

펀드명 : 마이다스 2Star 증권투자신탁W-1(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

1. 계약금액

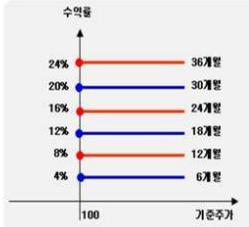
(단위: 백만원)

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

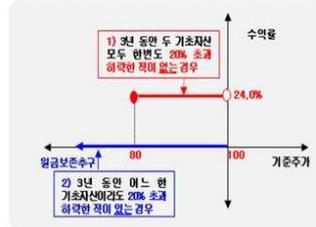
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (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 2Star 증권투자신탁W-1(ELS-파생) **18**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Star 증권투자신탁W-1(ELS-파생) **49**

펀드명 : 마이다스 2Star 증권투자신탁W-2(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

1. 계약금액

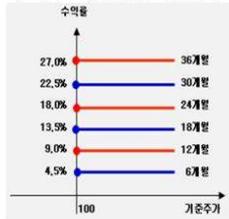
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,750		1,750	장외
합계			1,750		1,750	장외

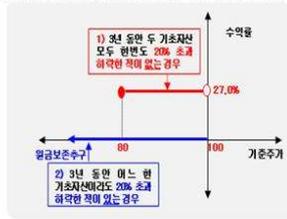
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (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

[그림A] 조기(만기) 상환 조건 충족시



[그림B] 조기(만기) 상환 조건을 충족하지 못하고 만기시



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 2Star 증권투자신탁W-2(ELS-파생) **57**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Star 증권투자신탁W-2(ELS-파생) **122**

펀드명 : 마이다스 2Star 증권투자신탁W-3(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

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	7,168		7,168	장외
합계			7,168		7,168	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. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 2Star 증권투자신탁W-3(ELS-파생) **81**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Star 증권투자신탁W-3(ELS-파생) **142**

펀드명 : 마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

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	2,246		2,246	장외
합계			2,246		2,246	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생)	217
-----------------------------	-----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생)	347
-----------------------------	-----

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

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	31,231		31,231	장외
합계			31,231		31,231	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) 추가연계증권 발행사: 신한금융투자

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생) **3,070**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생) **3,287**

펀드명 : 마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파

공시일: 2012-02-23

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 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)

마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파) 653

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파) 1,008

펀드명 : 마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파)

공시일: 2012-02-23

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	16,145		16,145	장외
합계			16,145		16,145	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)

마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파) **1,355**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-3(ELS파) **1,334**

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-3(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

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	4,568		4,568	장외
합계			4,568		4,568	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

○ 증대상황의 경우



○ 만기상황의 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) **412**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-3(ELS-파생) **404**

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-4(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

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	1,743		1,743	장외
합계			1,743		1,743	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) **138**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-4(ELS-파생) **86**

펀드명 : 마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-4(ELS파)

공시일: 2012-02-23

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	15,058		15,058	장외
합계			15,058		15,058	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

○ 중도상환의 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) 주기연계증권 발행사 : 신한금융투자

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-4(ELS파) 1,164

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-4(ELS파) 804

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

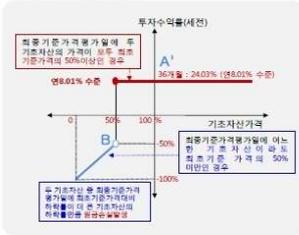
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,387		1,387	장외
합계			1,387		1,387	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



수익상환

A: 중도상환평가일의 모든 기초자산 가격(종가)이 순자산으로 해당 기준가격의 95-95-90-90-90-85-85% 이상인 경우 > 원금 + 연 8.01% 수익률 수준으로 해당 중도 상환 지급일에 펀드 장선
 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

- (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) 101

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생) 82

펀드명 : 마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-5(ELS파)

공시일: 2012-02-23

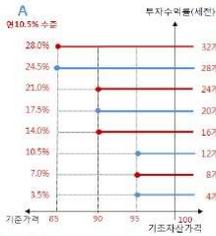
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	3,136		3,136	장외
합계			3,136		3,136	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

○ 중도상환의 경우



수익상환

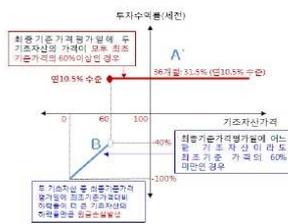
A: 중도상환평가일의 모든 기초자산 가격(종가)이 순자산적으로 해당 최초 기준가격의 95-95-95-90-90-90-85-85% 이상인 경우 > 원금 + 연 10.5% 수익률 수준으로 해당 중도 상환 지급일에 펀드 청산

A': 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 모든 기초자산가격(종가)이 해당 최초기준가격의 60% 이상인 경우 > 원금 + 연 10.5% 수익률 수준으로 만기상환

손실상환

B: 중도상환없음 + 최종기준가격평가일에 두 기초자산가격(종가) 중 하나라도 최초기준가격의 60%미만의 경우 > 원금손실 발생 : 두 기초자산 하락률 중 가장 큰 하락률 수준으로 손실 상환

○ 만기상환의 경우



최종기준가격평가일에 두 기초자산의 가격이 모두 최초 기준가격의 60% 이상인 경우

연 10.5% 수준

36개월 33.5% (연 10.5% 수준)

최종기준가격평가일에 어느 한 기초자산의 라도 최초기준 가격의 60% 미만인 경우

0

60

100

기초자산가격

투자수익률(백분)

최종기준가격평가일에 두 기초자산 가격(종가) 중 하나라도 최초기준가격의 60%미만의 경우

원금손실 발생 : 두 기초자산 하락률 중 가장 큰 하락률 수준으로 손실 상환

- (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)

마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-5(ELS파) 141

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스 2Index 증권투자신탁 KH-5(ELS파) 65

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-7(ELS-파생)

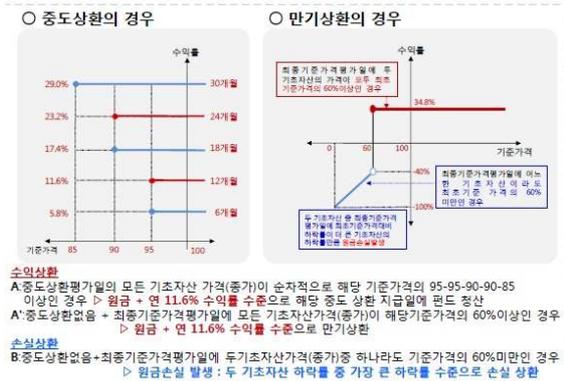
공시일: 2012-02-23

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	6,537		6,537	장외
합계			6,537		6,537	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) **21**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-7(ELS-파생) **0**

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-8(ELS-파생)

공시일: 2012-02-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

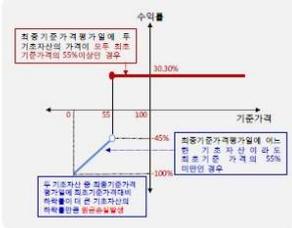
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	8,434		8,434	장외
합계			8,434		8,434	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



손익상환

- A: 중도상환평가일에 모든 기초자산 가격(종가)이 순차적으로 해당 기준가격의 90-90-85-85-80 이상인 경우 > 원금 + 연 10.1% 수익률 수준으로 해당 중도 상환 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) 0

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-8(ELS-파생) 0