

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(2023.09.27기준)

1) 파생상품종류	개별주식선물		주식스왑	주가지수선물
2) 종목명	2023-10 삼성전자개별선물	2023-10 셀트리온개별선물	에코프로	2023-12 코스피200지수선물
		2023-10 포스코DX개별선물		
	2023-10 SK하이닉스개별선물	2023-10 LG에너지솔루션개별선물	S-Oil	2023-12 코스닥150선물
		2023-10 KB금융개별선물		
3) 포지션	매수	매도		
4) 파생상품 위험평가액*	191,969,408			
5) NAV	14,300,285,593			
6) 파생위험평가액/NAV**	1.342%			

4. 기타 2023-12 코스닥150선물(매도포지션) / 2023-10 삼성전자개별선물(매수포지션) 일부 청산, 2023-10 POSCO홀딩스개별선물(매도포지션) / 2023-10 LG화학개별선물(매도포지션) 청산

\* 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 36.31% 입니다.