

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

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(2023.09.12기준)

1) 파생상품종류	주식스왑	개별주식선물		주가지수선물
2) 종목명	SK스퀘어_주식스왑3	2023-09 삼성전자개별선물	2023-09 셀트리온개별선물	2023-09 코스피200지수선물
			2023-10 포스코DX개별선물	
			2023-09 기아개별선물	
		2023-08 SK하이닉스개별선물	2023-09 현대차개별선물	2023-09 코스닥150선물
			2023-09 신한지주개별선물	
			2023-09 포스코DX개별선물	
2023-09 LG화학개별선물				
3) 포지션		매수	매도	
4) 파생상품 위험평가액*		1,155,880		
5) NAV		16,022,621,407		
6) 파생위험평가액/NAV**		0.001%		

4. 기타 : 2023-09 포스코DX개별선물(매도포지션) 추가매수

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

** 현재, 자본시장법 및 집합투자규약 관련 파생상품 위험평가액 비율은 약 23.45% 입니다.