

금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙<별지 제67호>에 따라 고난도 집합투자증권 지정과 관련한 파생상품 위험평가액 산정시 일정거래를 제외하는 집합투자기구의 파생상품 위험평가액을 다음과

1. 계산방법 : 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙 <별지 제67호> 제2-1조 2호, 제3-1조 및 제4-1조에 의하여 계산
2. 집합투자기구명 : 신한에쿼티알파일반사모혼합자산
3. 고난도 집합투자증권 산정관련 파생상품 위험평가액(2023.01.11기준)

1) 파생상품종류	개별주식선물			
2) 종목명	2023-01 LG전자개별선물	2023-02 삼성전자개별선물	2023-01 LG이노텍개별선물	2023-02 LG이노텍개별선물
	2023-01 카카오페이개별선물	2023-01 KB금융개별선물	2023-01 포스코케미칼개별선물	2023-01 NAVER개별선물
3) 포지션	매도			
4) 파생상품 위험평가액*	0			
5) NAV	14,868,121,387			
6) 파생위험평가액/NAV**	0%			

4. 기타 : 2023-02 삼성전자(매수포지션)추가매수, 2023-03 코스피200지수선물(매도포지션) 청산

* 이 공시는 고난도 금융투자상품에서 제외되는 파생상품관련이며, 자본시장법 및 집합투자규약등에서 제한하는 파생상품 위험평가액과는 다를수 있음(별표**참조)

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 발생후 보유지속

** 현재, 자본시장법 및 집합투자규약 관련 파생상품 위험평가액 비율은 약 13.19%입니다.