간접투자자산운용업감독규정 제 84조에의한 파생상품간접투자기구의 위험 지표 공

◑ 공시일: 2008-07-07

펀드명 : 신한니케이피닉스파생상품투자신탁제1호

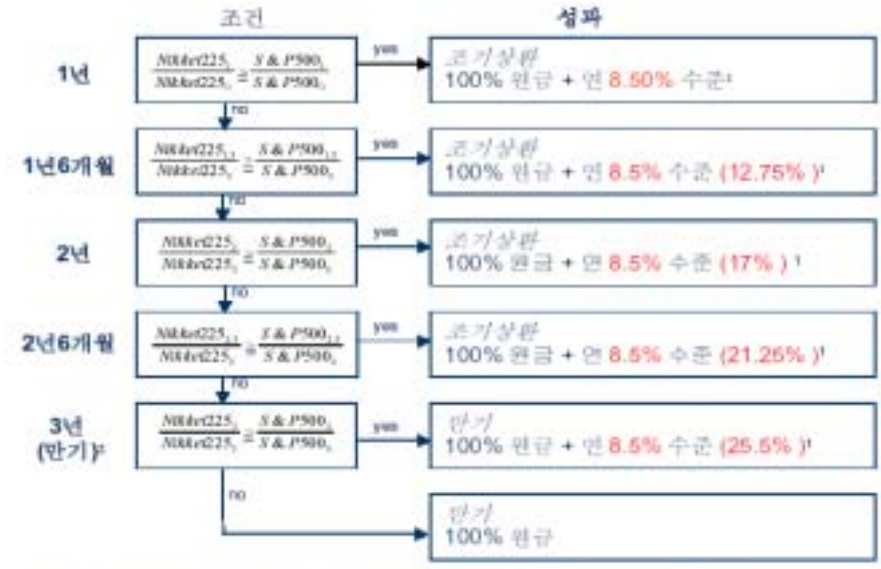
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	8,826		8,826	장외
합계			8,826		8,826	장외

2. 파생상품 거래에따른 만기 손익구조

(1) 기준주가 : 니케이225, S&P500
(2) 설정일 : 2006년 3월 13일
(3) 만기일 : 2009년 3월 13일
(4) 최초기준지수 : 2006년 3월 15일의 니케이225, S&P500의 지수
(5) 지수결정일 : 2007년 3월 13일, 2007년 9월 6일, 2008년 3월 6일, 2008년 9월 5일, 2009년 3월 6일
(6) 최종기준지수 : 2009년 3월 6일의 니케이225, S&P500의 지수



1. 신용위험, 거래상대방위험, 환율변동위험 및 재정정책에 의해서 영향을 받을 수 있음.
2. 만기한 경외 파생상품의 만기를 의미함.

3.시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

신한니케이피닉스파생상품투자신탁제1호	278

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

신한니케이피닉스파생상품투자신탁제1호	71

펀드명 : 신한니케이피닉스파생상품투자신탁제2호

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	3,837		3,837	장외
합계			3,837		3,837	장외

2. 파생상품 거래에따른 만기 손익구조

(1) 기준주가 : 니케이225, S&P500

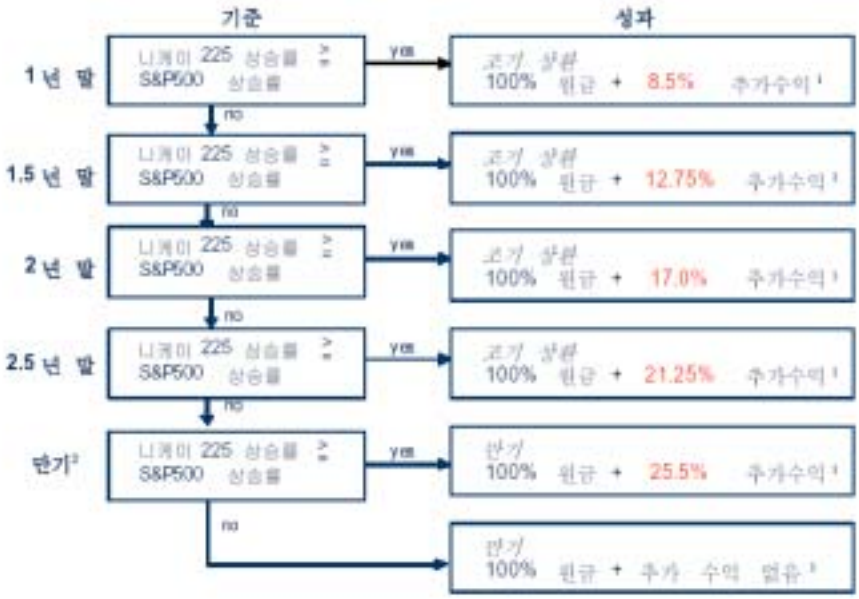
(2) 설정일 : 2006년 3월 27일

(3) 만기일 : 2009년 3월 19일

(4) 최초기준주가 : 2006년 3월 29일의 니케이225, S&P500의 지수

(5) 지수결정일 : 2007년 3월 20일, 2007년 9월 14일, 2008년 3월 18일, 2008년 9월 18일, 2009년 3월 19일

(6) 최종기준지수 : 2009년 3월 19일의 니케이225, S&P500의 지수



3.시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

신한니케이피닉스파생상품투자신탁제2호	117

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

신한니케이피닉스파생상품투자신탁제2호	27

펀드명 : 신한 BNPP뉴투스타 파생상품투자신탁 제3호

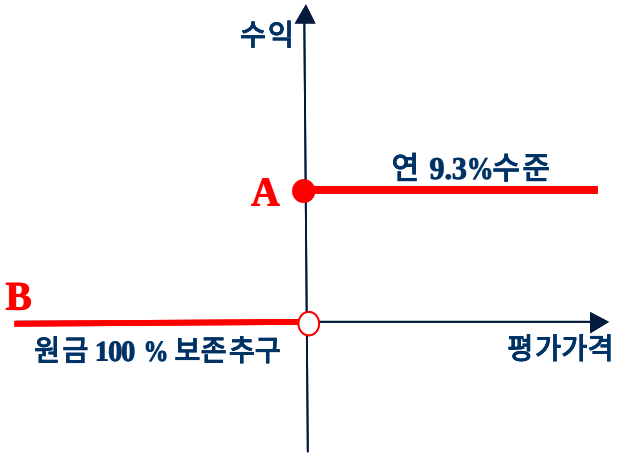
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	ELS				장외
누계	주식	ELS	5,131		5,131	장외
합계			5,131		5,131	장외

2. 파생상품 거래에따른 만기 손익구조

(1) 기초자산 : 하이닉스 보통주와 KT&G 보통주
(2) 발행일 : 2006년10월 11일
(3) 만기일 : 2009년 9월 28일
(4) 최초기준가격 : 2006년 9월 23일의 하이닉스 보통주와 KT&G 보통주 종가
(5) 중간평가일 : 2007년 3월 29일, 2007년 9월 28일, 2008년 3월 28일, 2008년 9월 29일, 2009년 3월 27일
(6) 최종기준가격 : 2009년 9월 23일의 하이닉스 보통주와 KT&G 보통주의 종가



3.시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

신한 BNPP뉴투스타 파생상품투자신탁 제3호	144

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

신한 BNPP뉴투스타 파생상품투자신탁 제3호	206