| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

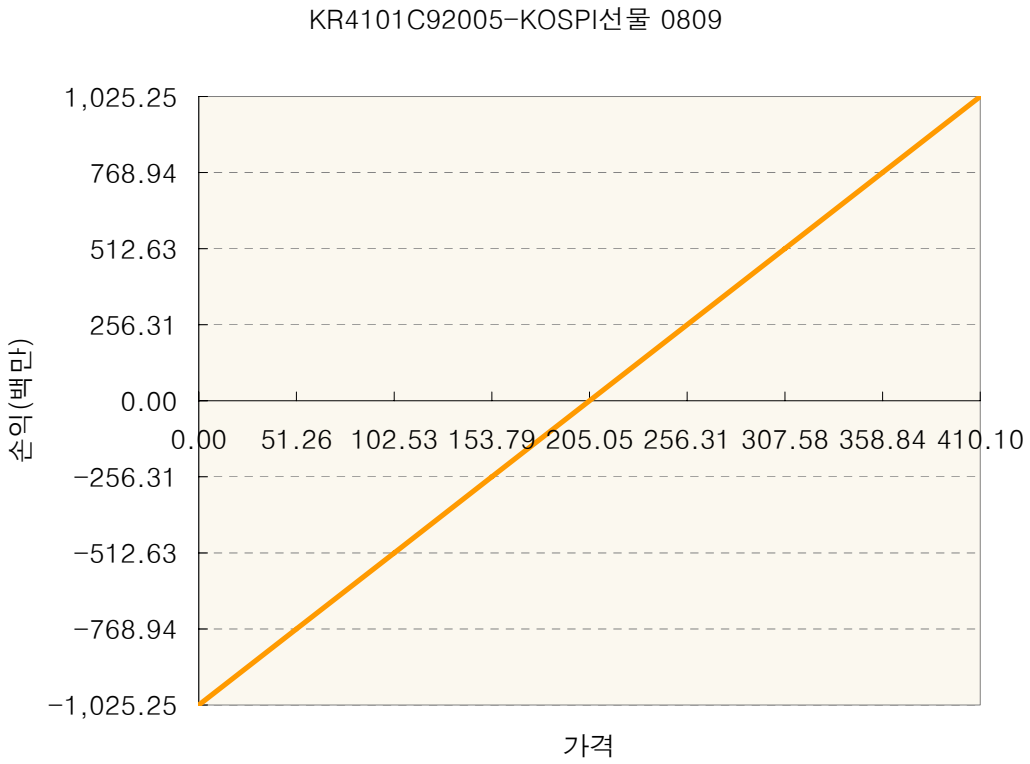
# 인덱스+a파생1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,025 | 0 | 1,025 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101C920 KOSPI선물 0809 | 82 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 129 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

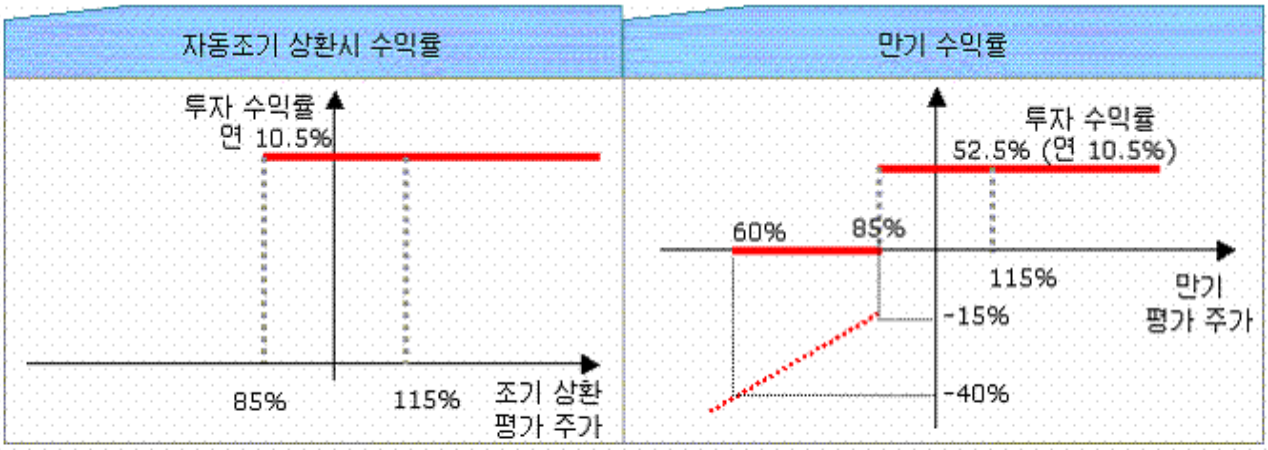
# TwinPower파생SH2

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 14,685 | 0 | 14,685 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 신한지주 보통주 현대차 보통주의 가격이 모두 기준가격 대비 85% 이상 이거나, 일별종가기준 두 종목이 동시에 15%이상 상승한 적이 있으면 연 10.5% 수익확보 하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만 기 상 환 조 건 | 상 환 금 액 |
|---|---|
| 기준 가격 대비 두 종목 모두 85% 이상인 경우 또는<br>기준가격 대비 동시에 두 종목 종가가 115%에 도달한 적이 있는 경우 | 원금 + 연 10.5% |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 60% 미만으로 하락(하락률 40%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금보존 추구 |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 60% 미만으로 하락(하락률 40%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금 손실<br>(두 종목 중 하락률이 큰종목의 손실률 적용) |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1012150 ELS5yUSDLB051228 | 2,066 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 2,893 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

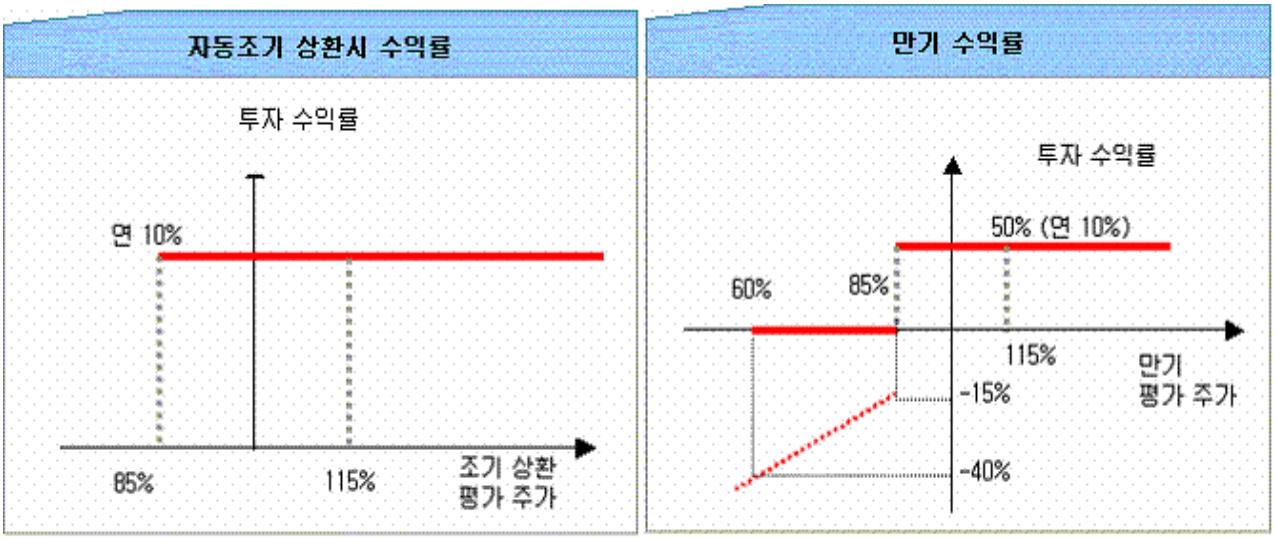
# TwinPower파생SH3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 19,632 | 0 | 19,632 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 신한지주 보통주·현대차 보통주의 가격이 모두 기준가격 대비 85% 이상 이거나, 일별종가기준 두 종목이 동시에 15%이상 상승한 적이 있으면 연 10% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 기준 가격 대비 두 종목 모두 85% 이상인 경우 또는<br>기준가격 대비 동시에 두 종목 종가가 115%에 도달한 적이 있는 경우 | 원금 + 연 10% |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 60% 미만으로 하락(하락률 40%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금보존 추구 |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 60% 미만으로 하락(하락률 40%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금 손실<br>(두 종목 중 하락률이 큰종목의 손실률 적용) |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6003452S ELS현대108회060105 | 2,582 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 3,890 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

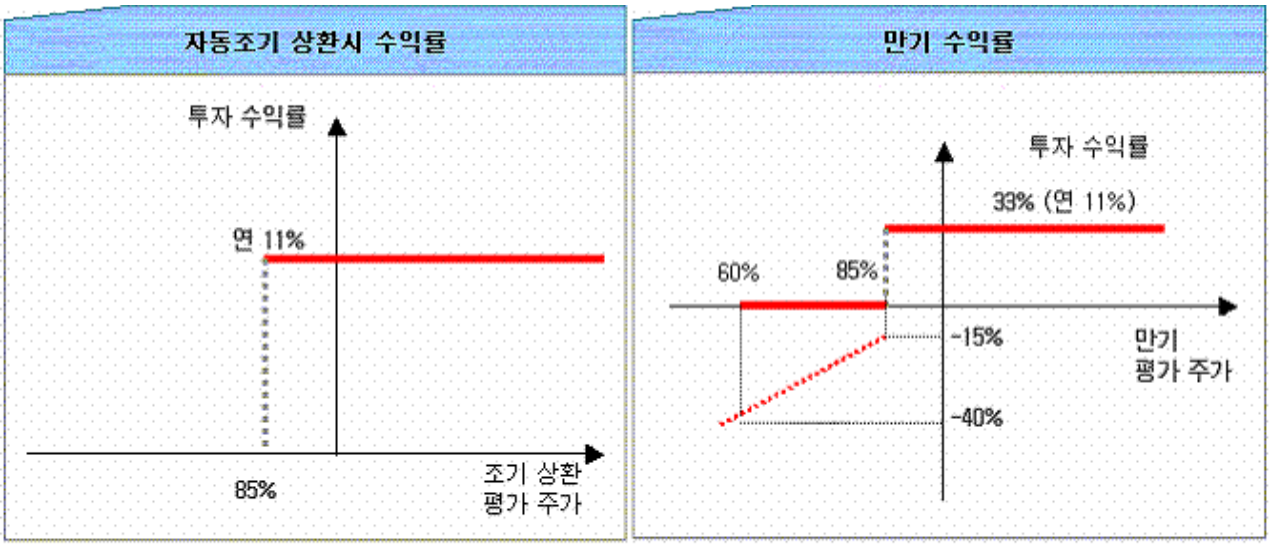
# Tops2스타파생HS3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 23,916 | 0 | 23,916 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 신한지주 보통주 · 현대차 보통주의 가격이 모두 최초 기준가격에서 15%를 초과하여 하락하지 않으면, 연 11% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 최초 기준가격에서 두 종목 모두 15% 초과하여 하락하지 않는 경우 | 원금 + 연 11.0%수준 |
| 한 종목이라도 기준가격에서 40% 초과하여 하락한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금손실 발생 |
| 한 종목이라도 기준가격에서 40% 초과하여 하락한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금보존 추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6005949S ELS우리468호060109 | 3,435 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 5,221 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

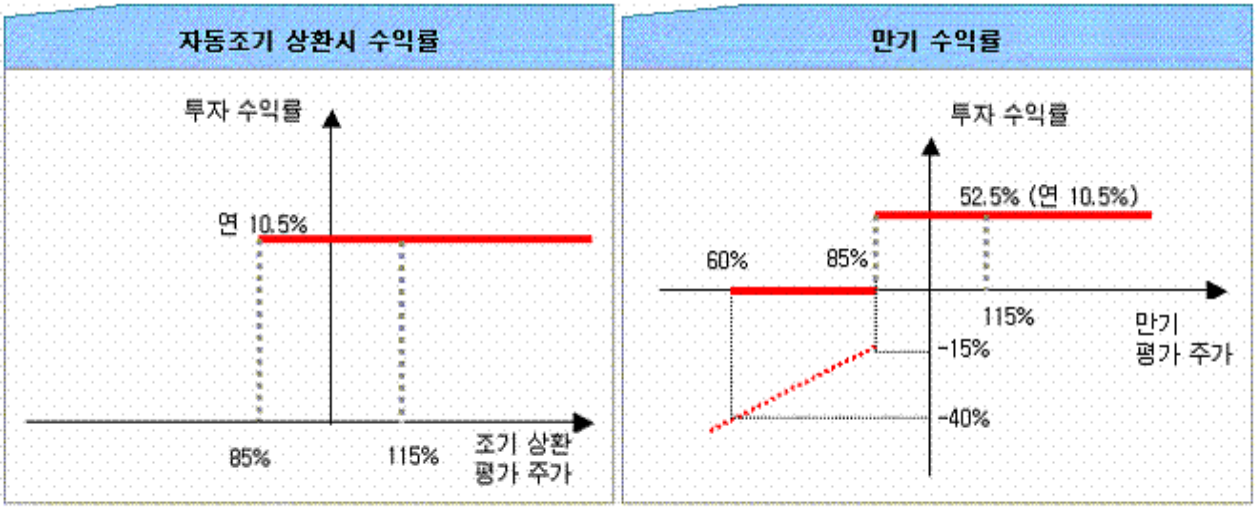
# TwinPower파생SH4

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 29,311 | 0 | 29,311 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 신한지주 보통주·현대차 보통주의 가격이 모두 최초 기준가격 에서 15%이하로 하락하거나, 일별종가기준 두 종목이 동시에 15%이상 상승한 적이 있으면 연 10.5% 수익확보하고 자동조기상환
2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가가격이 기준 가격 대비 두 종목 모두 15% 이하로 하락하는 경우 또는 투자기간 중 일별종가 기준으로 기준가격 대비 동시에 두 종목 모두 15%이상 상승한 적이 있는 경우 | 원금 + 연 10.5% |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 없는 경우(장중 포함) | 원금보존 추구 |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금 손실 (두 종목 중 하락률이 큰종목의 손실률 적용) |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6003459S ELS현대115회060119 | 4,059 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 4,924 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

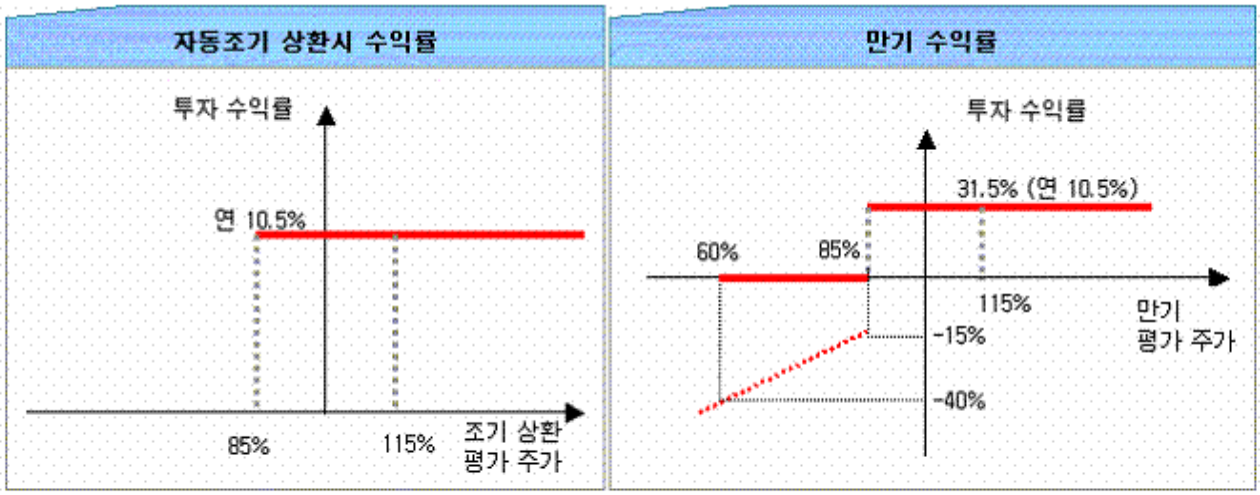
# Tops2스타파생PH3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,228 | 0 | 10,228 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 POSCO 보통주·현대차 보통주의 가격이 모두 최초 기준가격에서 15%이하로 하락하거나, 일별종가기준 두 종목이 동시에 15%이상 상승한 적이 있으면 연 10.5% 수익확보하고 자동조기상환
2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가가격이 기준 가격 대비 두 종목 모두 15% 이하로 하락하는 경우<br>또는 투자기간 중 일별종가 기준으로 기준가격 대비 동시에 두 종목 모두 15%이상 상승한 적이 있는 경우 | 원금 + 연 10.5% |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 없는 경우(장중 포함) | 원금보존 추구 |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금 손실<br>(두 종목 중 하락률이 큰종목의 손실률 적용) |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6003335S ELS하나191회060119 | 1,367 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 2,091 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

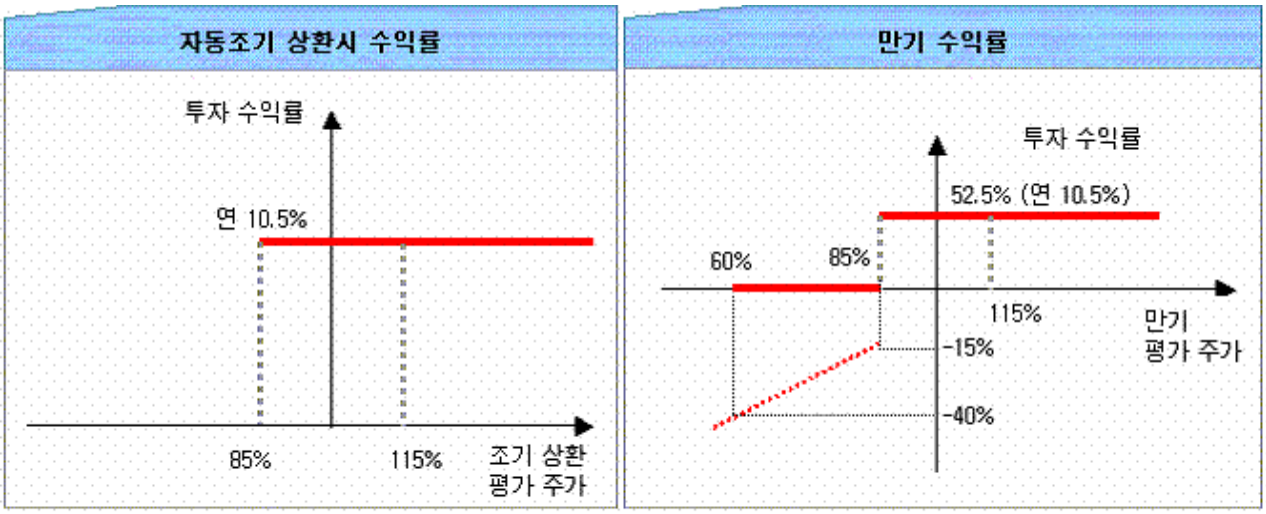
# CHOICE파생SS-28

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 19,278 | 0 | 19,278 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 삼성전자 보통주·신한지주 보통주의 가격이 모두 최초 기준가격 에서 15%이하로 하락하거나, 일별종가기준 두 종목이 동시에 15%이상 상승한 적이 있으면 연 10.5% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가가격이 기준 가격 대비 두 종목 모두 15% 이하로 하락하는 경우 또는 투자기간 중 일별종가 기준으로 기준가격 대비 동시에 두 종목 모두 15%이상 상승한 적이 있는 경우 | 원금 + 연 10.5% |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금보존 추구 |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금 손실 (두 종목 중 하락률이 큰종목의 손실률 적용) |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6001723S ELS신영124회060206 | 2,662 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 3,250 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

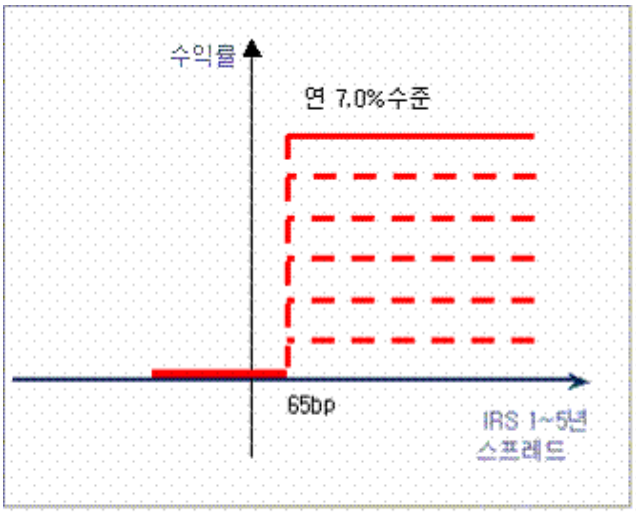
# 금리스프레드파생1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 금리 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 금리 | 옵션 | 614 | 0 | 614 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




**중도상환**

매 6개월 각 중도상환 평가일에
국내 IRS 스프레드 (5년 - 1년)가 65bp 수준보다 큰 경우
☞ 3.5% × n (n = 1, 2, 3, 4, 5,6) 지급 후 청산
(3년만기 매6개월 ; n은 최고 6까지)

**만기상환**

중도상환 평가일에 계속해서 중도상환 조건을 충족하지 못하여 만기에 이른 경우 : 원금보존

1. 조기상환 : 평가일에 6개월마다 국내 이자율 스왑 금리차(5년-1년)가 65bp수준 보다 높을 경우 연7% 수익확보 중도상환
2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만 기 상 환 조 건 | 상 환 금 액 |
|---|---|
| 평가일의 국내 이자율 스왑금리차(5년-1년)가 65bp수준 보다 높을 경우 | 원금 + 연 7% |
| 위의 조건에 해당하지 않고 만기까지 상환되지 않은 경우 | 원금보존 추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS0907140 ELS Deutsche 060721 | 4 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 26 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

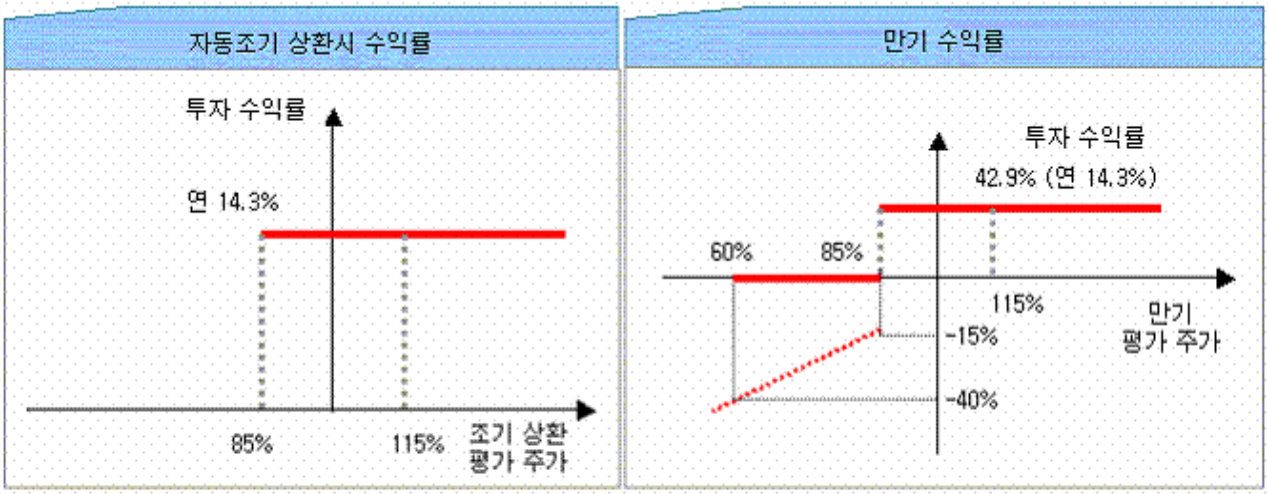
# New2Star파생PH(3Y)-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 44,288 | 0 | 44,288 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 POSCO 보통주·현대자동차 보통주의 가격이 모두 최초 기준가격에서 15%이하로 하락하거나, 일별종가기준 두 종목이 동시에 15%이상 상승한 적이 있으면 연 14.3% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만 기 상 환 조 건 | 상 환 금 액 |
|---|---|
| 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 15% 이하로 하락하는 경우 또는 투자기간 중 일별종가 기준으로 기준가격 대비 동시에 두 종목 모두 15%이상 상승한 적이 있는 경우 | 원금 + 연 14.3% |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 없는 경우(장중 포함) | 원금보존 추구 |
| 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 40% 초과하여 하락한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금 손실(두 종목 중 하락률이 큰 종목의 손실률 적용) |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR6003333S ELS하나306회060907 | 2,600 |
| KR6003543S ELS대신224회060907 | 3,893 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 11,056 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

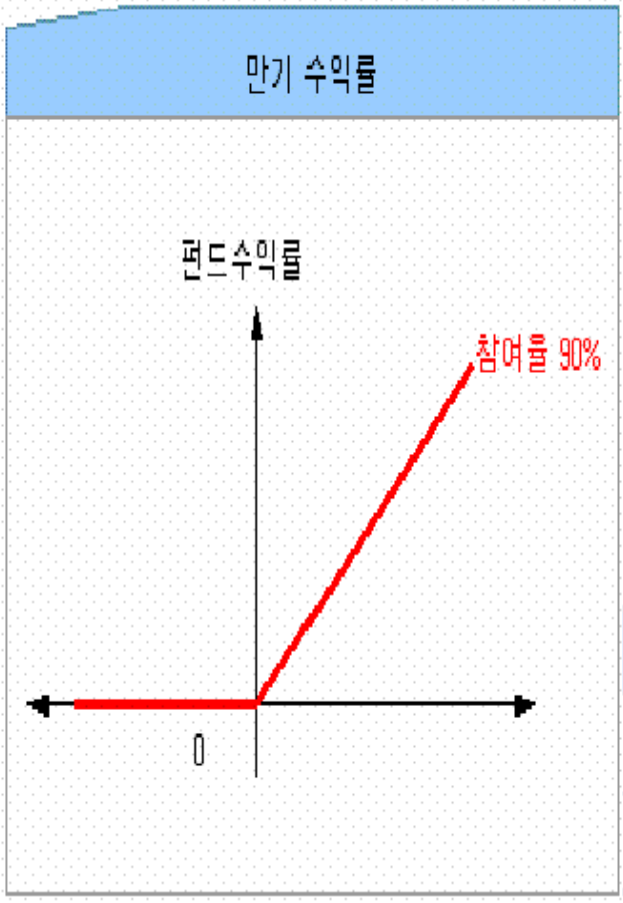
# Tops중국주식환율파생

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 실물자산 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 실물자산 | 옵션 | 4,772 | 0 | 4,772 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 투자기간과 상환조건

- 만기 2년
- 참여율 90% X Max [Basket의 8개 분기 평균수익률, 0]
- 분기별 Basket 상승률이 음수일 경우, 해당 분기수익률은 0을 적용
- Basket: 중국주가지수(HSCEI) 50%, 위완화 50%
- 만기시 원금보전추구

2. 기초자산

| 자산군 | 기초자산 | Bloomberg | 편입비중 |
|---|---|---|---|
| 주 식 | 중국(HSCEI) | HSCEI Index | 50% |
| 외 환 | 위안(CNY/USD) | CYCFUSD | 50% |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600354JS DLS대신4회061221 | 11 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 93 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

# Tops BEST포트폴리오1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,580 | 0 | 5,580 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

1. 투자기간과 상환조건

-만기 3년,-공격적자산구성, 균형적자산구성, 방어적자산구성의 3가지 프로파일 중 베스트 포트폴리오의 성과에 연동
-매년 평가일에 초기지수 평가일 대비 각 포트폴리오별 성과 결정, 주어진 Payoff에 따라 수익률 결정

수익구조:
75% x (1/N) x Max [가장 수익률이 높은 포트폴리오, 0 ], N는 해당 년도.

- 1년째 수익률 : 75% x Max[가장 수익률이 높은 포트폴리오, 0 ]
- 2년째 수익률 : 37.5% x Max[가장 수익률이 높은 포트폴리오, 0 ]
- 3년째 수익률 : 25% x Max[가장 수익률이 높은 포트폴리오, 0 ]

2. 기초자산

| | |
|---|---|
| 주식 | 미국 : Standard and Poor's 500 Index. (SPX Index)<br>유럽 : Dow Jones Euro STOXX 50 Price Index (SX5E Index)<br>일본 : Nikkei-225 Stock Average Index. (NKY Index) |
| 채권 | 미국 : iShares Lehman US Aggregate Bond Fund (AGG US Equity)<br>유럽 : iBoxx Euro Sovereigns Eurozone Performance Index (QW1A Index) |
| 상품 | WTI (CL1 cmdty) / Nickel (LONIDY cmdty) / Zinc (LOZSDY cmdty) |
| 부동산 | Tokyo Stock Exchange REIT Index (TSEREIT index) |

3. 쿠폰수익률 산출방법

| | 주식 | 채권 | 상품 | 부동산 |
|---|---|---|---|---|
| 공격적 포트폴리오 | 50% | 20% | 15% | 15% |
| 균형적 포트폴리오 | 40% | 40% | 10% | 10% |
| 방어적 포트폴리오 | 20% | 50% | 15% | 15% |

| | 주식 | | | 채권 | | 상품 | | | 부동산 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | S&P500 | DJ유로 | NIKKEI | AGG | QWA | WTI | 니켈 | 아연 | J-REIT |
| 공격적 포트폴리오 | 16.67% | 16.67% | 16.67% | 10.00% | 10.00% | 5.00% | 5.00% | 5.00% | 15.00% |
| 균형적 포트폴리오 | 13.37% | 13.33% | 13.33% | 20.00% | 20.00% | 3.33% | 3.33% | 3.33% | 10.00% |
| 방어적 포트폴리오 | 6.67% | 6.67% | 6.67% | 25.00% | 25.00% | 5.00% | 5.00% | 5.00% | 15.00% |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1001220 DLS_Barclays070202 | 102 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 34 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

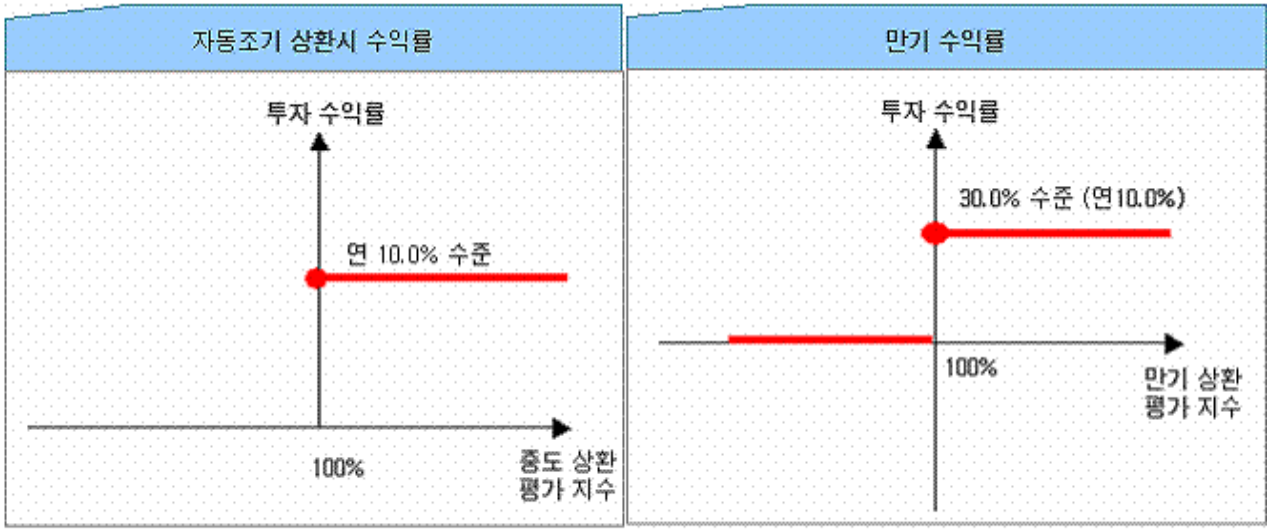
# Tops아시아2Star파생1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 26,848 | 0 | 26,848 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 중국주식(HSCEI) · 일본부동산(TSE REIT) 지수가 모두 기준지수 이상인 경우에 연 10% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가지수가 기준 지수 대비 두 지수 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연 10%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 만기까지 상환되지 않는 경우 | 원금보존추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR600172NT ELS신영465회060216 | 264 |
| KR6003336T ELS하나392회060216 | 197 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 173 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

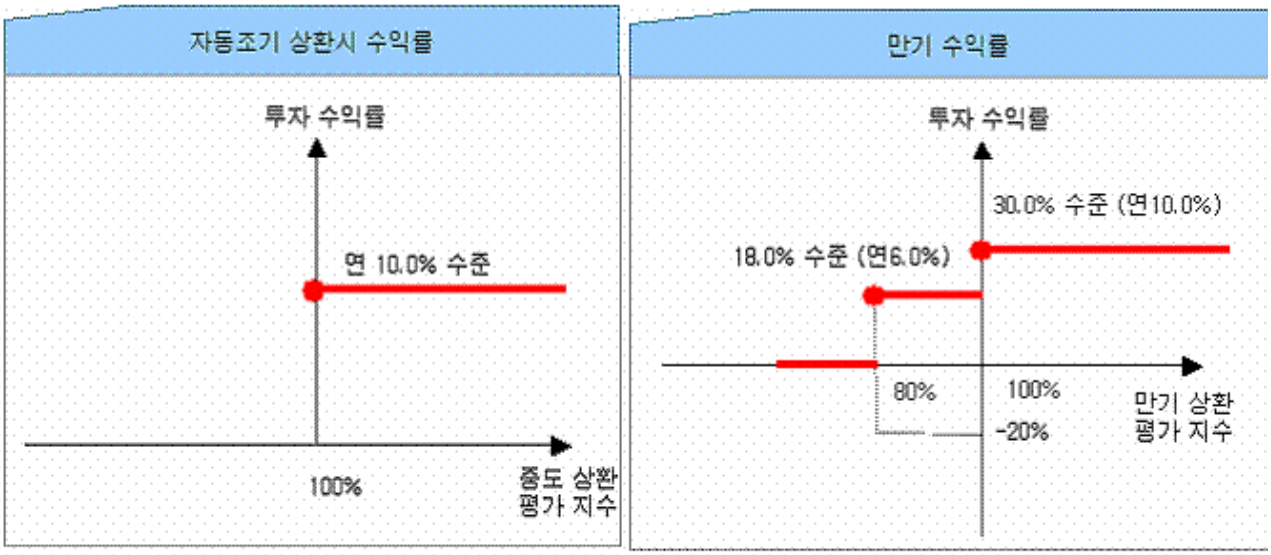
# 아시아2Star파생2호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 23,723 | 0 | 23,723 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 중국주식(HSCEI) · 일본부동산(TSE REIT) 지수가 모두 기준지수 이상인 경우에 연 10% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가지수가 기준 지수 대비 두 지수 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연 10%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 연6.0%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR6003546T ELS대신332회060308 | 166 |
| KRS1002250 ELS UBS 070312 | 168 |
| KRS1003020 ELS Deutsche 070312 | 168 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 192 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

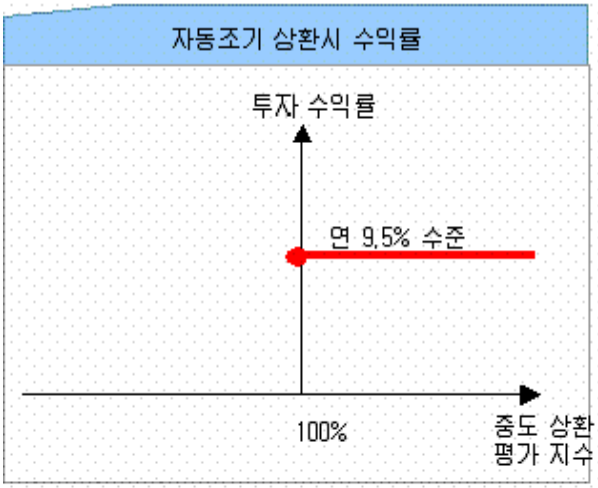
# 아시아2Star파생3호

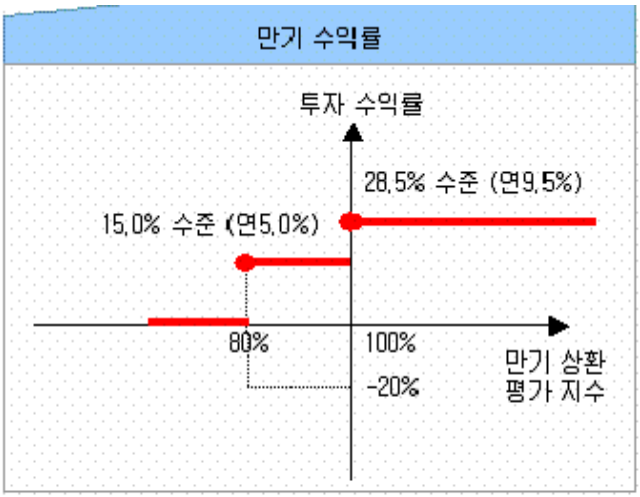
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,362 | 0 | 1,362 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 일본주식(NIKKEI225) · 일본부동산(TSE REIT) 지수가 모두 기준지수 이상인 경우에 연 9.5% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가지수가 기준 지수 대비 두 지수 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연 9.5%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 연5.0%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6003545T ELS대신333회060308 | 26 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 10 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

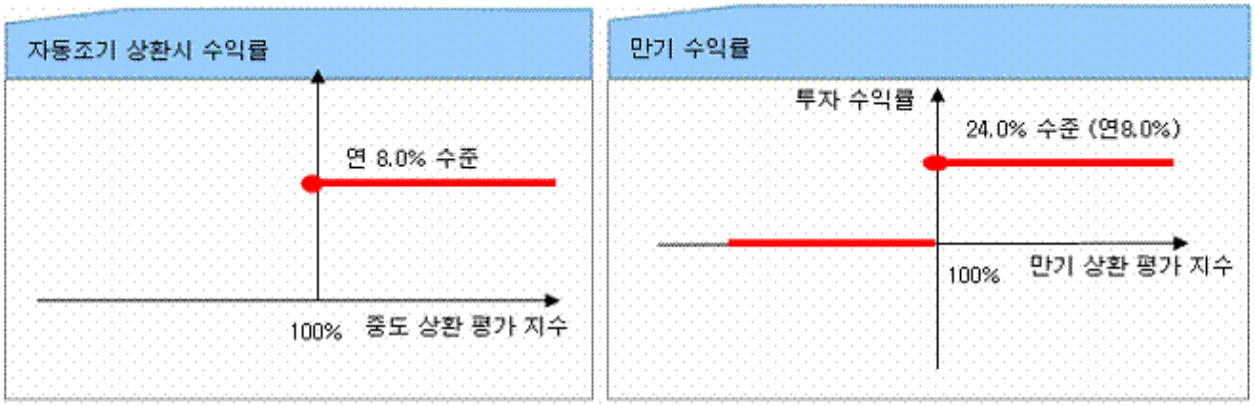
# Neo2Star파생SP-5

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 27,797 | 0 | 27,797 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 신한지주 보통주 ¡¤ POSCO 보통주의 가격이 모두 최초 기준가격 이상인 경우 연 8% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가가격이 최초 기준 가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연 8% |
| 위의 조건에 해당하지 않고 만기까지 상환되지 않은 경우 | 원금보존추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR600172LT ELS신영502회070315 | 247 |
| KR600345ST ELS현대423회070315 | 202 |
| KR600867CT ELS굿모닝635회070315 | 522 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,728 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

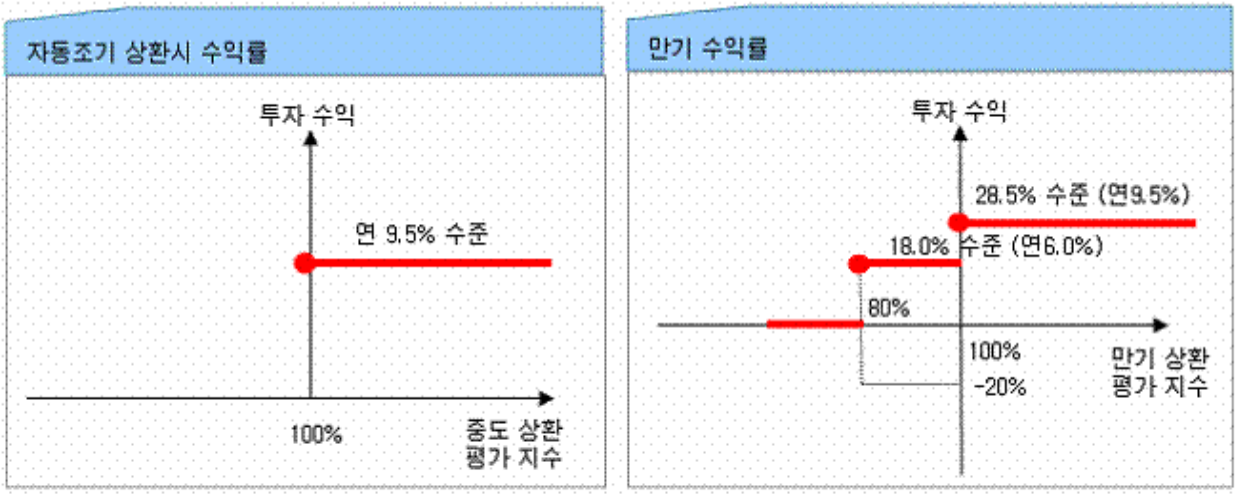
# 아시아2Star파생4호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,494 | 0 | 1,494 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 일본주식(NIKKEI225) ¡¤ 일본부동산(TSE REIT) 지수가 모두 기준지수 이상인 경우에 연 9.5% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가지수가 기준 지수 대비 두 지수 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연 9.5%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 연6.0%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600345ST ELS현대2007-448회070329 | 23 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 11 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

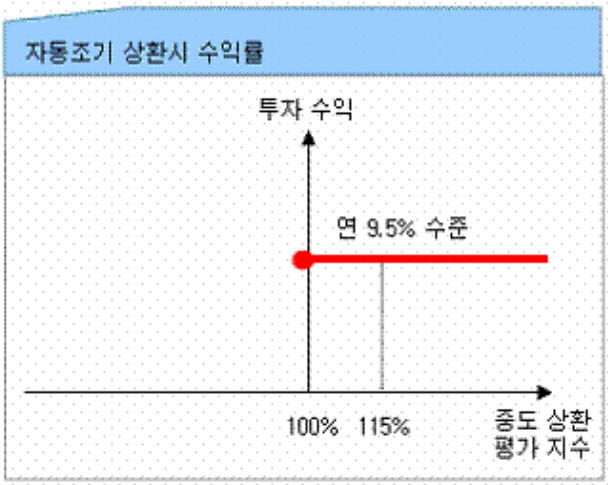
# 아시아2Star파생5호

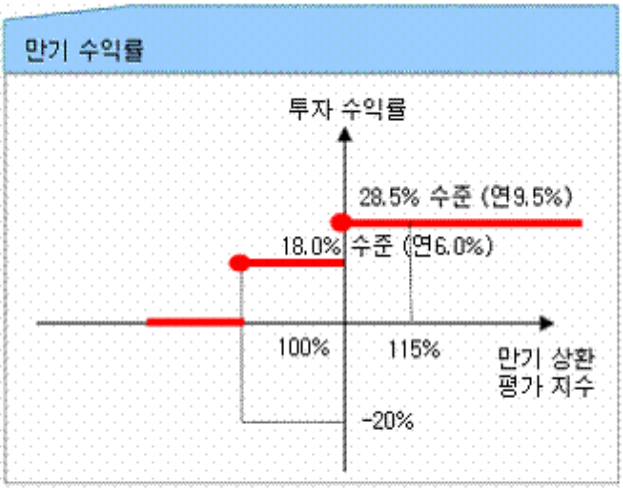
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 42,089 | 0 | 42,089 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 일본주식(NIKKEI225) ¡¤ 일본부동산(TSE REIT) 지수가 모두 기준지수 이상이거나, 일별종가기준 두 지수가 동시에 15%이상 상승한 적이 있는 경우에 연 9.5% 수익확보하고 자동조기상환

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| 평가일의 평가지수가 기준 지수 대비 두 지수 모두 100% 이상이거나 일별종가기준 두 지수가 동시에 15%이상 상승한 적이 있는 경우 | 원금 + 연 9.5%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 연6.0%수준 |
| 위의 조건에 해당되지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR600333DT ELS하나425회060404 | 433 |
| KR600594KT ELS우리1089회060404 | 260 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 189 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

# Carry Trading파생1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,024 | 0 | 8,024 | 장외 |

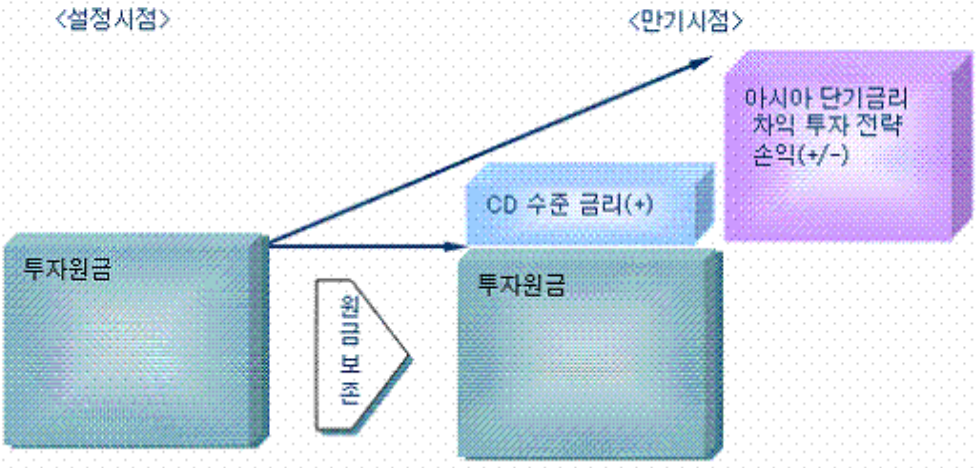
## 2. 만기시점의 손익구조

1. 투자기간과 상환조건

- 만기 5년
- 누적수익률 15%달성시 매3개월 중도상환 가능
  UBS의 예금 금리에 더하여 금리가 낮은 대만 및 싱가폴달러로 단기자금조달, 금리가 높은 아시아 3개월만기 단기 금리
- 포트폴리오에 투자하여 금리차익효과추구
  만기시 CD금리 수준 금리 + 금리차 활용 투자전략의 누적 손익에 따라 수익률 결정, 원금보존 추구형

2. 수익구조

- 운용자산의 일정부분을 아시아 단기금리 차익 전략에 투자하여 수익 확보
- 투자부문 일정 수익률 이하로 하락 시 Stop-Loss 실행
  ⇒ 만기 또는 조기상환 시점 :투자원금 +투자 전략 누적 손익+CD 수준 금리




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1204100 ELS_UBS-Asian_070411 | 0 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 0 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

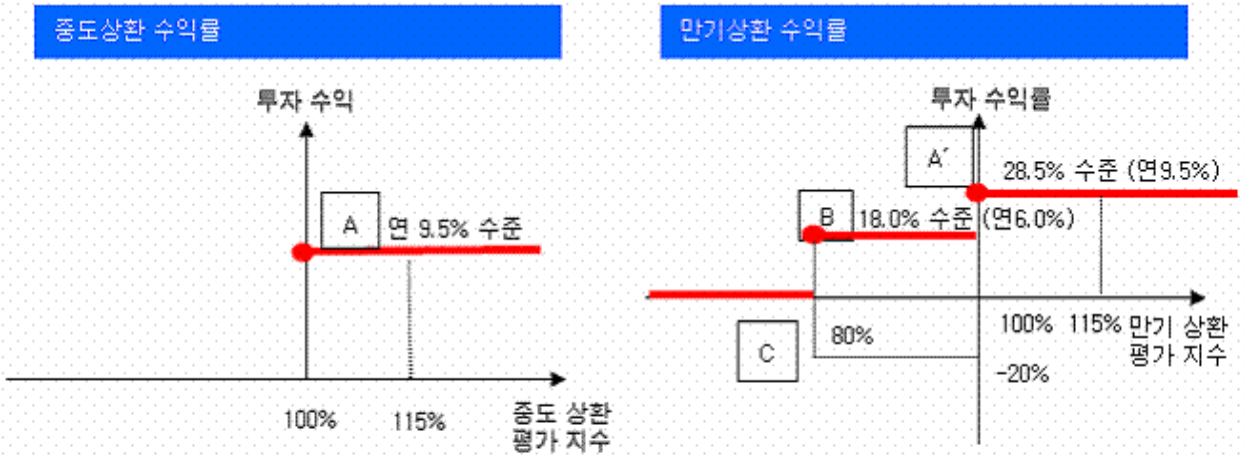
# 아시아2Star파생6호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 28,141 | 0 | 28,141 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 투자기간중 동일일자에 기초자산인 일본주식(NIKKEI225), 일본부동산(TSE REIT) 지수의 종가가 115%에 도달하거나, 조기상환 평가일의 평가지수가 두 지수 모두 기준지수 이상인 경우 연 9.5% 수준으로 상환.

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| - 평가일의 평가지수가 기준지수대비 두지수 모두 100% 이상인 경우<br>- 투자기간중 동일일자에 기준지수대비 115%에 도달한 경우(종가기준) | 원금 + 연9.5% 수준 |
| - 위의 조건에 해당하지 않고 투자기간중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우(장중포함) | 원금보존추구 |
| - 위의 조건에 해당하지 않고 투자기간중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우(장중포함) | 원금 + 18.0%(연 6.0%) 수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR600345XT ELS현대466회060426 | 173 |
| KR6005941T ELS우리1122회060426 | 141 |
| KR601636CT ELS삼성1180회060426 | 173 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 160 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

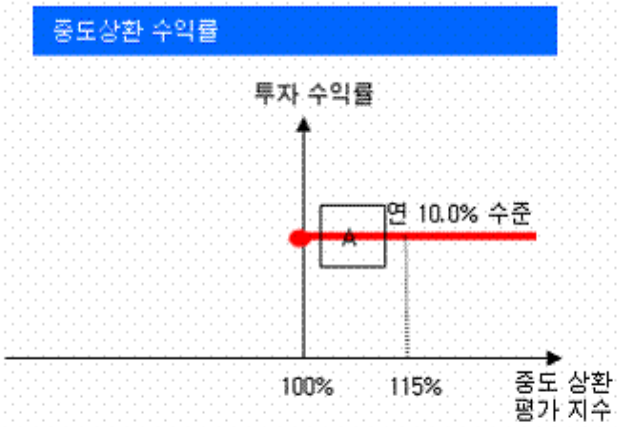
# Tops아시아2Star파생7

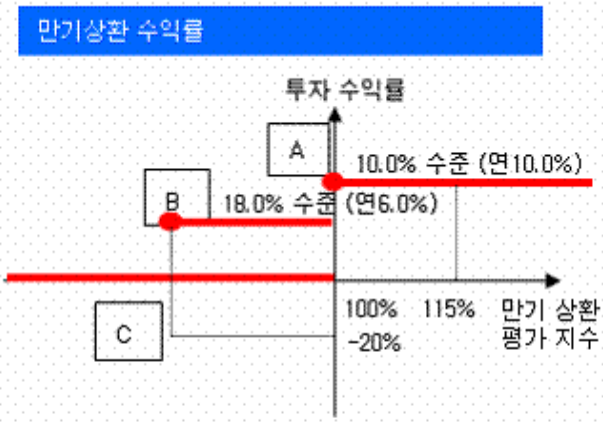
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 11,060 | 0 | 11,060 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 투자기간중 기초자산인 일본주식(NIKKEI 225) 및 일본부동산(TSE REIT) 두지수가 종가기준 115%에 도달하거나 평가일의 평가지수가 두지수 모두 기존지수이상인 경우 연 10.0% 수준으로 상환.

2. 만기 상환 (조기에 상환되지 않은 경우) :

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| - 평가일의 평가지수가 기준지수 대비 두 지수 모두 100% 이상인 경우<br>- 투자기간 중 동일 일자에(종가 기준) 기준지수 대비 115% 도달한 경우 | 원금 + 연10.0%수준 |
| - 위 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| - 위의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%) 수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR600172CT ELS신영571회060510 | 92 |
| KR600594KT ELS우리1148회060510 | 75 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 45 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

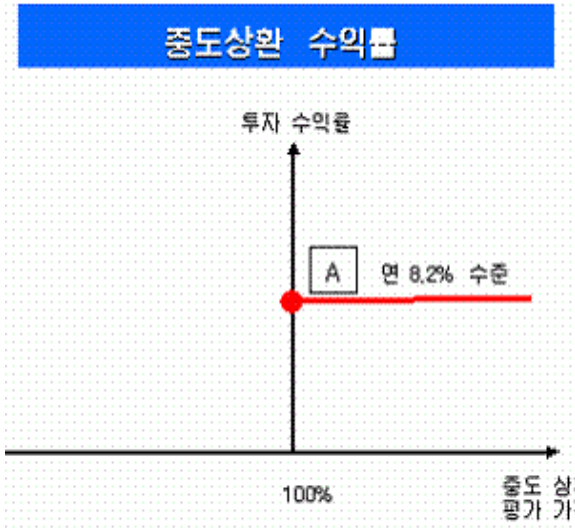
# Neo 2Star 파생SP-9호

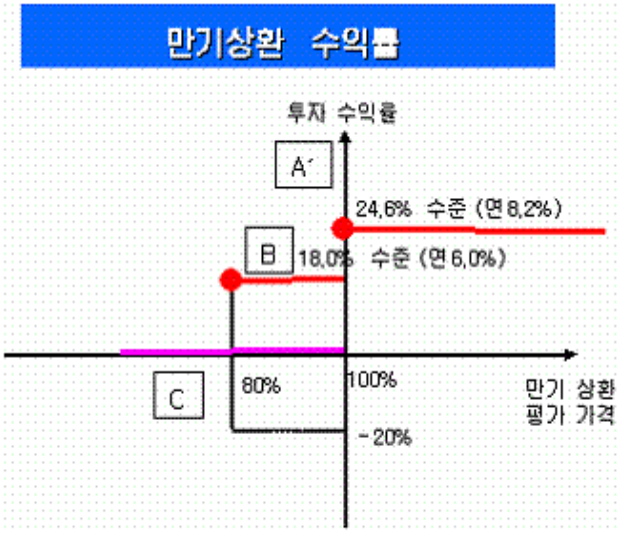
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,733 | 0 | 8,733 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환평가일에 기초자산으로 구성된 신한지주, Posco의 주가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 8.2% 수준으로 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|
| - 평가일의 평가주가가 기준주가 대비 두 주가 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연8.2%수준 |
| - 위의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준주가의 80% 미만으로 하락 (하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| - 위의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준주가의 80% 미만으로 하락 (하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR600172QT ELS신영586회070525 | 143 |
| KR603049VT ELS한투613회070525 | 132 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 443 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

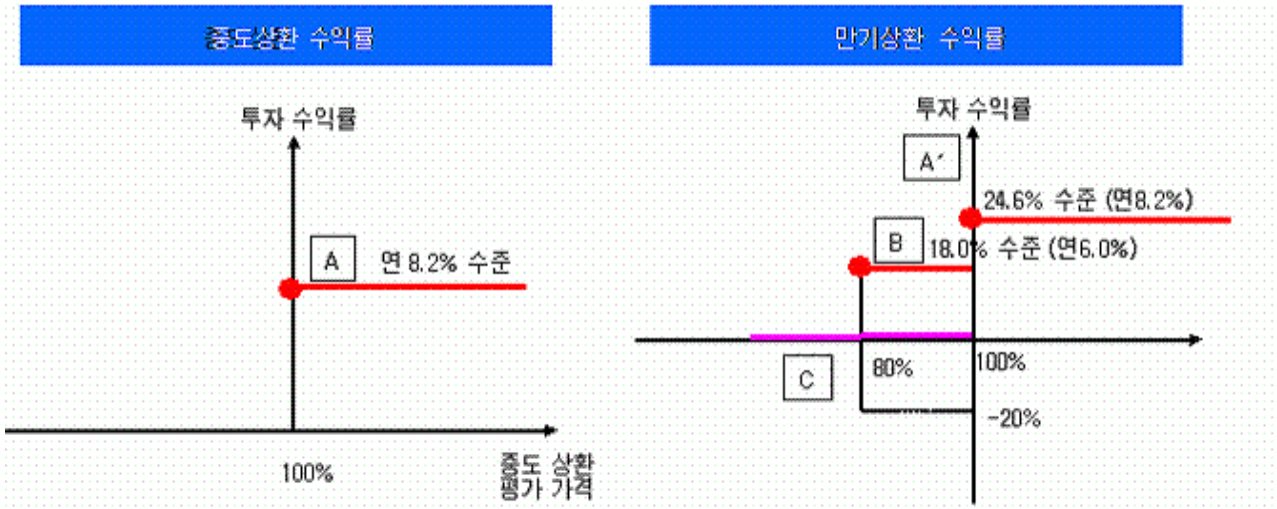
# Neo 2Star 파생SP-10

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 14,615 | 0 | 14,615 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환 평가일에 기초자산으로 구성된 신한지주, POSCO 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 8.2%수준으로 상환

2. 만기상환 (조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | 평가일의 평가주가가 기준주가 대비 두 주가 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연8.2%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 한 종목이라도 기준주가의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 한 종목이라도 기준주가의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR6003541T ELS대신378회070605 | 205 |
| KR6037626T ELS미래142회070605 | 233 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 779 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

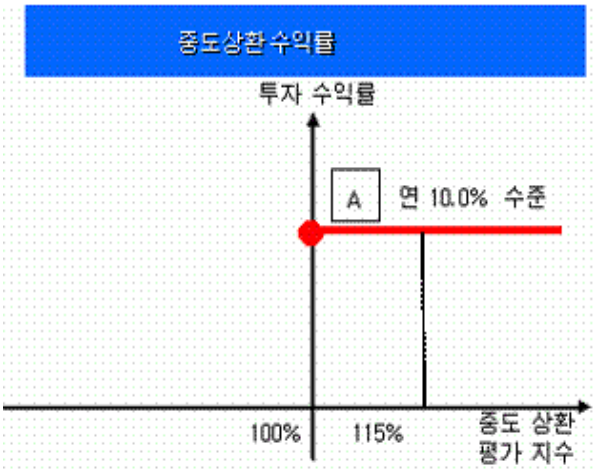
# 아시아2Star파생8호

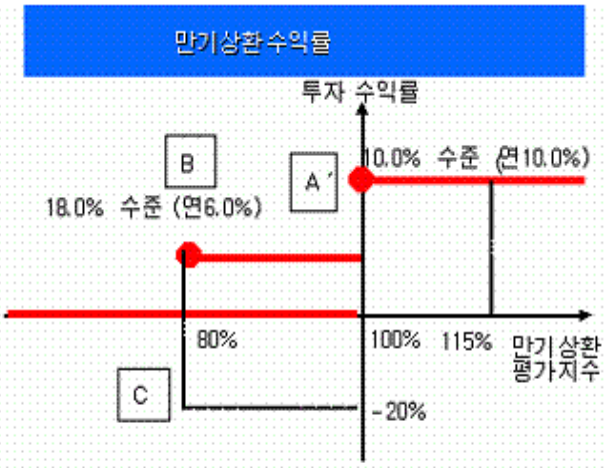
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,286 | 0 | 8,286 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 투자기간 중 기초자산인 일본 NIKKEI225, TSE REIT 두 지수가 동일일자에 종가가 115% 도달하거나, 평가일의 평가지수가 두 지수 모두 기준지수 이상인 경우 연 10.0% 수준으로 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 기준지수 대비 두 지수 모두 100% 이상인 경우<br>- 투자기간 중 동일 일자에(종가 기준) 기준지수 대비 115% 도달한 경우 | 원금 + 연10.0%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 지수라도 기준지수의80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6008676T ELS굿모닝706회070605 | 126 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 52 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

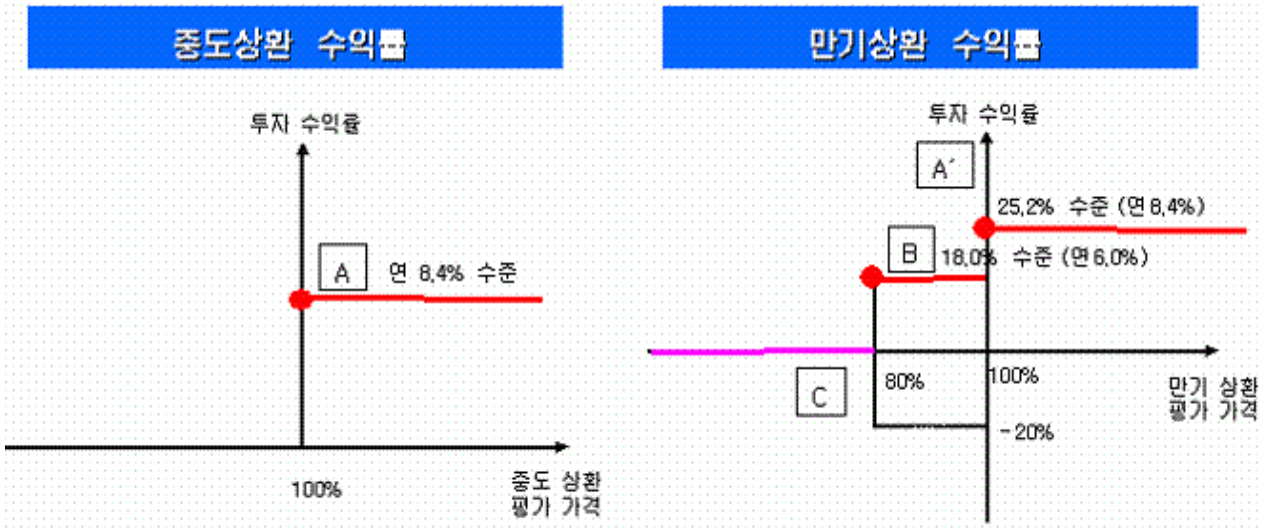
# Neo 2Star 파생SP-11

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 13,858 | 0 | 13,858 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환 평가일에 기초자산으로 구성된 신한지주, POSCO 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 8.4%수준으로 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연8.4%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR6003547T ELS대신383회070620 | 54 |
| KR6006808T ELS대우1404회070620 | 346 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 688 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

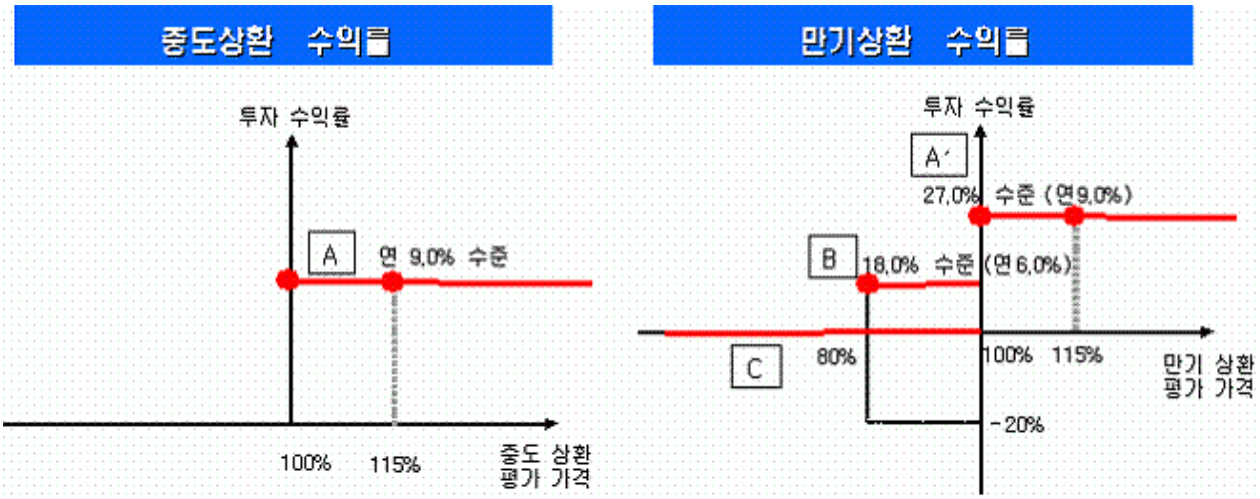
# Neo 3Star 파생SNK-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 835 | 0 | 835 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환 평가일에 기초자산으로 구성된 신한지주보통주, KOSPI200 Index, NIKKEI 225 의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 9.0%수준으로 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 세 종목 모두 100% 이상인 경우<br>- 기준가격 대비 동일일자에 세종목 종가가115%에 도달한 적이 있는 경우 | 원금 + 연9.0%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금 보존 추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%) 수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600172JTI ELS신영612회070620 | 24 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 20 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

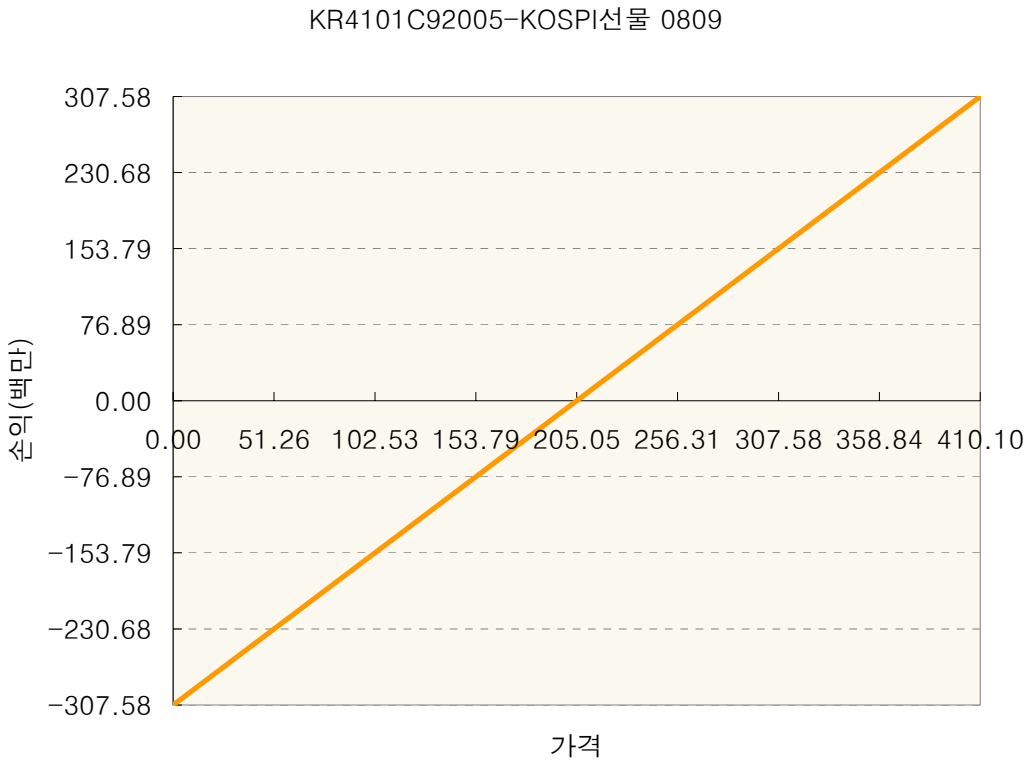
# 모아펀더멘탈파생1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 308 | 0 | 308 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101C920 KOSPI선물 0809 | 24 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 39 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

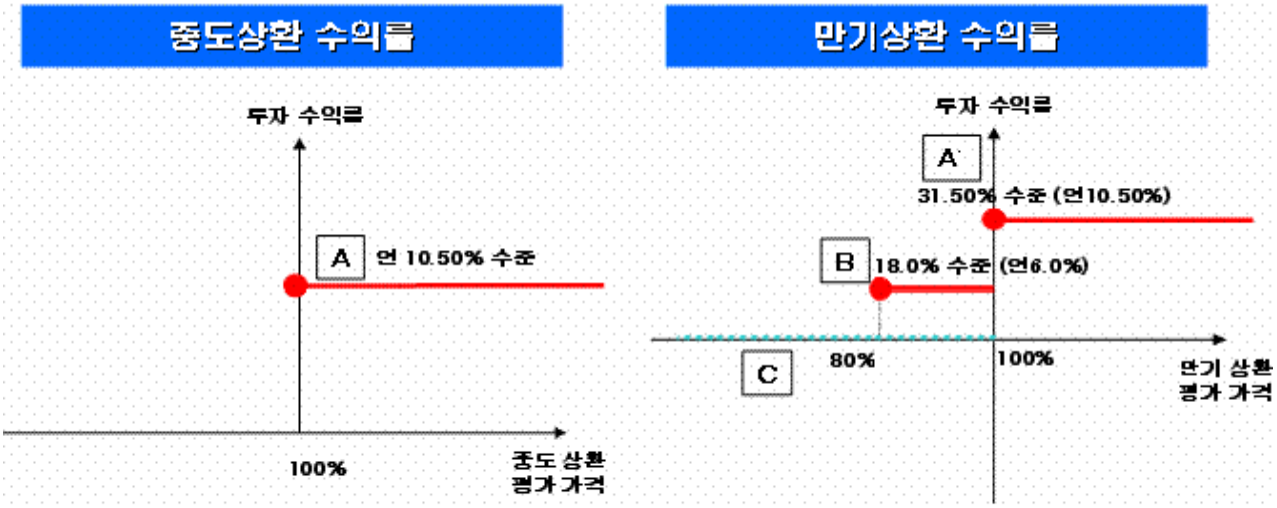
# 4Star 파생 SPST-1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,572 | 0 | 5,572 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 투자기간 동안 매 평가일마다 평가가격이 기준가격 이상인 기초자산(신한지주, 삼성전자, 포스코, TSE커EIT)은 제거되는 Removal 구조로 모든 기초자산이 제거되면(잔존 종목이 없으면) 연 10.5% 수준으로 중도상환.

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 잔존 종목 모두 100% 이상인 경우 (네 종목 모두 기초자산에서 제거) | 원금 + 연10.50%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락 (하락률 20%)한 적이 있는 경우(장중 포함) | 원금 보존 추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락 (하락률 20%)한 적이 없는 경우(장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600594FT ELS우리1227회070704 | 99 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 57 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

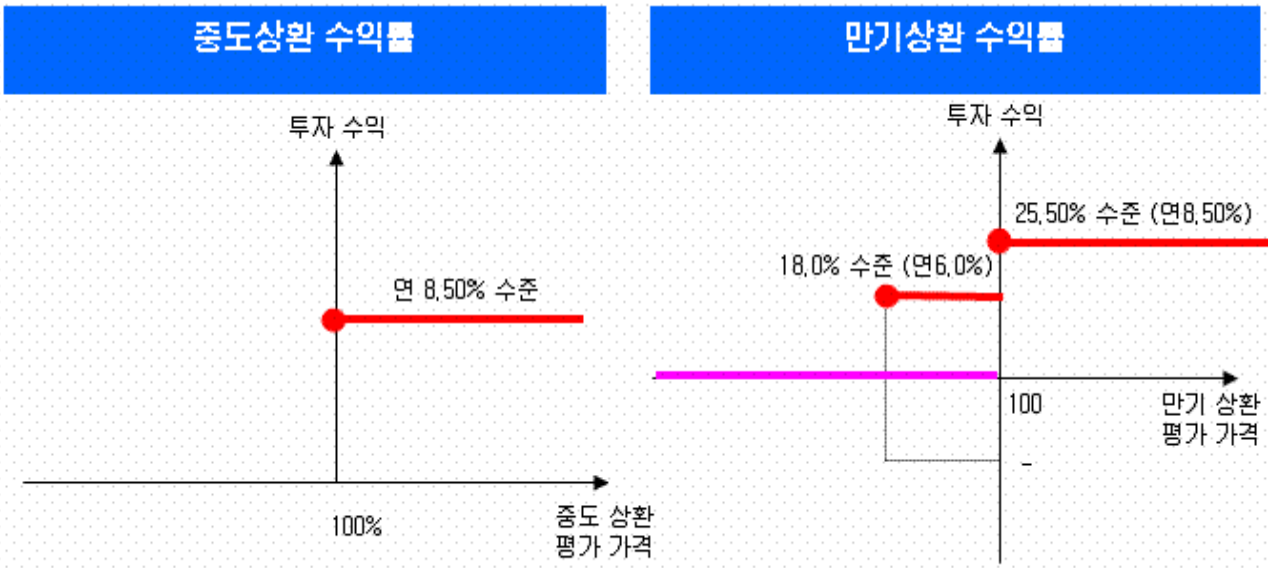
# 엔비유2Star파생SS1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,196 | 0 | 4,196 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환 평가일에 기초자산으로 구성된 신한지주, 삼성전자 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 8.5%수준으로 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연8.5%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600594RT ELS우리1257회070723 | 106 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

158

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

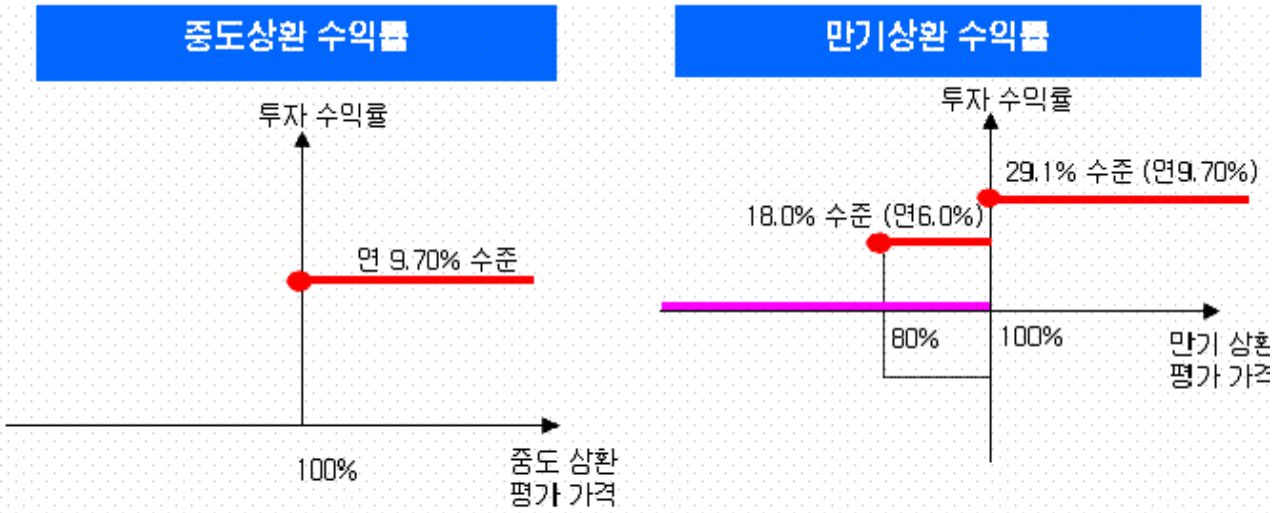
# 엔비유2Star파생SP-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,727 | 0 | 6,727 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환 평가일에 기초자산으로 구성된 신한지주, POSCO 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 9.7%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연9.7%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS0708070 ELS Deutsche 070807 | 178 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 276 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

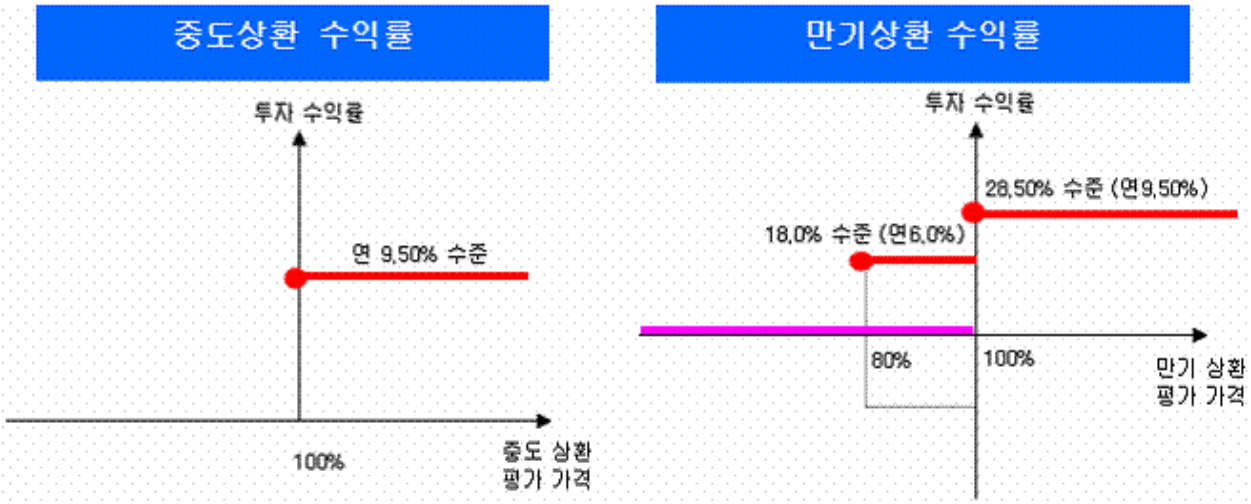
# 엔비유2Star파생PS-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 926 | 0 | 926 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환 평가일에 기초자산으로 구성된 POSCO, 삼성전자 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 9.5%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연9.5%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6006805T ELS대우1535회070803 | 37 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 45 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

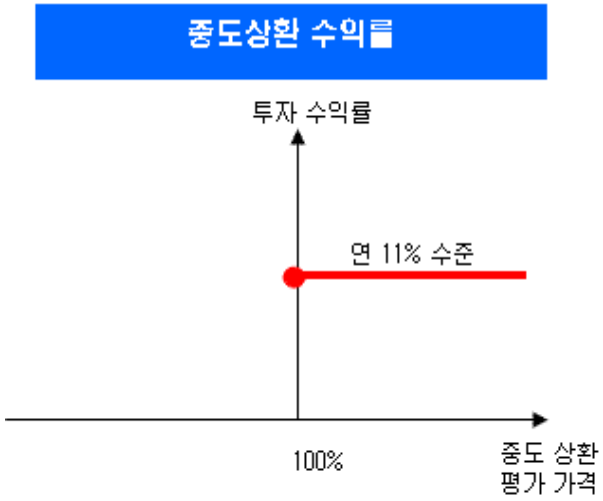
# 엔비유2Star파생PH-1

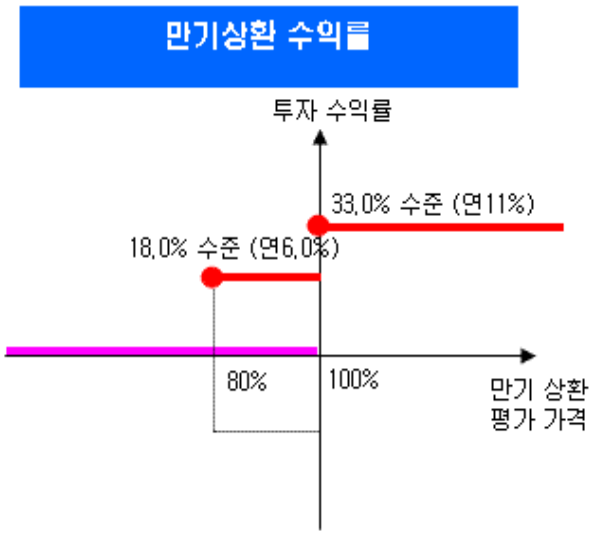
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 19,284 | 0 | 19,284 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 중도상환 평가일에 기초자산으로 구성된 POSCO, 현대중공업 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 11%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연11%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6003545T ELS대신408회070904 | 588 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 1,007 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

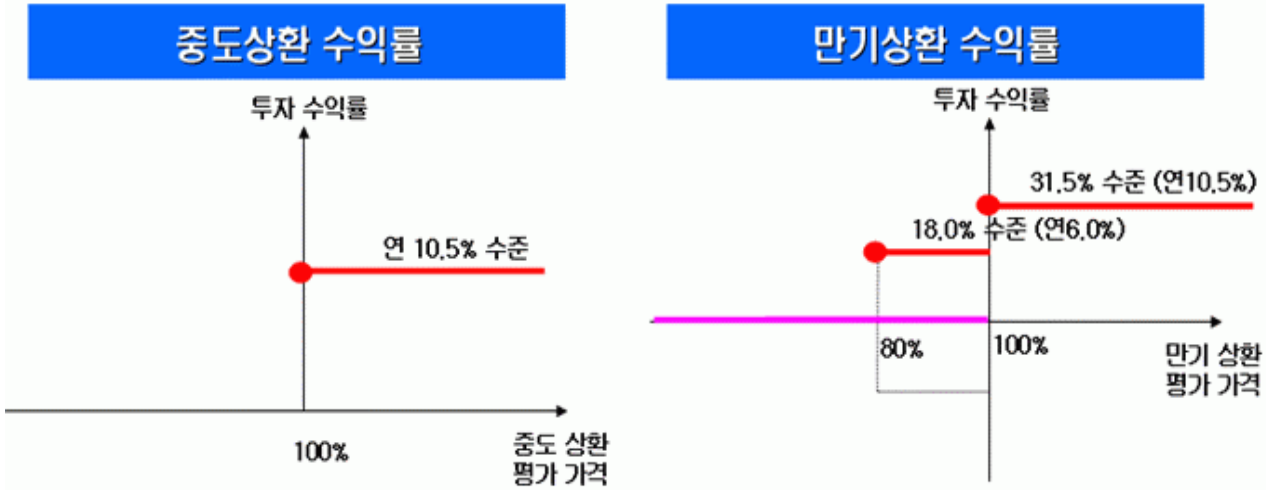
# 엔비유2Star파생SP-2

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 9,684 | 0 | 9,684 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행일로부터 매 6개월 경과일에 기초자산으로 구성된 POSCO, 신한지주 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 10.5%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연10.5%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1010010 ELS Deutsche 071009 | 226 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 315 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

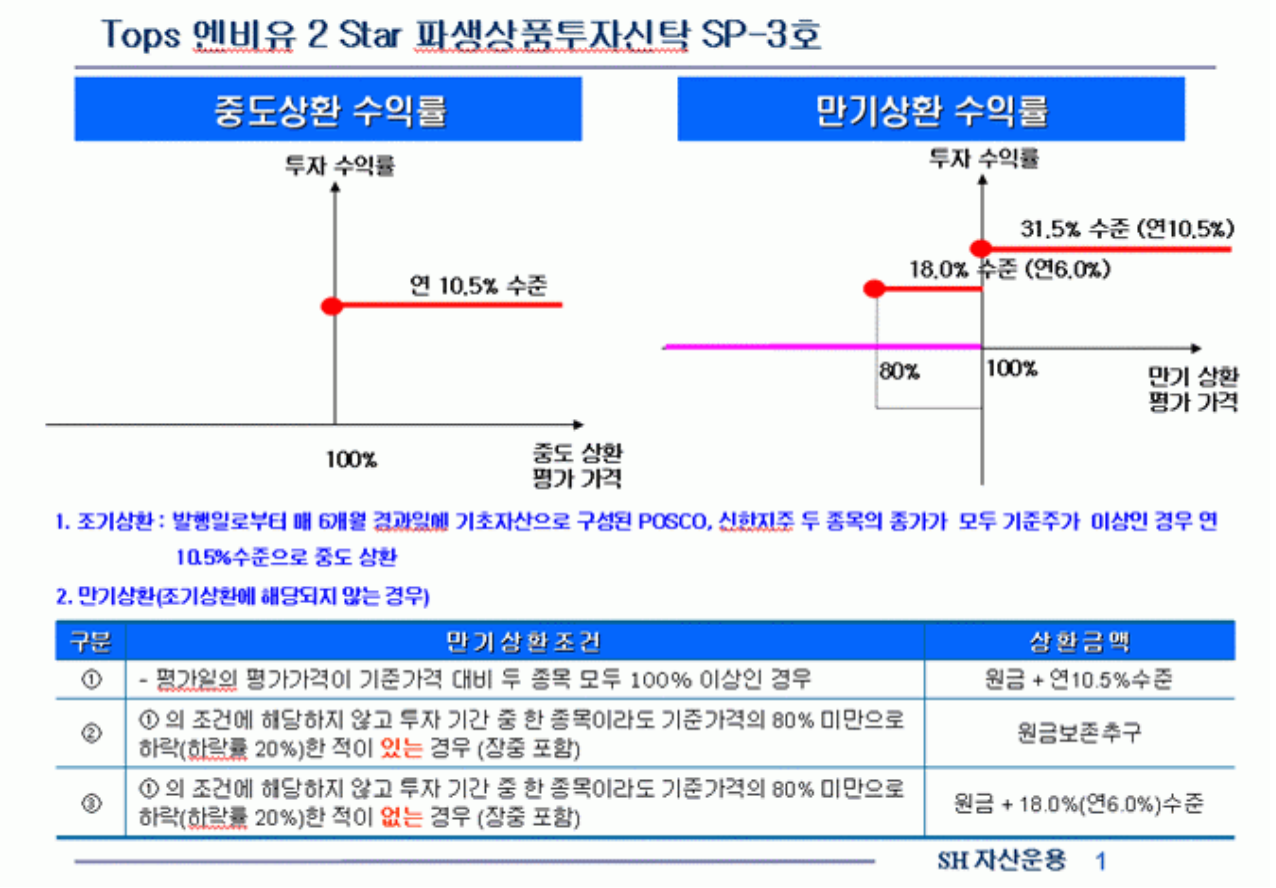
# 엔비유2Star파생SP-3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 4,637 | 0 | 4,637 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1010150 ELS Deutsche 071022 | 114 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 181 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

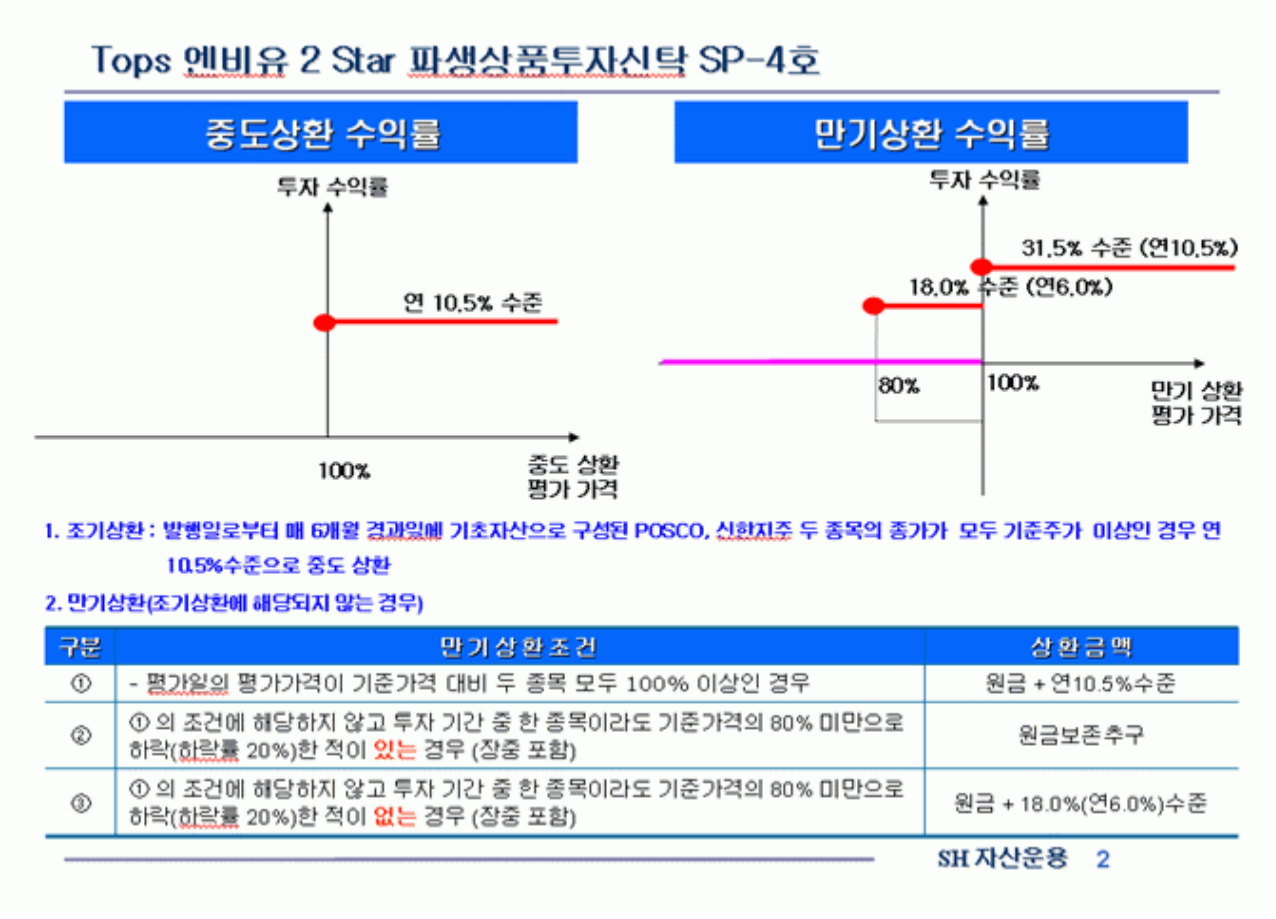
# 엔비유2Star파생SP-4

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 34,160 | 0 | 34,160 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1011010 ELS Deutsche 071107 | 880 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 1,406 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

# 골드파생1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

### SH 골드파생상품투자신탁 1호

1. 투자대상 및 수익구조

| 투자대상 | 투자비중 | 내용 |
|---|---|---|
| 골드리슈(Gold Riche)자유 | 30%내외 | 은행을 통해 금실물의 거래 없이 통장으로 금을 자유로이 입출금할 수 있는 상품으로 가입대상, 가입기간, 적립량의 제한이 없이 자유로운 입출금이 가능한 상품인 신한은행 골드리슈자유에 투자 |
| 금광주(AMEX Gold Miners Index 종목) | 70%내외 | AMEX Gold Miners Index를 추종하는 포트폴리오 구성, 금광업 기업 주식에 직접투자 |

- 골드리슈 상품 중 금실물의 거래 없이 통장으로 금을 자유로이 입출금 할 수 있는 상품에 투자하며, 매매기준율에 연동하여 가격변동이 이루어짐.

**매매기준율 결정**

- 국제금시세 : 로이터에서 제공하는 bid-offer 가격의 Midrate 또는 이 가격 사이에서 달러의 재량에 의해 국제 금시세를 적용
- 국제금시세는 달러기준 트로이온스(1toz=31.1034768g) 단위로 99.99%의 금 기준으로 표시되므로 원화기준 그램단위로 바꾸면 [ 국제금시세 × 원달러 매매기준율 ÷ 31.1034768 × 0.9999 ]로 계산됨
- 매매기준율 = 국제금시세 × 원달러 매매기준율 ÷ 31.1034768 × 0.9999

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KRS1711050 DLS신한GOLD071105 | 871 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,084 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

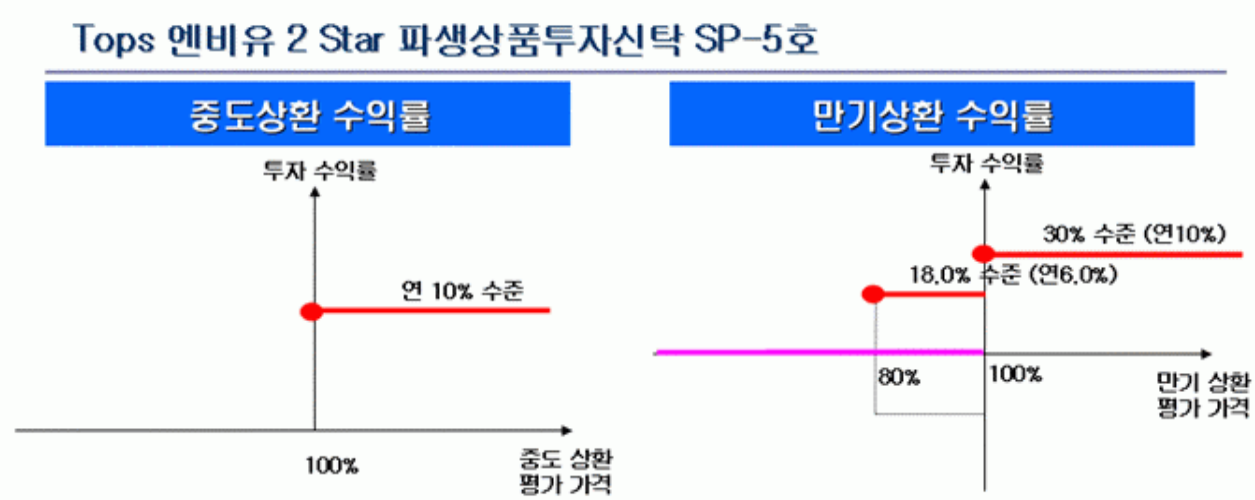
# 엔비유2Star파생SP-5

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,203 | 0 | 10,203 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행일로부터 매 6개월 경과일에 기초자산으로 구성된 POSCO, 신한지주 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 10%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연10%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600594LT ELS우리1507회20071129 | 391 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 549 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

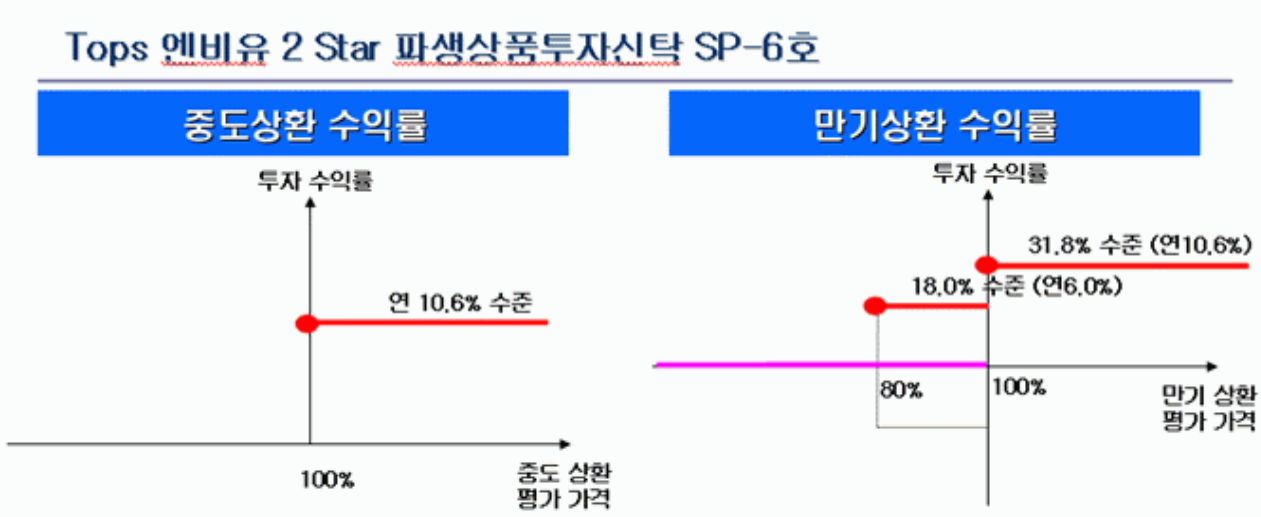
# 엔비유2Star파생SP-6

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,511 | 0 | 1,511 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행일로부터 매 6개월 경과일에 기초자산으로 구성된 POSCO, 신한지주 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 10.6%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연10.6%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 18.0%(연6.0%)수준 |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1012130 ELS Deutsche 071220 | 46 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 68 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

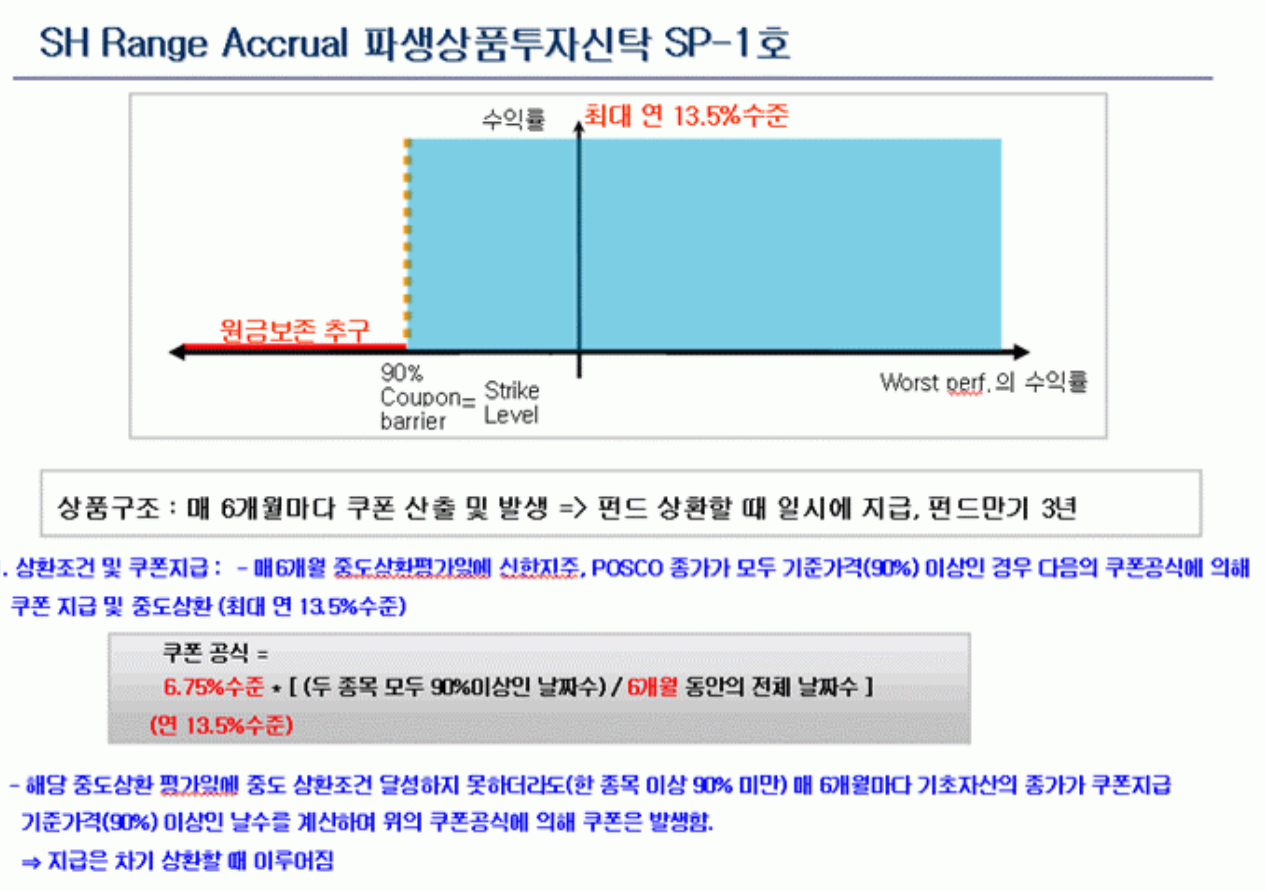
# Range Accrual파생SP1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,460 | 0 | 10,460 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KRS1102240 ELS Deutsche 080225 | 489 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 725 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

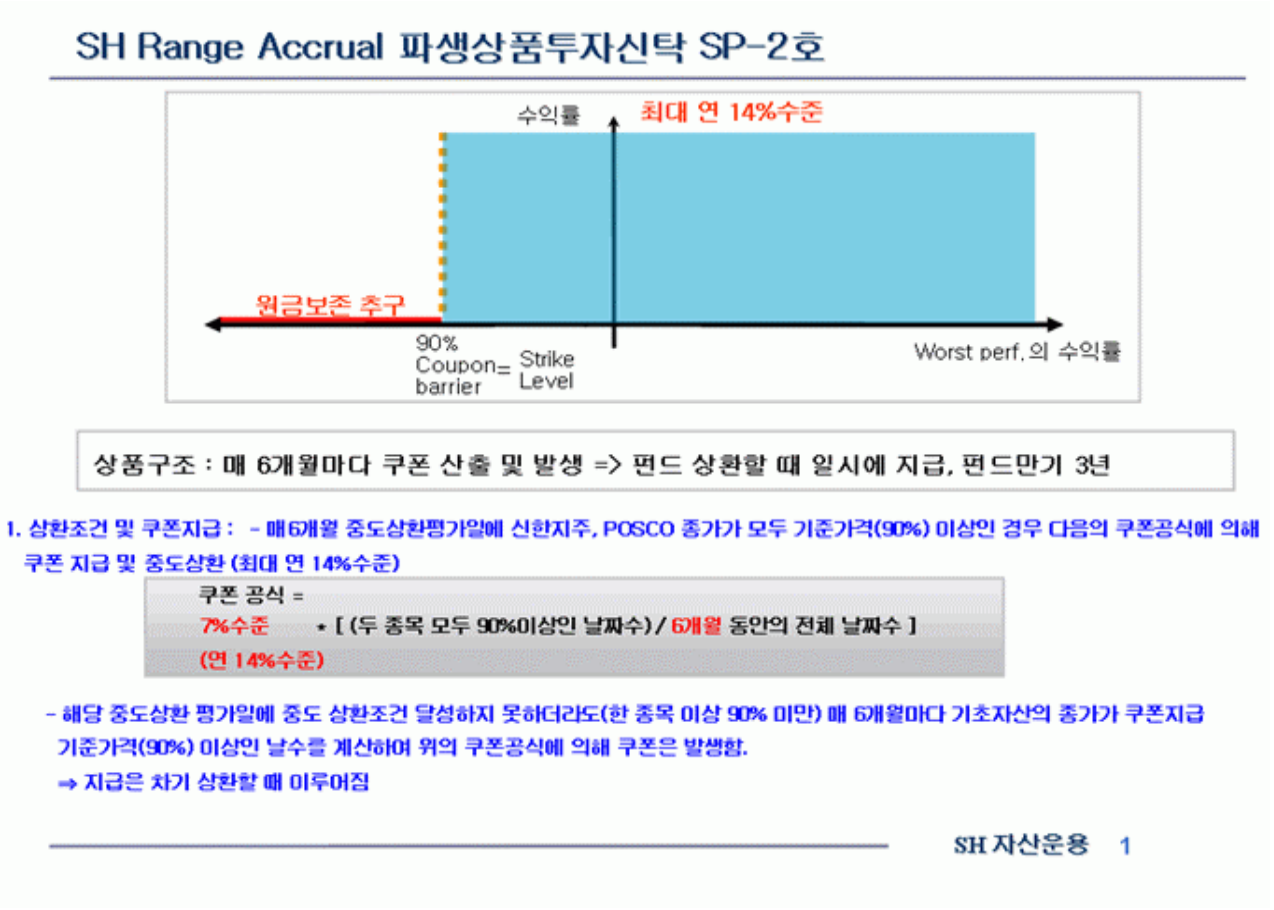
# Range Accural파생SP2

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,264 | 0 | 10,264 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1103020 ELS Deutsche 080307 | 456 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 809 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

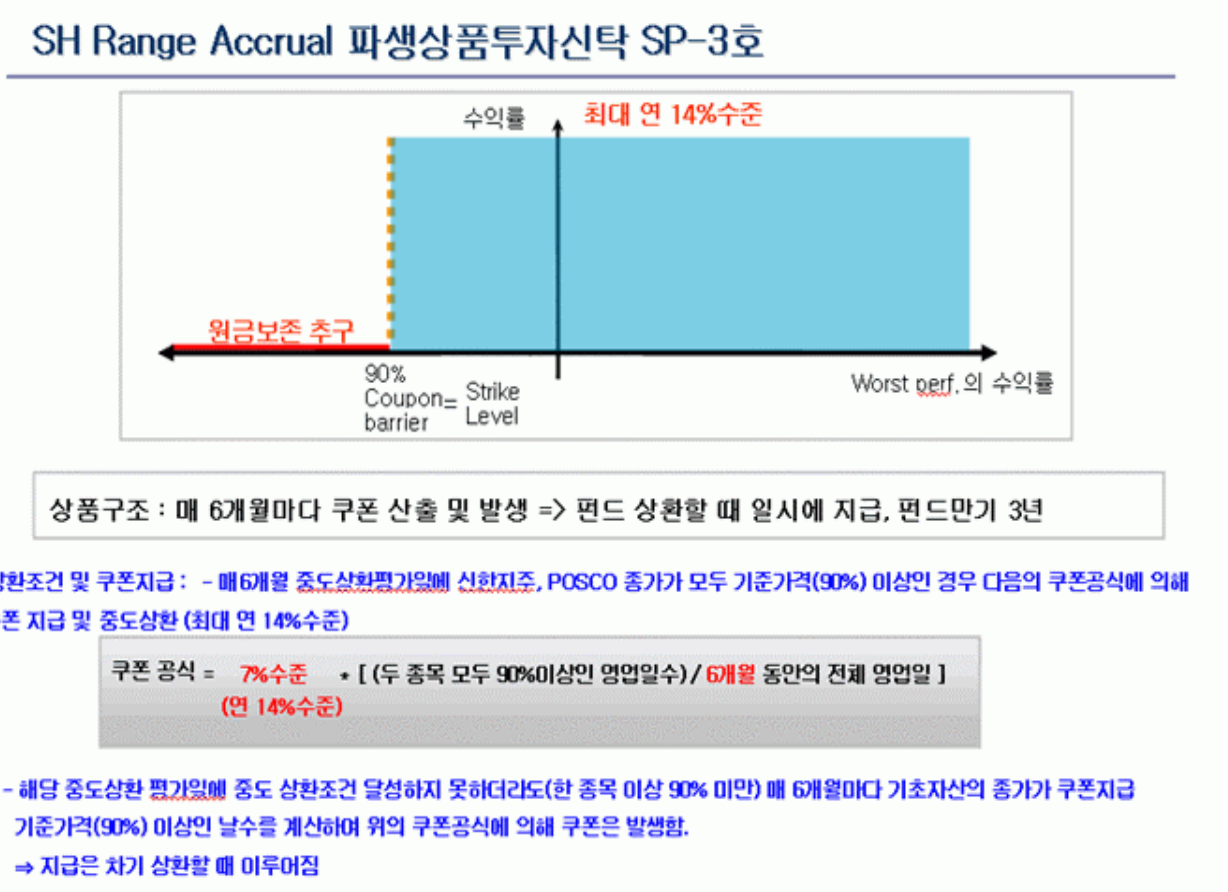
# Range Accrual파생SP3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,926 | 0 | 5,926 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KRS1103140 ELS Deutsche 080321 | 210 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 254 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

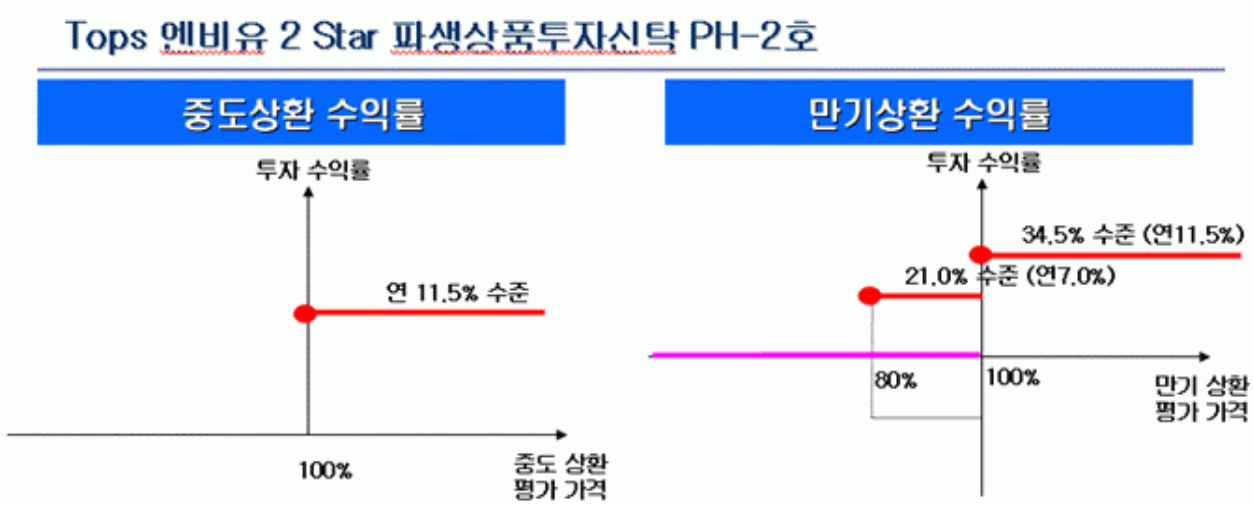
# 엔비유2Star파생PH-2

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | | | 0 | 40 | -40 | |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,922 | 0 | 1,922 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행일로부터 매 6개월 경과일에 기초자산으로 구성된 POSCO, 현대중공업 두 종목의 종가가 모두 기준주가 이상인 경우 연 11.5%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연11.5%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 있는 경우 (장중 포함) | 원금보존추구 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 80% 미만으로 하락(하락률 20%)한 적이 없는 경우 (장중 포함) | 원금 + 21.0%(연7.0%)수준 |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1103140 ELS Deutsche 080321 | 47 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 76 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2008-08-01 |
| 기준일 | 2008-07-31 |

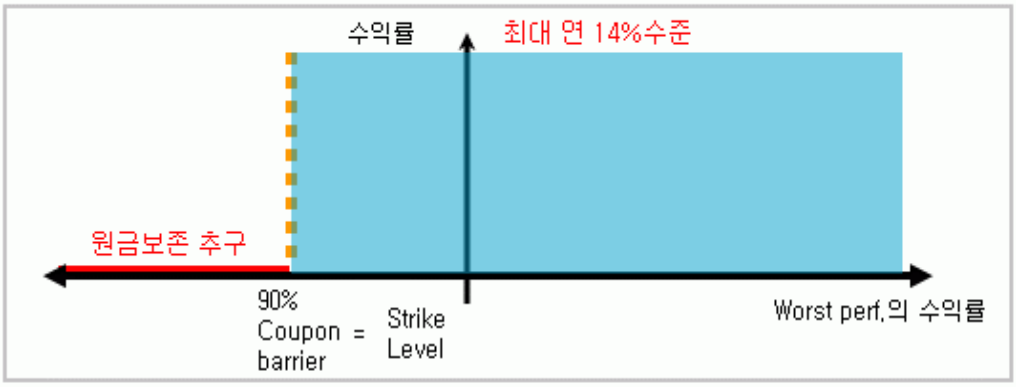
# Range Accrual파생SP4

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,886 | 0 | 5,886 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




상품구조 : 매 6개월마다 쿠폰 산출 및 발생 => 펀드 상환할 때 일시에 지급, 펀드만기 3년

쿠폰 공식 = 7%수준 (연 14%수준) * [ (두 종목 모두 90%이상인 영업일수) / 6개월 동안의 전체 영업일 ]

- 해당 중도상환 평가일에 중도 상환조건 달성하지 못하더라도(한 종목 이상 90% 미만) 매 6개월마다 기초자산의 종가가 쿠폰지급 기준가격(90%) 이상인 날수를 계산하여 위의 쿠폰공식에 의해 쿠폰은 발생함.
  ⇒ 지급은 차기 상환할 때 이루어짐

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KRS1104060 ELS Deutsche 080407 | 236 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

402

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2008-08-01 |
| 기준일 | 2008-07-31 |

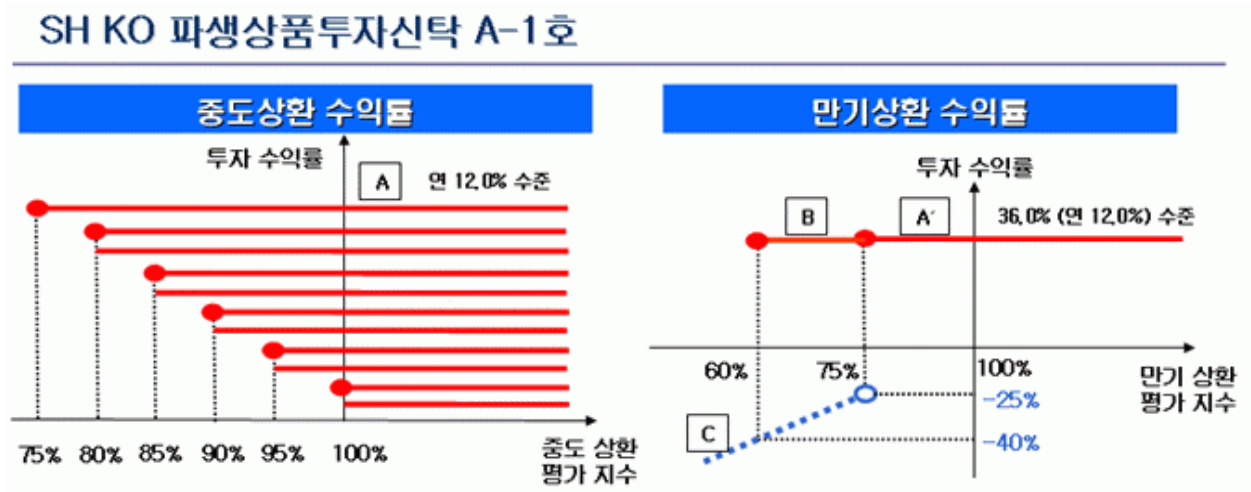
# SH KO파생A-1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,725 | 0 | 3,725 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환 평가일의 KOSPI200 지수가 기준지수대비 순차적으로 100%, 100%, 95%, 95%, 90%, 90%, 85%, 85%, 80% 80%, 75% 이상인 경우 연 12.0% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 기준지수 대비 75% 이상인 경우 | 원금 + 연12.0%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 KOSPI200 지수가 기준지수 대비 60% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연12.0%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 KOSPI200 지수가 기준지수 대비 60% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 (KOSPI200 수익률) |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR6003332V ELS하나659회080401 | 272 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|---|
| 158 |

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

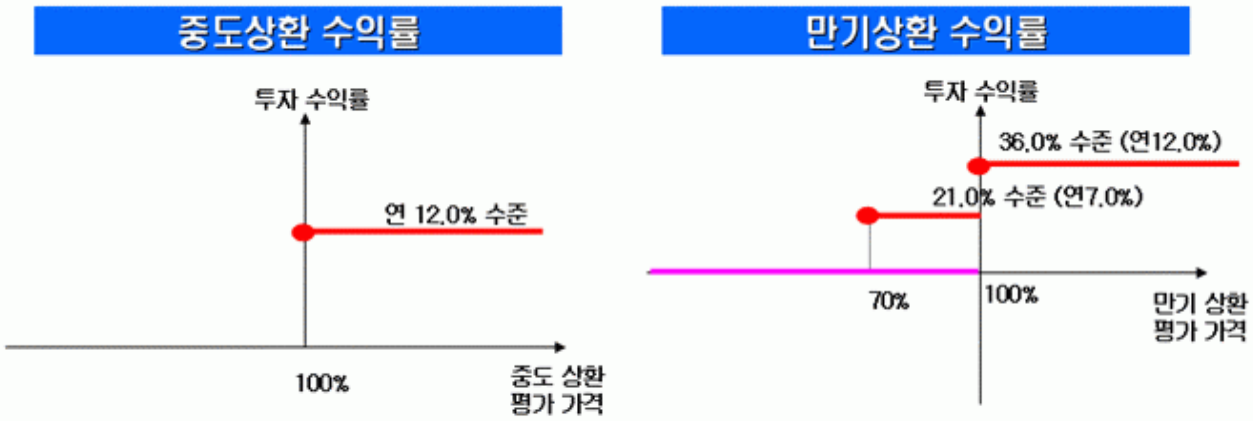
# 애그리2Star파생WS-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 실물자산 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 실물자산 | 옵션 | 632 | 0 | 632 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 조기상환 : 발행일로부터 매 6개월 경과일에 기초자산으로 구성된 밀, 콩 종가가 모두 기준가격 이상인 경우 연 12%수준으로 중도 상환

2. 만기상환(조기상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가가격이 기준가격 대비 두 종목 모두 100% 이상인 경우 | 원금 + 연12%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 70% 미만으로 하락(하락률 30%)한 적이 있는 경우 (종가) | 원금보존추구 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자 기간 중 한 종목이라도 기준가격의 70% 미만으로 하락(하락률 30%)한 적이 없는 경우 (종가) | 원금 + 21.0%(연7.0%)수준 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600354MV DLS대신11회080417 | 21 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 19 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

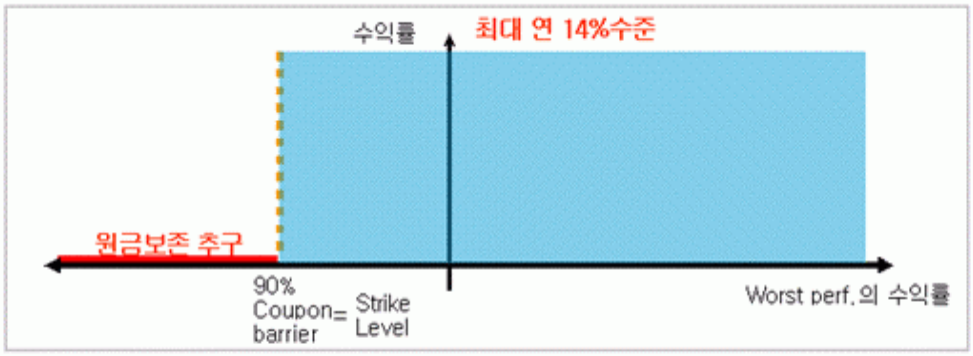
# Range Accrual파생SP5

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,347 | 0 | 3,347 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




상품구조 : 매 6개월마다 쿠폰 산출 및 발생 => 펀드 상환할 때 일시에 지급, 펀드만기 3년

1. 상환조건 및 쿠폰지급 : - 매6개월 중도상환평가일에 신한지주, POSCO 종가가 모두 기준가격대비 90% 이상인 경우 다음의 쿠폰공식에 의해 쿠폰 지급 및 중도상환 (최대 연 14%수준)

쿠폰 공식 = 7%수준 * [ (두 종목 모두 90%이상인 영업일수) / 6개월 동안의 전체 영업일 ]
(연 14%수준)

- 해당 중도상환 평가일에 중도 상환조건 달성하지 못하더라도(한 종목 이상 90% 미만) 매 6개월마다 기초자산의 종가가 쿠폰지급 기준가격(90%) 이상인 날수를 계산하여 위의 쿠폰공식에 의해 쿠폰은 발생함.
⇒ 지급은 차기 상환할 때 이루어짐

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1104190 ELS Deutsche080421 | 130 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 211 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

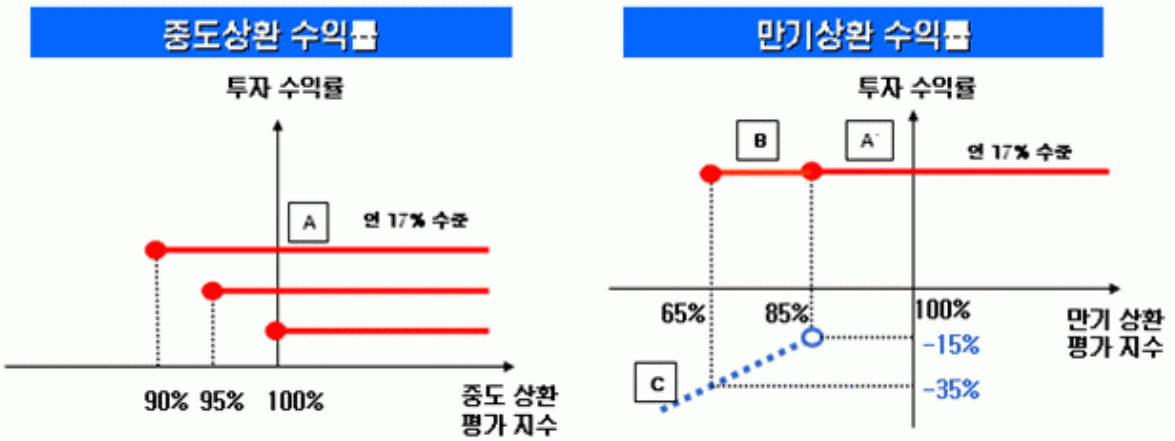
# SH KO 파생3호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 27,395 | 0 | 27,395 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 :각 중도상환평가일의 KOSPI200 지수가 기준지수대비 순차적으로 100%, 95%, 90%이상인 경우 연 17% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 기준지수 대비 85% 이상인 경우 | 원금 + 연17%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 KOSPI200 지수가 기준지수 대비 65% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연17%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간 중 KOSPI200 지수가 기준지수 대비 65% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 (KOSPI200 수익률) |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600172JV-ELS신영936회080415 | 2,725 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 1,031 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

# 메탈인덱스플러스모

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

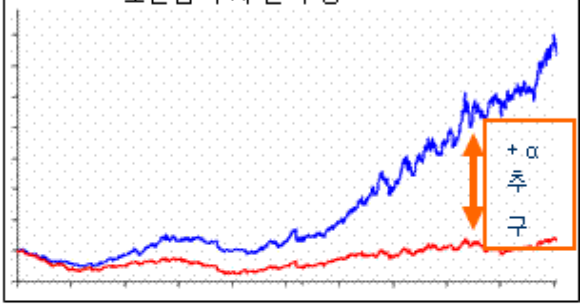
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,280 | 0 | 1,280 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

• 인덱스 중심으로 운용: 벤치마크는 DJ-AIG 금속/귀금속지수

▣ 기본 운용 전략
- ㅇ Benchmark 전략
- ㅇ 상품 관련 장내 / 외 파생상품에 투자

▣ 추가 운용 전략
- ㅇ 초과 수익률 달성 전략
- ㅇ 단기 시황에 따라 파생상품 편입비 조절
  예) 포워드 곡선에 따른 전략,
  모멘텀 투자 전략 등




• 장외파생상품 기초자산 예시

| 구분 | Dow Jones-AIG<br>금속 지수, 귀금속 지수 | S&P GSCI<br>금속 지수, 귀금속 지수 |
|---|---|---|
| 특징 | Dow Jones와 AIG에서 운영<br>한 상품의 비중은 2~15%로 제한<br>연간 정기 리벨런싱 시 동시에 한 부분이 차지한 비중은 최대 | Standard Poor's와 GS에서 운영<br>지난 5년간 개별 구성종목 간 세계<br>생산량의 상대적 수준을 바탕으로 각비중을 평균하여 결정. |

| 구분 | High Grade | Copper (CU) | Zinc (ZN) | Nickel(NI) | Aluminum (AL) | Lead(PB) | Tin(SN) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 거래소 | COMEX | LME | | | | | |

• 장내파생상품 예시

| 구분 | Gold(GC) | Silver(SI) | Platinum(PL) | Palladium(PA) |
|---|---|---|---|---|
| 거래소 | NYMEX(New York Merchantile Exchange), LBMA | | | |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| GCV8 | Comex Gold | 36 |
| HGU8 | High Grade Copper | 38 |
| LMAHDP | LME Aluminum | 41 |
| LMNIDP | LME Nickel | 9 |
| LMZSDP | LME Zinc | 7 |
| SIU8 | Comex Silver | 7 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준) (단위:백만원)

| 217 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

# 에너지인덱스파생모

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

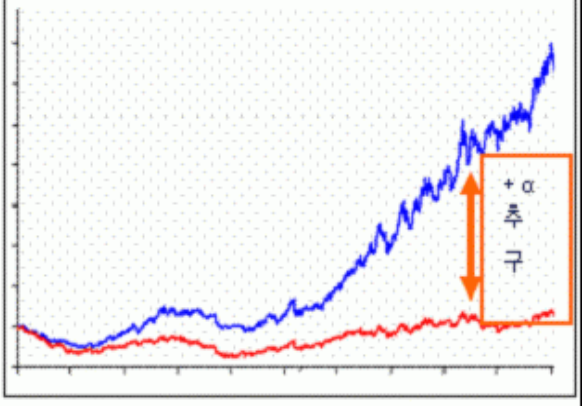
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,316 | 0 | 2,316 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

• 인덱스 중심으로 운용: 벤치마크는 DJ-AIG 농산물 지수

▣ 기본 운용 전략
- ㅇ Benchmark 전략
- ㅇ 상품 관련 장내 / 외 파생상품에 투자

▣ 추가 운용 전략
- ㅇ 초과 수익률 달성 전략
- ㅇ 단기 시황에 따라 파생상품 편입비 조절
  예) 포워드 곡선에 따른 전략,
  모멘텀 투자 전략 등




• 장외파생상품 기초자산 예시

| 구분 | Dow Jones-AIG 농산물지수 | S&P GSCI 농산물지수 |
|---|---|---|
| 특징 | Dow Jones와 AIG에서 운영<br>한 상품의 비중은 2~15%로 제한<br>연간 정기 리벨런싱 시 동시에한 부분이 차지한 비중은 최대 33%<br>매년 1회 리벨런싱<br>농산물은 4~5회 이월 | Standard Poor's와 GS에서 운영<br>지난 5년간 개별 구성종목 간 세계 생산량의 상대적 수준을 바탕으로 각비중을 평균하여 결정.<br>월별 이월 전략을 이용<br>농산물은 5~6회 이월 |

• 장내파생상품 예시

| 구분 | Soybean(S) | Wheat(W) | Corn(C) |
|---|---|---|---|
| 거래소 | CBOT | | |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLU8 | Crude Oil | 81 |
| HOU8 | Heating Oil | 24 |
| NGU8 | Natural Gas | 59 |
| XBU8 | RBOB Gasoline | 21 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 424 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

# 애그리컬쳐인덱스모

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

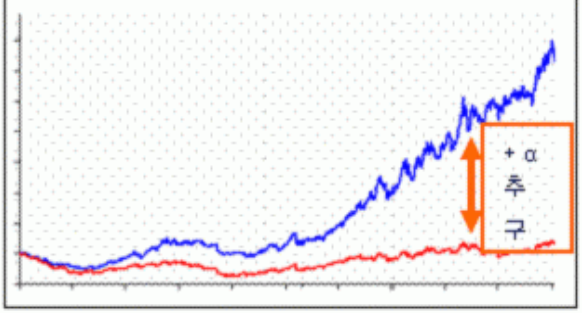
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,348 | 0 | 7,348 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

• **인덱스 중심으로 운용: 벤치마크는 DJ-AIG 에너지 지수**

▣ 기본 운용 전략
- o Benchmark 전략
- o 상품 관련 장내 / 외 파생상품에 투자

▣ 추가 운용 전략
- o 초과 수익률 달성 전략
- o 단기 시황에 따라 파생상품 편입비 조절
  예) 포워드 곡선에 따른 전략,
  모멘텀 투자 전략 등




• **장외파생상품 기초자산 예시**

| 구분 | Dow Jones-AIG 에너지 지수 | S&P GSCI 에너지 지수 |
|---|---|---|
| 특징 | Dow Jones와 AIG에서 운영한 상품의 비중은 2~15%로 제한<br>연간 정기 리벨런싱 시 동시에 한 부분이 차지한 비중은 최대 33%<br>매년 1회 리벨런싱 | Standard Poor's와 GS에서 운영<br>지난 5년간 개별 구성 종목간 세계 생산량의 상대적 수준을 바탕으로 각비중을 평균하여 결정.<br>월별 이월 전략을 이용 |

• **장내파생상품 예시**

| 구분 | Crude Oil(CL) | Natural Gas(NG) | Gasoline(RB) | Heating Oil(HO) |
|---|---|---|---|---|
| 거래소 | NYMEX | | | |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOU8 | Soybean Oil | 56 |
| CTZ8 | Cotton | 46 |
| CU8 | Corn | 140 |
| KCU8 | Coffee | 55 |
| SBV8 | Sugar No11 | 68 |
| SU8 | Soybean | 151 |
| WU8 | Wheat | 72 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준) (단위:백만원)

| 1,065 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

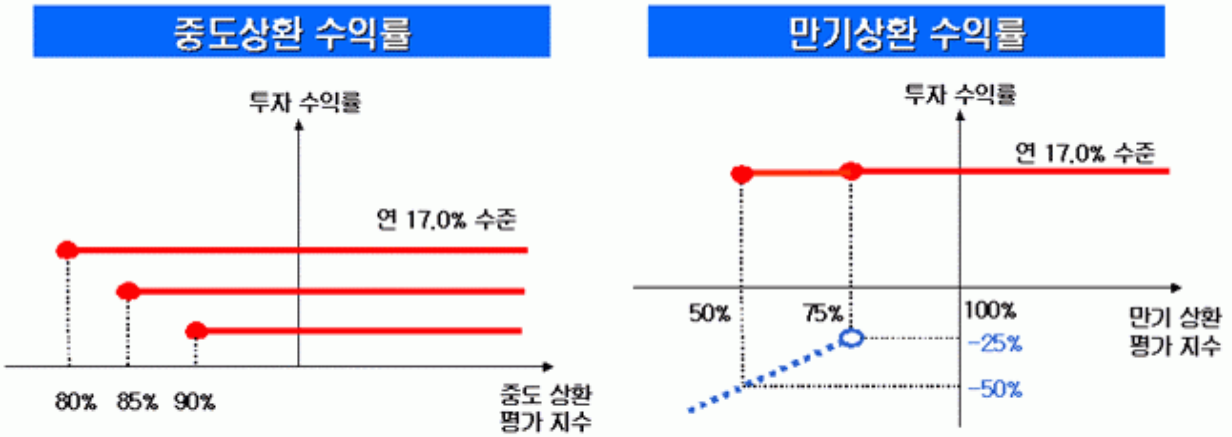
# SH한-중파생1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,782 | 0 | 6,782 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 3개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 85%, 80%이상인 경우 연 17% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 75% 이상인 경우 | 원금 + 연17%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연17%수준 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600172BV ELS신영959회080428 | 836 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 319 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2008-08-01 |
| 기준일 | 2008-07-31 |

# SH Range Accrual파생SP-6

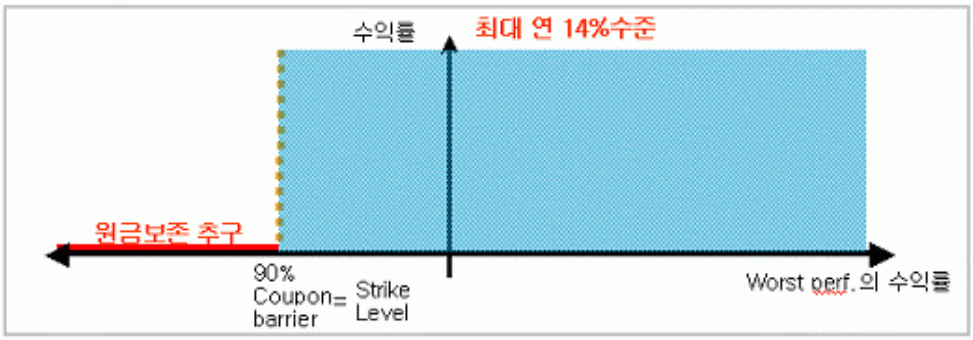
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,702 | 0 | 8,702 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

### SH Range Accrual 파생상품투자신탁 SP-6호




상품구조 : 매 6개월마다 쿠폰 산출 및 발생 => 펀드 상환할 때 일시에 지급, 펀드만기 3년

1. 상환조건 및 쿠폰지급 : - 매6개월 중도상환평가일에 신한지주, POSCO 종가가 모두 기준가격대비 90% 이상인 경우 다음의 쿠폰공식에 의해 쿠폰 지급 및 중도상환 (최대 연 14%수준)

쿠폰 공식 = 7%수준 (연 14%수준) * [ (두 종목 모두 90%이상인 영업일수) / 6개월 동안의 전체 영업일 ]

- 해당 중도상환 평가일에 중도 상환조건 달성하지 못하더라도(한 종목 이상 90% 미만) 매 6개월마다 기초자산의 종가가 쿠폰지급 기준가격(90%) 이상인 날수를 계산하여 위의 쿠폰공식에 의해 쿠폰은 발생함.
⇒ 지급은 차기 상환할 때 이루어짐

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KRS1105060 ELS Deutsche080509 | 312 |

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

516

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

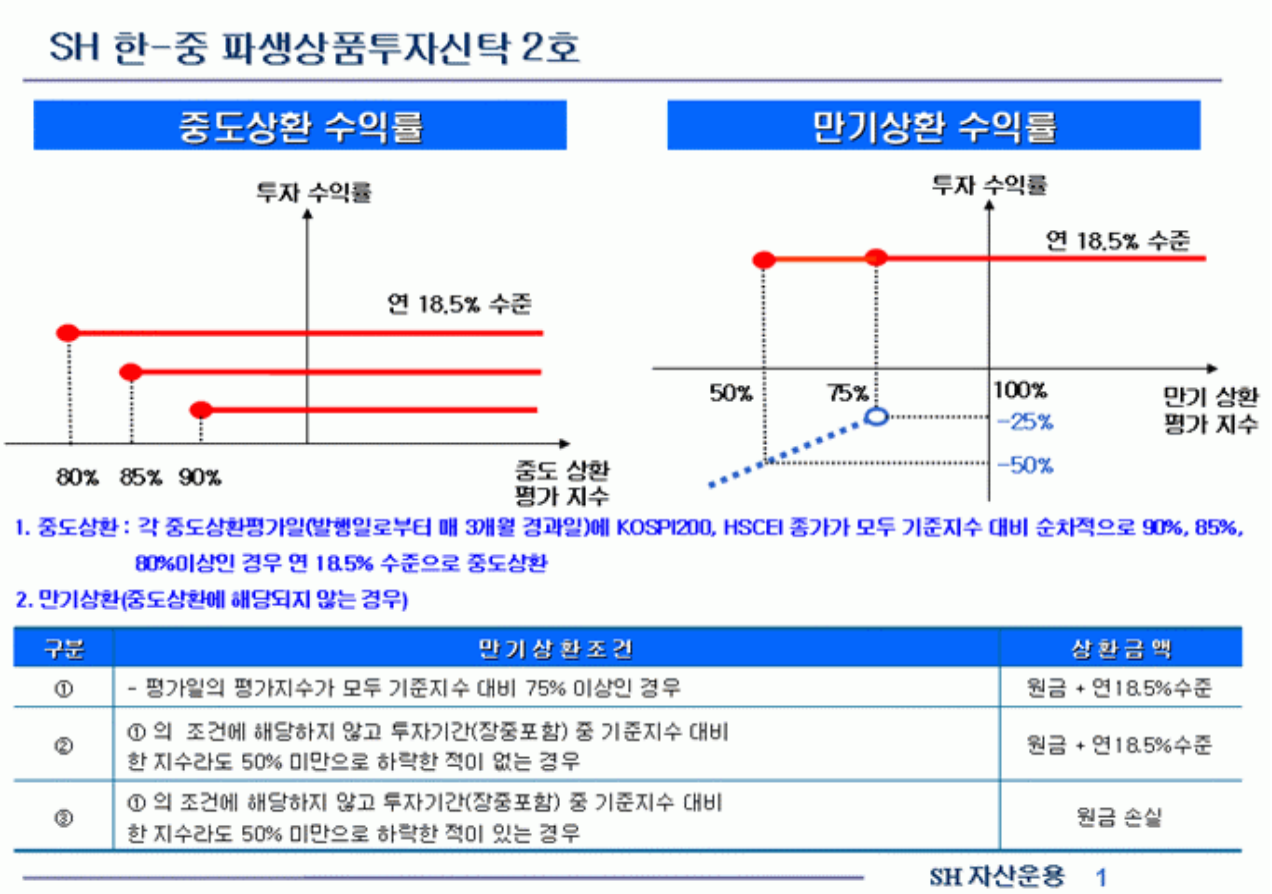
# SH 한-중 파생2호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,331 | 0 | 10,331 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6030612V ELS교보186회080502 | 1,280 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 449 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

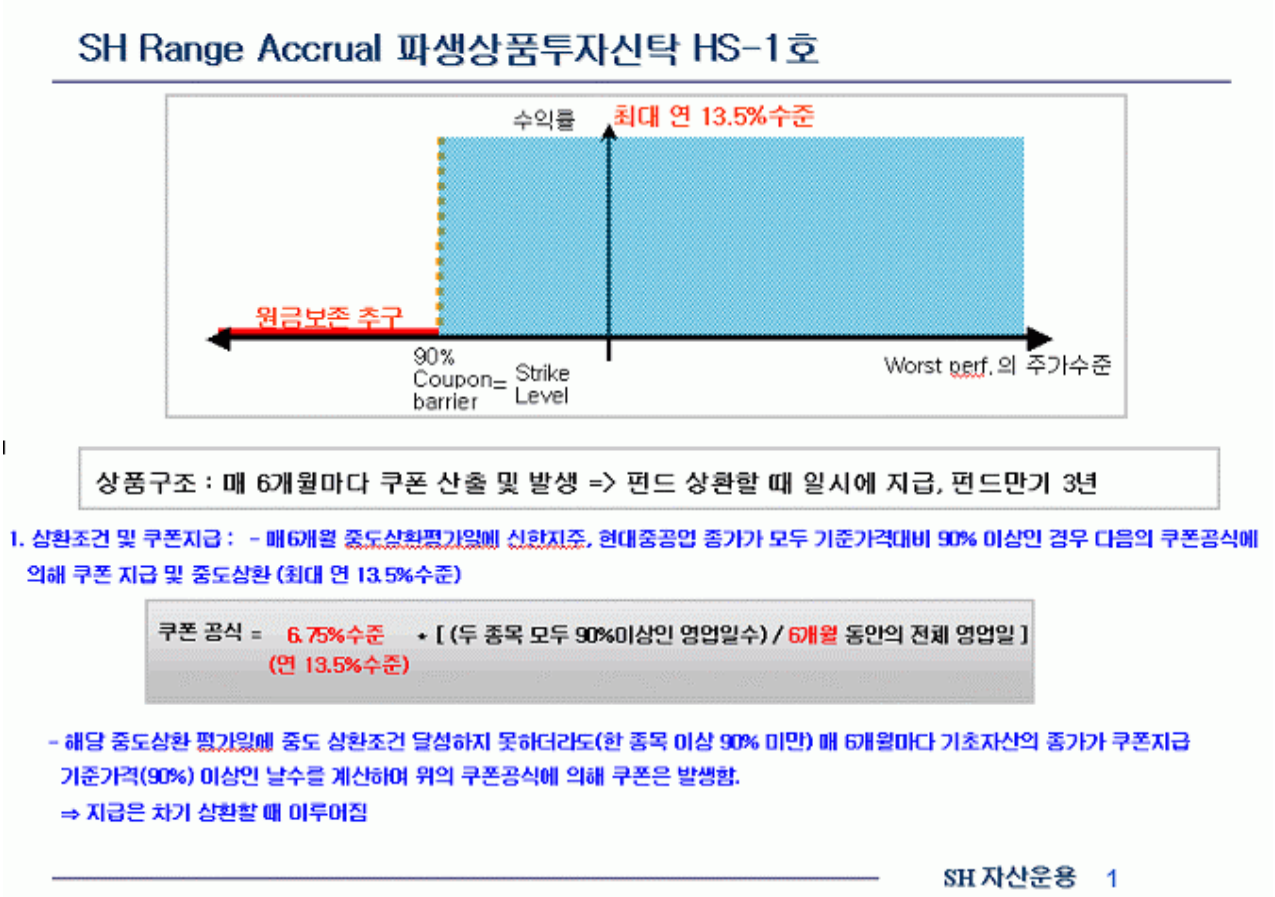
# Range Accrual파생HS1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,428 | 0 | 6,428 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KRS1105240 ELS Deutsche080523 | 222 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 297 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

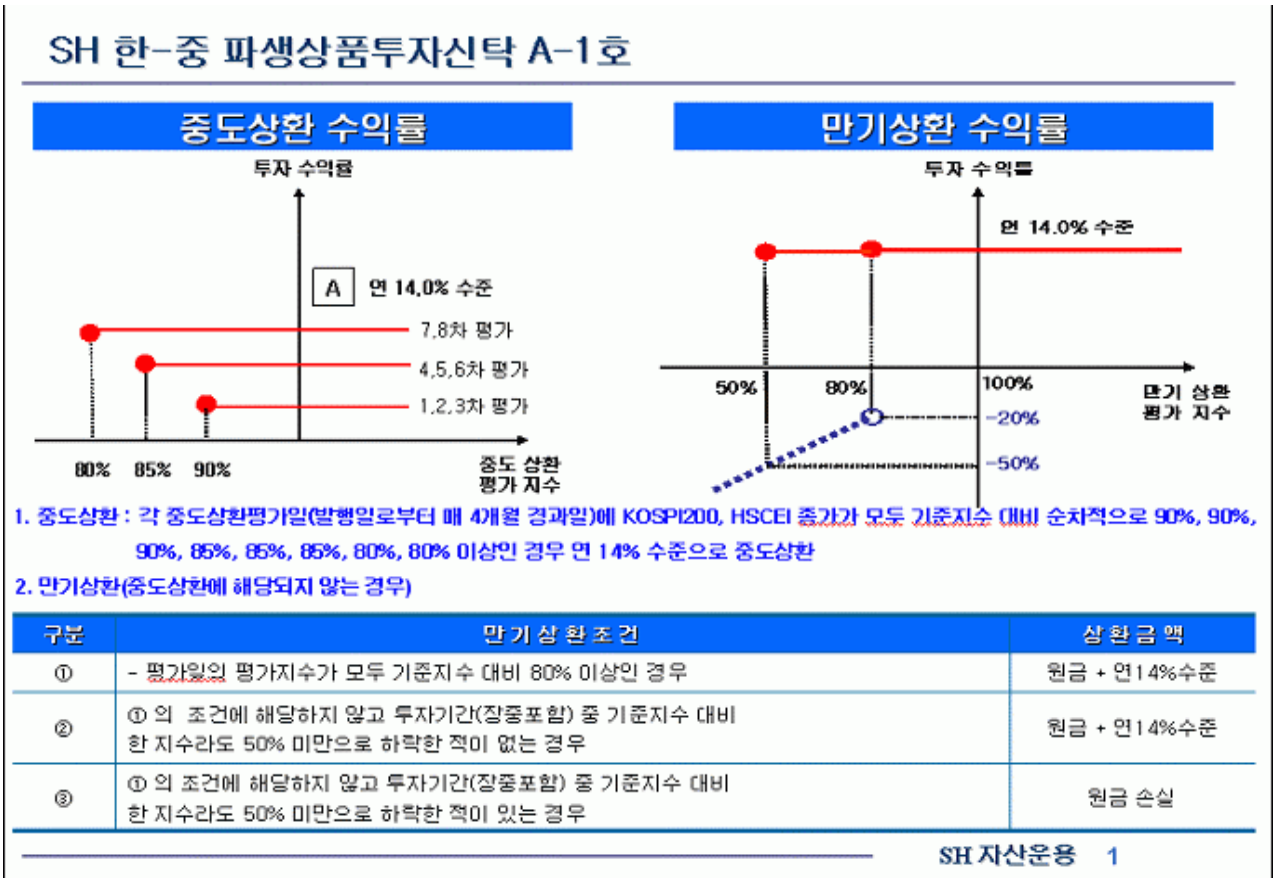
# SH한-중파생A-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,494 | 0 | 10,494 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 90%, 85%, 85%, 85%, 80%, 80% 이상인 경우 연 14% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우 | 원금 + 연14%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연14%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6003332V ELS하나705회080602 | 1,383 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 1,058 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

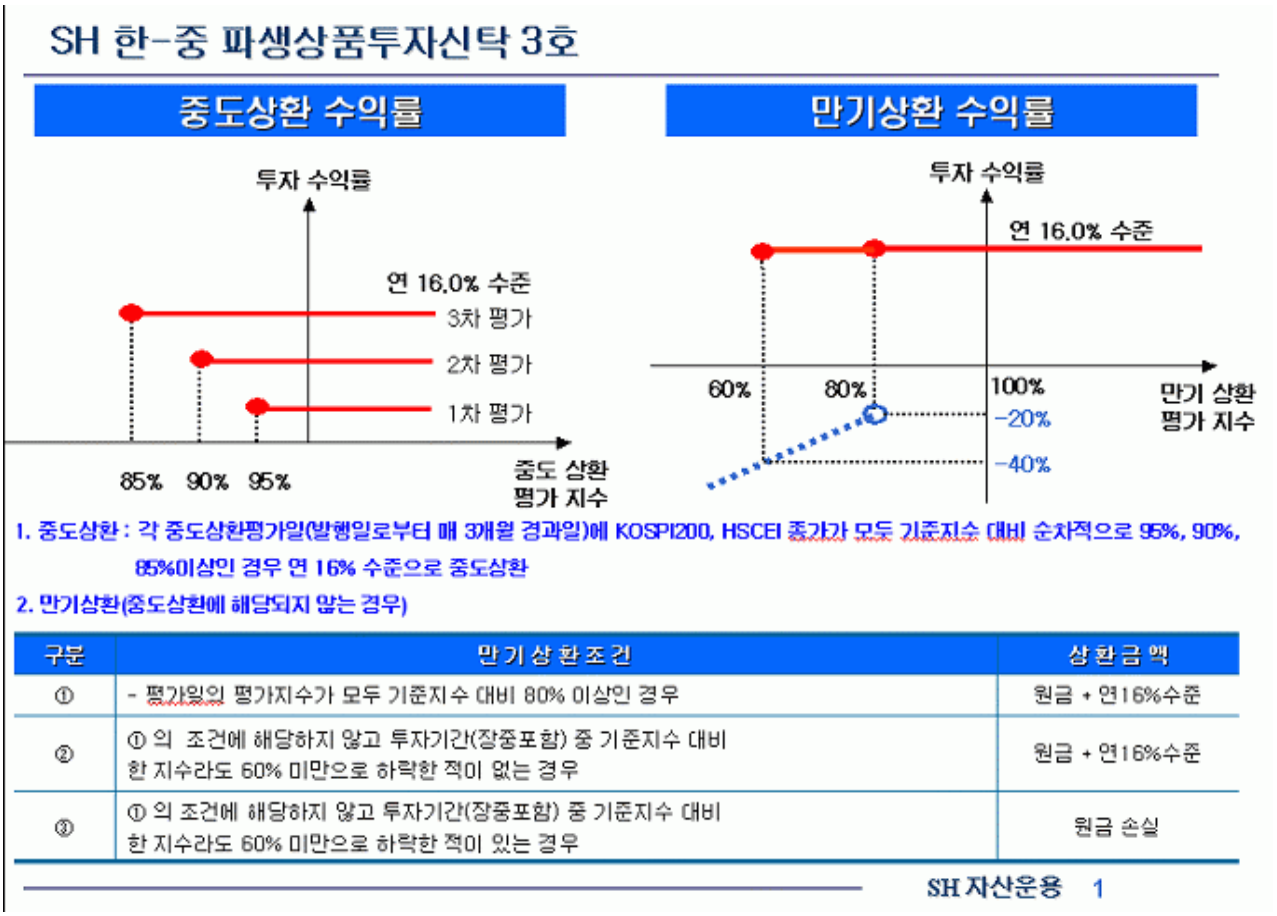
# SH한-중파생3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,310 | 0 | 8,310 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6030618V ELS교보206회080611 | 1,020 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 563 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

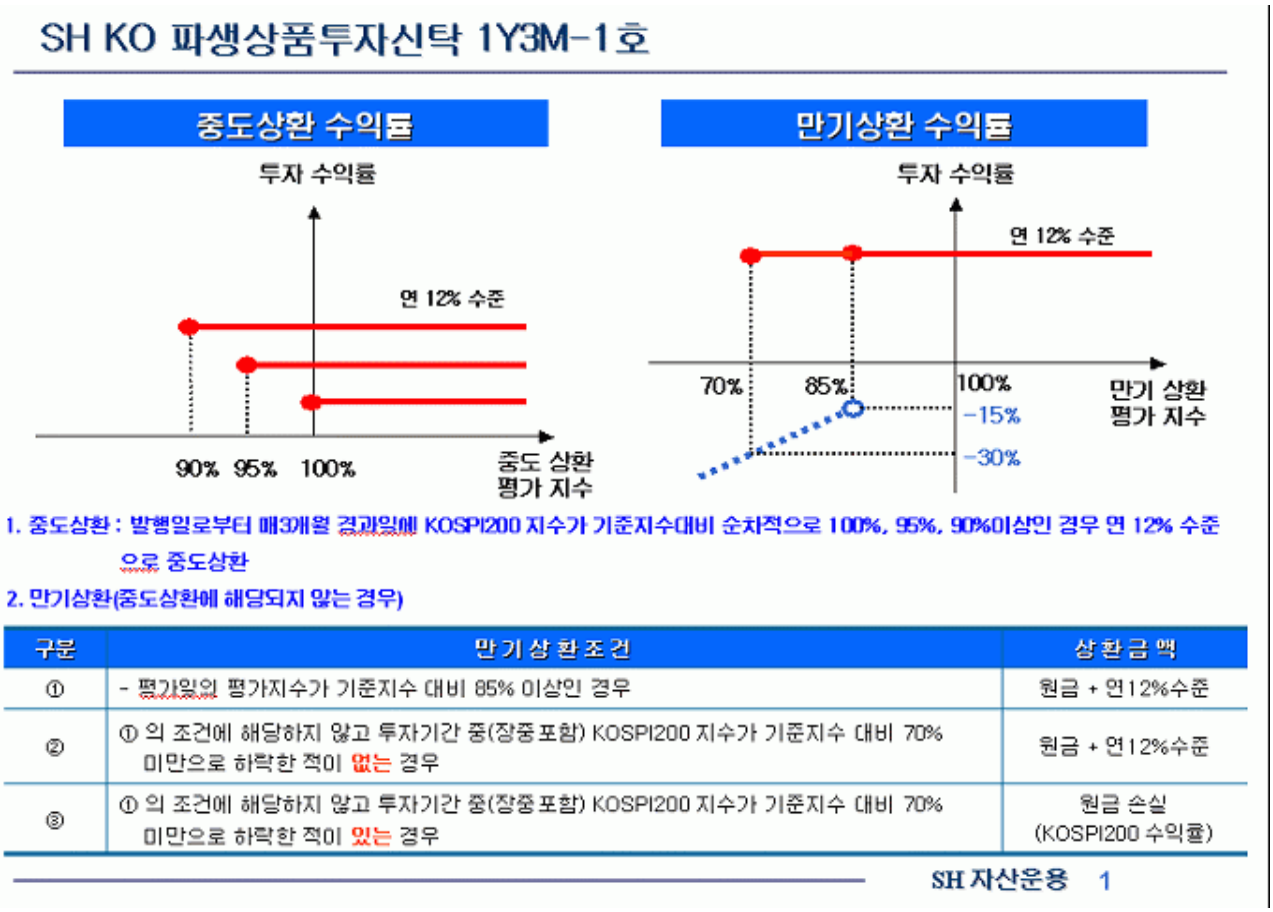
# SH KO파생1Y3M-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,932 | 0 | 2,932 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR603762JV1 ELS미래411회080610 | 285 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 185 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

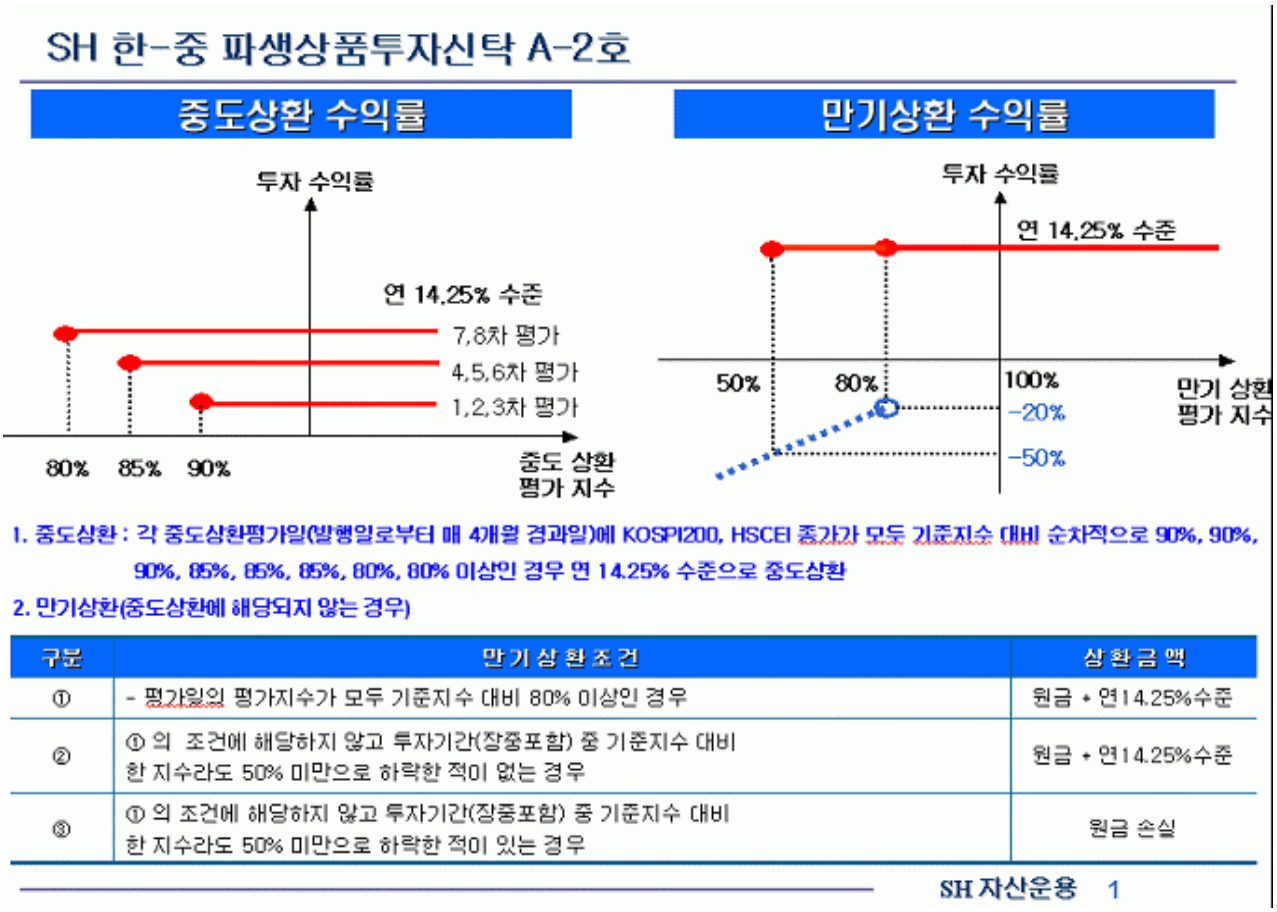
# 한-중파생A-2

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 13,552 | 0 | 13,552 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 90%, 85%, 85%, 85%, 80%, 80% 이상인 경우 연 14.25% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우 | 원금 + 연14.25%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연14.25%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600333NV ELS하나725회080616 | 1,742 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 1,006 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

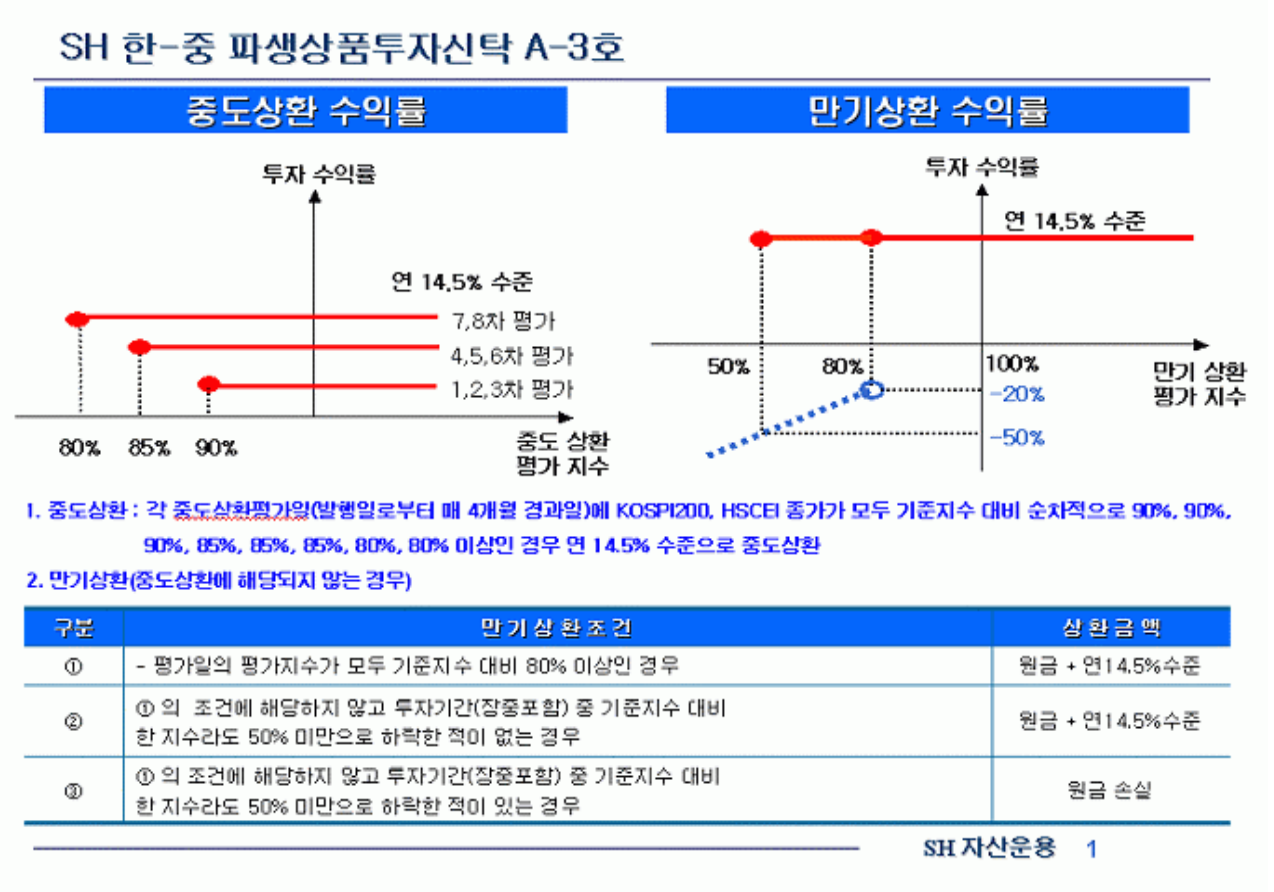
# SH한-중파생A-3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 16,080 | 0 | 16,080 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우 | 원금 + 연14.5%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연14.5%수준 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600333KV ELS하나752회080630 | 1,912 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 1,119 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

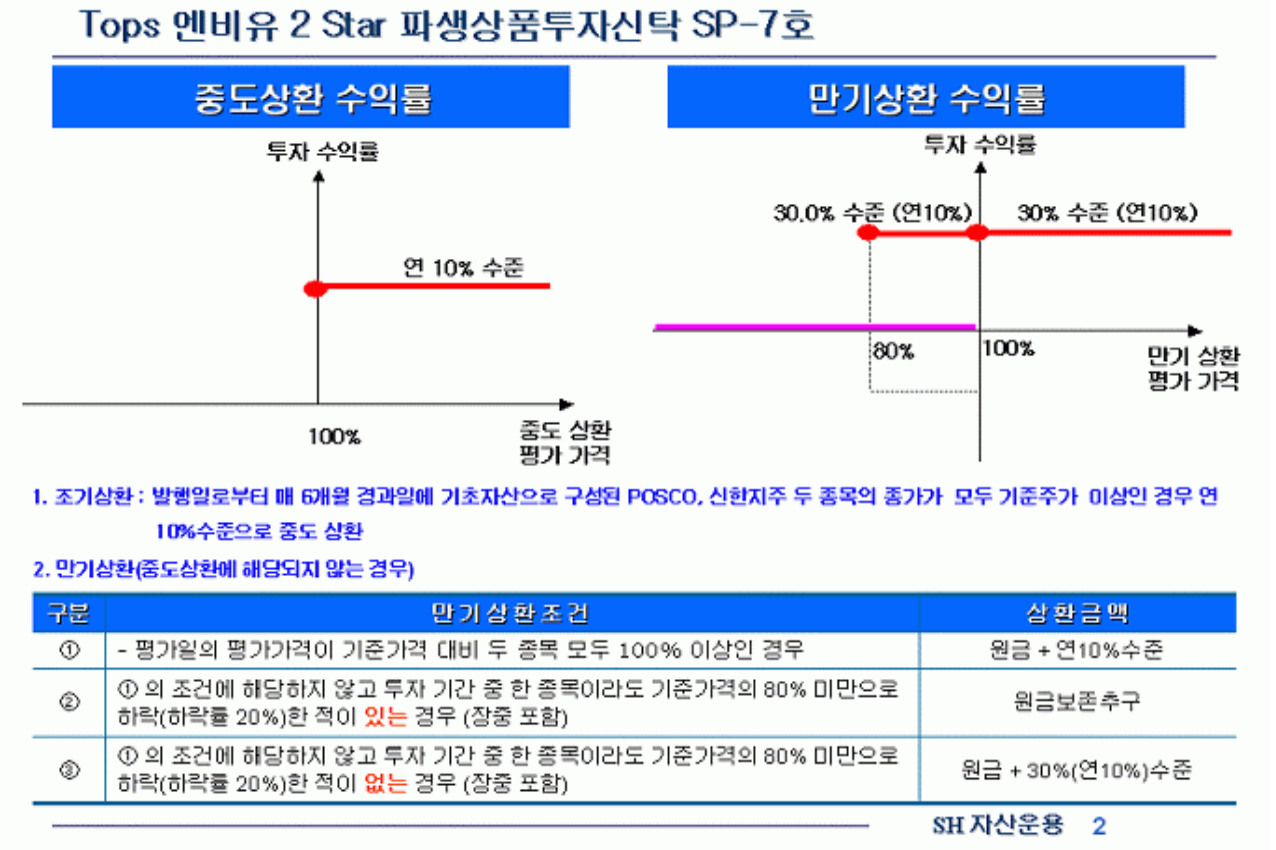
# 엔비유2Star파생SP-7

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,461 | 0 | 10,461 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600680CV ELS대우2565회080630 | 391 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 447 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

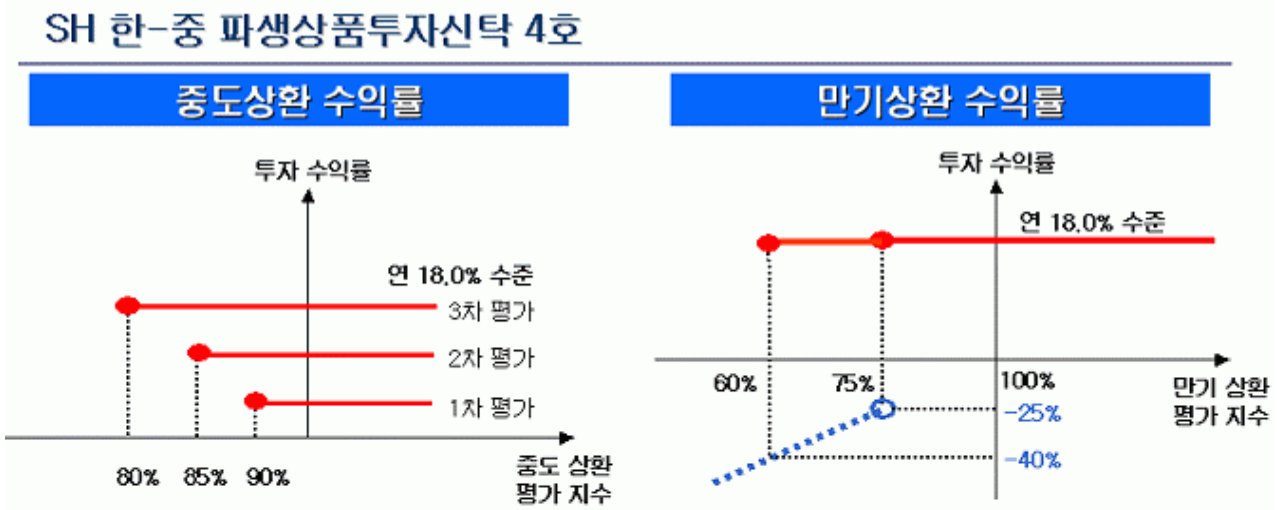
# SH한-중파생4호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 10,448 | 0 | 10,448 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 3개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 85%, 80%이상인 경우 연 18% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 75% 이상인 경우 | 원금 + 연18%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(정중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연18%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(정중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6030612V ELS교보242회080707 | 850 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 382 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

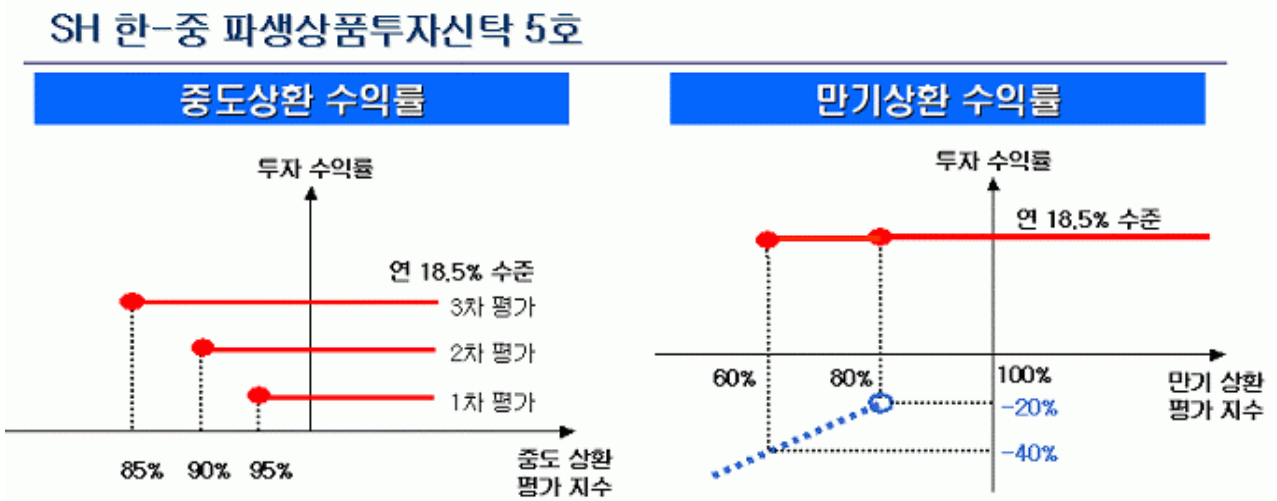
# SH한-중파생5호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 24,818 | 0 | 24,818 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 3개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 95%, 90%, 85%이상인 경우 연 18.5% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우 | 원금 + 연18.5%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연18.5%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600333AV ELS하나769회080708 | 2,484 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 1,166 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

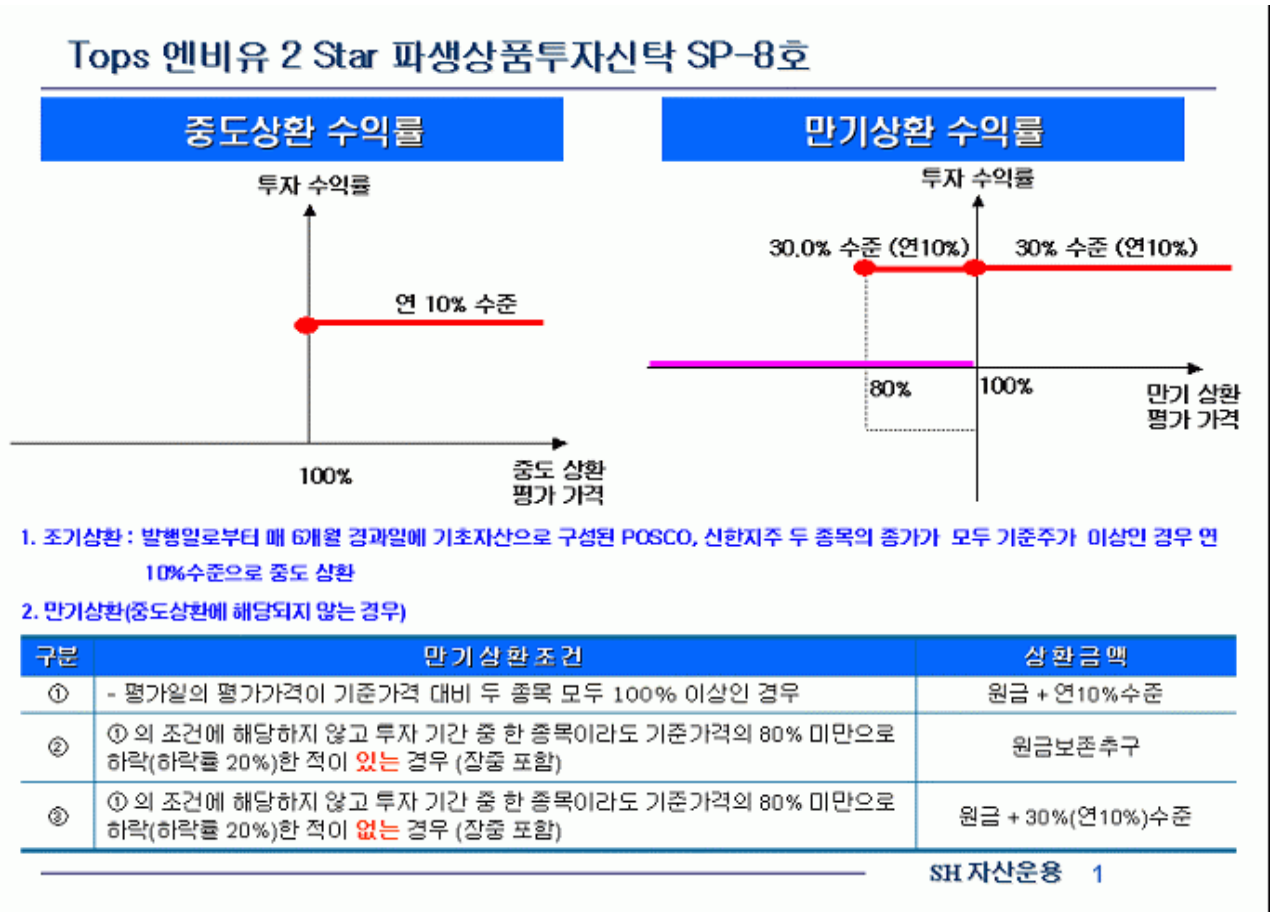
# 엔비유2Star파생SP-8

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,941 | 0 | 6,941 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600680W\ ELS대우2610회080714 | 261 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 325 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

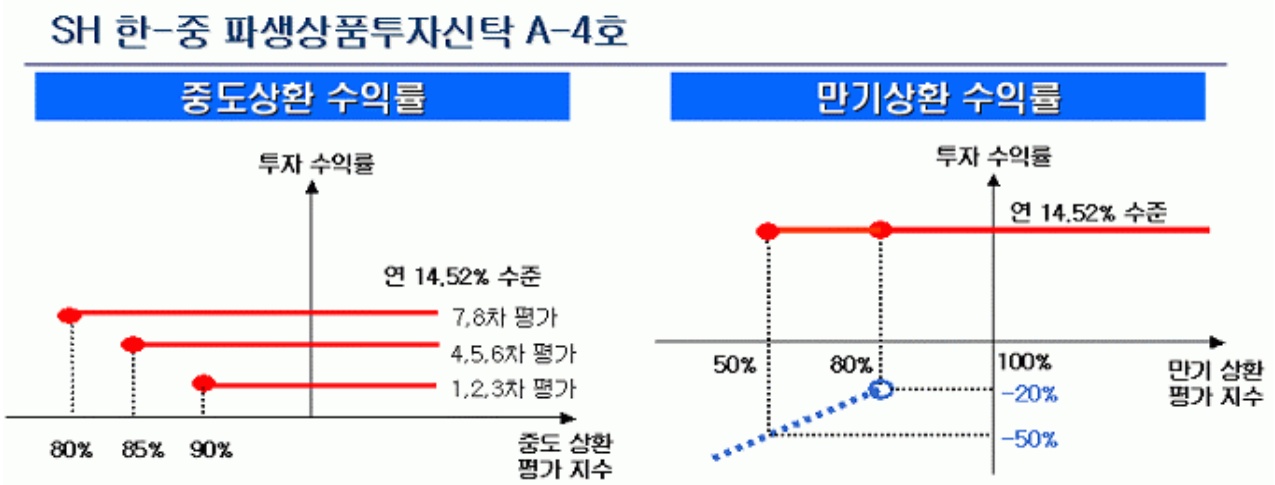
# SH한-중파생A-4

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,682 | 0 | 5,682 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 90%, 85%, 85%, 85%, 80%, 80% 이상인 경우 연 14.52% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우 | 원금 + 연14.52%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연14.52%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |

SH 자산운용 2

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600345VV ELS현대2008-875회080714 | 605 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 313 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

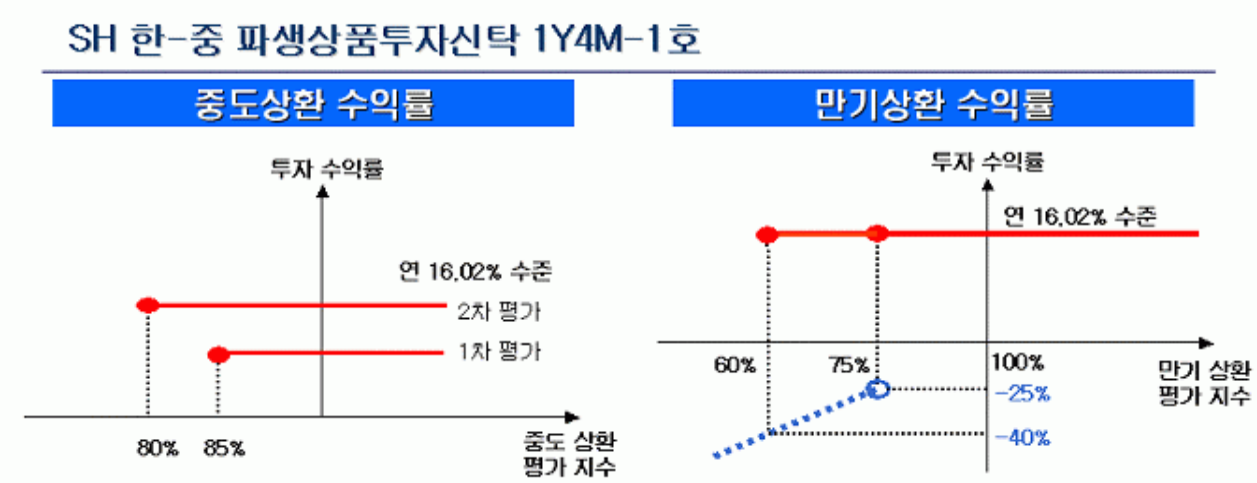
# SH한-중파생1Y4M-1

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,618 | 0 | 2,618 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 85%, 80%, 이상인 경우 연 16.02% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 75% 이상인 경우 | 원금 + 연16.02%수준 |
| ② | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연16.02%수준 |
| ③ | ①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR6030616V ELS교보243회080714 | 239 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 96 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

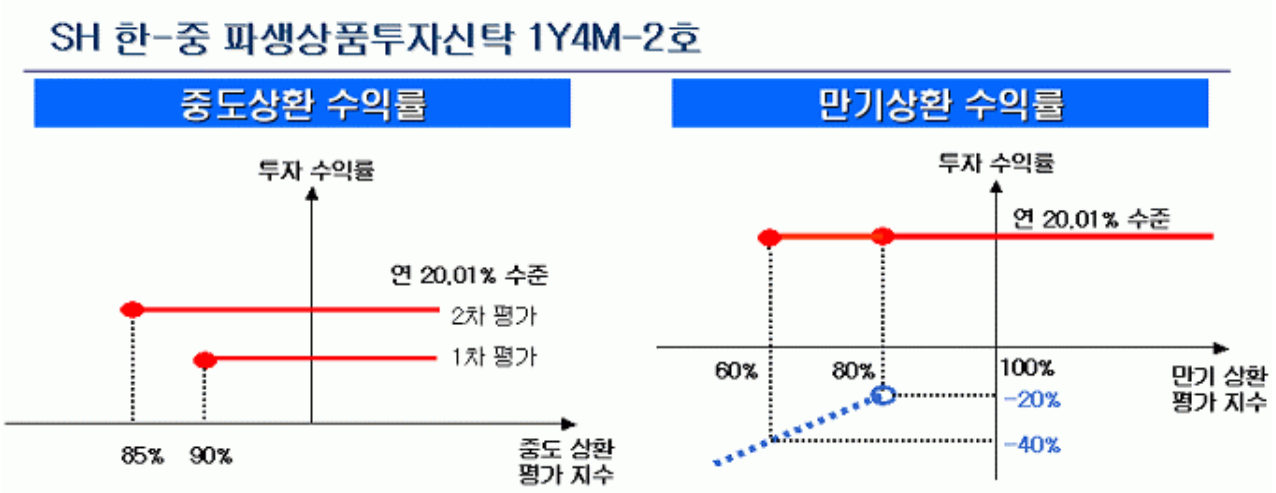
# SH한-중파생1Y4M-2

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 13,539 | 0 | 13,539 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 85%, 이상인 경우 연 20.01% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우 | 원금 + 연20.01%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연20.01%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR600172HV ELS신영1049회080721 | 1,292 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 553 |
|---|

| 공시일 | 2008-08-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2008-07-31 |

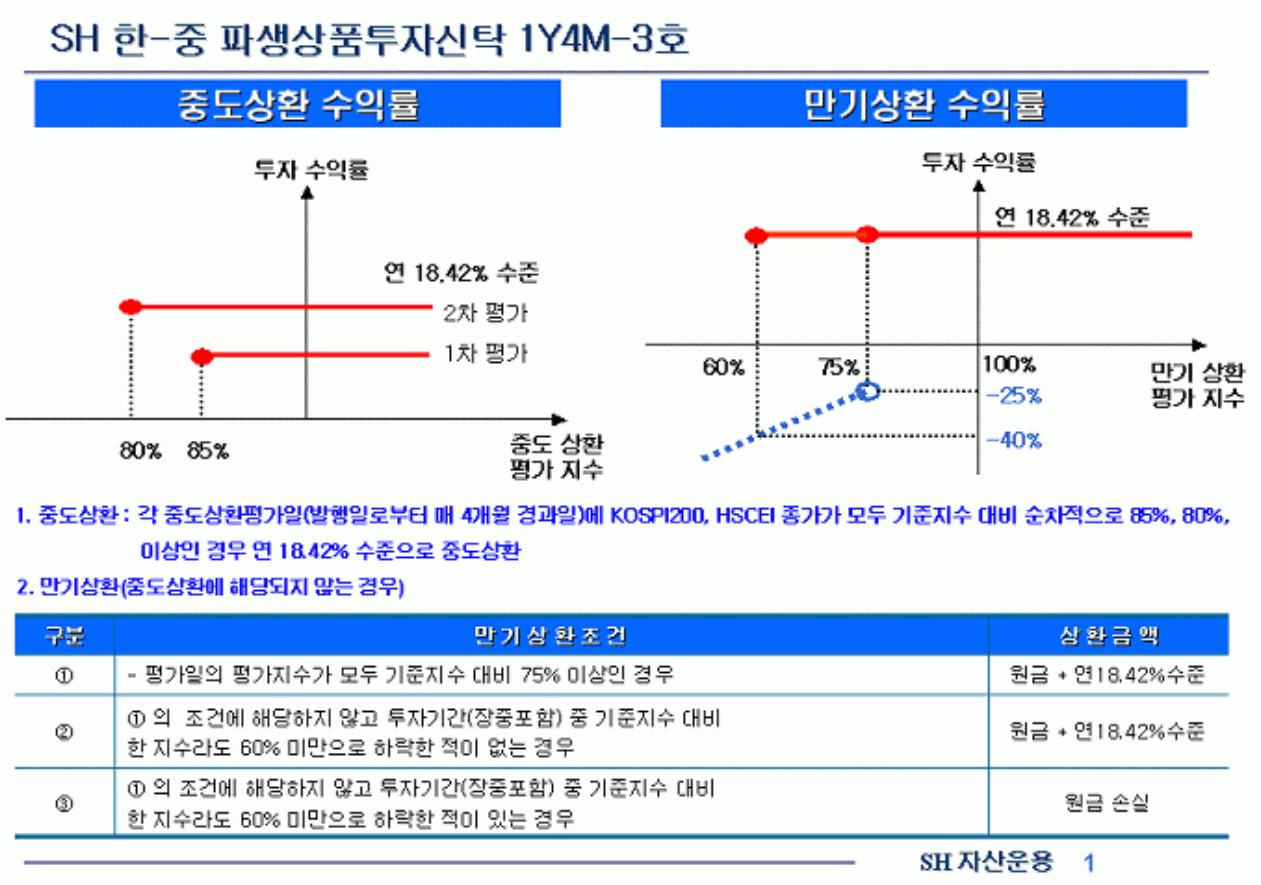
# SH한-중파생1Y4M-3

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,930 | 0 | 2,930 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 85%, 80%, 이상인 경우 연 18.42% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

| 구분 | 만기상환조건 | 상환금액 |
|---|---|---|
| ① | - 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 75% 이상인 경우 | 원금 + 연18.42%수준 |
| ② | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 없는 경우 | 원금 + 연18.42%수준 |
| ③ | ① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 60% 미만으로 하락한 적이 있는 경우 | 원금 손실 |

SH 자산운용 1

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR603061KV ELS교보257회080728 | 280 |
|---|---|

## 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%유의수준,10일기준)

(단위:백만원)

| 114 |
|---|