

펀드명 : 마이다스 New 2Star파생상품투자신탁HCHY-2

공시일: 2011-06-28

1. 계약금액

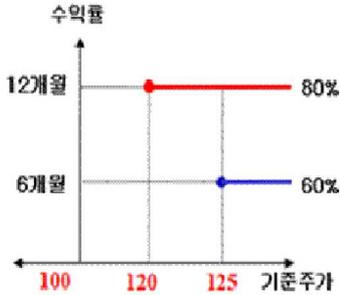
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	117		117	장외
합계			117		117	장외

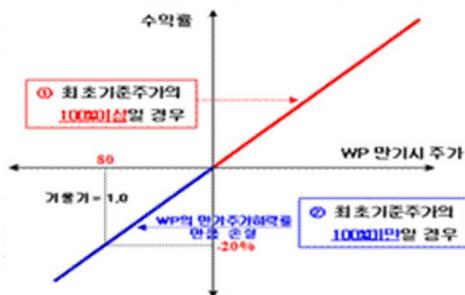
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 하이닉스, 현대차
- (2) 발행일 : 2008년 09월 23일
- (3) 만기일 : 2011년 09월 21일
- (4) 최초기준주가 : 2008년 09월 22일
- (5) 최종기준주가 : 2011년 09월 19일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 굿모닝신한증권

[그림A] 조기상환 조건 충족시



[그림B] 조기상환 조건을 충족하지 못하고 만기시



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star파생상품투자신탁HCHY: **13**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star파생상품투자신탁HCHY: **26**

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS		0	0	0 장의
누계	주식	ELS	3153500000			0 장의
합계				0		0 장의

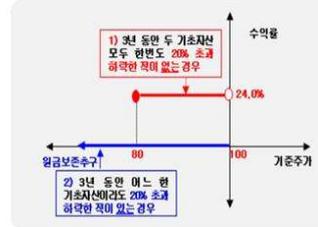
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : KOSPI200 Index, KT
- (2) 발행일 : 2010년 03월 23일
- (3) 만기일 : 2013년 03월 21일
- (4) 최초기준주가 : 2010년 03월 22일
- (5) 최종기준주가 : 2013년 03월 19일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자

[그림A] 조기(만기) 상환 조건 충족시



[그림B] 조기(만기) 상환 조건을 충족하지 못하고 만기시



3. 시나리오법에 의한 손익변동

마이다스 2Star증권투자신탁W-1(ELS-파생) (단위: 백만원)
99947685.92

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

마이다스 2Star증권투자신탁W-1(ELS-파생) (단위: 백만원)
201225383.5

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS		0	0	0 장의
누계	주식	ELS	1802500000			0 장의
합계				0		0 장의

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : SK에너지, SK텔레콤
- (2) 발행일 : 2010년 03월 23일
- (3) 만기일 : 2013년 03월 21일
- (4) 최초기준주가 : 2010년 03월 22일
- (5) 최종기준주가 : 2013년 03월 19일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자



3. 시나리오법에 의한 손익변동

마이다스 2Star증권투자신탁W-2(ELS-파생) (단위: 백만원)
89479982.24

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

마이다스 2Star증권투자신탁W-2(ELS-파생) (단위: 백만원)
181500803.9

펀드명 : 마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생)

공시일:

2011-06-28

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS	0	0	0	0 장외
누계	주식	ELS	7515730000	0	0	0 장외
합계				0	0	0 장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : LG전자, SK텔레콤
- (2) 발행일 : 2010년 04월 20일
- (3) 만기일 : 2013년 04월 18일
- (4) 최초기준주가 : 2010년 04월 19일
- (5) 최종기준주가 : 2013년 04월 16일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 대신증권



3. 시나리오범에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생) 72258510.75

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생) 97173857.67

마이더스에셋

펀드명 : 마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생)

공시일:

2011-06-28

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS	0	0	0	0 장외
누계	주식	ELS	2275800000	0	0	0 장외
합계			0	0	0	0 장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)
마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생) 185350444.4

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)
마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생) 144212280.7

마이다스에셋

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS		0	0	0 장의
누계	주식	ELS	24872840000			0 장의
합계				0		0 장의

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

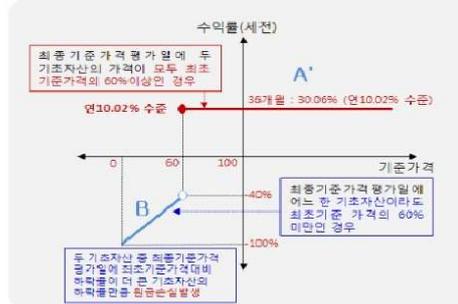
2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 03월 08일
- (3) 만기일 : 2014년 03월 06일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 03월 07일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 03월 04일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)
마이다스2Index증권프리미어KH-1(ELS-파): 1722029463

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)
마이다스2Index증권프리미어KH-1(ELS-파): 514653536.6

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS		0	0	0 장의
누계	주식	ELS	24147460000			0 장의
합계				0		0 장의

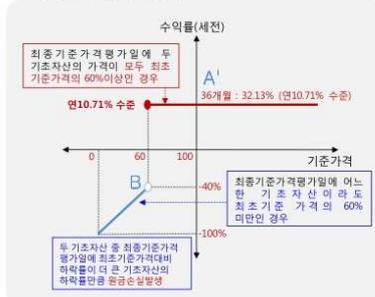
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 03월 22일
- (3) 만기일 : 2014년 03월 20일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 03월 22일
- (5) 최종기준주가 : 년 월 일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)
마이다스2Index증권투자신탁KH-2(ELS-파): 1258754310

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)
마이다스2Index증권투자신탁KH-2(ELS-파): 332473574.8

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS		0	0	0 장의
누계	주식	ELS	31404410000			0 장의
합계				0		0 장의

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

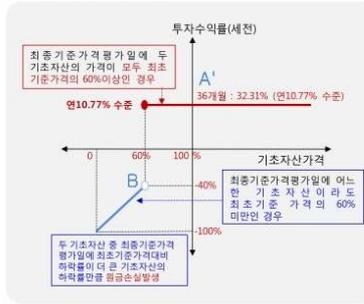
2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 04월 05일
- (3) 만기일 : 2014년 04월 03일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 04월 05일
- (5) 최종기준주가 : 년 월 일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)
마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파): 2503060081

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

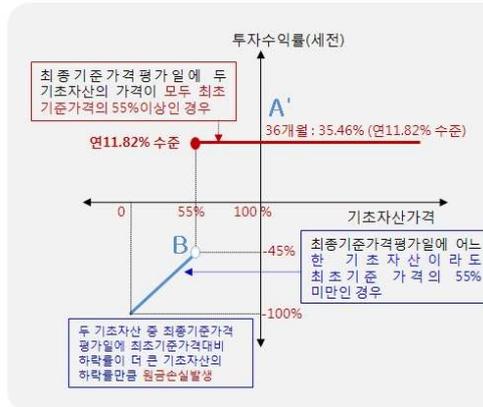
(단위: 백만원)
마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파): 2324039235

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS		0	0	0 장의
누계	주식	ELS	6666030000			0 장의
합계				0		0 장의

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, LG화학, 신한금융투자, 대우증권, 우리투자증권
- (2) 발행일 : 2011년 05월 09일
- (3) 만기일 : 2014년 04월 30일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 05월 06일이전 3 일의 각 기초자산의 증가의 산술평균
- (5) 최종기준주가 : 2014년 04월 28일이전 3 일의 각 기초자산의 증가의 산술평균
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)
마이다스2Star증권투자신탁프리HL-1(ELS- 549545733.3

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

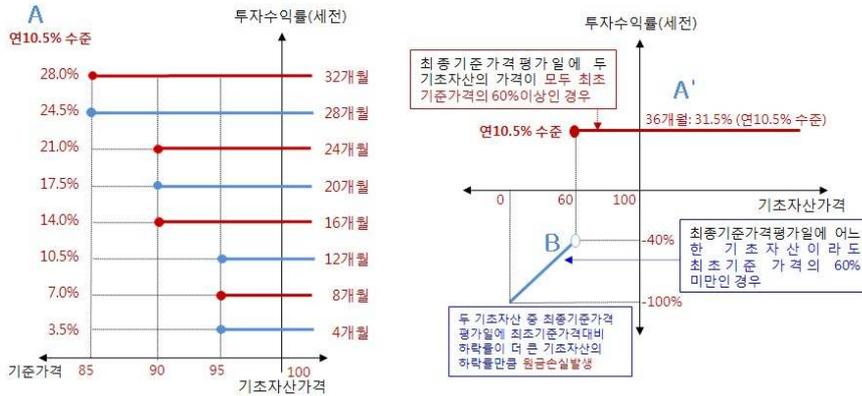
(단위: 백만원)
마이다스2Star증권투자신탁프리HL-1(ELS- 814564654

1. 계약금액

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	(단위: 백만원) 비고
신규	주식	ELS	0	0	0	0 장의
누계	주식	ELS	16327200000	0	0	0 장의
합계				0	0	0 장의

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 05월 12일
- (3) 만기일 : 2014년 05월 09일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 05월 11일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 05월 07일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)
마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파) 1082978460

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)
마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파) 840162254.6