

펀드명 : 마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생)

공시일: 2013-08-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	10	-10	장외
누계	주식	ELS	2,002		2,002	장외
합계			2,002		2,002	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생)	1,388
-----------------------------	-------

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁K-1(ELS-파생)	957
-----------------------------	-----

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생)

공시일: 2013-08-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	10	-10	장외
누계	주식	ELS	30,058		30,058	장외
합계			30,058		30,058	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

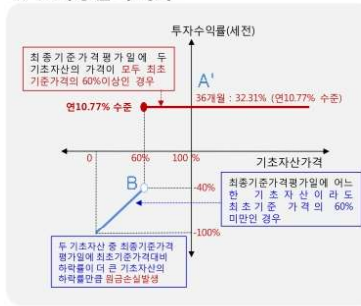
2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (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) **4,751**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생) **3,600**

펀드명 : 마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파

공시일: 2013-08-29

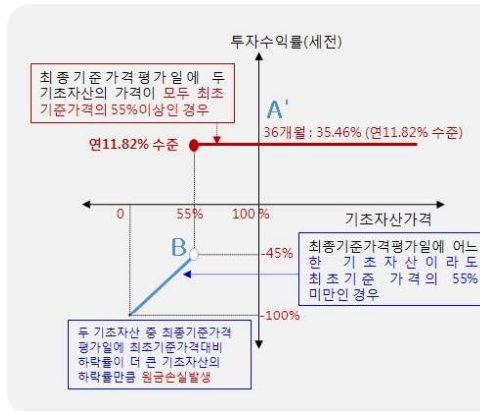
1. 계약금액

(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) 888

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파) 1,312

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-5(ELS-파생)

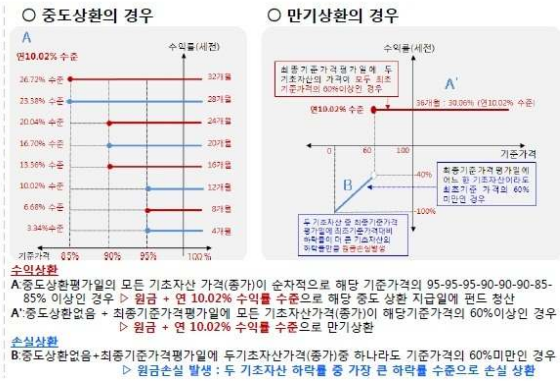
공시일: 2013-08-29

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	9,585		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)	1,217
------------------------------	-------

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-5(ELS-파생)	766
------------------------------	-----

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생)

공시일: 2013-08-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

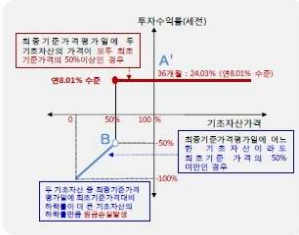
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,298		1,298	장외
합계			1,298		1,298	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

○ 중도상환의 경우



○ 만기상환의 경우



수익상환

A: 중도상환평가일의 모든 기초자산 가격(종가)이 순차적으로 해당 기준가격의 95-95-90-90-85-85% 이상인 경우 > 원금 + 연 8.01% 수익률 수준으로 해당 중도상환 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) 주가연계증권 발행사 : 신한금융투자

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생)	120
------------------------------	-----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-6(ELS-파생)	39
------------------------------	----

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자SL-2(ELS-파

공시일: 2013-08-29

1. 계약금액

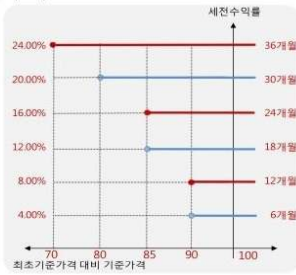
(단위: 백만원)

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)	789
----------------------------	-----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자SL-2(ELS-파)	730
----------------------------	-----

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자HH-1(ELS-파

공시일: 2013-08-29

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)	39
----------------------------	----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자HH-1(ELS-파)	1
----------------------------	---

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자SL-3(ELS-파

공시일: 2013-08-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

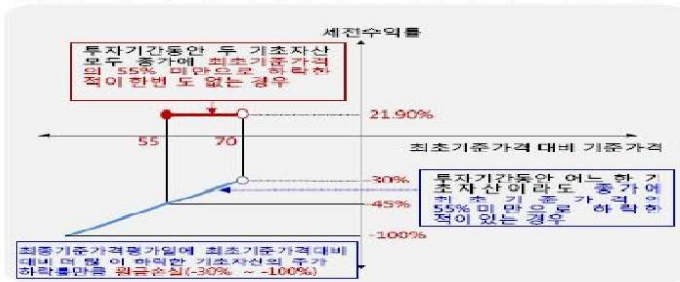
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,214		1,214	장외
합계			1,214		1,214	장외

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	93
---------------------------	----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자SL-3(ELS-파	0
---------------------------	---

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자KH-1(ELS-파

공시일: 2013-08-29

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) **53**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자KH-1(ELS-파) **44**

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자LK-1(ELS-파

공시일: 2013-08-29

1. 계약금액

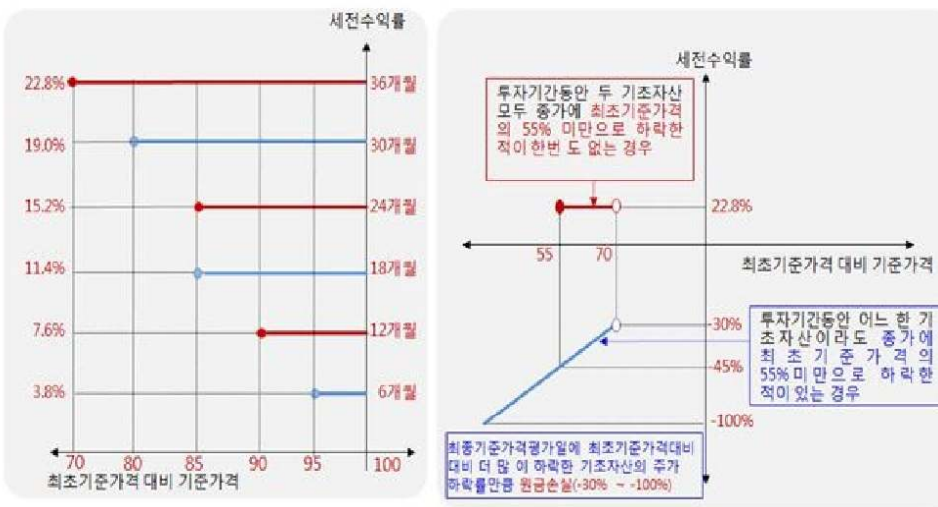
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	795		795	장외
합계			795		795	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)

마이다스2스타주가연동증권투자LK-1(ELS-파) **58**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자LK-1(ELS-파) **54**