

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(2025.03.10기준)

1) 파생상품종류	개별주식선물			추가지수선물
	2) 종목명	2025-03 아모레퍼시픽개별선물 (매수)	2025-03 LG생활건강개별선물 (매도)	
2025-03 코스맥스비티아이개별선물 (매수)		2025-03 콜마홀딩스개별선물 (매도)	2025-04 한국항공우주개별선물 (매도)	
2025-03 금호석유개별선물 (매수)		2025-04 삼성SDI개별선물 (매도)	2025-03 풀어비스개별선물 (매도)	
		2025-03 롯데케미칼개별선물 (매도)	2025-04 POSCO홀딩스개별선물 (매도)	
3) 포지션	매수		매도	
4) 파생상품 위험평가액*	0			
5) NAV	1,248,026,454			
6) 파생위험평가액/NAV**	0%			

4. 기타 : 2025-03 현대백화점개별선물 (매도), 2025-03 CJ ENM개별선물 (매도) / 청산, 2025-04 한국항공우주개별선물 (매도) / 신규거래, 2025-04 삼성SDI개별선물 (매도) / 추가거래
2025-04 POSCO홀딩스개별선물 (매도), 2025-03 롯데쇼핑개별선물 (매도), 2025-03 아모레퍼시픽개별선물 (매수), 2025-03 LG생활건강개별선물 (매도), 2025-03 한국콜마개별선물 (매도), 2025-03 코스맥스비티아이개별선물 (매수), 2025-03 풀어비스개별선물 (매도) / 일부청산

* 이 공시는 고난도 금융투자상품에서 제외되는 파생상품관련이며, 자본시장법 및 집합투자규약등에서 제한하는 파생상품 위험평가액과는 다를수 있음(별표**참조)

** 현재, 자본시장법 및 집합투자규약 관련 파생상품 위험평가액 비율은 6.94% 입니다.