

## 파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권KGSH-1호

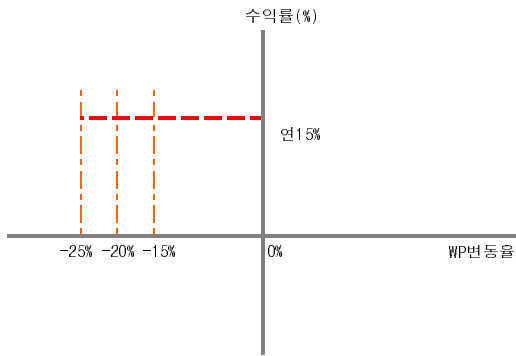
1. 계약금액

단위(백만원)

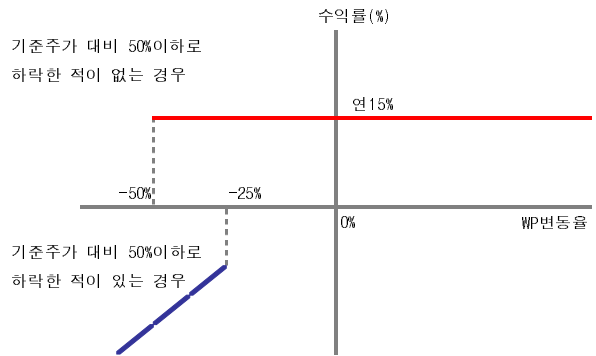
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

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 시나 리오	8.00%	80.52	67.25	53.99	40.72	27.45	14.19	0.92
	5.33%	79.36	66.09	52.83	39.56	26.29	13.03	(0.24)
	2.67%	65.79	52.52	39.25	25.99	12.72	(0.55)	(13.81)
	0.00%	39.80	26.53	13.27	0.00	(13.27)	(26.53)	(39.80)
	-2.67%	1.40	(11.87)	(25.14)	(38.40)	(51.67)	(64.94)	(78.20)
	-5.33%	(49.42)	(62.69)	(75.95)	(89.22)	(102.49)	(115.75)	(129.02)
	-8.00%	(112.65)	(125.92)	(139.18)	(152.45)	(165.72)	(178.98)	(192.25)

최대손실 시나리오

위험액	-192.25
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	203.45
-----	--------

[1-2]

메리츠2Star증권KGSH-1호

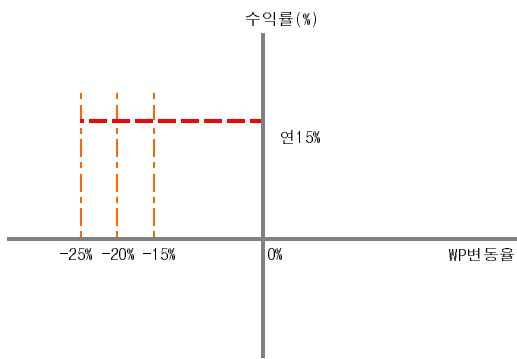
1. 계약금액

단위(백만원)

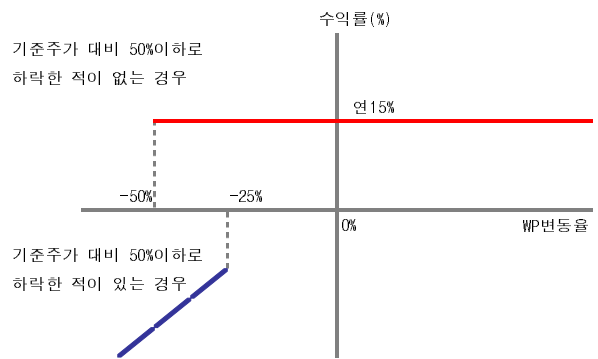
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[1-3]

메리츠2Star증권KGSH-1호

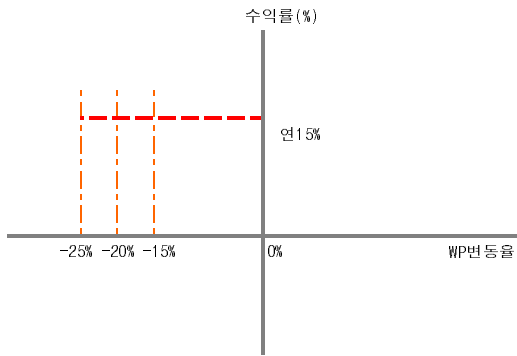
1. 계약금액

단위(백만원)

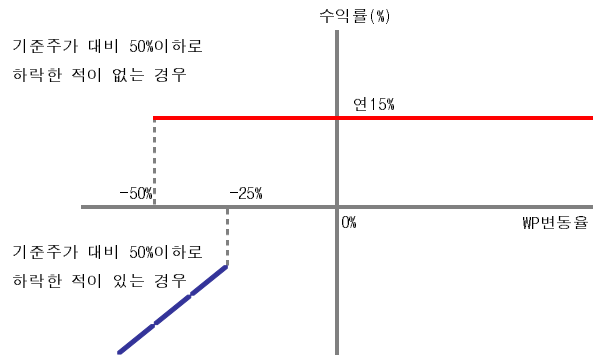
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

[1-4]

메리츠2Star증권KGSH-1호

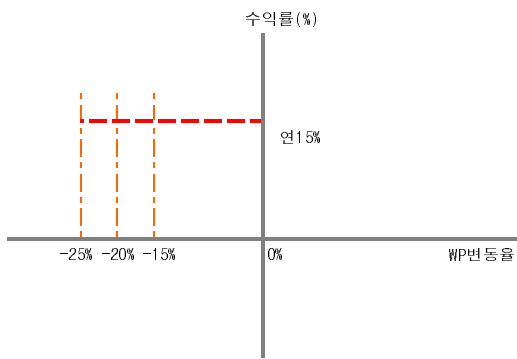
1. 계약금액

단위(백만원)

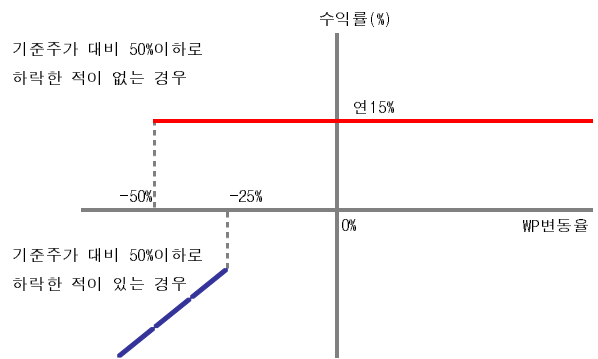
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	865	0	865	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[2-1] 메리츠2Star증권KISE-1호

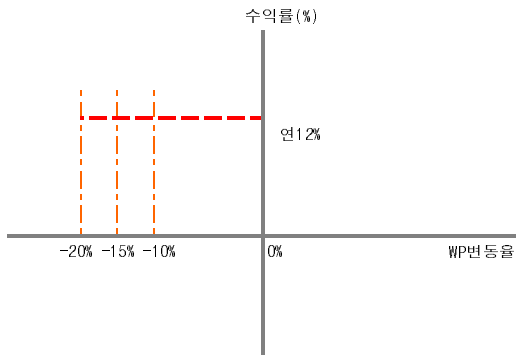
1. 계약금액

단위(백만원)

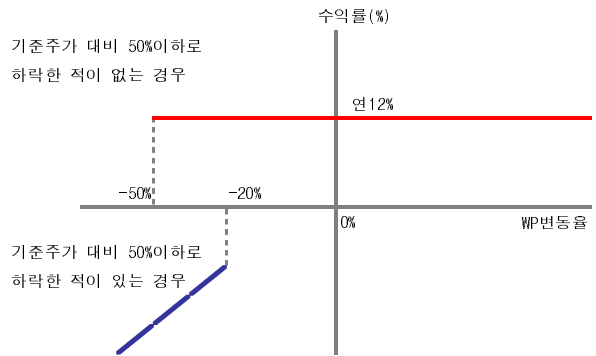
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

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%	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11
	5.33%	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05
	2.67%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
	-5.33%	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05
	-8.00%	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11

최대손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.00
-----	------

[2-2]

메리츠2Star증권KISE-1호

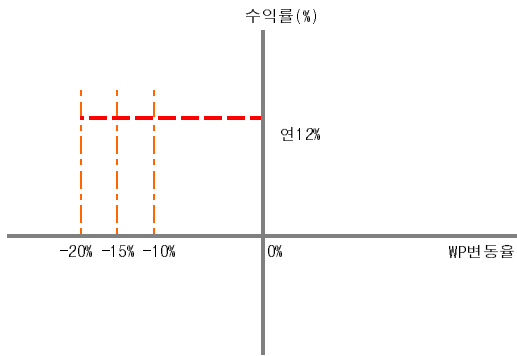
1. 계약금액

단위(백만원)

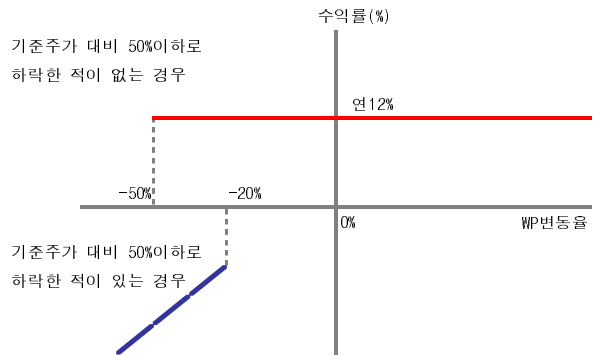
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552329WB7 우리투자증권(ELS)2730

[2-3]

메리츠2Star증권KISE-1호

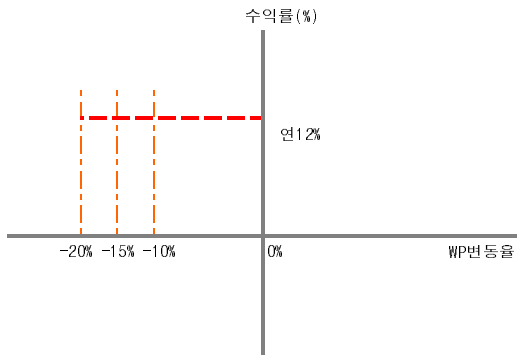
1. 계약금액

단위(백만원)

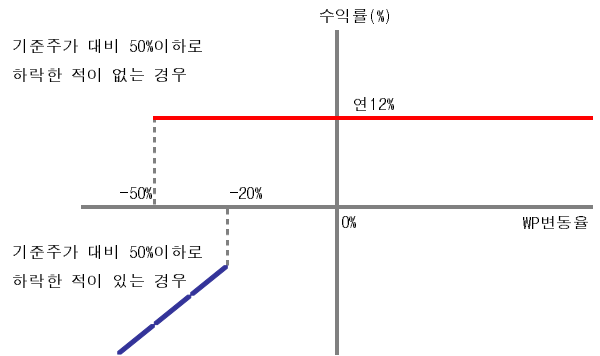
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579318WB9 한국투자증권(ELS)1411



[2-4]

메리츠2Star증권KISE-1호

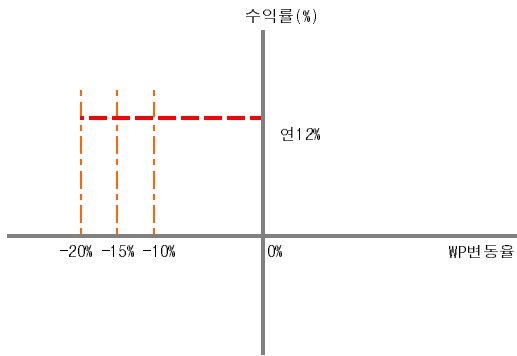
1. 계약금액

단위(백만원)

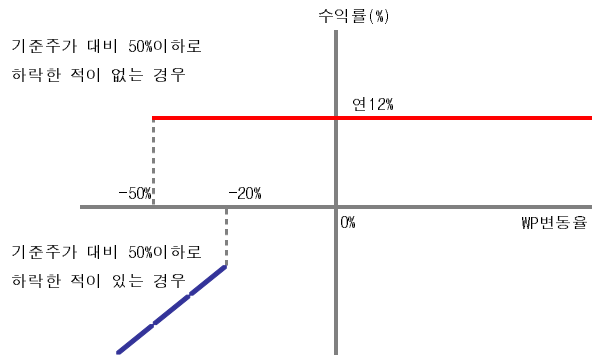
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	2,418	0	2,418	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669313WB1 동양(ELS)347

[3-1] 메리츠2Star증권KISE-2호

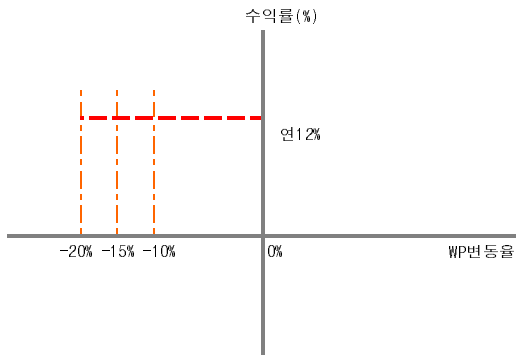
1. 계약금액

단위(백만원)

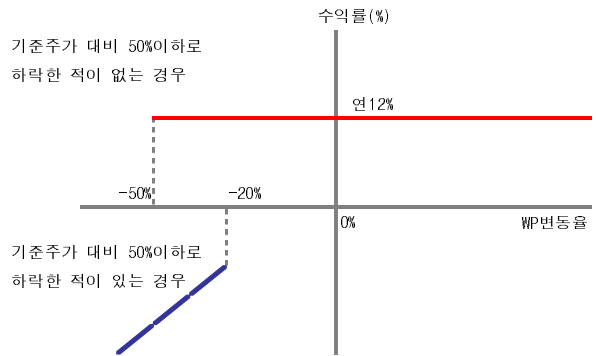
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

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%	0.46	0.46	0.46	0.46	0.46	0.46	0.46
	5.33%	0.20	0.20	0.20	0.20	0.20	0.20	0.20
	2.67%	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05	0.05
	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-2.67%	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06	0.06
	-5.33%	0.23	0.23	0.23	0.23	0.23	0.23	0.23
	-8.00%	0.51	0.51	0.51	0.51	0.51	0.51	0.51

최대 손실 시나리오

위험액	0.00
-----	------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.14
-----	------

[3-2]

메리츠2Star증권KISE-2호

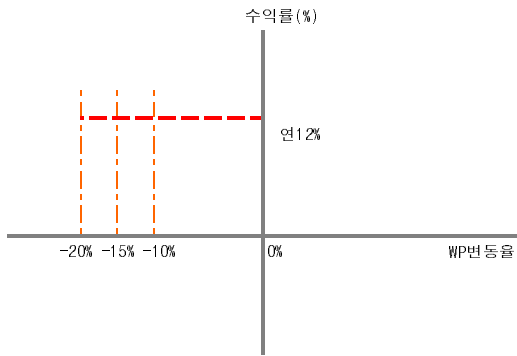
1. 계약금액

단위(백만원)

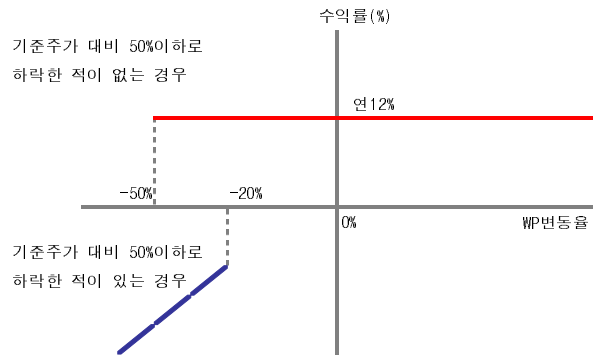
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6549319WB4 신영증권(ELS)1314

[3-3]

메리츠2Star증권KISE-2호

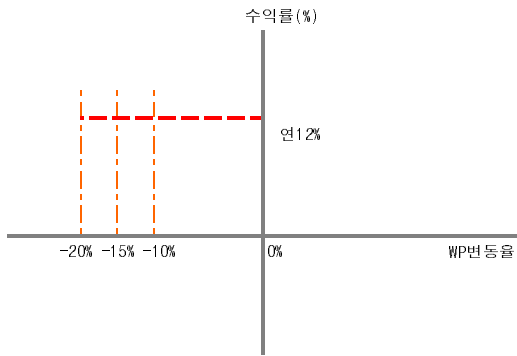
1. 계약금액

단위(백만원)

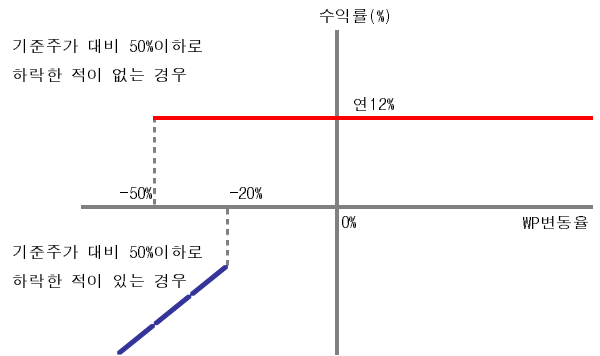
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,093	0	1,093	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589315WB3 현대증권(ELS)2009-1123

[3-4]

메리츠2Star증권KISE-2호

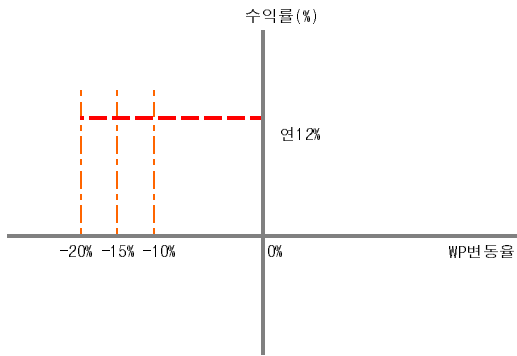
1. 계약금액

단위(백만원)

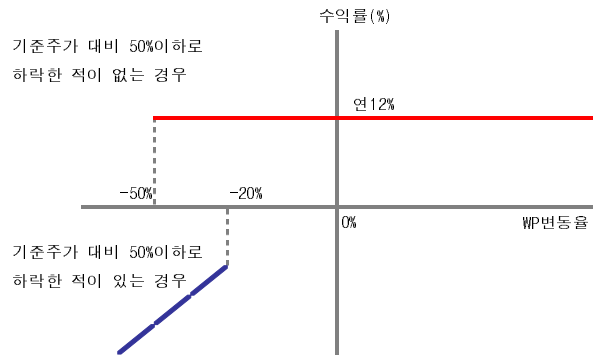
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,053	0	1,053	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669325WB5 동양(ELS)358

[4-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

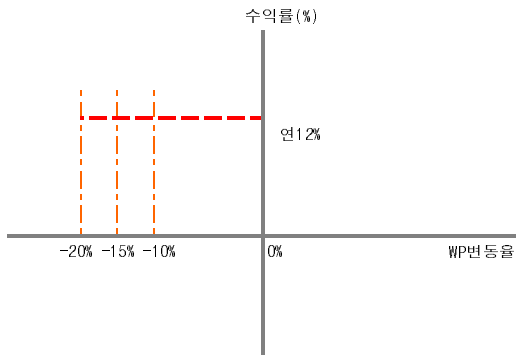
1. 계약금액

단위(백만원)

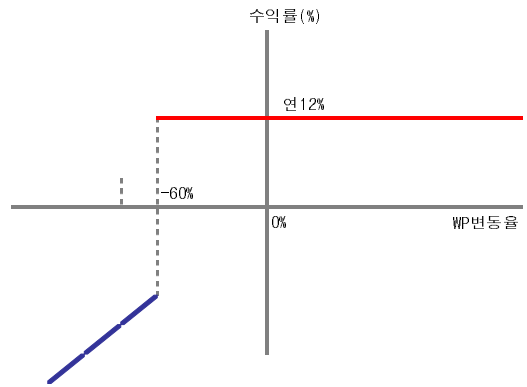
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

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%	(2.51)	(3.25)	(3.99)	(4.73)	(5.47)	(6.21)	(6.95)
	5.33%	1.50	0.76	0.02	(0.72)	(1.46)	(2.20)	(2.94)
	2.67%	3.08	2.34	1.60	0.86	0.12	(0.62)	(1.36)
	0.00%	2.22	1.48	0.74	0.00	(0.74)	(1.48)	(2.22)
	-2.67%	(1.08)	(1.82)	(2.56)	(3.30)	(4.03)	(4.77)	(5.51)
	-5.33%	(6.81)	(7.55)	(8.29)	(9.03)	(9.77)	(10.51)	(11.25)
	-8.00%	(14.98)	(15.72)	(16.46)	(17.20)	(17.94)	(18.68)	(19.41)

최대손실 시나리오

위험액	-19.41
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	20.99
-----	-------

[4-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

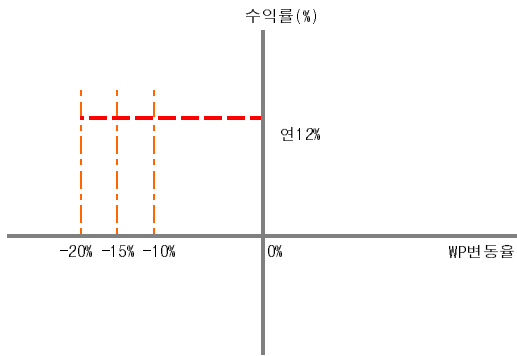
1. 계약금액

단위(백만원)

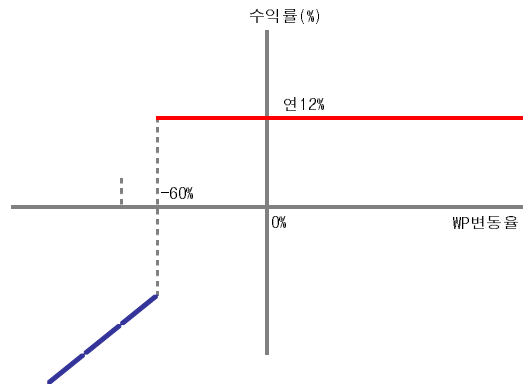
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[4-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

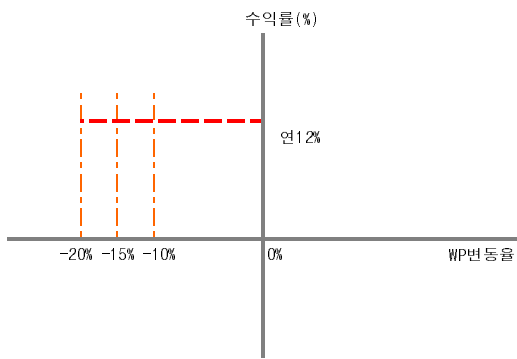
1. 계약금액

단위(백만원)

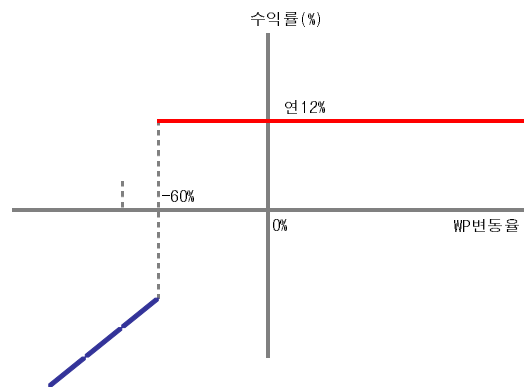
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147



[4-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

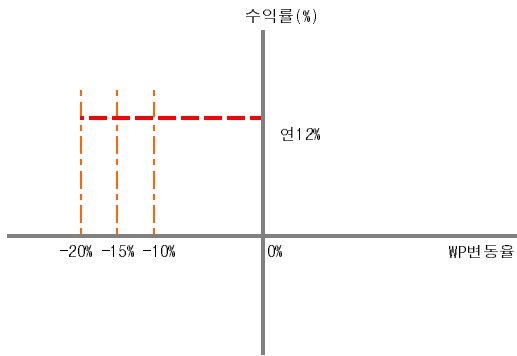
1. 계약금액

단위(백만원)

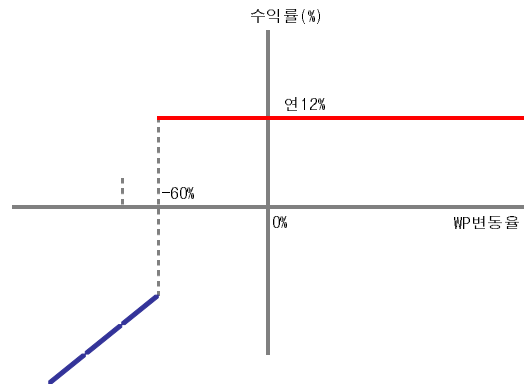
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	324	0	324	장외

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

[5-1] 메리츠2Star증권SEWF-1호

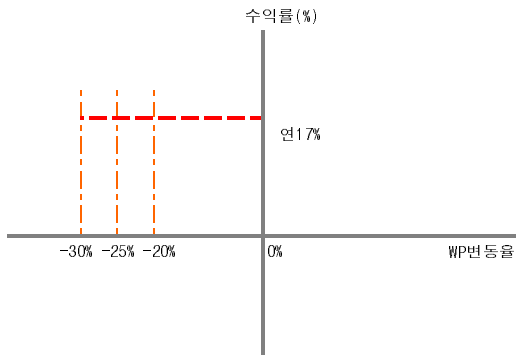
1. 계약금액

단위(백만원)

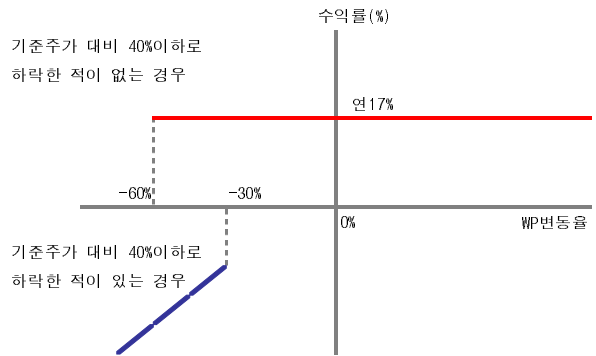
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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%	16.24	7.07	(2.09)	(11.26)	(20.42)	(29.59)	(38.75)
	5.33%	36.47	27.31	18.14	8.98	(0.19)	(9.35)	(18.52)
	2.67%	40.23	31.06	21.90	12.73	3.57	(5.60)	(14.76)
	0.00%	27.49	18.33	9.16	0.00	(9.16)	(18.33)	(27.49)
	-2.67%	(1.72)	(10.89)	(20.05)	(29.22)	(38.38)	(47.55)	(56.71)
	-5.33%	(47.42)	(56.59)	(65.75)	(74.92)	(84.08)	(93.25)	(102.41)
	-8.00%	(109.61)	(118.77)	(127.94)	(137.10)	(146.27)	(155.43)	(164.60)

최대 손실 시나리오

위험액	-164.60
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	172.35
-----	--------

[5-2]

메리츠2Star증권SEWF-1호

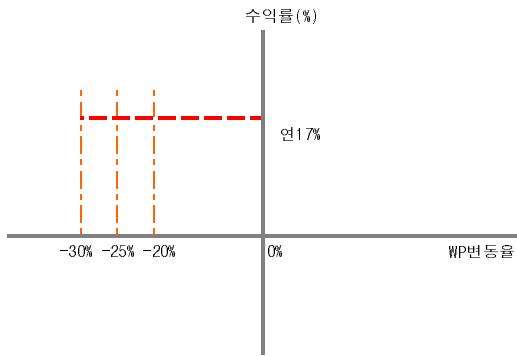
1. 계약금액

단위(백만원)

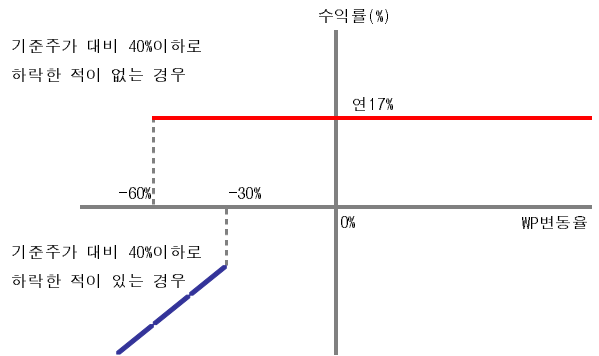
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6552318WB0 우리투자증권(ELS)2733

[5-3]

메리츠2Star증권SEWF-1호

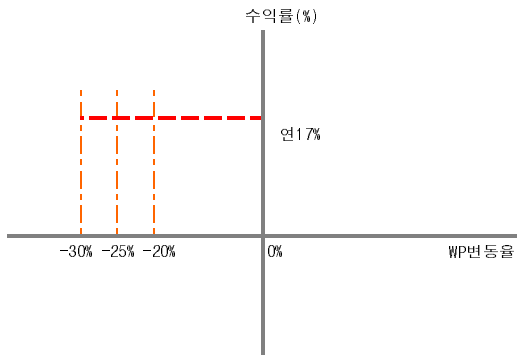
1. 계약금액

단위(백만원)

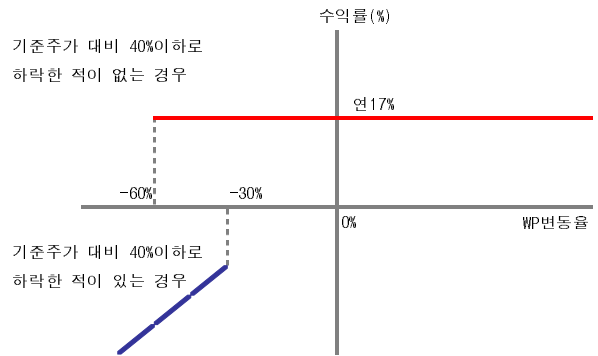
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662304WB7 동양(ELS)343

[5-4]

메리츠2Star증권SEWF-1호

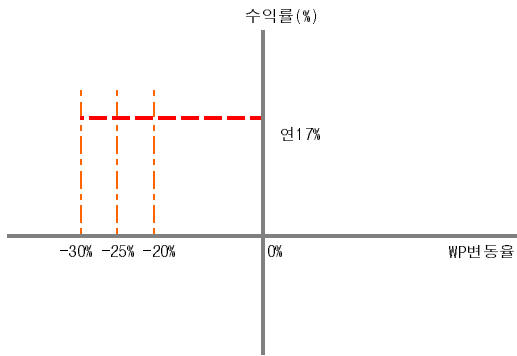
1. 계약금액

단위(백만원)

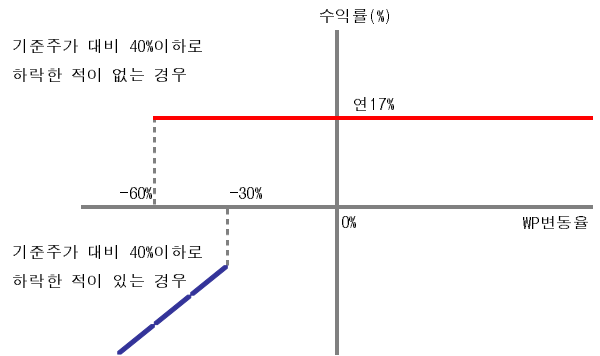
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,331	0	1,331	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

KR6702307WB2 H&D증권(ELS)332

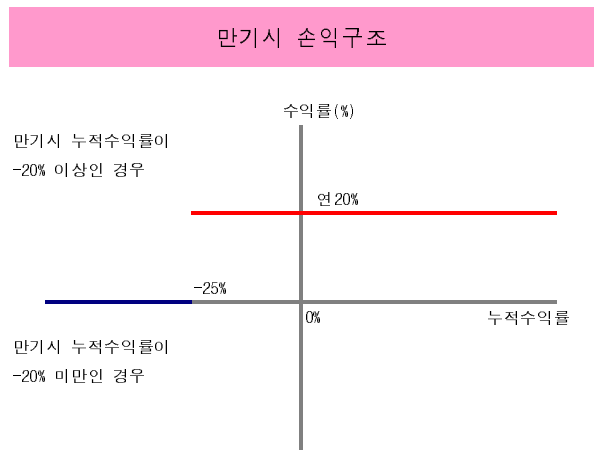
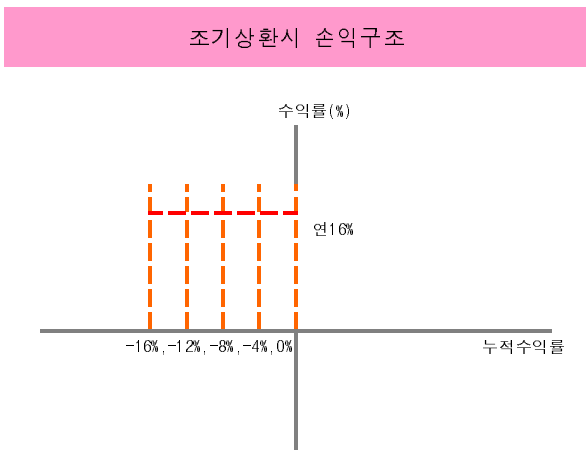
[6] 메리츠크리켓 단위 파생3호

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
-----	------

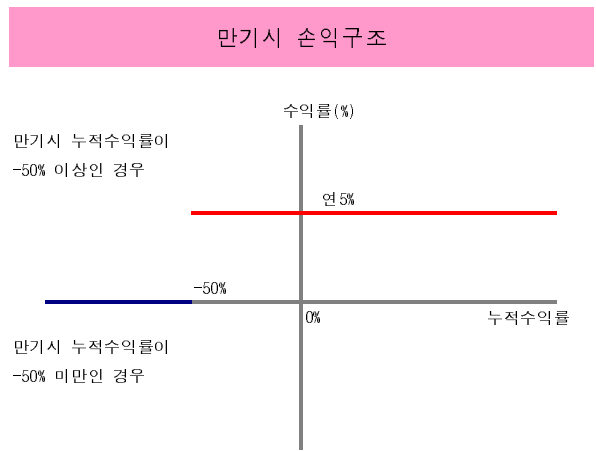
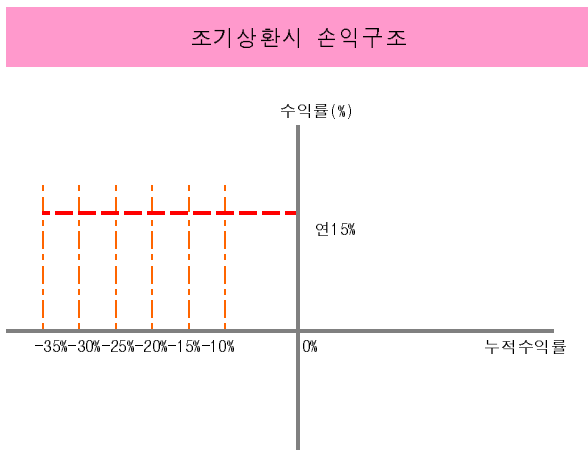
[7] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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
	5.33%	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
	-2.67%	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
	-8.00%	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
-----	------

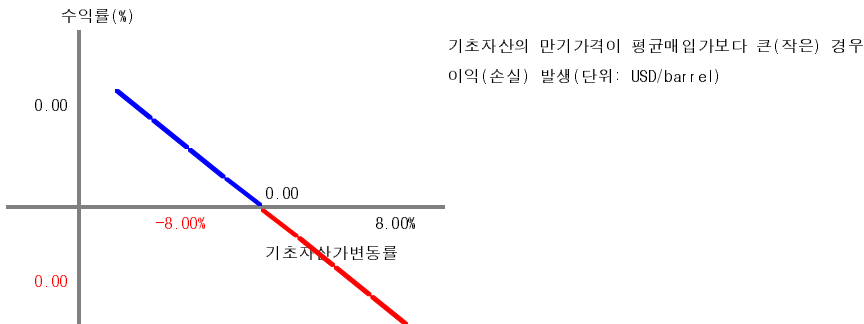
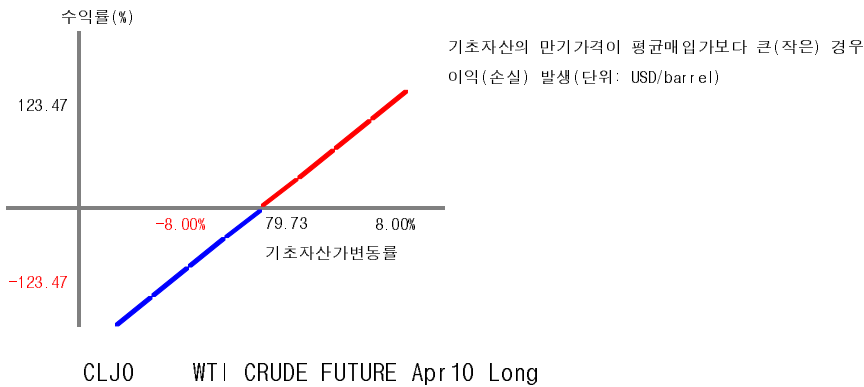
[8] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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%	123.47
	5.33%	82.26
	2.67%	41.21
	0.00%	0.00
	-2.67%	-41.21
	-5.33%	-82.26
	-8.00%	-123.47

최대손실 시나리오	
위험액	-123.47

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	500
-----	-----



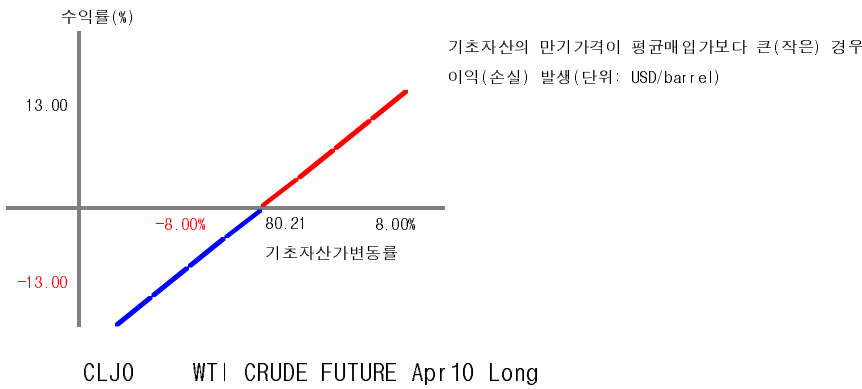
[9] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유\_파생형]

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%	13.00
	5.33%	8.66
	2.67%	4.34
	0.00%	0.00
	-2.67%	-4.34
	-5.33%	-8.66
	-8.00%	-13.00

최대손실 시나리오	
위험액	-13.00

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	52
-----	----

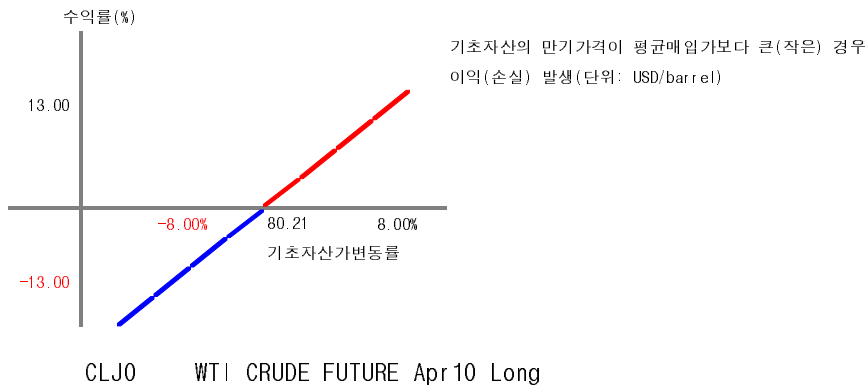
[10-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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%	43.68
	5.33%	29.10
	2.67%	14.58
	0.00%	0.00
	-2.67%	-14.58
	-5.33%	-29.10
	-8.00%	-43.68

최대손실 시나리오	
위험액	-43.68

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	174
-----	-----

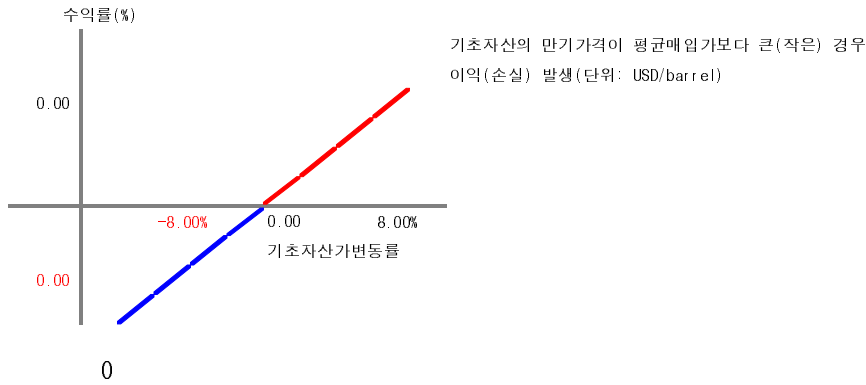
[10-2] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



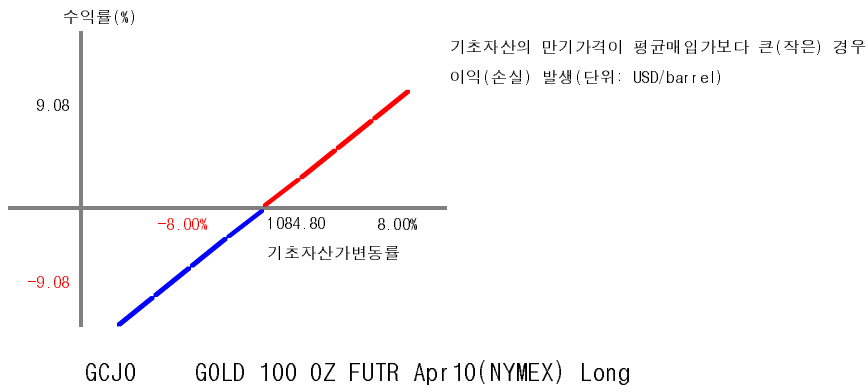
[10-3] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



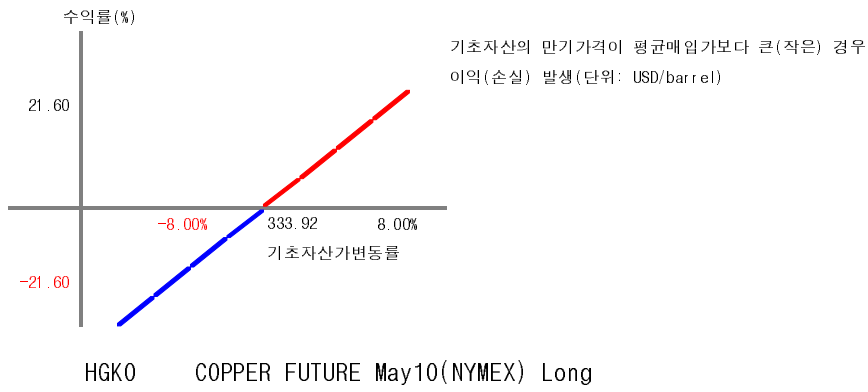
[10-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



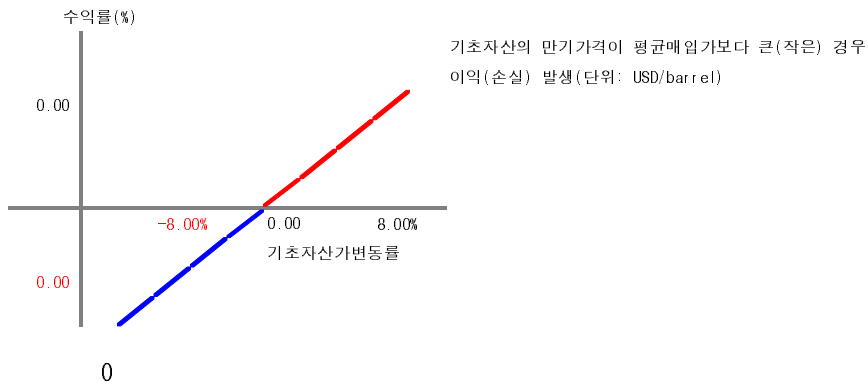
[10-5] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



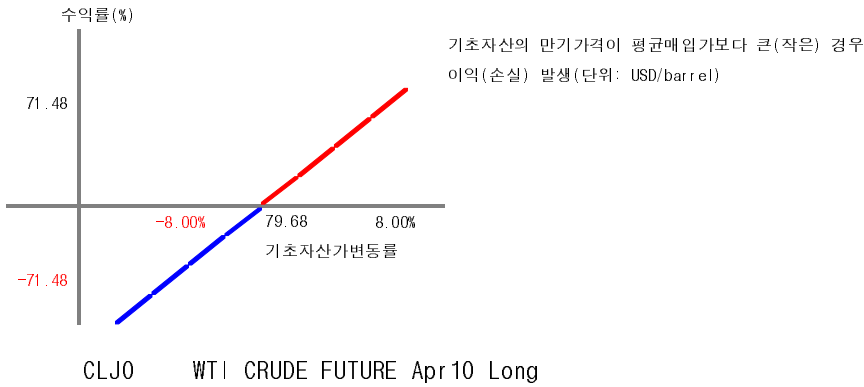
[11] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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))

CLJ0 WTI CRUDE FUTURE Apr 10 Long

구분	시나리오	
기초자산시나리오	8.00%	71.48
	5.33%	47.63
	2.67%	23.86
	0.00%	0.00
	-2.67%	-23.86
	-5.33%	-47.63
	-8.00%	-71.48

최대손실 시나리오	
위험액	-71.48

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	269
-----	-----

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

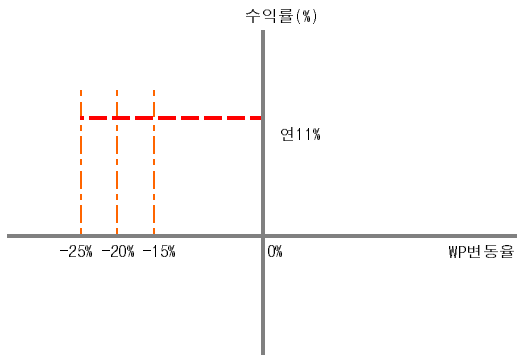
1. 계약금액

단위(백만원)

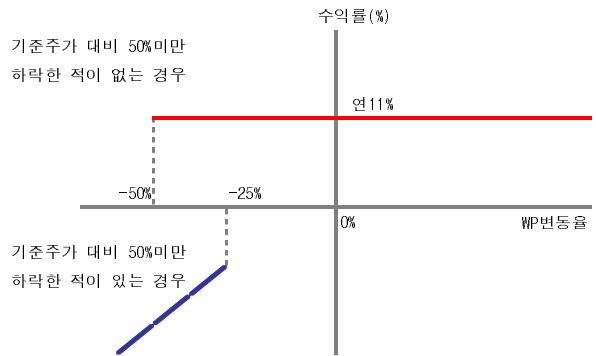
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6503327WC9 신한투자(ELS)1275

구분	기초자산시나리오	변동성 시나리오						
		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0.00%	8.33%	16.67%	25.00%
	8.00%	(1.01)	(1.03)	(1.06)	(1.09)	(1.11)	(1.14)	(1.17)
	5.33%	(0.35)	(0.37)	(0.40)	(0.43)	(0.45)	(0.48)	(0.51)
	2.67%	0.02	(0.01)	(0.04)	(0.06)	(0.09)	(0.12)	(0.14)
	0.00%	0.08	0.05	0.03	0.00	(0.03)	(0.05)	(0.08)
	-2.67%	(0.15)	(0.18)	(0.21)	(0.23)	(0.26)	(0.29)	(0.31)
	-5.33%	(0.69)	(0.71)	(0.74)	(0.77)	(0.79)	(0.82)	(0.84)
	-8.00%	(1.52)	(1.54)	(1.57)	(1.60)	(1.62)	(1.65)	(1.67)

최대손실 시나리오

위험액	-1.67
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	0.63
-----	------



[12-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

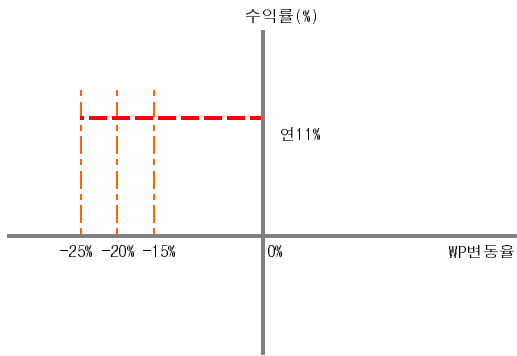
1. 계약금액

단위(백만원)

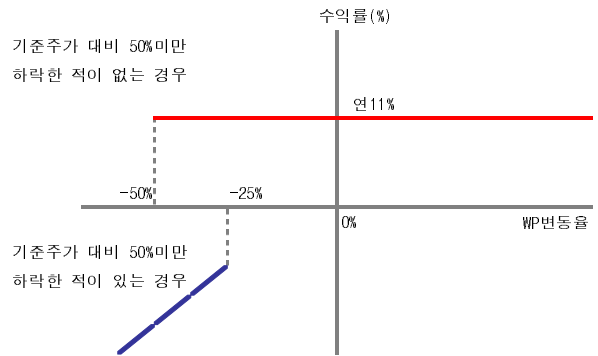
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

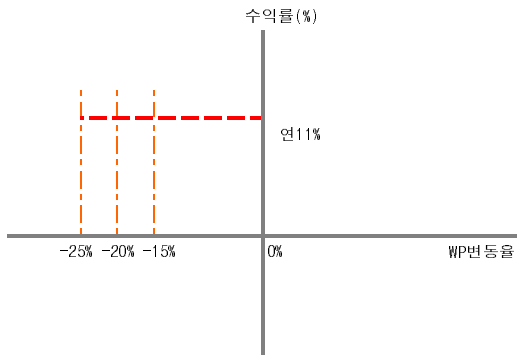
1. 계약금액

단위(백만원)

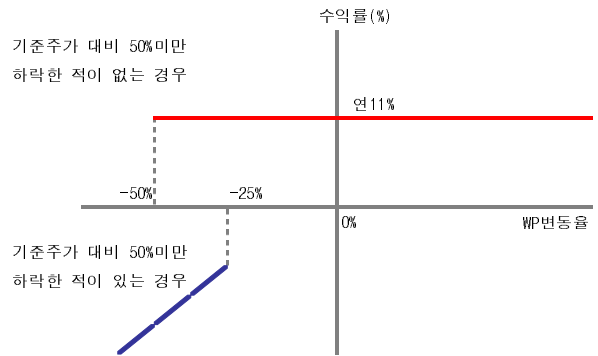
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[12-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

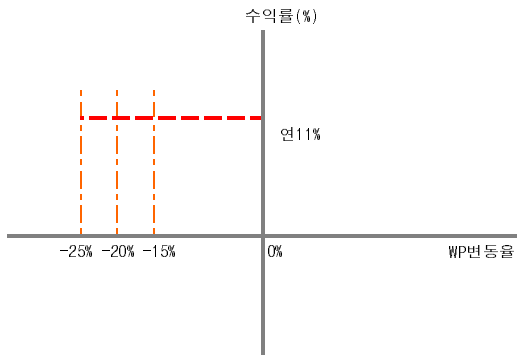
1. 계약금액

단위(백만원)

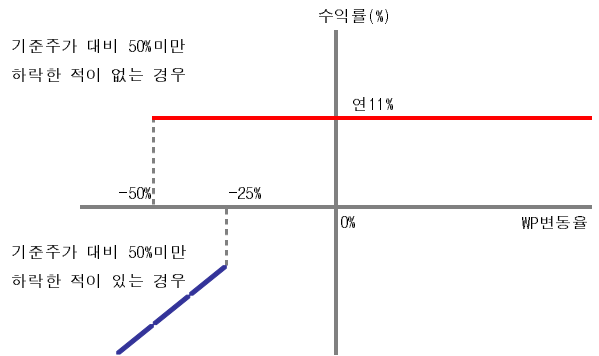
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	441	0	441	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[13-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

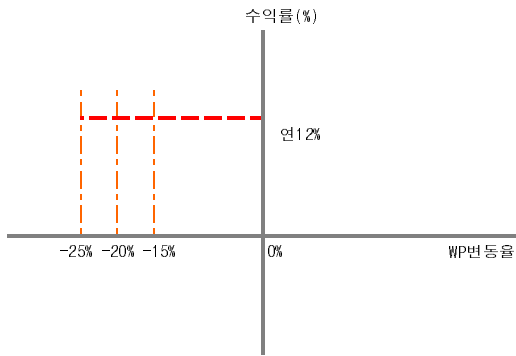
1. 계약금액

단위(백만원)

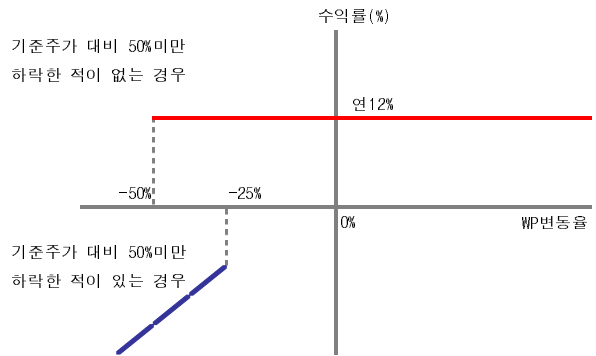
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

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%	7.40	5.59	3.78	1.97	0.16	(1.65)	(3.46)
	5.33%	9.23	7.42	5.61	3.80	1.99	0.18	(1.63)
	2.67%	8.57	6.76	4.95	3.14	1.33	(0.48)	(2.29)
	0.00%	5.43	3.62	1.81	0.00	(1.81)	(3.62)	(5.43)
	-2.67%	(0.19)	(2.00)	(3.81)	(5.62)	(7.43)	(9.24)	(11.05)
	-5.33%	(8.29)	(10.10)	(11.91)	(13.72)	(15.53)	(17.34)	(19.15)
	-8.00%	(18.86)	(20.67)	(22.48)	(24.29)	(26.10)	(27.91)	(29.72)

최대손실 시나리오

위험액	-29.72
-----	--------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	27.92
-----	-------

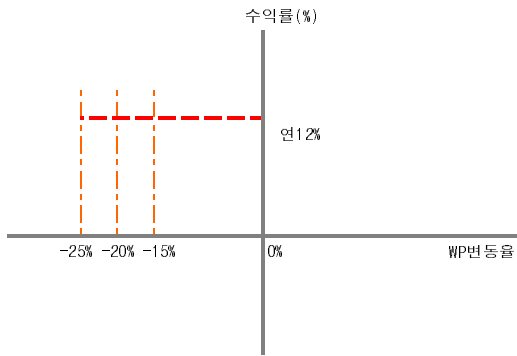
1. 계약금액

단위(백만원)

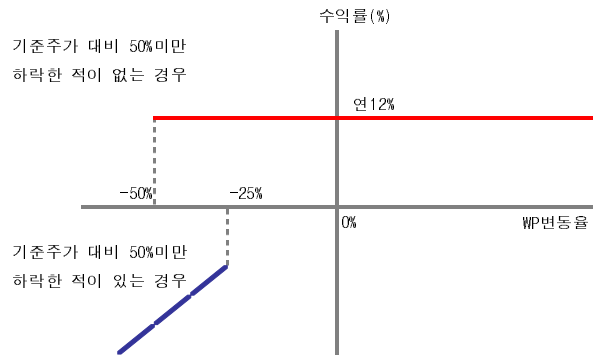
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[13-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

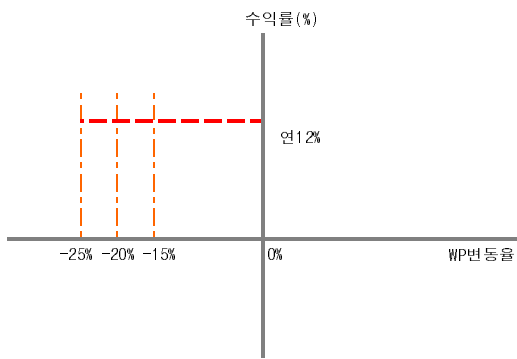
1. 계약금액

단위(백만원)

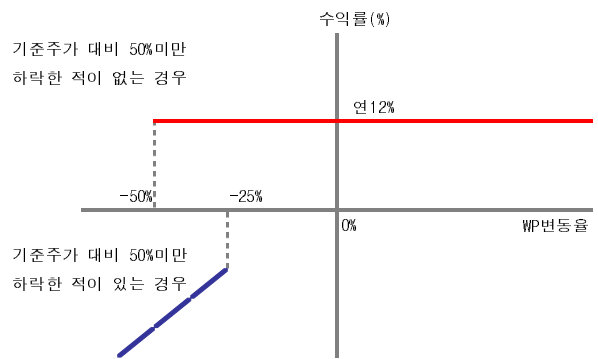
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[13-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

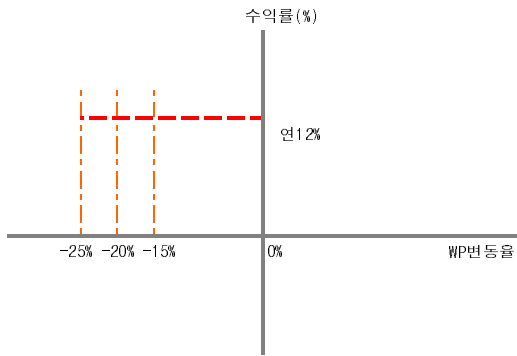
1. 계약금액

단위(백만원)

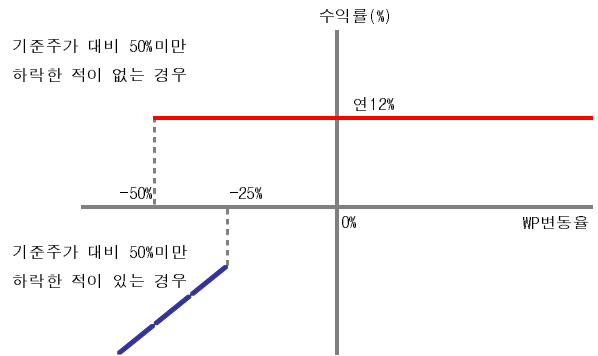
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	392	0	392	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[14-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

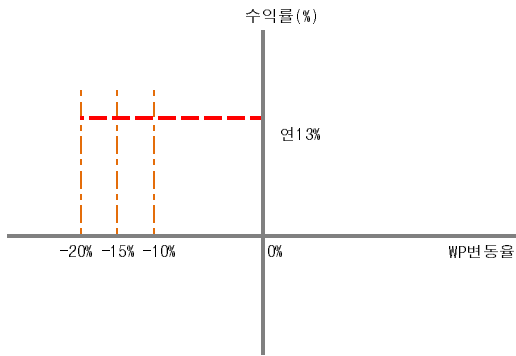
1. 계약금액

단위(백만원)

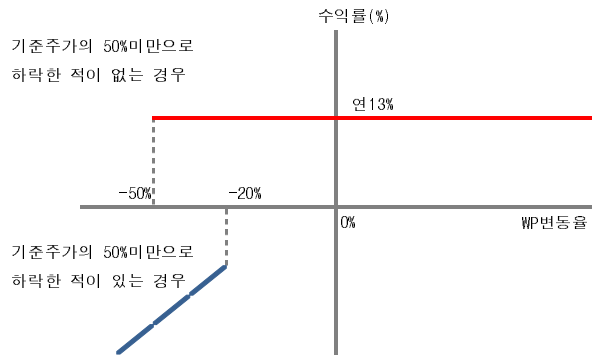
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

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%	8.54	7.80	7.06	6.33	5.59	4.85	4.11
	5.33%	6.06	5.32	4.59	3.85	3.11	2.37	1.63
	2.67%	3.95	3.22	2.48	1.74	1.00	0.26	(0.48)
	0.00%	2.21	1.48	0.74	0.00	(0.74)	(1.48)	(2.21)
	-2.67%	0.85	0.11	(0.63)	(1.37)	(2.11)	(2.84)	(3.58)
	-5.33%	(0.15)	(0.89)	(1.63)	(2.37)	(3.10)	(3.84)	(4.58)
	-8.00%	(0.78)	(1.52)	(2.26)	(2.99)	(3.73)	(4.47)	(5.21)

최대손실 시나리오

위험액	-5.21
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	9.50
-----	------



[14-2] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

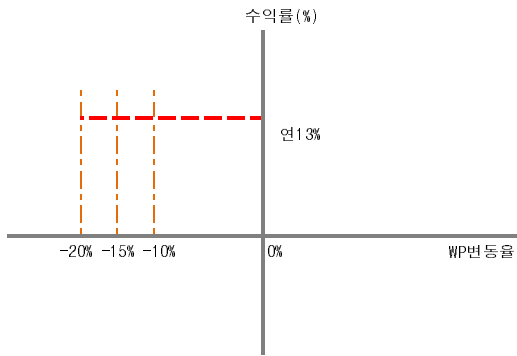
1. 계약금액

단위(백만원)

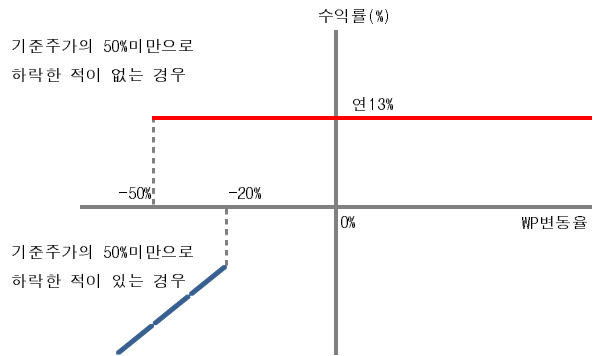
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[14-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

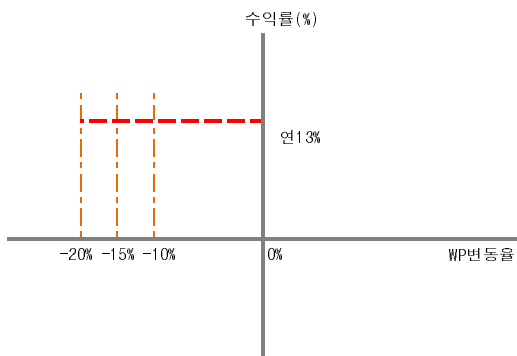
1. 계약금액

단위(백만원)

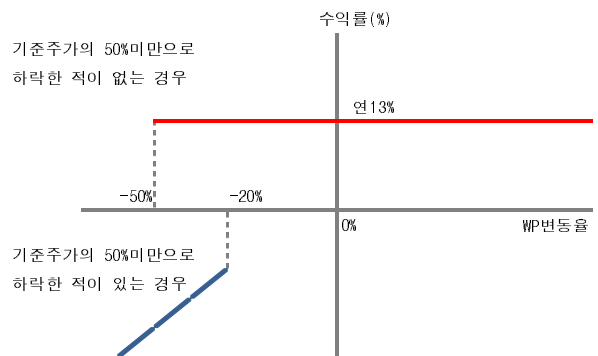
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[14-4] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

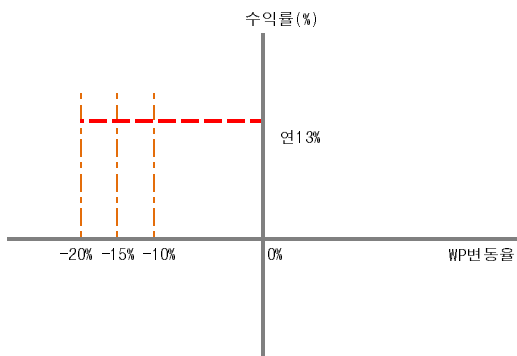
1. 계약금액

단위(백만원)

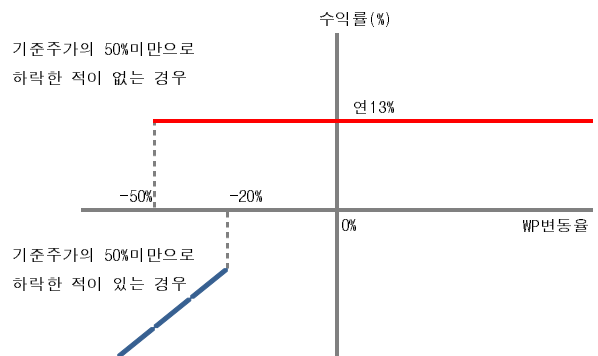
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,920	0	1,920	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703338014 H&D증권(ELS)431

[15-1] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

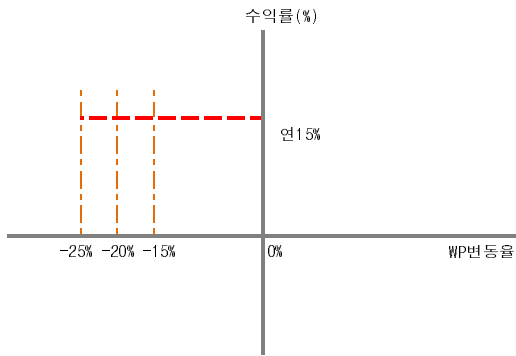
1. 계약금액

단위(백만원)

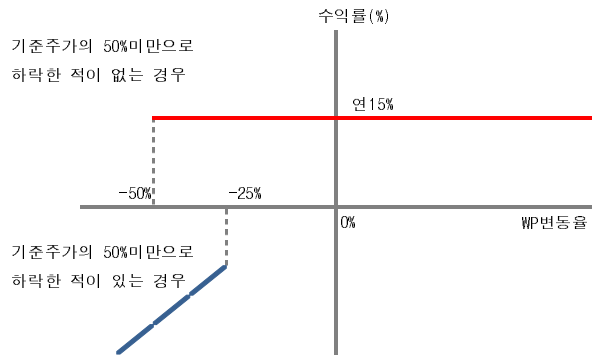
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

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%	67.91	55.17	42.44	29.70	16.97	4.23	(8.50)
	5.33%	61.74	49.01	36.27	23.54	10.80	(1.93)	(14.67)
	2.67%	51.84	39.10	26.37	13.64	0.90	(11.83)	(24.57)
	0.00%	38.20	25.47	12.73	0.00	(12.73)	(25.47)	(38.20)
	-2.67%	20.83	8.10	(4.64)	(17.37)	(30.10)	(42.84)	(55.57)
	-5.33%	(0.27)	(13.01)	(25.74)	(38.48)	(51.21)	(63.94)	(76.68)
	-8.00%	(25.11)	(37.85)	(50.58)	(63.32)	(76.05)	(88.78)	(101.52)

최대손실 시나리오

위험액	-101.52
-----	---------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

위험액	89.13
-----	-------

[15-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

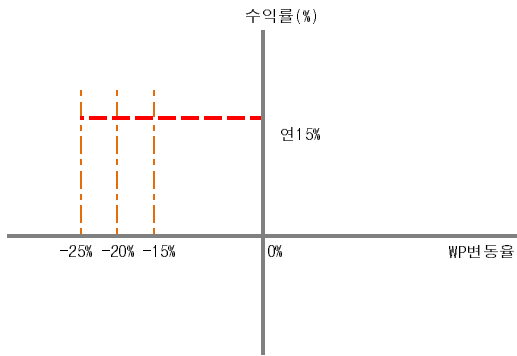
1. 계약금액

단위(백만원)

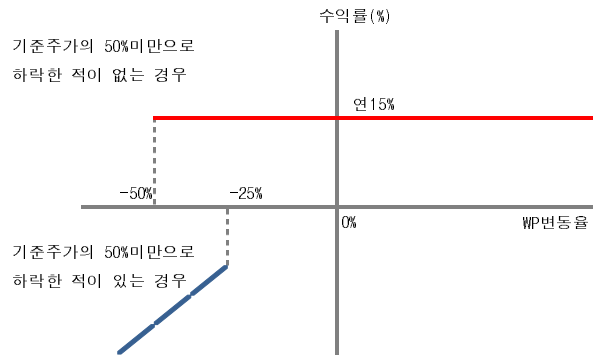
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[15-3]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

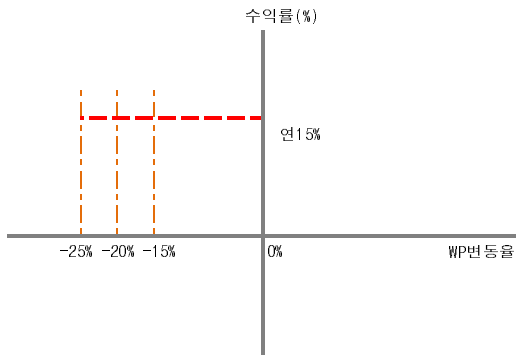
1. 계약금액

단위(백만원)

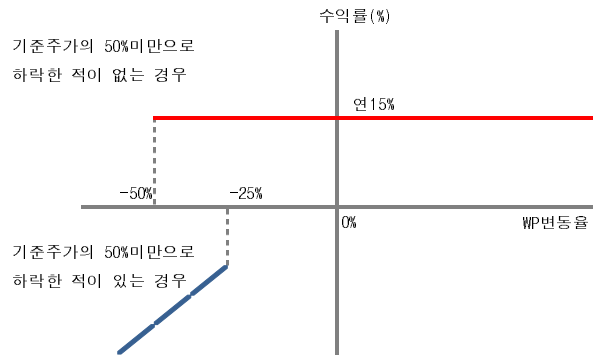
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오    KR6662335027    동양(ELS)459

[15-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

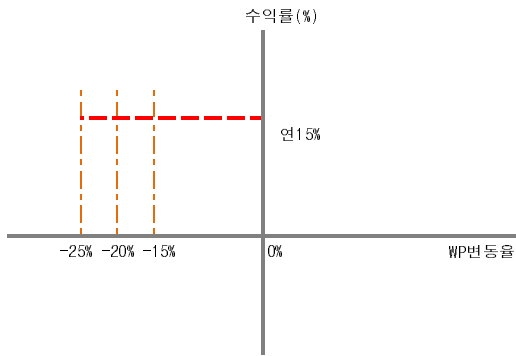
1. 계약금액

단위(백만원)

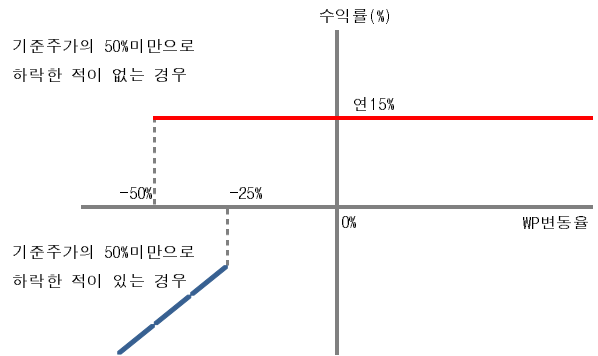
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	662	0	662	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[16-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

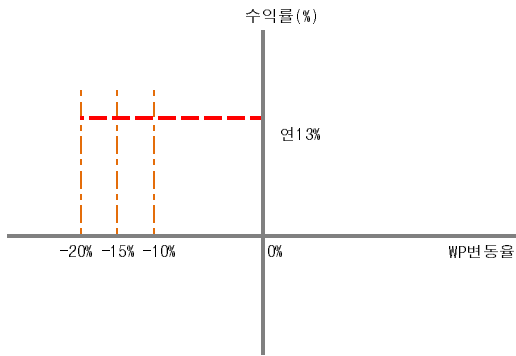
1. 계약금액

단위(백만원)

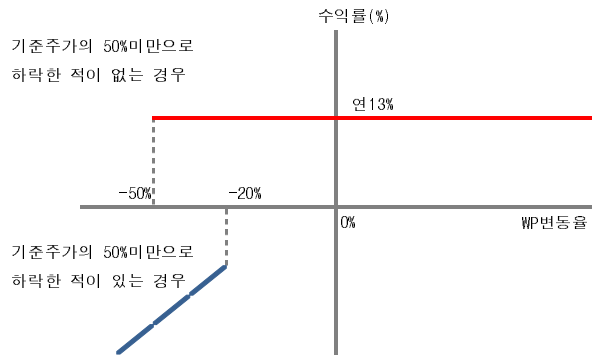
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

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%	3.44	3.36	3.27	3.19	3.11	3.03	2.95
	5.33%	2.16	2.08	2.00	1.91	1.83	1.75	1.67
	2.67%	1.10	1.01	0.93	0.85	0.77	0.69	0.60
	0.00%	0.25	0.16	0.08	0.00	(0.08)	(0.16)	(0.25)
	-2.67%	(0.39)	(0.47)	(0.56)	(0.64)	(0.72)	(0.80)	(0.88)
	-5.33%	(0.81)	(0.90)	(0.98)	(1.06)	(1.14)	(1.22)	(1.31)
	-8.00%	(1.02)	(1.11)	(1.19)	(1.27)	(1.35)	(1.43)	(1.52)

최대손실 시나리오

위험액	-1.52
-----	-------

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

위험액	5.75
-----	------



[16-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

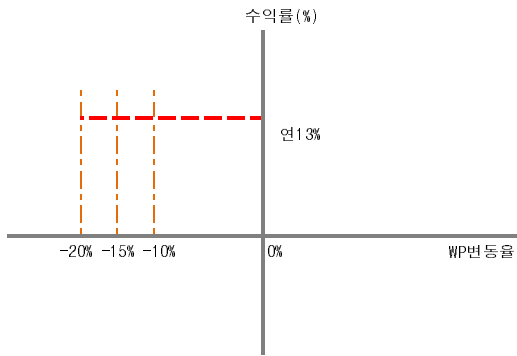
1. 계약금액

단위(백만원)

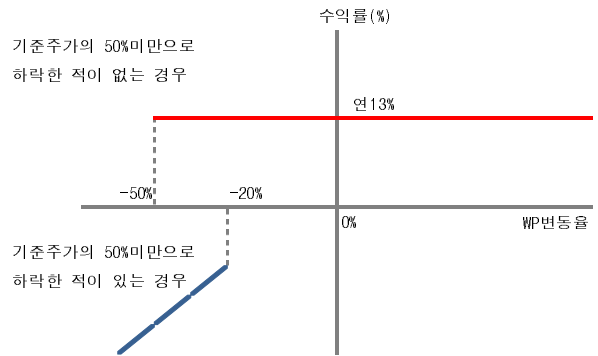
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[16-3] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

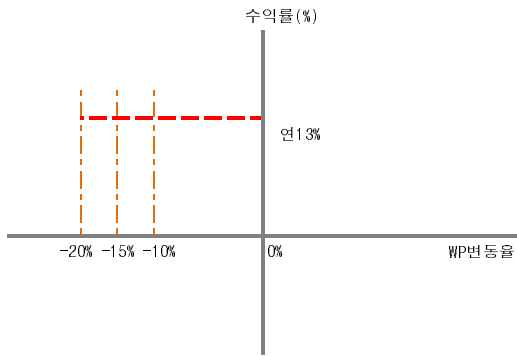
1. 계약금액

단위(백만원)

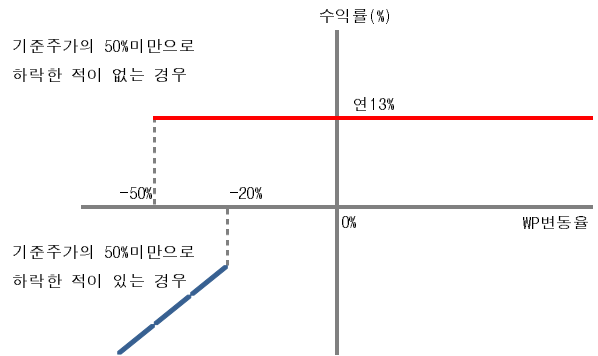
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,048	0	1,048	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[16-4] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

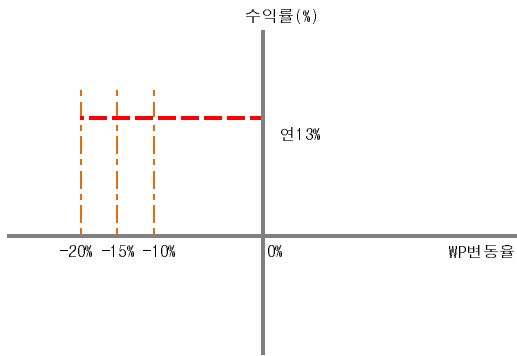
1. 계약금액

단위(백만원)

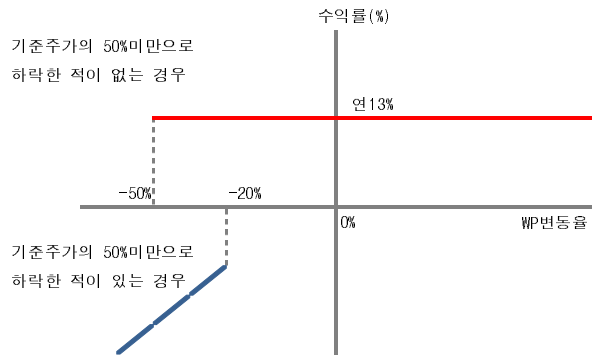
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
누계	유가증권	ELS	1,075	0	1,075	장익

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504