

간접투자자산운용업감독규정 제 84조에 의한 파생상품간접투자기구의 위험 지표 공시

● 공시일: 2005-08-18

펀드명: 마이더스 two-star ELS 파생상품투자신탁 제1호

1. 계약금액

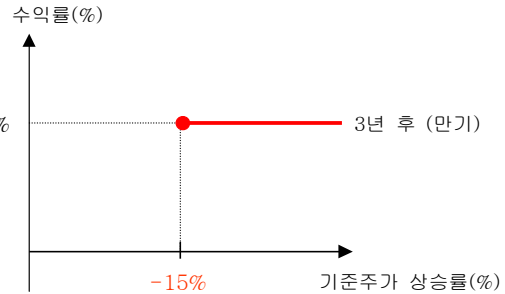
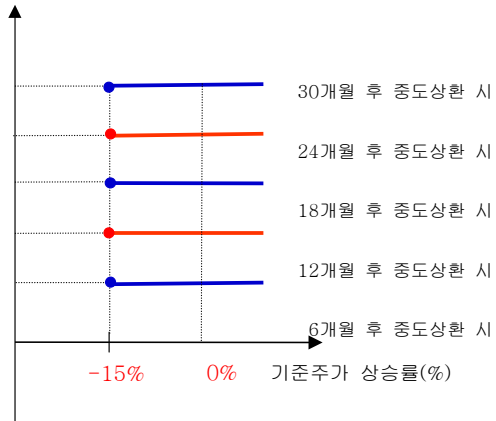
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	7,692		7,692	장외
누계	주식	ELS	7,692		7,692	장외
합계			7,692		7,692	장외

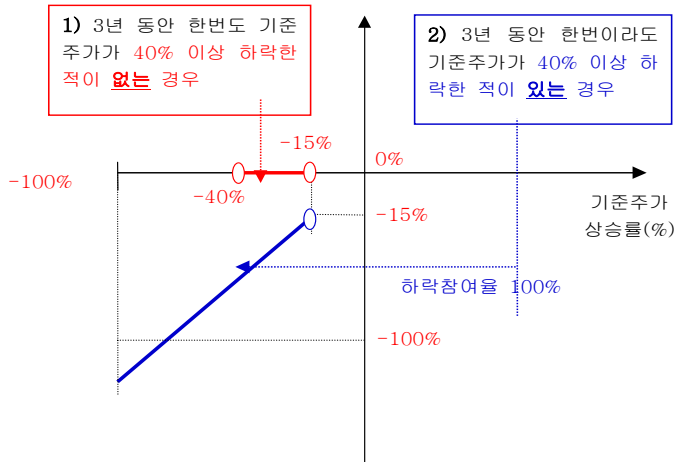
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기준주가 : 한국전력보통주와 한진해운보통주
- (2) 추가연계증권 발행자 : 굿모닝신한증권
- (3) 발행일 : 2005년 8월 16일
- (4) 만기일 : 2008년 8월 12일
- (5) 최초기준주가 : 2005년 08월 12일의 한국전력보통주 종가인 W36,300/ 한진해운보통주 종가인 W25,500
- (6) 중간평가일 : 2006년 2월 10일, 2006년 8월 10일, 2007년 2월 12일, 2007년 8월 10일, 2008년 2월 12일
- (7) 최종기준주가 : 2008년 8월 8일의 기준주가의 거래소 증가

수익률(%)



수익률(%)



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이더스two-star ELS 파생상품투자 614

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스two-star ELS 파생상품투자 923