**간접투자자산운용업감독규정 제 84조에의한 파생상품간접투자기구의 위험 지표 공시**

◑ 공시일: 2008-07-24

**펀드명 : 신한니케이피닉스파생상품투자신탁제1호**

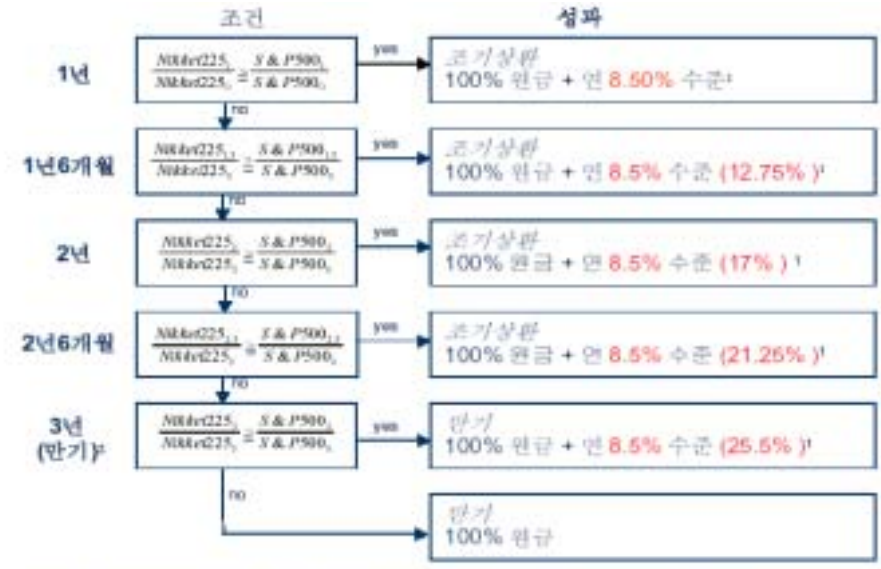
## 1. 계약금액

(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 경우 파생상품의 만기를 의미함.

## 3.시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

| | |
|---|---|
| 신한니케이피닉스파생상품투자신탁제1호 | 279 |

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|---|---|
| 신한니케이피닉스파생상품투자신탁제1호 | 74 |

**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

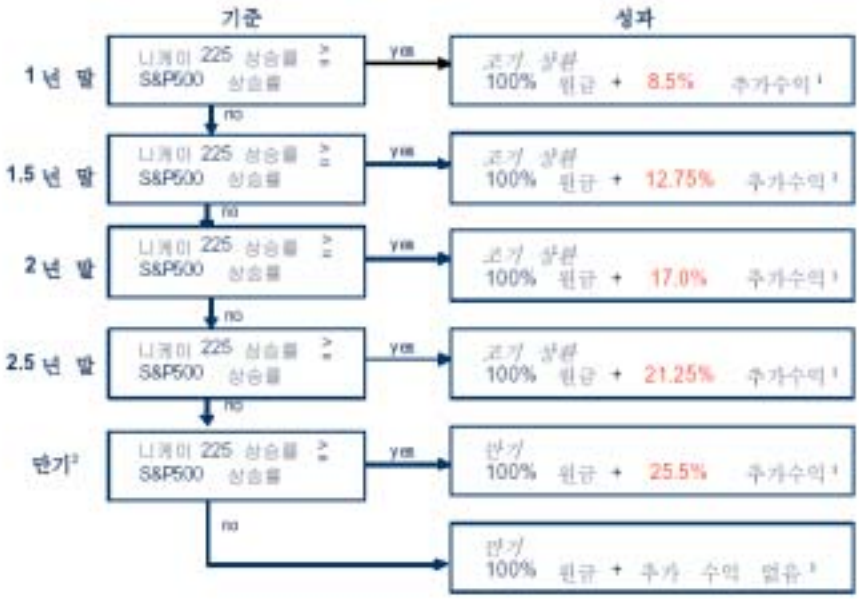
(2) 설정일 : 2006년 3월 27일

(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 | 28 |

**펀드명 : 신한 BNPP뉴투스타 파생상품투자신탁 제3호**

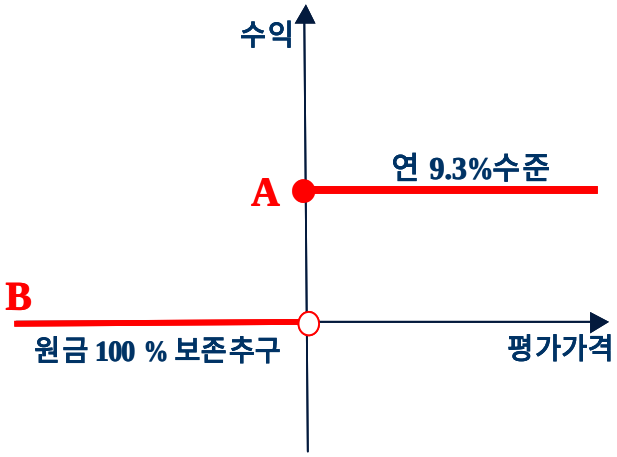
## 1. 계약금액

(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 | 119 |

## 4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|---|---|
| 신한 BNPP뉴투스타 파생상품투자신탁 제3호 | 251 |