

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(2025.04.09기준)

1) 파생상품종류		개별주식선물		
2) 종목명	2025-04 아모레퍼시픽개별선물 (매수)	2025-05 영원무역홀딩스개별선물 (매도)	2025-05 삼성중공업개별선물 (매도)	2025-05 한세실업개별선물 (매도)
		2025-05 한미반도체개별선물 (매도)	2025-05 한국항공우주개별선물 (매도)	2025-05 포스코퓨처엠개별선물 (매도)
		2025-05 삼성전자개별선물 (매도)	2025-05 현대건설개별선물 (매도)	2025-05 삼성바이오로직스개별선물 (매도)
		2025-05 한국전력개별선물 (매도)	2025-05 한화개별선물 (매도)	2025-05 에코프로비엠개별선물 (매도)
		2025-05 HD한국조선해양개별선물 (매도)	2025-05 한화솔루션개별선물 (매도)	2025-05 크래프톤개별선물 (매도)
		2025-05 HD현대인프라코어개별선물 (매도)	2025-05 포스코DX개별선물 (매도)	2025-05 하이브개별선물 (매도)
		2025-05 S-Oil개별선물 (매도)	2025-05 한미약품개별선물 (매도)	2025-05 주성엔지니어링개별선물 (매도)
		2025-05 포스코인터내셔널개별선물 (매도)	2025-05 한국콜마개별선물 (매도)	2025-05 파마리서치개별선물 (매도)
		2025-05 롯데쇼핑개별선물 (매도)	2025-05 영원무역개별선물 (매도)	
3) 포지션	매수	매도		
4) 파생상품 위험평가액*	0			
5) NAV	1,216,347,550			
6) 파생위험평가액/NAV**	0%			

4. 기타 : 2025-05 영원무역홀딩스개별선물 (매도), 2025-05 HD한국조선해양개별선물 (매도), 2025-05 S-Oil개별선물 (매도), 2025-05 포스코인터내셔널개별선물 (매도), 2025-05 롯데쇼핑개별선물 (매도) / 신규거래
 2025-05 현대건설개별선물 (매도), 2025-05 한화개별선물 (매도), 2025-05 한국콜마개별선물 (매도), 2025-05 영원무역개별선물 (매도), 2025-05 한세실업개별선물 (매도) / 신규거래
 2025-05 포스코퓨처엠개별선물 (매도), 2025-05 에코프로비엠개별선물 (매도), 2025-05 주성엔지니어링개별선물 (매도), 2025-05 파마리서치개별선물 (매도) / 신규거래
 2025-05 한미반도체개별선물 (매도), 2025-05 삼성전자개별선물 (매도), 2025-05 HD현대인프라코어개별선물 (매도), 2025-05 삼성중공업개별선물 (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 10.77% 입니다.