

## 펀드명 : 마이다스 2Star증권투자신탁W-1(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

### 1. 계약금액

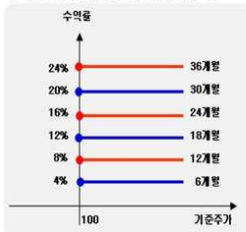
(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 3,124 |       | 3,124     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,124 |       | 3,124     | 장외 |

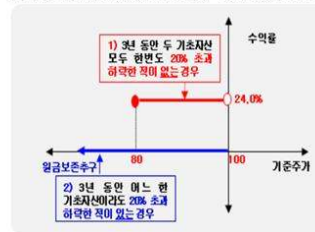
### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (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) **76**

### 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Star증권투자신탁W-1(ELS-파생) **146**

## 펀드명 : 마이다스 2Star증권투자신탁W-2(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

### 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  | 1,780 |       | 1,780     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,780 |       | 1,780     | 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) **43**

### 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Star증권투자신탁W-2(ELS-파생) **88**

## 펀드명 : 마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

### 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  | 7,506 |       | 7,506     | 장외 |
| 합계 |      |      | 7,506 |       | 7,506     | 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) **52**

### 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 2Star증권투자신탁W-3(ELS-파생) **60**

펀드명 : 마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

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  | 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) | 192 |
|----------------------------|-----|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 마이다스2Star증권투자신탁K-1(ELS-파생) | 222 |
|----------------------------|-----|

# 펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

## 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  | 31,368 |       | 31,368    | 장외 |
| 합계 |      |      | 31,368 |       | 31,368    | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

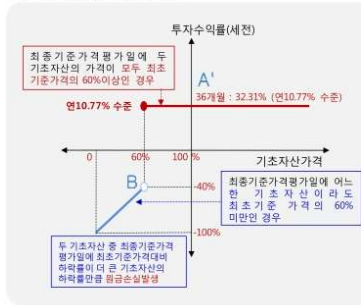
### 2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (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) **2,475**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생) **3,683**

## 펀드명 : 마이다스2Star증권투자신탁프리HL-1(ELS-파

공시일: 2011-09-28

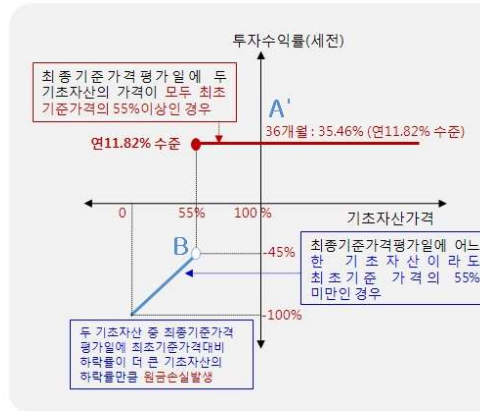
### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 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 3일의 각 기초자산의 증가의 산술평균
- (5) 최종기준주가 : 2014년 04월 28일 이전 3일의 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) **540**

### 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star증권투자신탁프리HL-1(ELS-파) **581**

## 펀드명 : 마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파)

공시일: 2011-09-28

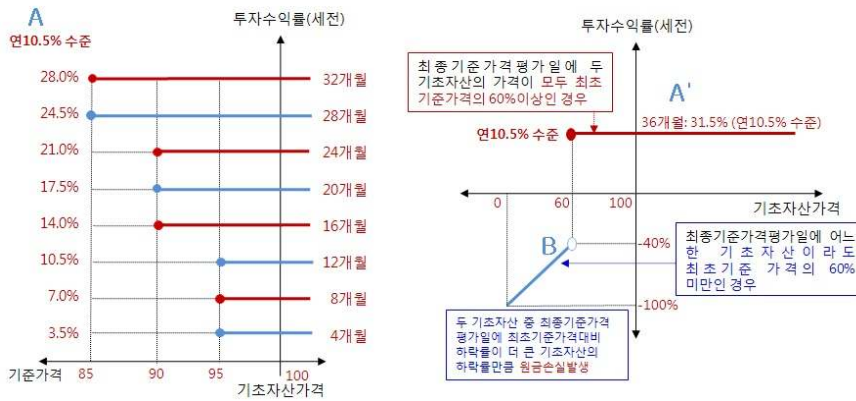
### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 16,213 |       | 16,213    | 장외 |
| 합계 |      |      | 16,213 |       | 16,213    | 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) 1,258

### 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파) 1,631

# 펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-3(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

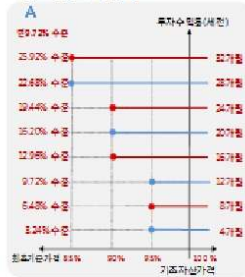
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

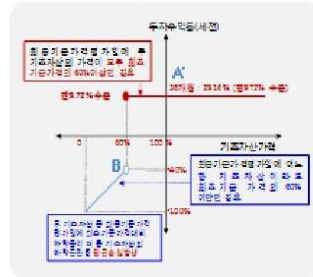
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 4,575 |       | 4,575     | 장외 |
| 합계 |      |      | 4,575 |       | 4,575     | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

### ○ 중도상환의 경우



### ○ 만기상환의 경우



- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 07월 01일
- (3) 만기일 : 2014년 06월 27일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 06월 30일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 06월 25일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-3(ELS-파생) **347**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-3(ELS-파생) **255**



# 펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-4(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

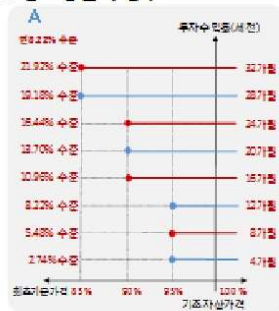
## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

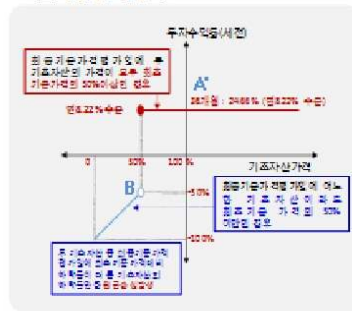
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 1,755 |       | 1,755     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,755 |       | 1,755     | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

### ○ 증도상환의 경우



### ○ 만기상환의 경우



- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 07월 01일
- (3) 만기일 : 2014년 06월 27일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 06월 30일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 06월 25일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-4(ELS-파생) **153**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-4(ELS-파생) **186**

## 펀드명 : 마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-4(ELS파)

공시일: 2011-09-28

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

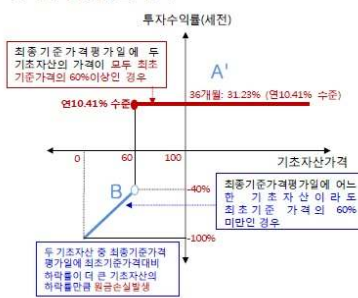
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 15,110 |       | 15,110    | 장외 |
| 합계 |      |      | 15,110 |       | 15,110    | 장외 |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

#### ○ 증도상환의 경우



#### ○ 만기상환의 경우



- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 07월 19일
- (3) 만기일 : 2014년 07월 17일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 07월 18일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 07월 15일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-4(ELS파) **1,071**

### 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-4(ELS파) **1,256**

# 펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-5(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

## 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  | 10,065 |       | 10,065    | 장외 |
| 합계 |      |      | 10,065 |       | 10,065    | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

### ○ 중도상환의 경우



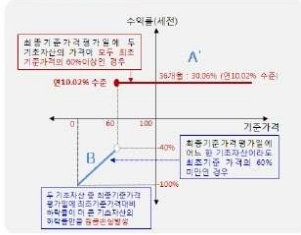
#### 손익상환

A 중도상환평가일에 모든 기초자산 가격(종가)이 순차적으로 해당 기준가격의 95-95-90-90-90-85-85 이상인 경우 > 원금 + 연 10.02% 수익률 수준으로 해당 중도상환 지급일에 펀드 청산  
 A' 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 모든 기초자산가격(종가)이 해당기준가격의 60%이상인 경우 > 원금 + 연 10.02% 수익률 수준으로 만기상환

#### 손실상환

B 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 두 기초자산가격(종가)중 하나라도 기준가격의 60%미만인 경우 > 원금손실 발생 : 두 기초자산 하락률 중 하락률 수준으로 손실 상환

### ○ 만기상환의 경우



- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 08월 02일
- (3) 만기일 : 2014년 07월 31일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 08월 01일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 07월 29일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-5(ELS-파생) **685**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-5(ELS-파생) **824**

# 펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

## 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  | 1,387 |       | 1,387     | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,387 |       | 1,387     | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

### ○ 중도상환의 경우



#### 수익상환

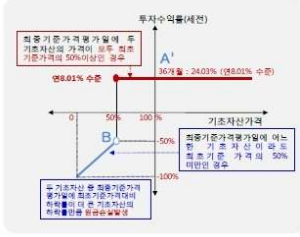
A. 중도상환평가일에 모든 기초자산 가격(종가)이 순차적으로 해당 기준가격의 95-95-95-90-90-90-85-85% 이상인 경우 > 원금 + 연 8.01% 수익률 수준으로 해당 중도상환 지급일에 펀드 청산

A'. 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 모든 기초자산가격(종가)이 해당기준가격의 50%이상인 경우 > 원금 + 연 8.01% 수익률 수준으로 만기상환

#### 손실상환

B. 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 두 기초자산가격(종가) 중 하나라도 기준가격의 50%미만인 경우 > 원금손실 발생 : 두 기초자산 하락률 중 가장 큰 하락률 수준으로 손실 상환

### ○ 만기상환의 경우



- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 08월 02일
- (3) 만기일 : 2014년 07월 31일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 08월 01일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 07월 29일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생) **108**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생) **91**

# 펀드명 : 마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-5(ELS파)

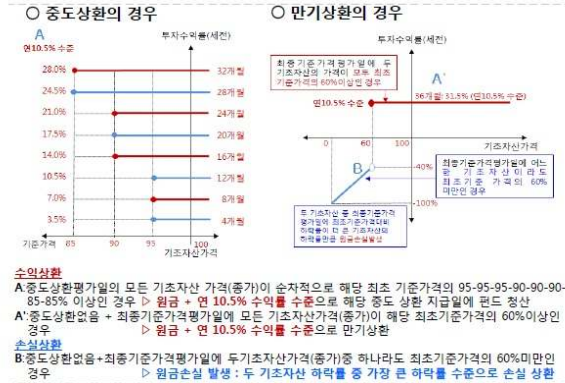
공시일: 2011-09-28

## 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  | 3,411 |       | 3,411     | 장외 |
| 합계 |      |      | 3,411 |       | 3,411     | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 08월 17일
- (3) 만기일 : 2014년 08월 13일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 08월 16일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 08월 11일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-5(ELS파) **269**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이더스 2Index 증권투자신탁 KH-5(ELS파) **175**

# 펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-7(ELS-파생)

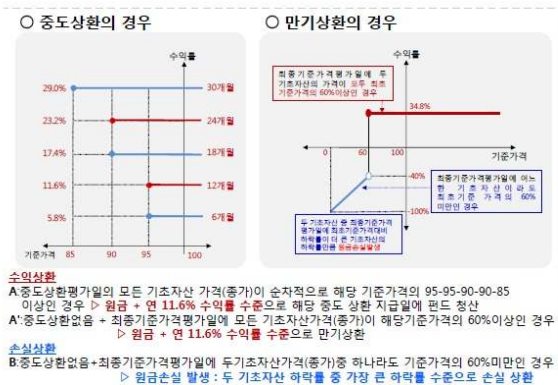
공시일: 2011-09-28

## 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  | 6,559 |       | 6,559     | 장외 |
| 합계 |      |      | 6,559 |       | 6,559     | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 09월 01일
- (3) 만기일 : 2014년 08월 28일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 08월 31일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 08월 26일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-7(ELS-파생) **552**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-7(ELS-파생) **557**

# 펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-8(ELS-파생)

공시일: 2011-09-28

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

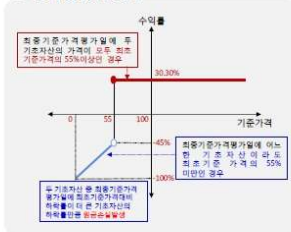
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주식   | ELS  | 8,439 |       | 8,439     | 장외 |
| 합계 |      |      | 8,439 |       | 8,439     | 장외 |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

### ○ 중도상환의 경우



### ○ 만기상환의 경우



#### 수익상환

A: 중도상환평가일의 모든 기초자산 가격(종가)이 순차적으로 해당 기준가격의 90-90-85-85-80 이상인 경우 > 원금 + 연 10.1% 수익률 수준으로 해당 중도상환 지급일에 펀드 청산  
 A': 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 모든 기초자산가격(종가)이 해당기준가격의 55%이상인 경우 > 원금 + 연 10.1% 수익률 수준으로 만기상환

#### 손실상환

B: 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 두 기초자산가격(종가)중 하나라도 기준가격의 55%미만인 경우 > 원금손실 발생 : 두 기초자산 하락률 중 가장 큰 하락률 수준으로 손실 상환

- (1) 기초자산 : HangSeng China Enterprises Index, KOSPI200 Index
- (2) 발행일 : 2011년 09월 01일
- (3) 만기일 : 2014년 08월 28일
- (4) 최초기준주가 : 2011년 08월 31일
- (5) 최종기준주가 : 2014년 08월 26일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-8(ELS-파생) **673**

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-8(ELS-파생) **504**