

펀드명 : 플러스2star트리플찬스증권투자신탁2호(ELS-파생형)

공시일: 2012-09-11

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 | 4,211 | | 4,211 | 장외 |
| 합계 | | | 4,211 | | 4,211 | 장외 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

- (1) 기초자산 : LG전자, 우리금융
- (2) 발행일 : 2010년 04월 19일
- (3) 만기일 : 2013년 04월 16일
- (4) 최초기준주가 : 2010년 04월 16일
- (5) 최종기준주가 : 2013년 04월 12일
- (6) 평가기간 : 최초기준주가 결정일 이후부터 최종기준주가 결정일까지
- (7) 추가연계증권 발행사 : 신한금융투자



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

플러스2star트리플찬스증권투자신탁2호(ELS) 165

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

플러스2star트리플찬스증권투자신탁2호(ELS) 329