

금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙<별지 제67호>에 따라 고난도 집합투자증권 지정과 관련한 파생상품 위험평가액 산정시 일

1. 계산방법 : 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙 <별지 제67호> 제2-1조 2호, 제3-1조 및 제4-1조에 의하여 계산

2. 집합투자지구명 : 신한에쿼티알파일반사모혼합자산

3. 고난도 집합투자증권 산정관련 파생상품 위험평가액(2022.03.25기준)

1) 파생상품종류	주가지수선물, 개별주식선물
2) 종목명	2022-06 코스피200, 2022-04 현대차개별선물
3) 포지션	매도, 매도
4) 파생상품 위험평가액*	0
5) NAV	11,924,017,654
6) 파생위험평가액/NAV	0%

4. 기타 : 2022.03.25 매매없음***

* 이 공시는 고난도 금융투자상품에서 제외되는 파생상품관련이며, 자본시장법 및 규약등에서 제한하는 파생상품 위험평가액과는 다를수 있음

** 월물변경에 따른 파생상품 만기 연장시 매매없음으로 표현

*** 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙 <별지제 67호> 제3-1조에 따라 위험평가액 산정에서 제외(공시대상 아님)되는 파생상품(현물과 동일한 실질을 갖는 스왑거래) 거래 발

*** 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙 <별지제 67호> 제3-1조에 따라 위험평가액 산정에서 제외(공시대상 아님)되는 파생상품(개별주식선물) 거래 발생(2022.03.25)

정거래를 제외하는 집합투자기구의 파생상품 위험평가액을 다음과 같이 공시합니다

생(2022.03.22)후 보유지속