

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(2024.01.11기준)

| 1) 파생상품종류 | 개별주식선물 | 주가지수선물 |
|------------------|----------------------------|--------------------|
| 2) 종목명 | 2024-02 삼성SDI개별선물 (매도) | 2024-03 코스피200지수선물 |
| | 2024-02 한화에어로스페이스개별선물 (매도) | |
| | 2024-02 한화솔루션개별선물 (매도) | |
| | 2024-02 LIG넥스원개별선물 (매도) | |
| | 2024-02 LG에너지솔루션개별선물 (매도) | |
| 3) 포지션 | 매도 | |
| 4) 파생상품 위험평가액* | 0 | |
| 5) NAV | 4,149,967,118 | |
| 6) 파생위험평가액/NAV** | 0% | |

4. 기타 : 2024-03 코스피200지수선물 (매도), 2024-02 LG에너지솔루션개별선물 (매도) / 일부청산

2024-01 포스코DX개별선물 (매도), 2024-01 셀트리온개별선물 (매도), 2024-01 LIG넥스원개별선물 (매도), 2024-01 코스맥스개별선물 (매수), 2024-01 HDC현대산업개발개별선물 (매도), 2024-01 JYP Ent.개별선물 (매도), 2024-01 SK아이이테크놀로지개별선물 (매도), 2024-01 메리츠금융지주개별선물 (매수), 2024-01 한솔케미칼개별선물 (매도) / 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 8.65% 입니다.