

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 산정 관련 파생상품 위험평가액(2024.11.25기준)

1) 파생상품종류		개별주식선물		추가지수선물	
2)	종목명	2024-12 LG이노텍개별선물 (매수)	2024-12 삼성전기개별선물 (매도)	2024-12 SK이노베이션개별선물 (매도)	2024-12 미니코스피200 선물 (매도)
			2024-12 GS건설개별선물 (매도)	2024-12 삼성전자개별선물 (매도)	
			2024-12 대한항공개별선물 (매도)	2024-12 HMM개별선물 (매도)	2024-12 코스닥150선물 (매도)
			2024-12 LG에너지솔루션개별선물 (매도)	2024-12 POSCO홀딩스개별선물 (매도)	
2024-12 한국항공우주개별선물 (매도)	2024-12 S-Oil개별선물 (매도)				
3) 포지션	매수	매도			
4) 파생상품 위험평가액*	0				
5) NAV	1,190,805,643				
6) 파생위험평가액/NAV**	0%				

4. 기타 : 2024-12 삼성전자개별선물 (매도), 2024-12 POSCO홀딩스개별선물 (매도) / 신규거래, 2024-12 와이즈엔터테인먼트개별선물 (매도), 2024-12 JYP Ent.개별선물 (매도) / 청산, 2024-12 코스닥150선물 (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 11.12% 입니다.