

펀드명 : 한화 PLUS 미국달러SOFR금리액티브특별자산상장지수투

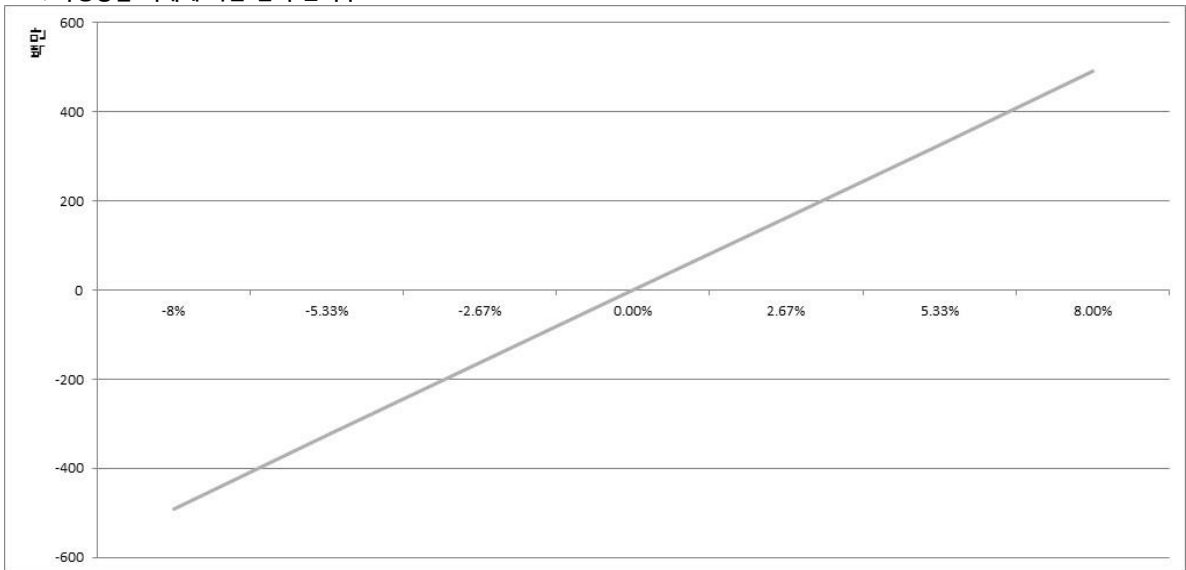
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	6,130	0	6,130	장외
합계			6,130	0	6,130	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

490

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-490,403,755	-326,935,836	-163,467,918	0	163,467,918	326,935,836	490,403,755
16.67%	-490,403,755	-326,935,836	-163,467,918	0	163,467,918	326,935,836	490,403,755
8.33%	-490,403,755	-326,935,836	-163,467,918	0	163,467,918	326,935,836	490,403,755
0%	-490,403,755	-326,935,836	-163,467,918	0	163,467,918	326,935,836	490,403,755
-8.33%	-490,403,755	-326,935,836	-163,467,918	0	163,467,918	326,935,836	490,403,755
-16.67%	-490,403,755	-326,935,836	-163,467,918	0	163,467,918	326,935,836	490,403,755
-25%	-490,403,755	-326,935,836	-163,467,918	0	163,467,918	326,935,836	490,403,755

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

245

펀드명 : 한화 PLUS 신흥국MSCI인버스증권상장지수투자신탁(주)

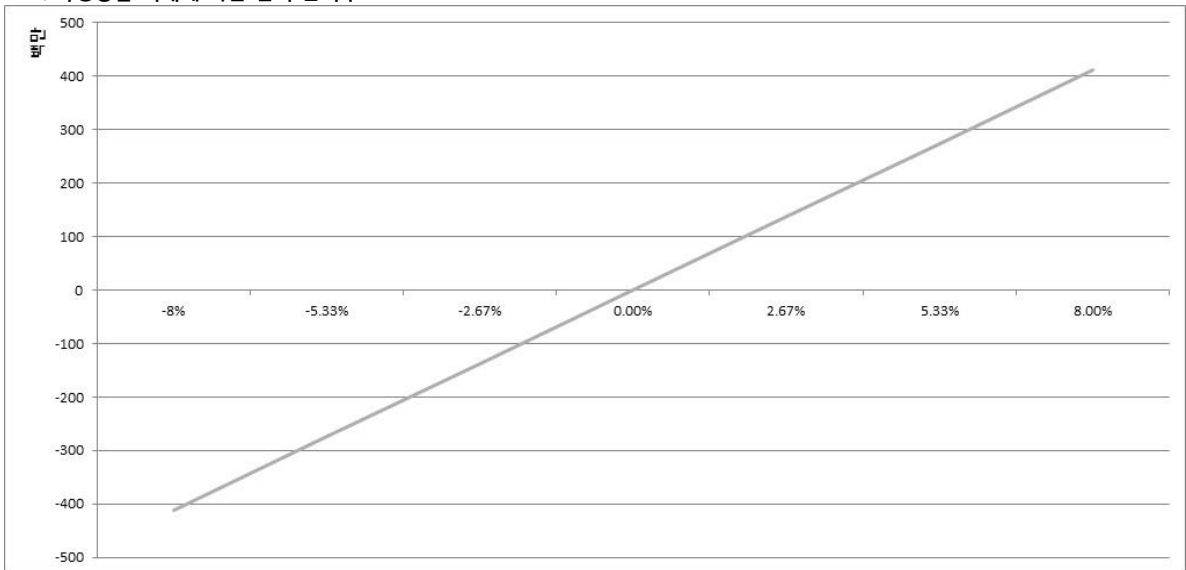
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	5,137	0	5,137	장외
합계			5,137	0	5,137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

411

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-410,957,876	-273,971,917	-136,985,959	0	136,985,959	273,971,917	410,957,876
16.67%	-410,957,876	-273,971,917	-136,985,959	0	136,985,959	273,971,917	410,957,876
8.33%	-410,957,876	-273,971,917	-136,985,959	0	136,985,959	273,971,917	410,957,876
0%	-410,957,876	-273,971,917	-136,985,959	0	136,985,959	273,971,917	410,957,876
-8.33%	-410,957,876	-273,971,917	-136,985,959	0	136,985,959	273,971,917	410,957,876
-16.67%	-410,957,876	-273,971,917	-136,985,959	0	136,985,959	273,971,917	410,957,876
-25%	-410,957,876	-273,971,917	-136,985,959	0	136,985,959	273,971,917	410,957,876

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

505

펀드명 : 한화 PLUS 글로벌MSCI증권상장지수투자신탁(주식-파생)

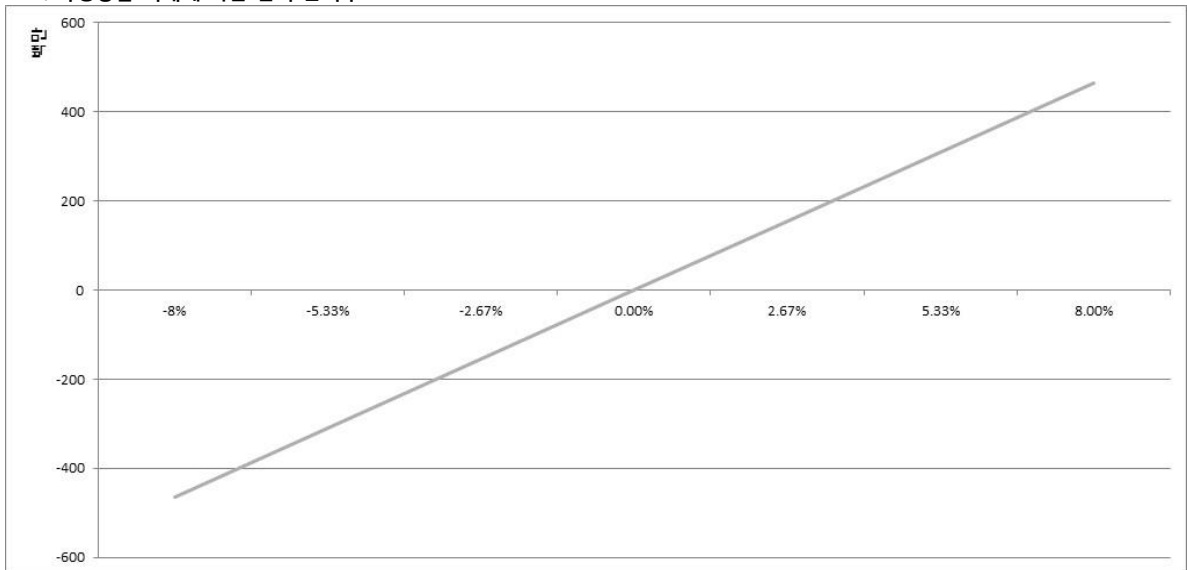
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	5,807	0	5,807	장외
합계			5,807	0	5,807	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

465

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-464,558,069	-309,705,380	-154,852,690	0	154,852,690	309,705,380	464,558,069
16.67%	-464,558,069	-309,705,380	-154,852,690	0	154,852,690	309,705,380	464,558,069
8.33%	-464,558,069	-309,705,380	-154,852,690	0	154,852,690	309,705,380	464,558,069
0%	-464,558,069	-309,705,380	-154,852,690	0	154,852,690	309,705,380	464,558,069
-8.33%	-464,558,069	-309,705,380	-154,852,690	0	154,852,690	309,705,380	464,558,069
-16.67%	-464,558,069	-309,705,380	-154,852,690	0	154,852,690	309,705,380	464,558,069
-25%	-464,558,069	-309,705,380	-154,852,690	0	154,852,690	309,705,380	464,558,069

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

463

펀드명 : 한화 PLUS 선진국MSCI증권상장지수투자신탁(주식-파생)

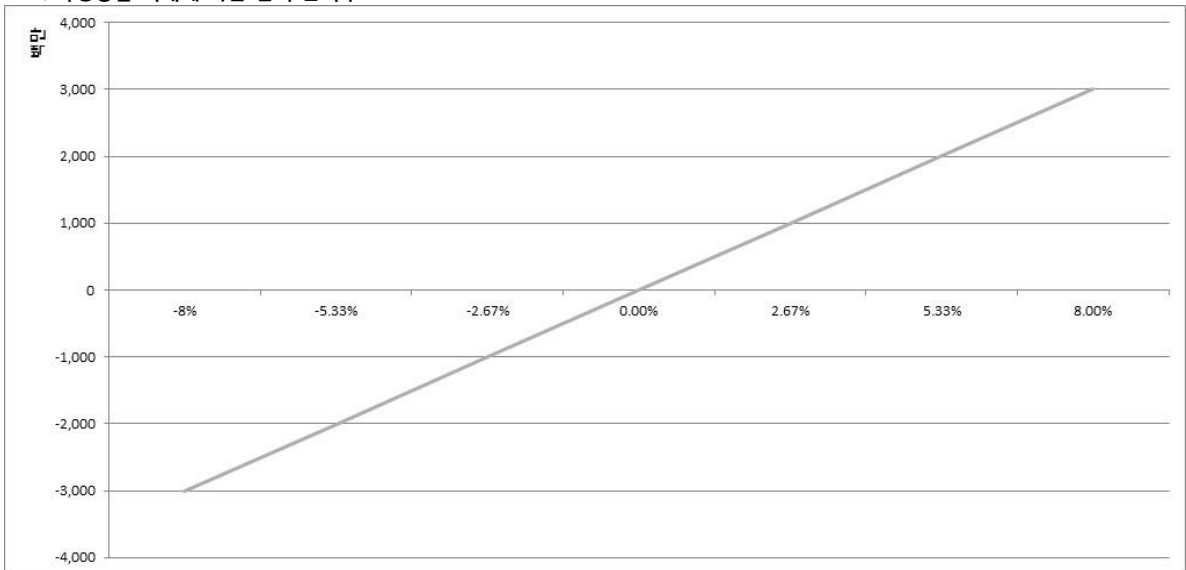
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	37,688	0	37,688	장외
합계			37,688	0	37,688	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,015

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-3,015,069,897	-2,010,046,598	-1,005,023,299	0	1,005,023,299	2,010,046,598	3,015,069,897
16.67%	-3,015,069,897	-2,010,046,598	-1,005,023,299	0	1,005,023,299	2,010,046,598	3,015,069,897
8.33%	-3,015,069,897	-2,010,046,598	-1,005,023,299	0	1,005,023,299	2,010,046,598	3,015,069,897
0%	-3,015,069,897	-2,010,046,598	-1,005,023,299	0	1,005,023,299	2,010,046,598	3,015,069,897
-8.33%	-3,015,069,897	-2,010,046,598	-1,005,023,299	0	1,005,023,299	2,010,046,598	3,015,069,897
-16.67%	-3,015,069,897	-2,010,046,598	-1,005,023,299	0	1,005,023,299	2,010,046,598	3,015,069,897
-25%	-3,015,069,897	-2,010,046,598	-1,005,023,299	0	1,005,023,299	2,010,046,598	3,015,069,897

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,959

펀드명 : 한화 PLUS 신흥국MSCI증권상장지수투자신탁(주식-파생)

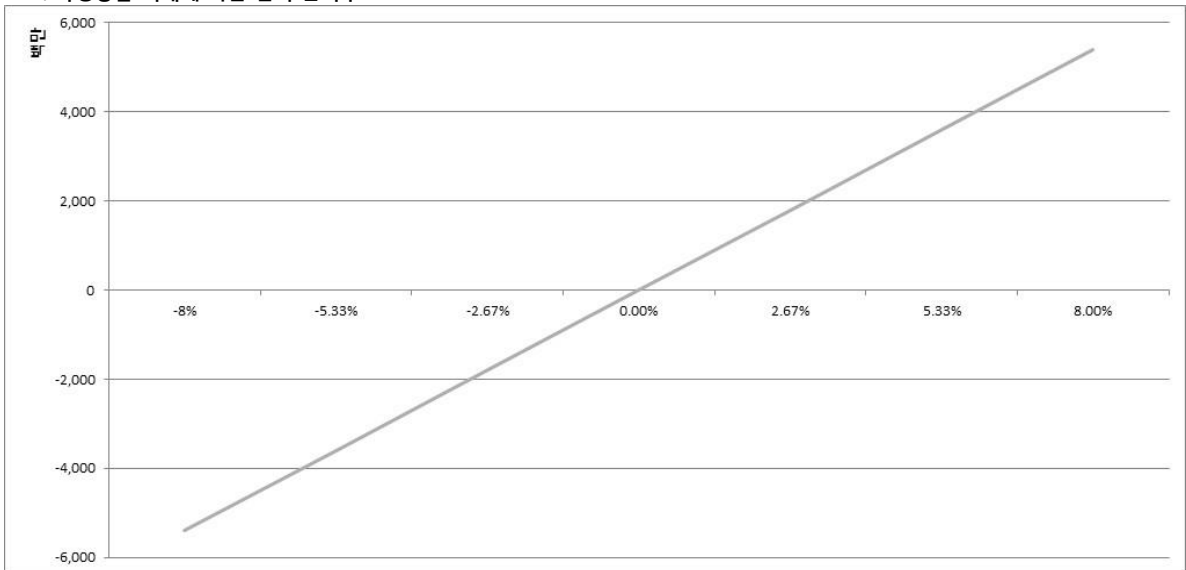
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	67,363	0	67,363	장외
합계			67,363	0	67,363	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,389

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-5,389,042,528	-3,592,695,019	-1,796,347,509	0	1,796,347,509	3,592,695,019	5,389,042,528
16.67%	-5,389,042,528	-3,592,695,019	-1,796,347,509	0	1,796,347,509	3,592,695,019	5,389,042,528
8.33%	-5,389,042,528	-3,592,695,019	-1,796,347,509	0	1,796,347,509	3,592,695,019	5,389,042,528
0%	-5,389,042,528	-3,592,695,019	-1,796,347,509	0	1,796,347,509	3,592,695,019	5,389,042,528
-8.33%	-5,389,042,528	-3,592,695,019	-1,796,347,509	0	1,796,347,509	3,592,695,019	5,389,042,528
-16.67%	-5,389,042,528	-3,592,695,019	-1,796,347,509	0	1,796,347,509	3,592,695,019	5,389,042,528
-25%	-5,389,042,528	-3,592,695,019	-1,796,347,509	0	1,796,347,509	3,592,695,019	5,389,042,528

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,678

펀드명 : 한화 PLUS 미국다우존스고배당주증권상장지수투자신탁

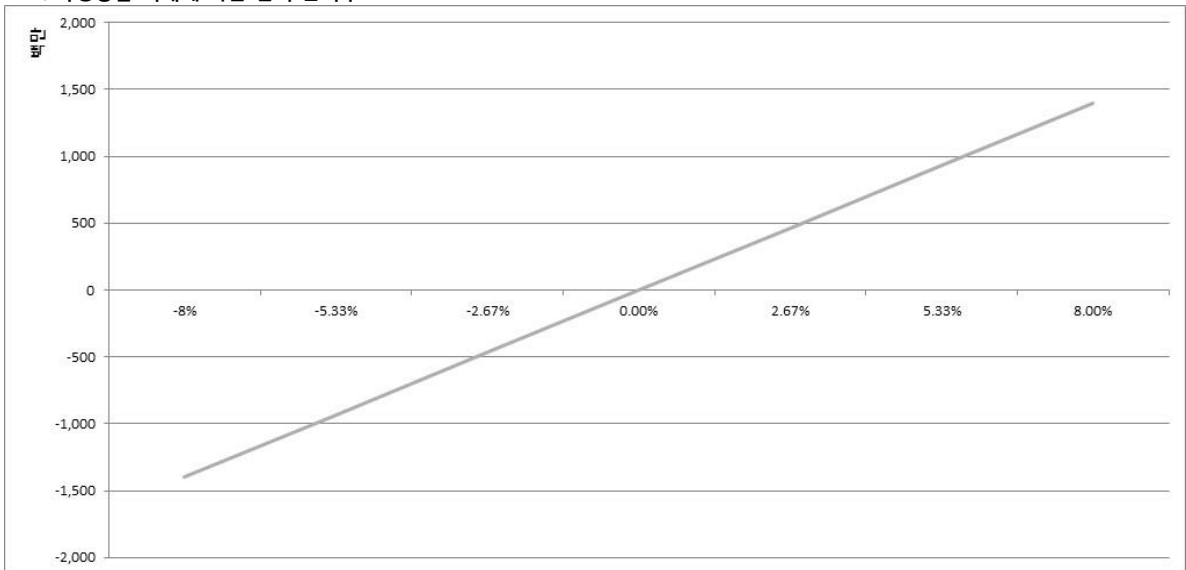
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	17,513	0	17,513	장외
합계			17,513	0	17,513	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,401

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-1,401,043,851	-934,029,232	-467,014,619	0	467,014,619	934,029,232	1,401,043,851
16.67%	-1,401,043,851	-934,029,232	-467,014,619	0	467,014,619	934,029,232	1,401,043,851
8.33%	-1,401,043,851	-934,029,232	-467,014,619	0	467,014,619	934,029,232	1,401,043,851
0%	-1,401,043,851	-934,029,232	-467,014,619	0	467,014,619	934,029,232	1,401,043,851
-8.33%	-1,401,043,851	-934,029,232	-467,014,619	0	467,014,619	934,029,232	1,401,043,851
-16.67%	-1,401,043,851	-934,029,232	-467,014,619	0	467,014,619	934,029,232	1,401,043,851
-25%	-1,401,043,851	-934,029,232	-467,014,619	0	467,014,619	934,029,232	1,401,043,851

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,329

펀드명 : 한화 PLUS 스마트베타Quality채권혼합증권상장지수투

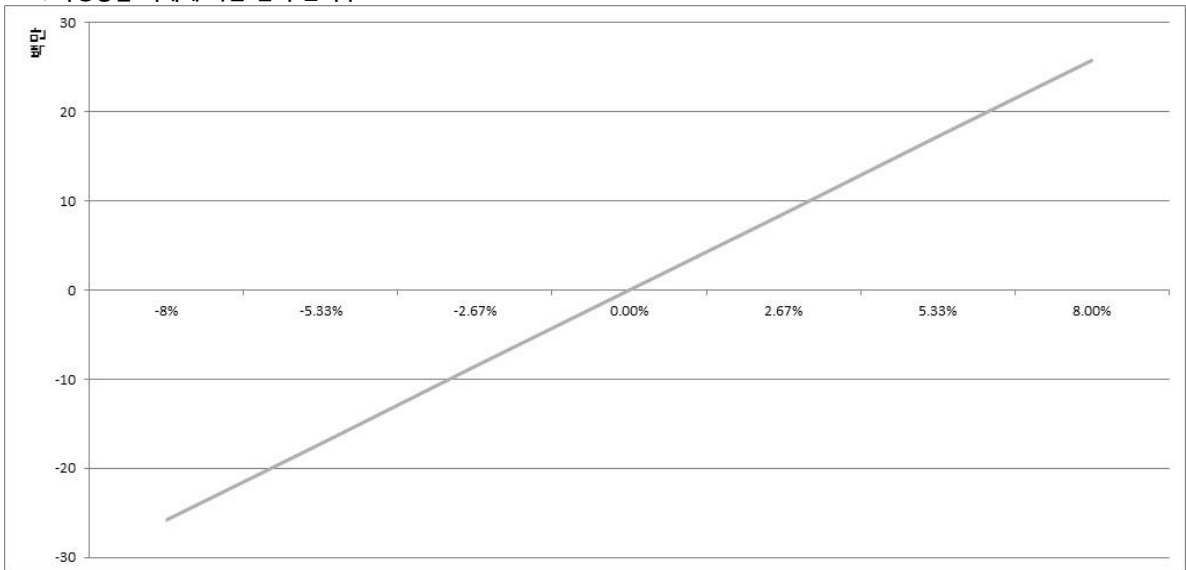
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	323	0	323	장내
합계			323	0	323	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-25,831,200	-17,220,800	-8,610,400	0	8,610,400	17,220,800	25,831,200
16.67%	-25,831,200	-17,220,800	-8,610,400	0	8,610,400	17,220,800	25,831,200
8.33%	-25,831,200	-17,220,800	-8,610,400	0	8,610,400	17,220,800	25,831,200
0%	-25,831,200	-17,220,800	-8,610,400	0	8,610,400	17,220,800	25,831,200
-8.33%	-25,831,200	-17,220,800	-8,610,400	0	8,610,400	17,220,800	25,831,200
-16.67%	-25,831,200	-17,220,800	-8,610,400	0	8,610,400	17,220,800	25,831,200
-25%	-25,831,200	-17,220,800	-8,610,400	0	8,610,400	17,220,800	25,831,200

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2

펀드명 : 한화 PLUS 고배당주채권혼합증권상장지수투자신탁(채)

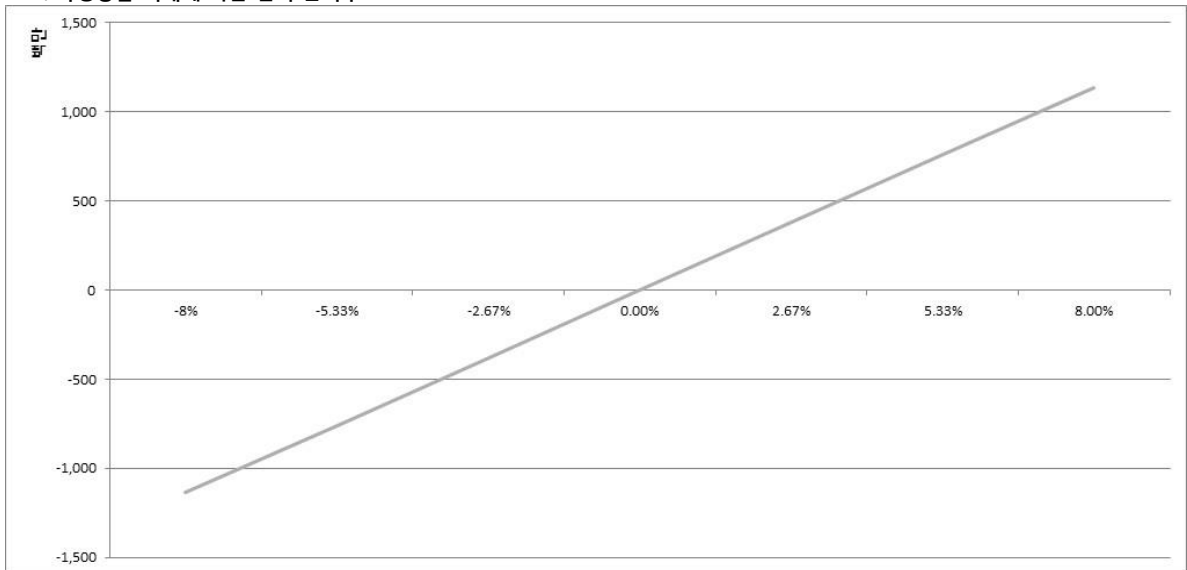
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,799	-2,799	장내
누계	유가증권	선물	14,211	0	14,211	장내
합계			14,211	0	14,211	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,137

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-1,136,572,800	-757,715,200	-378,857,600	0	378,857,600	757,715,200	1,136,572,800
16.67%	-1,136,572,800	-757,715,200	-378,857,600	0	378,857,600	757,715,200	1,136,572,800
8.33%	-1,136,572,800	-757,715,200	-378,857,600	0	378,857,600	757,715,200	1,136,572,800
0%	-1,136,572,800	-757,715,200	-378,857,600	0	378,857,600	757,715,200	1,136,572,800
-8.33%	-1,136,572,800	-757,715,200	-378,857,600	0	378,857,600	757,715,200	1,136,572,800
-16.67%	-1,136,572,800	-757,715,200	-378,857,600	0	378,857,600	757,715,200	1,136,572,800
-25%	-1,136,572,800	-757,715,200	-378,857,600	0	378,857,600	757,715,200	1,136,572,800

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

97

펀드명 : 한화 PLUS 200선물인버스2X증권상장지수투자신탁(주식)

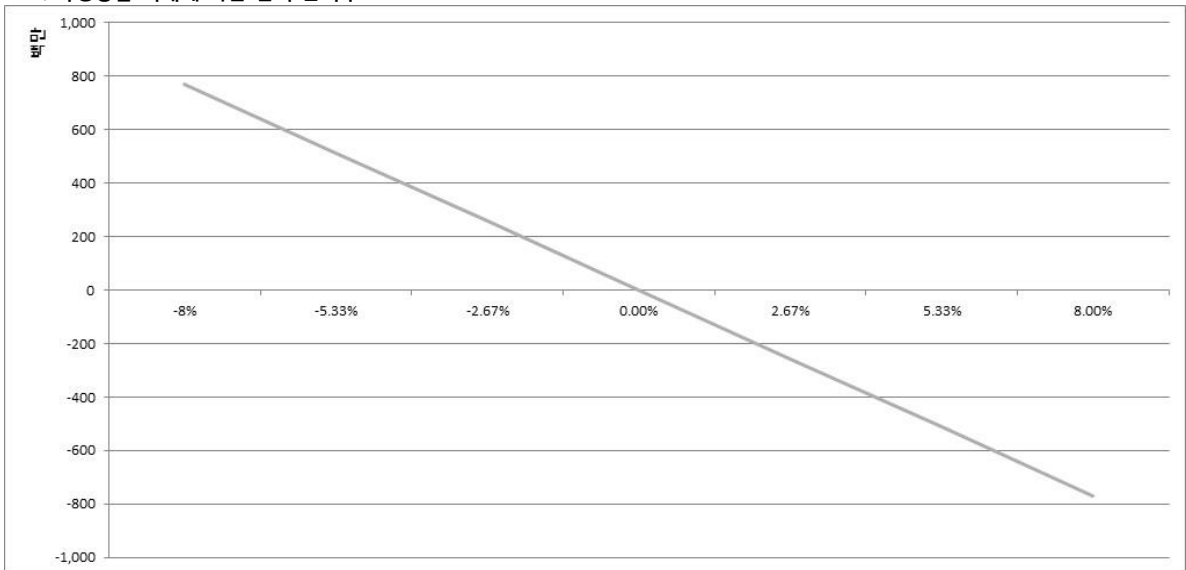
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	445	0	445	장내
누계	주가지수	선물	0	9,622	-9,622	장내
합계			0	9,622	-9,622	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

771

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	770,688,000	513,792,000	256,896,000	0	-256,896,000	-513,792,000	-770,688,000
16.67%	770,688,000	513,792,000	256,896,000	0	-256,896,000	-513,792,000	-770,688,000
8.33%	770,688,000	513,792,000	256,896,000	0	-256,896,000	-513,792,000	-770,688,000
0%	770,688,000	513,792,000	256,896,000	0	-256,896,000	-513,792,000	-770,688,000
-8.33%	770,688,000	513,792,000	256,896,000	0	-256,896,000	-513,792,000	-770,688,000
-16.67%	770,688,000	513,792,000	256,896,000	0	-256,896,000	-513,792,000	-770,688,000
-25%	770,688,000	513,792,000	256,896,000	0	-256,896,000	-513,792,000	-770,688,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,006

펀드명 : 한화 PLUS 200선물레버리지증권상장지수투자신탁(주식)

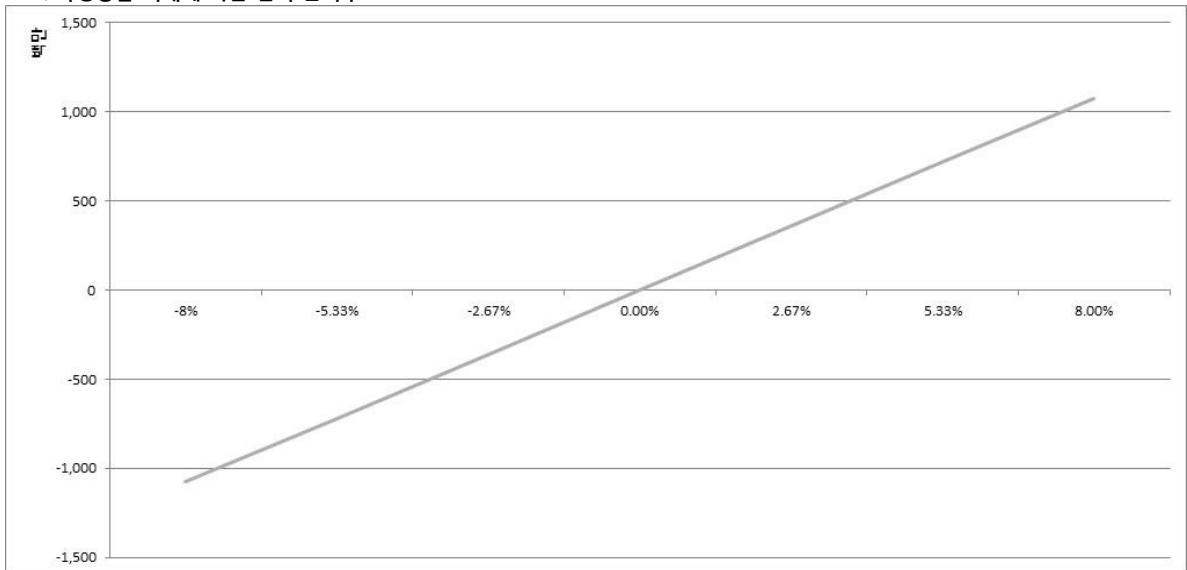
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	178	0	178	장내
누계	주가지수	선물	13,453	0	13,453	장내
합계			13,453	0	13,453	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,078

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-1,077,536,000	-718,357,333	-359,178,667	0	359,178,667	718,357,333	1,077,536,000
16.67%	-1,077,536,000	-718,357,333	-359,178,667	0	359,178,667	718,357,333	1,077,536,000
8.33%	-1,077,536,000	-718,357,333	-359,178,667	0	359,178,667	718,357,333	1,077,536,000
0%	-1,077,536,000	-718,357,333	-359,178,667	0	359,178,667	718,357,333	1,077,536,000
-8.33%	-1,077,536,000	-718,357,333	-359,178,667	0	359,178,667	718,357,333	1,077,536,000
-16.67%	-1,077,536,000	-718,357,333	-359,178,667	0	359,178,667	718,357,333	1,077,536,000
-25%	-1,077,536,000	-718,357,333	-359,178,667	0	359,178,667	718,357,333	1,077,536,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,406

펀드명 : 한화 PLUS 심천차이넥스트증권상장지수투자신탁(주식-

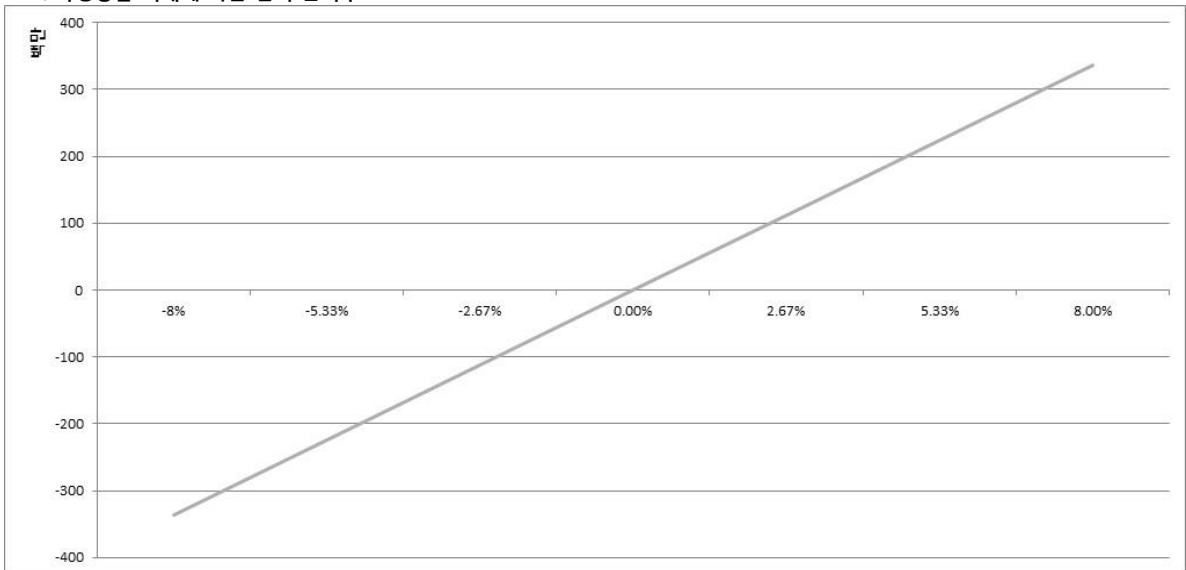
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,195	0	4,195	장외
합계			4,195	0	4,195	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

336

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-335,612,623	-223,741,748	-111,870,874	0	111,870,874	223,741,748	335,612,623
16.67%	-335,612,623	-223,741,748	-111,870,874	0	111,870,874	223,741,748	335,612,623
8.33%	-335,612,623	-223,741,748	-111,870,874	0	111,870,874	223,741,748	335,612,623
0%	-335,612,623	-223,741,748	-111,870,874	0	111,870,874	223,741,748	335,612,623
-8.33%	-335,612,623	-223,741,748	-111,870,874	0	111,870,874	223,741,748	335,612,623
-16.67%	-335,612,623	-223,741,748	-111,870,874	0	111,870,874	223,741,748	335,612,623
-25%	-335,612,623	-223,741,748	-111,870,874	0	111,870,874	223,741,748	335,612,623

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

760

펀드명 : 한화 PLUS S&P500증권상장지수투자신탁(주식-파생)(H)

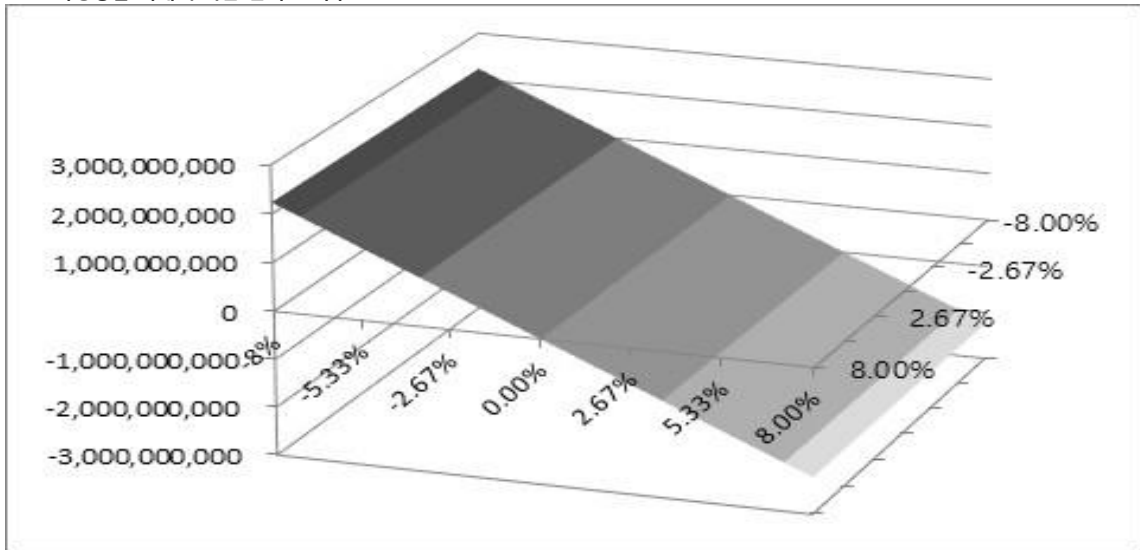
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	26,148	-26,148	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	813	0	813	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	21	-21	장외
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	10	0	10	장외
합계			823	26,168	-25,345	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,237

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테이블 상 수치 기재가 어려움

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,109

펀드명 : 한화 PLUS 국채선물10년증권상장지수투자신탁(채권-파

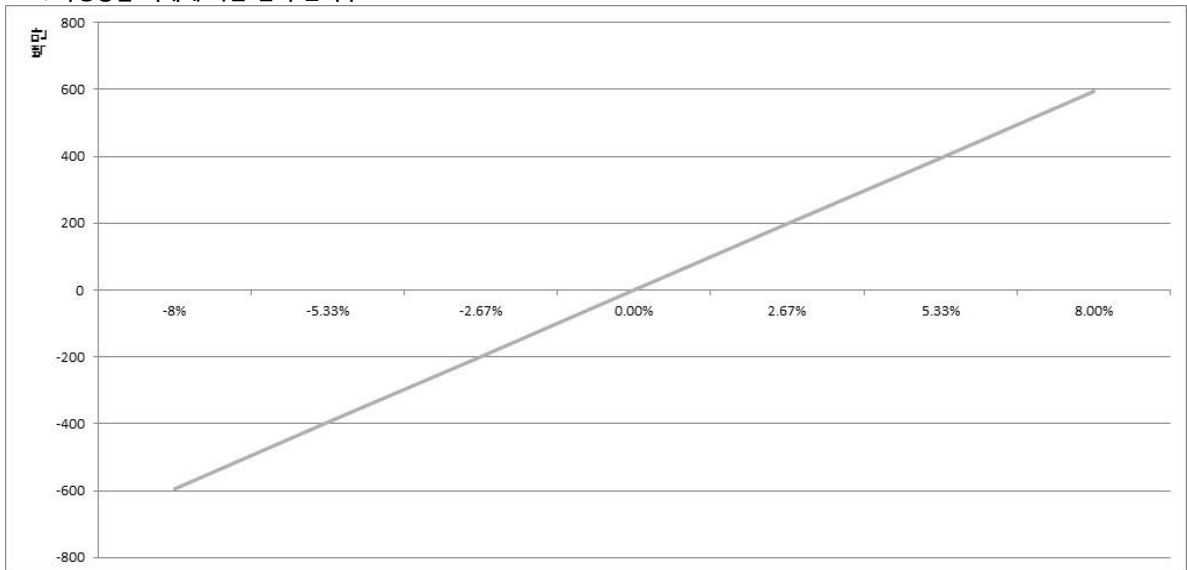
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,436	0	7,436	장내
합계			7,436	0	7,436	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

595

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-594,704,000	-396,469,333	-198,234,667	0	198,234,667	396,469,333	594,704,000
16.67%	-594,704,000	-396,469,333	-198,234,667	0	198,234,667	396,469,333	594,704,000
8.33%	-594,704,000	-396,469,333	-198,234,667	0	198,234,667	396,469,333	594,704,000
0%	-594,704,000	-396,469,333	-198,234,667	0	198,234,667	396,469,333	594,704,000
-8.33%	-594,704,000	-396,469,333	-198,234,667	0	198,234,667	396,469,333	594,704,000
-16.67%	-594,704,000	-396,469,333	-198,234,667	0	198,234,667	396,469,333	594,704,000
-25%	-594,704,000	-396,469,333	-198,234,667	0	198,234,667	396,469,333	594,704,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

157

펀드명 : 한화 PLUS 국채선물3년증권상장지수투자신탁(채권-파

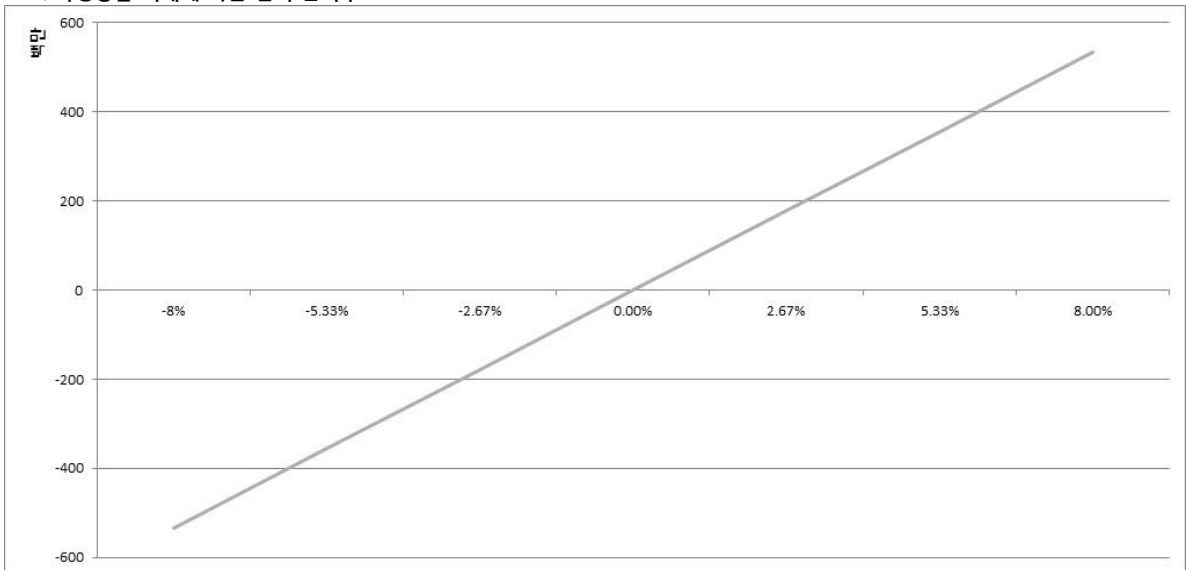
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,675	0	6,675	장내
합계			6,675	0	6,675	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

534

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-533,844,800	-355,896,533	-177,948,267	0	177,948,267	355,896,533	533,844,800
16.67%	-533,844,800	-355,896,533	-177,948,267	0	177,948,267	355,896,533	533,844,800
8.33%	-533,844,800	-355,896,533	-177,948,267	0	177,948,267	355,896,533	533,844,800
0%	-533,844,800	-355,896,533	-177,948,267	0	177,948,267	355,896,533	533,844,800
-8.33%	-533,844,800	-355,896,533	-177,948,267	0	177,948,267	355,896,533	533,844,800
-16.67%	-533,844,800	-355,896,533	-177,948,267	0	177,948,267	355,896,533	533,844,800
-25%	-533,844,800	-355,896,533	-177,948,267	0	177,948,267	355,896,533	533,844,800

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

46

펀드명 : 한화 PLUS 코스닥150선물인버스증권상장지수투자신탁(

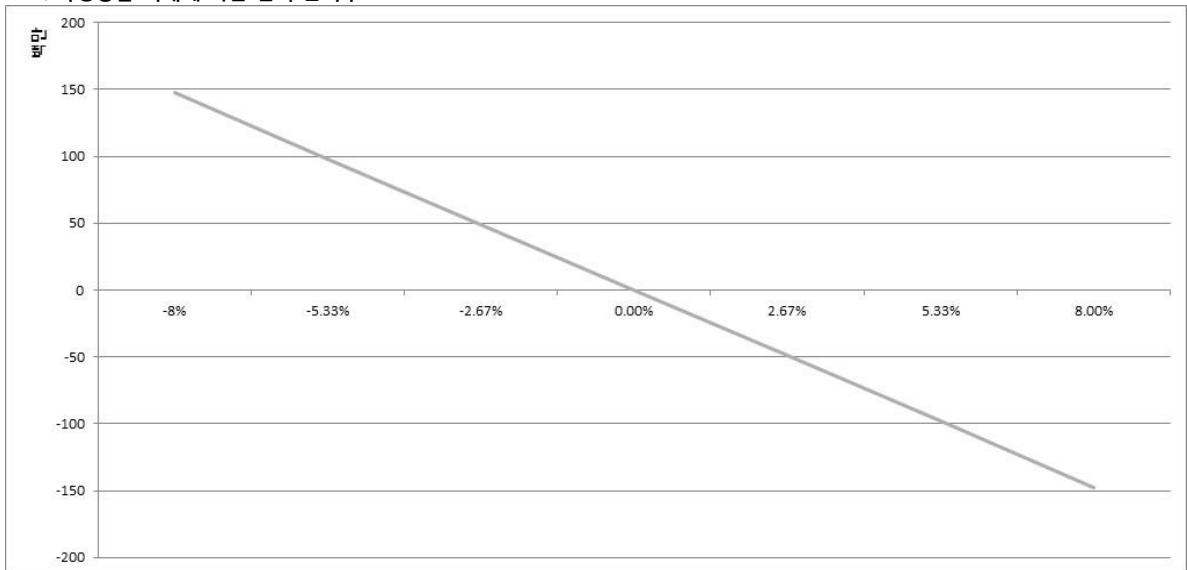
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	24	0	24	장내
누계	주가지수	선물	0	1,834	-1,834	장내
합계			0	1,834	-1,834	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

147

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	147,349,200	98,232,800	49,116,400	0	-49,116,400	-98,232,800	-147,349,200
16.67%	147,349,200	98,232,800	49,116,400	0	-49,116,400	-98,232,800	-147,349,200
8.33%	147,349,200	98,232,800	49,116,400	0	-49,116,400	-98,232,800	-147,349,200
0%	147,349,200	98,232,800	49,116,400	0	-49,116,400	-98,232,800	-147,349,200
-8.33%	147,349,200	98,232,800	49,116,400	0	-49,116,400	-98,232,800	-147,349,200
-16.67%	147,349,200	98,232,800	49,116,400	0	-49,116,400	-98,232,800	-147,349,200
-25%	147,349,200	98,232,800	49,116,400	0	-49,116,400	-98,232,800	-147,349,200

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

259

펀드명 : 한화 PLUS 미국테크TOP10레버리지증권상장지수투자신

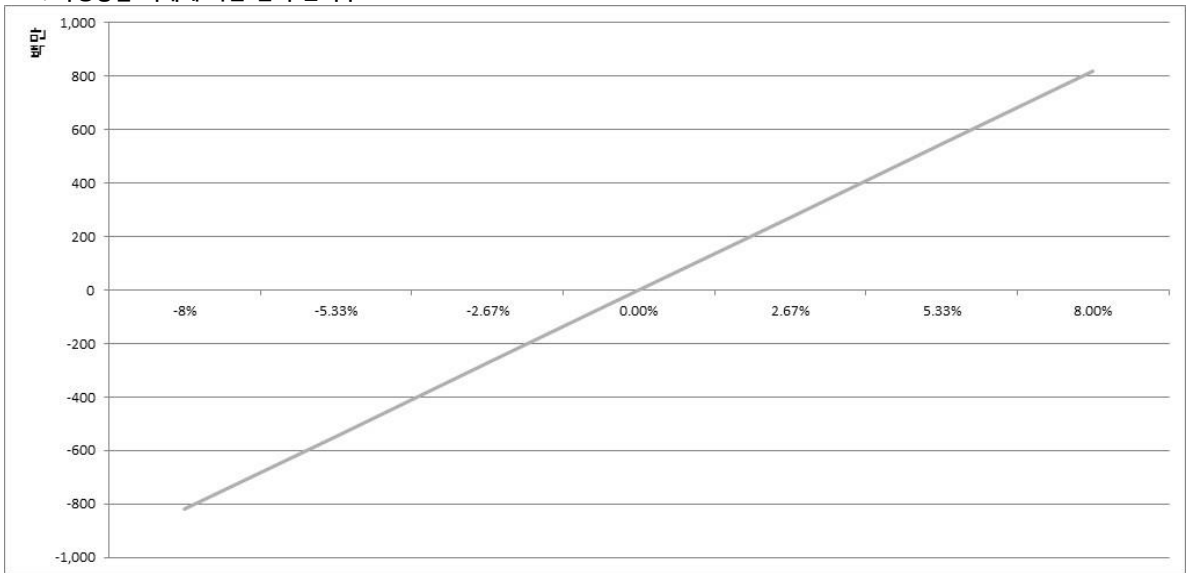
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	10,256	0	10,256	장외
합계			10,256	0	10,256	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

821

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-820,506,657	-547,004,438	-273,502,219	0	273,502,219	547,004,438	820,506,657
16.67%	-820,506,657	-547,004,438	-273,502,219	0	273,502,219	547,004,438	820,506,657
8.33%	-820,506,657	-547,004,438	-273,502,219	0	273,502,219	547,004,438	820,506,657
0%	-820,506,657	-547,004,438	-273,502,219	0	273,502,219	547,004,438	820,506,657
-8.33%	-820,506,657	-547,004,438	-273,502,219	0	273,502,219	547,004,438	820,506,657
-16.67%	-820,506,657	-547,004,438	-273,502,219	0	273,502,219	547,004,438	820,506,657
-25%	-820,506,657	-547,004,438	-273,502,219	0	273,502,219	547,004,438	820,506,657

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,594

펀드명 : 한화 PLUS 일본엔화초단기국채증권상장지수투자신탁

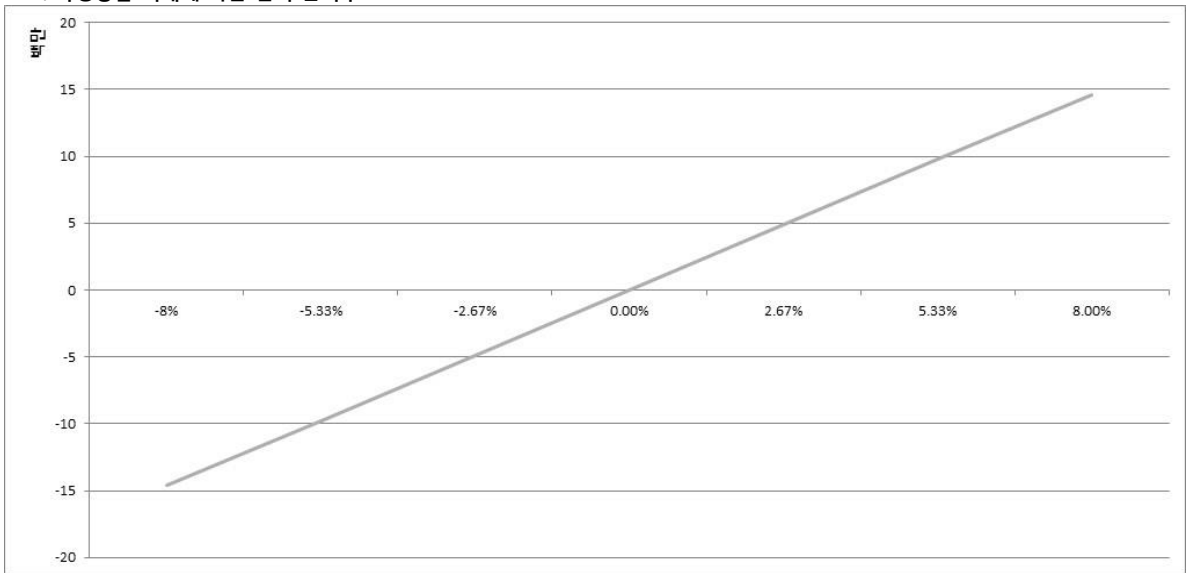
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	183	0	183	장외
합계			183	0	183	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-14,623,041	-9,748,694	-4,874,347	0	4,874,347	9,748,694	14,623,041
16.67%	-14,623,041	-9,748,694	-4,874,347	0	4,874,347	9,748,694	14,623,041
8.33%	-14,623,041	-9,748,694	-4,874,347	0	4,874,347	9,748,694	14,623,041
0%	-14,623,041	-9,748,694	-4,874,347	0	4,874,347	9,748,694	14,623,041
-8.33%	-14,623,041	-9,748,694	-4,874,347	0	4,874,347	9,748,694	14,623,041
-16.67%	-14,623,041	-9,748,694	-4,874,347	0	4,874,347	9,748,694	14,623,041
-25%	-14,623,041	-9,748,694	-4,874,347	0	4,874,347	9,748,694	14,623,041

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

10

펀드명 : 한화 PLUS 고배당주위클리커버드콜증권상장지수투자신

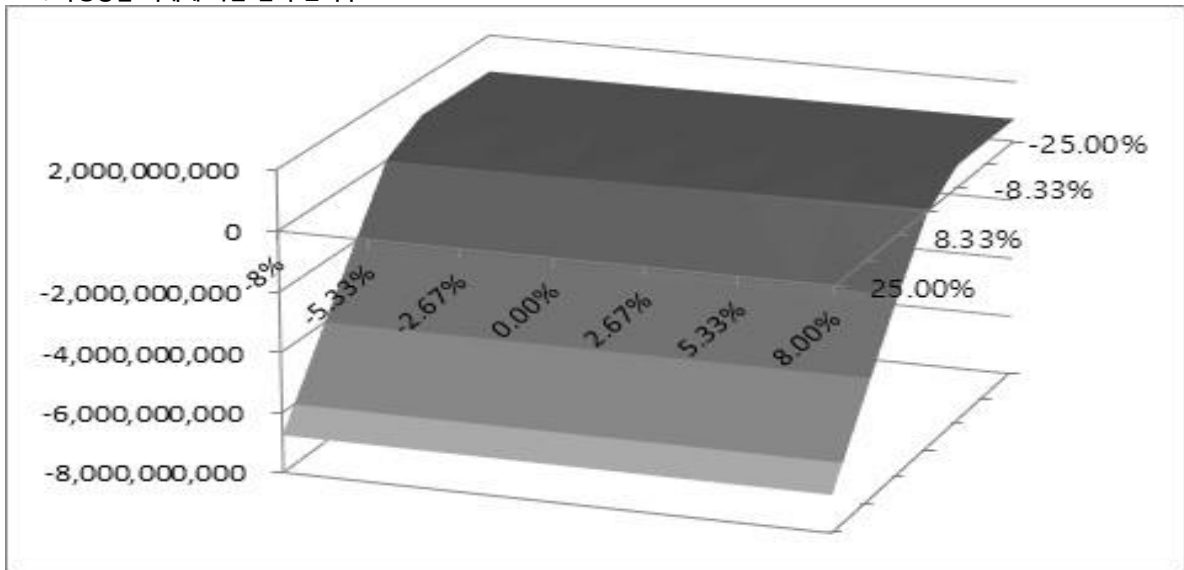
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	85,883	-85,883	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	668	0	668	장내
합계			668	85,883	-85,215	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

6,751

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테이블 상 수치 기재가 어려움

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4,009

펀드명 : 한화 PLUS 미국배당증가성장주데일리커버드콜증권상장

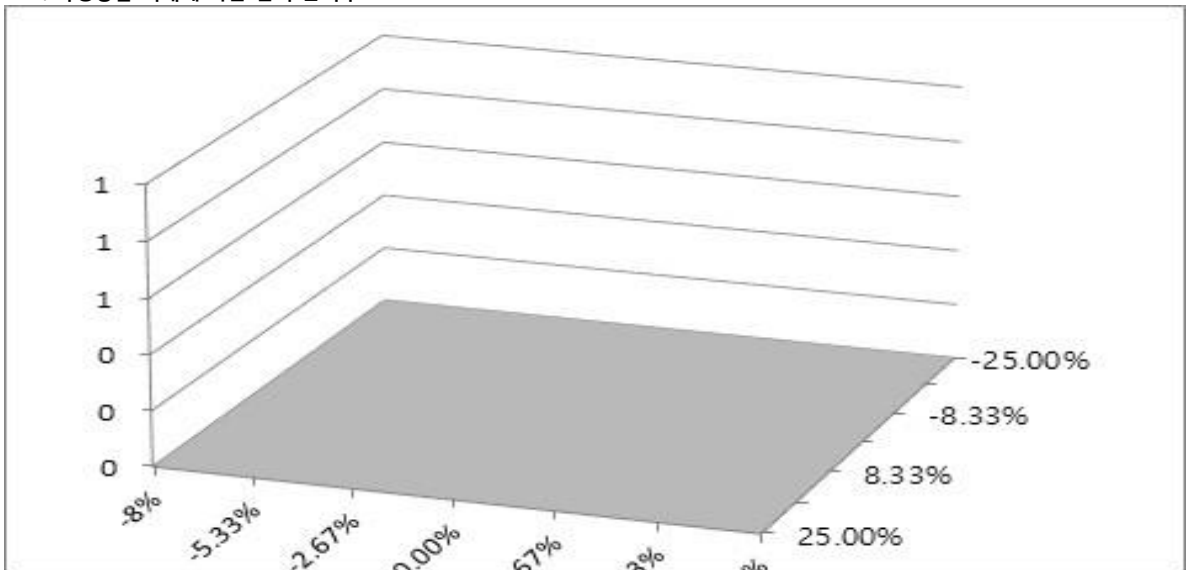
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	옵션	26	2,440	-2,414	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,440	-2,440	장내
합계			0	2,440	-2,440	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테이블 상 수치 기재가 어려움

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

181

펀드명 : 한화 PLUS 고배당주위클리고정커버드콜증권상장지수투

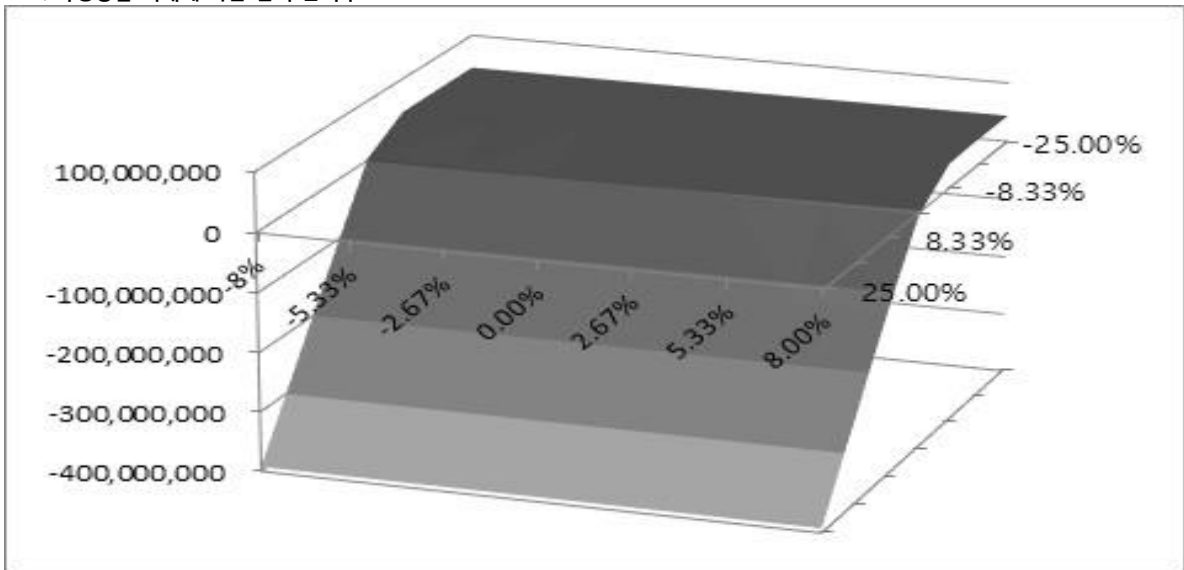
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	옵션	0	0	0	장내
누계	주가지수	옵션	0	4,989	-4,989	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17	0	17	장내
합계			17	4,989	-4,972	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

392

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테이블 상 수치 기재가 어려움

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

234

펀드명 : 한화2.2배레버리지인덱스증권투자신탁(주식-파생재간)

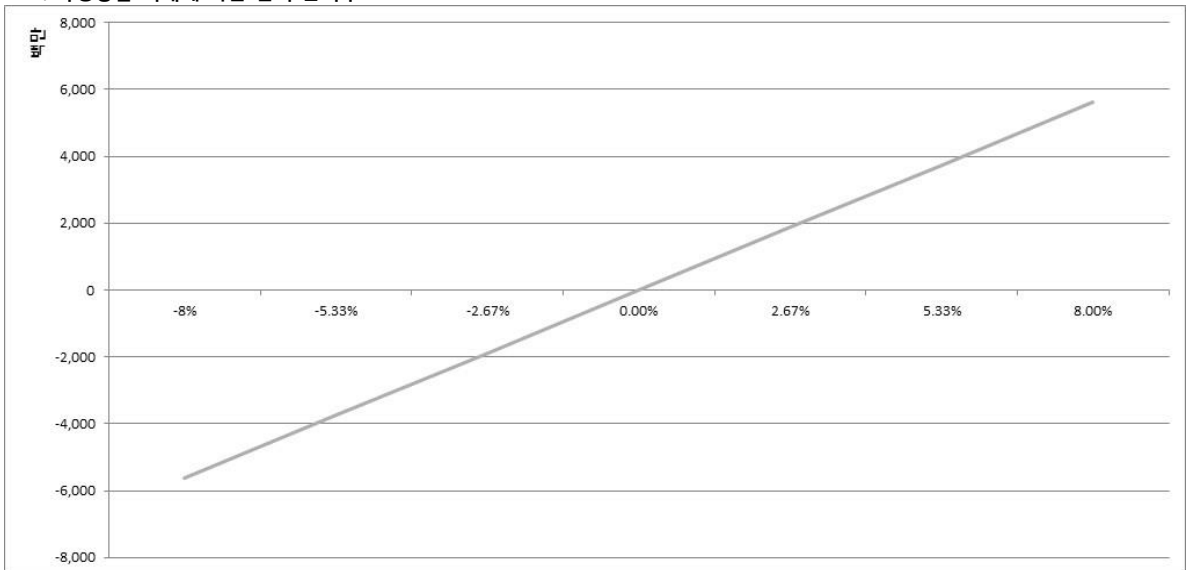
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,782	0	1,782	장내
누계	주가지수	선물	70,203	0	70,203	장내
합계			70,203	0	70,203	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,623

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-5,623,168,000	-3,748,778,667	-1,874,389,333	0	1,874,389,333	3,748,778,667	5,623,168,000
16.67%	-5,623,168,000	-3,748,778,667	-1,874,389,333	0	1,874,389,333	3,748,778,667	5,623,168,000
8.33%	-5,623,168,000	-3,748,778,667	-1,874,389,333	0	1,874,389,333	3,748,778,667	5,623,168,000
0%	-5,623,168,000	-3,748,778,667	-1,874,389,333	0	1,874,389,333	3,748,778,667	5,623,168,000
-8.33%	-5,623,168,000	-3,748,778,667	-1,874,389,333	0	1,874,389,333	3,748,778,667	5,623,168,000
-16.67%	-5,623,168,000	-3,748,778,667	-1,874,389,333	0	1,874,389,333	3,748,778,667	5,623,168,000
-25%	-5,623,168,000	-3,748,778,667	-1,874,389,333	0	1,874,389,333	3,748,778,667	5,623,168,000

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,338

펀드명 : 한화차이나H 스피드업1.5배증권 모투자신탁(주식-파생)

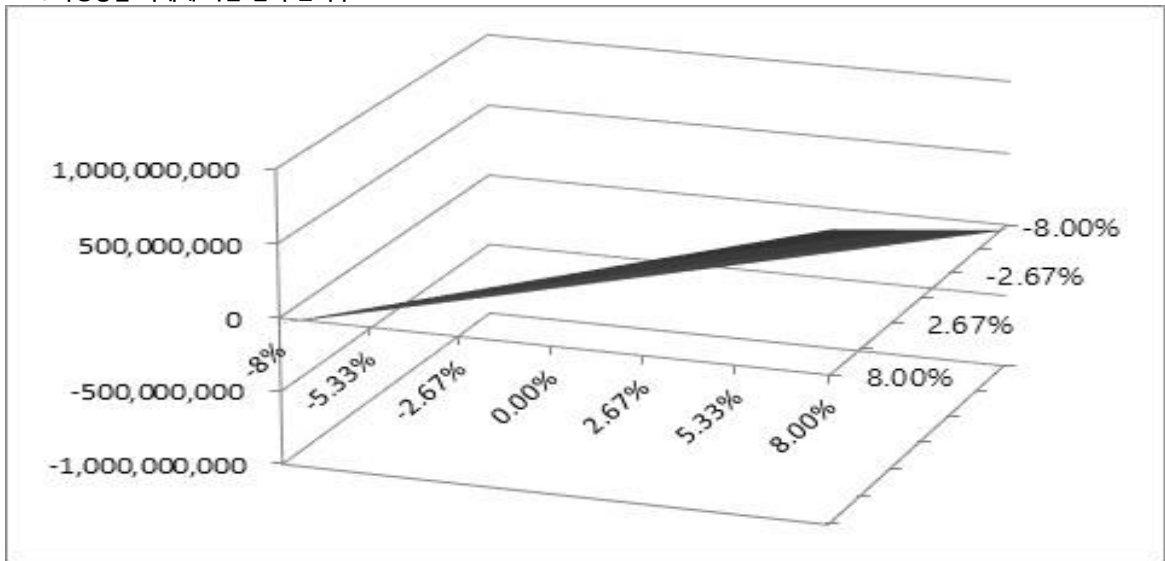
공시일: 2025-05-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	통화	선물	0	619	-619	장내
신규	주가지수	선물	5,788	5,788	0	장내
누계	주가지수	선물	5,788	0	5,788	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	31	-31	장외
합계			5,788	650	5,138	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

882

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%							
16.67%							
8.33%							
0%							
-8.33%							
-16.67%							
-25%							

* 해당 펀드 내 다수의 파생상품이 포함되어 테이블 상 수치 기재가 어려움

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

837