

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(2024.05.29기준)

| 1) 파생상품종류 | 개별주식선물 | | 주가지수선물 |
|------------------|---------------------------|---------------------|-------------------------|
| 2) 종목명 | 2024-06 GS개별선물 (매도) | 2024-06 금양개별선물 (매수) | 2024-06 코스피200지수선물 (매도) |
| | 2024-06 카카오개별선물 (매도) | | |
| | 2024-06 HD한국조선해양개별선물 (매도) | | |
| 3) 포지션 | 매도 | 매수 | 매도 |
| 4) 파생상품 위험평가액* | 0 | | |
| 5) NAV | 2,016,256,158 | | |
| 6) 파생위험평가액/NAV** | 0% | | |

4. 기타 : 2024-06 삼성화재개별선물 (매도), 2024-06 DB손해보험개별선물 (매수) / 청산, 2024-06 두산밥캣개별선물 (매도) / 신규거래, 2024-06 GS개별선물 (매도), 2024-06 HD한국조선해양개별선물 (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 5.64% 입니다.