

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

공시일: 2016-02-02

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 | 6,164 | | 6,164 | 장외 |
| 합계 | | | 6,164 | | 6,164 | |

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 증가의 산술평균
- (5) 최종기준주가 : 2016년 02월 23일 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



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1

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

공시일: 2016-02-02

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

27

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

71

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

공시일: 2016-02-02

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

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

84

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

공시일: 2016-02-02

1. 계약금액

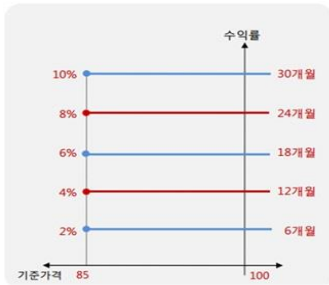
(단위: 백만원)

| 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 | |

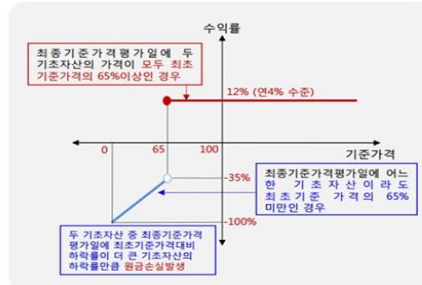
2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (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

47

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

62