

펀드명 : 마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생)

공시일: 2013-08-20

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 | 2,150 | | 2,150 | 장외 |
| 합계 | | | 2,150 | | 2,150 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

| | |
|-----------------------------|-------|
| 마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생) | 1,067 |
|-----------------------------|-------|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|-----------------------------|-----|
| 마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생) | 414 |
|-----------------------------|-----|

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생)

공시일: 2013-08-20

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 | 30,087 | | 30,087 | 장외 |
| 합계 | | | 30,087 | | 30,087 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

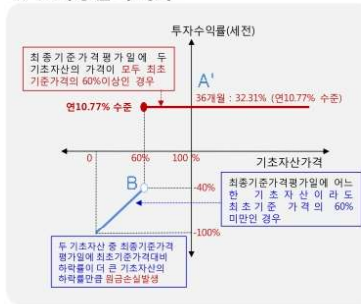
2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (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) **4,562**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생) **2,660**

펀드명 : 마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파

공시일: 2013-08-20

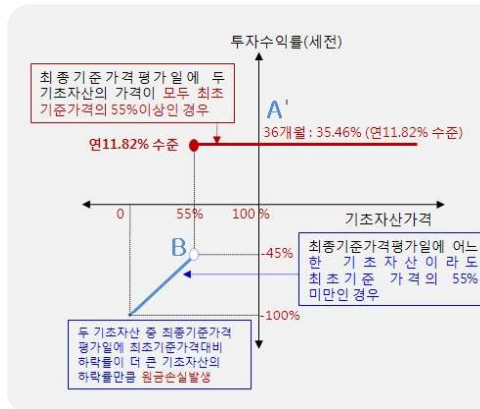
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 6,616 | | 6,616 | 장외 |
| 합계 | | | 6,616 | | 6,616 | 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) 920

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파) 1,278

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-5(ELS-파생)

공시일: 2013-08-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 5 | -5 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 9,585 | | 9,585 | 장외 |
| 합계 | | | 9,585 | | 9,585 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



- (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) | 1,125 |
|------------------------------|-------|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| 마이다스2Index증권프리미어KH-5(ELS-파생) | 591 |
|------------------------------|-----|

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생)

공시일: 2013-08-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

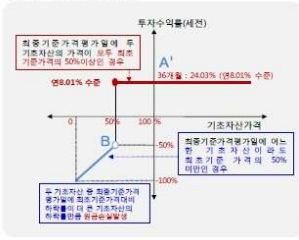
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,298 | | 1,298 | 장외 |
| 합계 | | | 1,298 | | 1,298 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



수익상환

A: 중도상환평가일에 모든 기초자산 가격(종가)이 순차적으로 해당 기준가격의 95-95-90-90-90-85-85% 이상인 경우 > 원금 + 연 8.01% 수익률 수준으로 해당 중도 상환 지급일에 펀드 장산
 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 하락 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) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

| | |
|------------------------------|----|
| 마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생) | 92 |
|------------------------------|----|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|------------------------------|----|
| 마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생) | 19 |
|------------------------------|----|

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자SL-2(ELS-파

공시일: 2013-08-20

1. 계약금액

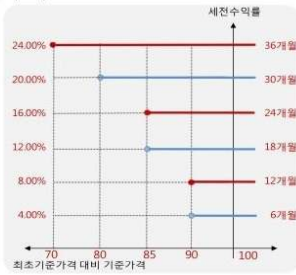
(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 9,600 | | 9,600 | 장외 |
| 합계 | | | 9,600 | | 9,600 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : LG화학, 삼성전자
- (2) 발행일 : 2013년 02월 28일
- (3) 만기일 : 2016년 02월 25일
- (4) 최초기준주가 : 2013년 02월 27일 이전 3 일의 각 기초자산의 종가의 산술평균
- (5) 최종기준주가 : 2016년 02월 23일 이전 3 일의 각 기초자산의 종가의 산술평균
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 대신증권

1. 상환 조건 충족 시



2. 상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

| | |
|----------------------------|-----|
| 마이다스2스타주가연동증권투자SL-2(ELS-파) | 830 |
|----------------------------|-----|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|----------------------------|-----|
| 마이다스2스타주가연동증권투자SL-2(ELS-파) | 886 |
|----------------------------|-----|

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자HH-1(ELS-파

공시일: 2013-08-20

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 | 2,082 | | 2,082 | 장외 |
| 합계 | | | 2,082 | | 2,082 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : 현대중공업, 현대차
- (2) 발행일 : 2013년 04월 11일
- (3) 만기일 : 2016년 04월 07일
- (4) 최초기준주가 : 2013년 04월 10일 이전 3 일의 각 기초자산의 증가의 산술평균
- (5) 최종기준주가 : 2016년 04월 05일 이전 3 일의 각 기초자산의 증가의 산술평균
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 주가연계증권 발행사 : 대신증권

1. 상환 조건 충족 시



2. 상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자HH-1(ELS-파) **52**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자HH-1(ELS-파) **7**

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자SL-3(ELS-파

공시일: 2013-08-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

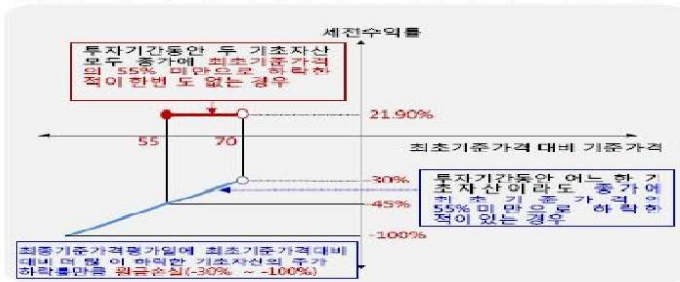
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주식 | ELS | 1,214 | | 1,214 | 장외 |
| 합계 | | | 1,214 | | 1,214 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

1. 상환 조건 충족 시



2. 상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자SL-3(ELS-파) **95**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자SL-3(ELS-파) **0**

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자KH-1(ELS-파

공시일: 2013-08-20

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 | 667 | | 667 | 장외 |
| 합계 | | | 667 | | 667 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

1. 상환 조건 충족 시



2. 상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자KH-1(ELS-파) 51

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자KH-1(ELS-파) 39