

파생상품간접투자기구의 위험에 관한 지표공시

[1-1] 메리츠2Star증권KGSH-1호

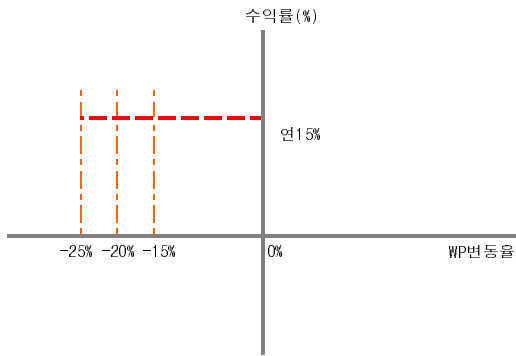
1. 계약금액

단위(백만원)

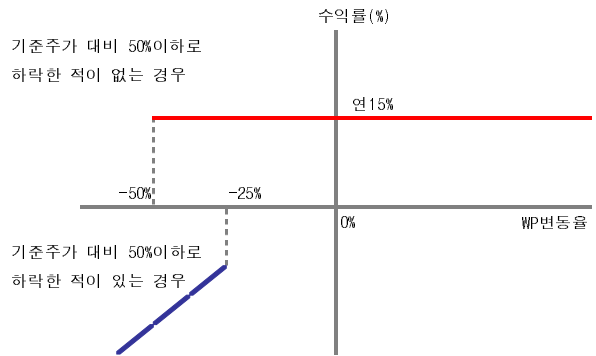
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 865 | 0 | 865 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(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% | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) |
| | 5.33% | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) |
| | 2.67% | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) |
| | 0.00% | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | -2.67% | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) | (31.13) |
| | -5.33% | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) | (124.51) |
| | -8.00% | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) | (280.14) |

최대 손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -280.14 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|------|
| 위험액 | 0.00 |
|-----|------|

[1-2]

메리츠2Star증권KGSH-1호

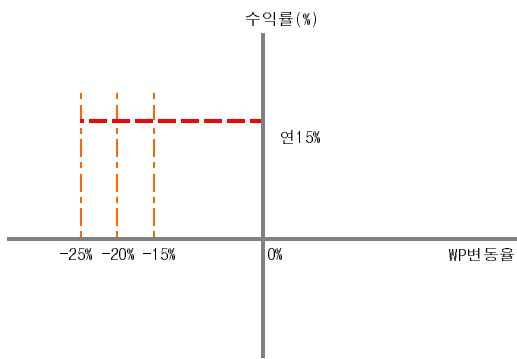
1. 계약금액

단위(백만원)

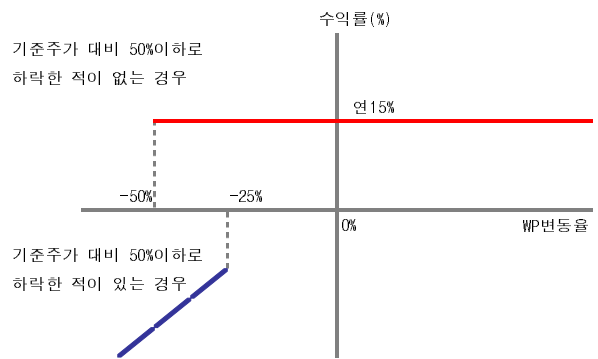
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 865 | 0 | 865 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582333WB3 현대증권(ELS)2009-1138

[1-3]

메리츠2Star증권KGSH-1호

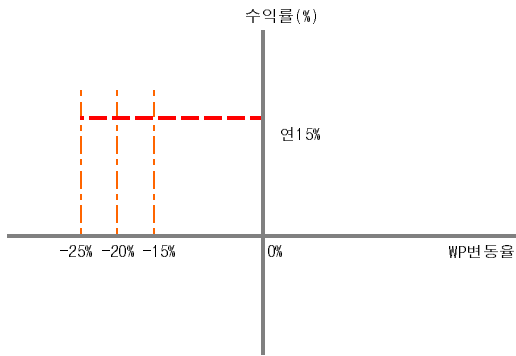
1. 계약금액

단위(백만원)

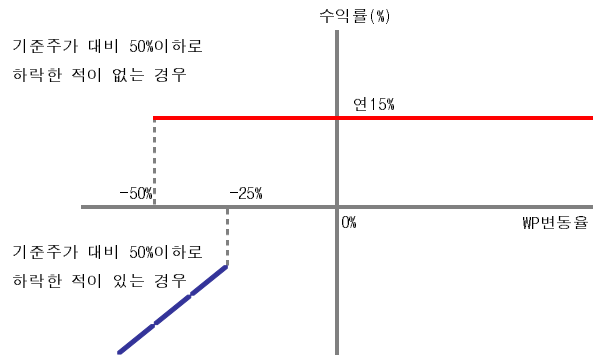
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 865 | 0 | 865 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6662340WB1 동양(ELS)361

[1-4]

메리츠2Star증권KGSH-1호

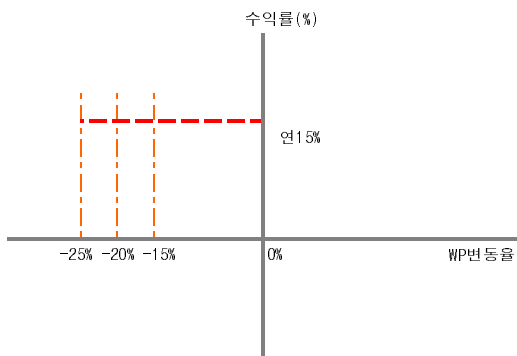
1. 계약금액

단위(백만원)

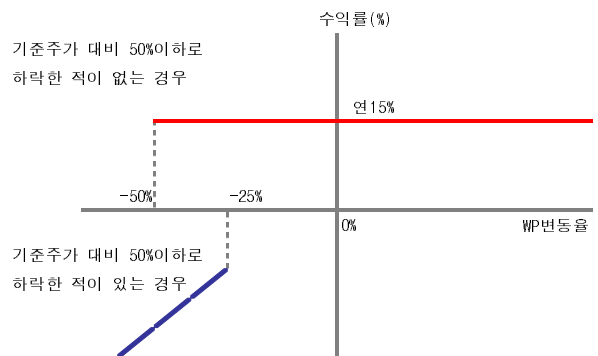
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 865 | 0 | 865 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6702366WB8 H&D증권(ELS)379

[3-1] 메리츠2Star증권SEST-1호

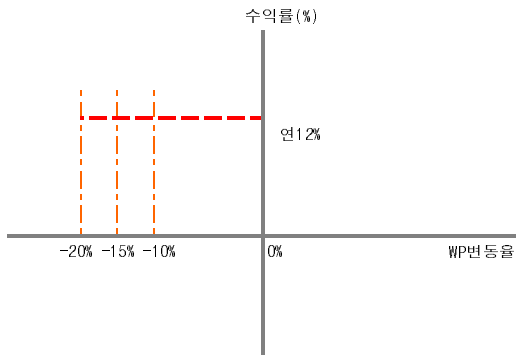
1. 계약금액

단위(백만원)

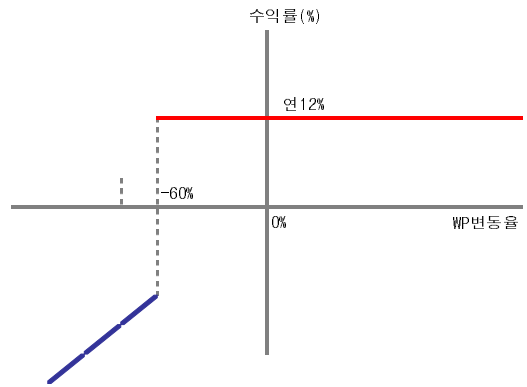
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 324 | 0 | 324 | 장익 |

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% | (20.73) | (21.11) | (21.49) | (21.87) | (22.25) | (22.63) | (23.01) |
| | 5.33% | (7.51) | (7.89) | (8.27) | (8.65) | (9.03) | (9.41) | (9.79) |
| | 2.67% | (0.22) | (0.60) | (0.98) | (1.36) | (1.74) | (2.12) | (2.50) |
| | 0.00% | 1.14 | 0.76 | 0.38 | 0.00 | (0.38) | (0.76) | (1.14) |
| | -2.67% | (3.43) | (3.81) | (4.19) | (4.57) | (4.95) | (5.33) | (5.71) |
| | -5.33% | (13.94) | (14.31) | (14.69) | (15.07) | (15.45) | (15.83) | (16.21) |
| | -8.00% | (30.37) | (30.75) | (31.12) | (31.50) | (31.88) | (32.26) | (32.64) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -32.64 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 19.98 |
|-----|-------|

[3-2]

메리츠2Star증권SEST-1호

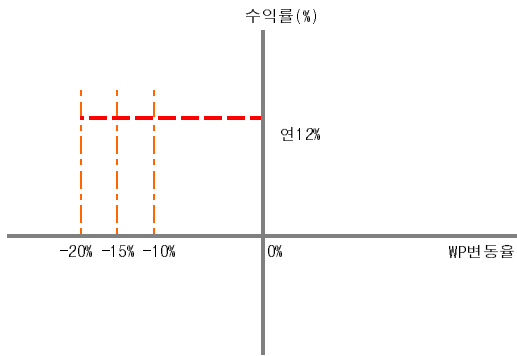
1. 계약금액

단위(백만원)

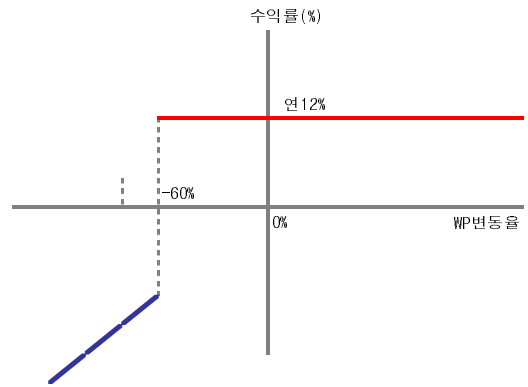
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 324 | 0 | 324 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6572338WC2 한국투자증권(ELS)1479

[3-3]

메리츠2Star증권SEST-1호

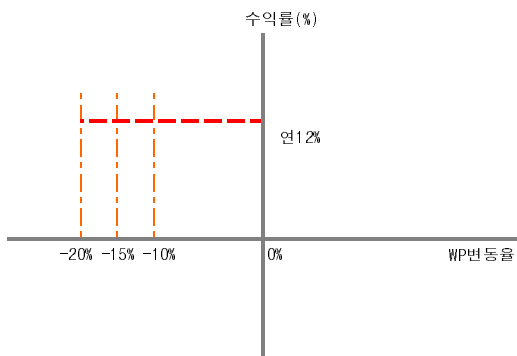
1. 계약금액

단위(백만원)

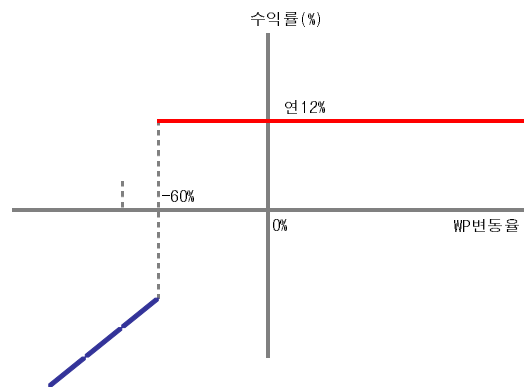
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 324 | 0 | 324 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6582313WC3 현대증권(ELS)2009-1147

[3-4]

메리츠2Star증권SEST-1호

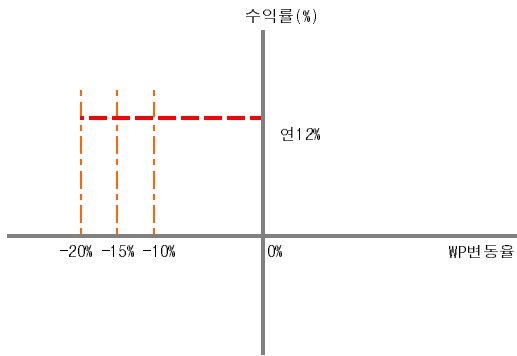
1. 계약금액

단위(백만원)

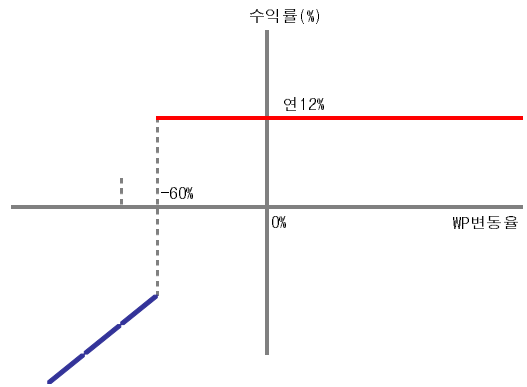
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 324 | 0 | 324 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6692307WC2 NH투자증권(ELS)211

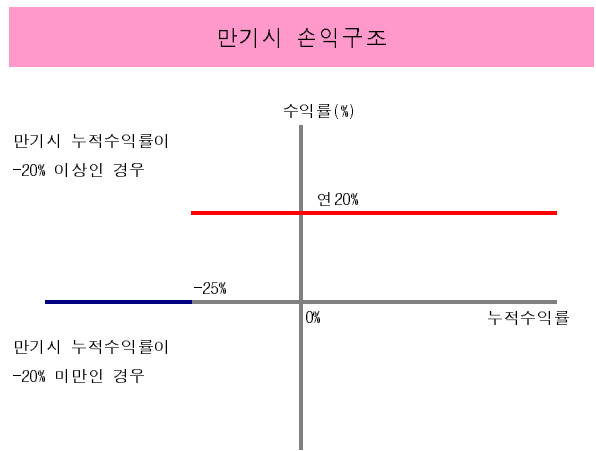
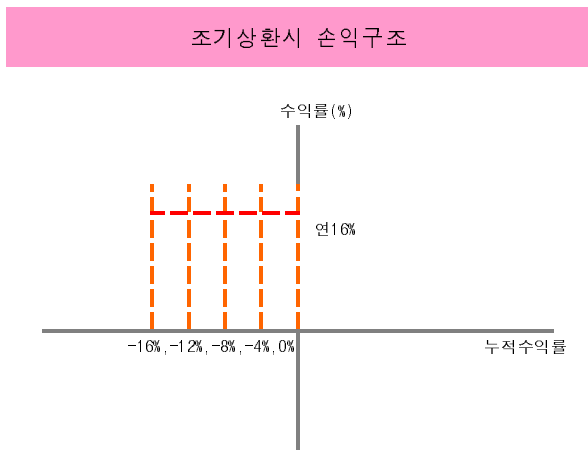
[4] 메리츠클리켓 단위 파생3호

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 시나 리오 | 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 |
|-----|------|

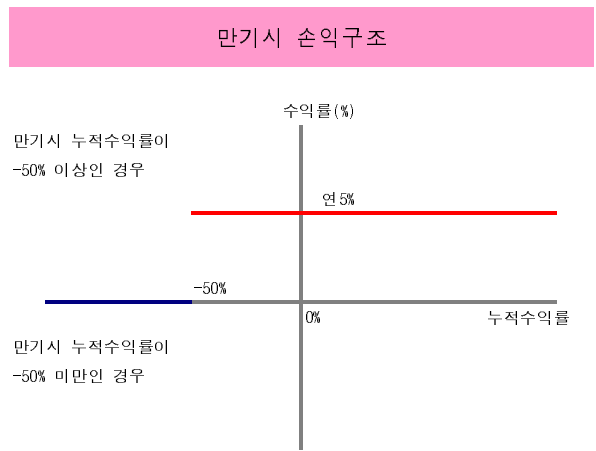
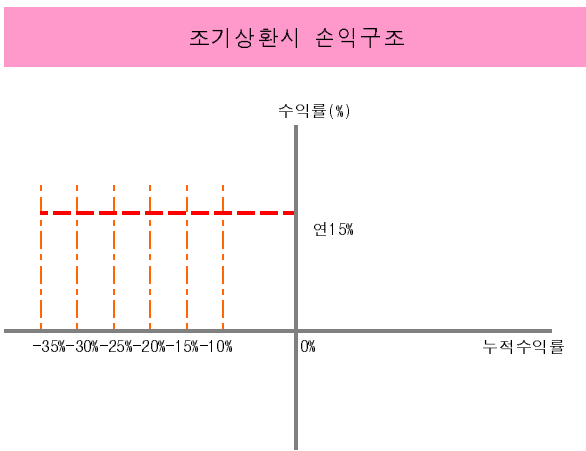
[5] 메리츠클리켓 단위 파생 5호

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 |
|-----|------|

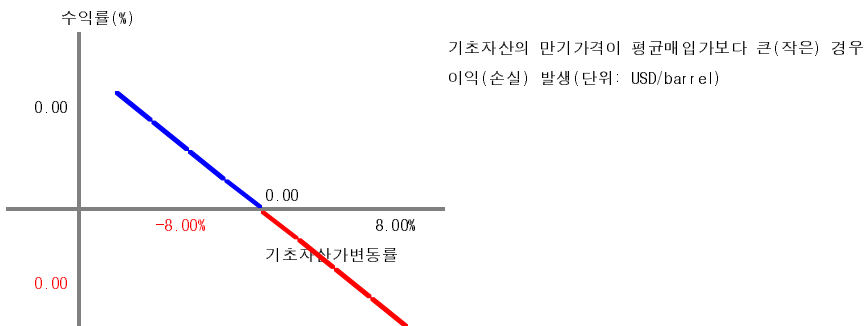
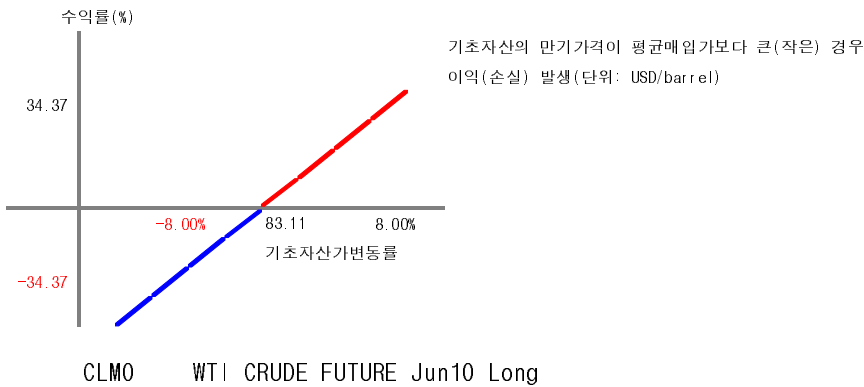
[6] 메리츠 WTI Index 사모특별 1호

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 | |
|----------------------|--------|--------|
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | 34.37 |
| | 5.33% | 22.90 |
| | 2.67% | 11.47 |
| | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -11.47 |
| | -5.33% | -22.90 |
| | -8.00% | -34.37 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|--------|
| 위험액 | -34.37 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-----|
| 위험액 | 139 |
|-----|-----|

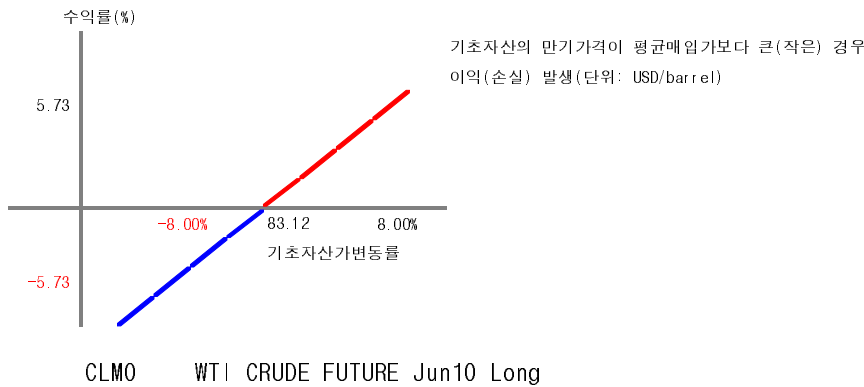
[7] 메리츠WTIIndex특별자산1호[원유_파생형]

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(최대 손실가능금액(단위:1000USD))

CLMO WTI CRUDE FUTURE Jun10 Long

| 구분 | 시나리오 | |
|------------|--------|-------|
| 기초 자산 시나리오 | 8.00% | 5.73 |
| | 5.33% | 3.82 |
| | 2.67% | 1.91 |
| | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -1.91 |
| | -5.33% | -3.82 |
| | -8.00% | -5.73 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|-------|
| 위험액 | -5.73 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|----|
| 위험액 | 23 |
|-----|----|

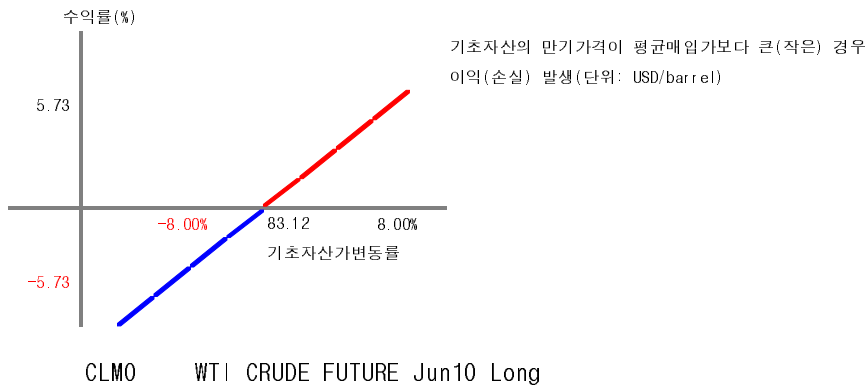
[8-1] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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% | 21.80 |
| | 5.33% | 14.53 |
| | 2.67% | 7.28 |
| | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -7.28 |
| | -5.33% | -14.53 |
| | -8.00% | -21.80 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|--------|
| 위험액 | -21.80 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|----|
| 위험액 | 87 |
|-----|----|

[8-2]

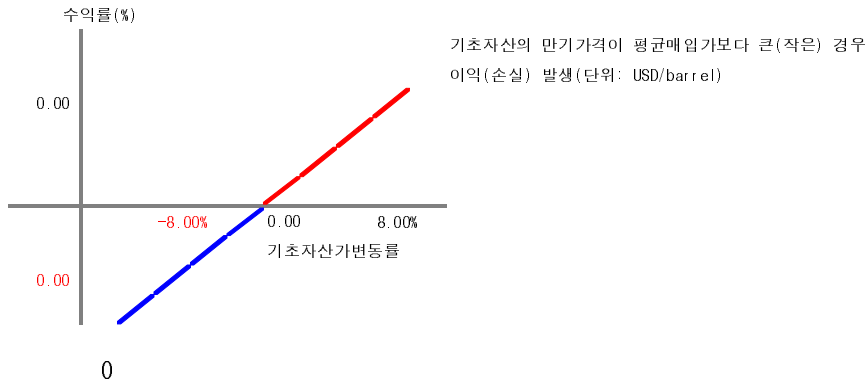
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



[8-3]

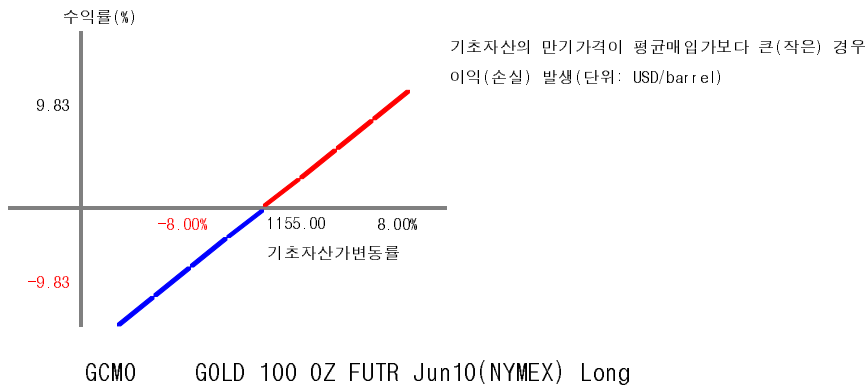
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



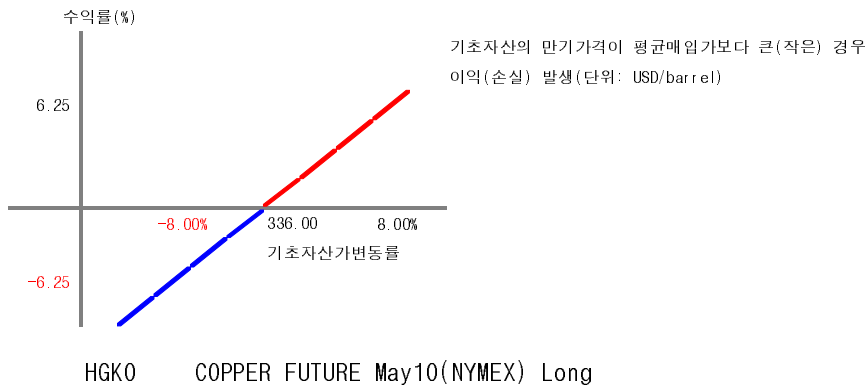
[8-4] 메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



[8-5]

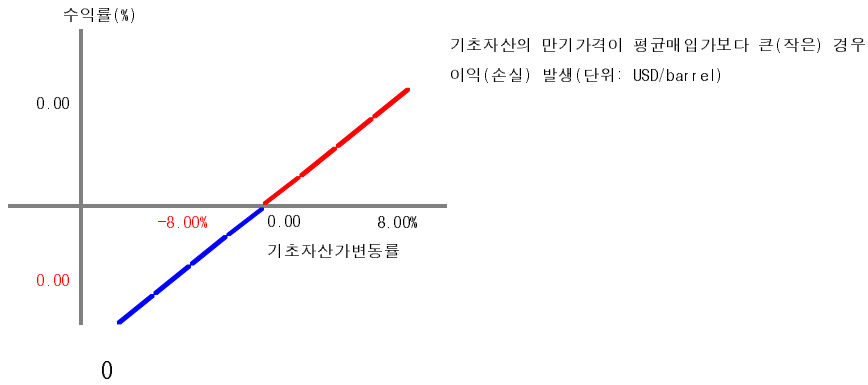
메리츠PremiumCommodity특별자산1

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



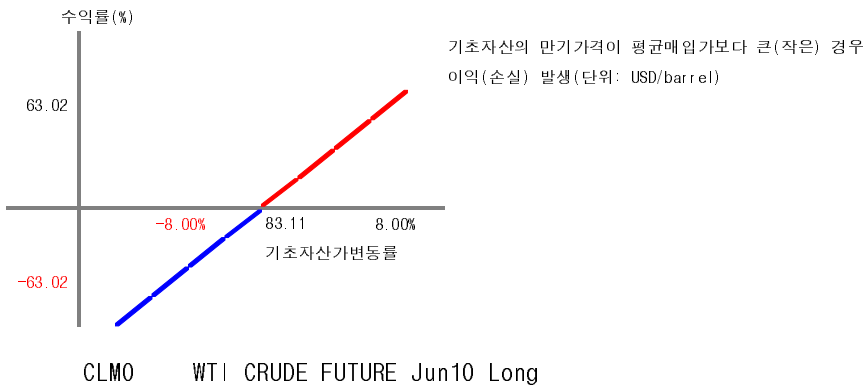
[9] 메리츠WTIindex사모특별자산2호

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% | 63.02 |
| | 5.33% | 41.99 |
| | 2.67% | 21.03 |
| | 0.00% | 0.00 |
| | -2.67% | -21.03 |
| | -5.33% | -41.99 |
| | -8.00% | -63.02 |

| 최대손실 시나리오 | |
|-----------|--------|
| 위험액 | -63.02 |

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-----|
| 위험액 | 237 |
|-----|-----|

[10-1] 메리츠한중지수연계증권제2호

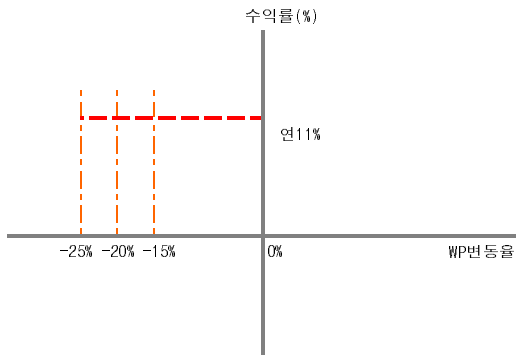
1. 계약금액

단위(백만원)

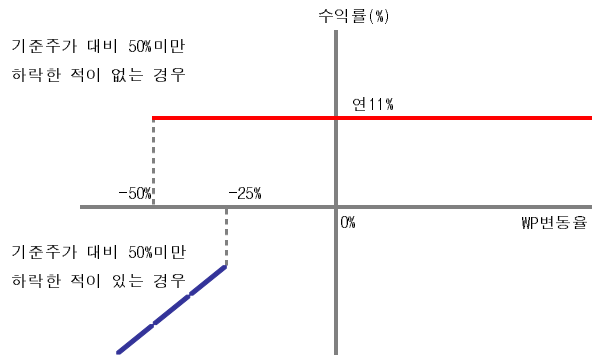
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 441 | 0 | 441 | 장익 |

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 시나 리오 | 8.00% | (5.39) | (7.06) | (8.73) | (10.40) | (12.07) | (13.74) | (15.41) |
| | 5.33% | 3.59 | 1.92 | 0.25 | (1.42) | (3.09) | (4.76) | (6.43) |
| | 2.67% | 7.06 | 5.39 | 3.72 | 2.05 | 0.38 | (1.29) | (2.96) |
| | 0.00% | 5.01 | 3.34 | 1.67 | 0.00 | (1.67) | (3.34) | (5.01) |
| | -2.67% | (2.56) | (4.23) | (5.90) | (7.57) | (9.24) | (10.91) | (12.58) |
| | -5.33% | (15.65) | (17.32) | (18.99) | (20.66) | (22.33) | (24.00) | (25.67) |
| | -8.00% | (34.25) | (35.92) | (37.59) | (39.26) | (40.93) | (42.60) | (44.27) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -44.27 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 36.68 |
|-----|-------|

[10-2]

메리츠한중지수연계증권제2호

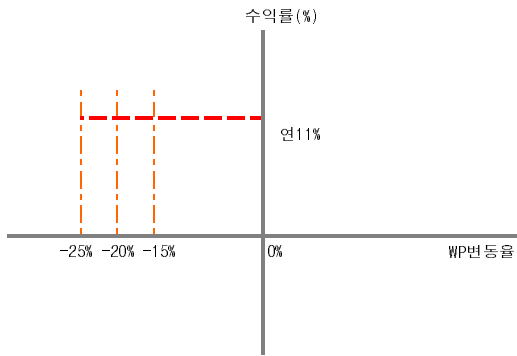
1. 계약금액

단위(백만원)

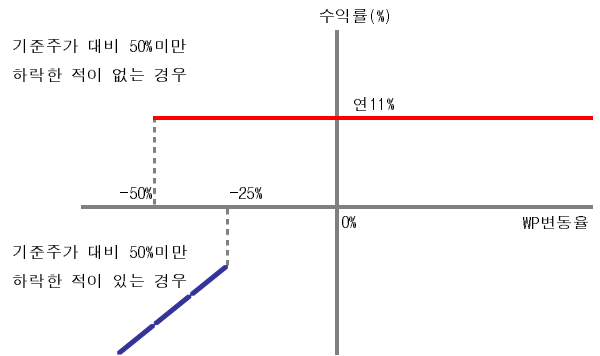
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 441 | 0 | 441 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6579384WC9 한국투자증권(ELS)1499

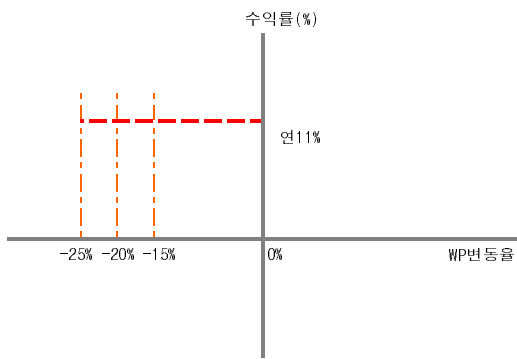
1. 계약금액

단위(백만원)

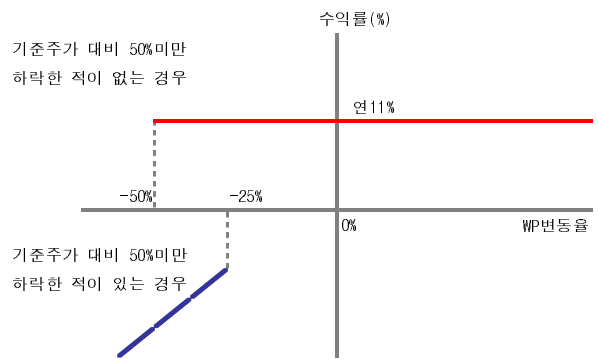
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 441 | 0 | 441 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6589326WC8 현대증권(ELS)2009-1154

[10-4]

메리츠한중지수연계증권제2호

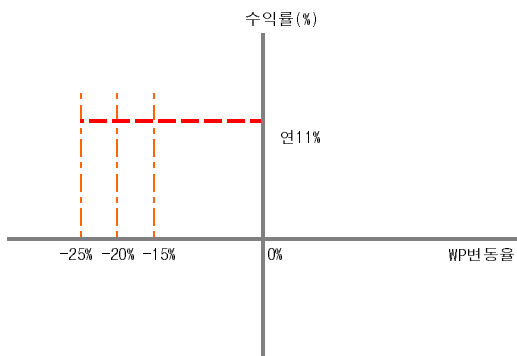
1. 계약금액

단위(백만원)

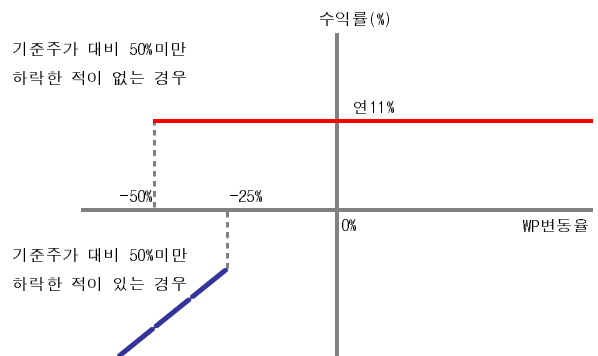
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 441 | 0 | 441 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6669380WC8 동양(ELS)403

[11-1] 메리츠한중지수연계증권제3호

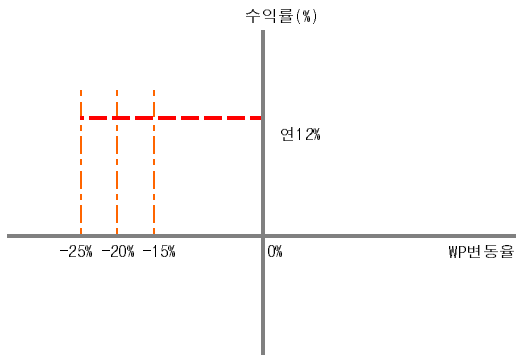
1. 계약금액

단위(백만원)

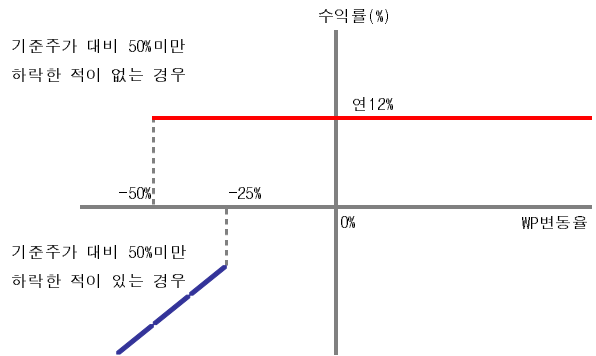
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 392 | 0 | 392 | 장익 |

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% | 16.97 | 13.41 | 9.86 | 6.30 | 2.74 | (0.81) | (4.37) |
| | 5.33% | 20.75 | 17.20 | 13.64 | 10.08 | 6.53 | 2.97 | (0.58) |
| | 2.67% | 18.65 | 15.10 | 11.54 | 7.98 | 4.43 | 0.87 | (2.68) |
| | 0.00% | 10.67 | 7.11 | 3.56 | 0.00 | (3.56) | (7.11) | (10.67) |
| | -2.67% | (3.20) | (6.76) | (10.31) | (13.87) | (17.42) | (20.98) | (24.54) |
| | -5.33% | (22.95) | (26.51) | (30.07) | (33.62) | (37.18) | (40.73) | (44.29) |
| | -8.00% | (48.59) | (52.15) | (55.70) | (59.26) | (62.81) | (66.37) | (69.93) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -69.93 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 64.28 |
|-----|-------|

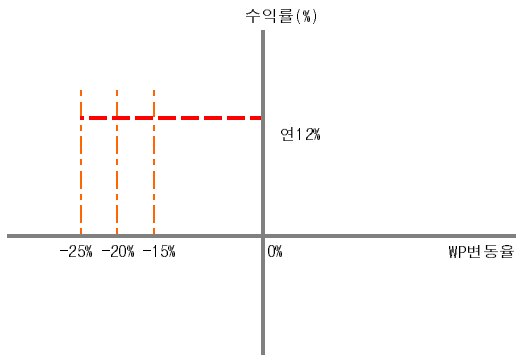
1. 계약금액

단위(백만원)

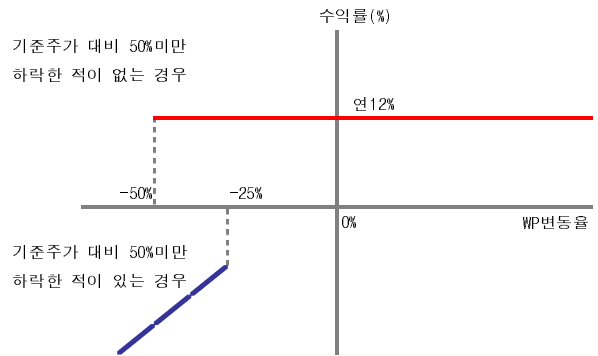
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 392 | 0 | 392 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6553366WC6 우리투자증권(ELS)2842

[11-3]

메리츠한중지수연계증권제3호

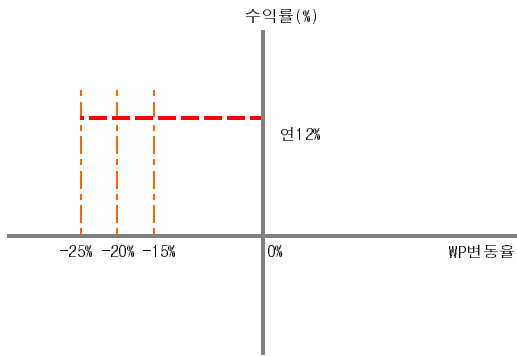
1. 계약금액

단위(백만원)

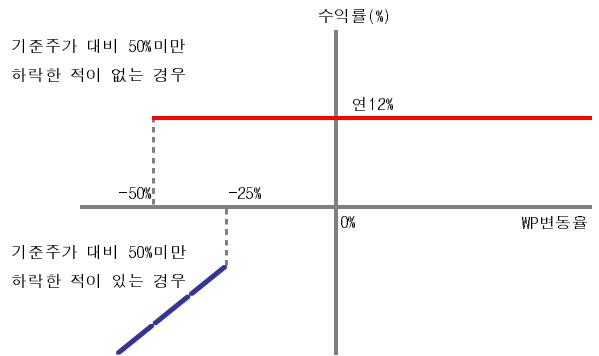
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 392 | 0 | 392 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR65733A3WC8 한국투자증권(ELS)1512

[11-4]

메리츠한중지수연계증권제3호

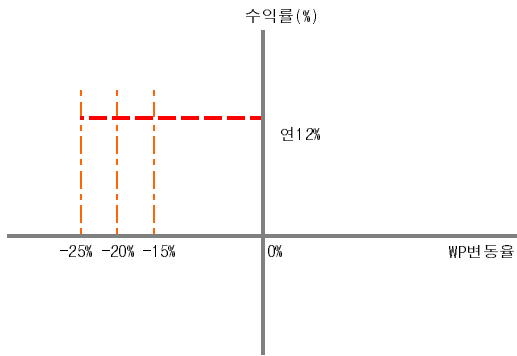
1. 계약금액

단위(백만원)

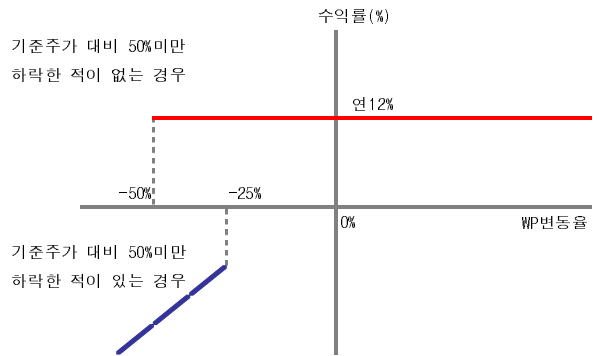
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 392 | 0 | 392 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

KR6663390WC3 동양(ELS)414

[12-1] 메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

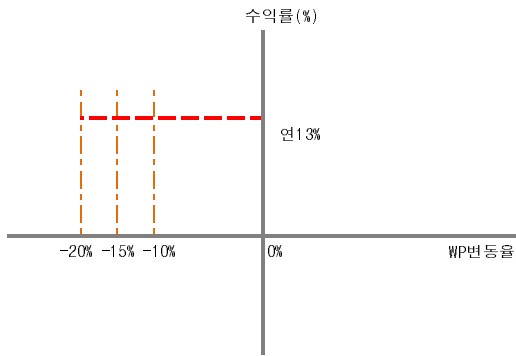
1. 계약금액

단위(백만원)

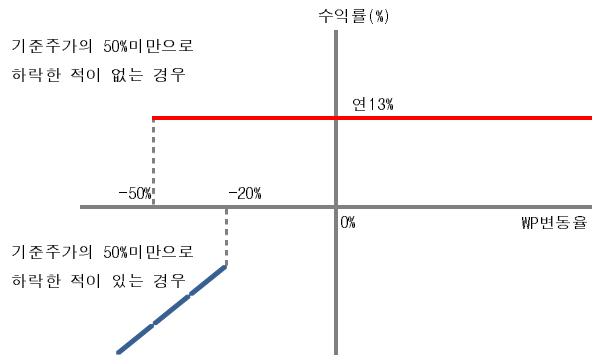
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,920 | 0 | 1,920 | 장익 |

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% | 93.95 | 72.68 | 51.40 | 30.13 | 8.85 | (12.42) | (33.70) |
| | 5.33% | 100.72 | 79.45 | 58.17 | 36.90 | 15.62 | (5.65) | (26.93) |
| | 2.67% | 90.68 | 69.40 | 48.13 | 26.86 | 5.58 | (15.69) | (36.97) |
| | 0.00% | 63.82 | 42.55 | 21.27 | 0.00 | (21.27) | (42.55) | (63.82) |
| | -2.67% | 20.16 | (1.12) | (22.39) | (43.67) | (64.94) | (86.22) | (107.49) |
| | -5.33% | (40.32) | (61.60) | (82.87) | (104.15) | (125.42) | (146.70) | (167.97) |
| | -8.00% | (117.62) | (138.89) | (160.17) | (181.44) | (202.72) | (223.99) | (245.27) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -245.27 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 211.99 |
|-----|--------|

[12-2]

메리츠한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

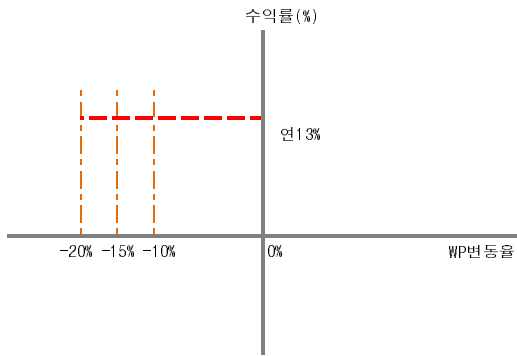
1. 계약금액

단위(백만원)

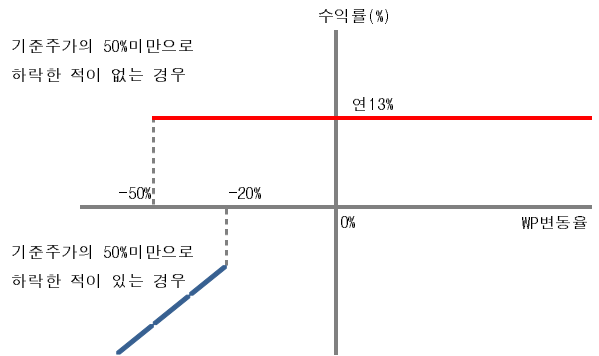
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,920 | 0 | 1,920 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6513130015 대신증권(ELS)948

[12-3] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

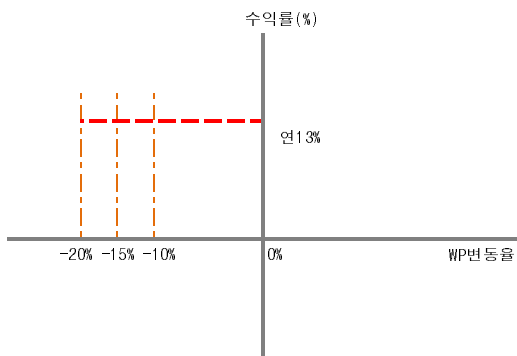
1. 계약금액

단위(백만원)

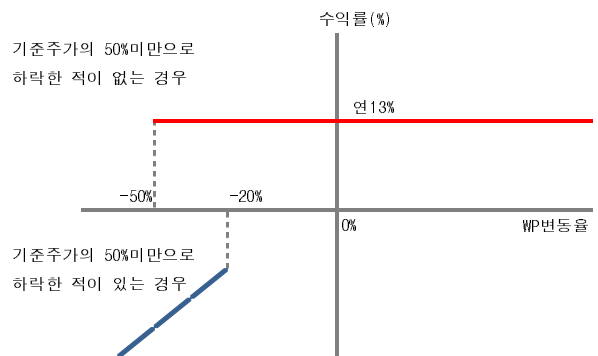
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,920 | 0 | 1,920 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6583341013 현대증권(ELS)2010-1179

[12-4] 메리트한중지수연계증권제4호[ELS-파생형]

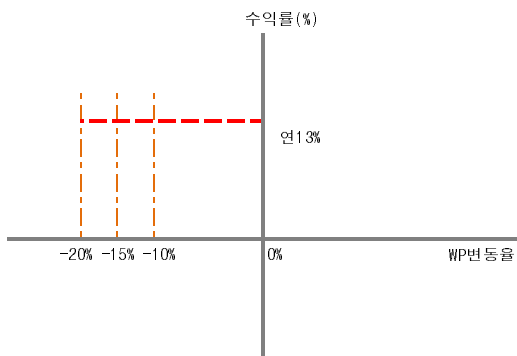
1. 계약금액

단위(백만원)

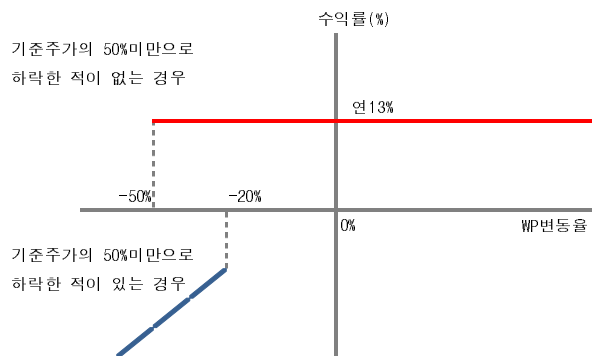
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,920 | 0 | 1,920 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703338014 H&D증권(ELS)431

[13-1] 메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

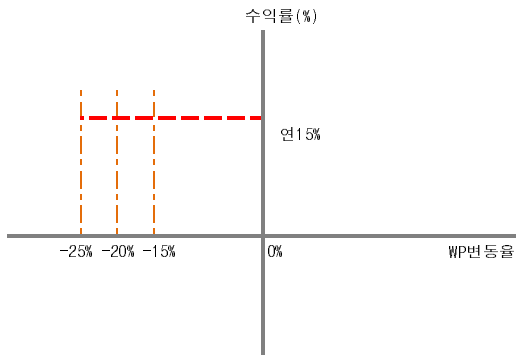
1. 계약금액

단위(백만원)

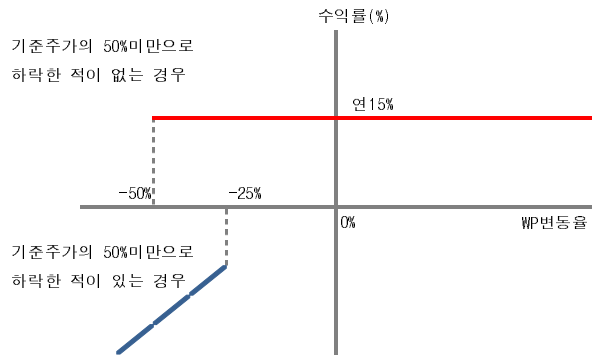
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 662 | 0 | 662 | 장익 |

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% | 88.83 | 74.57 | 60.30 | 46.03 | 31.76 | 17.49 | 3.22 |
| | 5.33% | 78.23 | 63.96 | 49.69 | 35.42 | 21.16 | 6.89 | (7.38) |
| | 2.67% | 62.89 | 48.62 | 34.35 | 20.08 | 5.81 | (8.46) | (22.72) |
| | 0.00% | 42.81 | 28.54 | 14.27 | 0.00 | (14.27) | (28.54) | (42.81) |
| | -2.67% | 17.99 | 3.72 | (10.55) | (24.82) | (39.09) | (53.36) | (67.63) |
| | -5.33% | (11.58) | (25.84) | (40.11) | (54.38) | (68.65) | (82.92) | (97.19) |
| | -8.00% | (45.87) | (60.14) | (74.41) | (88.68) | (102.95) | (117.22) | (131.49) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -131.49 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 126.01 |
|-----|--------|

[13-2]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

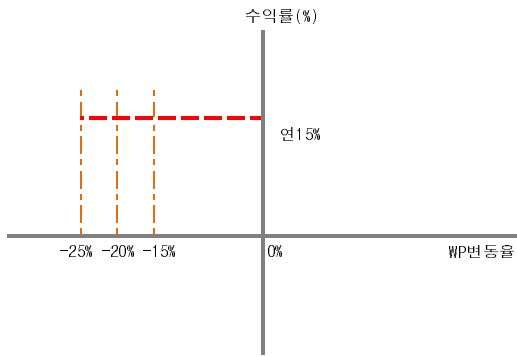
1. 계약금액

단위(백만원)

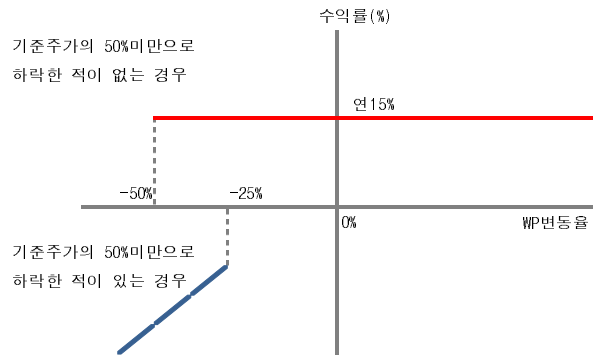
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 662 | 0 | 662 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6582134021 현대증권(ELS)2010-1193

[13-3]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

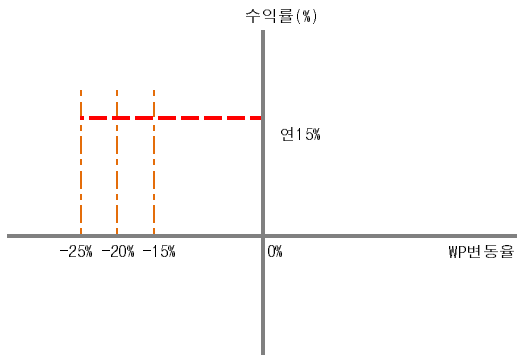
1. 계약금액

단위(백만원)

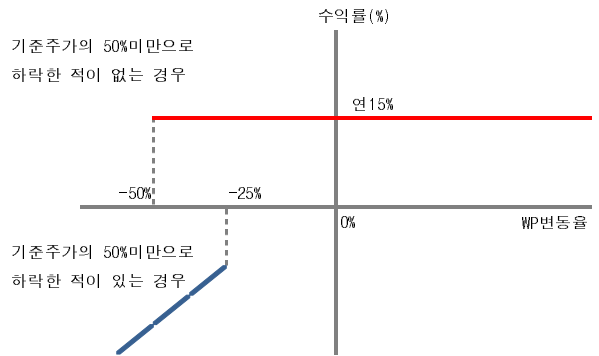
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 662 | 0 | 662 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6662335027 동양(ELS)459

[13-4]

메리츠2Star증권LESH-1호[ELS-파생형]

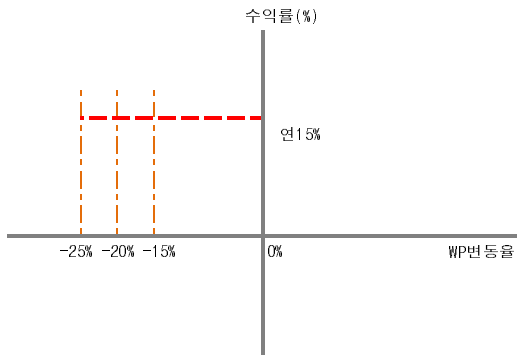
1. 계약금액

단위(백만원)

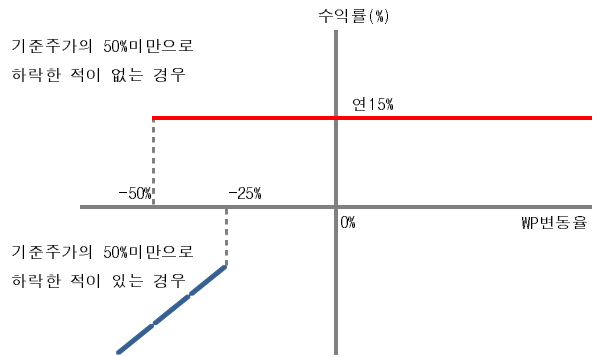
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 662 | 0 | 662 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6702328024 H&D증권(ELS)499

[14-1] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

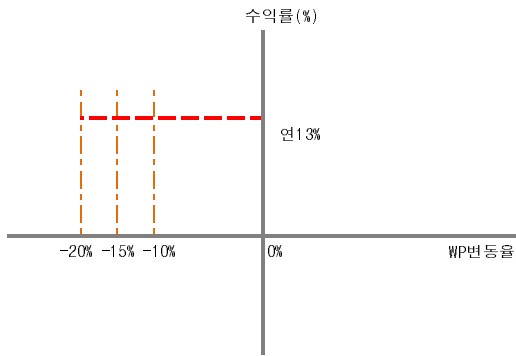
1. 계약금액

단위(백만원)

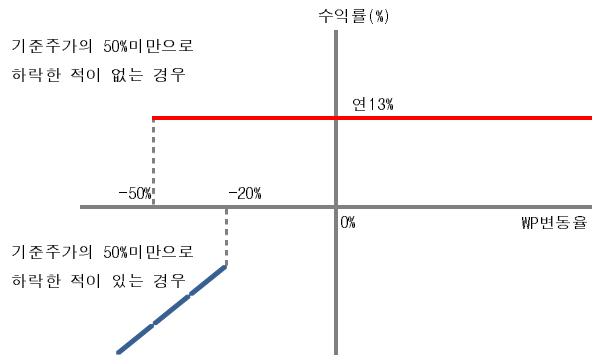
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,075 | 0 | 1,075 | 장익 |

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% | 52.15 | 41.60 | 31.06 | 20.51 | 9.97 | (0.58) | (11.12) |
| | 5.33% | 51.78 | 41.23 | 30.69 | 20.14 | 9.60 | (0.95) | (11.49) |
| | 2.67% | 44.94 | 34.39 | 23.85 | 13.30 | 2.76 | (7.78) | (18.33) |
| | 0.00% | 31.63 | 21.09 | 10.54 | 0.00 | (10.54) | (21.09) | (31.63) |
| | -2.67% | 11.86 | 1.32 | (9.23) | (19.77) | (30.31) | (40.86) | (51.40) |
| | -5.33% | (14.37) | (24.92) | (35.46) | (46.01) | (56.55) | (67.10) | (77.64) |
| | -8.00% | (47.08) | (57.62) | (68.17) | (78.71) | (89.25) | (99.80) | (110.34) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -110.34 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액(단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 104.22 |
|-----|--------|

[14-2] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

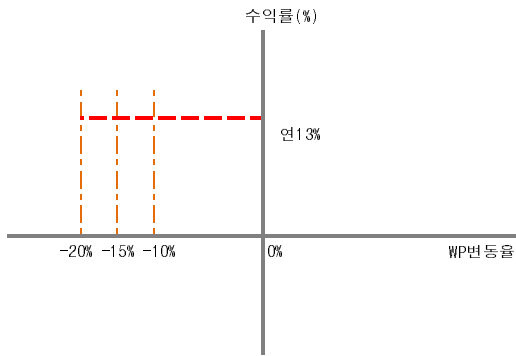
1. 계약금액

단위(백만원)

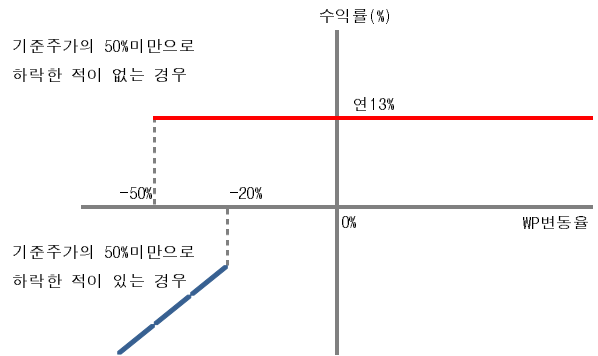
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,075 | 0 | 1,075 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6553313034 우리투자증권(ELS)2980

[14-3] 메리트한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

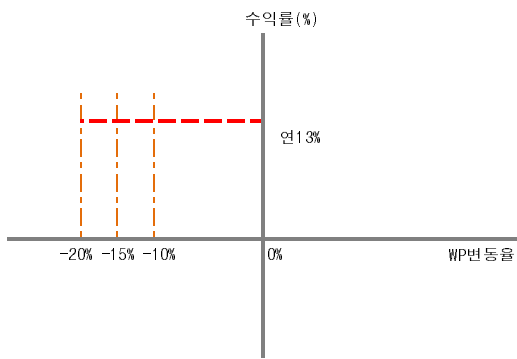
1. 계약금액

단위(백만원)

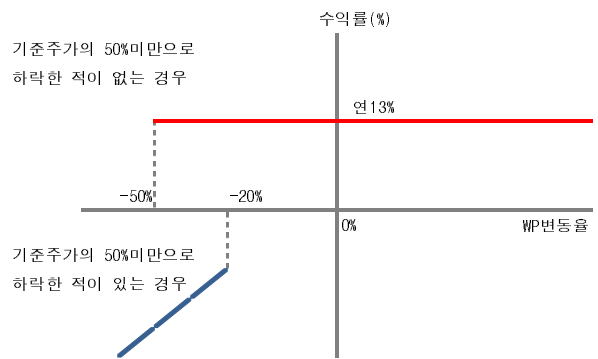
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,048 | 0 | 1,048 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6663306035 동양(ELS)485

[14-4] 메리츠한중지수연계증권제5호[ELS-파생형]

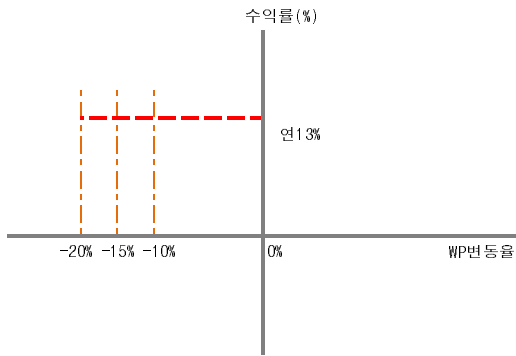
1. 계약금액

단위(백만원)

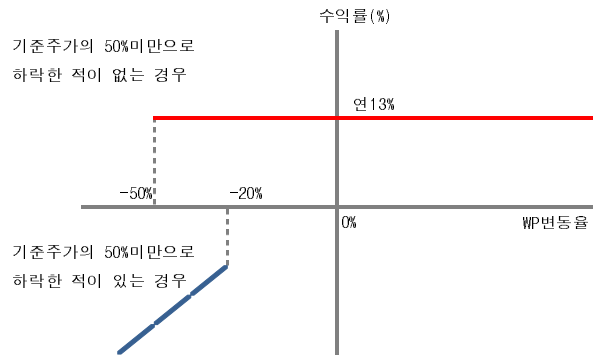
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,075 | 0 | 1,075 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대 손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6703307035 H&D증권(ELS)504

[15] 메리츠2Star증권LESF-1호[ELS-파생형]

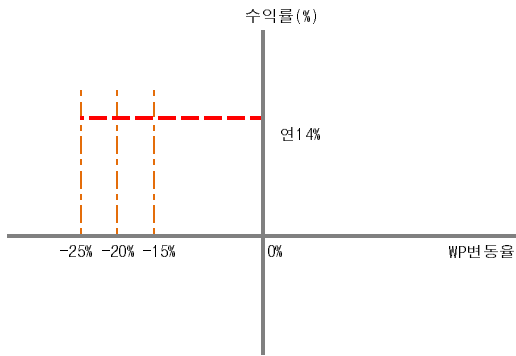
1. 계약금액

단위(백만원)

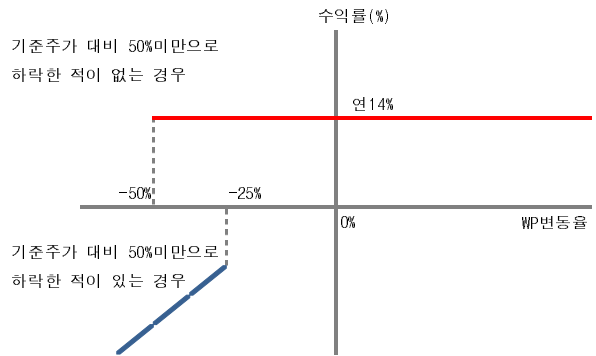
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,439 | 0 | 3,439 | 장익 |

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% | 89.99 | 76.91 | 63.82 | 50.74 | 37.65 | 24.57 | 11.48 |
| | 5.33% | 77.96 | 64.88 | 51.79 | 38.71 | 25.62 | 12.54 | (0.55) |
| | 2.67% | 61.05 | 47.96 | 34.88 | 21.79 | 8.71 | (4.38) | (17.46) |
| | 0.00% | 39.26 | 26.17 | 13.09 | 0.00 | (13.09) | (26.17) | (39.26) |
| | -2.67% | 12.58 | (0.51) | (13.59) | (26.68) | (39.76) | (52.85) | (65.93) |
| | -5.33% | (18.98) | (32.07) | (45.15) | (58.24) | (71.32) | (84.41) | (97.49) |
| | -8.00% | (55.42) | (68.51) | (81.59) | (94.68) | (107.76) | (120.85) | (133.93) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -133.93 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 106.20 |
|-----|--------|

[16] 메리츠2Star증권SEKE-1호[ELS-파생형]

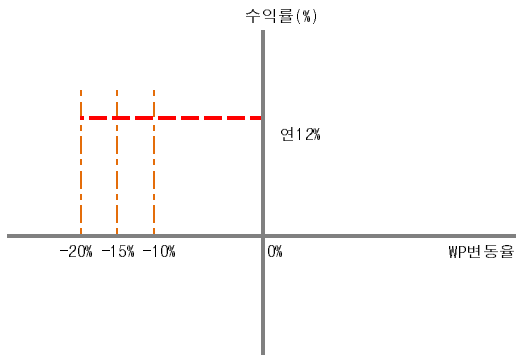
1. 계약금액

단위(백만원)

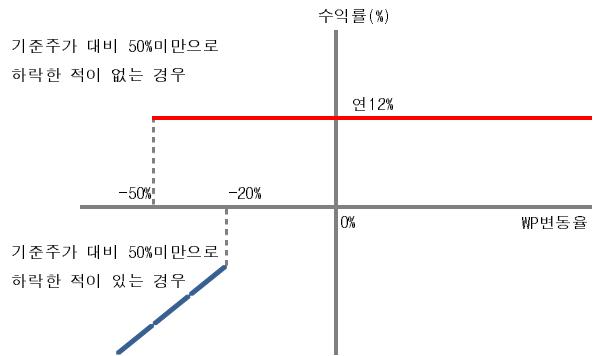
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,542 | 0 | 1,542 | 장익 |

2. 만기시점의 손익구조

조기상환시 손익구조



만기시 손익구조



3. 손익구조변동(최대손실가능금액(단위:백만원))

손익구조변동 시나리오 KR6502348032 신한투자(ELS)1408

| 구분 | | 변동성 시나리오 | | | | | | |
|----------------------|--------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0.00% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| 기초 자산 시나 리오 | 8.00% | 61.52 | 52.77 | 44.02 | 35.26 | 26.51 | 17.76 | 9.01 |
| | 5.33% | 52.02 | 43.27 | 34.52 | 25.77 | 17.01 | 8.26 | (0.49) |
| | 2.67% | 40.27 | 31.52 | 22.76 | 14.01 | 5.26 | (3.49) | (12.25) |
| | 0.00% | 26.26 | 17.50 | 8.75 | 0.00 | (8.75) | (17.50) | (26.26) |
| | -2.67% | 9.99 | 1.24 | (7.52) | (16.27) | (25.02) | (33.77) | (42.52) |
| | -5.33% | (8.53) | (17.29) | (26.04) | (34.79) | (43.54) | (52.30) | (61.05) |
| | -8.00% | (29.31) | (38.07) | (46.82) | (55.57) | (64.32) | (73.08) | (81.83) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | -81.83 |
|-----|--------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|-------|
| 위험액 | 87.13 |
|-----|-------|

[17] 메리츠2Star증권SEPO-2호[ELS-파생형]

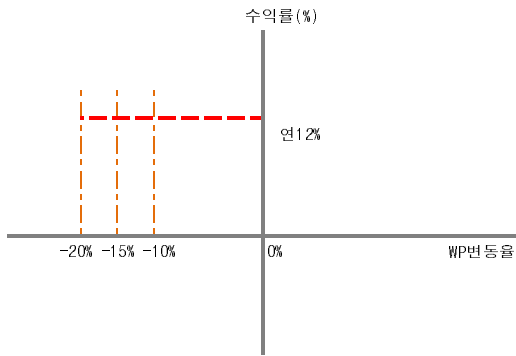
1. 계약금액

단위(백만원)

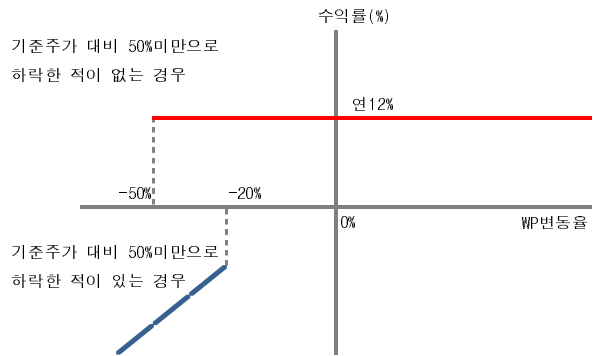
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,715 | 0 | 1,715 | 장익 |

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 시나리오 | 8.00% | 91.69 | 78.01 | 64.33 | 50.65 | 36.96 | 23.28 | 9.60 |
| | 5.33% | 77.18 | 63.49 | 49.81 | 36.13 | 22.45 | 8.77 | (4.91) |
| | 2.67% | 60.29 | 46.61 | 32.93 | 19.25 | 5.57 | (8.11) | (21.79) |
| | 0.00% | 41.04 | 27.36 | 13.68 | 0.00 | (13.68) | (27.36) | (41.04) |
| | -2.67% | 19.42 | 5.74 | (7.94) | (21.62) | (35.30) | (48.98) | (62.66) |
| | -5.33% | (4.57) | (18.25) | (31.93) | (45.61) | (59.29) | (72.97) | (86.65) |
| | -8.00% | (30.92) | (44.60) | (58.28) | (71.97) | (85.65) | (99.33) | (113.01) |

최대손실 시나리오

| | |
|-----|---------|
| 위험액 | -113.01 |
|-----|---------|

4. 파생상품의 최대 손실 예상금액 (단위:백만원)

| | |
|-----|--------|
| 위험액 | 111.83 |
|-----|--------|