

금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙<별지 제67호>에 따라 고난도 집합투자증권 지정과 관련한 파생상품 위험평가액 산정시 일정거래를 제외하는 집합투자구의 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. 집합투자지구명 : 신한에쿼티알파일반사모혼합자산
3. 고난도 집합투자증권 산정 관련 파생상품 위험평가액(2024.10.07기준)

1) 파생상품종류		개별주식선물			주가지수선물
2) 종목명	2024-11 금양개발선물 (매수)	2024-09 현대차개발선물 (매도)	2024-11 LIG넥스원개발선물 (매도)		2024-12 코스닥150선물 (매도)
	2024-10 DB손해보험개발선물 (매수)	2024-10 현대제철개발선물 (매도)	2024-10 HD현대중공업개발선물 (매도)		
	2024-10 HD현대미포개발선물 (매수)	2024-10 포스코DX개발선물 (매도)	2024-10 KT&G개발선물 (매도)		
		2024-10 SK바이오사이언스개발선물 (매도)	2024-11 이오테크닉스개발선물 (매도)		
	2024-11 LG화학개발선물 (매도)				
3) 포지션	매수	매도			
4) 파생상품 위험평가액*	0				
5) NAV	1,975,983,975				
6) 파생위험평가액/NAV**	0%				

4. 기타 : 2024-10 농심개발선물 (매도), 2024-10 크래프톤개발선물 (매도), 2024-10 금양개발선물 (매수) / 청산, 2024-10 KT&G개발선물 (매도), 2024-12 코스닥150선물 (매도) / 일부청산, 2024-11 LIG넥스원개발선물 (매도), 2024-11 금양개발선물 (매수) / 신규거래, 2024-11 LG화학개발선물 (매도), 2024-11 이오테크닉스개발선물 (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 6.77% 입니다.