

**파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시**

---

[1-1] 메리츠2Star증권KGSH-1호

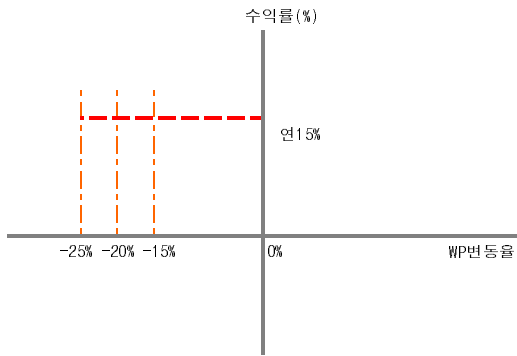
1. 계약금액

단위(백만원)

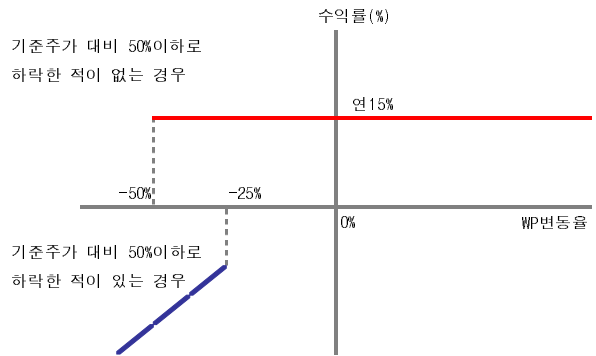
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6552359WB4 우리투자증권(ELS)2765

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	171.48	147.92	124.36	100.81	77.25	53.69	30.13
	5.33%	143.46	119.90	96.34	72.78	49.22	25.67	2.11
	2.67%	109.86	86.30	62.74	39.18	15.62	(7.94)	(31.49)
	0.00%	70.68	47.12	23.56	0.00	(23.56)	(47.12)	(70.68)
	-2.67%	25.92	2.36	(21.20)	(44.76)	(68.32)	(91.88)	(115.44)
	-5.33%	(24.42)	(47.98)	(71.54)	(95.10)	(118.66)	(142.22)	(165.77)
	-8.00%	(80.34)	(103.90)	(127.46)	(151.02)	(174.58)	(198.13)	(221.69)

최대손실 시나리오

위험액	-221.69
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	263.33
-----	--------

[1-2]

메리츠2Star증권KGSH-1호

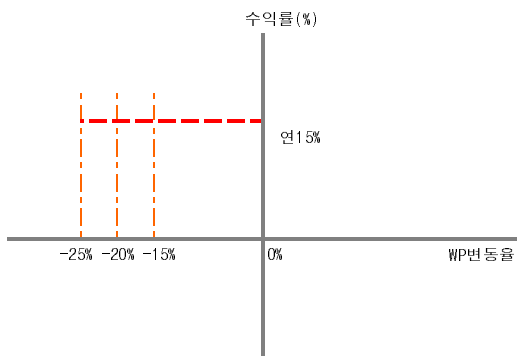
1. 계약금액

단위(백만원)

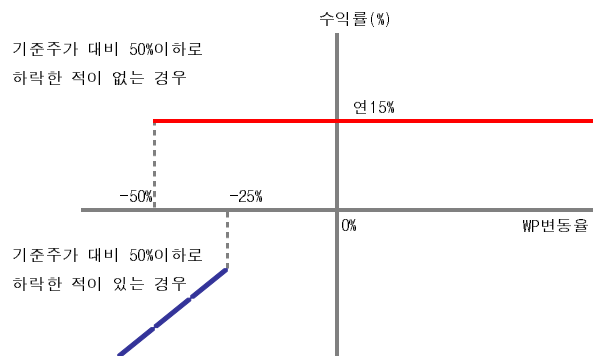
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[1-3]

메리츠2Star증권KGSH-1호

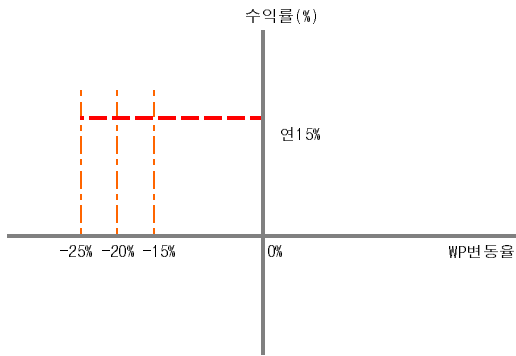
1. 계약금액

단위(백만원)

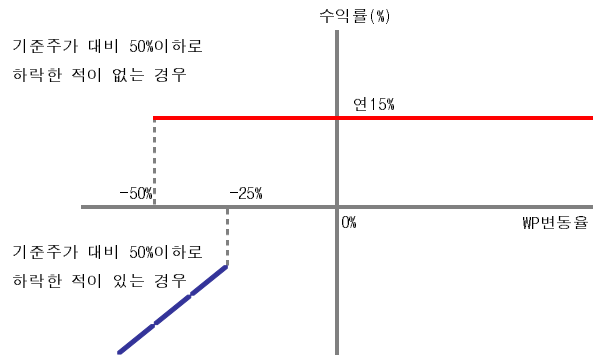
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

[1-4]

메리츠2Star증권KGSH-1호

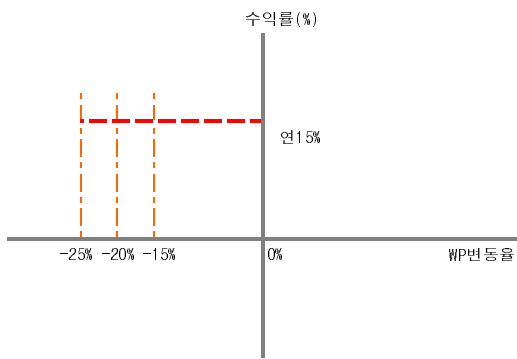
1. 계약금액

단위(백만원)

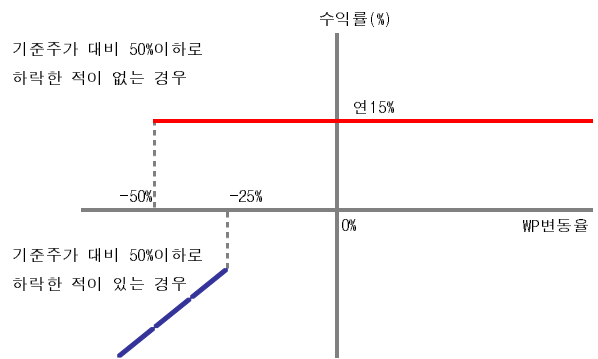
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[2-1] 메리츠2Star증권KISE-1호

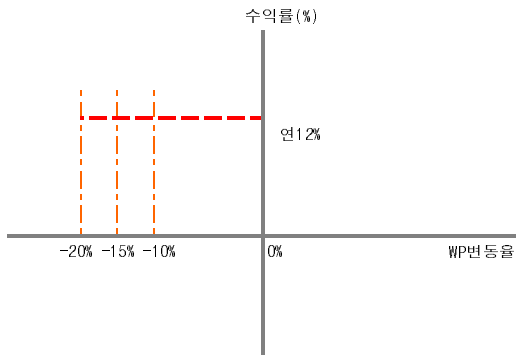
1. 계약금액

단위(백만원)

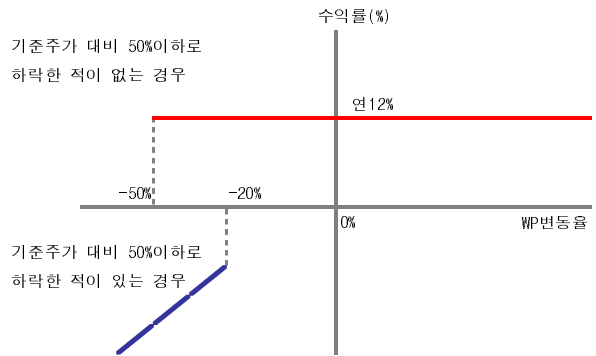
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6509307WB7 신한투자(ELS)1211

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	12.31	12.39	12.47	12.54	12.62	12.70	12.78
	5.33%	5.38	5.46	5.54	5.62	5.69	5.77	5.85
	2.67%	1.20	1.28	1.36	1.44	1.51	1.59	1.67
	0.00%	(0.23)	(0.15)	(0.08)	0.00	0.08	0.15	0.23
	-2.67%	1.08	1.15	1.23	1.31	1.39	1.46	1.54
	-5.33%	5.13	5.21	5.29	5.37	5.44	5.52	5.60
	-8.00%	11.93	12.01	12.09	12.17	12.24	12.32	12.40

최대손실 시나리오

위험액	-0.23
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	2.65
-----	------

[2-2]

메리츠2Star증권KISE-1호

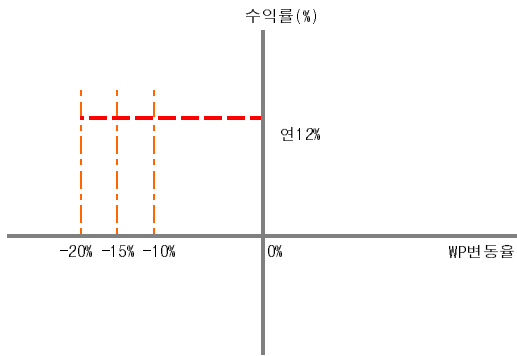
1. 계약금액

단위(백만원)

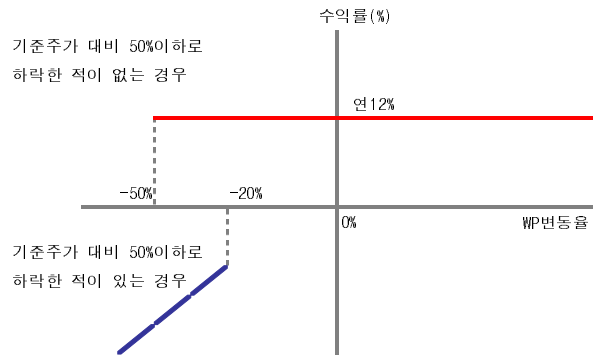
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552329WB7 우리투자증권(ELS)2730

[2-3]

메리츠2Star증권KISE-1호

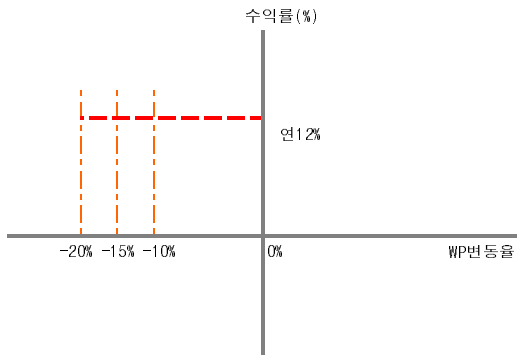
1. 계약금액

단위(백만원)

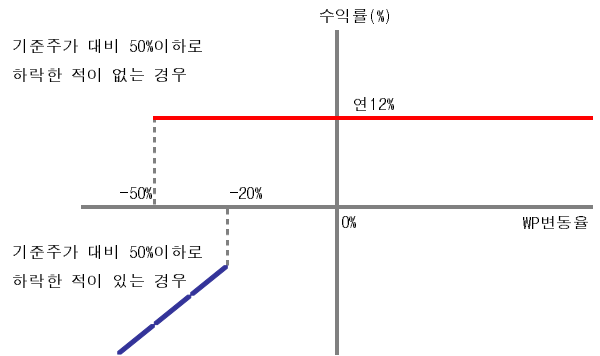
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579318WB9 한국투자증권(ELS)1411



[2-4]

메리츠2Star증권KISE-1호

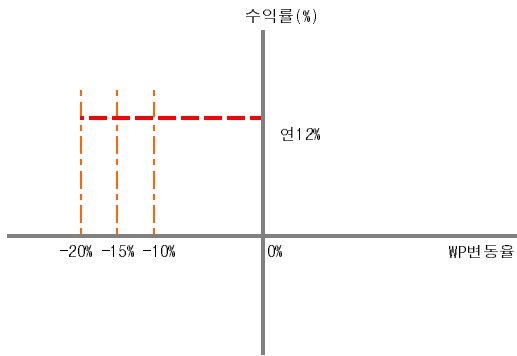
1. 계약금액

단위(백만원)

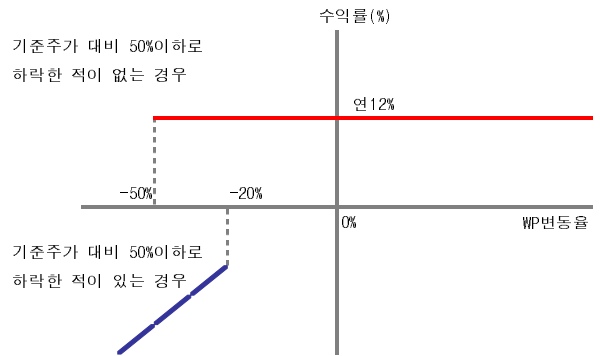
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669313WB1 동양(ELS)347

[3-1] 메리츠2Star증권KISE-2호

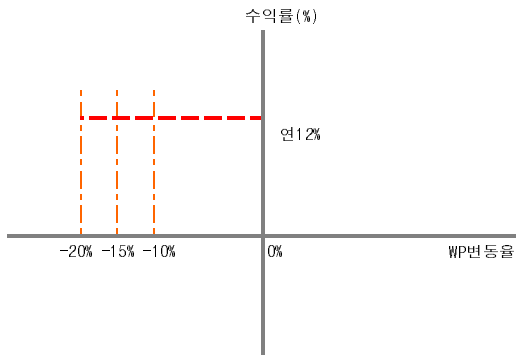
1. 계약금액

단위(백만원)

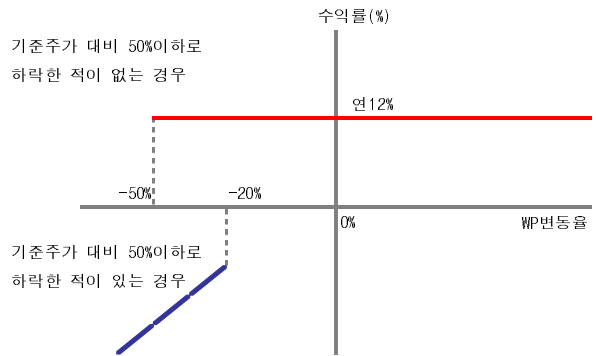
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6509318WB4 신한투자(ELS)1219

구분		변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
기초 자산 시나리오	8.00%	8.99	9.03	9.07	9.11	9.15	9.18	9.22
	5.33%	3.60	3.64	3.68	3.71	3.75	3.79	3.83
	2.67%	0.57	0.60	0.64	0.68	0.72	0.75	0.79
	0.00%	(0.11)	(0.08)	(0.04)	0.00	0.04	0.08	0.11
	-2.67%	1.57	1.60	1.64	1.68	1.72	1.75	1.79
	-5.33%	5.60	5.64	5.68	5.71	5.75	5.79	5.83
	-8.00%	11.99	12.03	12.07	12.11	12.14	12.18	12.22

최대 손실 시나리오

위험액	-0.11
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	11.10
-----	-------

[3-2]

메리츠2Star증권KISE-2호

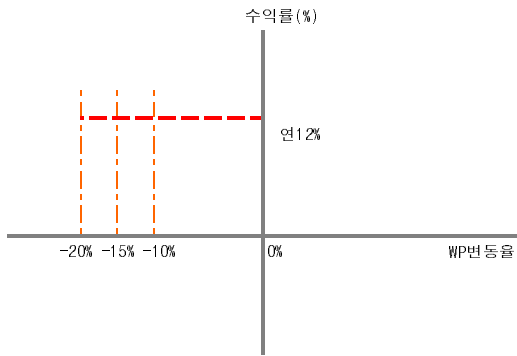
1. 계약금액

단위(백만원)

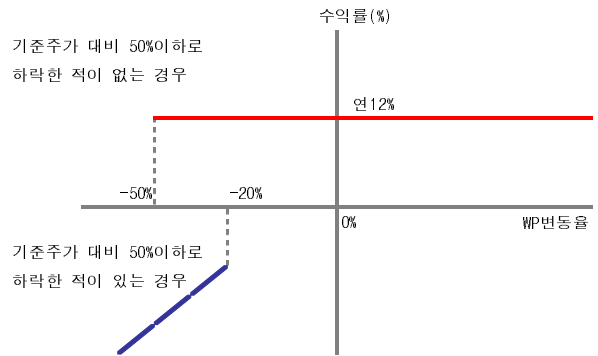
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6549319WB4 신영증권(ELS)1314

[3-3]

메리츠2Star증권KISE-2호

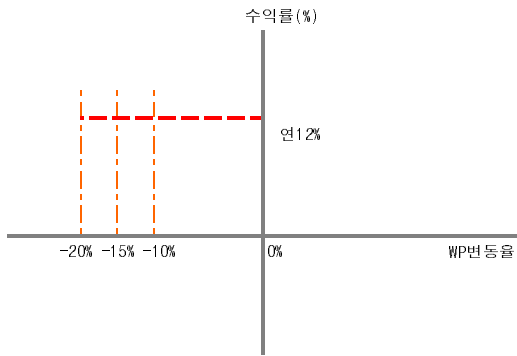
1. 계약금액

단위(백만원)

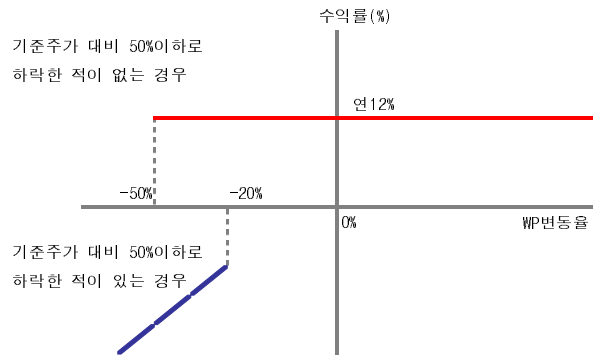
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6589315WB3 현대증권(ELS)2009-1123

[3-4]

메리츠2Star증권KISE-2호

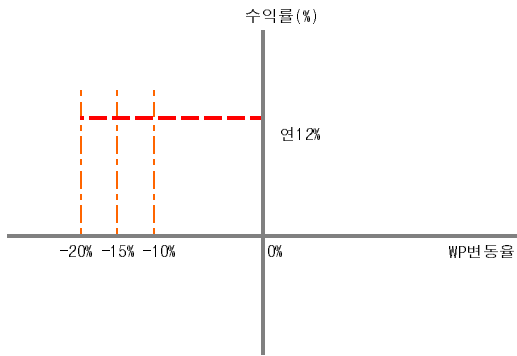
1. 계약금액

단위(백만원)

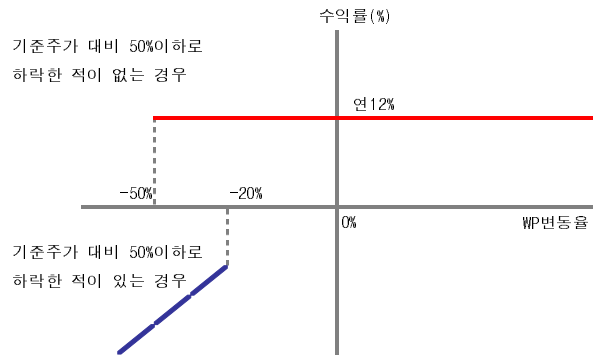
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,053	0	1,053	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669325WB5 동양(ELS)358

[4-1] 메리츠2Star증권SEPO-1호

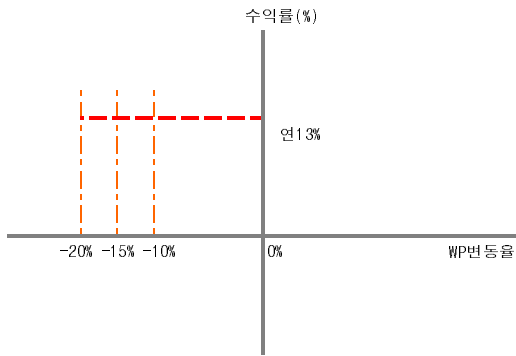
1. 계약금액

단위(백만원)

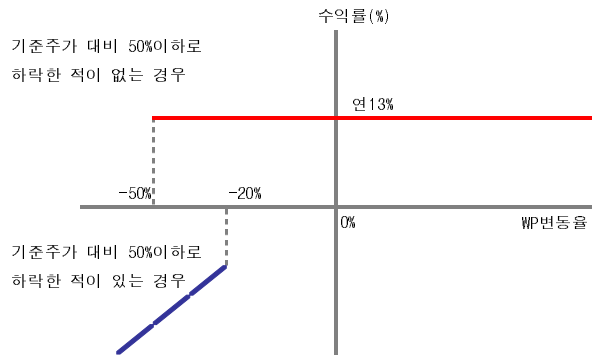
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502325W91 신한투자(ELS)1162

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
-----	------

[4-2]

메리츠2Star증권SEPO-1호

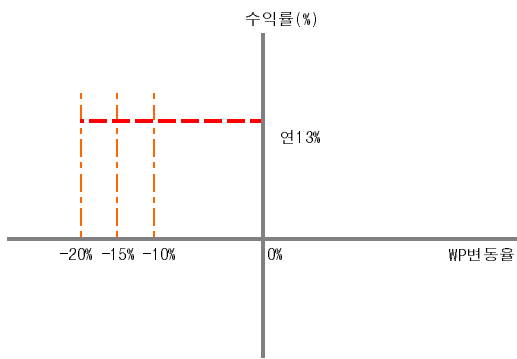
1. 계약금액

단위(백만원)

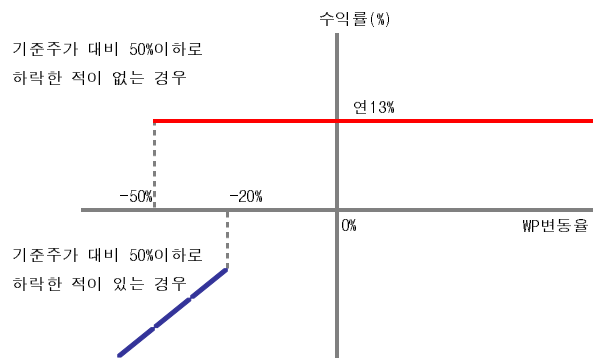
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552375W95 우리투자증권(ELS)2658

[4-3]

메리츠2Star증권SEPO-1호

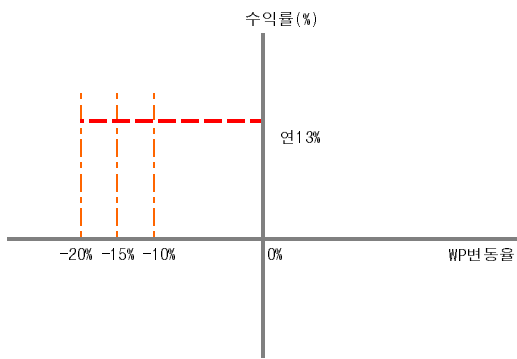
1. 계약금액

단위(백만원)

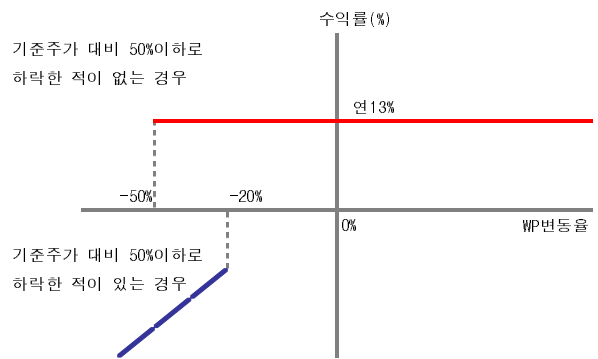
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582137W91 현대증권(ELS)2009-1092



[4-4]

메리츠2Star증권SEPO-1호

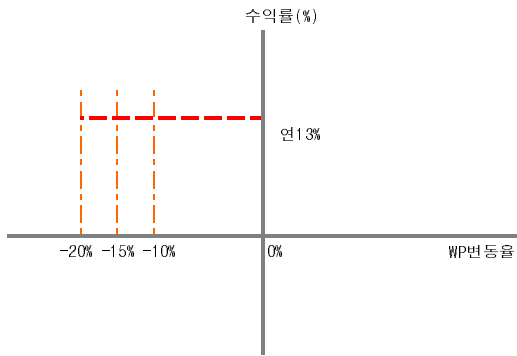
1. 계약금액

단위(백만원)

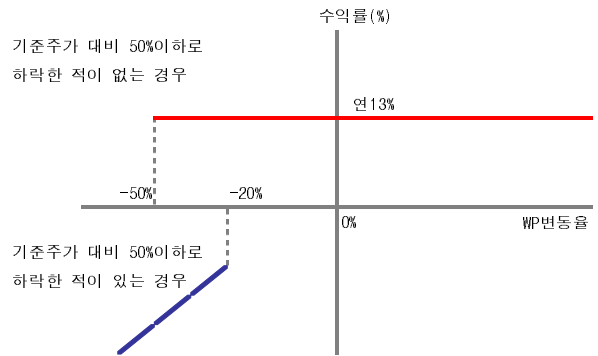
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	992	0	992	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662339W97 동양(ELS)308

[5-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

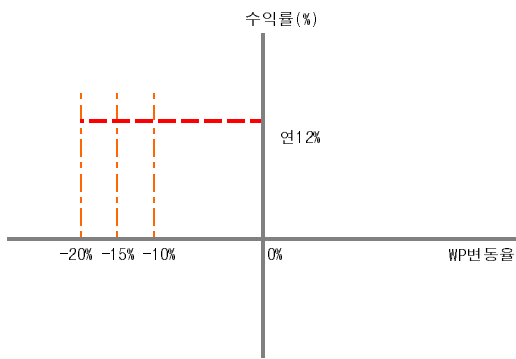
1. 계약금액

단위(백만원)

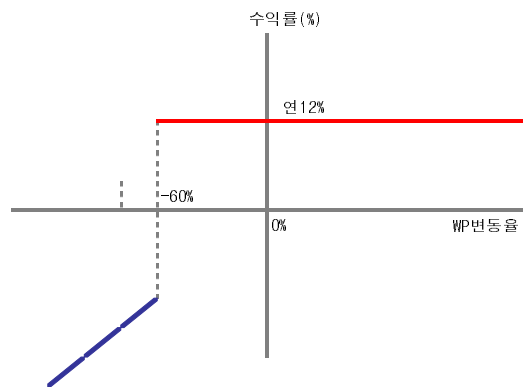
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	2.87	0.99	(0.89)	(2.77)	(4.66)	(6.54)	(8.42)
	5.33%	5.76	3.88	1.99	0.11	(1.77)	(3.65)	(5.54)
	2.67%	6.68	4.80	2.92	1.04	(0.85)	(2.73)	(4.61)
	0.00%	5.65	3.77	1.88	0.00	(1.88)	(3.77)	(5.65)
	-2.67%	2.65	0.77	(1.11)	(3.00)	(4.88)	(6.76)	(8.65)
	-5.33%	(2.31)	(4.19)	(6.07)	(7.96)	(9.84)	(11.72)	(13.60)
	-8.00%	(9.23)	(11.11)	(12.99)	(14.88)	(16.76)	(18.64)	(20.52)

최대손실 시나리오

위험액	-20.52
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	14.33
-----	-------

[5-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

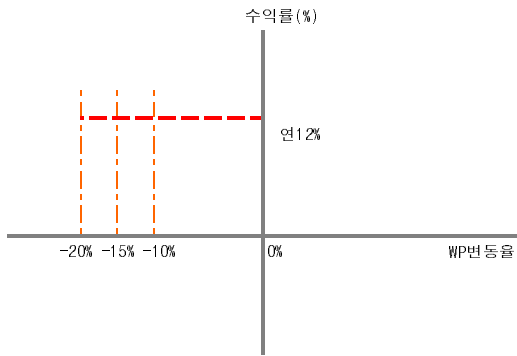
1. 계약금액

단위(백만원)

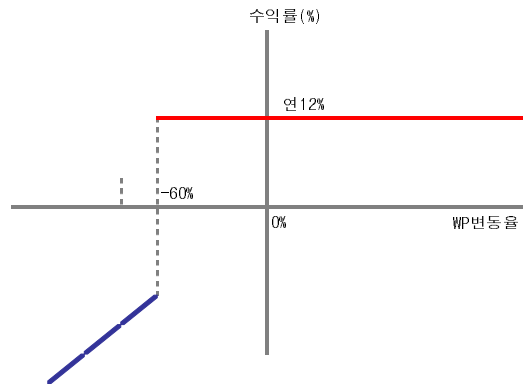
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[5-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

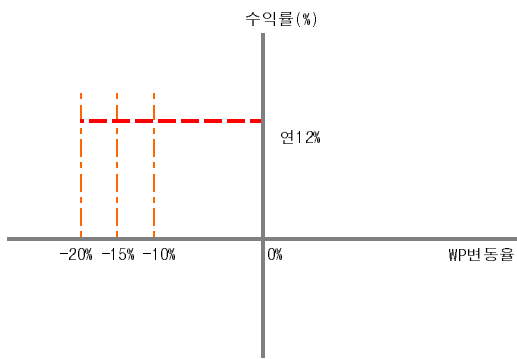
1. 계약금액

단위(백만원)

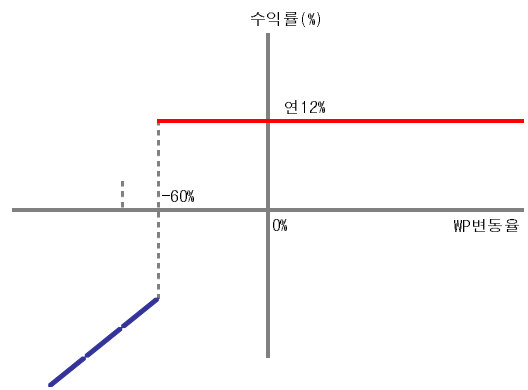
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[5-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

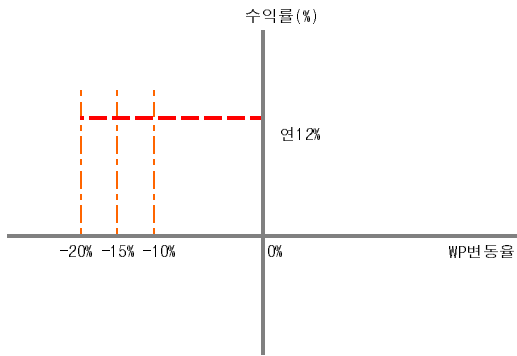
1. 계약금액

단위(백만원)

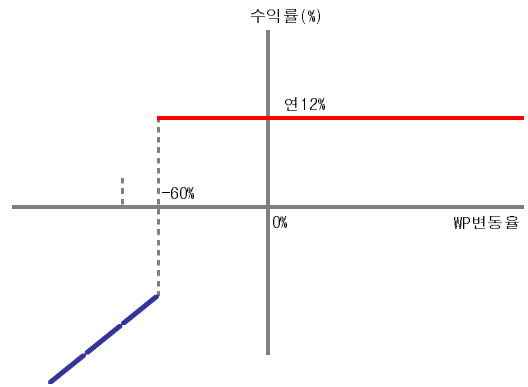
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

[6-1] 메리츠2Star증권SEWF-1호

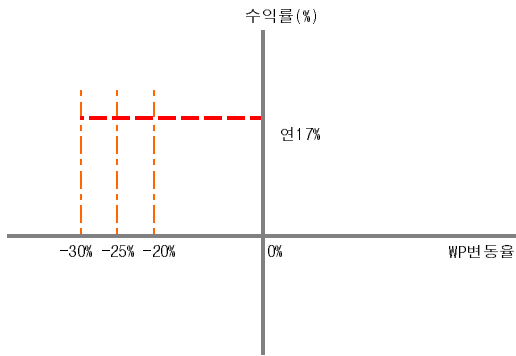
1. 계약금액

단위(백만원)

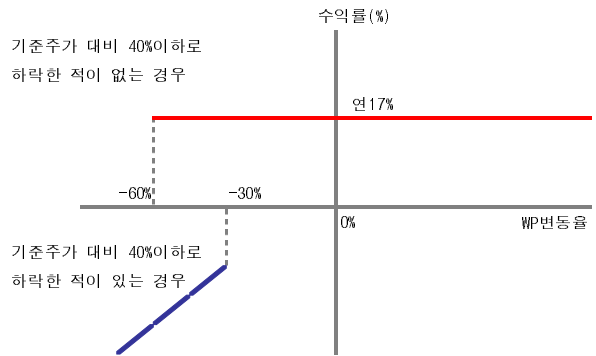
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502301WB7 신한투자(ELS)1206

구분	변동성 시나리오							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%	
기초 자산 시나리오	8.00%	145.62	113.61	81.61	49.60	17.60	(14.40)	(46.41)
	5.33%	140.58	108.57	76.57	44.56	12.56	(19.45)	(51.45)
	2.67%	124.04	92.04	60.03	28.03	(3.98)	(35.98)	(67.98)
	0.00%	96.01	64.01	32.00	0.00	(32.00)	(64.01)	(96.01)
	-2.67%	56.49	24.49	(7.52)	(39.52)	(71.52)	(103.53)	(135.53)
	-5.33%	5.48	(26.53)	(58.53)	(90.53)	(122.54)	(154.54)	(186.55)
	-8.00%	(57.03)	(89.03)	(121.04)	(153.04)	(185.04)	(217.05)	(249.05)

최대손실 시나리오

위험액	-249.05
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	233.10
-----	--------

[6-2]

메리츠2Star증권SEWF-1호

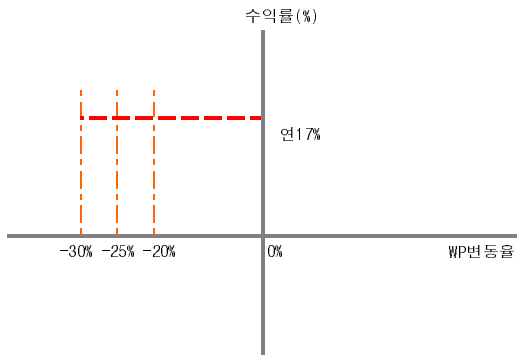
1. 계약금액

단위(백만원)

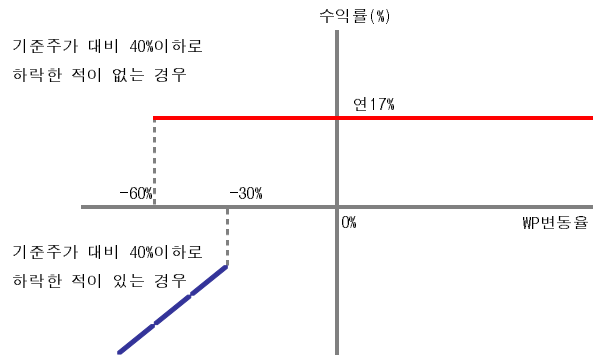
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733

[6-3]

메리츠2Star증권SEWF-1호

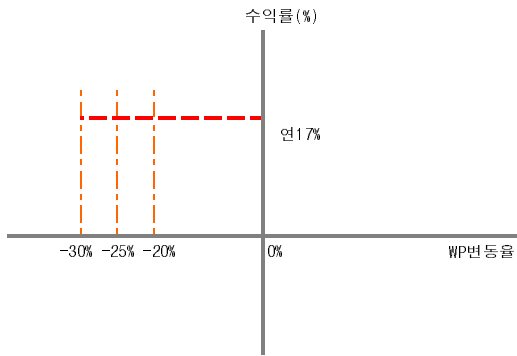
1. 계약금액

단위(백만원)

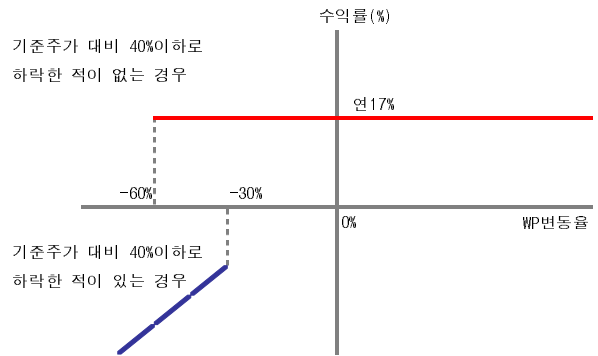
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343



[6-4]

메리츠2Star증권SEWF-1호

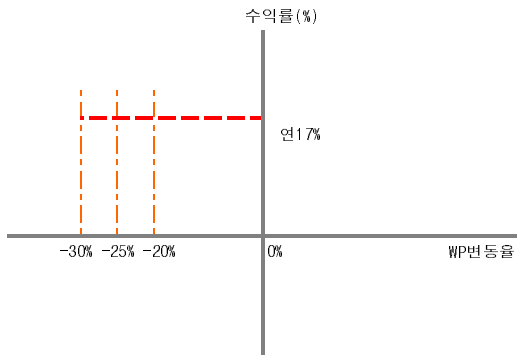
1. 계약금액

단위(백만원)

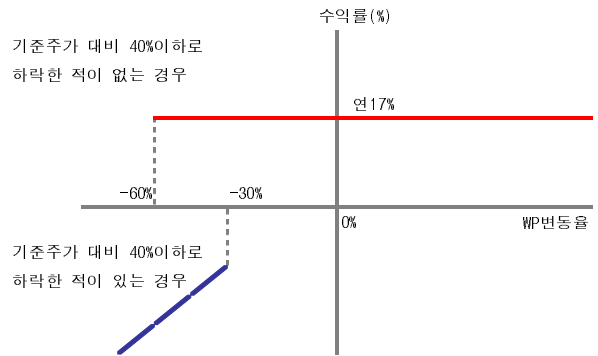
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

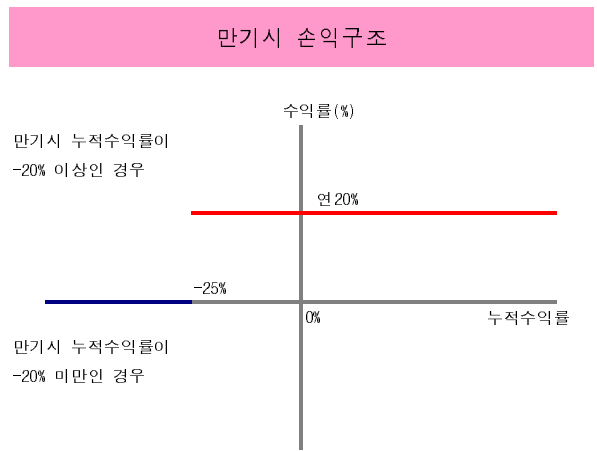
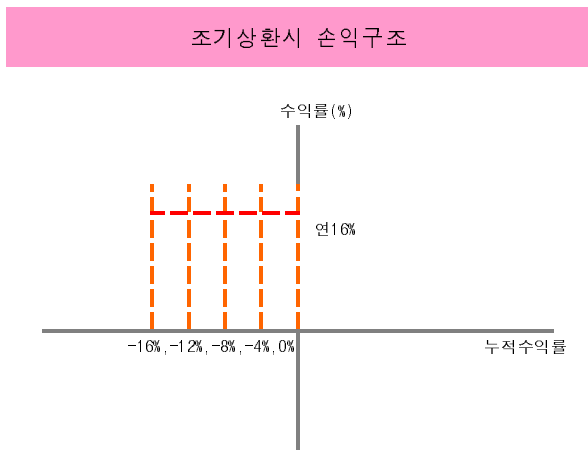
[7] 메리츠클리켓 단위 파생3호

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
-----	------

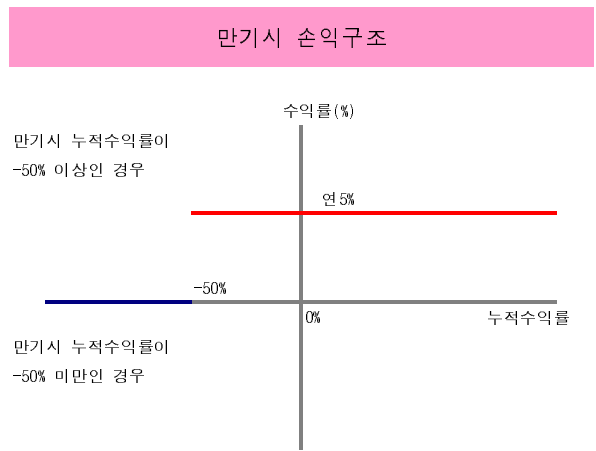
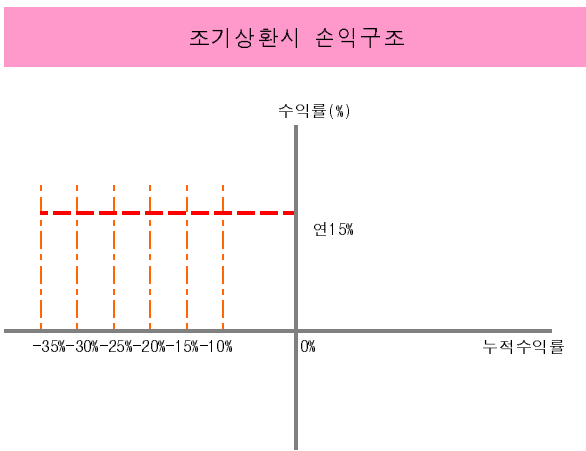
[8] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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
-----	------

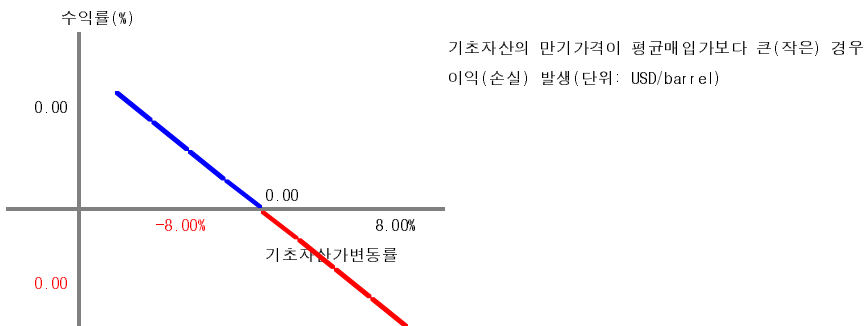
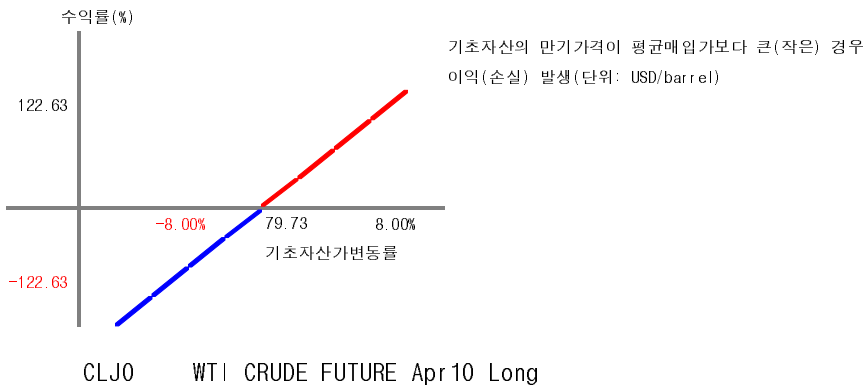
[9] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

1. 계약금액

단위(백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	선물	19	0	19	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	122.63
	5.33%	81.70
	2.67%	40.93
	0.00%	0.00
	-2.67%	-40.93
	-5.33%	-81.70
	-8.00%	-122.63

최대손실 시나리오	
위험액	-122.63

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	497
-----	-----

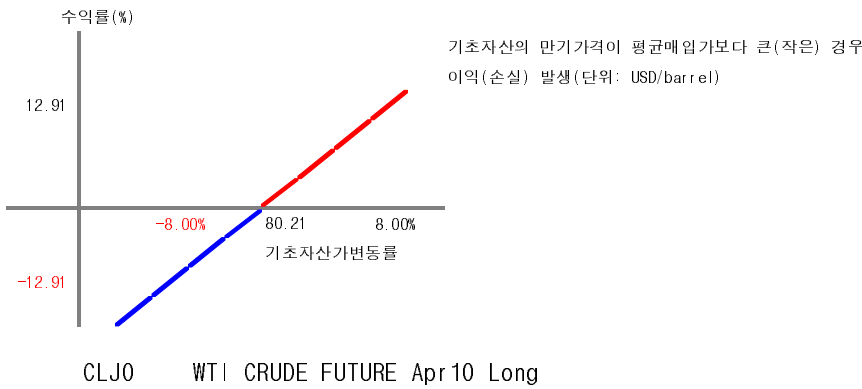
[10] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

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



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	12.91
	5.33%	8.60
	2.67%	4.31
	0.00%	0.00
	-2.67%	-4.31
	-5.33%	-8.60
	-8.00%	-12.91

최대손실 시나리오	
위험액	-12.91

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	51
-----	----

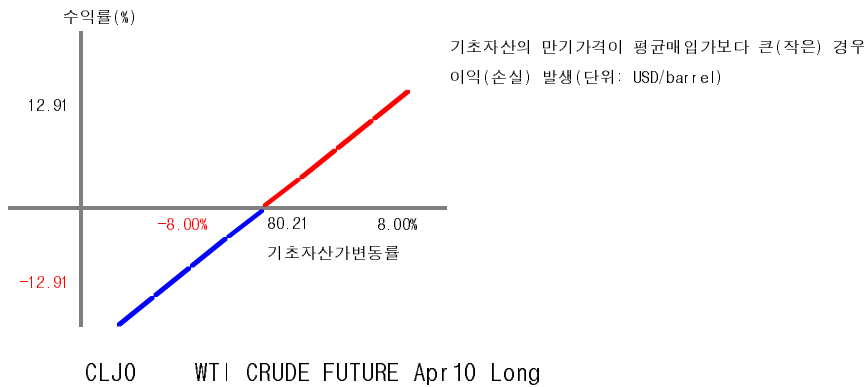
[11-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



3. 손익구조변동(최대 손실 가능금액(단위:1000USD))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	42.01
	5.33%	27.99
	2.67%	14.02
	0.00%	0.00
	-2.67%	-14.02
	-5.33%	-27.99
	-8.00%	-42.01

최대손실 시나리오	
위험액	-42.01

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	167
-----	-----

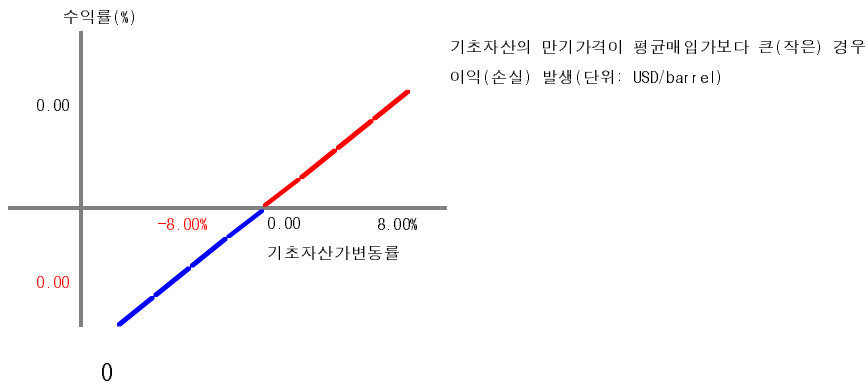
[11-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



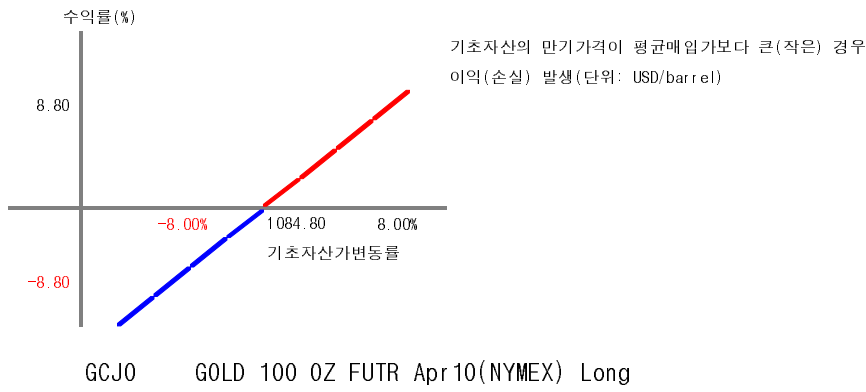
[11-3] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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





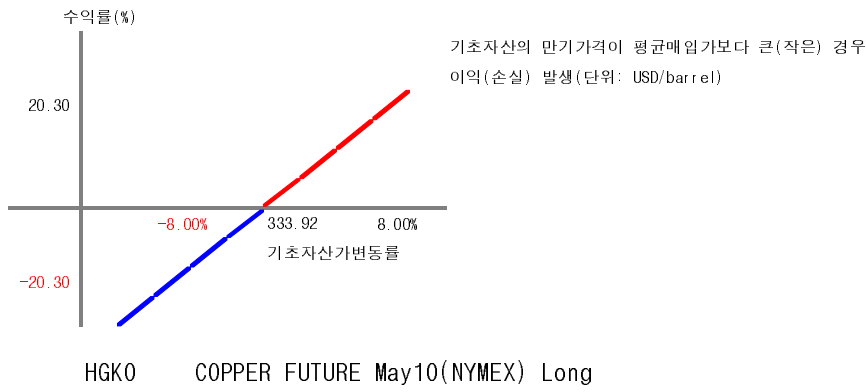
[11-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



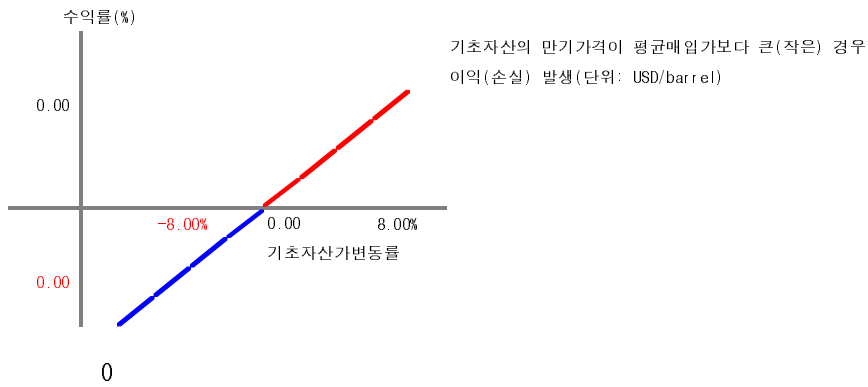
[11-5] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



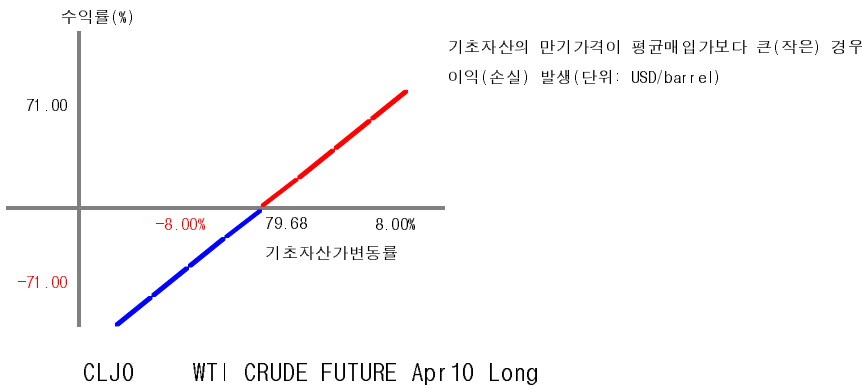
[12] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초 자산 시나리오	8.00%	71.00
	5.33%	47.30
	2.67%	23.70
	0.00%	0.00
	-2.67%	-23.70
	-5.33%	-47.30
	-8.00%	-71.00

최대손실 시나리오	
위험액	-71.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	267
-----	-----

[13-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

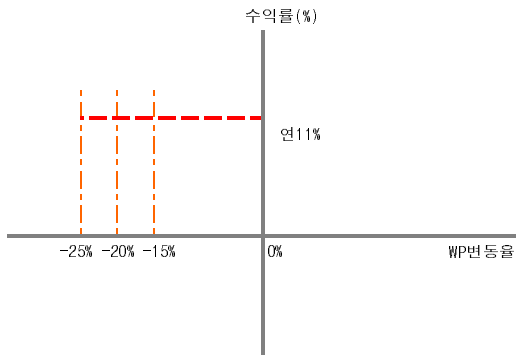
1. 계약금액

단위(백만원)

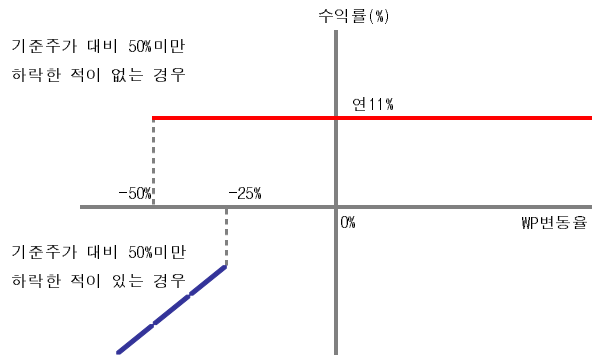
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

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%	19.08	15.45	11.83	8.20	4.58	0.96	(2.67)
	5.33%	18.42	14.80	11.18	7.55	3.93	0.30	(3.32)
	2.67%	15.69	12.07	8.44	4.82	1.19	(2.43)	(6.05)
	0.00%	10.87	7.25	3.62	0.00	(3.62)	(7.25)	(10.87)
	-2.67%	3.97	0.35	(3.28)	(6.90)	(10.52)	(14.15)	(17.77)
	-5.33%	(5.01)	(8.64)	(12.26)	(15.88)	(19.51)	(23.13)	(26.76)
	-8.00%	(16.08)	(19.70)	(23.33)	(26.95)	(30.58)	(34.20)	(37.82)

최대손실 시나리오

위험액	-37.82
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	32.88
-----	-------

[13-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

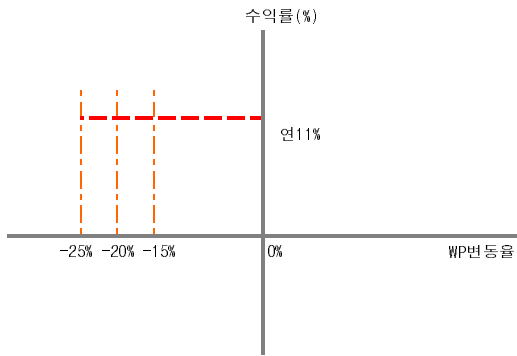
1. 계약금액

단위(백만원)

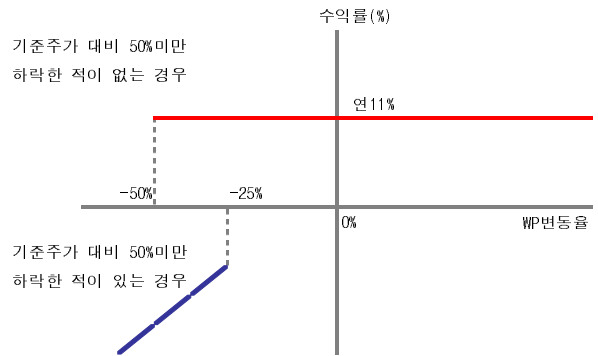
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

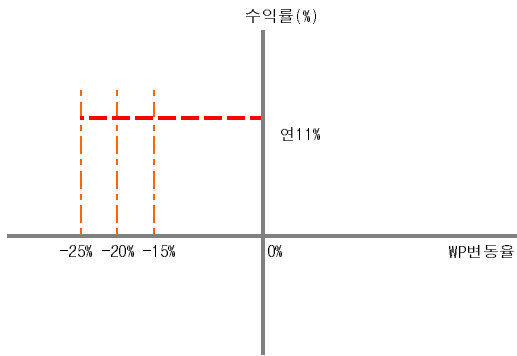
1. 계약금액

단위(백만원)

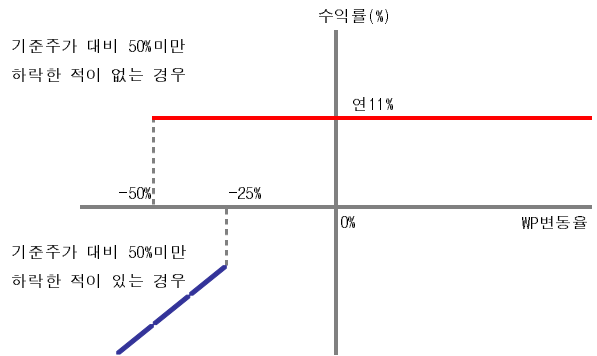
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

[13-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

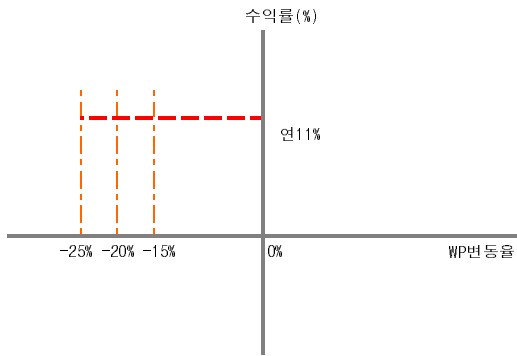
1. 계약금액

단위(백만원)

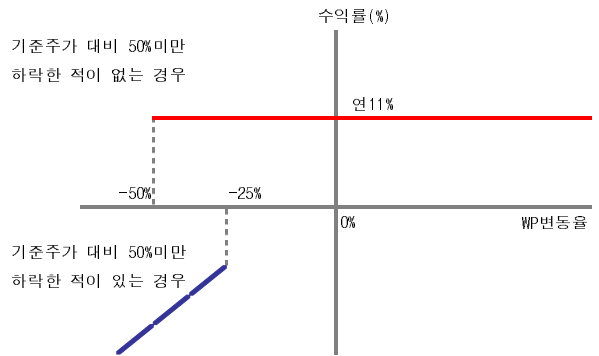
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[14-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

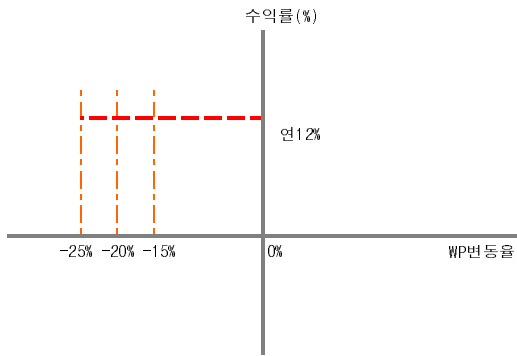
1. 계약금액

단위(백만원)

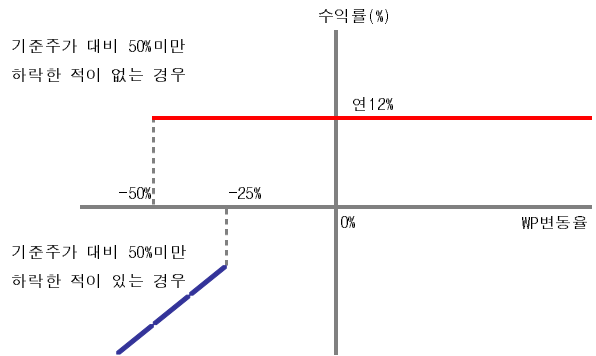
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

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%	26.37	21.23	16.08	10.94	5.79	0.65	(4.50)
	5.33%	25.71	20.57	15.42	10.28	5.13	(0.01)	(5.16)
	2.67%	22.07	16.92	11.78	6.63	1.49	(3.66)	(8.80)
	0.00%	15.44	10.29	5.15	0.00	(5.15)	(10.29)	(15.44)
	-2.67%	5.82	0.68	(4.47)	(9.61)	(14.76)	(19.90)	(25.05)
	-5.33%	(6.78)	(11.92)	(17.07)	(22.21)	(27.36)	(32.50)	(37.65)
	-8.00%	(22.36)	(27.51)	(32.65)	(37.80)	(42.94)	(48.09)	(53.23)

최대손실 시나리오

위험액	-53.23
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	41.96
-----	-------



[14-2]

메리츠한중지수연계증권제3호

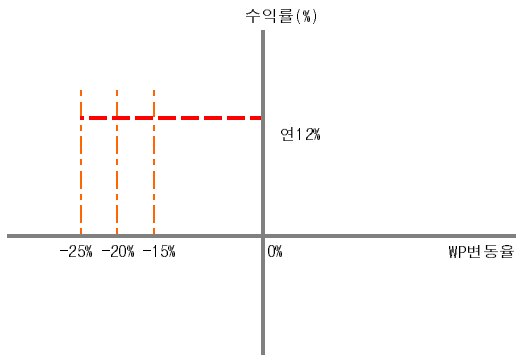
1. 계약금액

단위(백만원)

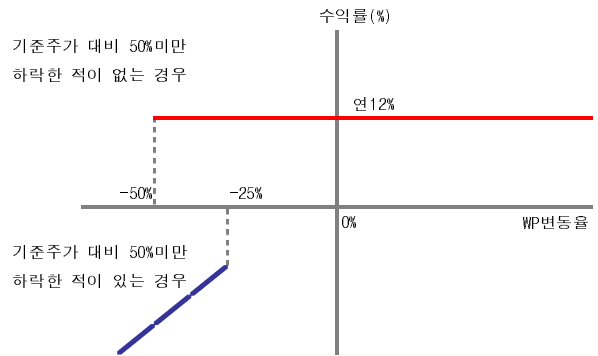
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[14-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

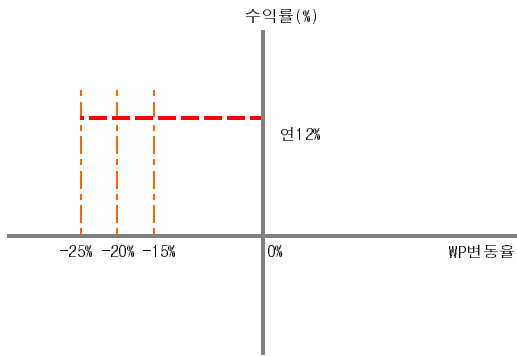
1. 계약금액

단위(백만원)

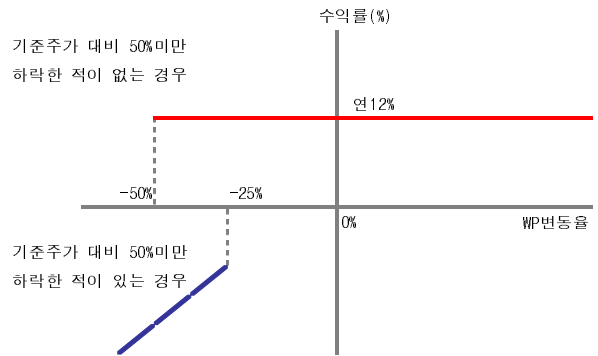
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[14-4] 메리츠한중지수연계증권제3호

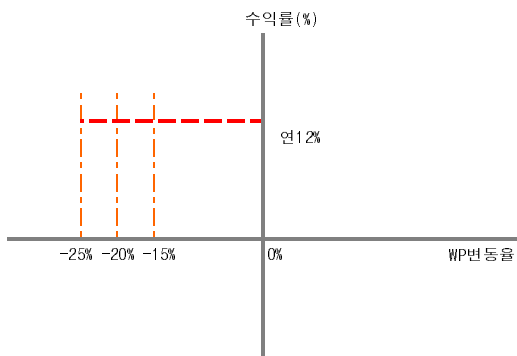
1. 계약금액

단위(백만원)

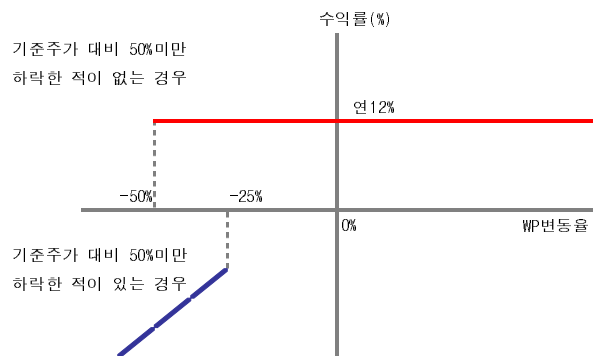
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[15-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

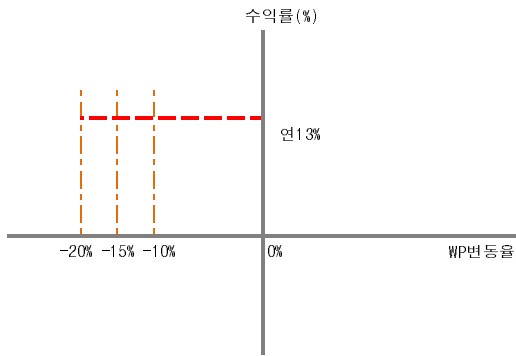
1. 계약금액

단위(백만원)

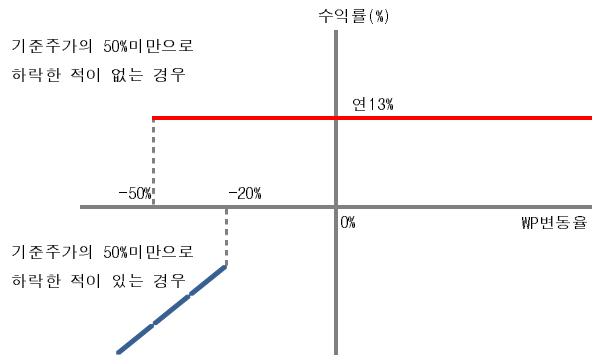
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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%	9.26	8.14	7.02	5.90	4.78	3.66	2.54
	5.33%	2.37	1.25	0.13	(0.99)	(2.11)	(3.23)	(4.35)
	2.67%	0.41	(0.71)	(1.84)	(2.96)	(4.08)	(5.20)	(6.32)
	0.00%	3.36	2.24	1.12	0.00	(1.12)	(2.24)	(3.36)
	-2.67%	11.24	10.12	9.00	7.88	6.76	5.64	4.52
	-5.33%	24.05	22.92	21.80	20.68	19.56	18.44	17.32
	-8.00%	41.77	40.65	39.53	38.41	37.29	36.17	35.04

최대손실 시나리오

위험액	-6.32
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	33.01
-----	-------

[15-2] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

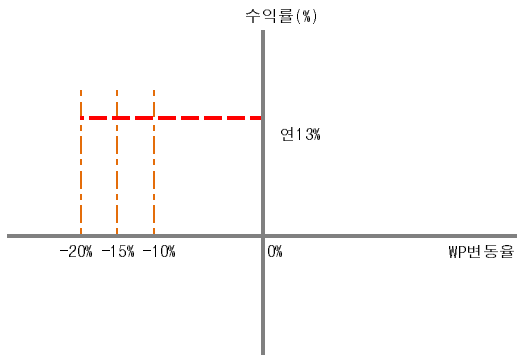
1. 계약금액

단위(백만원)

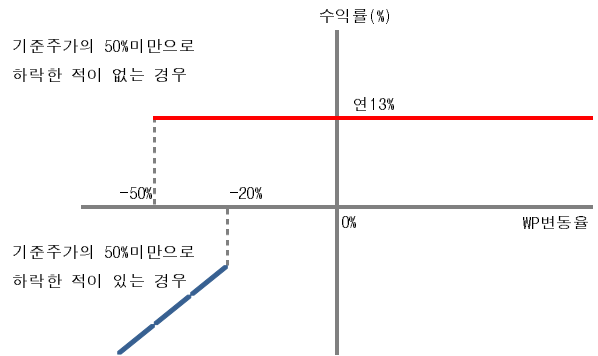
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[15-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

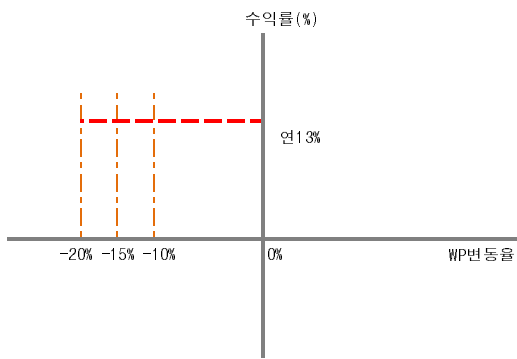
1. 계약금액

단위(백만원)

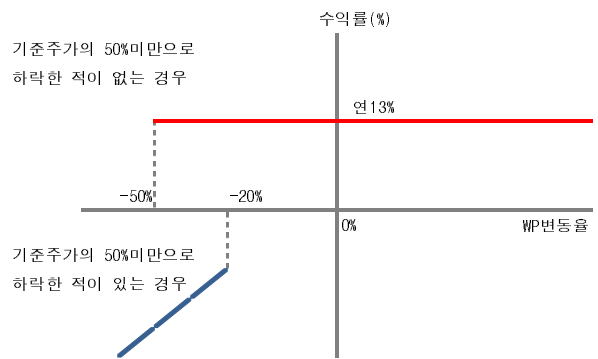
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[15-4] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

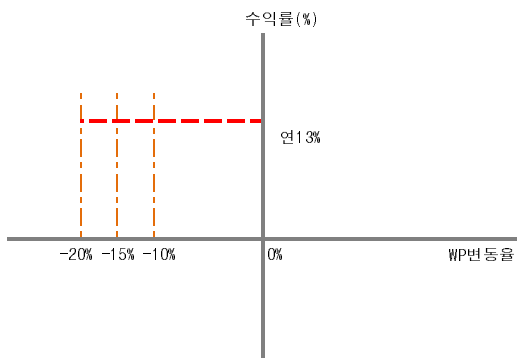
1. 계약금액

단위(백만원)

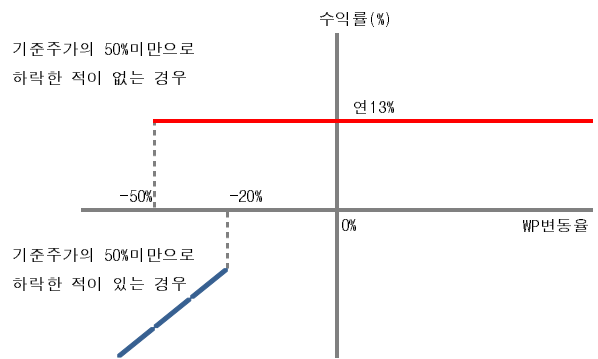
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703338014 H&D증권(ELS)431

[16-1] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

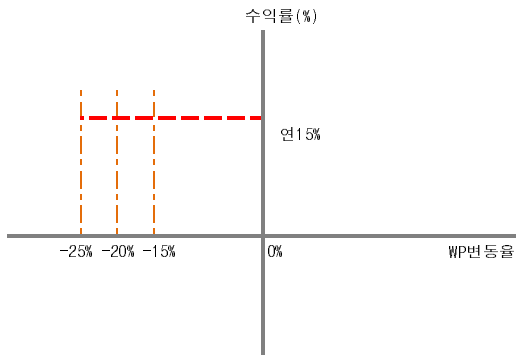
1. 계약금액

단위(백만원)

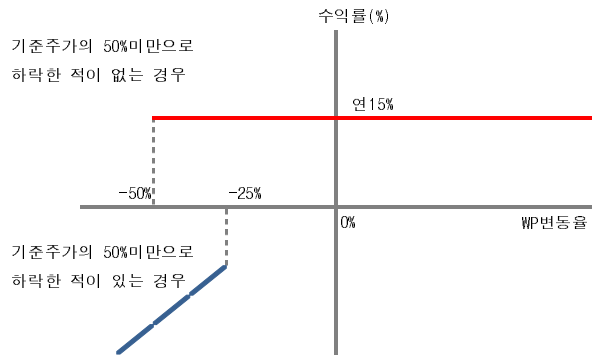
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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%	126.06	102.30	78.55	54.79	31.03	7.28	(16.48)
	5.33%	110.79	87.03	63.28	39.52	15.76	(8.00)	(31.75)
	2.67%	92.53	68.77	45.01	21.26	(2.50)	(26.26)	(50.02)
	0.00%	71.27	47.51	23.76	0.00	(23.76)	(47.51)	(71.27)
	-2.67%	47.02	23.27	(0.49)	(24.25)	(48.00)	(71.76)	(95.52)
	-5.33%	19.78	(3.97)	(27.73)	(51.49)	(75.24)	(99.00)	(122.76)
	-8.00%	(10.45)	(34.21)	(57.96)	(81.72)	(105.48)	(129.23)	(152.99)

최대손실 시나리오

위험액	-152.99
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	133.66
-----	--------



[16-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

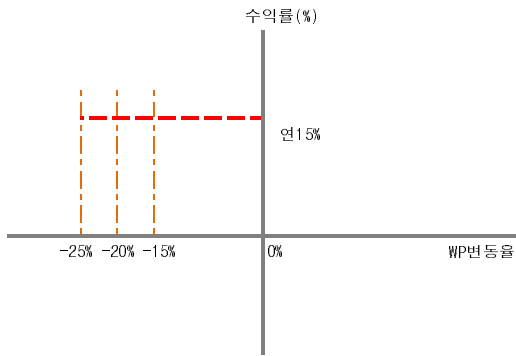
1. 계약금액

단위(백만원)

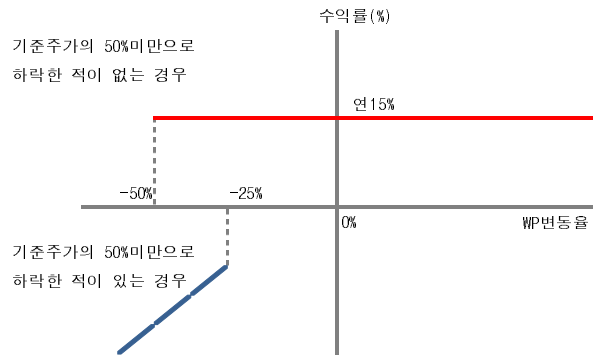
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[16-3]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

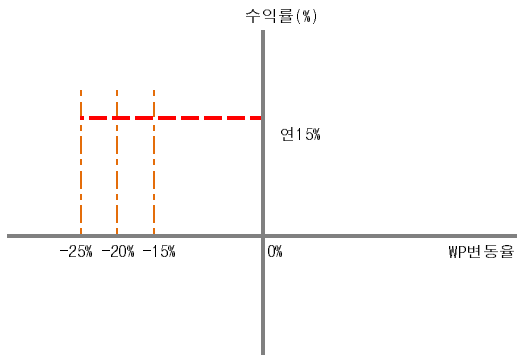
1. 계약금액

단위(백만원)

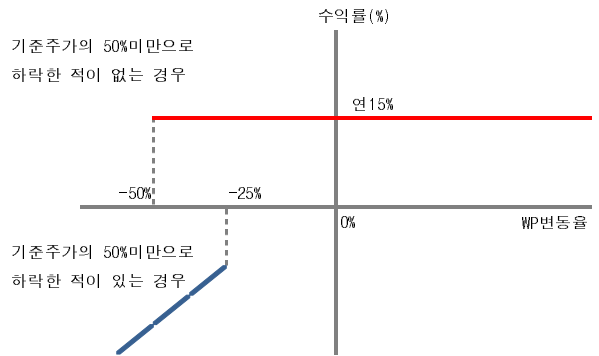
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[16-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

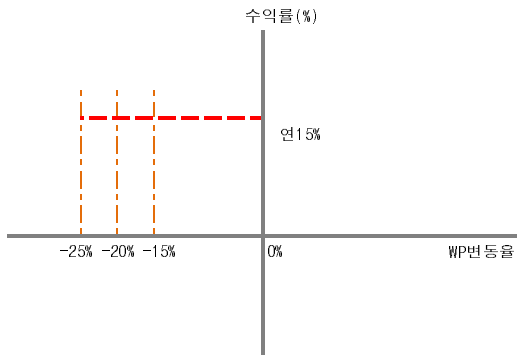
1. 계약금액

단위(백만원)

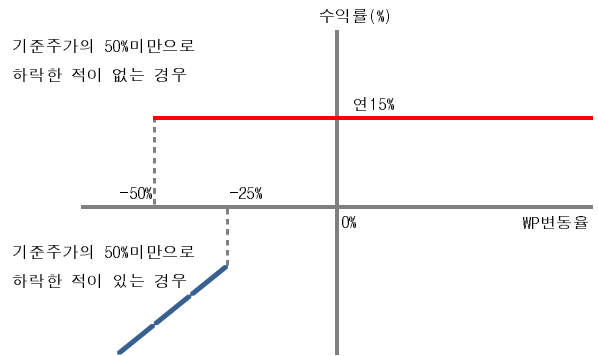
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[17-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

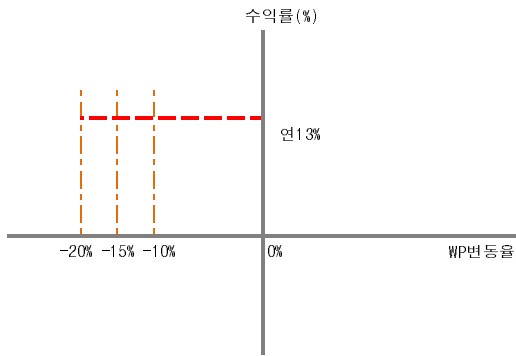
1. 계약금액

단위(백만원)

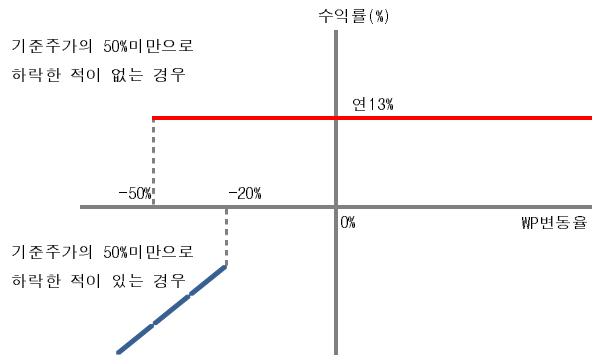
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513101032 대신증권(ELS)993

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	66.63	51.27	35.92	20.57	5.22	(10.14)	(25.49)
	5.33%	64.25	48.90	33.55	18.20	2.84	(12.51)	(27.86)
	2.67%	57.40	42.05	26.69	11.34	(4.01)	(19.37)	(34.72)
	0.00%	46.06	30.71	15.35	0.00	(15.35)	(30.71)	(46.06)
	-2.67%	30.24	14.88	(0.47)	(15.82)	(31.18)	(46.53)	(61.88)
	-5.33%	9.93	(5.42)	(20.78)	(36.13)	(51.48)	(66.84)	(82.19)
	-8.00%	(14.86)	(30.22)	(45.57)	(60.92)	(76.27)	(91.63)	(106.98)

최대손실 시나리오

위험액	-106.98
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	106.14
-----	--------

[17-2]

메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

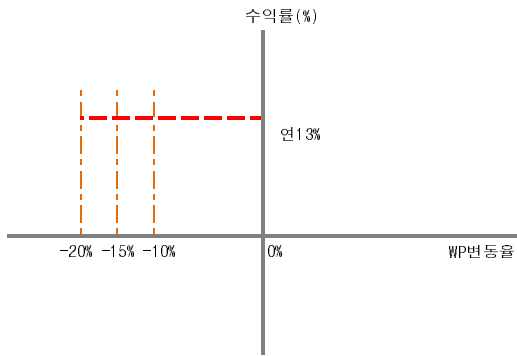
1. 계약금액

단위(백만원)

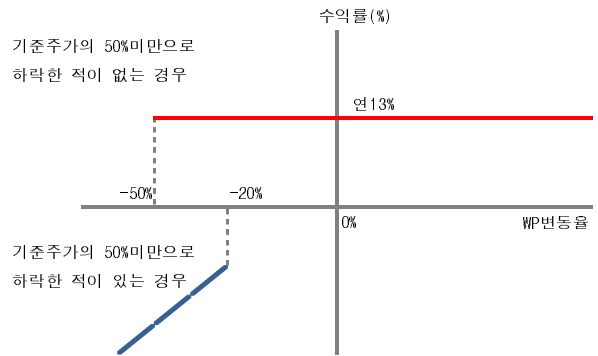
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[17-3] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

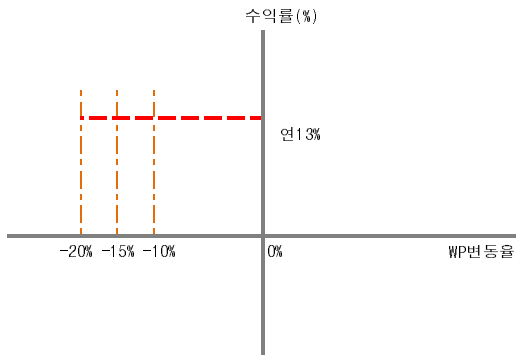
1. 계약금액

단위(백만원)

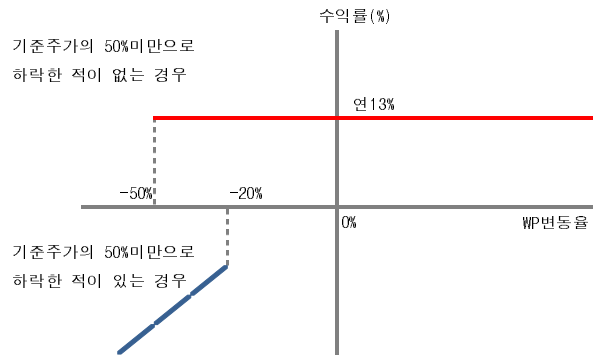
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[17-4] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

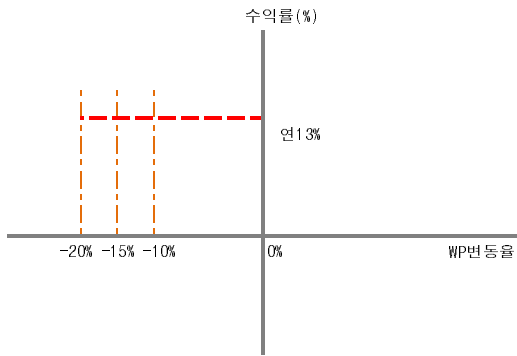
1. 계약금액

단위(백만원)

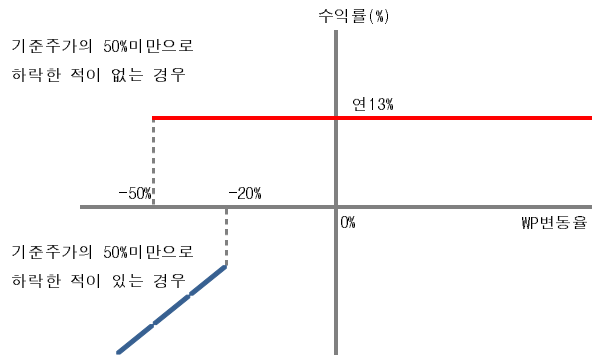
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504