

펀드명 : 마이다스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-2호(ELS-파생형)

공시일: 2016-01-05

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	6,497		6,497	장외
합계			6,497		6,497	

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 3일의 각 기초자산의 증가의 산술평균
- (5) 최종기준주가 : 2016년 02월 23일 이전 3일의 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



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

110

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

12

펀드명 : 마이다스 2스타 주가연동 증권투자신탁 SL-3호(ELS-파생형)

공시일: 2016-01-05

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	1,154		1,154	장외
합계			1,154		1,154	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

1. 상환 조건 충족 시



2. 상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이은 경우



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

28

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

75

펀드명 : 마이다스 2스타 주가연동 증권투자신탁 KH-2호(ELS-파생형)

공시일: 2016-01-05

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	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

1. 상환 조건 충족 시



2. 상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

31

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

78

펀드명 : 마이다스 2Index 증권투자신탁 K-6호 (ELS-파생형)

공시일: 2016-01-05

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	630		630	장외
합계			630		630	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : KOSPI200, HSCEI
- (2) 발행일 : 2015년 3월 23일
- (3) 만기일 : 2018년 3월 20일
- (4) 최초기준주가 : 2015년 3월 20일 각 기초자산의 증가

1. 상환조건 충족 시



2. 상환 조건을 충족하지 못하고 만기에 이른 경우



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

54

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

72