

펀드명 : 마이다스 New 2Star파생상품투자신탁HCHY-2

공시일: 2011-06-30

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: **12**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 New 2Star파생상품투자신탁HCHY: **25**

펀드명 : 마이다스 2Star증권투자신탁W-1(ELS-파생)

공시일: 2011-06-30

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 | 3,154 | | 3,154 | 장외 |
| 합계 | | | 3,154 | | 3,154 | 장외 |

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

(단위: 백만원)

마이다스 2Star증권투자신탁W-1(ELS-파생) **116**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Star증권투자신탁W-1(ELS-파생) **222**

펀드명 : 마이다스 2Star증권투자신탁W-2(ELS-파생)

공시일: 2011-06-30

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 | 1,803 | | 1,803 | 장외 |
| 합계 | | | 1,803 | | 1,803 | 장외 |

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

(단위: 백만원)

마이다스 2Star증권투자신탁W-2(ELS-파생) **100**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Star증권투자신탁W-2(ELS-파생) **263**

펀드명 : 마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생)

공시일: 2011-06-30

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 | 7,516 | | 7,516 | 장외 |
| 합계 | | | 7,516 | | 7,516 | 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) 주가연계증권 발행사 : 대신증권



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생) **81**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생) **128**

펀드명 : 마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생)

공시일: 2011-06-30

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 | 2,276 | | 2,276 | 장외 |
| 합계 | | | 2,276 | | 2,276 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

| | |
|----------------------------|-----|
| 마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생) | 183 |
|----------------------------|-----|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|----------------------------|-----|
| 마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생) | 208 |
|----------------------------|-----|

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-1(ELS-파생)

공시일: 2011-06-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 11 | -11 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 24,862 | | 24,862 | 장외 |
| 합계 | | | 24,862 | | 24,862 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

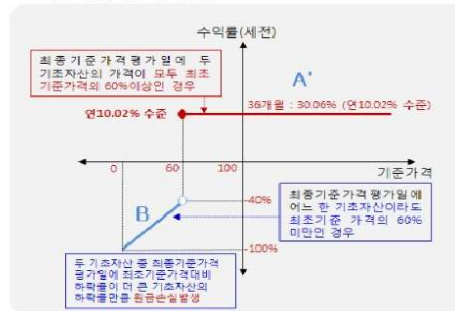
2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (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) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-1(ELS-파생) **1,774**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-1(ELS-파생) **674**

펀드명 : 마이다스2Index증권투자신탁KH-2(ELS-파생)

공시일: 2011-06-30

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 | 24,147 | | 24,147 | 장외 |
| 합계 | | | 24,147 | | 24,147 | 장외 |

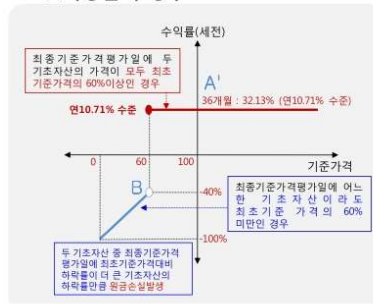
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (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) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권투자신탁KH-2(ELS-파생) **1,365**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권투자신탁KH-2(ELS-파생) **350**

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생)

공시일: 2011-06-30

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 | 31,404 | | 31,404 | 장외 |
| 합계 | | | 31,404 | | 31,404 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

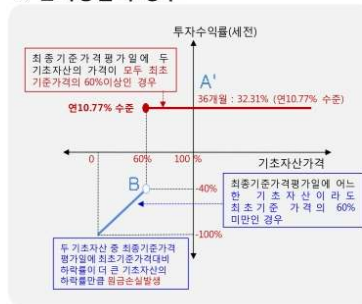
2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (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-파생) **2,676**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생) **1,878**

펀드명 : 마이다스2Star증권투자신탁프리HL-1(ELS-파

공시일: 2011-06-30

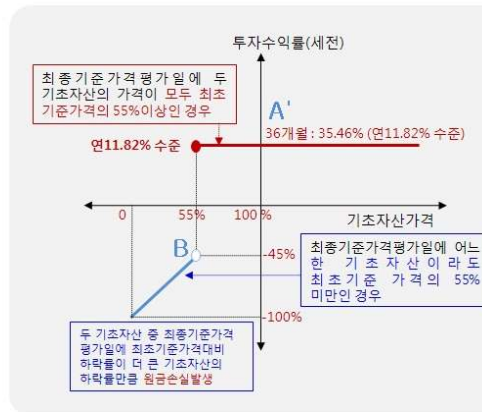
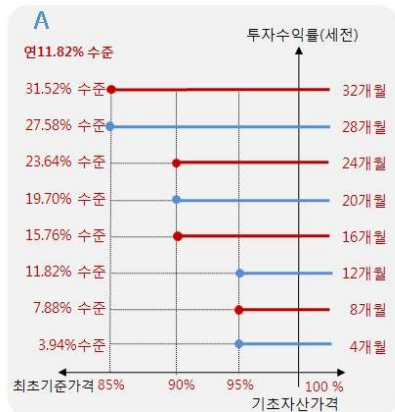
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 6,666 | | 6,666 | 장외 |
| 합계 | | | 6,666 | | 6,666 | 장외 |

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 06일 이전 3 일의 각 기초자산의 증가의 산술평균
- (5) 최종기준주가 : 2014년 04월 28일 이전 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-파) **542**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star증권투자신탁프리HL-1(ELS-파) **1,095**

펀드명 : 마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파)

공시일: 2011-06-30

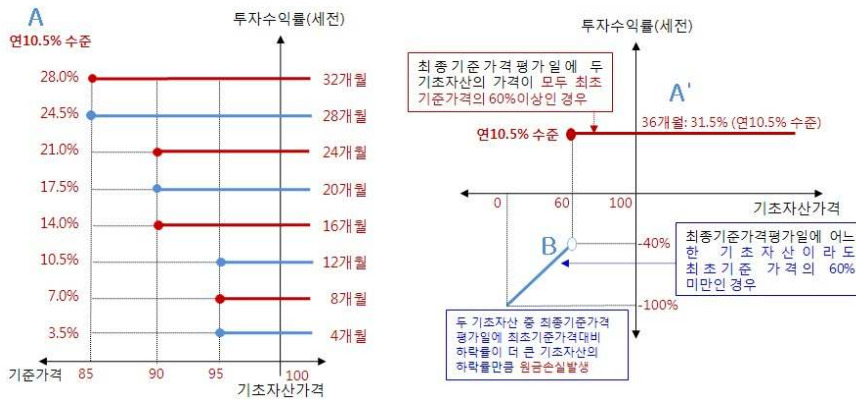
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 16,327 | | 16,327 | 장외 |
| 합계 | | | 16,327 | | 16,327 | 장외 |

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) **1,141**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파) **760**