

● 공시일: 2005-12-19

펀드명: 마이다스 two-star ELS 파생상품투자신탁 제1호

1. 계약금액

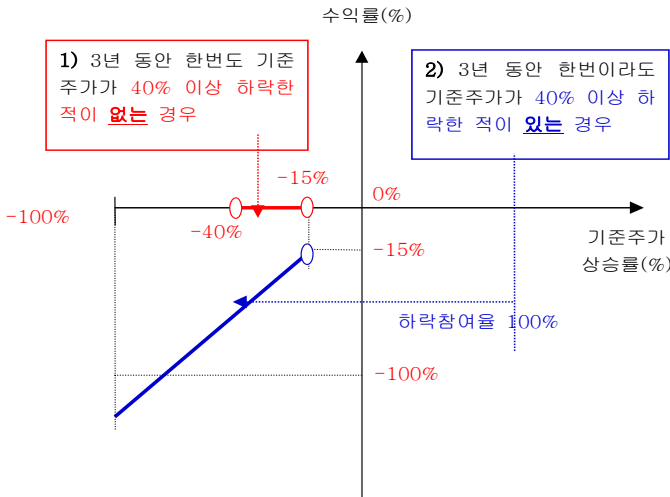
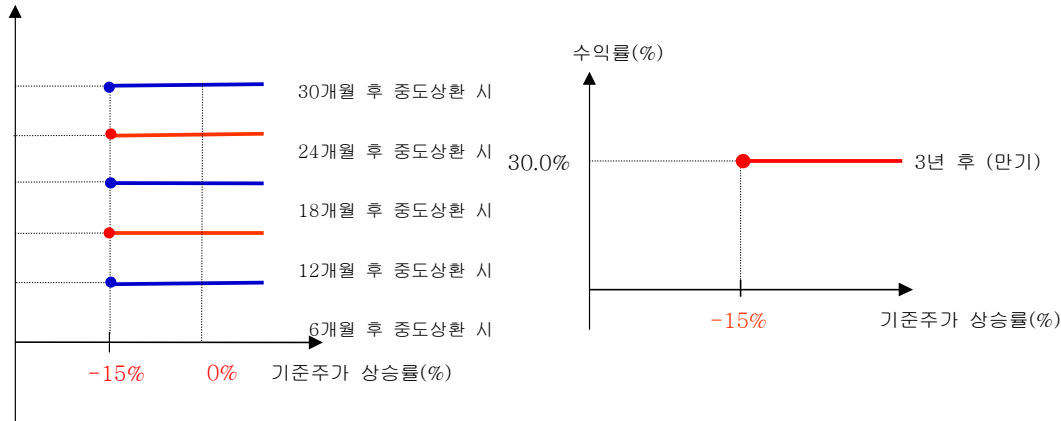
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				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 증가인 W36,300/ 한진해운보통주 증가인 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(%)



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스two-star ELS 파생상품투자1 **862**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스two-star ELS 파생상품투자1 **1,284**

펀드명 : 마이다스일본리츠지수연계파생상품투자1

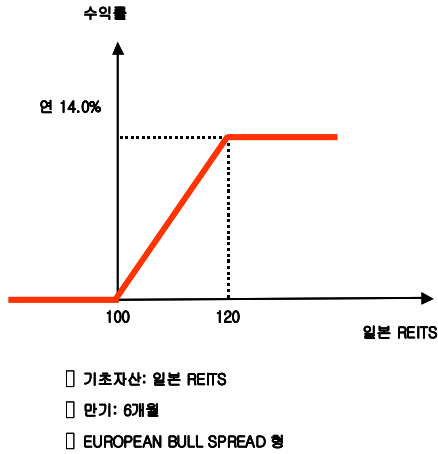
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	12,478		12,478	장외
합계			12,478		12,478	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기준지수 :Tokyo Stook Exchange REIT Index(TSREIT <Index>)
- (2) 주가연계증권 발행자 : 대신증권
- (3) 발행일 : 2005년 10월 4일
- (4) 만기일 : 2006년 10월 2일
- (5) 최초기준지수 : 2005년 9월 30일의 TSREIT <Index> 증가 1603.97
- (6) 최종기준지수 : 2006년 9월 22일, 9월 25일, 9월 26일, 9월 27일, 9월 28일 기초자산 지수증가의 산술평가



예 상 손 익 예 시	
만기 지수 상승률	수익율(연)
20%이상	14.00%
20%	14.00%
15%	10.50%
10%	7.00%
5%	3.50%
0%	0.00%
0%이하	0.00%

3. 시나리오법에 의한 손익변동 (단위: 백만원)

마이다스일본리츠지수연계파생상품투자1 **217**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일) (단위: 백만원)

마이다스일본리츠지수연계파생상품투자1 **323**

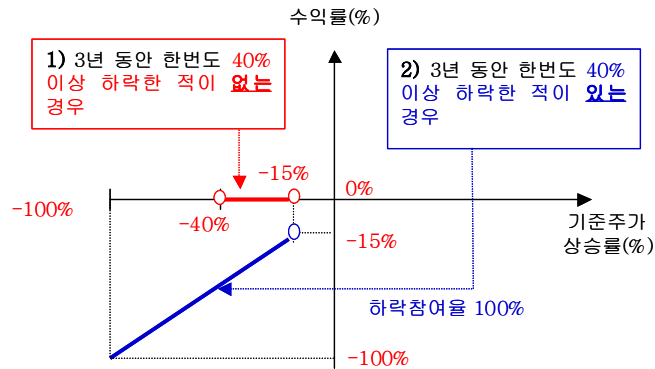
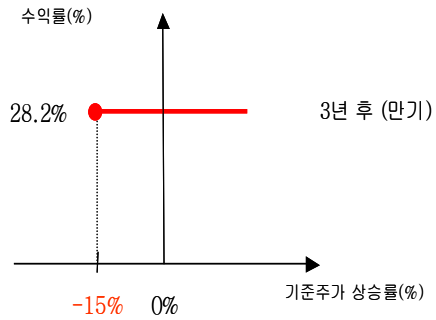
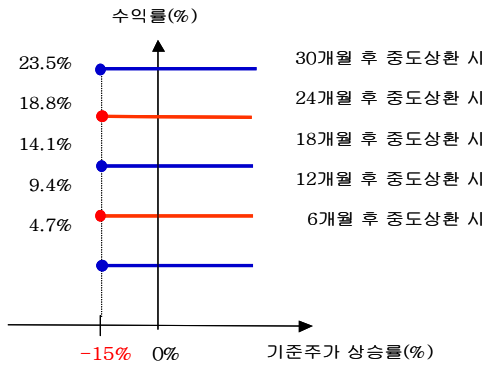
1. 계약금액

구분		거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식		ELS				장외
누계	주식		ELS	9,240		9,240	장외
합계				9,240		9,240	장외

(단위: 백만원)

2. 파생상품 거래에 따른 만기 수익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, 기업은행 보통주
- (2) 추가연계증권 발행자 : 굿모닝신한증권
- (3) 발행일 : 2005년 10월 27일
- (4) 만기일 : 2008년 10월 29일
- (5) 최초기준주가 : 삼성전자 보통주 565,000원, 기업은행 보통주 12,950원
(2005년 10월 24일, 10월 25일 및 10월 26일 각 기초자산 증가의 산술평균)
- (6) 최종기준주가 : 2008년 10월 23일, 10월 24일, 10월 27일 증가의 평균



3. 시나리오법에 의한 수익변동

마이다스two-star ELS 파생상품투자 KS-1

(단위: 백만원)

453

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

마이다스two-star ELS 파생상품투자 KS-1

(단위: 백만원)

239

1. 계약금액

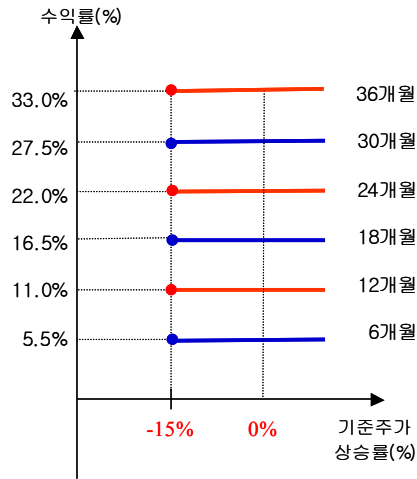
구분		거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식		ELS				장외
누계	주식		ELS	8,855		8,855	
합계				8,855		8,855	장외

(단위: 백만원)

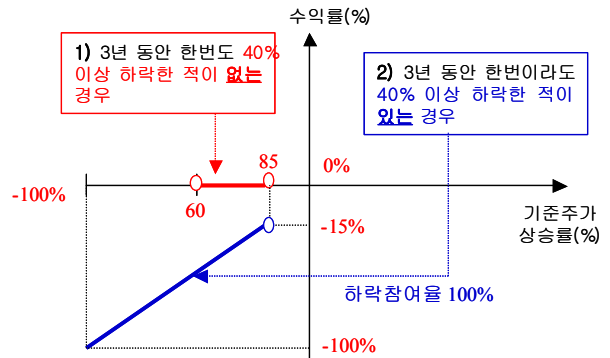
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : POSCO 보통주, 우리금융 보통주
- (2) 추가연계증권 발행자 : 굿모닝신한증권
- (3) 발행일 : 2005년 11월 17일
- (4) 만기일 : 2008년 11월 19일
- (5) 최초기준주가 : POSCO 보통주 213,166원, 우리금융 보통주 18,900원
(2005년 11월 14일, 11월 15일 및 11월 16일 각 기초자산 증가의 산술평균)
- (6) 최종기준주가 : 2008년 11월 13일, 11월 14일, 11월 17일 증가의 평균

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동 (단위: 백만원)
마이다스two-star ELS 파생상품투자 PW-1 **628**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일) (단위: 백만원)
마이다스two-star ELS 파생상품투자 PW-1 **1,090**

1. 계약금액

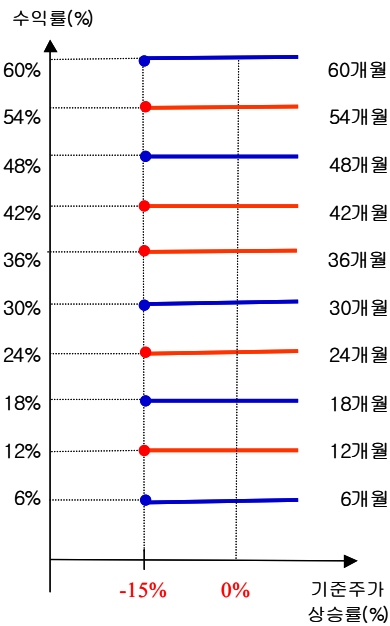
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	5,970		5,970	장외
합계			5,970		5,970	장외

(단위: 백만원)

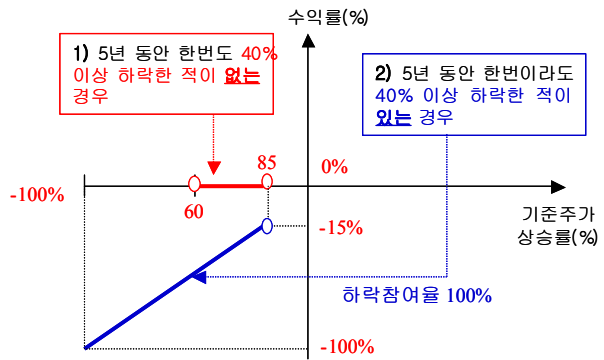
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : POSCO 보통주, 현대차 보통주
- (2) 추가연계증권 발행자 : 굿모닝신한증권
- (3) 발행일 : 2005년 12월 05일
- (4) 만기일 : 2010년 12월 03일
- (5) 최초기준주가 : POSCO 보통주 205,833원, 현대차 보통주 87,533원
(2005년 11월 30일, 12월 01일 및 12월 02일 각 기초자산 종가의 산술평균)
- (6) 최종기준주가 : 2010년 11월 29일, 11월 30일, 12월 01일의 POSCO 보통주, 현대차 보통주 종가의 산술평균

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



- 1)의 경우 : 만기상환금 = 원금
- 2)의 경우 : 만기상환금 = 원금 × (1 - 하락률이 높은 종목의 하락률)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

마이다스two-star ELS 파생상품투자 PH-1 (단위: 백만원) **412**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

마이다스two-star ELS 파생상품투자 PH-1 (단위: 백만원) **782**