

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(2023.12.11기준)

1) 파생상품종류			주가지수선물
2) 종목명	2023-12 삼성전자개별선물 (매도)	2023-12 JYP Ent.개별선물 (매도)	2023-12 코스피200지수선물
	2023-12 현대모비스개별선물 (매도)	2023-12 동진세미캠개별선물 (매도)	
	2023-12 삼성전기개별선물 (매도)	2023-12 DL이앤씨개별선물 (매도)	
	2023-12 하나금융지주개별선물 (매도)	2023-12 에코프로비엠개별선물 (매도)	
	2023-12 SK이노베이션개별선물 (매도)	2023-12 LG에너지솔루션개별선물 (매도)	
	2023-12 SK하이닉스개별선물 (매도)	2023-12 크래프톤개별선물 (매도)	
	2023-12 하이트진로개별선물 (매도)	2023-12 SK아이이테크놀로지개별선물 (매도)	
	2023-12 삼성에스디에스개별선물 (매도)	2023-12 하이브개별선물 (매도)	
	2023-12 셀트리온개별선물 (매수)	2023-12 오리온개별선물 (매도)	
	2023-12 LIG넥스원개별선물 (매도)	2023-12 엘앤에프개별선물 (매도)	
	2023-12 넷마블개별선물 (매도)	2023-12 LS개별선물 (매도)	
	2023-12 셀트리온헬스케어개별선물 (매도)	2023-12 한솔케미칼개별선물 (매도)	
	2023-12 포스코퓨처엠개별선물 (매도)		
	2023-12 한올바이오파마개별선물 (매도)	2023-12 이오테크닉스개별선물 (매도)	
3) 포지션	매도		
4) 파생상품 위험평가액*	0		
5) NAV	13,923,240,058		
6) 파생위험평가액/NAV**	0%		

4. 기타 : 2023-12 코스피200지수선물 매도포지션 일부 청산, 2023-12 에코프로비엠개별선물 매도포지션 추가매수

2023-12 포스코DX개별선물, 2023-12 와이엔터테인먼트개별선물 / 매도포지션지션 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 19.41% 입니다.