

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(2024.04.15기준)

1) 파생상품종류	개별주식선물		주가지수선물
2) 종목명	2024-05 LG디스플레이개별선물 (매도)	2024-05 카카오게임즈개별선물 (매도)	2024-06 코스피200지수선물 (매도)
	2024-05 GS건설개별선물 (매도)	2024-05 LG에너지솔루션개별선물 (매도)	
	2024-05 아모레퍼시픽개별선물 (매도)	2024-05 카카오뱅크개별선물 (매도)	
	2024-05 카카오개별선물 (매도)	2024-05 카카오페이개별선물 (매도)	
	2024-05 포스코DX개별선물 (매도)	2024-05 SK스퀘어개별선물 (매도)	
	2024-05 LG생활건강개별선물 (매도)	2024-05 한화오션개별선물 (매도)	
	2024-05 CJ제일제당개별선물 (매도)		
3) 포지션	매도		
4) 파생상품 위험평가액*	0		
5) NAV	2,611,434,442		
6) 파생위험평가액/NAV**	0%		

4. 기타 :2024-06 코스피200지수선물 (매도), 2024-05 LG디스플레이개별선물 (매도), 2024-05 포스코DX개별선물 (매도), 2024-05 LG생활건강개별선물 (매도), 2024-05 CJ제일제당개별선물 (매도), 2024-05 넷마블개별선물 (매도), 2024-05 카카오게임즈개별선물 (매도) / 일부청산

2024-05 카카오뱅크개별선물 (매도), 2024-05 SK스퀘어개별선물 (매도), 2024-05 한화오션개별선물 (매도) / 일부청산, 2024-05 SK아이이테크놀로지개별선물 (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 17.35% 입니다.