

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(2024.06.21기준)

1) 파생상품종류	개별주식선물		
2) 종목명	2024-07 GS개별선물 (매도)	2024-07 포스코DX개별선물 (매도)	2024-07 금호석유개별선물 (매수)
	2024-07 HD현대인프라코어개별선물 (매도)	2024-07 SK스퀘어개별선물 (매도)	2024-07 한세실업개별선물 (매수)
	2024-07 롯데케미칼개별선물 (매도)	2024-07 영원무역홀딩스개별선물 (매도)	2024-07 두산밥캣개별선물 (매수)
	2024-07 하이트진로개별선물 (매도)	2024-07 포스코퓨처엠개별선물 (매도)	2024-07 LS ELECTRIC개별선물 (매수)
	2024-07 한국항공우주개별선물 (매도)	2024-07 LG에너지솔루션개별선물 (매도)	
3) 포지션	매도		매수
4) 파생상품 위험평가액*	0		
5) NAV	2,049,191,000		
6) 파생위험평가액/NAV**	0%		

4. 기타 : 2024-07 포스코인터내셔널개별선물 (매수), 2024-07 파라다이스개별선물 (매도), 2024-07 삼성화재개별선물 (매수), 2024-07 DB손해보험개별선물 (매도), 2024-07 LIG넥스원개별선물 (매수), 2024-07 롯데칠성개별선물 (매도) / 청산
2024-07 GS개별선물 (매도), 2024-07 SK스퀘어개별선물 (매도) / 신규거래, 2024-07 LS ELECTRIC개별선물 (매수) / 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 6.01% 입니다.