

펀드명 : 마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생)

공시일: 2014-02-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	99	-99	장외
누계	주식	ELS	28,663		28,663	장외
합계			28,663		28,663	장외

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

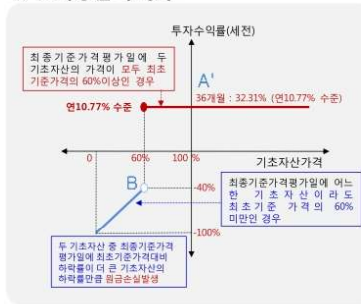
2. 파생상품거래에 따른 만기시점의 손익구조

- (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) **5,473**

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Index증권프리미어KH-2(ELS-파생) **3,574**

펀드명 : 마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파

공시일: 2014-02-05

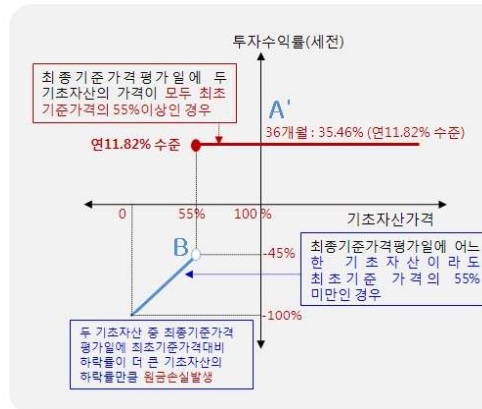
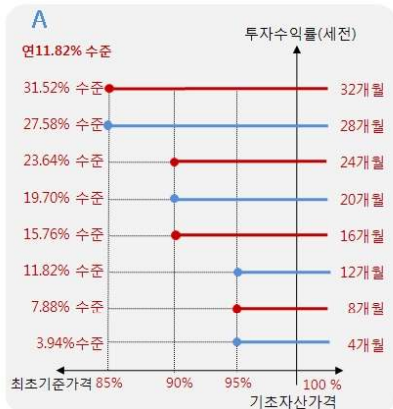
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	6,168		6,168	장외
합계			6,168		6,168	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) 958

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2Star 증권투자신탁프리HL-1(ELS-파) 1,477

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자SL-2(ELS-파

공시일: 2014-02-05

1. 계약금액

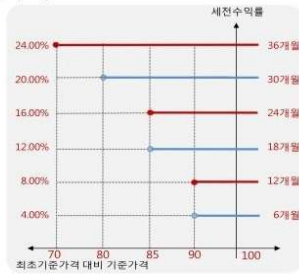
(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	9,490		9,490	장외
합계			9,490		9,490	장외

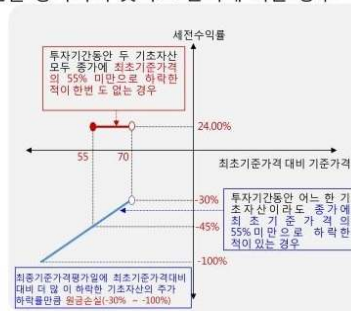
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (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) 859

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자SL-2(ELS-파) 942

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자SL-3(ELS-파

공시일: 2014-02-05

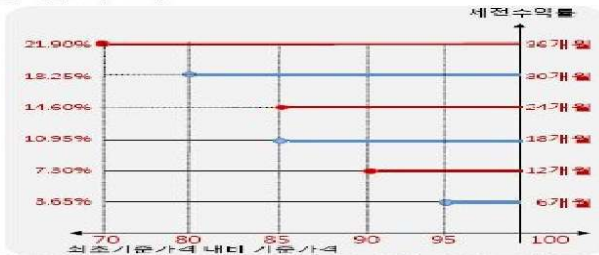
1. 계약금액

(단위: 백만원)

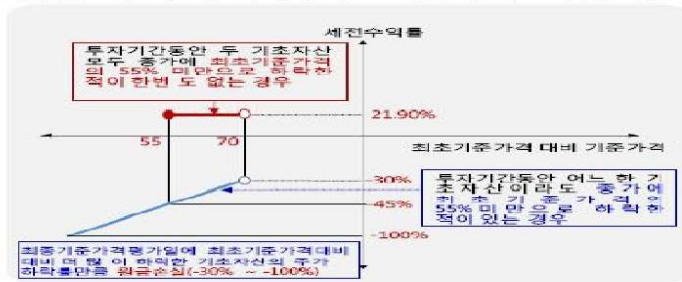
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,214		1,214	장외
합계			1,214		1,214	장외

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	101
---------------------------	-----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

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

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자KH-1(ELS-파

공시일: 2014-02-05

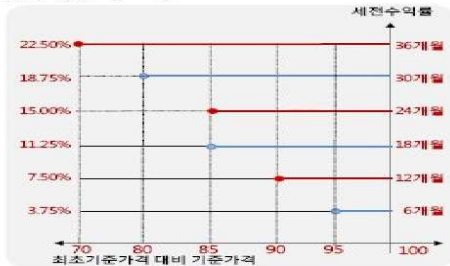
1. 계약금액

(단위: 백만원)

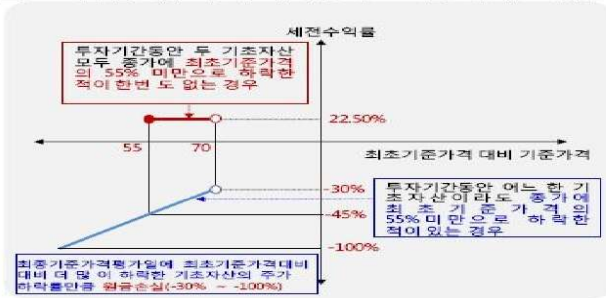
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	647		647	장외
합계			647		647	장외

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	55
---------------------------	----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자KH-1(ELS-파	13
---------------------------	----

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자LK-1(ELS-파

공시일: 2014-02-05

1. 계약금액

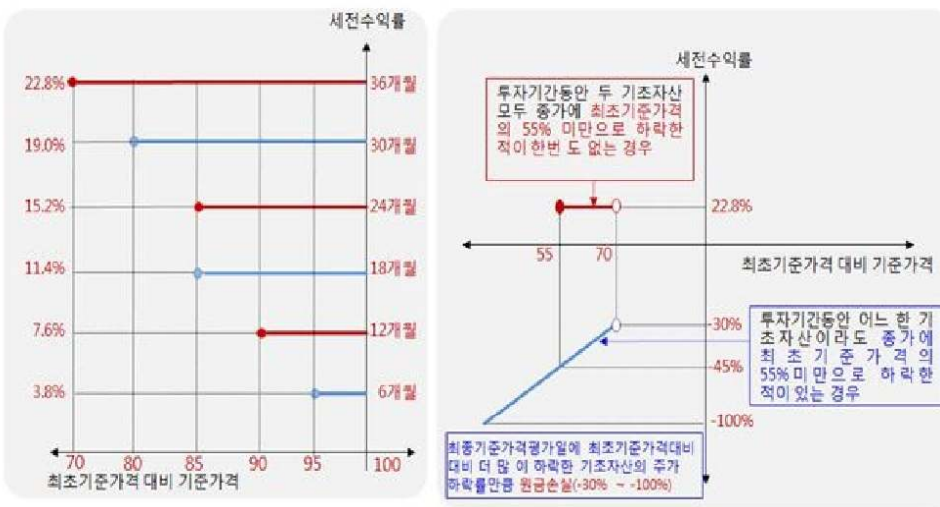
(단위: 백만원)

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	78
---------------------------	----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자LK-1(ELS-파	47
---------------------------	----

펀드명 : 마이다스2스타주가연동증권투자KH-2(ELS-파

공시일: 2014-02-05

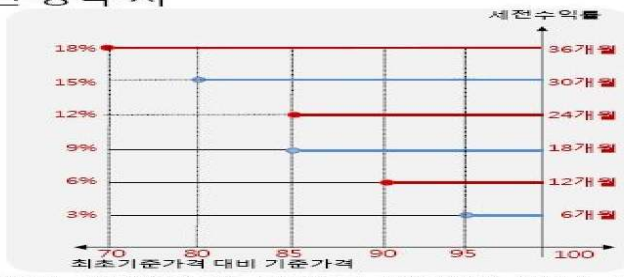
1. 계약금액

(단위: 백만원)

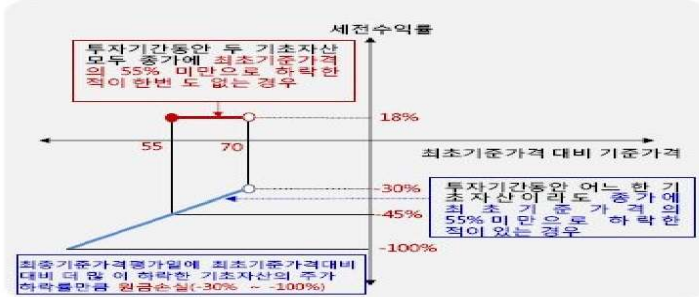
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS	0	0	0	장외
누계	주식	ELS	1,078		1,078	장외
합계			1,078		1,078	장외

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-2(ELS-파) 85

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

마이다스2스타주가연동증권투자KH-2(ELS-파) 43