공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

인덱스+a파생1호

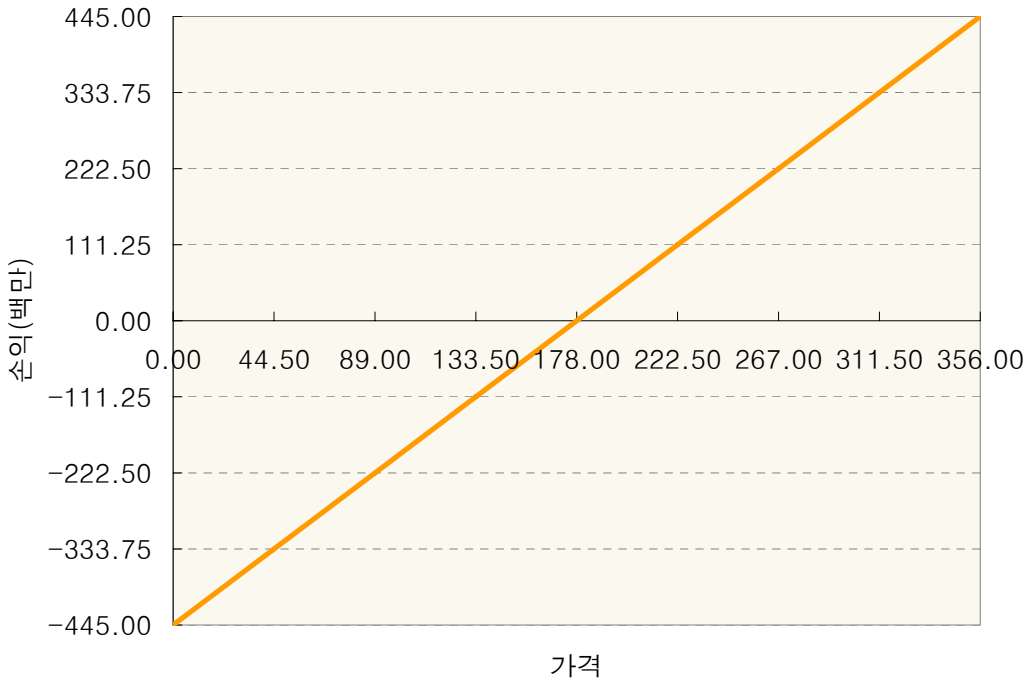
1. 계약금액

(단위:백만원)

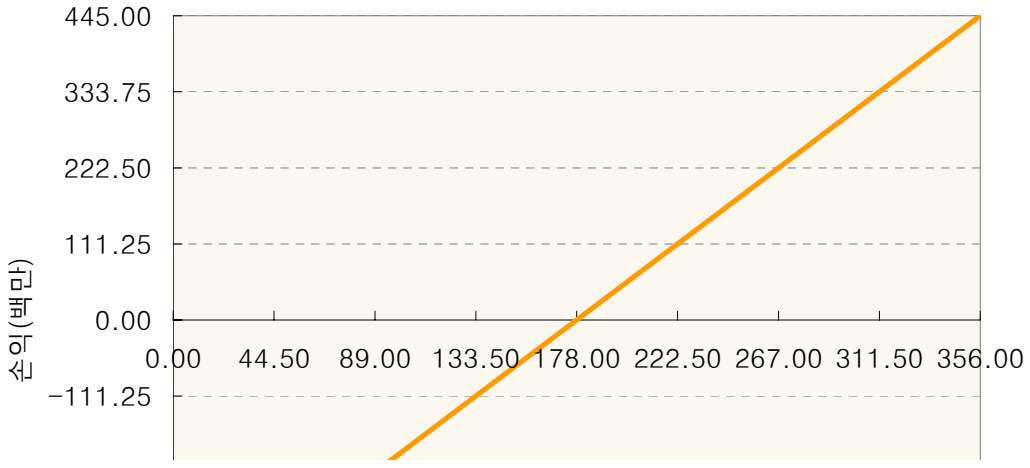
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	890	0	890	장내

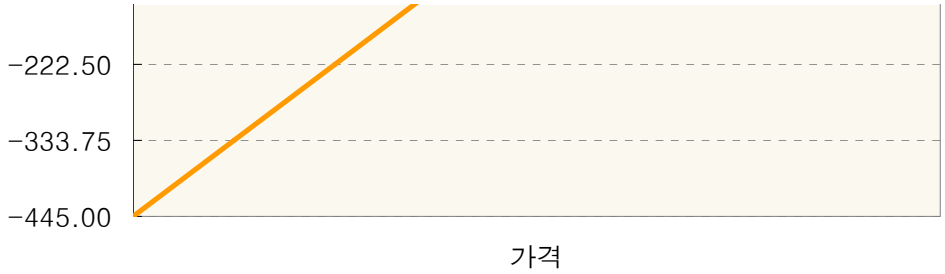
2. 만기시점의 손익구조

KR4101CC2003-KOSPI선물 0812



KR4101D32009-KOSPI선물 0903





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101CC2(KOSPI선물 0812	36
KR4101D320 KOSPI선물 0903	36

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

(단위:백만원)

117

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

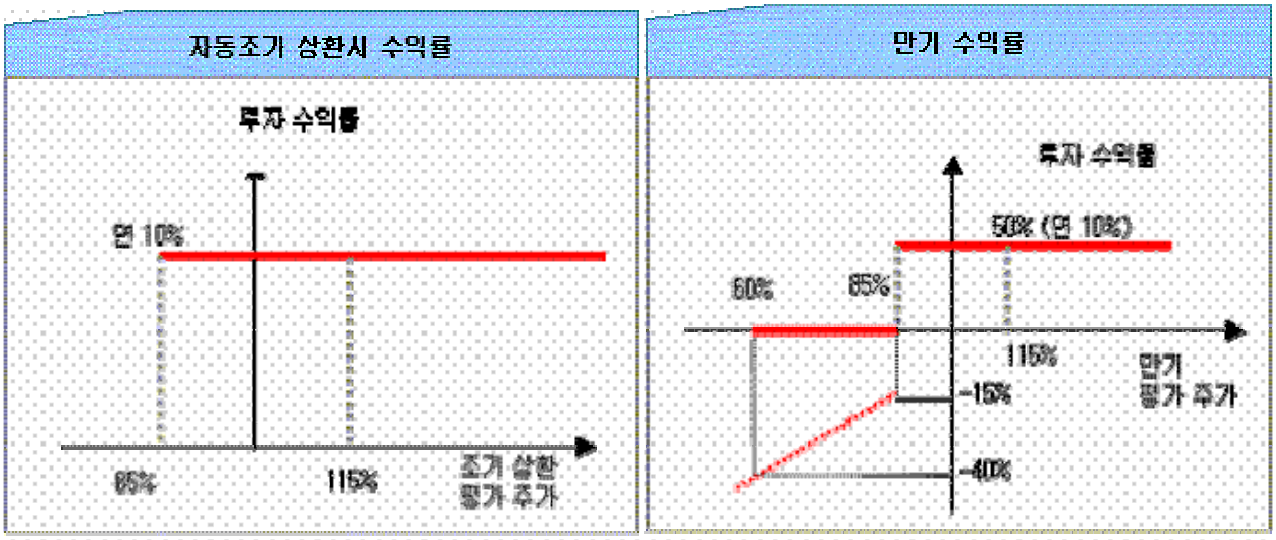
TwinPower파생SH2

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	14,550	0	14,550	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 조기상환 : 발행후 매 6개월이 경과한 시점에서의 신한지주 보통주 현대차 보통주의 가격이 모두 기준가격 대비 85% 이상 여겨나, 월별종가기준 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 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 (두 종목 중 하락률이 큰종목의 손실률 적용)

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR600354W\ ELS대신675호080829	2,283

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

(단위:백만원)

3,407

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

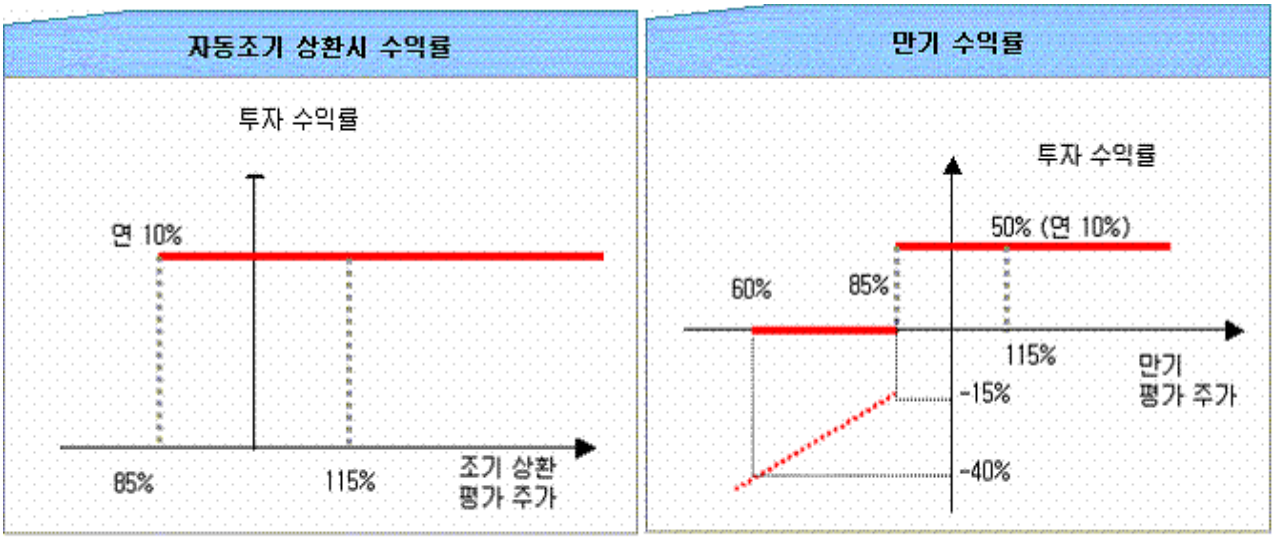
TwinPower파생SH3

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	19,593	0	19,593	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 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 (두 종목 중 하락률이 큰종목의 손실률 적용)

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR6003452S ELS현대108회060105	2,763

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

(단위:백만원)

4,517

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

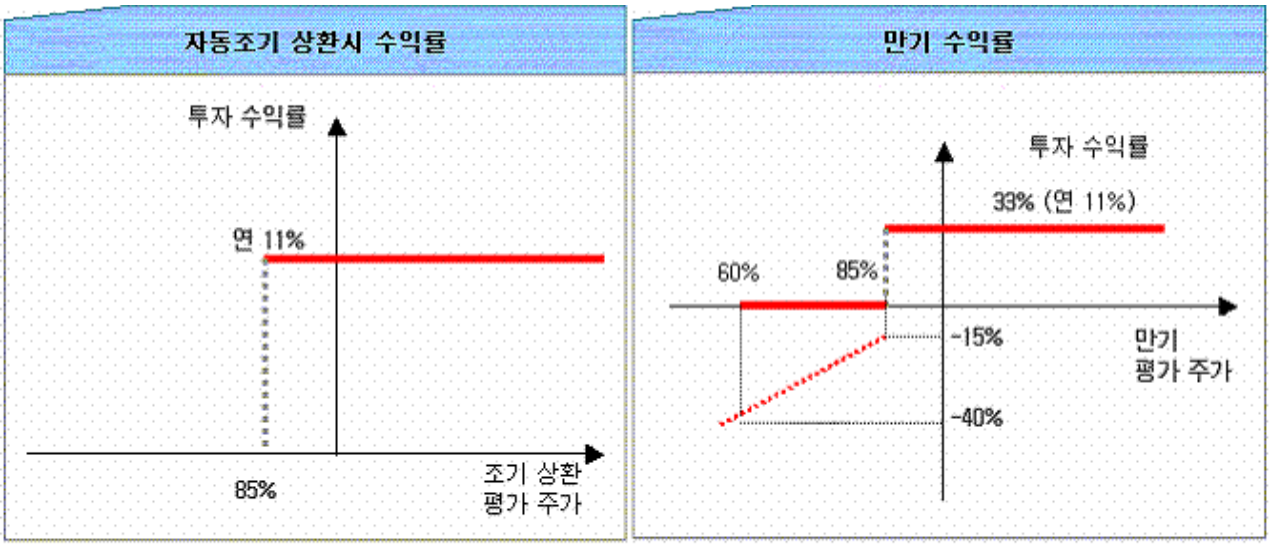
Tops2스타파생HS3

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	3,824

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

(단위:백만원)

5,604

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

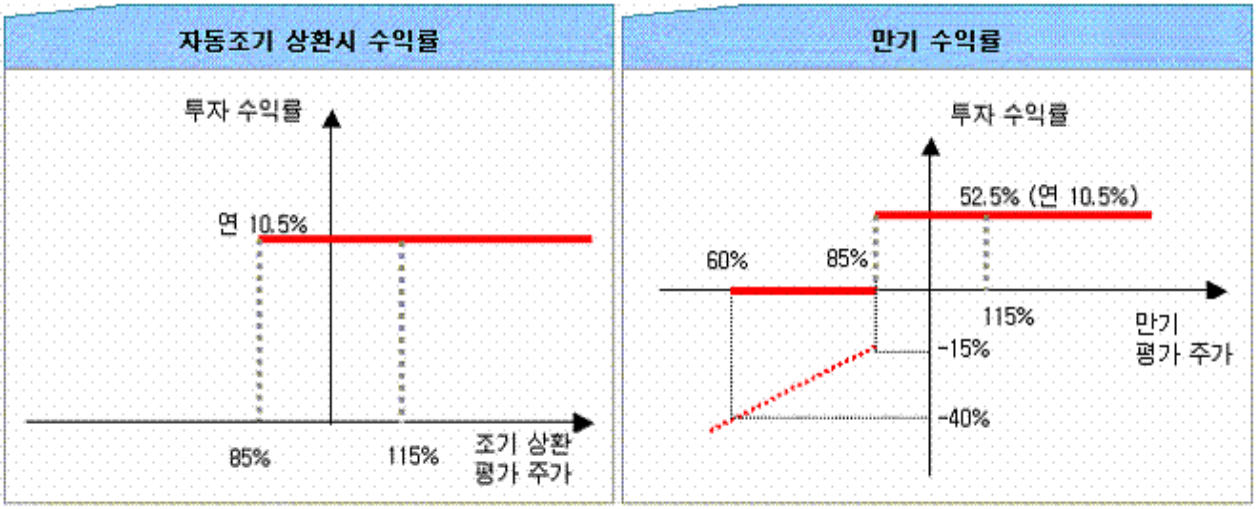
TwinPower파생SH4

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	29,168	0	29,168	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	4,543

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

(단위:백만원)

6,614

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

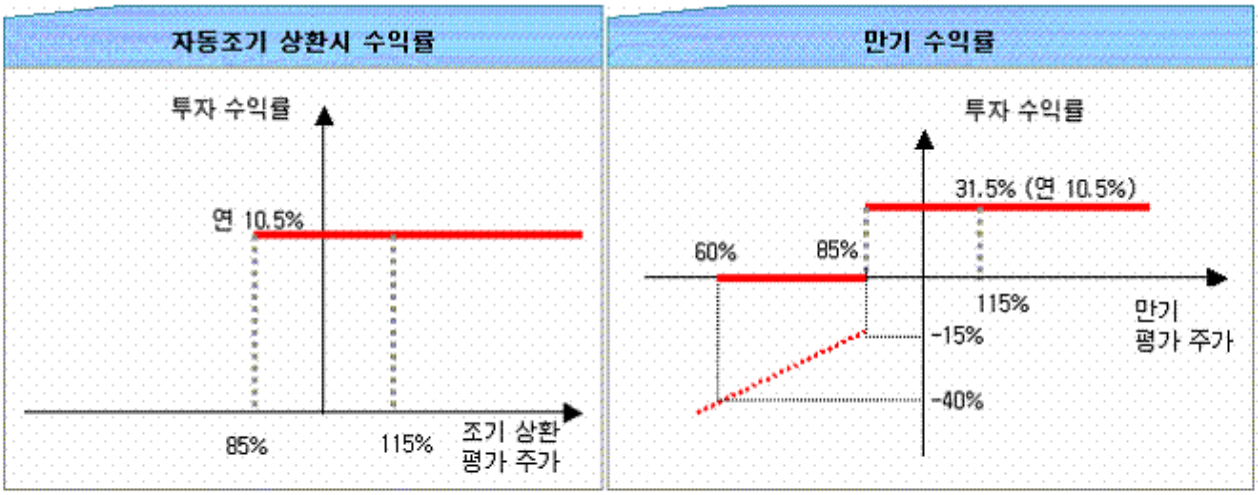
Tops2스타파생PH3

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	10,023	0	10,023	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 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)

KR6003335S ELS하나191회060119	1,507

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

(단위:백만원)

2,250

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

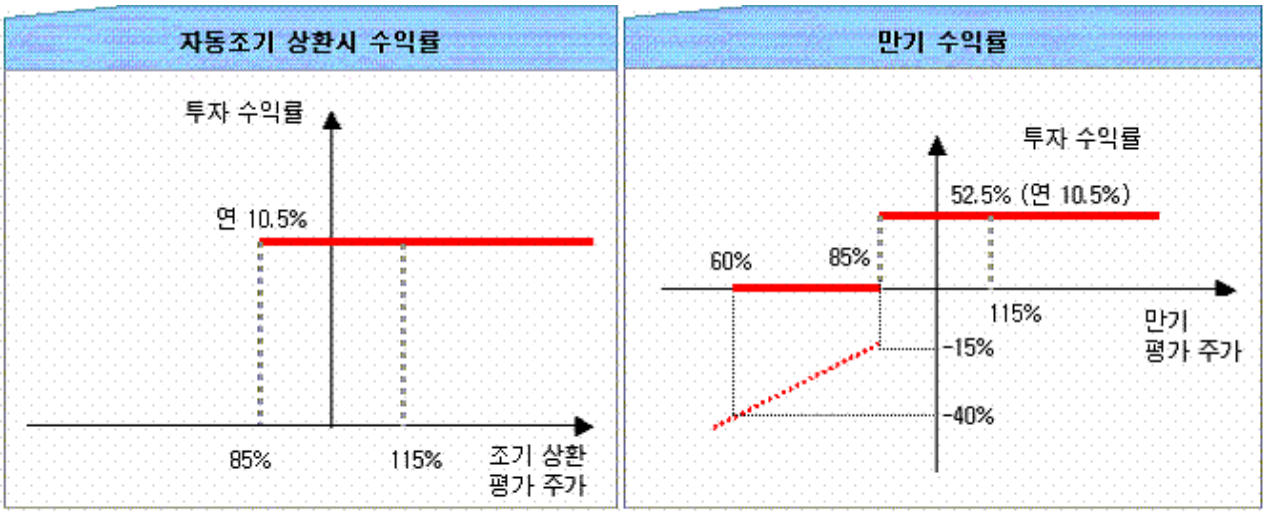
CHOICE파생SS-28

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	19,094	0	19,094	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	2,958

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

(단위:백만원)

4,517

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

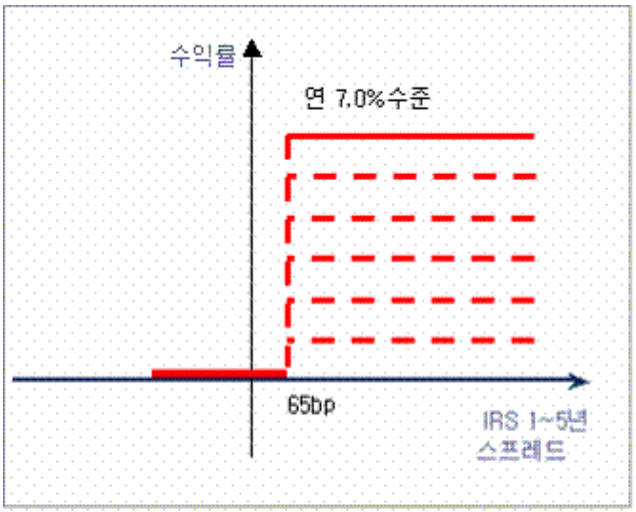
금리스프레드파생1

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	3

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

(단위:백만원)

1

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

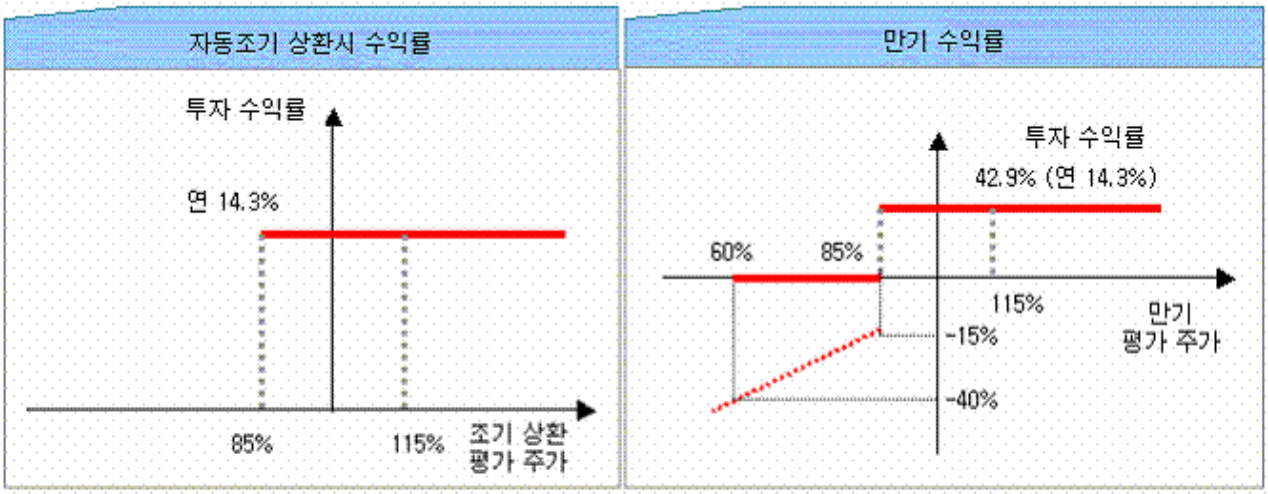
New2Star파생PH(3Y)-1

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	42,853	0	42,853	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	2,461
KR6003543S ELS대신224회060907	3,858

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

(단위:백만원)

9,036

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

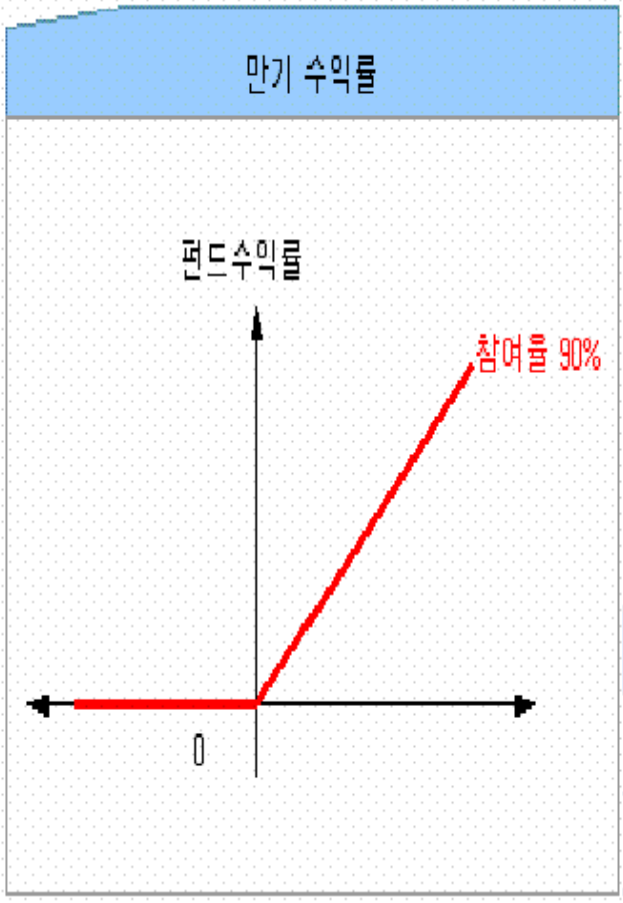
Tops중국주식환율파생

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	4,617	0	4,617	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 | 6

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

(단위:백만원)

38

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

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) 유럽 : Dow Jones Euro STOXX 50 Price Index (SX5E Index) 일본 : Nikkei-225 Stock Average Index. (NKY Index)
채권	미국 : iShares Lehman US Aggregate Bond Fund (AGG US Equity) 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 | 20

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

(단위:백만원)

5

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

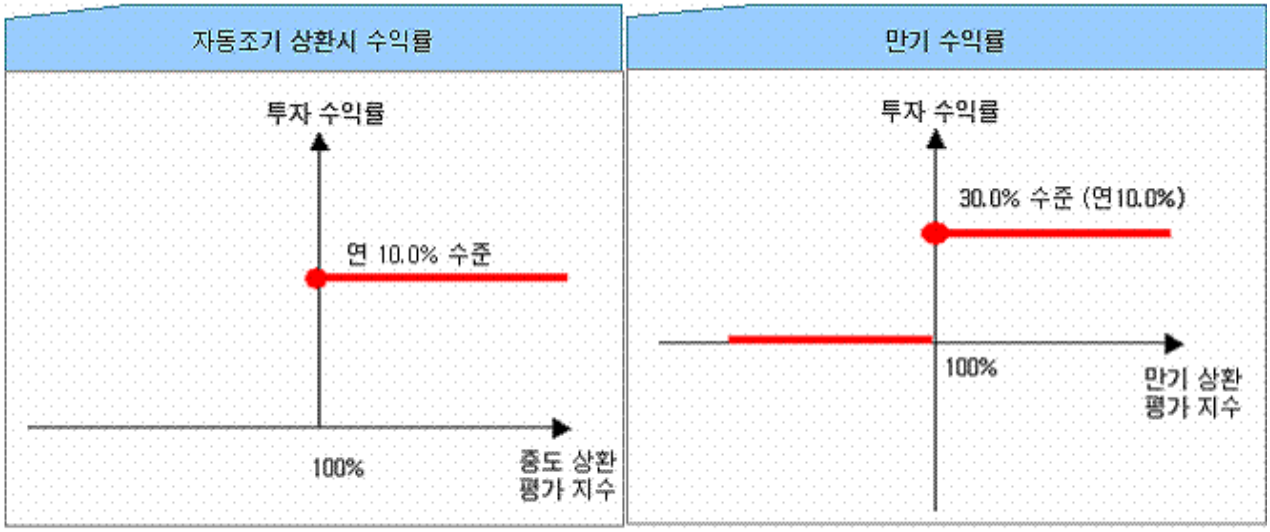
Tops아시아2Star파생1

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	26,507	0	26,507	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	77
KR6003336T ELS하나392회060216	56

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

(단위:백만원)

20

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

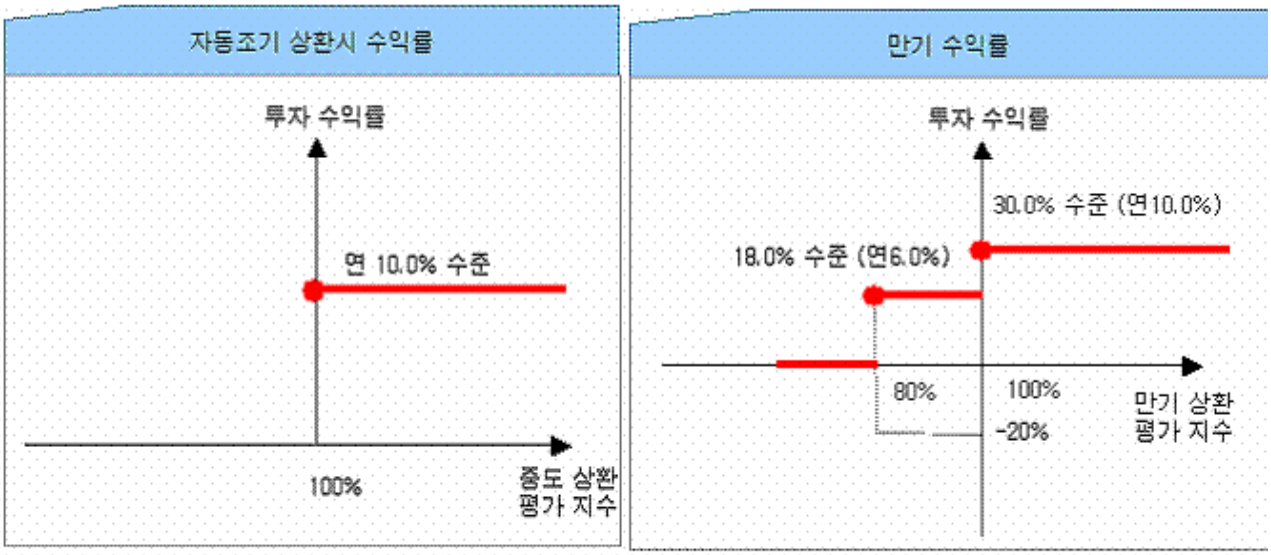
아시아2Star파생2호

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	23,231	0	23,231	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	46
KR6513306V ELS대신717회081007	60
KRS1003020 ELS Deutsche 070312	51

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

(단위:백만원)

40

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

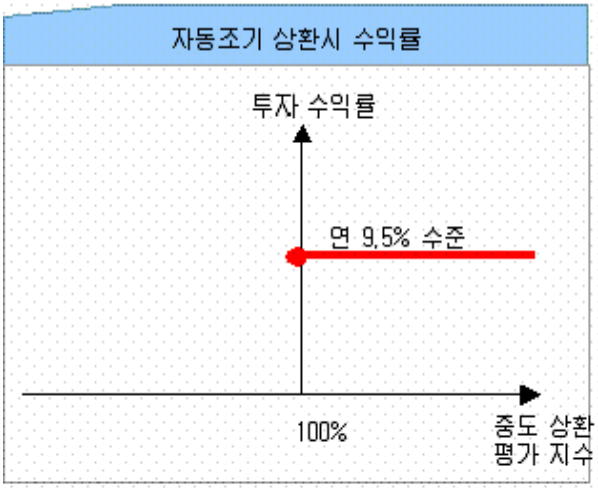
아시아2Star파생3호

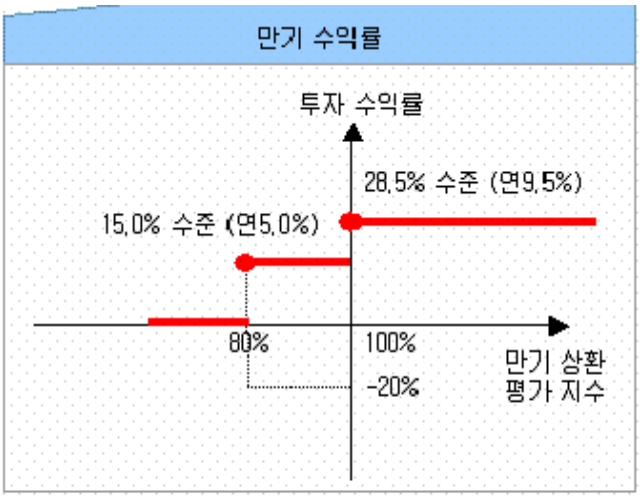
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,359	0	1,359	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	8

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

(단위:백만원)

2

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

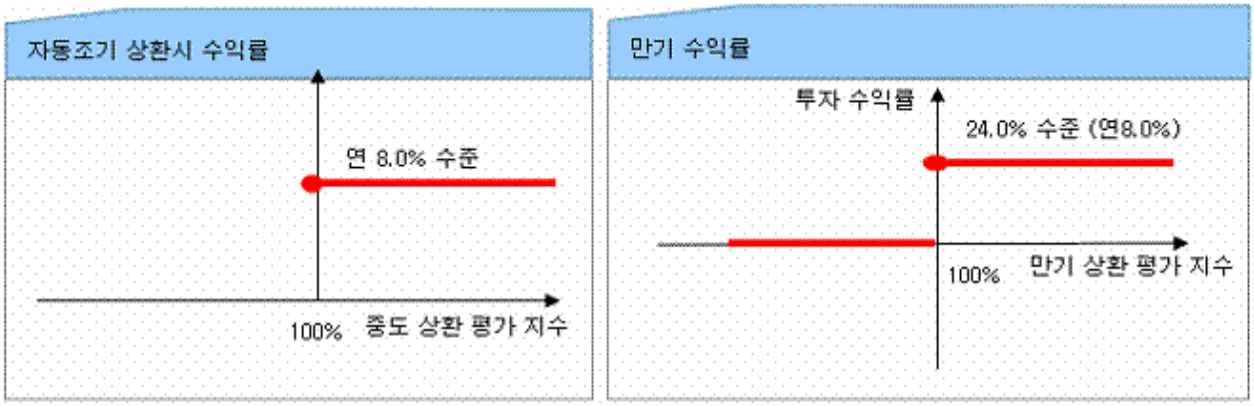
Neo2Star파생SP-5

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	27,367	0	27,367	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	195
KR600345ST ELS현대423회070315	149
KR600867CT ELS굿모닝635회070315	415

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

(단위:백만원)

1,111

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

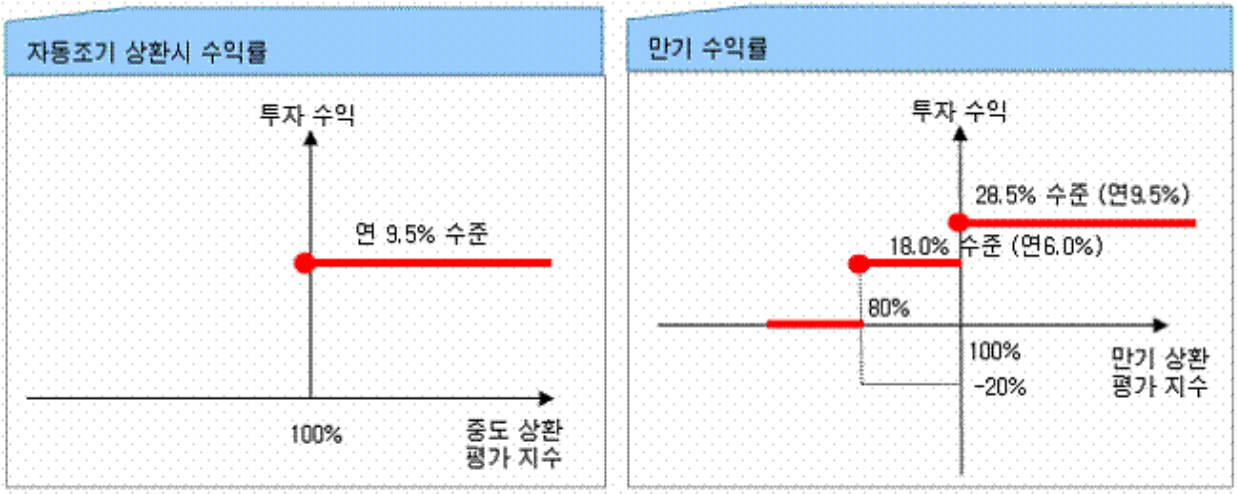
아시아2Star파생4호

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	8

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

(단위:백만원)

2

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

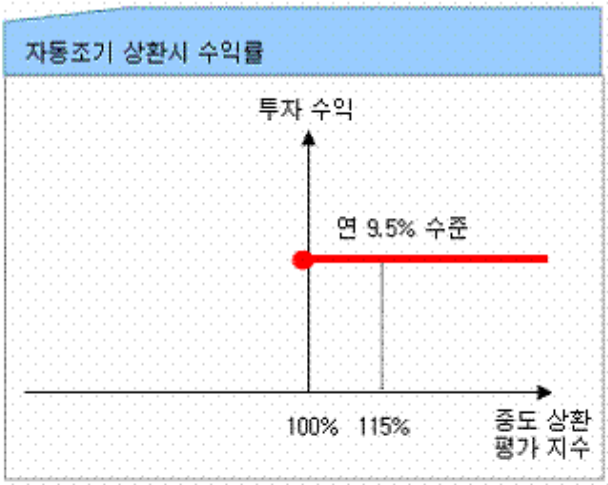
아시아2Star파생5호

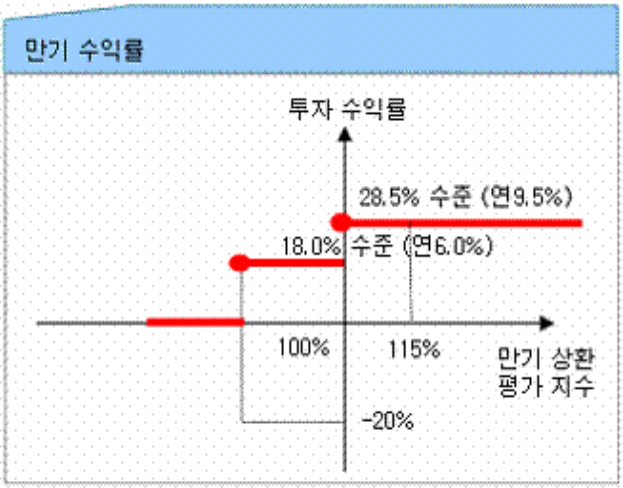
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	41,362	0	41,362	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	158
KR600594KT ELS우리1089회060404	91

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

(단위:백만원)

52

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

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	7,894	0	7,894	장외

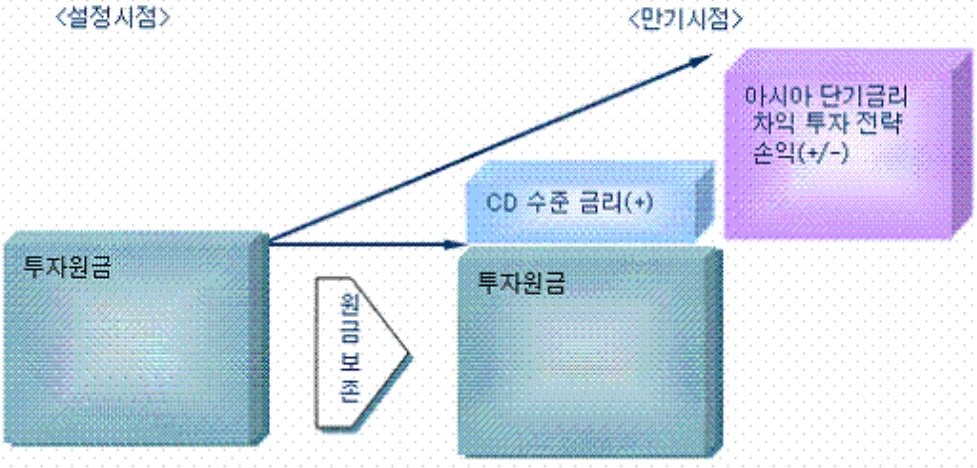
2. 만기시점의 손익구조

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	2008-10-15
기준일	2008-10-14

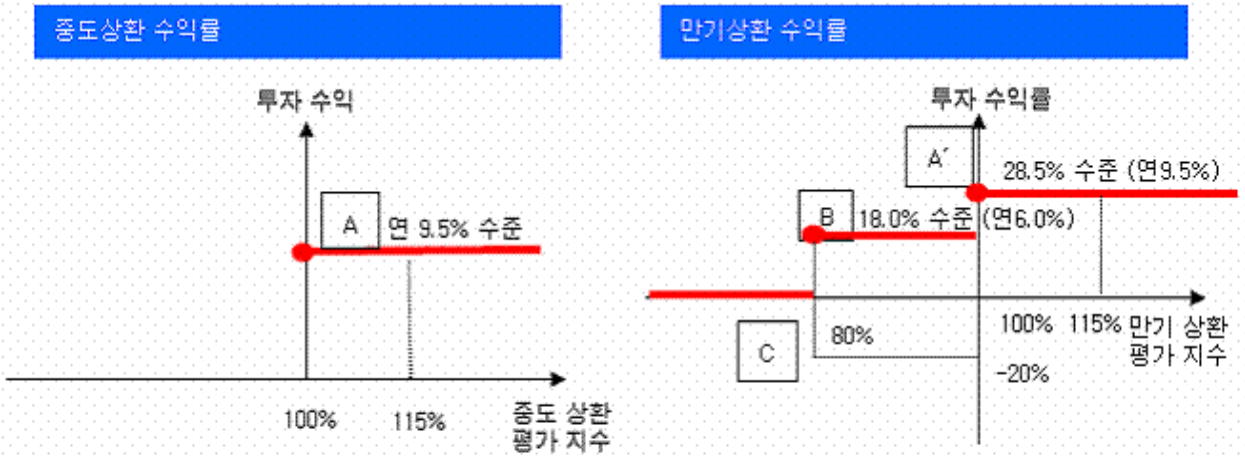
아시아2Star파생6호

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	27,717	0	27,717	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 - 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	65
KR6005941T ELS우리1122회060426	50
KR601636CT ELS삼성1180회060426	65

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

(단위:백만원)

35

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

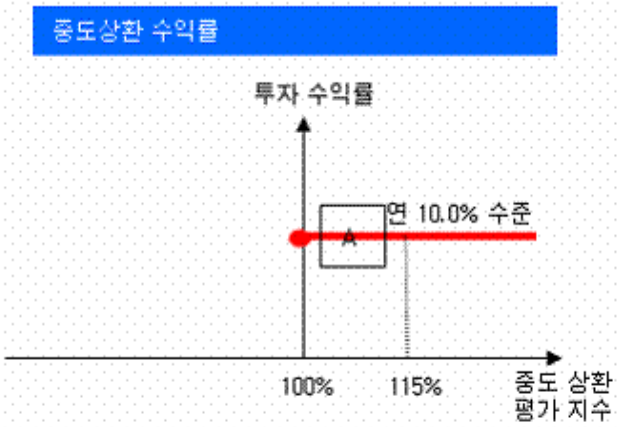
Tops아시아2Star파생7

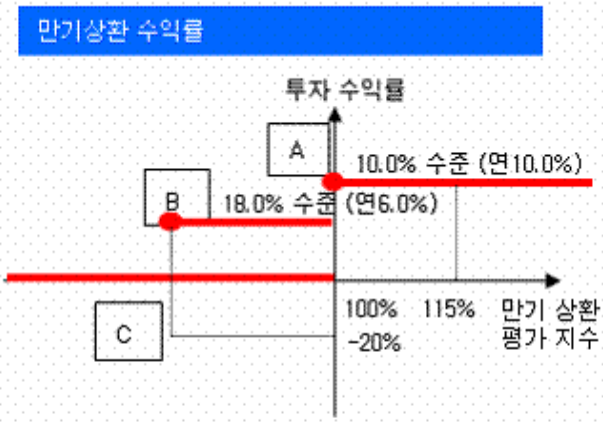
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	10,816	0	10,816	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 - 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	33
KR600594KT ELS우리1148회060510	29

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

(단위:백만원)

17

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

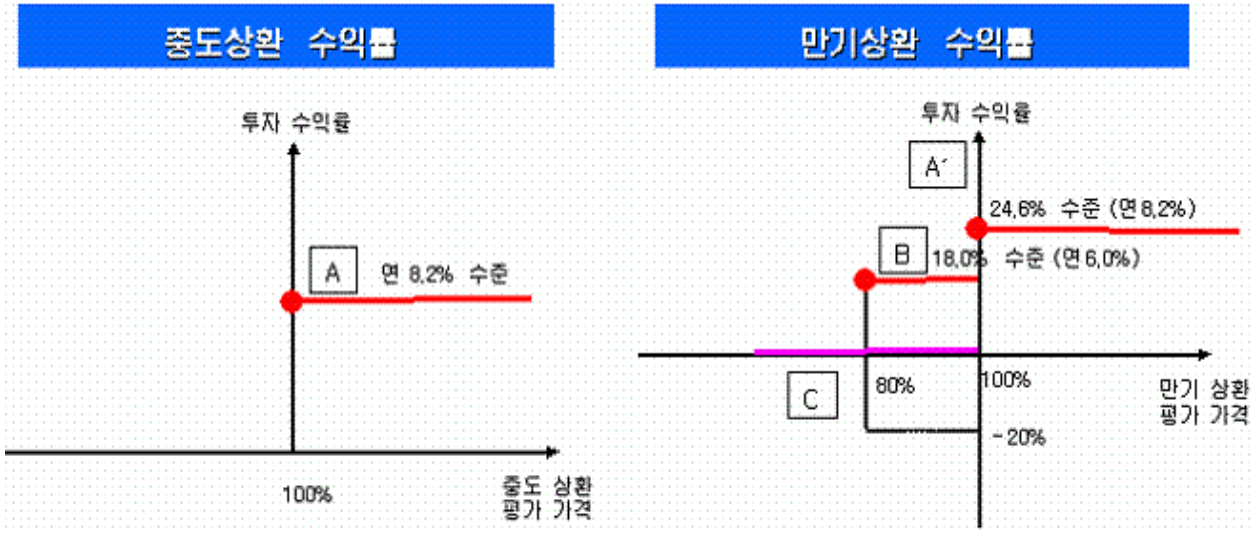
Neo 2Star 파생SP-9호

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	8,566	0	8,566	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	113
KR603049VT ELS한투613회070525	102

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

(단위:백만원)

330

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

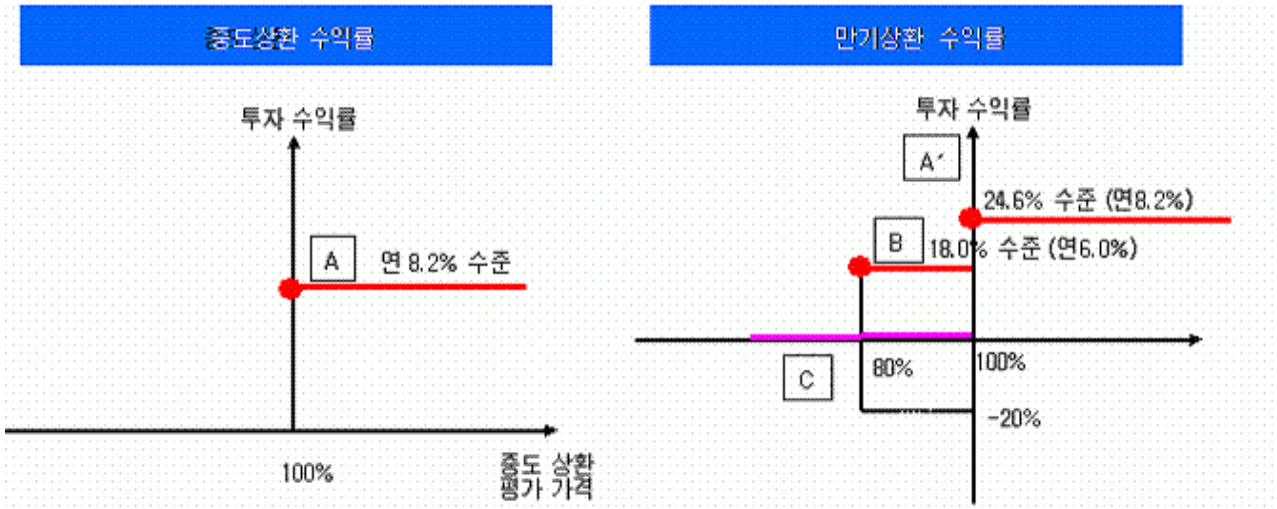
Neo 2Star 파생SP-10

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	14,472	0	14,472	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	147
KR6037626T ELS미래142회070605	171

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

(단위:백만원)

435

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

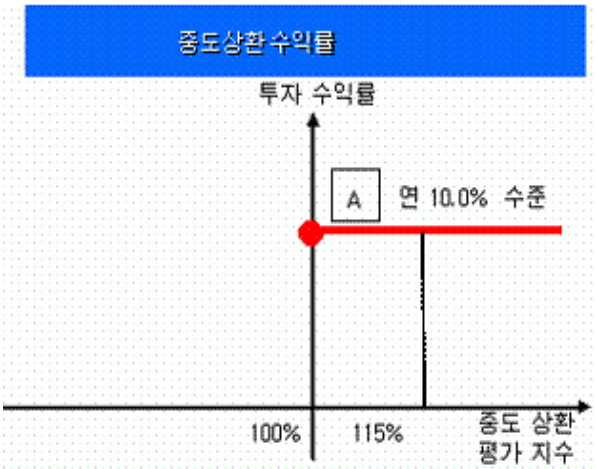
아시아2Star파생8호

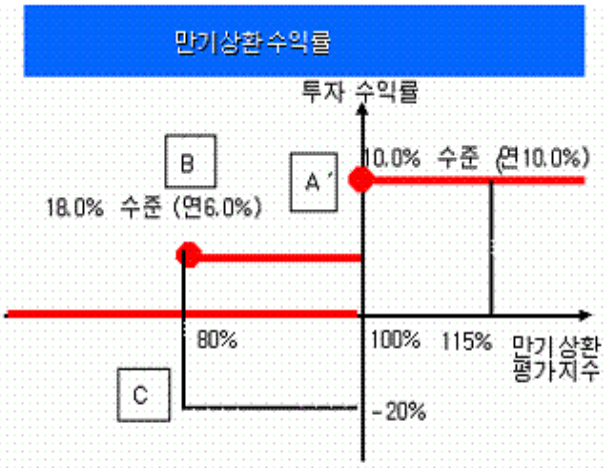
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	8,123	0	8,123	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 - 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	50

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

(단위:백만원)

10

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

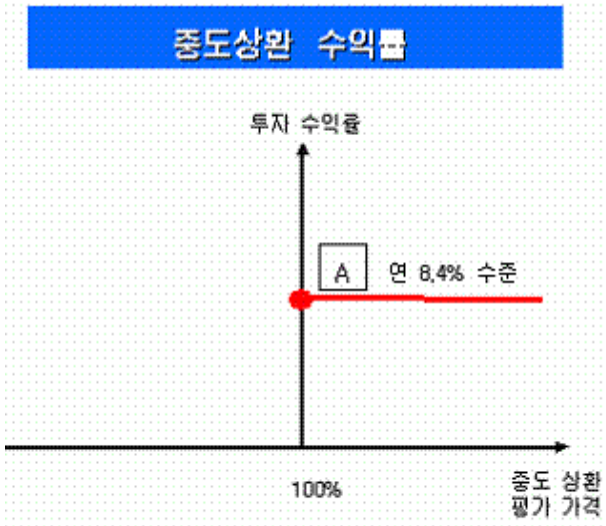
Neo 2Star 파생SP-11

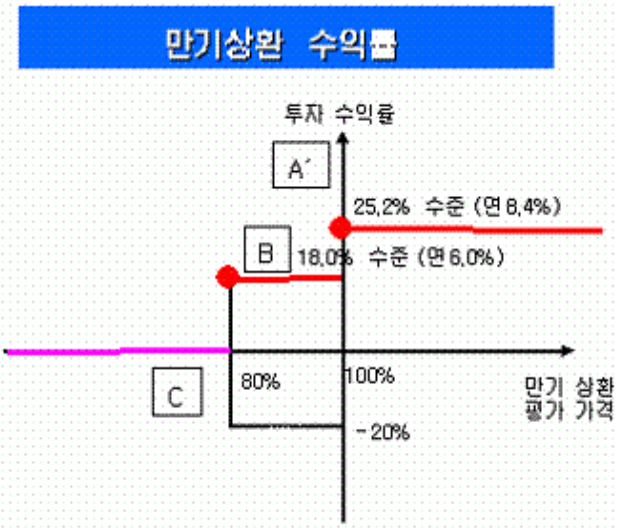
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	12,583	0	12,583	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	13
KR6006808T ELS대우1404회070620	266

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

(단위:백만원)

390

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

Neo 3Star 파생SNK-1

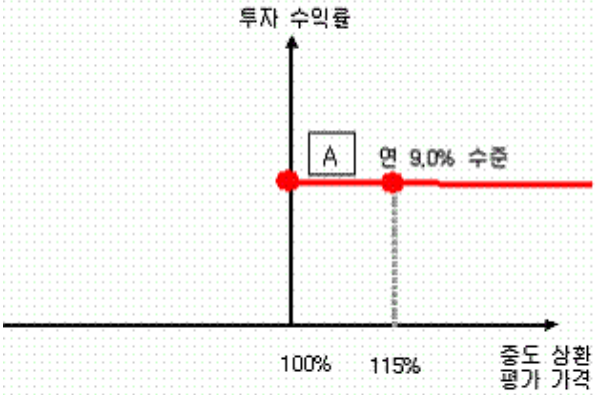
1. 계약금액

(단위:백만원)

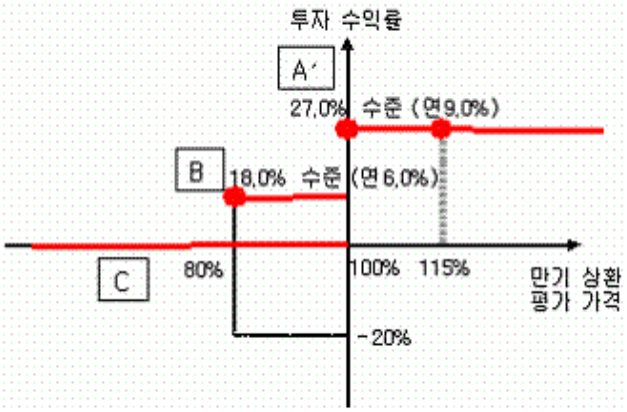
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	535	0	535	장외

2. 만기시점의 손익구조

중도상환 수익률



만기상환 수익률



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 - 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	10

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

(단위:백만원)

5

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

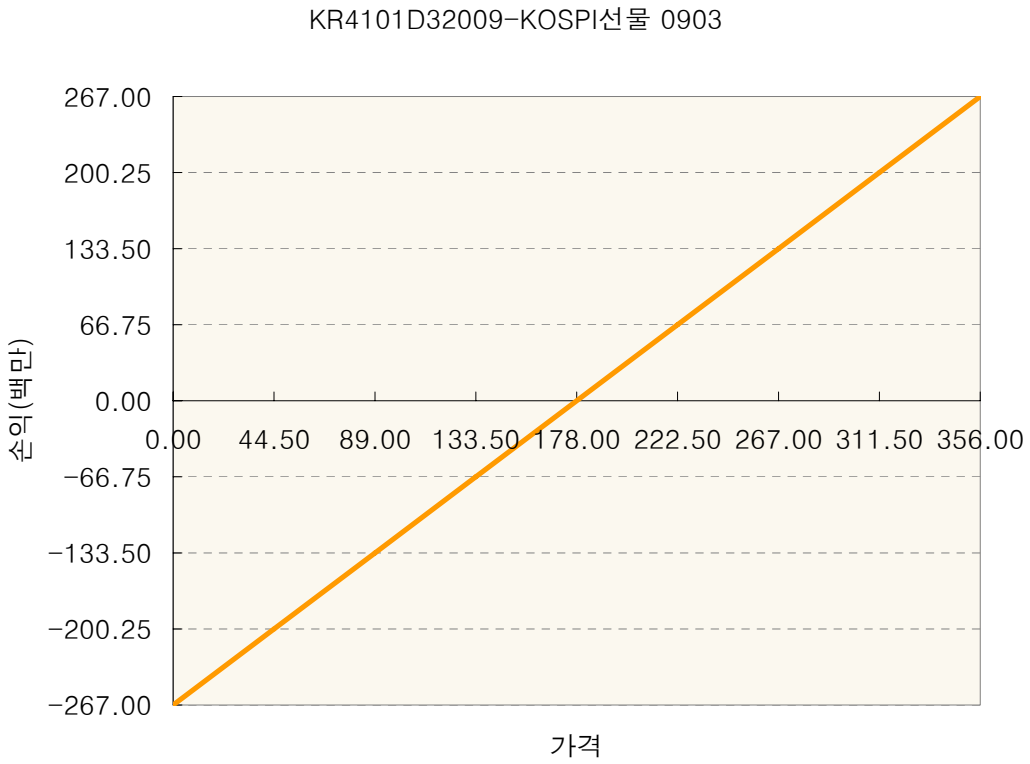
모아펀더멘탈파생1호

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	267	0	267	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101D320 KOSPI선물 0903	21

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

(단위:백만원)

35

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

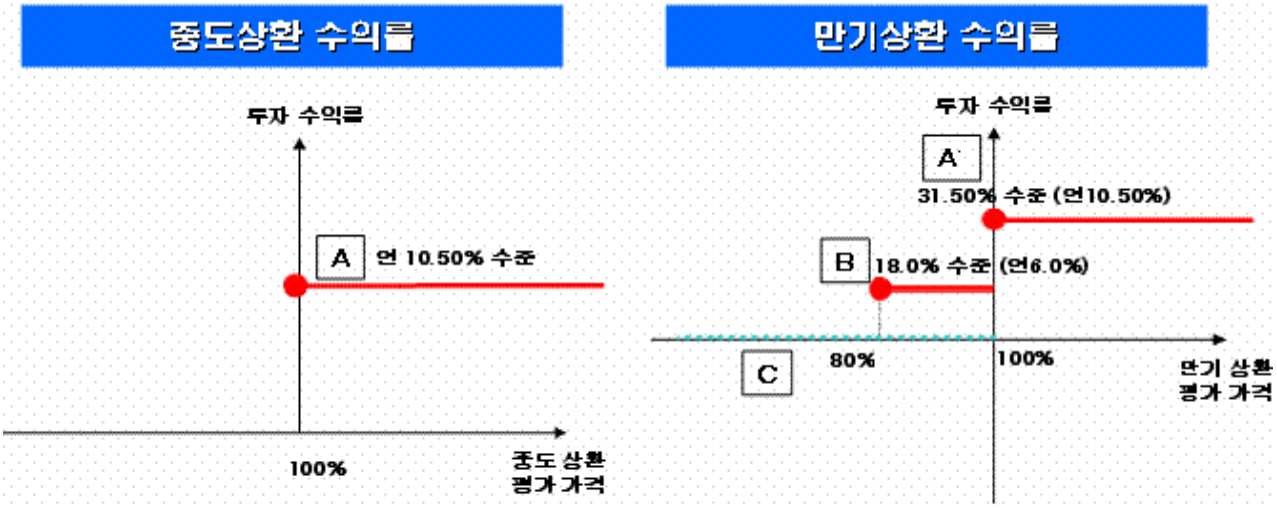
4Star 파생 SPST-1호

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	5,533	0	5,533	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
40

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

(단위:백만원)

11

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

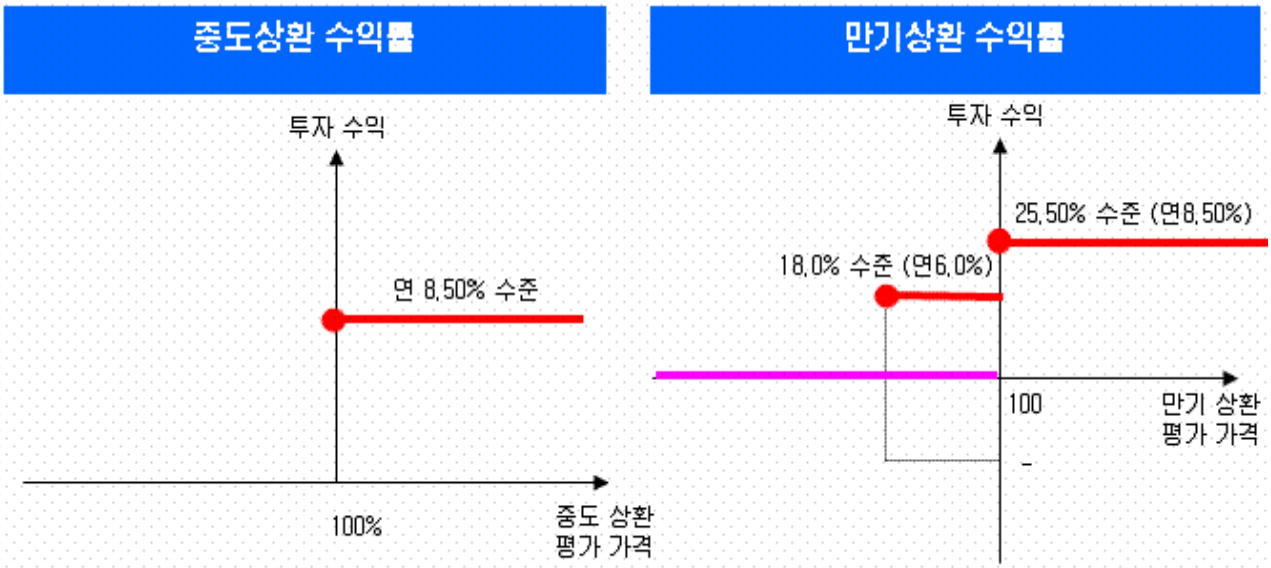
엔비유2Star파생SS1

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	4,107	0	4,107	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	89

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

(단위:백만원)

104

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

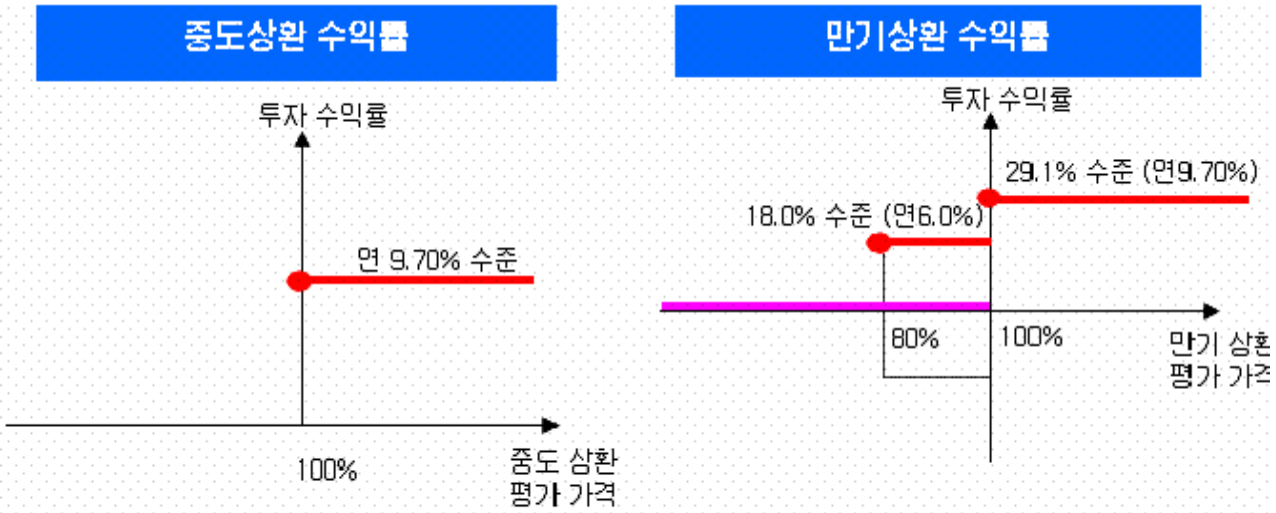
엔비유2Star파생SP-1

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	6,717	0	6,717	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	131

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

(단위:백만원)

170

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

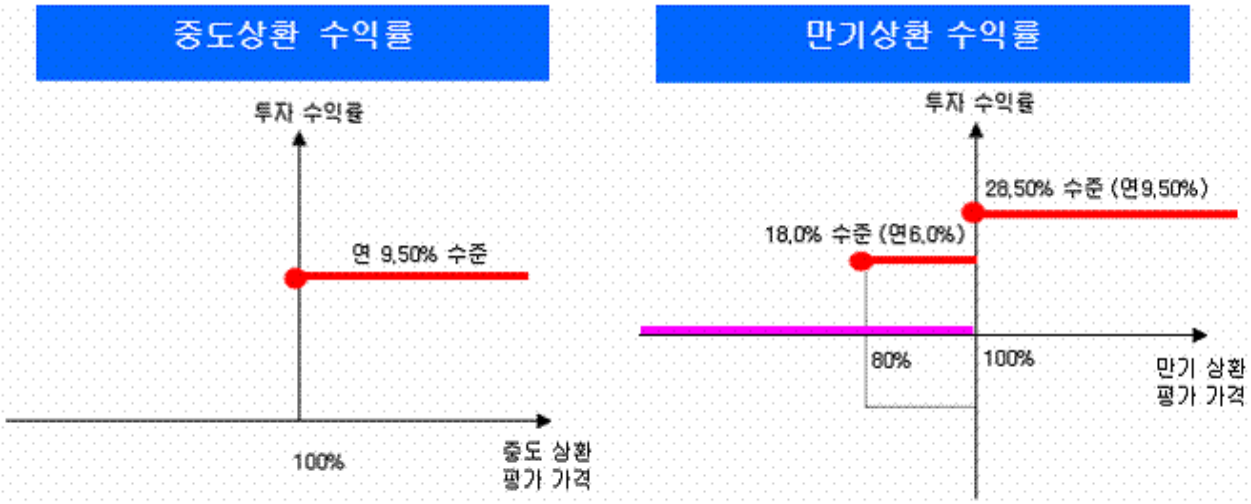
엔비유2Star파생PS-1

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	916	0	916	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	26

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

(단위:백만원)

36

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

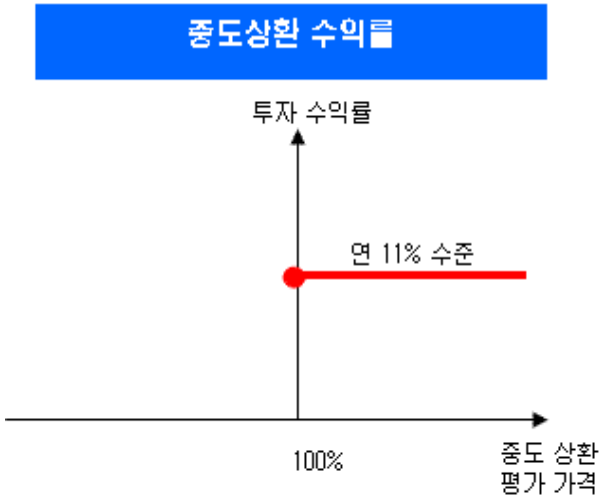
엔비유2Star파생PH-1

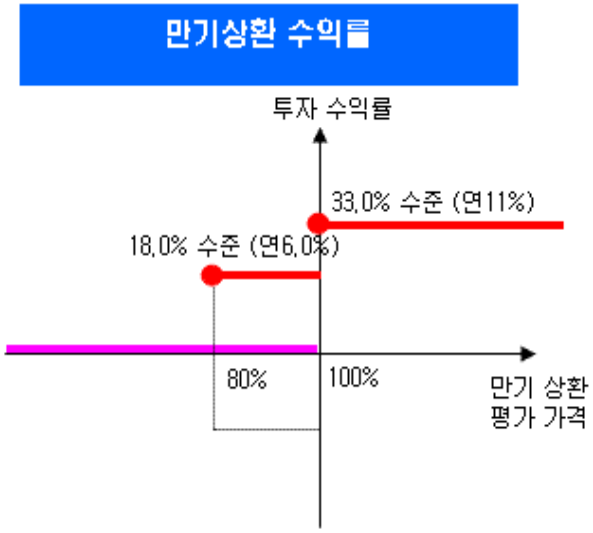
1. 계약금액

(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	400

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

(단위:백만원)

465

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

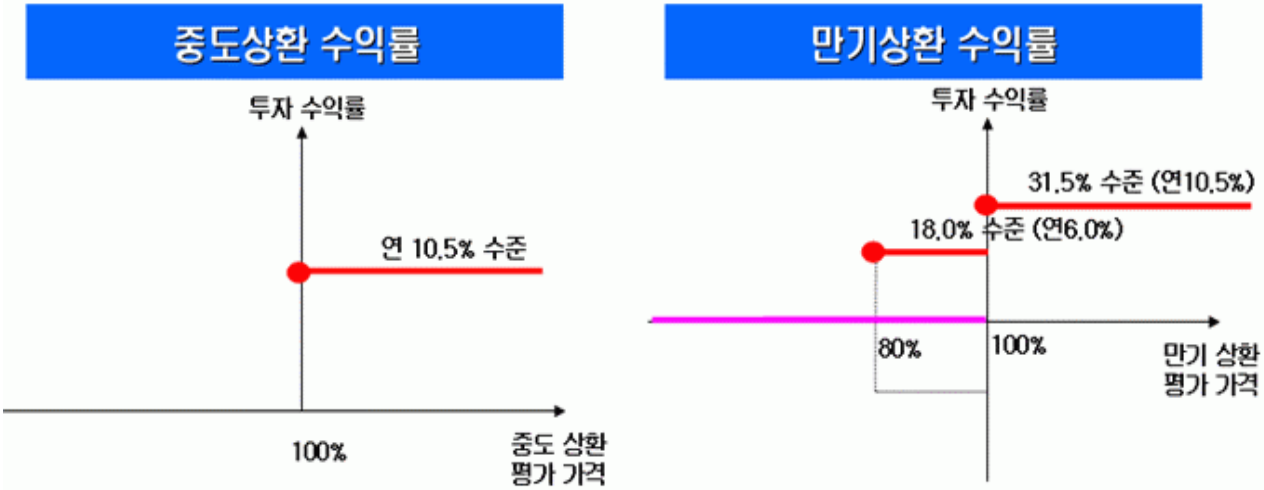
엔비유2Star파생SP-2

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	9,554	0	9,554	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	137

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

(단위:백만원)

155

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

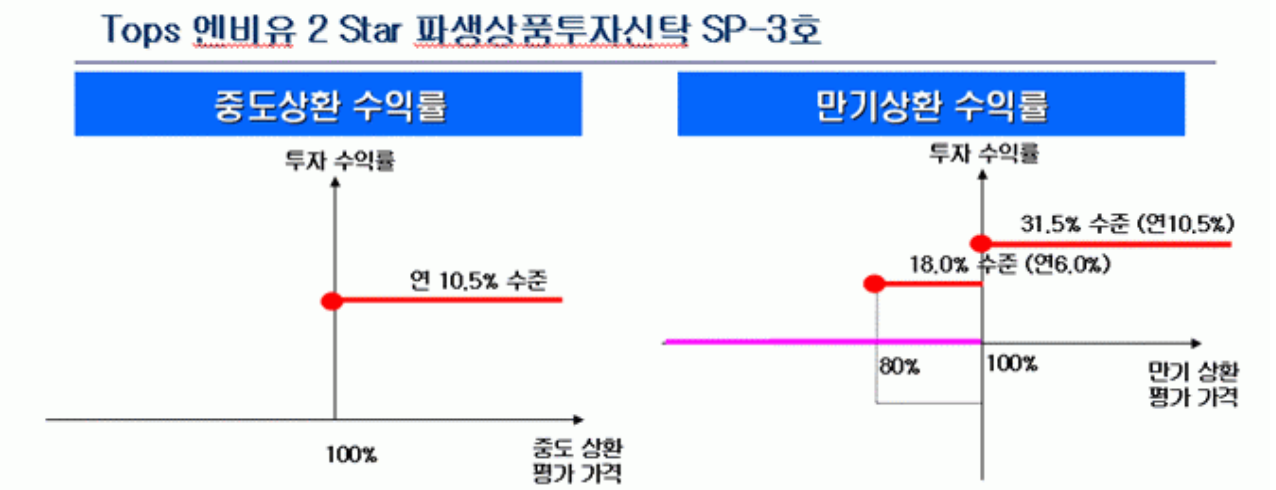
엔비유2Star파생SP-3

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	4,576	0	4,576	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

SH 자산운용 1

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS1010150 ELS Deutsche 071022	77

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

(단위:백만원)

99

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

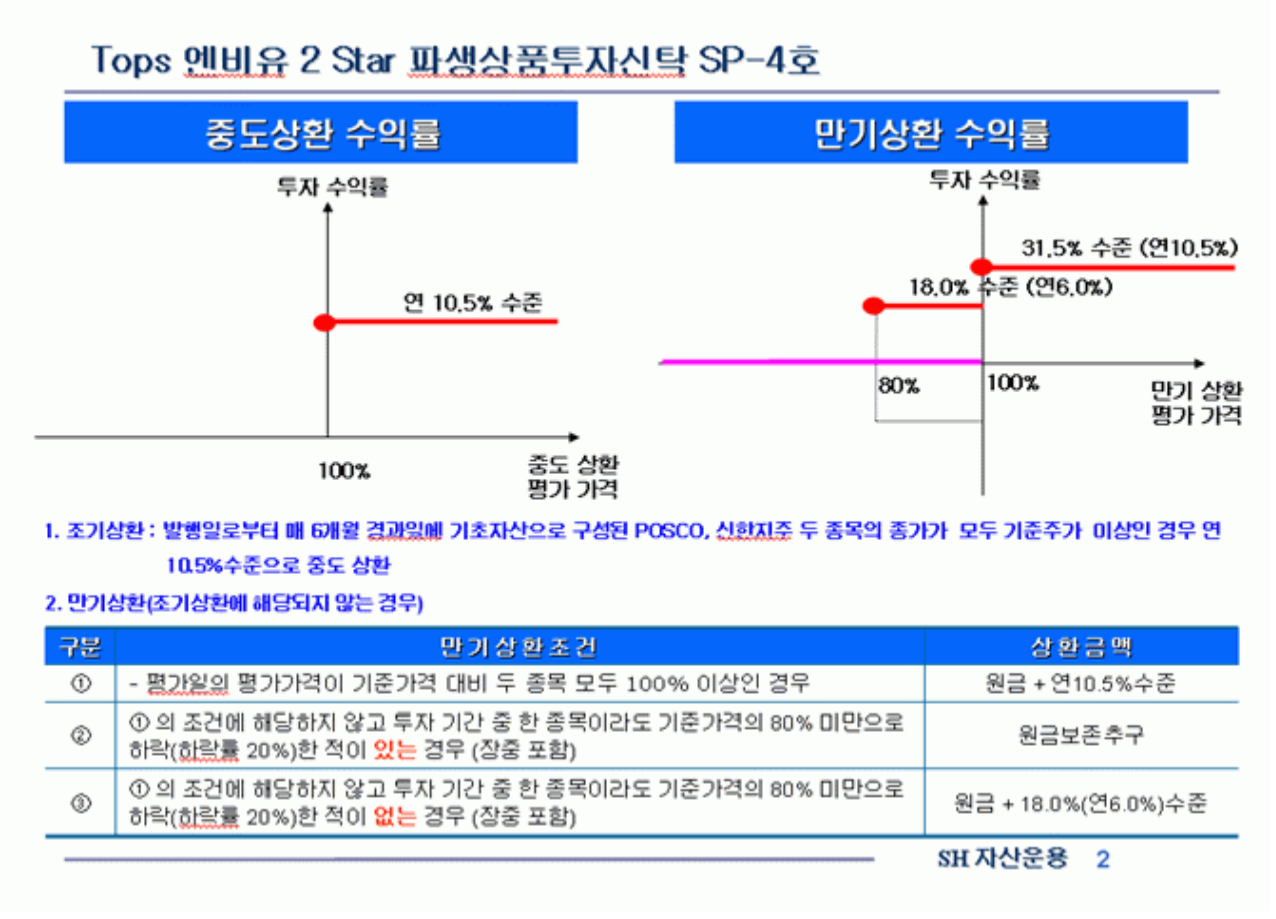
엔비유2Star파생SP-4

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	34,140	0	34,140	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS1011010 ELS Deutsche 071107	618

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

(단위:백만원)

678

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

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	547

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

(단위:백만원)

1,063

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

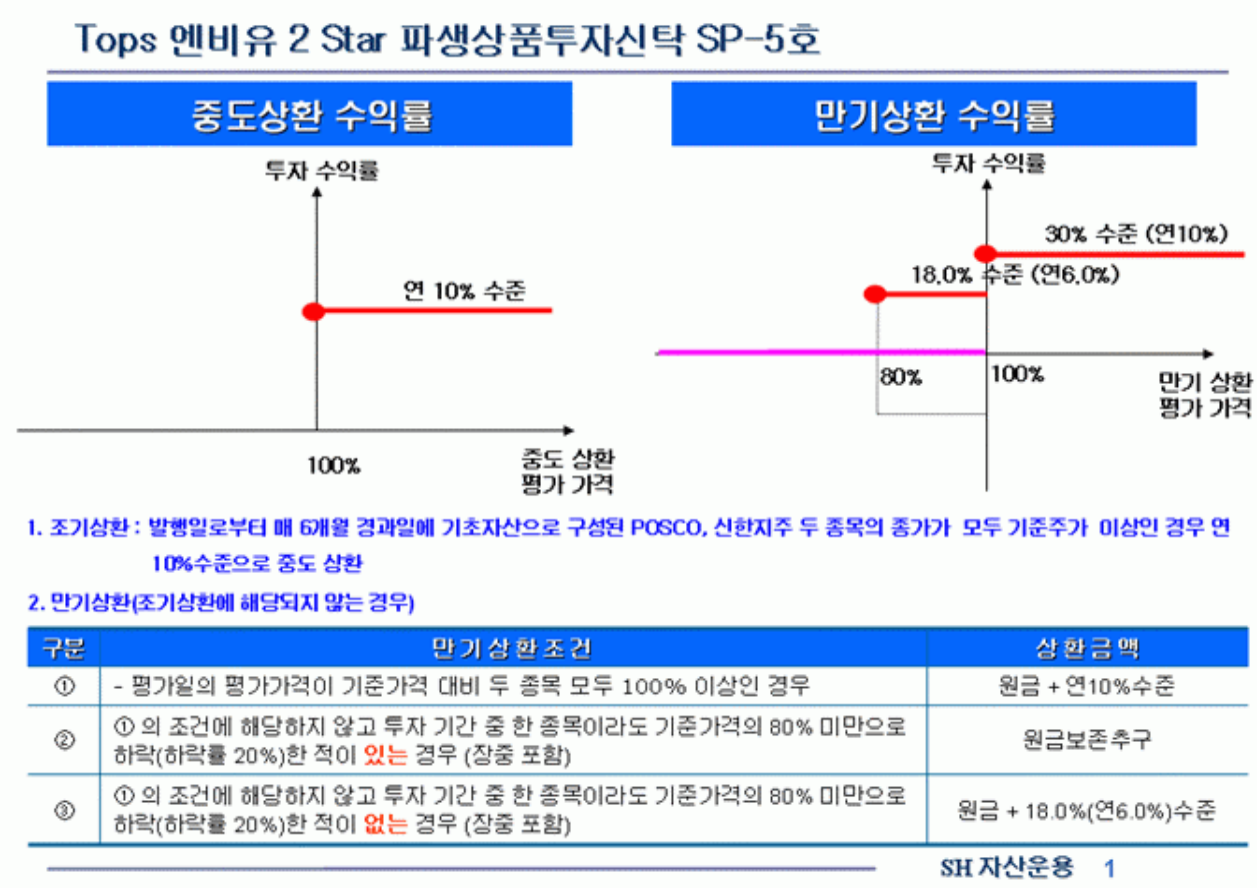
엔비유2Star파생SP-5

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	10,193	0	10,193	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	237

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

(단위:백만원)

280

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

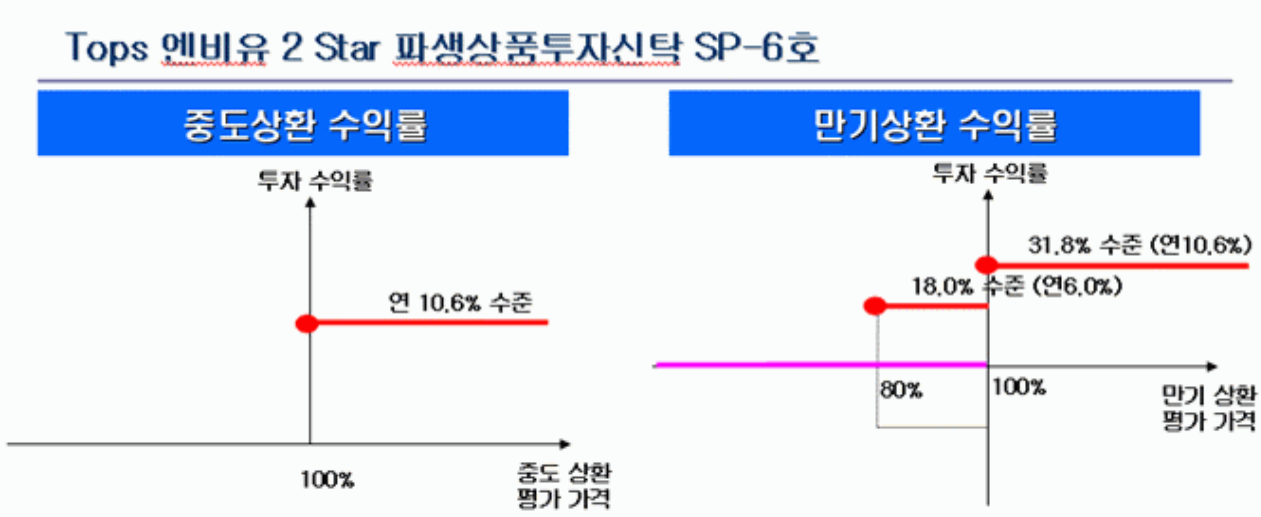
엔비유2Star파생SP-6

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	1,492	0	1,492	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	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)

KRS1012130 ELS Deutsche 071220	32

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

(단위:백만원)

42

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

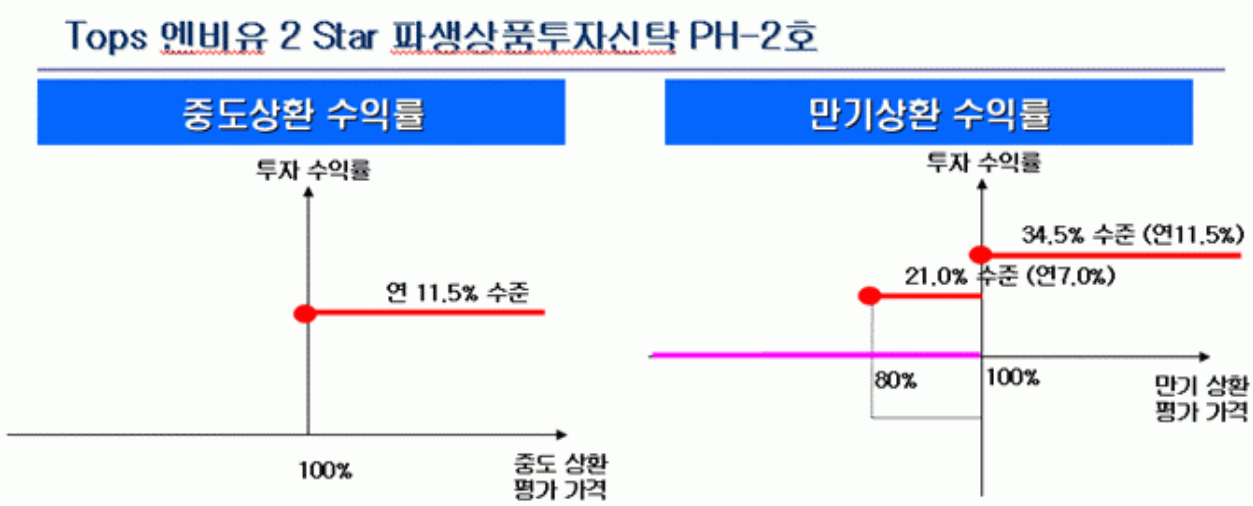
엔비유2Star파생PH-2

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	1,912	0	1,912	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	39

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

(단위:백만원)

63

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

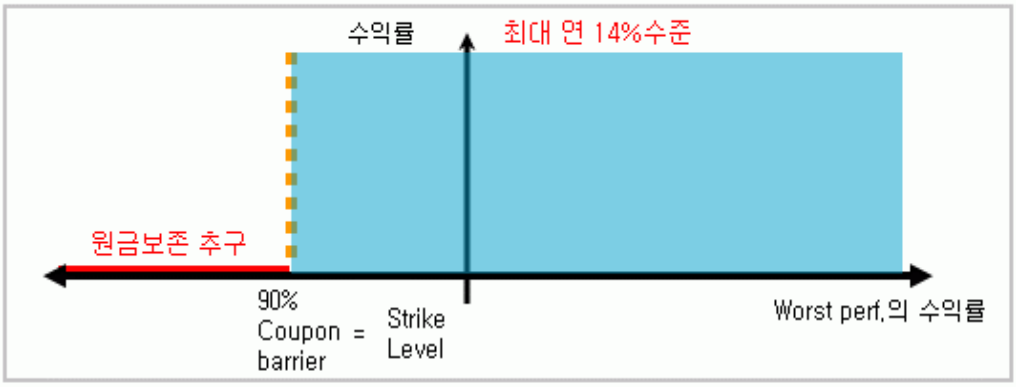
Range Accrual파생SP4

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	5,726	0	5,726	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	91

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

(단위:백만원)

147

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

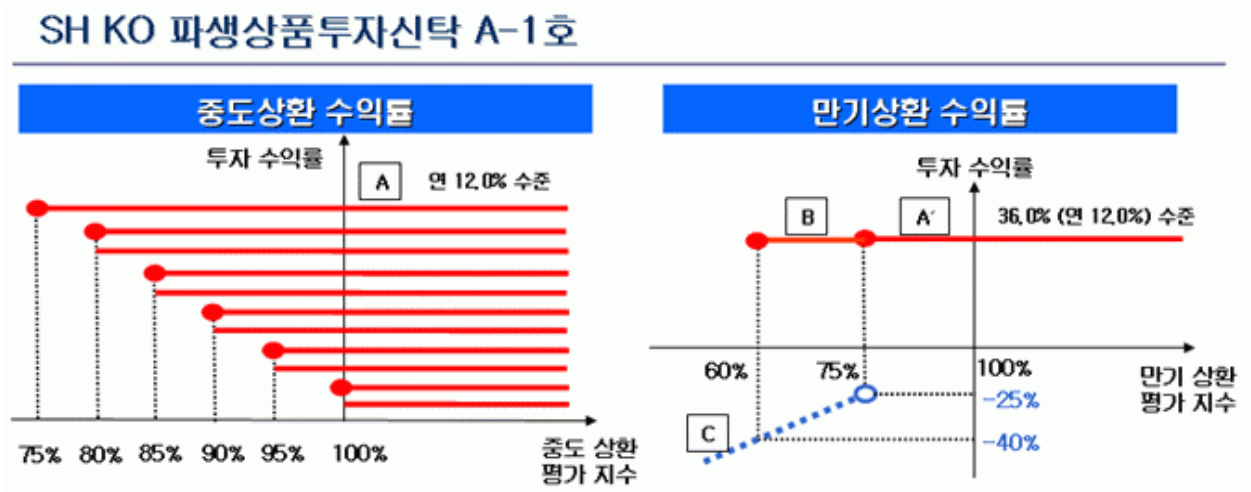
SH KO파생A-1호

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	3,694	0	3,694	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	348

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

(단위:백만원)

236

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

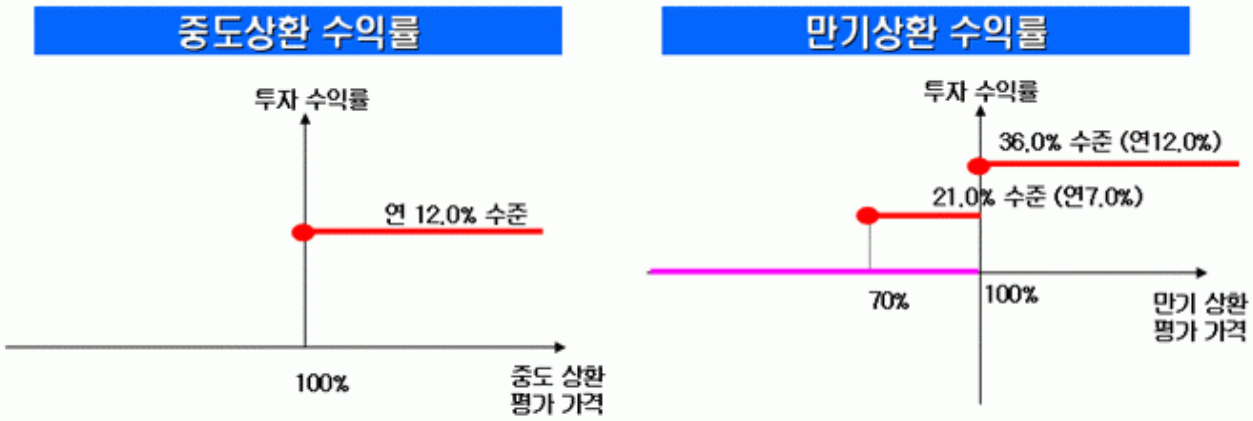
애그리2Star파생WS-1

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	577	0	577	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
10

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

(단위:백만원)

6

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

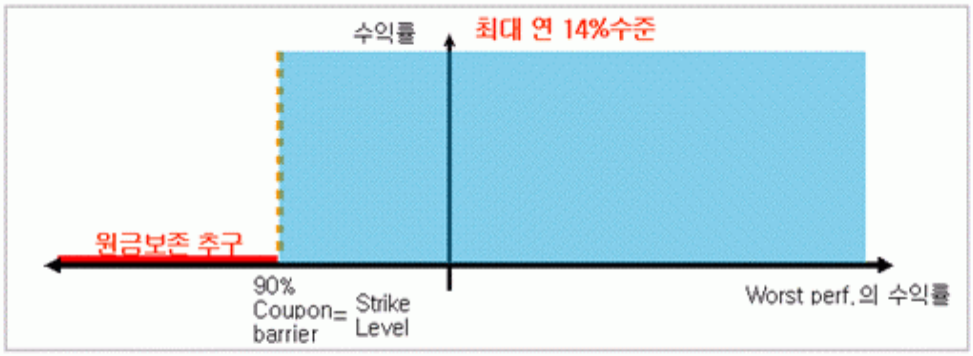
Range Accrual파생SP5

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	3,312	0	3,312	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	54

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

(단위:백만원)

81

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

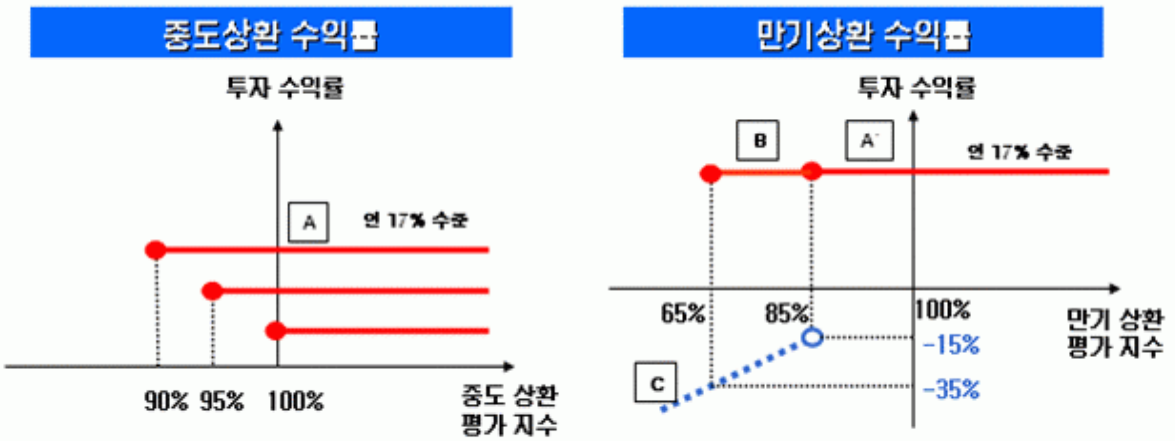
SH KO 파생3호

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	27,134	0	27,134	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	4,135

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

(단위:백만원)

3,130

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

메탈인덱스플러스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

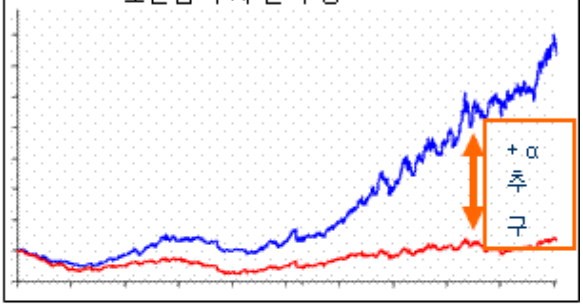
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,176	0	1,176	장내

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 금속 지수, 귀금속 지수	S&P GSCI 금속 지수, 귀금속 지수
특징	Dow Jones와 AIG에서 운영 한 상품의 비중은 2~15%로 제한 연간 정기 리벨런싱 시 동시에 한 부분이 차지한 비중은 최대	Standard Poor's와 GS에서 운영 지난 5년간 개별 구성종목 간 세계 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)

GCZ8	Comex Gold	30
HGZ8	High Grade Copper	18
LMAHDP	LME Aluminum	29
LMNIDP	LME Nickel	6
LMZSDP	LME Zinc	6
SIZ8	Comex Silver	4

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

170

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

에너지인덱스파생모

1. 계약금액

(단위:백만원)

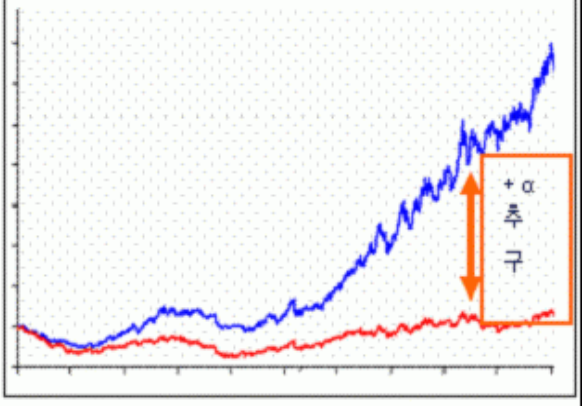
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,725	0	1,725	장내

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 한 상품의 비중은 2~15%로 제한 연간 정기 리벨런싱 시 동시에한 부분이 차지한 비중은 최대 33% 매년 1회 리벨런싱 농산물은 4~5회 이월	Standard Poor's와 GS에서 운영 지난 5년간 개별 구성종목 간 세계 생산량의 상대적 수준을 바탕으로 각비중을 평균하여 결정. 월별 이월 전략을 이용 농산물은 5~6회 이월

• 장내파생상품 예시

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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLZ8	Crude Oil	64
HOZ8	Heating Oil	11
NGZ8	Natural Gas	54
XBZ8	♪	9

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

(단위:백만원)

320

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

애그리컬쳐인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

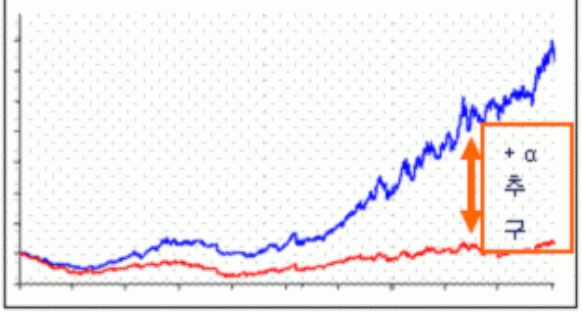
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,115	0	4,115	장내

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 연간 정기 리벨런싱 시 동시에 한 부분이 차지한 비중은 최대 33% 매년 1회 리벨런싱	Standard Poor's와 GS에서 운영 지난 5년간 개별 구성 종목간 세계 생산량의 상대적 수준을 바탕으로 각비중을 평균하여 결정. 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)

BOZ8	Soybean Oil	27
CTZ8	Cotton	21
CZ8	Corn	62
KCZ8	Coffee	35
SBH9	Sugar No11	48
SF9	Soybean	100
WZ8	Wheat	37

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

696

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

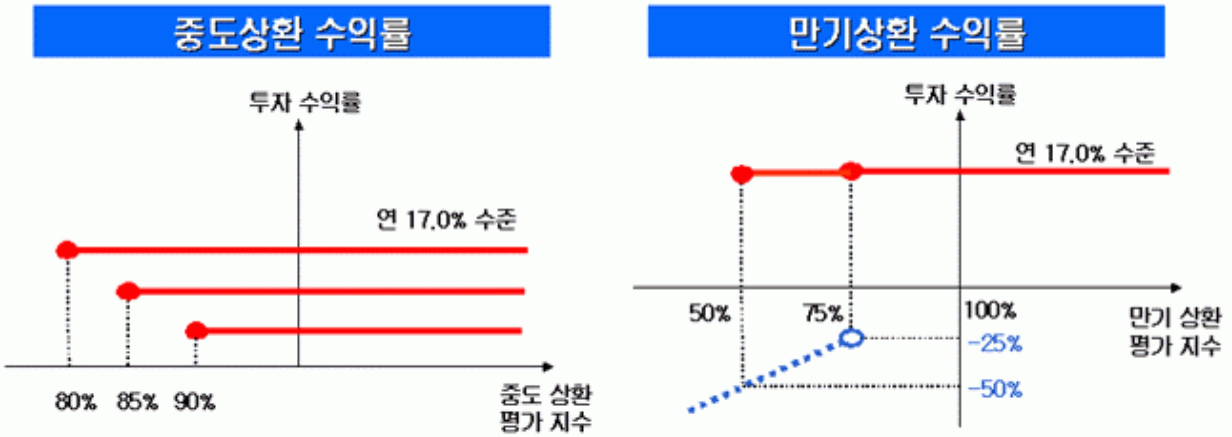
SH한-중파생1호

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	6,772	0	6,772	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	545

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

(단위:백만원)

557

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

SH Range Accrual파생SP-6

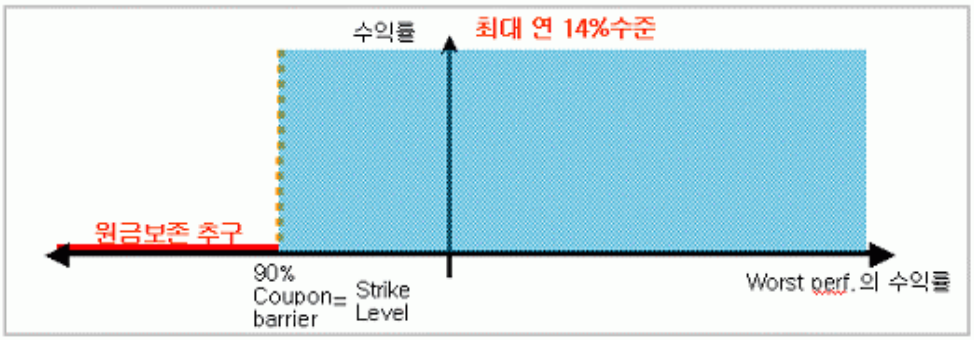
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	8,584	0	8,584	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	105

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

(단위:백만원)

159

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

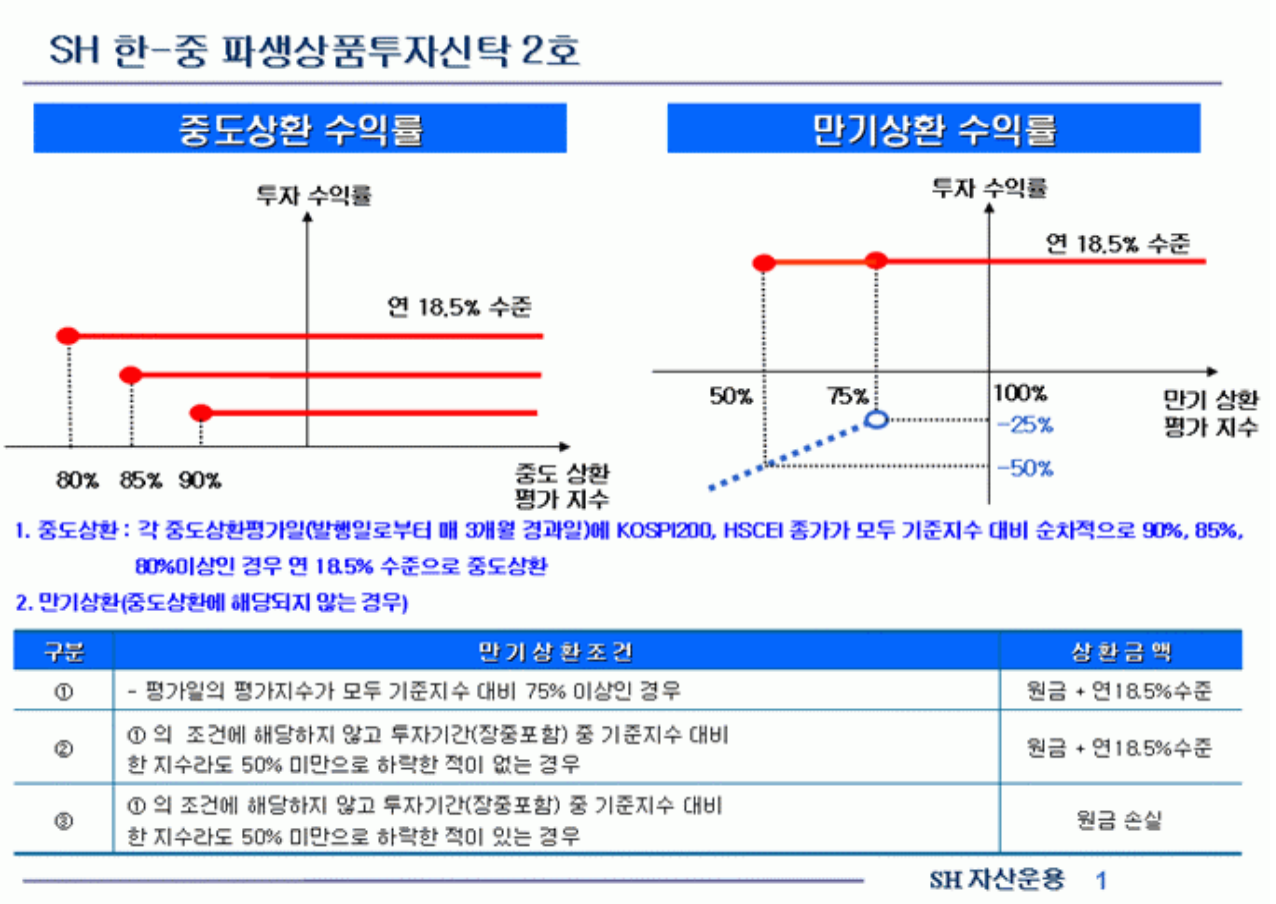
SH 한-중 파생2호

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	10,192	0	10,192	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR6030612V ELS교보186회080502	834

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

(단위:백만원)

729

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

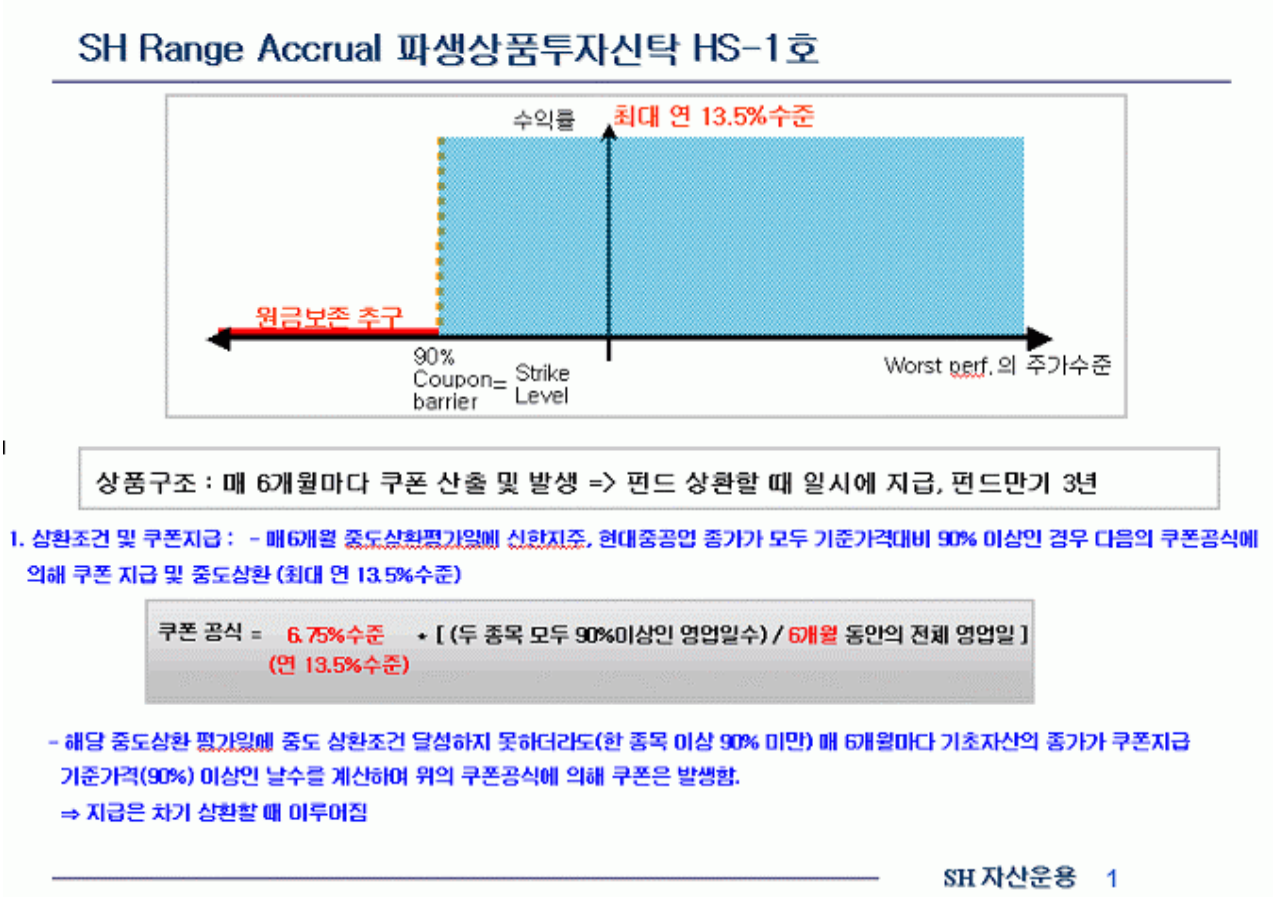
Range Accrual파생HS1

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	6,398	0	6,398	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS1105240 ELS Deutsche080523	60

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

(단위:백만원)

90

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

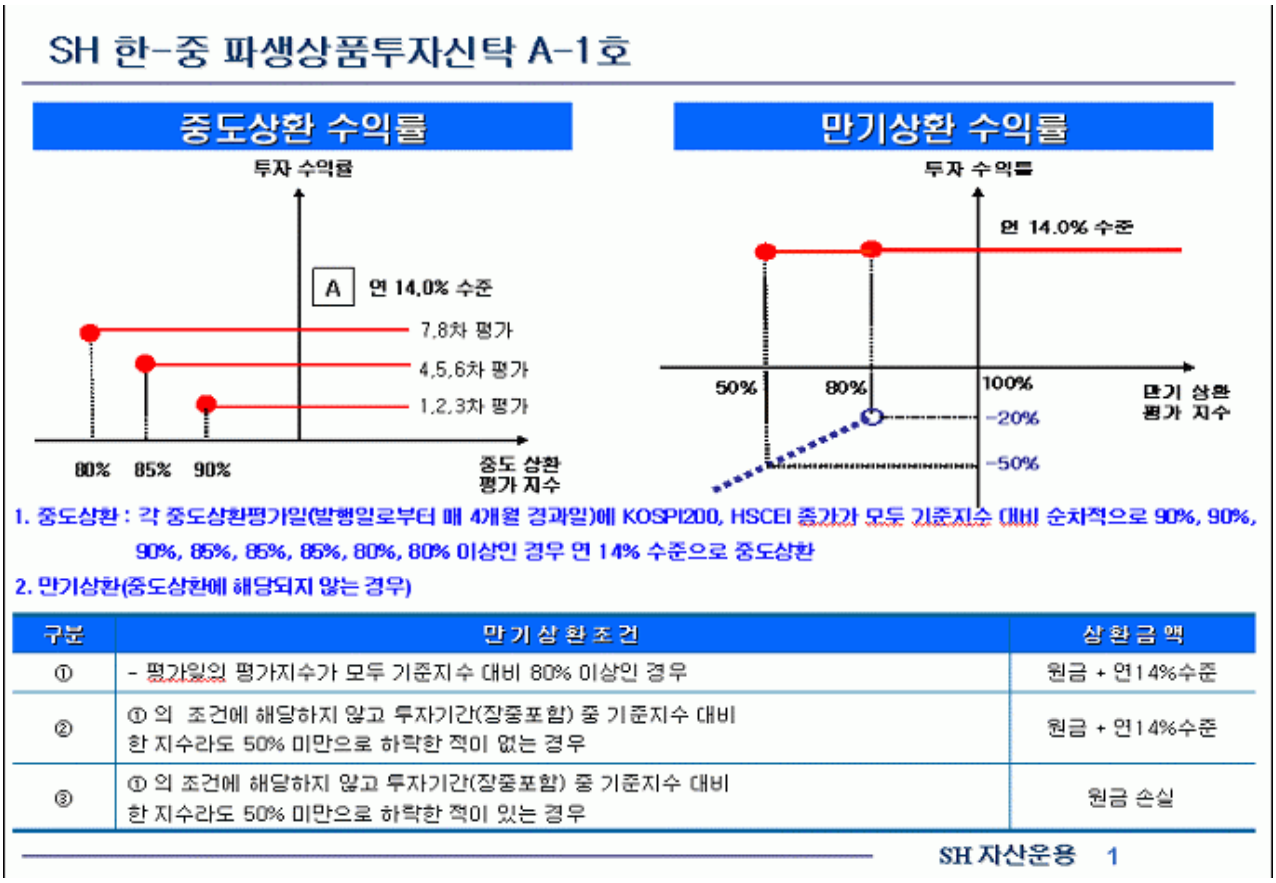
SH한-중파생A-1

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	1,090

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

(단위:백만원)

957

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

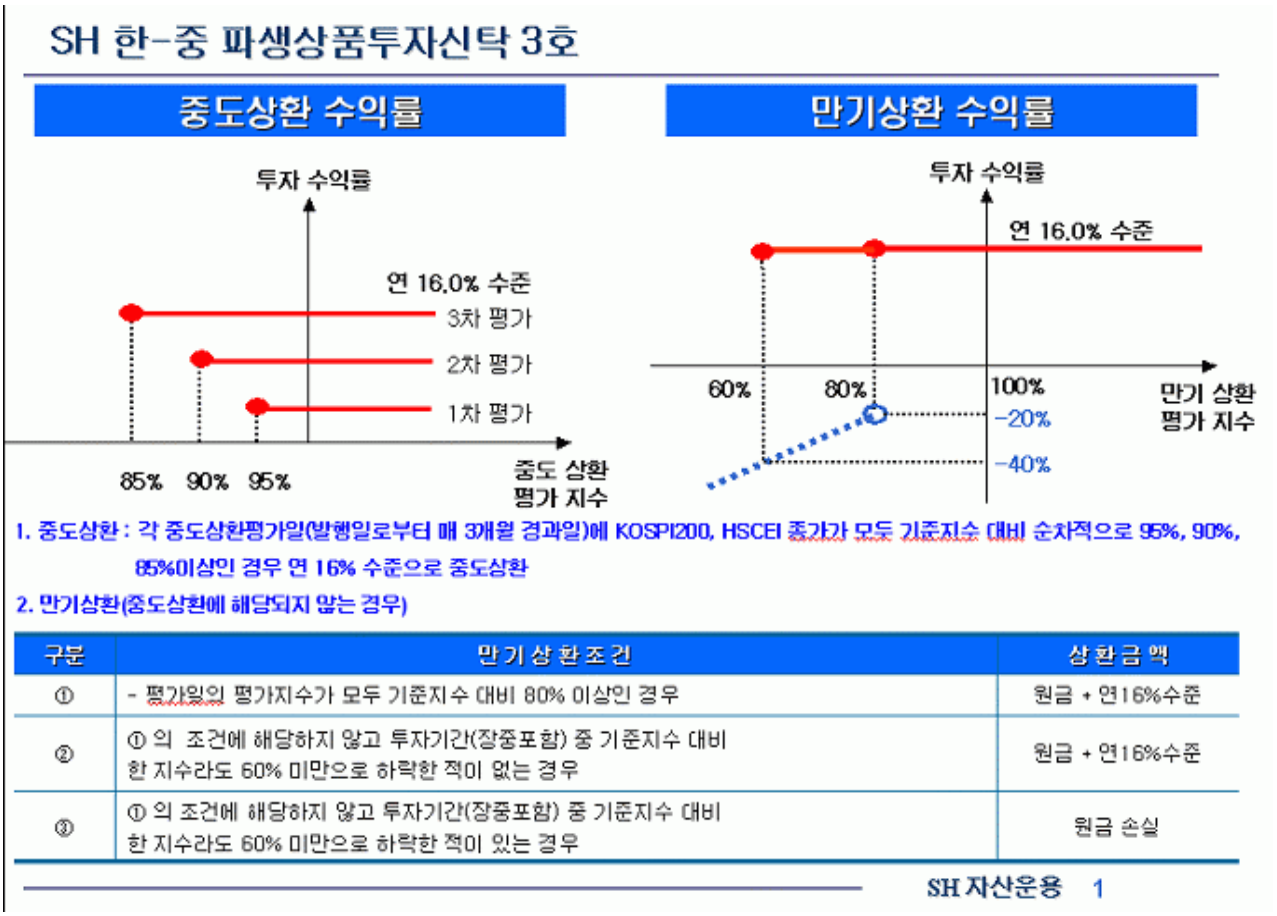
SH한-중파생3

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	8,283	0	8,283	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR6030618V ELS교보206회080611	762

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

(단위:백만원)

639

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

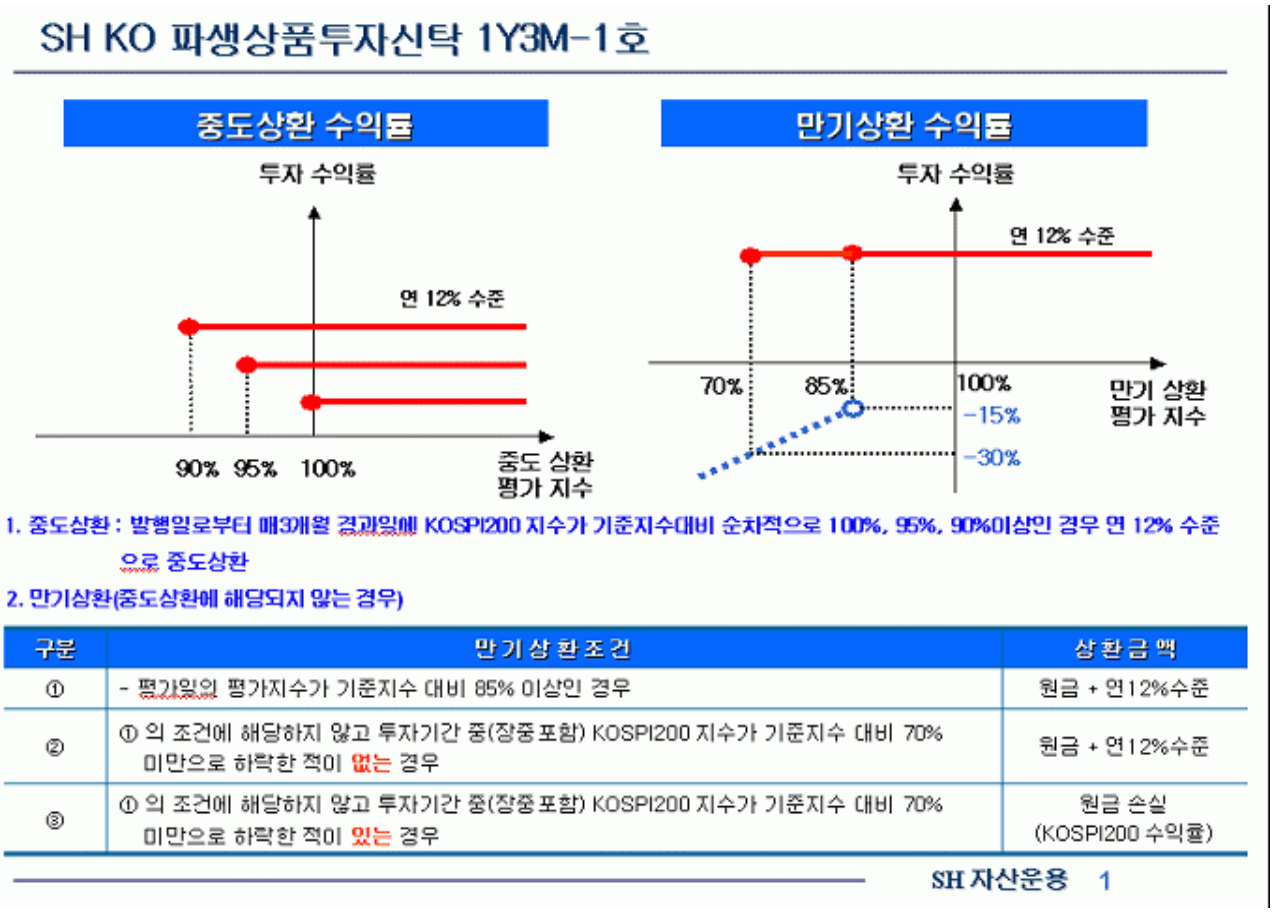
SH KO파생1Y3M-1

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	2,829	0	2,829	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR603762JV1 ELS미래411회080610	233

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

(단위:백만원)

239

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

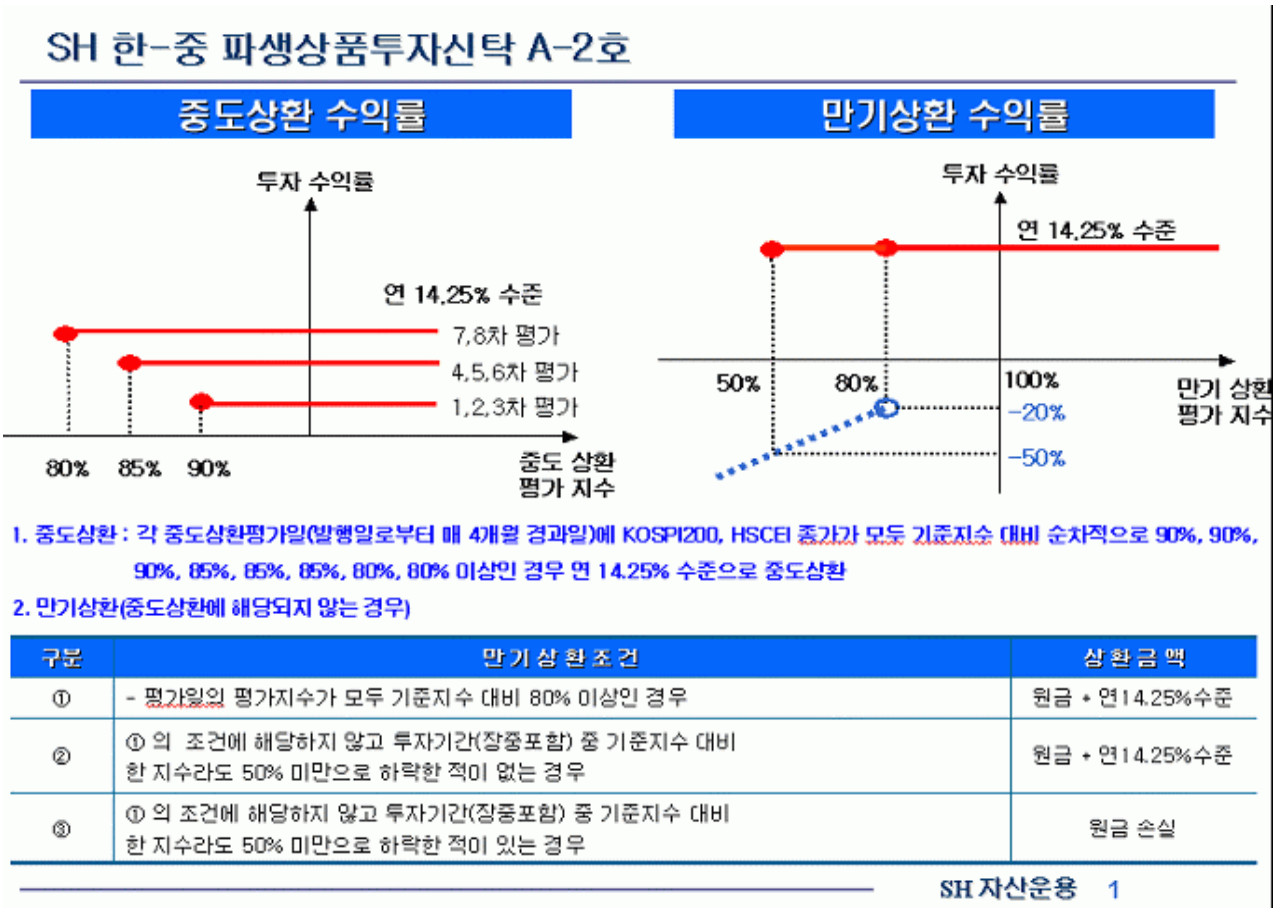
한-중파생A-2

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	13,539	0	13,539	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 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	1,693

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

(단위:백만원)

894

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

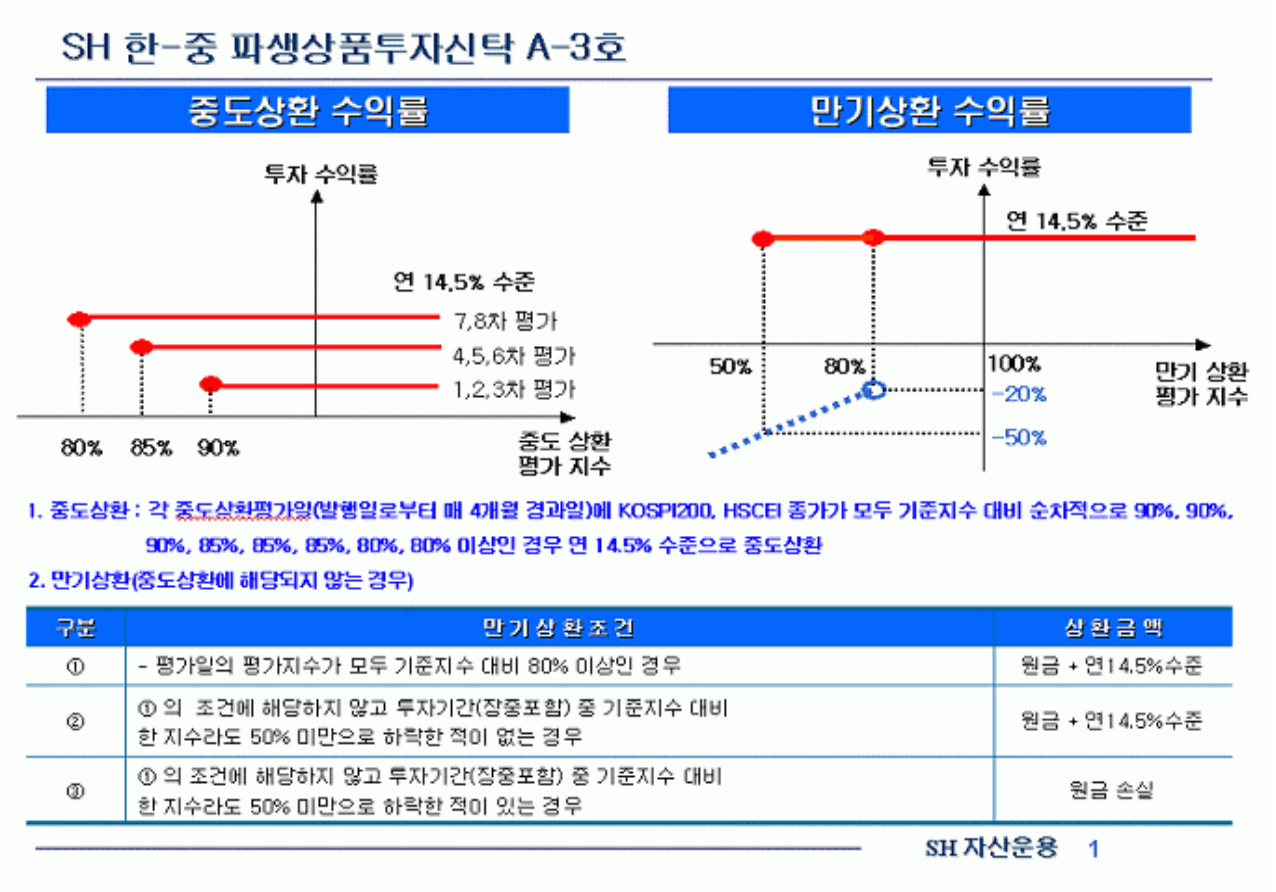
SH한-중파생A-3

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



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 14.5% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

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	2,020

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

(단위:백만원)

1,253

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

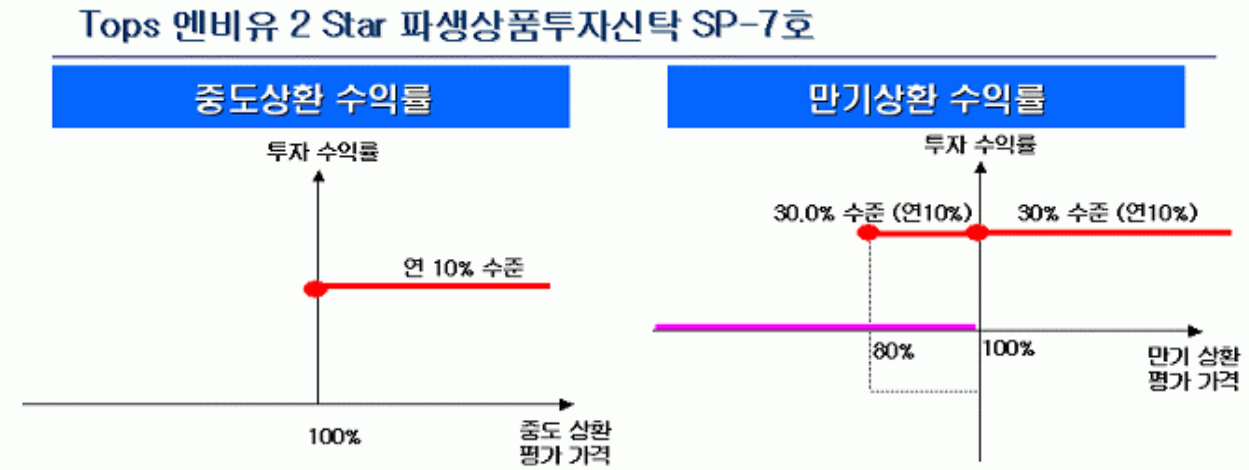
엔비유2Star파생SP-7

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	10,409	0	10,409	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(중도상환에 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 + 30%(연10%)수준

SH 자산운용 2

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR600680CV ELS대우2565회080630	255

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

(단위:백만원)

363

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

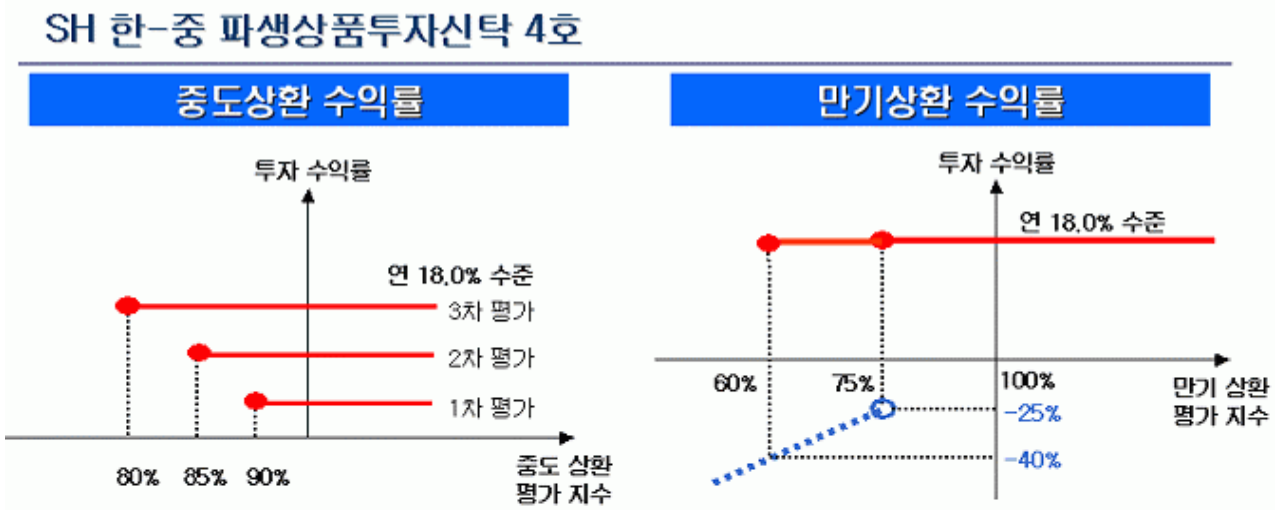
SH한-중파생4호

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	10,394	0	10,394	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

SH 자산운용 1

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR6030612V ELS교보242회080707	1,178

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

(단위:백만원)

769

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

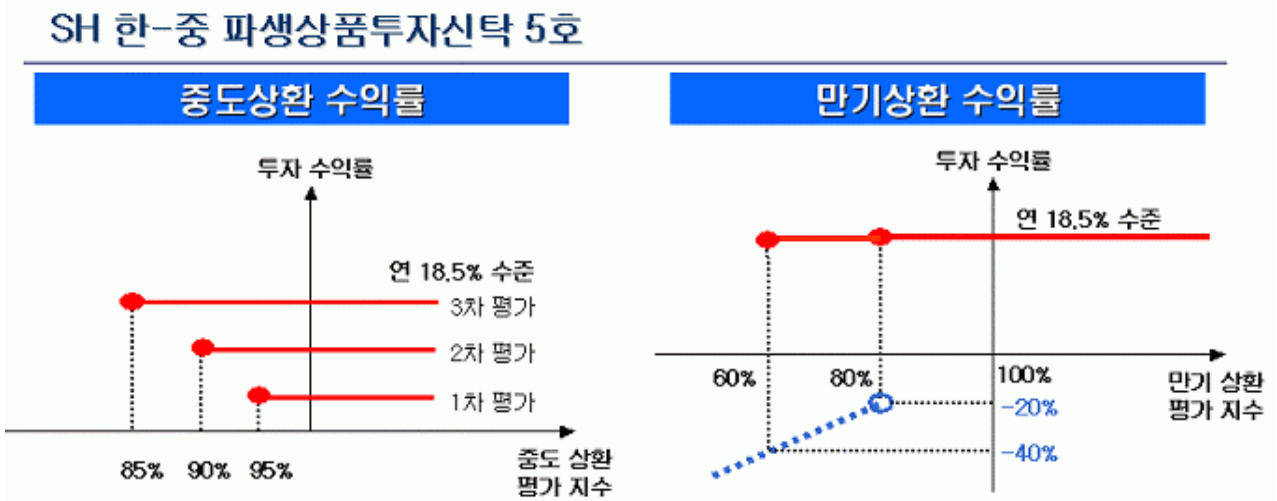
SH한-중파생5호

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	24,723	0	24,723	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

SH 자산운용 1

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR600333AV ELS하나769회080708	2,405

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

(단위:백만원)

1,842

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

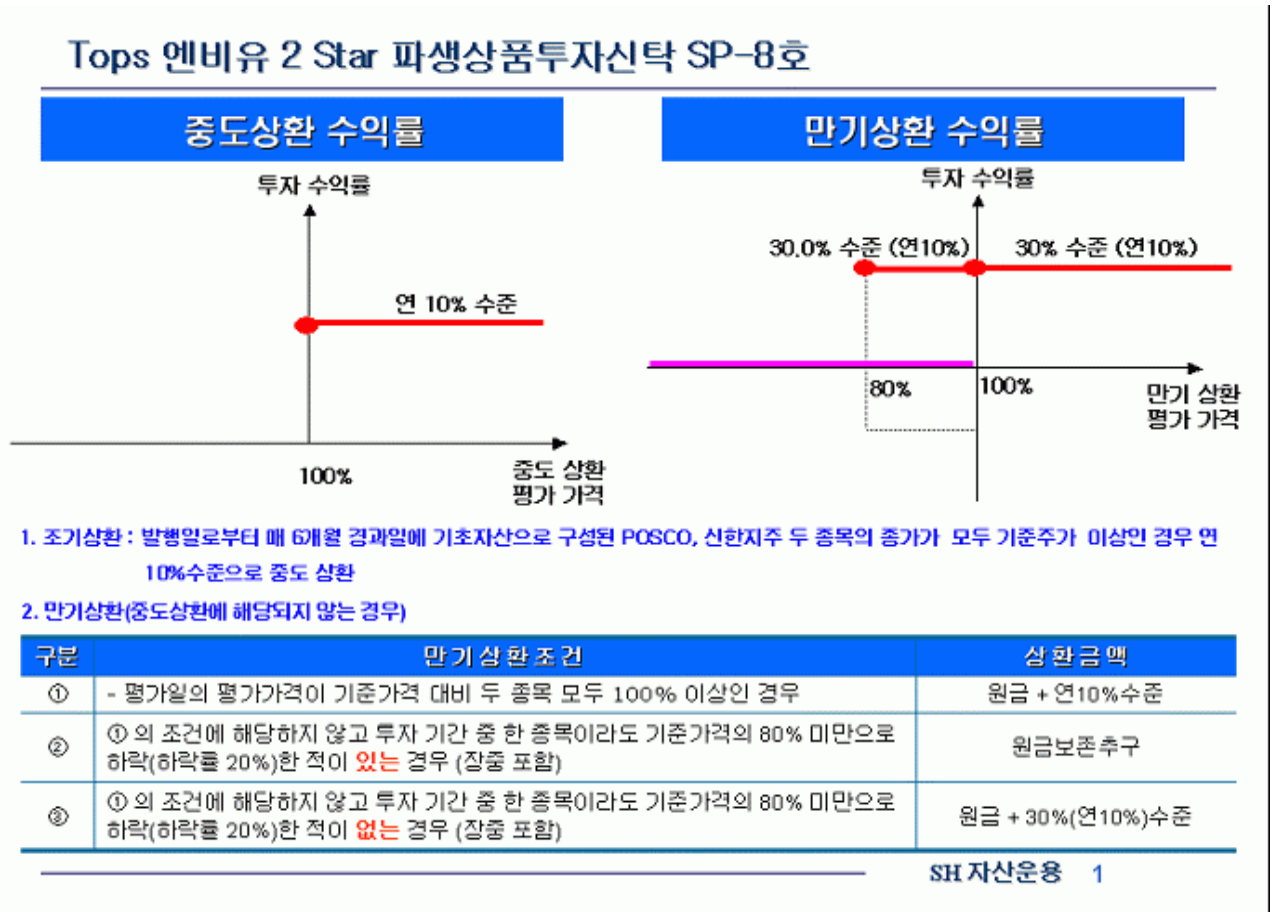
엔비유2Star파생SP-8

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	183

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

(단위:백만원)

317

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

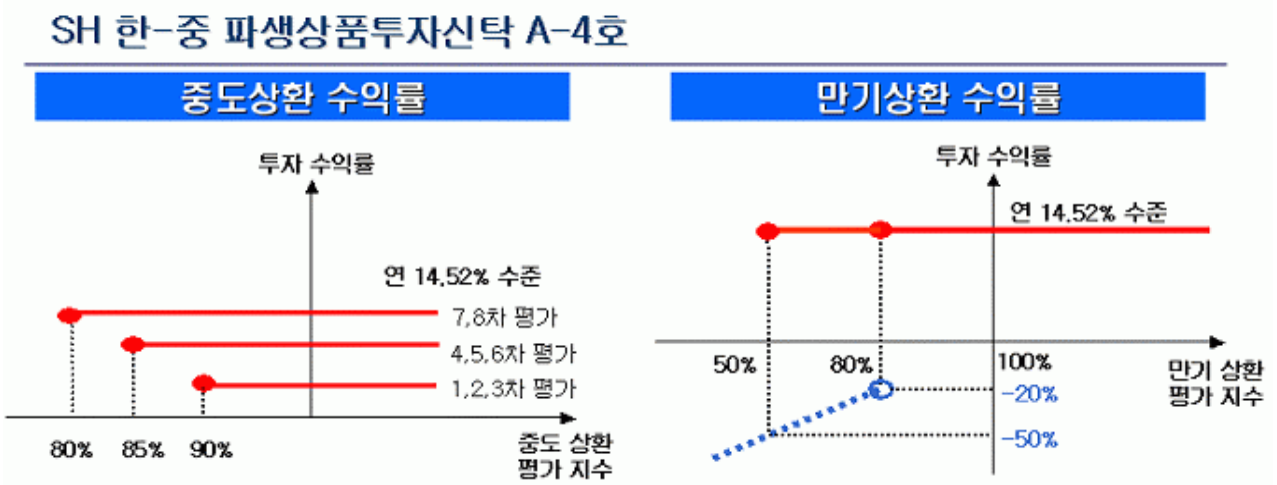
SH한-중파생A-4

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	5,672	0	5,672	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	①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연14.52%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)

KR600345VV ELS현대2008-875회080714	639

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

(단위:백만원)

369

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

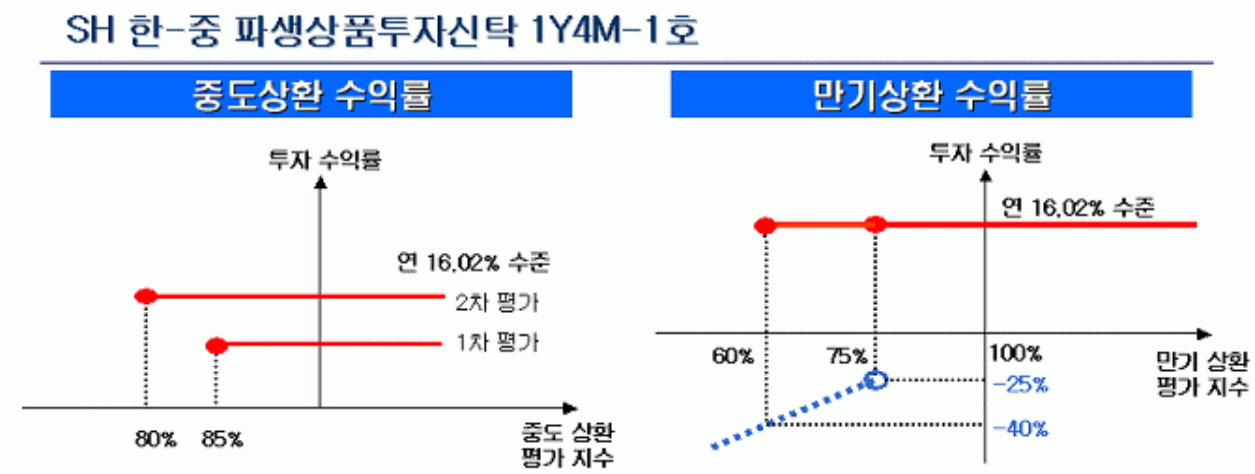
SH한-중파생1Y4M-1

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	247

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

(단위:백만원)

214

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

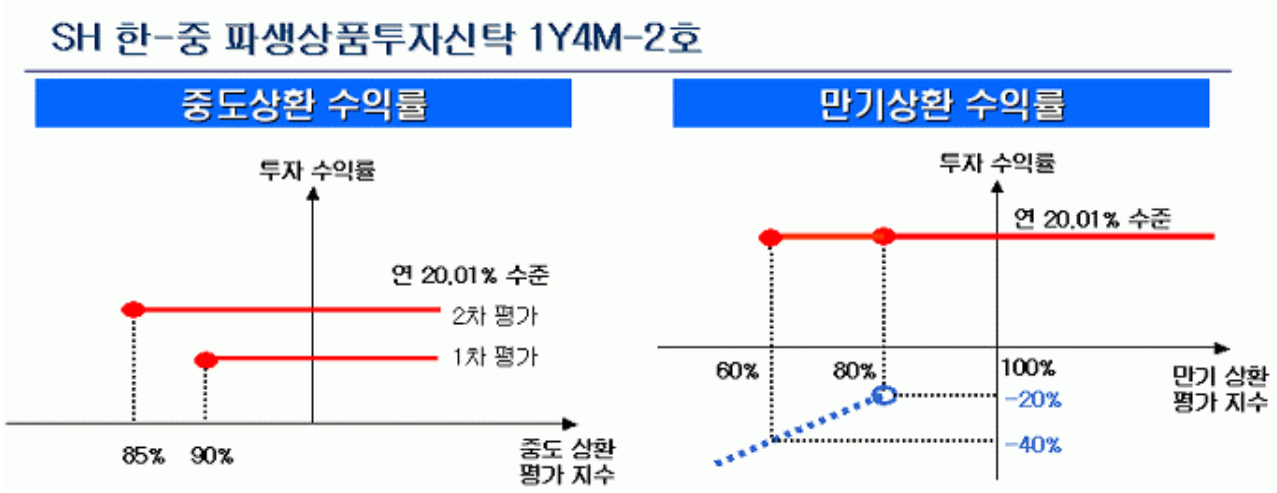
SH한-중파생1Y4M-2

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	13,332	0	13,332	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	1,196

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

(단위:백만원)

878

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

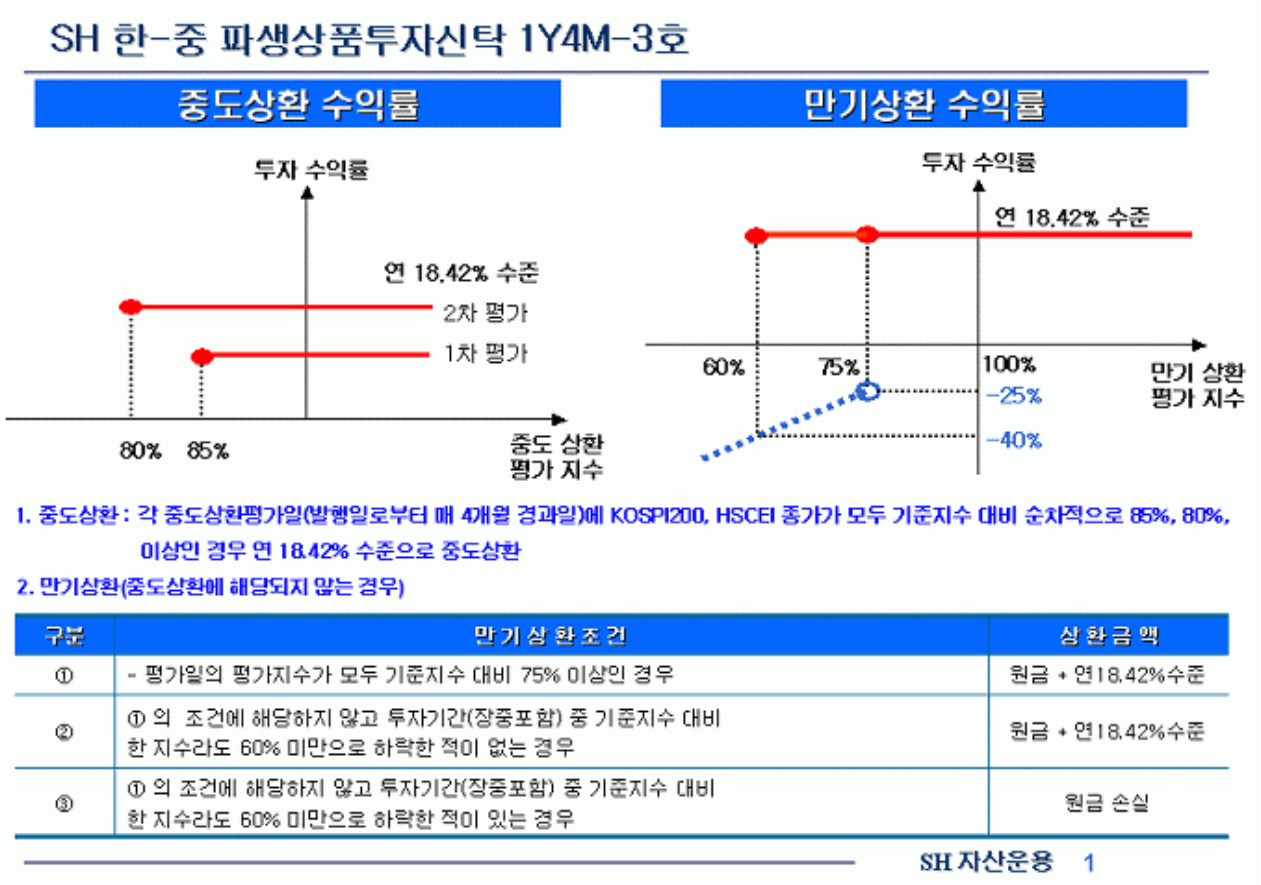
SH한-중파생1Y4M-3

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	2,870	0	2,870	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	268

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

(단위:백만원)

230

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

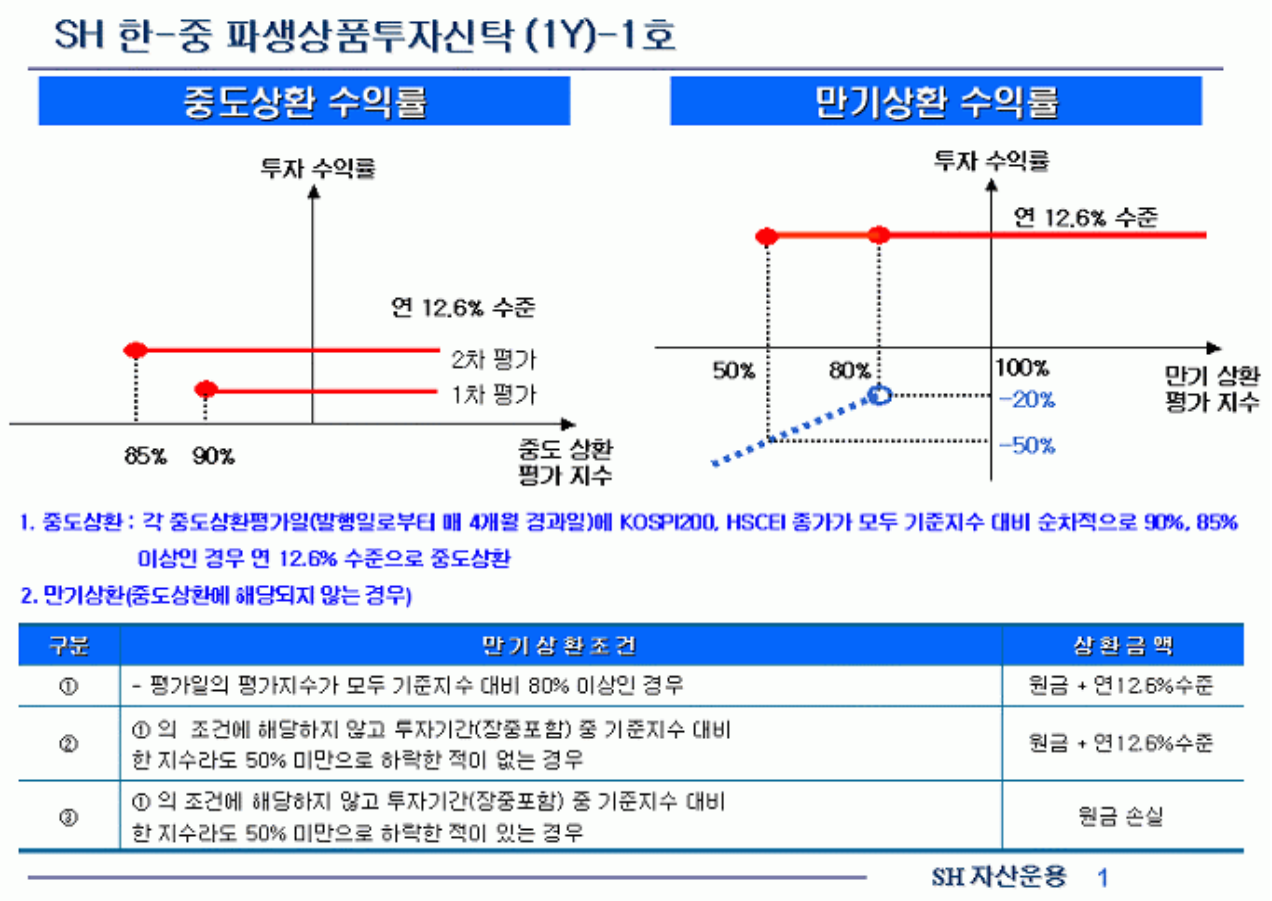
SH한-중파생(1Y)-1

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	160	0	160	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 12.6% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

구분	만기상환조건	상환금액
①	- 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우	원금 + 연12.6%수준
②	① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연12.6%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)

KR6003337V ELS하나803회080808	22

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

(단위:백만원)

10

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

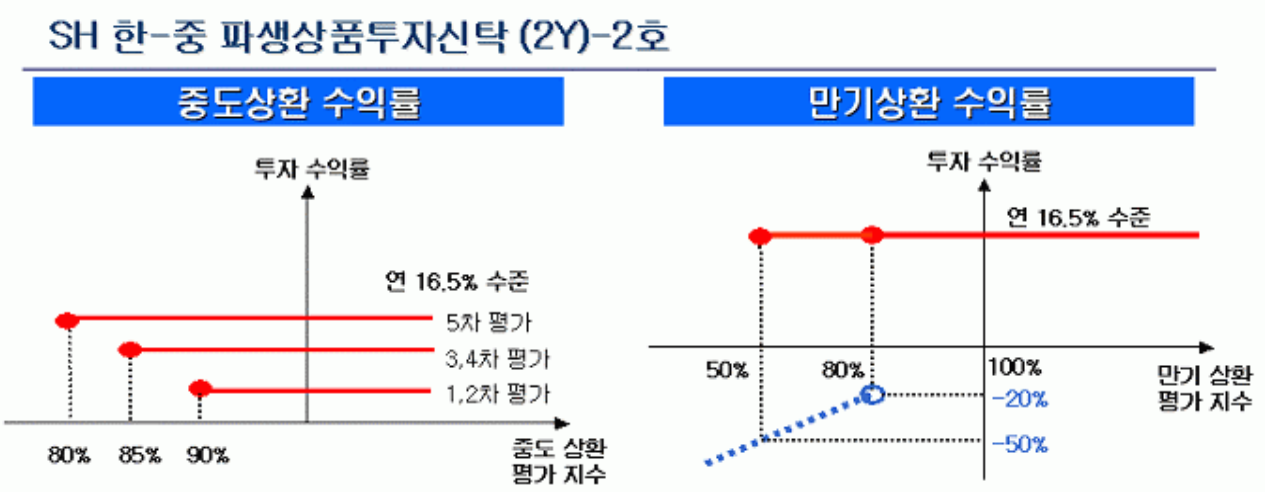
SH한-중파생(2Y)-2

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	23,600	0	23,600	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 85%, 85%, 80% 이상인 경우 연 16.5% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

구분	만기상환조건	상환금액
①	- 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우	원금 + 연16.5%수준
②	①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연16.5%수준
③	①의 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)

KR6003338V ELS하나804회080808	2,585

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

(단위:백만원)

2,013

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

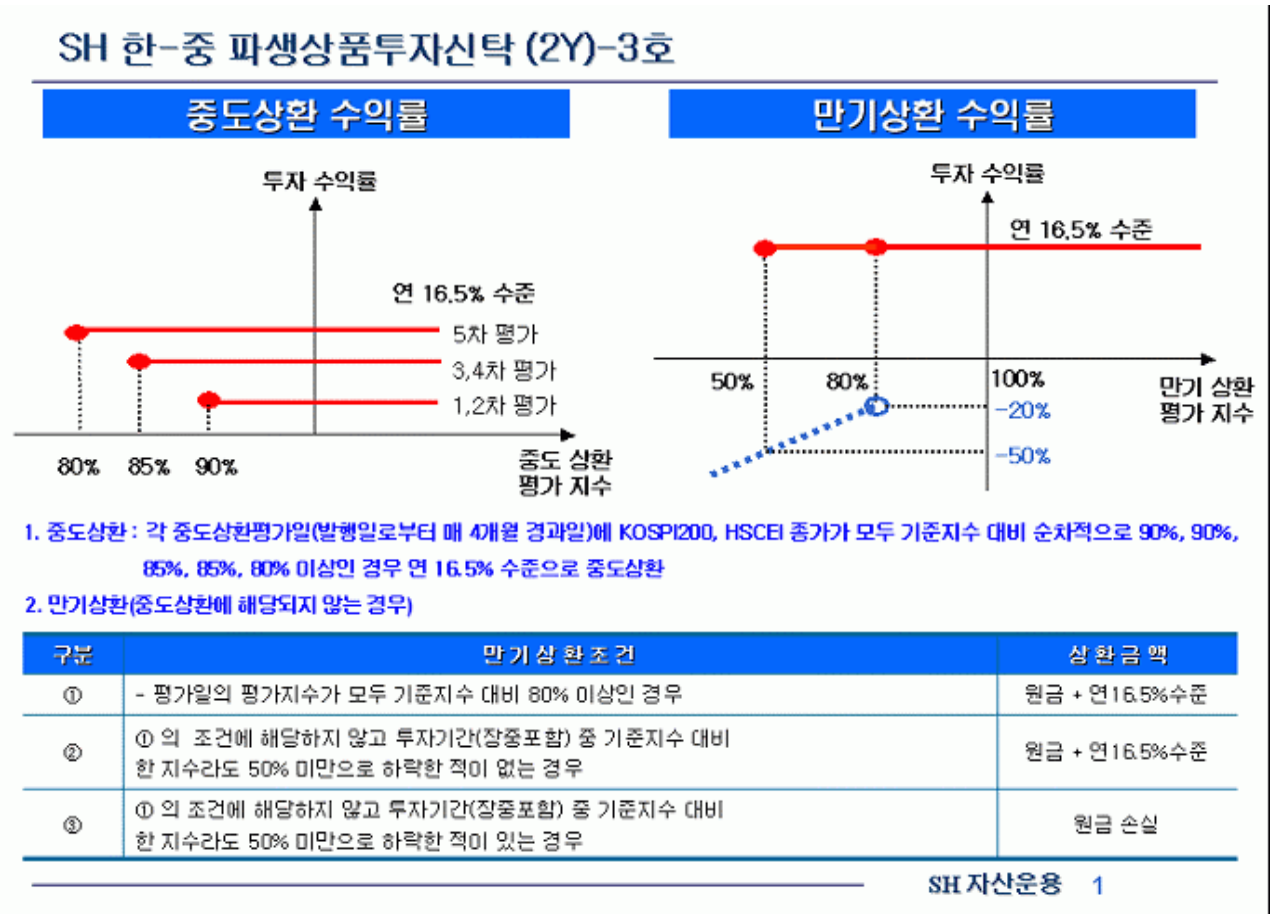
SH한-중파생(2Y)-3

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	49,223	0	49,223	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR600172CV ELS신영1079회080818	6,143

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

(단위:백만원)

3,539

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

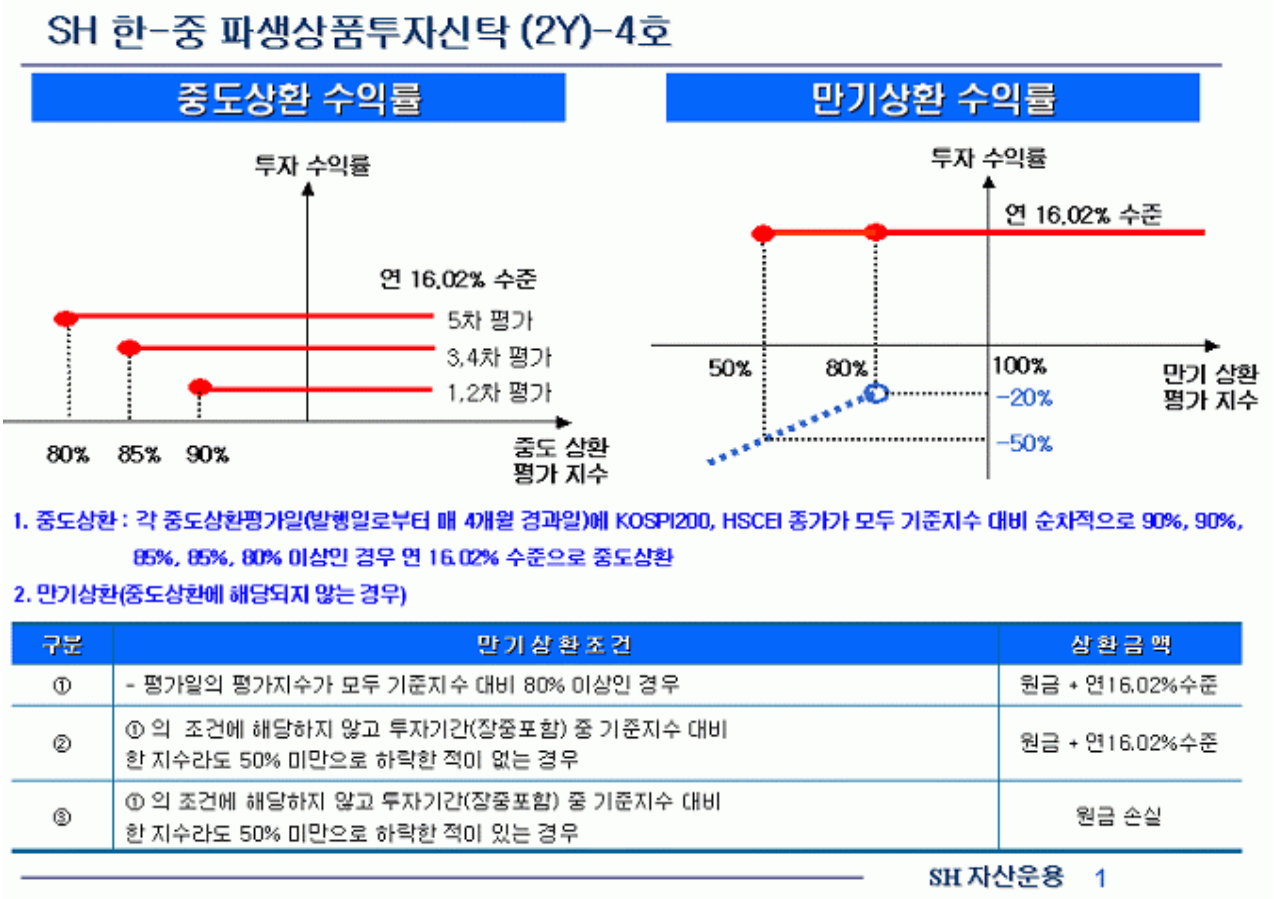
한-중파생(2Y)-4

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	18,553	0	18,553	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 85%, 85%, 80% 이상인 경우 연 16.02% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

구분	만기상환조건	상환금액
①	- 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우	원금 + 연16.02%수준
②	① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연16.02%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)

KR600594PV ELS우리2147회080826	2,144

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

(단위:백만원)

1,172

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

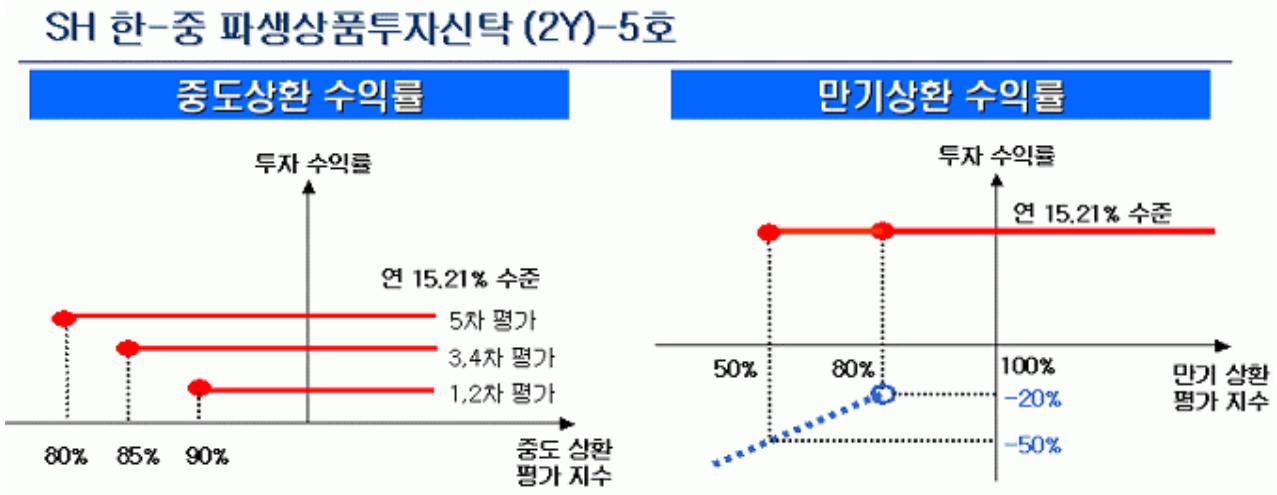
SH한-중파생(2Y)-5호

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	14,017	0	14,017	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 85%, 85%, 80% 이상인 경우 연 15.21% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

구분	만기상환조건	상환금액
①	- 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우	원금 + 연15.21%수준
②	① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연15.21%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)

KR6553330V ELS우리2173회080908	1,545

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

(단위:백만원)

981

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

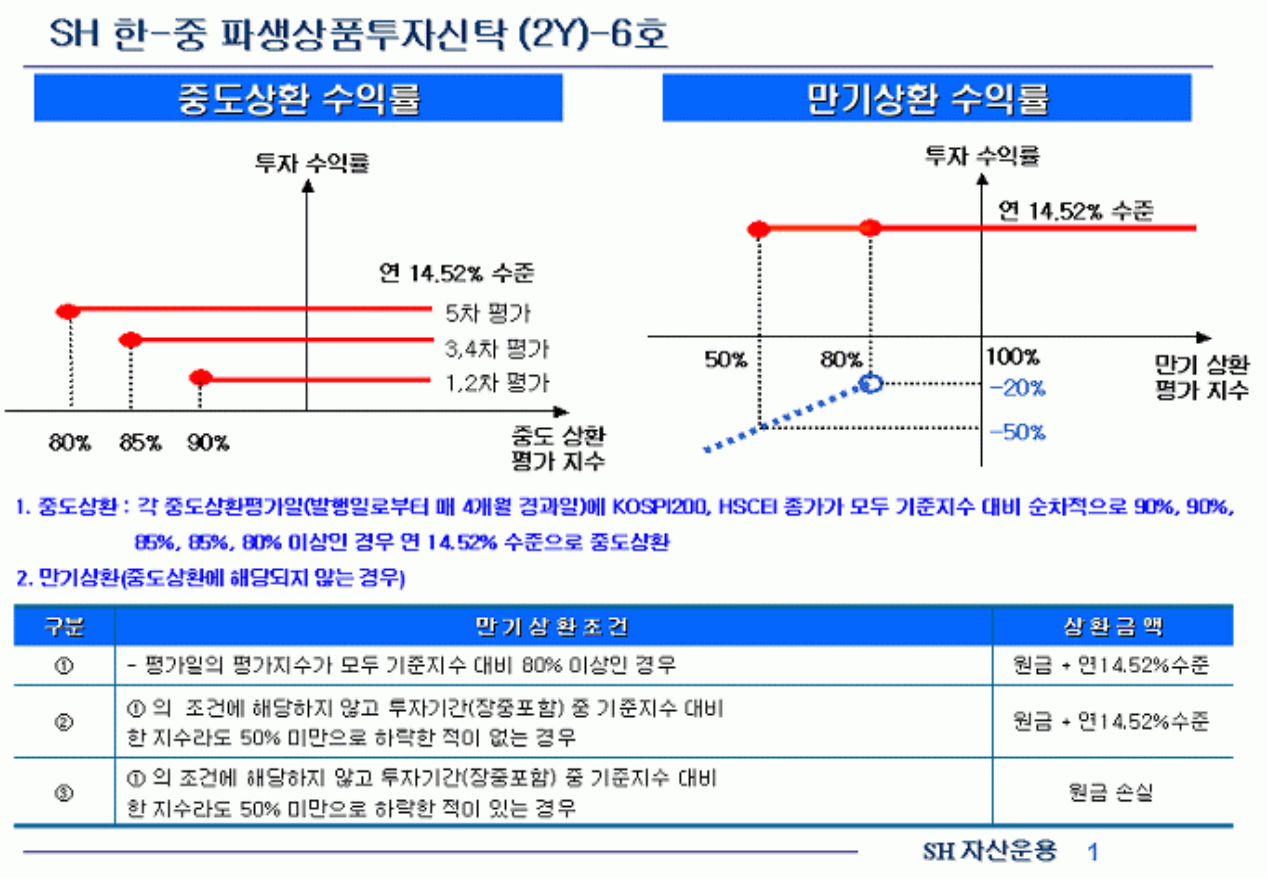
한-중파생(2Y)-6

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	8,155	0	8,155	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 85%, 85%, 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	①의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연14.52%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)

KR6543317V ELS신영1118회080922	950

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

(단위:백만원)

495

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

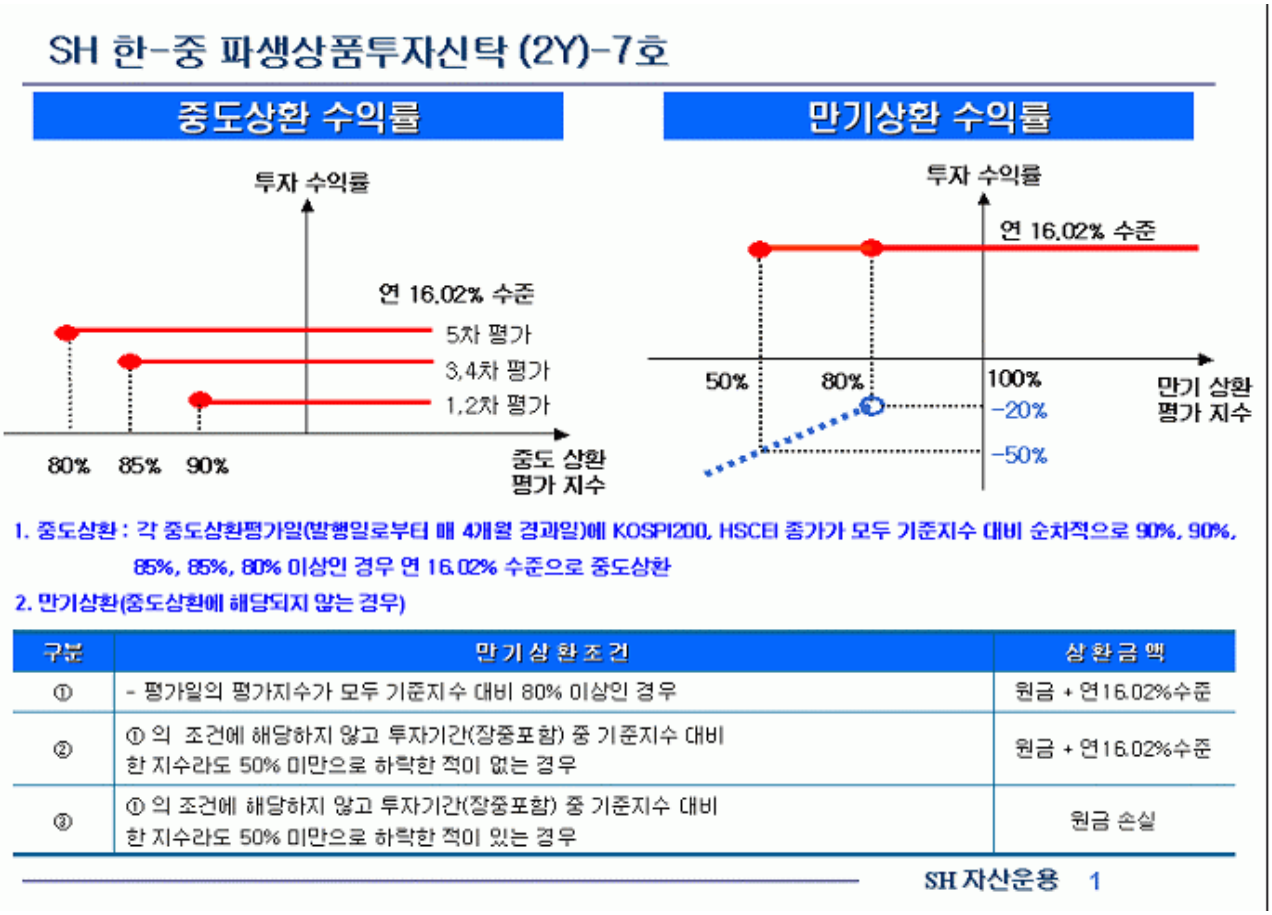
한-중파생(2Y)-7

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	4,288	0	4,288	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 85%, 85%, 80% 이상인 경우 연 16.02% 수준으로 중도상환

2. 만기상환(중도상환에 해당되지 않는 경우)

구분	만기상환조건	상환금액
①	- 평가일의 평가지수가 모두 기준지수 대비 80% 이상인 경우	원금 + 연16.02%수준
②	① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연16.02%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)

KR6583340V ELS현대2008-948회080929	515

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

(단위:백만원)

277

공시일	2008-10-15
기준일	2008-10-14

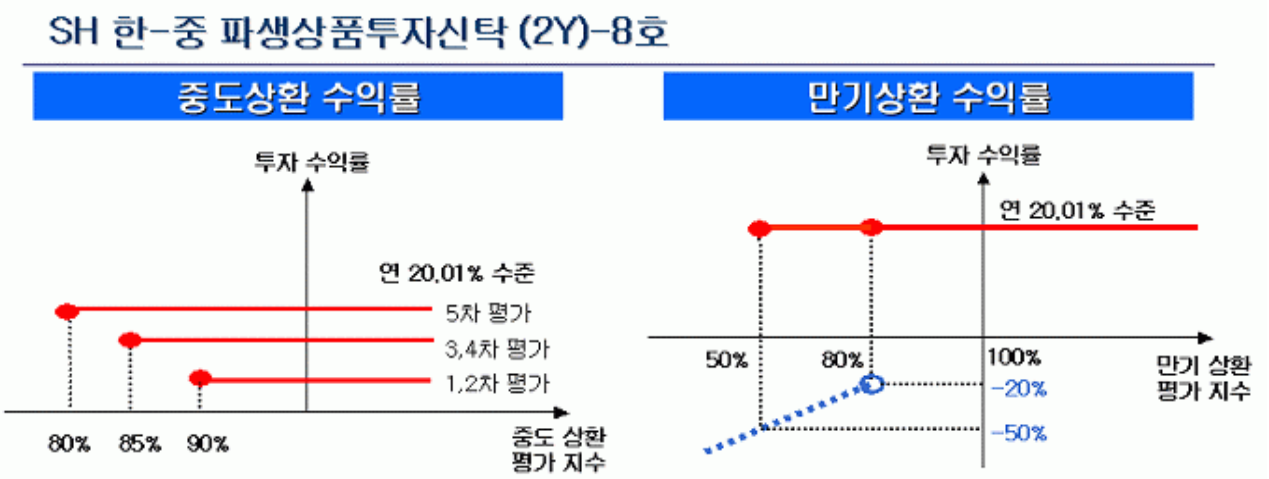
한-중파생(2Y)-8

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	3,024	0	3,024	장외

2. 만기시점의 손익구조



1. 중도상환 : 각 중도상환평가일(발행일로부터 매 4개월 경과일)에 KOSPI200, HSCEI 종가가 모두 기준지수 대비 순차적으로 90%, 90%, 85%, 85%, 80% 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 50% 미만으로 하락한 적이 없는 경우	원금 + 연20.01%수준
③	① 의 조건에 해당하지 않고 투자기간(장중포함) 중 기준지수 대비 한 지수라도 50% 미만으로 하락한 적이 있는 경우	원금 손실

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR6513307V ELS대신718회081013	297

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

(단위:백만원)

108