

간접투자자산운용업감독규정 제 84조에의한 파생상품간접투자기구의 위험 지표 공시

● 공시일: 2006-09-13

펀드명 : 마이다스일브리츠지수연계파생상품투자1

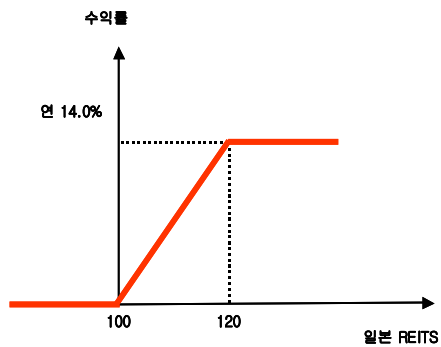
1. 계약금액

(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 거래에따른 만기 손익구조

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



- 기초자산: 일본 REITS
- 만기: 6개월
- EUROPEAN BULL SPREAD 형

예 상 손 익 예 시

만기지수상승률	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)

마이다스일브리츠지수연계파생상품투자1 **637**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스일브리츠지수연계파생상품투자1 **773**

1. 계약금액

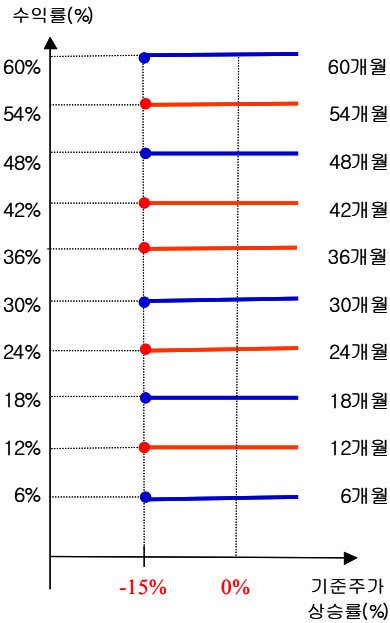
(단위: 백만원)

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

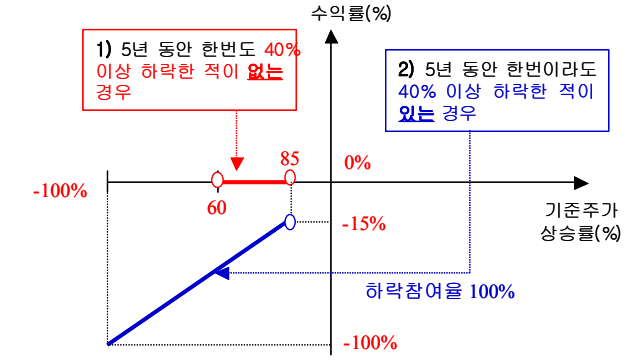
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (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

(단위: 백만원)

마이다스two-star ELS 파생상품투자 PH-1 **488**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스two-star ELS 파생상품투자 PH-1 **824**

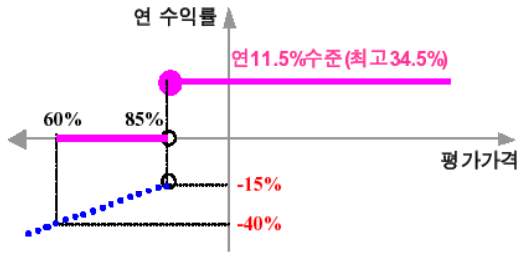
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	6,337		6,337	장외
합계			6,337		6,337	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : POSCO 보통주, 현대차 보통주
- (2) 추가연계증권 발행자 : ㈜외환은행
- (3) 발행일 : 2005년 12월 21일
- (4) 만기일 : 2008년 12월 24일
- (5) 최초기준주가 : 2005년 12월 21일 증가
- (6) 최종기준주가 : 2008년 12월 19일의 증가
- (7) 중간평가일 : 2006년 6월 20일, 2006년 12월 20일, 2007년 6월 20일, 2007년 12월 20일, 2008년 6월 20일 각 증가



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스two-star ELS 파생상품투자 PH-2

538

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스two-star ELS 파생상품투자 PH-2

1,132

1. 계약금액

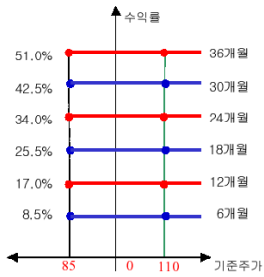
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	40,623		40,623	장외
합계			40,623		40,623	장외

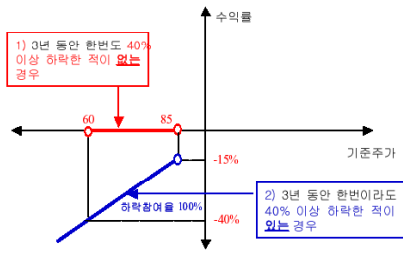
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, 삼성화재 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 3월 22일
- (3) 만기일 : 2009년 3월 16일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 636,666원, 삼성화재 보통주 131,333원
- (5) 최초기준주가 : 2006년 3월 17일, 20일, 21일 증가의 평균
- (6) 최종기준주가 : 2009년 3월 12일 증가3
- (7) 중간평가일 : 2006년 9월 13일, 2007년 3월 14일, 2007년 9월 12일, 2008년 3월 12일, 2008년 9월 11일의 각 증가

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

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 SS-2

0

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 SS-2

0

1. 계약금액

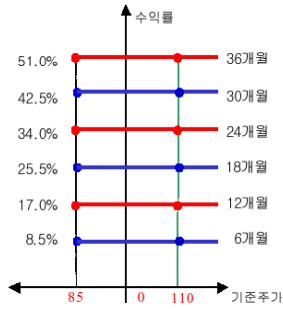
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	22,452		22,452	장외
합계			22,452		22,452	장외

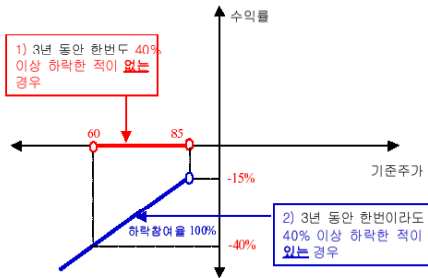
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, 삼성화재 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 3월 30일
- (3) 만기일 : 2009년 3월 25일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 623,000원, 삼성화재 보통주 125,500원
- (5) 최초기준주가 : 2006년 3월 30일 종가
- (6) 최종기준주가 : 2009년 3월 25일 종가
- (7) 중간평가일 : 2006년 9월 27일, 2007년 3월 27일, 2007년 9월 21일, 2008년 3월 26일, 2008년 9월 25일의 각 종가

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

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 SS-3

0

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 SS-3

0

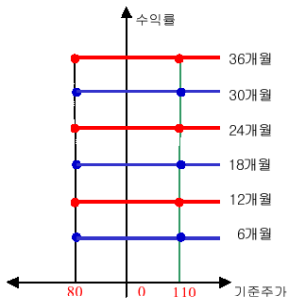
1. 계약금액

						(단위: 백만원)
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	19,612		19,612	장외
합계			19,612		19,612	장외

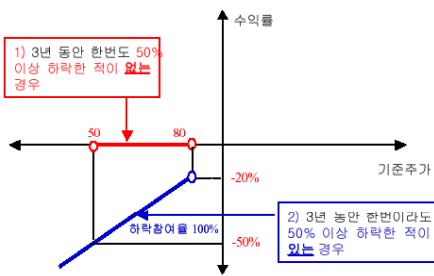
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, 삼성화재 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 4월 6일
- (3) 만기일 : 2009년 4월 2일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 649,000원, 삼성화재 보통주 129,666원
- (5) 최초기준주가 : 2006년 4월 3일, 4일, 5일 증가의 산술 평균
- (6) 최종기준주가 : 2009년 3월 27일, 30일, 31일 증가의 산술 평균
- (7) 중간평가일 : 2006년 9월 28일, 2007년 3월 29일, 2007년 9월 28일, 2008년 3월 31일, 2008년 9월 30일의 각 증가

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

마이다스New 2Star 파생상품투자 SS-4 (단위: 백만원)

0

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

마이다스New 2Star 파생상품투자 SS-4 (단위: 백만원)

0

1. 계약금액

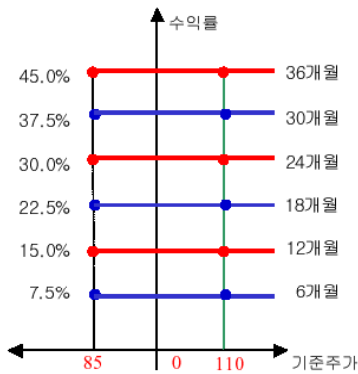
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	22,444		22,444	장외
합계			22,444		22,444	장외

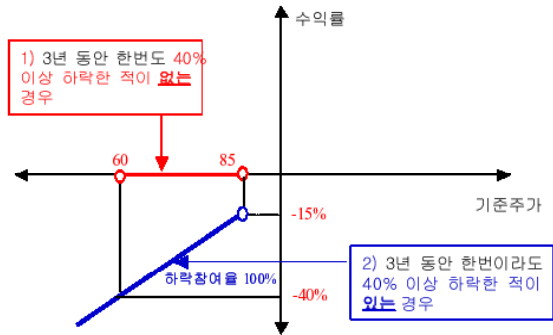
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : SK텔레콤 보통주, 삼성화재 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 4월 25일
- (3) 만기일 : 2009년 4월 23일
- (4) 기준가격 : SK텔레콤 보통주 218,000원, 삼성화재 보통주 136,500원
- (5) 최초기준주가 : 2006년 4월 24일 종가
- (6) 최종기준주가 : 2009년 4월 21일 종가
- (7) 중간평가일 : 2006년 10월 19일, 2007년 4월 19일, 2007년 10월 19일, 2008년 4월 21일, 2008년 10월 21일의 각 종가

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

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 ST-1호 **2,378**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 ST-1호 **2,615**

펀드명 : 마이다스 New 주가지수연계 파생상품1호

1. 계약금액

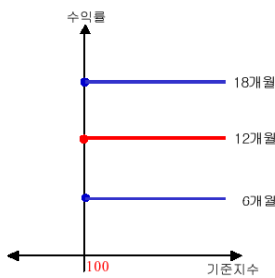
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	1,169		1,169	장외
합계			1,169		1,169	장외

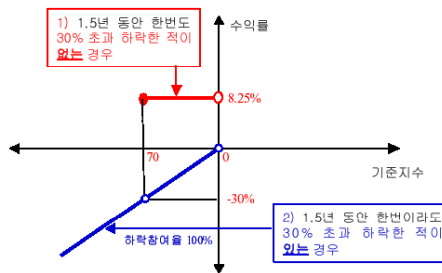
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2006년 5월 16일
- (3) 만기일 : 2007년 11월 14일
- (4) 기준가격 : 2006년 5월 15일 기초자산 증가(183.08)
- (5) 최종기준주가 : 2007년 11월 12일의 기초자산 증가
- (6) 중간평가일 : 2006년 11월 10일, 2007년 5월 10일의 각 증가

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 New 주가지수연계 파생상품1호

86

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 New 주가지수연계 파생상품1호

138

1. 계약금액

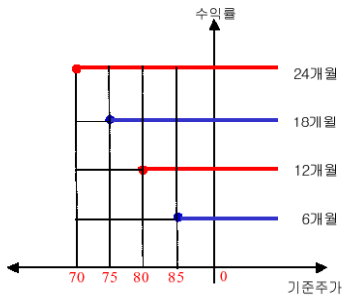
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	30,656		30,656	
합계			30,656		30,656	장외

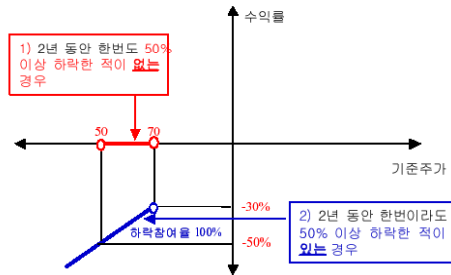
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, 하이닉스 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 5월 17일
- (3) 만기일 : 2008년 5월 9일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 648,666원, 하이닉스 보통주 33,050원(2006년 5월 12일, 15일, 16일 각 종가의 평균)
- (5) 최종기준주가 : 2008년 5월 7일의 기초자산 종가
- (6) 중간평가일 : 2006년 11월 8일, 2007년 5월 9일, 2007년 11월 7일의 각 종가

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이더스 New 2Star 파생상품투자신탁 SH-1 971

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 New 2Star 파생상품투자신탁 SH-1 649

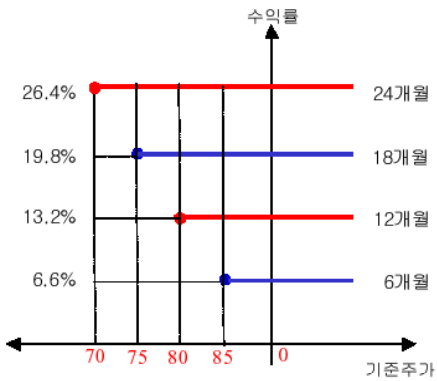
1. 계약금액

						(단위: 백만원)
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	16,221		16,221	장외
합계			16,221		16,221	장외

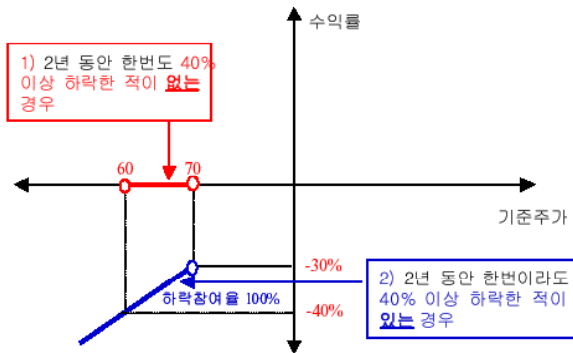
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, 삼성증권 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 5월 24일
- (3) 만기일 : 2008년 5월 23일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 621,666원, 삼성증권 보통주 52,800원(2006년 5월 25일, 26일, 29일 각 종가의 평균)
- (5) 최종기준주가 : 2008년 5월 19일, 20일, 21일의 기초자산 종가의 평균
- (6) 중간평가일 : 2006년 11월 17일, 20일, 21일, 2007년 5월 17일, 18일, 21일, 2007년 11월 19일, 20일, 21일의 각 종가

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동 (단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 SE-1 790

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일) (단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 SE-1 590

1. 계약금액

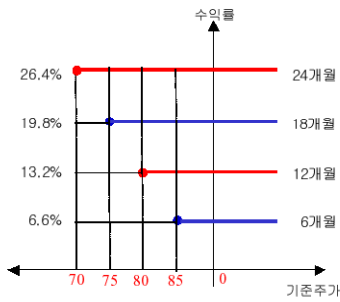
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	9,128		9,128	
합계			9,128		9,128	장외

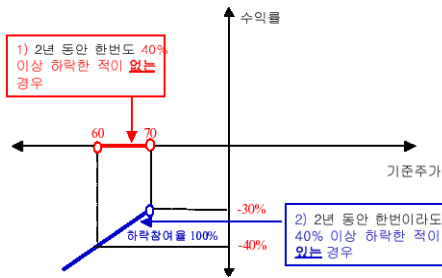
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, 삼성증권 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 6월 12일
- (3) 만기일 : 2008년 6월 5일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 583,000원, 삼성증권 보통주 46,933원(2006년 6월 7일, 8일, 9일 각 종가의 평균)
- (5) 최종기준주가 : 2008년 5월 30일, 6월 2일, 3일의 기초자산 종가의 평균
- (6) 중간평가일 : 2006년 11월 30일, 12월 1일, 4일, 2007년 5월 30일, 31일, 6월 1일, 2007년 11월 30일, 12월 3일, 4일의 각 종가 평균

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

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 SE-2

198

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 SE-2

145

1. 계약금액

(단위: 백만원)

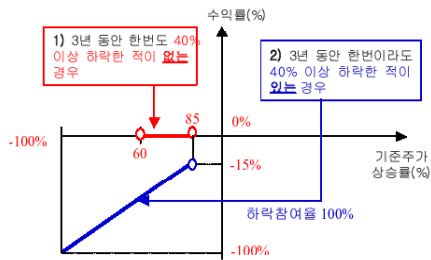
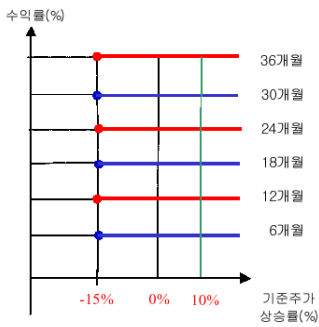
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	12,852		12,852	장외
합계			12,852		12,852	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, KT&G 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 6월 14일
- (3) 만기일 : 2009년 6월 8일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 565,333원, KT&G 보통주 52,400원(2006년 6월 9일, 12일, 13일 각 종가의 평균)
- (5) 최종기준주가 : 2009년 6월 4일의 기초자산 종가
- (6) 중간평가일 : 2006년 12월 6일, 2007년 6월 5일, 2007년 12월 5일, 2008년 6월 3일, 2008년 12월 4일 각 종가

조기상환 조건 충족 시

조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 SK-1 0

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 SK-1 6

1. 계약금액

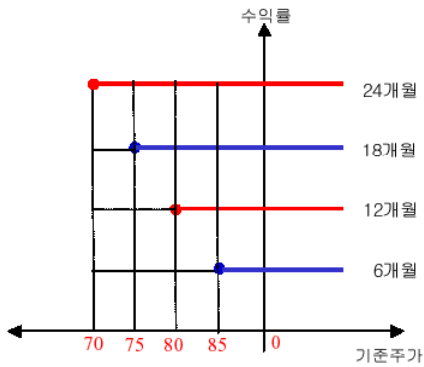
구분		거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식		ELS				장외
누계	주식		ELS	8,954		8,954	장외
합계				8,954		8,954	장외

(단위: 백만원)

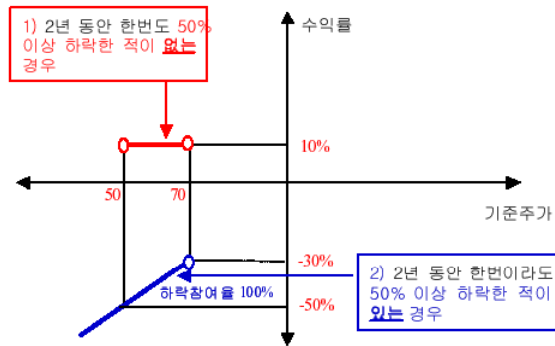
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 삼성전자 보통주, KT&G 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 7월 3일
- (3) 만기일 : 2008년 6월 27일
- (4) 기준가격 : 삼성전자 보통주 50,216원, KT&G 보통주 54,466원(2006년 6월 28일, 29일, 30일 각 종가의 평균)
- (5) 최종기준주가 : 2008년 6월 23일, 24일, 25일 의 기초자산 종가의 평균
- (6) 중간평가일 : 2006년 12월 20일, 21일, 22일, 2007년 6월 21일, 22일, 25일, 2007년 12월 19일, 20일, 21일의 각 종가 평균

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 KS-1 **68**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 KS-1 **150**

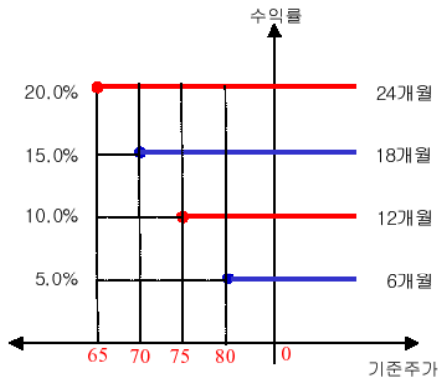
1. 계약금액

						(단위: 백만원)
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	4,275		4,275	장외
합계			4,275		4,275	장외

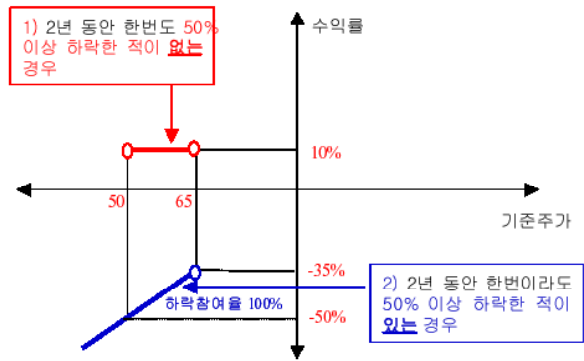
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : POSCO 보통주, 대우조선해양 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 7월 5일
- (3) 만기일 : 2008년 7월 11일
- (4) 기준가격 : POSCO 보통주 253,166원, 대우조선해양 보통주 27,666원(2006년 6월 28일, 29일, 30일 기초자산 각 종가의 평균)
- (5) 최종기준주가 : 2008년 7월 1일, 2일, 3일 의 기초자산 종가의 평균
- (6) 중간평가일 : 2007년 1월 3일, 4일, 5일, 2007년 7월 2일, 3일, 4일, 2008년 1월 3일, 4일, 7일의 각 종가 평균

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동 (단위: 백만원)
 마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 PD-1 **284**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일) (단위: 백만원)
 마이다스 New 2Star 파생상품투자신탁 PD-1 **309**

1. 계약금액

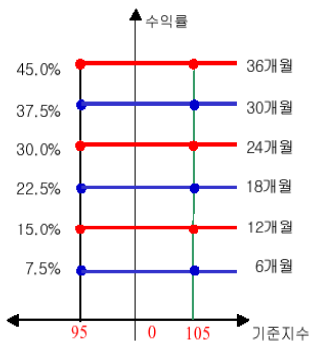
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	4,239		4,239	장외
합계			4,239		4,239	장외

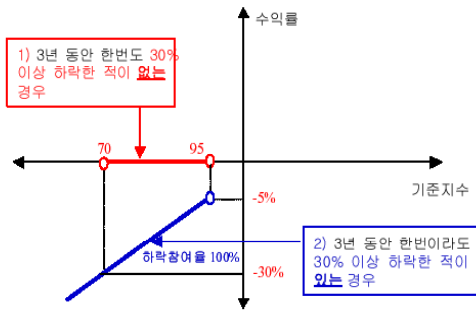
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : KOSPI200지수 / NIKKEI225지수
- (2) 발행일 : 2006년 7월 10일
- (3) 만기일 : 2009년 7월 6일
- (4) 기준가격 : 2006년 7월 7일의 기초자산 각각의 종가(KOSPI200 : 164.70, NIKKEI225 : 15,307.61)
- (5) 최종기준주가 : 2009년 7월 2일 기초자산 종가
- (6) 중간평가일 : 2007년 1월 3일, 2007년 7월 4일, 2008년 1월 2일, 2008년 7월 2일, 2009년 1월 2일의 각 종가

조기상환 조건 충족 시



조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Index 파생상품투자신탁 KN-1 0

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Index 파생상품투자신탁 KN-1 0

1. 계약금액

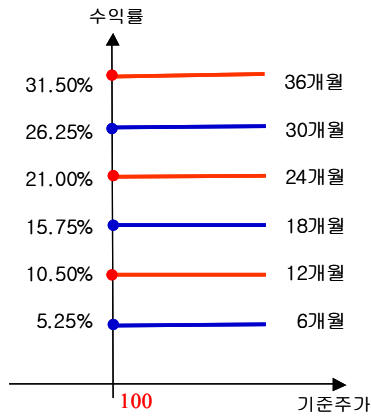
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	10,359		10,359	장외
합계			10,359		10,359	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 우리금융 보통주, KT 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 8월 7일
- (3) 만기일 : 2009년 8월 3일
- (4) 기준가격 : 2006년 8월 4일의 기초자산 각각의 증가(우리금융 : 19,150원 KT : : 39,100원)
- (5) 최종기준주가 : 2009년 7월 30일 기초자산 증가
- (6) 중간평가일 : 2007년 1월 30일, 2007년 8월 1일, 2008년 1월 30일, 2008년 7월 30일, 2009년 1월 30일의 각 증가

조기상환 조건 충족 시



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 KW-1호

317

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 KW-1호

342

1. 계약금액

(단위: 백만원)

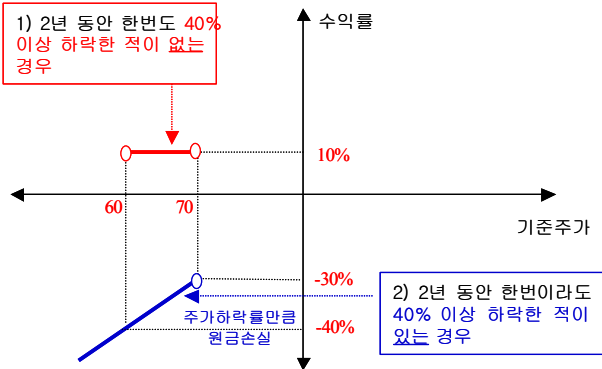
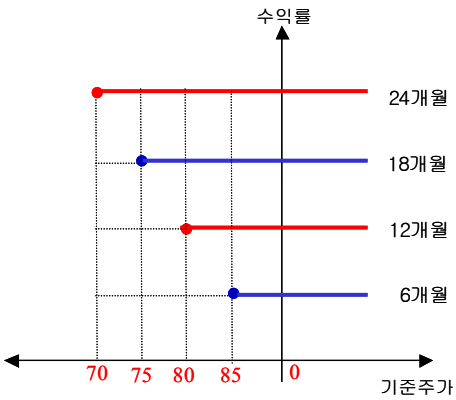
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	15,957		15,957	장외
합계			15,957		15,957	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 우리금융 보통주, 하이닉스 보통주
- (2) 발행일 : 2006년 8월 17일
- (3) 만기일 : 2008년 8월 8일
- (4) 기준가격 : 2006년 8월 11일, 14일, 16일의 기초자산 각각의 증가(우리금융 보통주 : 18,583원, 하이닉스 보통주 : 32,750원)
- (5) 최종기준주가 : 2008년 8월 4일, 5일, 6일 기초자산 증가 평균
- (6) 중간평가일 : 2007년 2월 7일, 2007년 8월 8일, 2008년 2월 1일의 각 증가

조기상환 조건 충족 시

조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 WH-1호

899

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스New 2Star 파생상품투자 WH-1호

1,311