

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(2024.03.27기준)

1) 파생상품종류		개별주식선물		주가지수선물
2) 종목명	2024-04 레고캠바이오개별선물 (매수)	2024-04 에스엠개별선물 (매도)	2024-04 HD한국조선해양개별선물 (매도)	2024-06 코스피200지수선물 (매도)
		2024-04 현대건설개별선물 (매도)	2024-04 넷마블개별선물 (매도)	
		2024-04 현대미포조선개별선물 (매도)	2024-04 에코프로비엠개별선물 (매도)	
		2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물 (매도)	2024-04 하이브개별선물 (매도)	
		2024-04 카카오개별선물 (매도)	2024-04 한화오션개별선물 (매도)	
		2024-04 SKC개별선물 (매도)	2024-04 아모레퍼시픽개별선물 (매도)	
3) 포지션	매수	매도		
4) 파생상품 위험평가액*	0			
5) NAV	2,685,500,633			
6) 파생위험평가액/NAV**	0%			

4. 기타 :2024-04 삼성엔지니어링개별선물 (매도), 2024-04 LG에너지솔루션개별선물 (매도), 2024-04 카카오뱅크개별선물 (매도), 2024-04 한솔케미칼개별선물 (매도) / 청산, 2024-04 현대미포조선개별선물 (매도), 2024-04 한화오션개별선물 (매도) / 일부청산
2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물 (매도) / 신규거래, 2024-04 아모레퍼시픽개별선물 (매도), 2024-04 에스엠개별선물 (매도), 2024-04 넷마블개별선물 (매도), 2024-04 하이브개별선물 (매도) / 추가거래

* 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 39.51% 입니다.