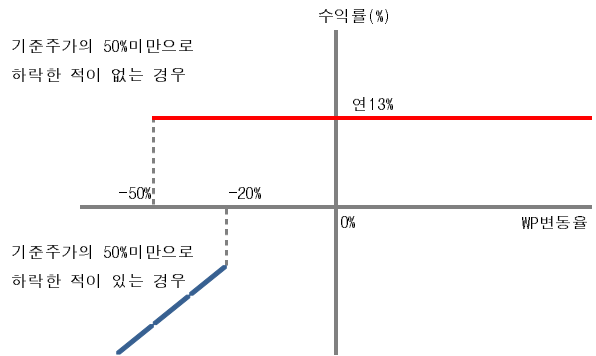
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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%	(118.34)	(119.16)	(119.97)	(120.78)	(121.60)	(122.41)	(123.22)
	5.33%	(50.26)	(51.08)	(51.89)	(52.70)	(53.52)	(54.33)	(55.14)
	2.67%	(10.00)	(10.81)	(11.63)	(12.44)	(13.26)	(14.07)	(14.88)
	0.00%	2.44	1.63	0.81	0.00	(0.81)	(1.63)	(2.44)
	-2.67%	(12.94)	(13.75)	(14.56)	(15.38)	(16.19)	(17.00)	(17.82)
	-5.33%	(56.13)	(56.95)	(57.76)	(58.57)	(59.39)	(60.20)	(61.01)
	-8.00%	(127.15)	(127.96)	(128.78)	(129.59)	(130.40)	(131.22)	(132.03)

최대손실 시나리오

위험액	-132.03
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	34.86
-----	-------

[6-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

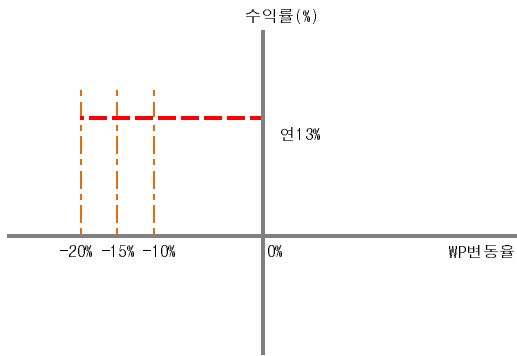
1. 계약금액

단위(백만원)

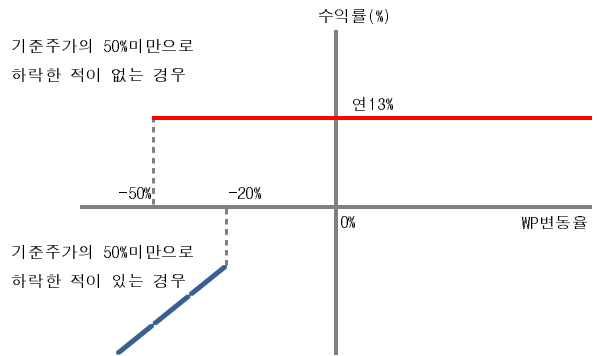
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[6-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

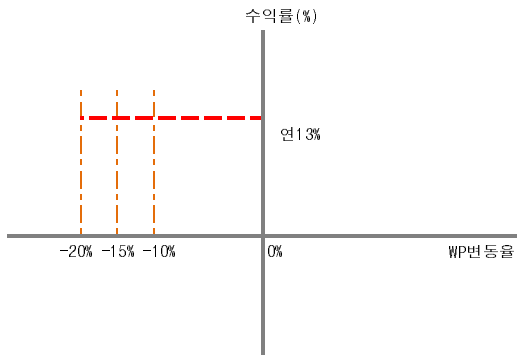
1. 계약금액

단위(백만원)

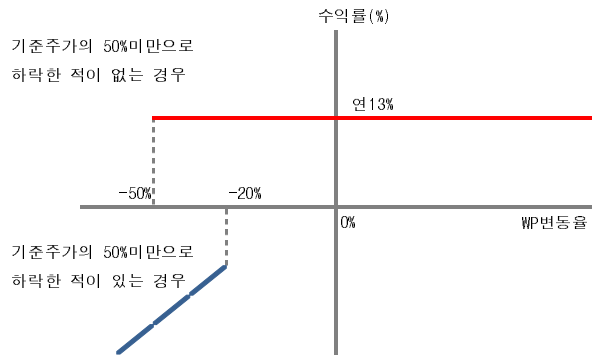
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[6-4] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

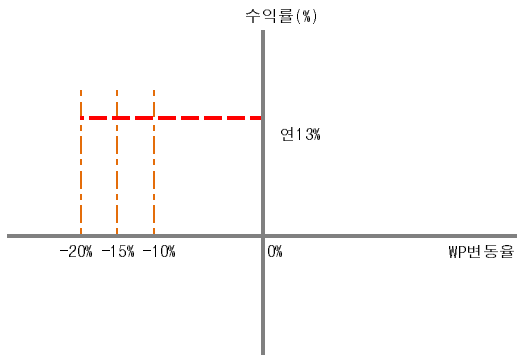
1. 계약금액

단위(백만원)

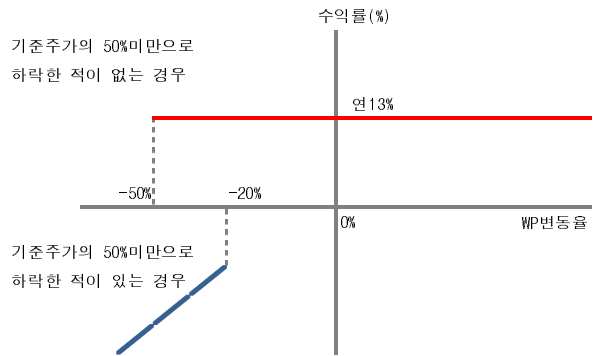
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703338014 H&D증권(ELS)431

[7-1] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

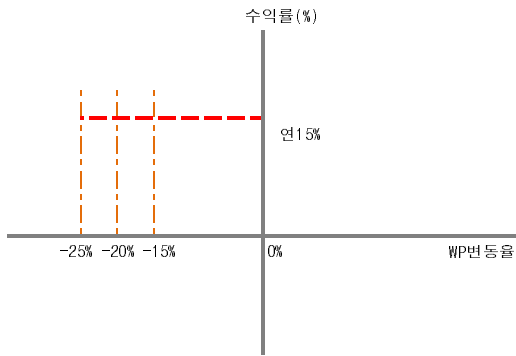
1. 계약금액

단위(백만원)

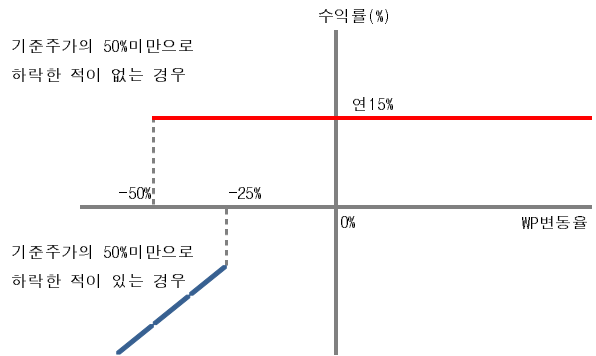
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512111024 대신증권(ELS)966

구분	변동성 시나리오							
	8.00%	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	107.71	94.82	81.94	69.05	56.16	43.27	30.39	
	93.66	80.77	67.88	54.99	42.11	29.22	16.33	
	70.64	57.75	44.87	31.98	19.09	6.20	(6.68)	
	38.66	25.77	12.89	0.00	(12.89)	(25.77)	(38.66)	
	(2.28)	(15.16)	(28.05)	(40.94)	(53.83)	(66.71)	(79.60)	
	(52.18)	(65.06)	(77.95)	(90.84)	(103.73)	(116.61)	(129.50)	
	(111.04)	(123.93)	(136.81)	(149.70)	(162.59)	(175.48)	(188.36)	

최대손실 시나리오

위험액	-188.36
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	187.06
-----	--------

[7-2] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

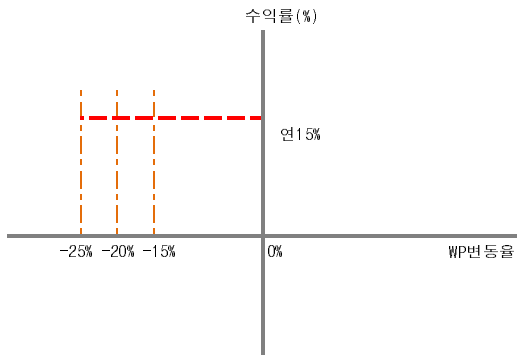
1. 계약금액

단위(백만원)

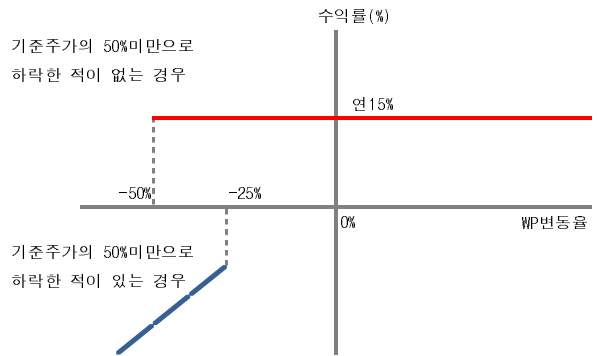
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[7-3] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

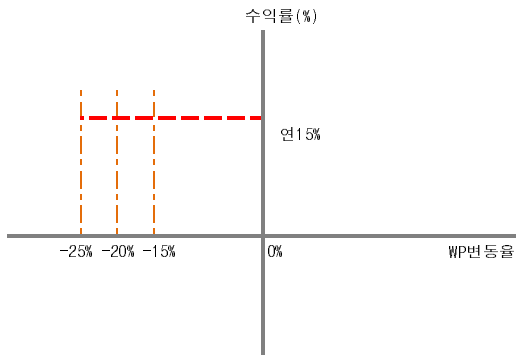
1. 계약금액

단위(백만원)

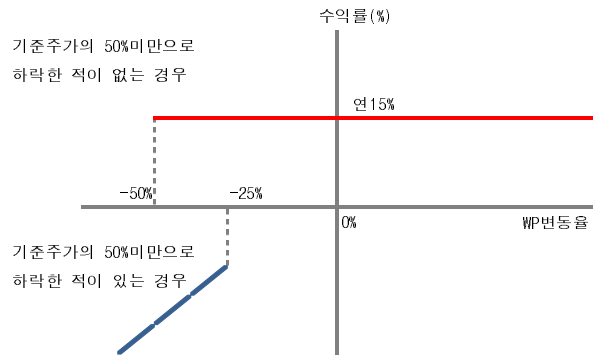
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[7-4] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

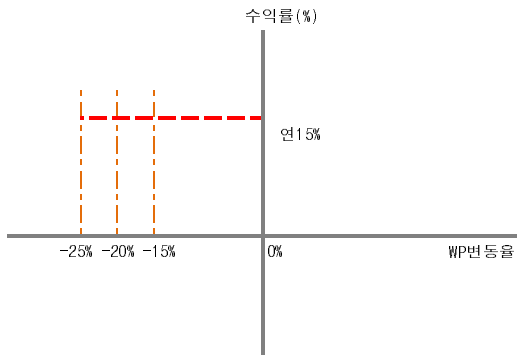
1. 계약금액

단위(백만원)

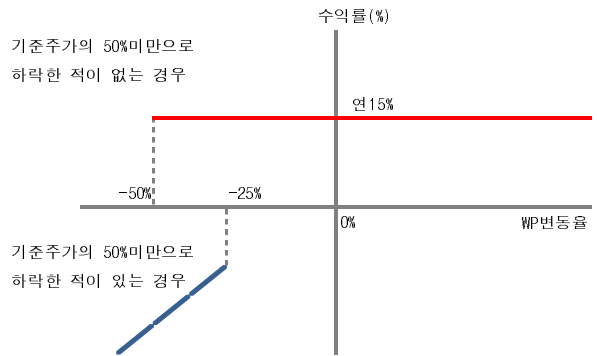
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[8-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

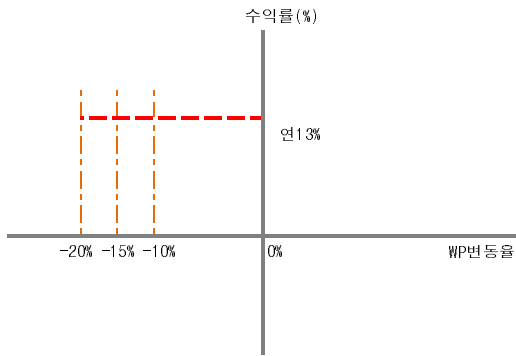
1. 계약금액

단위(백만원)

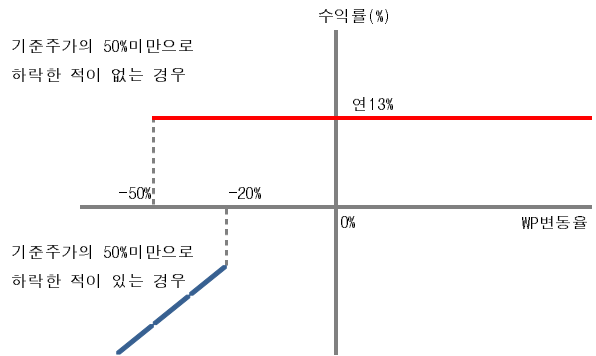
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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%	9.50	4.48	(0.54)	(5.56)	(10.58)	(15.60)	(20.63)
	5.33%	18.93	13.91	8.89	3.87	(1.15)	(6.17)	(11.19)
	2.67%	20.79	15.77	10.74	5.72	0.70	(4.32)	(9.34)
	0.00%	15.06	10.04	5.02	0.00	(5.02)	(10.04)	(15.06)
	-2.67%	1.76	(3.26)	(8.28)	(13.30)	(18.32)	(23.34)	(28.36)
	-5.33%	(19.11)	(24.13)	(29.16)	(34.18)	(39.20)	(44.22)	(49.24)
	-8.00%	(47.57)	(52.59)	(57.61)	(62.63)	(67.65)	(72.67)	(77.70)

최대손실 시나리오

위험액	-77.70
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	53.33
-----	-------

[8-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

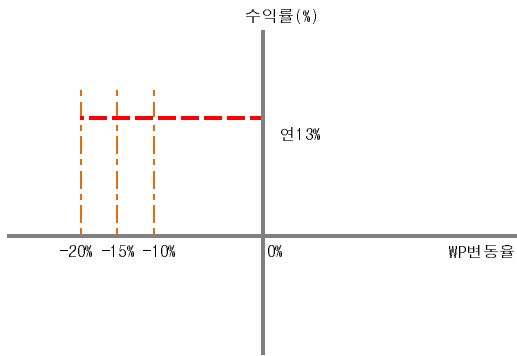
1. 계약금액

단위(백만원)

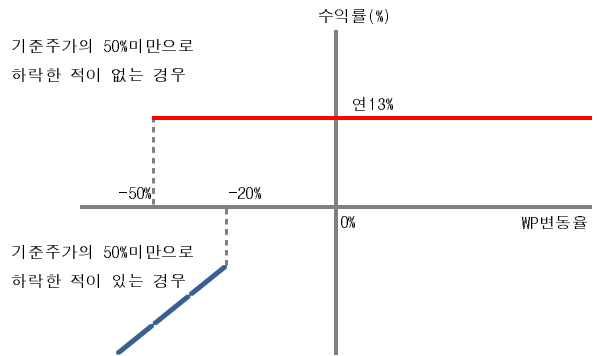
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[8-3] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

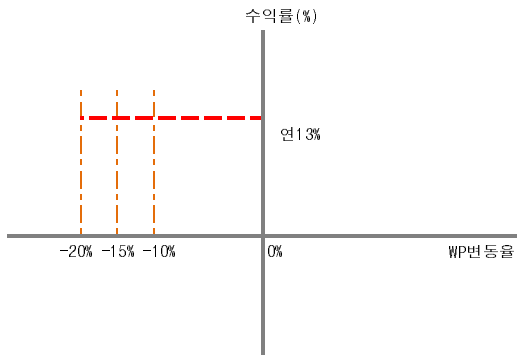
1. 계약금액

단위(백만원)

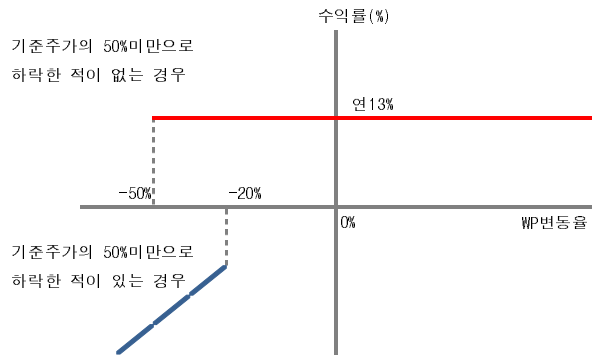
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[8-4] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

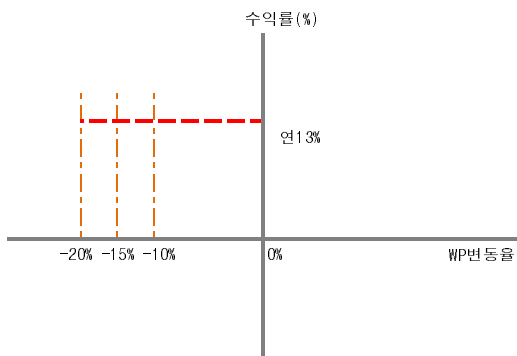
1. 계약금액

단위(백만원)

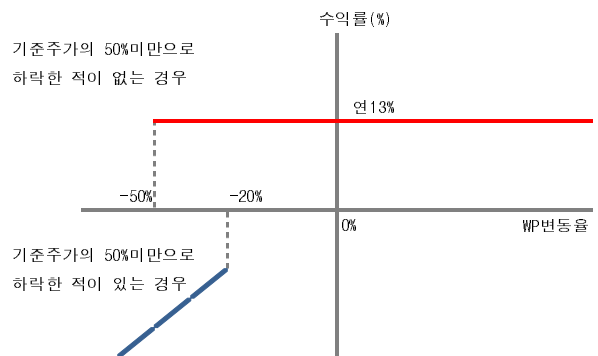
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504

[9] 메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

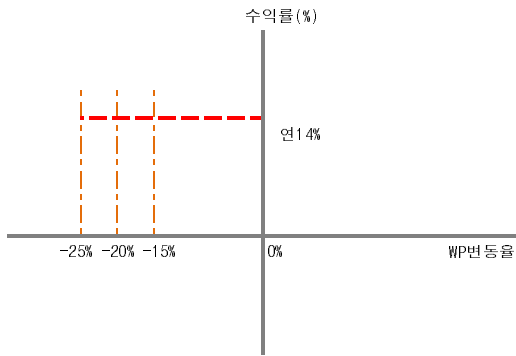
1. 계약금액

단위(백만원)

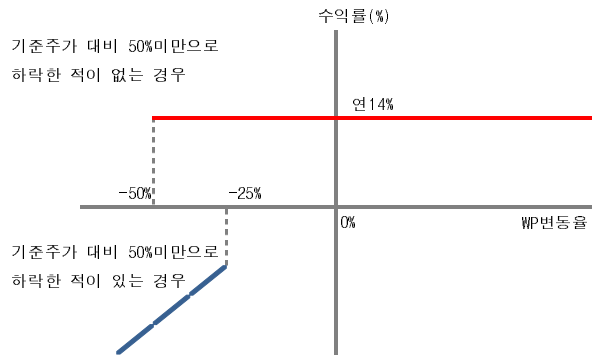
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	3,439	0	3,439	장익

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 시나 리오	8.00%	89.43	76.75	64.08	51.41	38.74	26.06	13.39
	5.33%	80.32	67.64	54.97	42.30	29.62	16.95	4.28
	2.67%	63.18	50.51	37.83	25.16	12.49	(0.19)	(12.86)
	0.00%	38.02	25.35	12.67	0.00	(12.67)	(25.35)	(38.02)
	-2.67%	4.84	(7.84)	(20.51)	(33.18)	(45.86)	(58.53)	(71.20)
	-5.33%	(36.37)	(49.05)	(61.72)	(74.39)	(87.07)	(99.74)	(112.41)
	-8.00%	(85.61)	(98.28)	(110.95)	(123.62)	(136.30)	(148.97)	(161.64)

최대손실 시나리오

위험액	-161.64
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	158.20
-----	--------

[10] 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

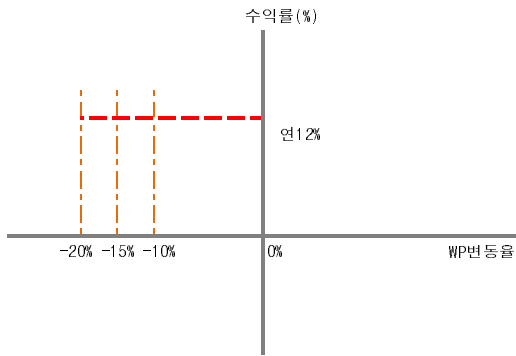
1. 계약금액

단위(백만원)

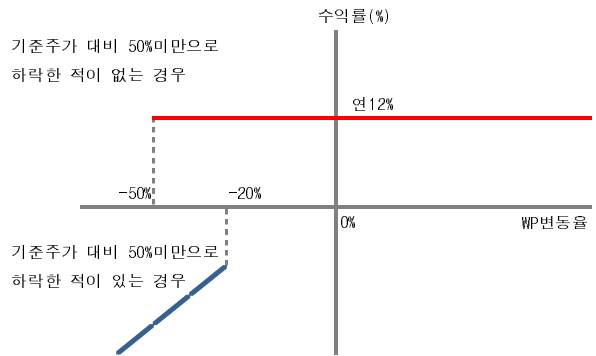
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,542	0	1,542	장익

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%	79.31	68.61	57.90	47.20	36.49	25.78	15.08
	5.33%	65.95	55.24	44.54	33.83	23.12	12.42	1.71
	2.67%	50.22	39.51	28.80	18.10	7.39	(3.31)	(14.02)
	0.00%	32.12	21.41	10.71	0.00	(10.71)	(21.41)	(32.12)
	-2.67%	11.65	0.95	(9.76)	(20.46)	(31.17)	(41.88)	(52.58)
	-5.33%	(11.18)	(21.88)	(32.59)	(43.30)	(54.00)	(64.71)	(75.41)
	-8.00%	(36.38)	(47.08)	(57.79)	(68.49)	(79.20)	(89.91)	(100.61)

최대손실 시나리오

위험액	-100.61
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	91.93
-----	-------

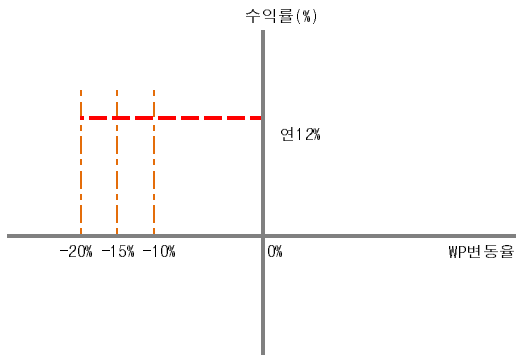
1. 계약금액

단위(백만원)

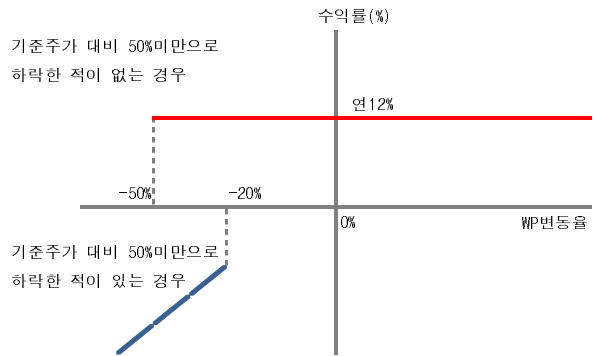
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,715	0	1,715	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512107048 대신증권(ELS)1029

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	66.84	56.53	46.22	35.92	25.61	15.31	5.00
	5.33%	57.89	47.58	37.27	26.97	16.66	6.35	(3.95)
	2.67%	45.91	35.61	25.30	14.99	4.69	(5.62)	(15.92)
	0.00%	30.92	20.61	10.31	0.00	(10.31)	(20.61)	(30.92)
	-2.67%	12.90	2.60	(7.71)	(18.01)	(28.32)	(38.63)	(48.93)
	-5.33%	(8.13)	(18.44)	(28.74)	(39.05)	(49.36)	(59.66)	(69.97)
	-8.00%	(32.19)	(42.49)	(52.80)	(63.11)	(73.41)	(83.72)	(94.03)

최대손실 시나리오

위험액	-94.03
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	91.07
-----	-------

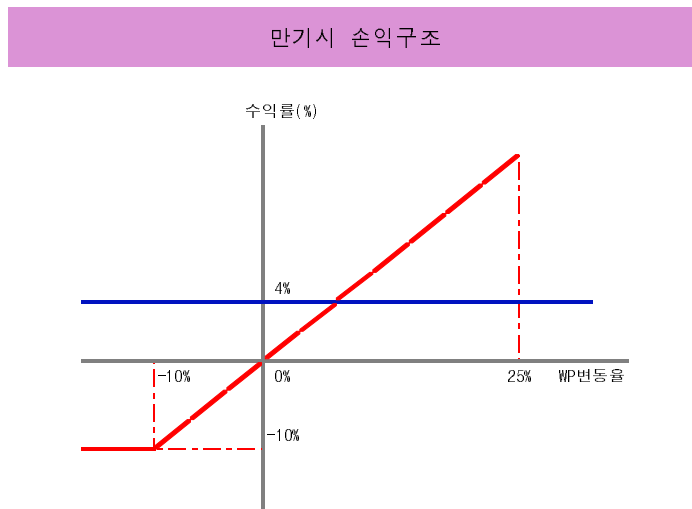
[12] 메리트주가지수연계증권제1호[ELS-파생형]

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	445	0	445	장익

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503339048 신한투자(ELS)1447

구분	변동성 시나리오							
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	9.03	8.27	7.52	6.77	6.01	5.26	4.51
	5.33%	7.03	6.28	5.52	4.77	4.02	3.26	2.51
	2.67%	4.78	4.02	3.27	2.52	1.76	1.01	0.25
	0.00%	2.26	1.51	0.75	0.00	(0.75)	(1.51)	(2.26)
	-2.67%	(0.51)	(1.27)	(2.02)	(2.77)	(3.53)	(4.28)	(5.04)
	-5.33%	(3.55)	(4.30)	(5.05)	(5.81)	(6.56)	(7.32)	(8.07)
	-8.00%	(6.84)	(7.59)	(8.35)	(9.10)	(9.86)	(10.61)	(11.36)

최대손실 시나리오

위험액	-11.36
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	12.23
-----	-------

[13] 메리츠한중지수연계증권제6호[ELS-파생형]

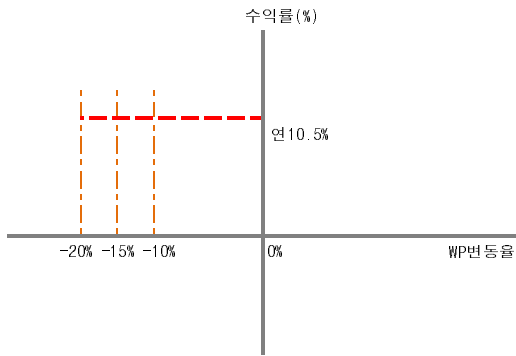
1. 계약금액

단위(백만원)

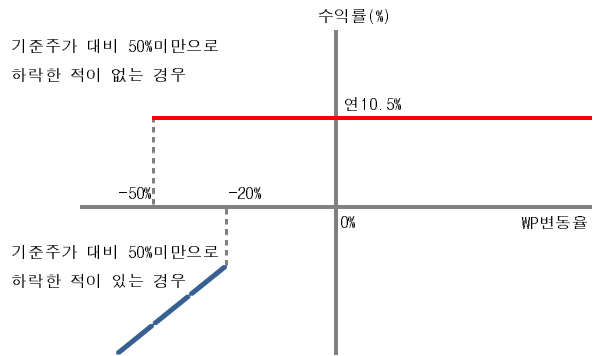
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,431	0	1,431	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513135048 대신증권(ELS)1059

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	39.73	33.81	27.89	21.96	16.04	10.12	4.19
	5.33%	35.07	29.15	23.23	17.30	11.38	5.46	(0.46)
	2.67%	27.75	21.83	15.91	9.98	4.06	(1.86)	(7.78)
	0.00%	17.77	11.85	5.92	0.00	(5.92)	(11.85)	(17.77)
	-2.67%	5.12	(0.80)	(6.72)	(12.65)	(18.57)	(24.49)	(30.41)
	-5.33%	(10.19)	(16.11)	(22.03)	(27.96)	(33.88)	(39.80)	(45.72)
	-8.00%	(28.16)	(34.08)	(40.01)	(45.93)	(51.85)	(57.77)	(63.70)

최대손실 시나리오

위험액	-63.70
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	64.75
-----	-------

[14] 메리츠한중지수연계증권제7호[ELS-파생형]

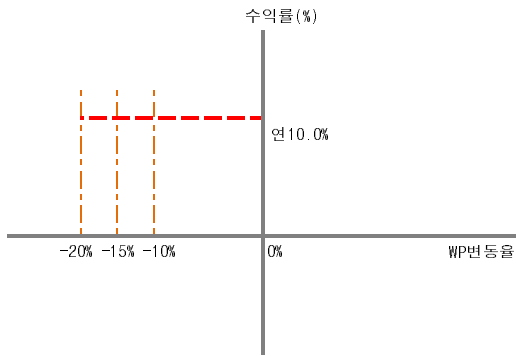
1. 계약금액

단위(백만원)

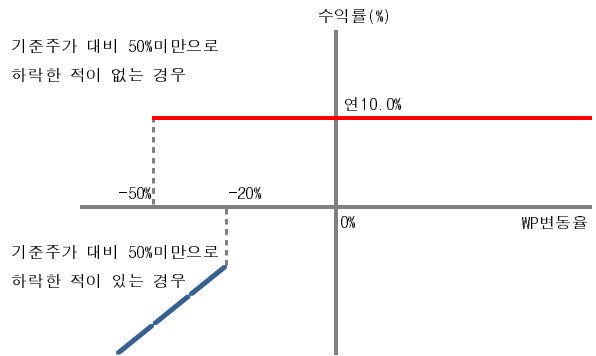
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,146	0	1,146	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513118051 대신증권(ELS)1072

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	16.80	14.00	11.20	8.41	5.61	2.81	0.01
	5.33%	15.75	12.95	10.15	7.36	4.56	1.76	(1.04)
	2.67%	12.94	10.15	7.35	4.55	1.76	(1.04)	(3.84)
	0.00%	8.39	5.59	2.80	0.00	(2.80)	(5.59)	(8.39)
	-2.67%	2.09	(0.71)	(3.51)	(6.30)	(9.10)	(11.90)	(14.70)
	-5.33%	(5.97)	(8.76)	(11.56)	(14.36)	(17.15)	(19.95)	(22.75)
	-8.00%	(15.77)	(18.57)	(21.37)	(24.16)	(26.96)	(29.76)	(32.55)

최대손실 시나리오

위험액	-32.55
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	30.12
-----	-------

[15] 메리츠2Star증권SEPO-3호[ELS-파생형]

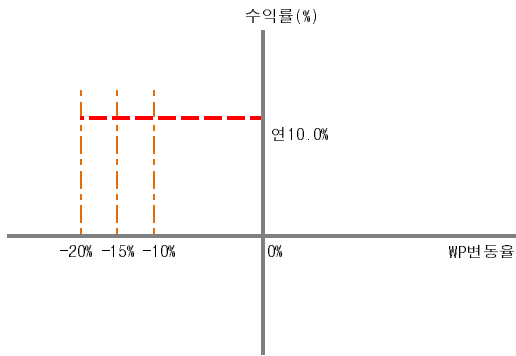
1. 계약금액

단위(백만원)

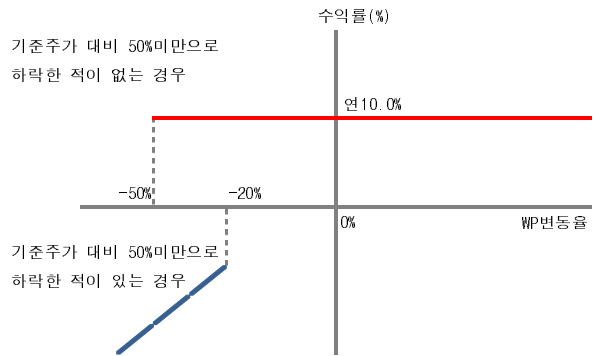
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,347	0	1,347	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6512123052 대신증권(ELS)1087

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	22.95	20.00	17.04	14.09	11.13	8.18	5.23
	5.33%	20.03	17.08	14.12	11.17	8.21	5.26	2.31
	2.67%	15.33	12.38	9.43	6.47	3.52	0.56	(2.39)
	0.00%	8.86	5.91	2.95	0.00	(2.95)	(5.91)	(8.86)
	-2.67%	0.61	(2.34)	(5.29)	(8.25)	(11.20)	(14.16)	(17.11)
	-5.33%	(9.41)	(12.37)	(15.32)	(18.27)	(21.23)	(24.18)	(27.13)
	-8.00%	(21.21)	(24.17)	(27.12)	(30.07)	(33.03)	(35.98)	(38.94)

최대손실 시나리오

위험액	-38.94
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	67.52
-----	-------

[16] 메리츠2Star증권HISE-1[ELS-파생형]

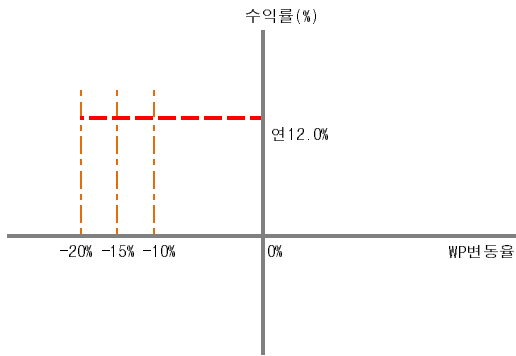
1. 계약금액

단위(백만원)

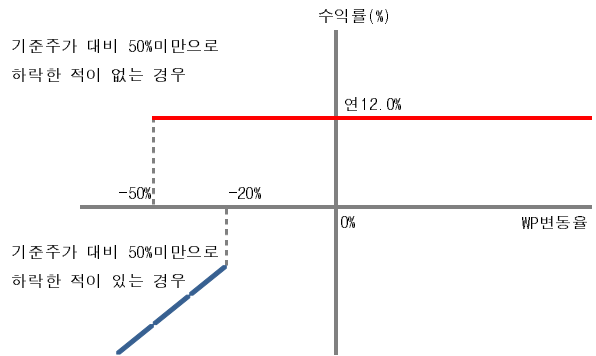
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	296	0	296	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6509358059 신한투자(ELS)1506

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	3.55	2.86	2.17	1.48	0.79	0.10	(0.59)
	5.33%	3.48	2.79	2.10	1.41	0.72	0.03	(0.66)
	2.67%	2.99	2.30	1.61	0.92	0.23	(0.46)	(1.16)
	0.00%	2.07	1.38	0.69	0.00	(0.69)	(1.38)	(2.07)
	-2.67%	0.73	0.04	(0.65)	(1.34)	(2.03)	(2.72)	(3.41)
	-5.33%	(1.03)	(1.72)	(2.41)	(3.10)	(3.79)	(4.48)	(5.17)
	-8.00%	(3.21)	(3.90)	(4.59)	(5.28)	(5.97)	(6.66)	(7.35)

최대손실 시나리오

위험액	-7.35
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	7.38
-----	------