

# 펀드명 : 한화 PLUS 미국달러SOFR금리액티브특별자산상장지수투

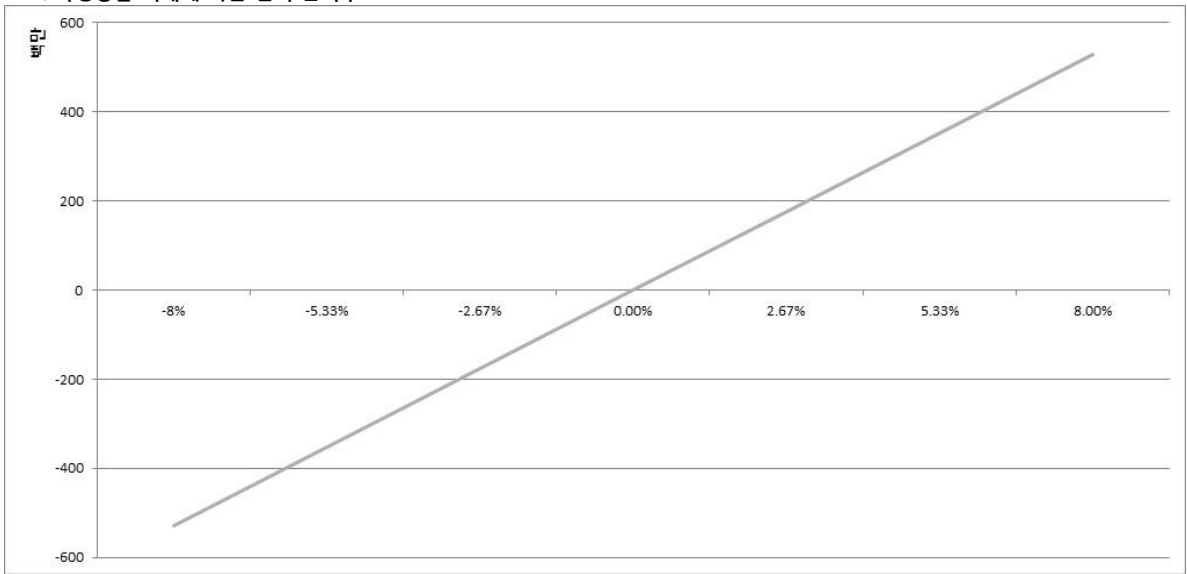
공시일: 2025-12-29

## 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	6,618	0	6,618	장외
합계			6,618	0	6,618	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

529

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-529,475,692	-352,983,794	-176,491,897	0	176,491,897	352,983,794	529,475,692
16.67%	-529,475,692	-352,983,794	-176,491,897	0	176,491,897	352,983,794	529,475,692
8.33%	-529,475,692	-352,983,794	-176,491,897	0	176,491,897	352,983,794	529,475,692
0%	-529,475,692	-352,983,794	-176,491,897	0	176,491,897	352,983,794	529,475,692
-8.33%	-529,475,692	-352,983,794	-176,491,897	0	176,491,897	352,983,794	529,475,692
-16.67%	-529,475,692	-352,983,794	-176,491,897	0	176,491,897	352,983,794	529,475,692
-25%	-529,475,692	-352,983,794	-176,491,897	0	176,491,897	352,983,794	529,475,692

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

274

# 펀드명 : 한화 PLUS 글로벌MSCI증권상장지수투자신탁(주식-파생)

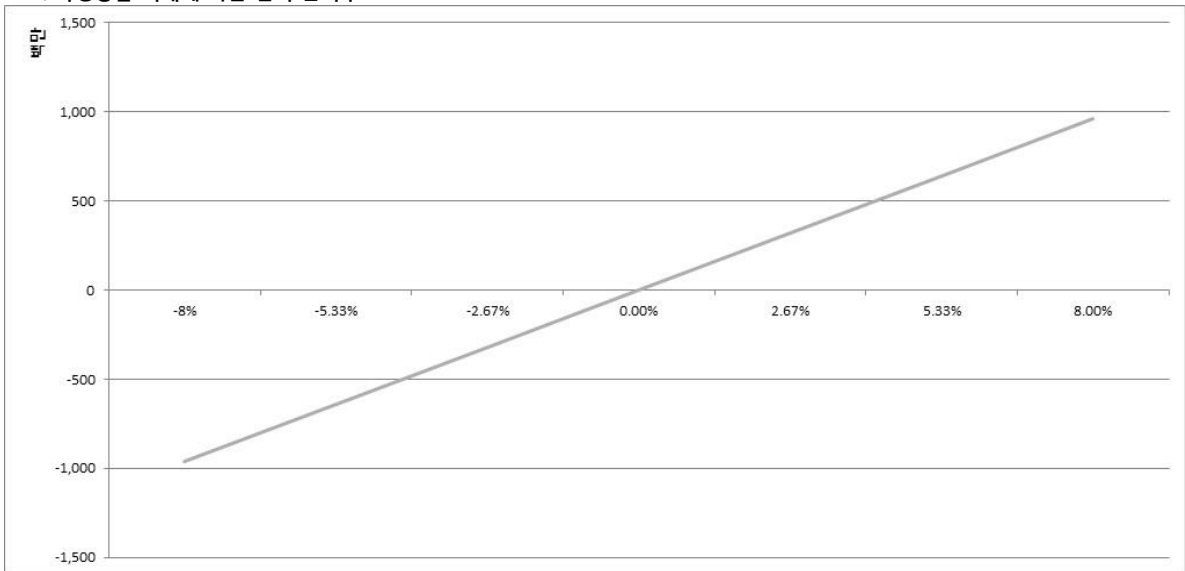
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	4,921	0	4,921	장외
누계	주가지수	스왑	11,978	0	11,978	장외
합계			11,978	0	11,978	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

958

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-958,262,379	-638,841,586	-319,420,793	0	319,420,793	638,841,586	958,262,379
16.67%	-958,262,379	-638,841,586	-319,420,793	0	319,420,793	638,841,586	958,262,379
8.33%	-958,262,379	-638,841,586	-319,420,793	0	319,420,793	638,841,586	958,262,379
0%	-958,262,379	-638,841,586	-319,420,793	0	319,420,793	638,841,586	958,262,379
-8.33%	-958,262,379	-638,841,586	-319,420,793	0	319,420,793	638,841,586	958,262,379
-16.67%	-958,262,379	-638,841,586	-319,420,793	0	319,420,793	638,841,586	958,262,379
-25%	-958,262,379	-638,841,586	-319,420,793	0	319,420,793	638,841,586	958,262,379

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

876

# 펀드명 : 한화 PLUS 선진국MSCI증권상장지수투자신탁(주식-파생)

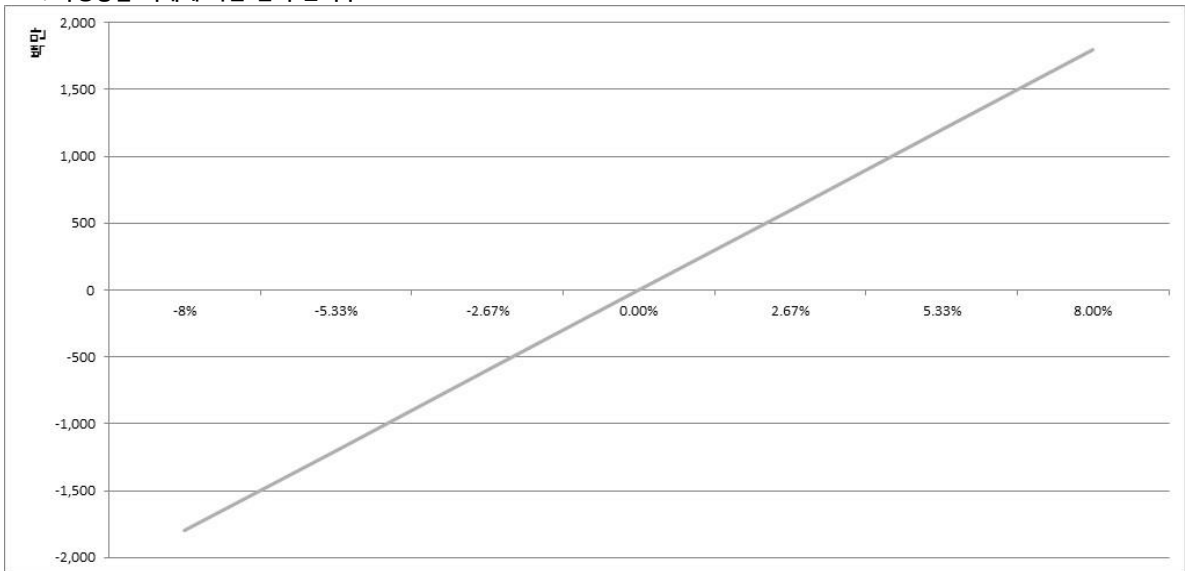
공시일: 2025-12-29

## 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	22,486	0	22,486	장외
합계			22,486	0	22,486	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,799

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-1,798,897,702	-1,199,265,135	-599,632,567	0	599,632,567	1,199,265,135	1,798,897,702
16.67%	-1,798,897,702	-1,199,265,135	-599,632,567	0	599,632,567	1,199,265,135	1,798,897,702
8.33%	-1,798,897,702	-1,199,265,135	-599,632,567	0	599,632,567	1,199,265,135	1,798,897,702
0%	-1,798,897,702	-1,199,265,135	-599,632,567	0	599,632,567	1,199,265,135	1,798,897,702
-8.33%	-1,798,897,702	-1,199,265,135	-599,632,567	0	599,632,567	1,199,265,135	1,798,897,702
-16.67%	-1,798,897,702	-1,199,265,135	-599,632,567	0	599,632,567	1,199,265,135	1,798,897,702
-25%	-1,798,897,702	-1,199,265,135	-599,632,567	0	599,632,567	1,199,265,135	1,798,897,702

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,615

# 펀드명 : 한화 PLUS 신흥국MSCI증권상장지수투자신탁(주식-파생)

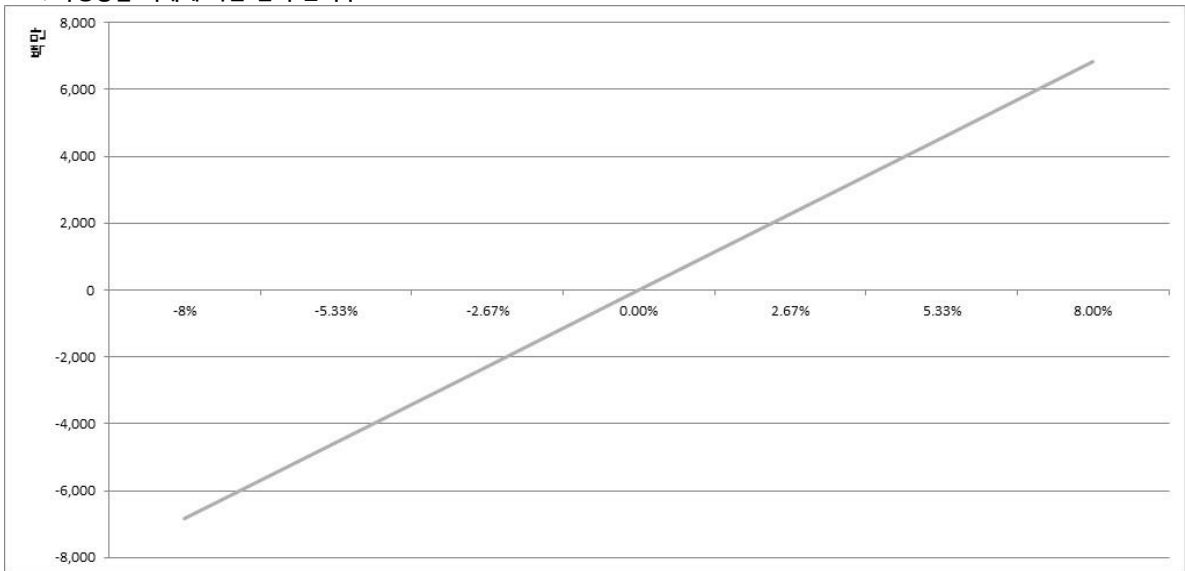
공시일: 2025-12-29

## 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	85,611	0	85,611	장외
합계			85,611	0	85,611	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

6,849

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-6,848,897,986	-4,565,931,991	-2,282,965,995	0	2,282,965,995	4,565,931,991	6,848,897,986
16.67%	-6,848,897,986	-4,565,931,991	-2,282,965,995	0	2,282,965,995	4,565,931,991	6,848,897,986
8.33%	-6,848,897,986	-4,565,931,991	-2,282,965,995	0	2,282,965,995	4,565,931,991	6,848,897,986
0%	-6,848,897,986	-4,565,931,991	-2,282,965,995	0	2,282,965,995	4,565,931,991	6,848,897,986
-8.33%	-6,848,897,986	-4,565,931,991	-2,282,965,995	0	2,282,965,995	4,565,931,991	6,848,897,986
-16.67%	-6,848,897,986	-4,565,931,991	-2,282,965,995	0	2,282,965,995	4,565,931,991	6,848,897,986
-25%	-6,848,897,986	-4,565,931,991	-2,282,965,995	0	2,282,965,995	4,565,931,991	6,848,897,986

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

5,503

# 펀드명 : 한화 PLUS 미국다우존스고배당주증권상장지수투자신탁

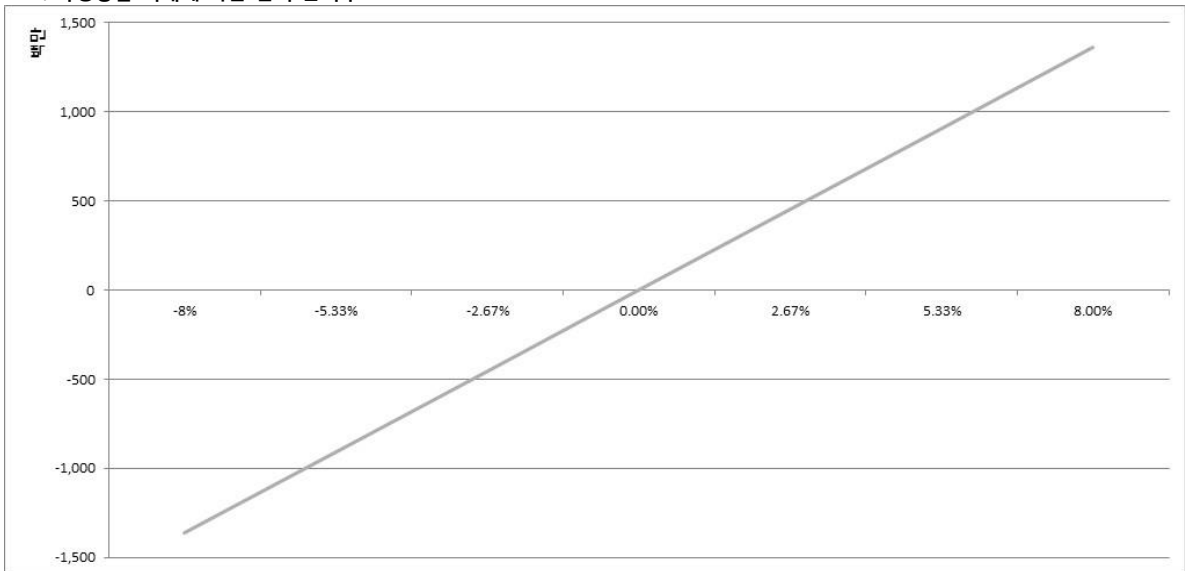
공시일: 2025-12-29

## 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	17,030	0	17,030	장외
합계			17,030	0	17,030	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

1,362

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-1,362,360,141	-908,240,096	-454,120,045	0	454,120,045	908,240,096	1,362,360,141
16.67%	-1,362,360,141	-908,240,096	-454,120,045	0	454,120,045	908,240,096	1,362,360,141
8.33%	-1,362,360,141	-908,240,096	-454,120,045	0	454,120,045	908,240,096	1,362,360,141
0%	-1,362,360,141	-908,240,096	-454,120,045	0	454,120,045	908,240,096	1,362,360,141
-8.33%	-1,362,360,141	-908,240,096	-454,120,045	0	454,120,045	908,240,096	1,362,360,141
-16.67%	-1,362,360,141	-908,240,096	-454,120,045	0	454,120,045	908,240,096	1,362,360,141
-25%	-1,362,360,141	-908,240,096	-454,120,045	0	454,120,045	908,240,096	1,362,360,141

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,271

# 펀드명 : 한화 PLUS 스마트베타Quality채권혼합증권상장지수투

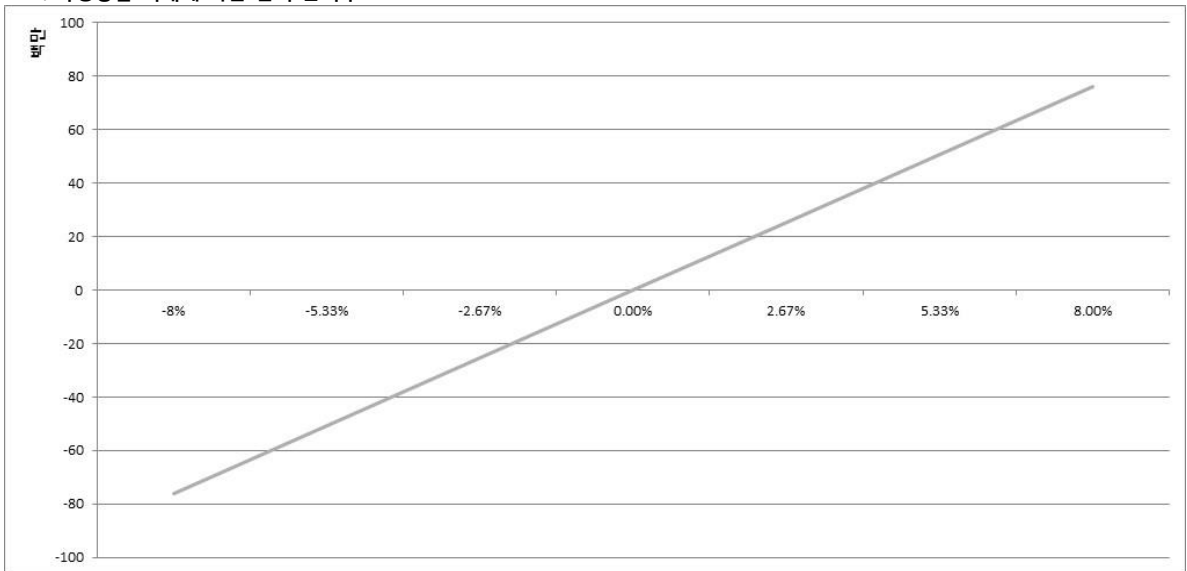
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	528	0	528	장내
누계	유가증권	선물	951	0	951	장내
합계			951	0	951	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

76

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-75,895,200	-50,596,800	-25,298,400	0	25,298,400	50,596,800	75,895,200
16.67%	-75,895,200	-50,596,800	-25,298,400	0	25,298,400	50,596,800	75,895,200
8.33%	-75,895,200	-50,596,800	-25,298,400	0	25,298,400	50,596,800	75,895,200
0%	-75,895,200	-50,596,800	-25,298,400	0	25,298,400	50,596,800	75,895,200
-8.33%	-75,895,200	-50,596,800	-25,298,400	0	25,298,400	50,596,800	75,895,200
-16.67%	-75,895,200	-50,596,800	-25,298,400	0	25,298,400	50,596,800	75,895,200
-25%	-75,895,200	-50,596,800	-25,298,400	0	25,298,400	50,596,800	75,895,200

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6

# 펀드명 : 한화 PLUS 고배당주채권혼합증권상장지수투자신탁(채)

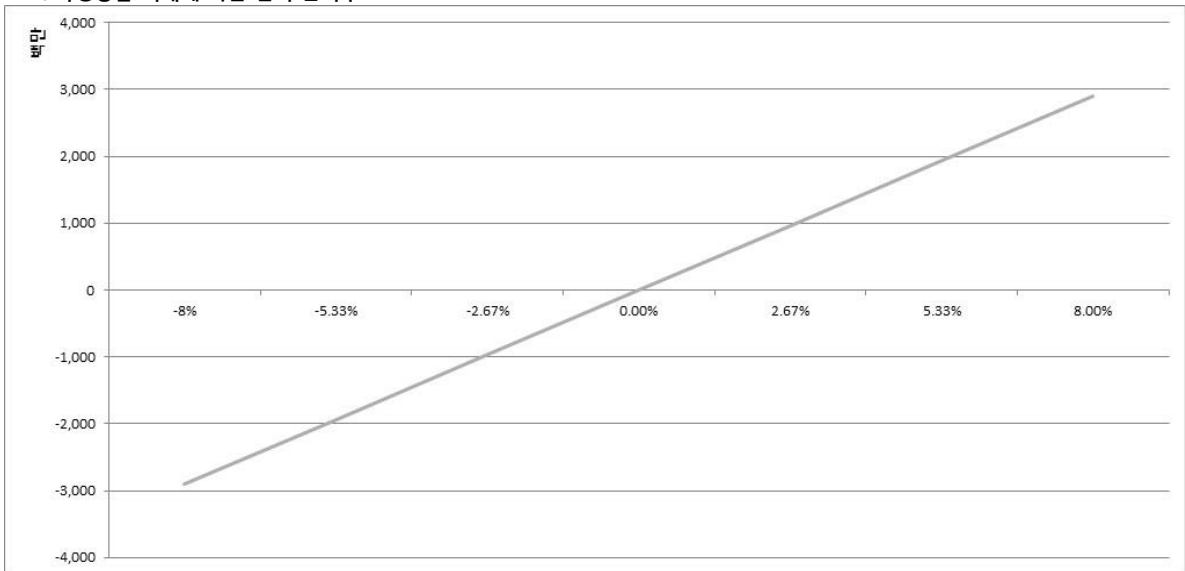
공시일: 2025-12-29

## 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	36,337	0	36,337	장내
합계			36,337	0	36,337	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

2,901

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,900,883,200	-1,933,922,133	-966,961,067	0	966,961,067	1,933,922,133	2,900,883,200
16.67%	-2,900,883,200	-1,933,922,133	-966,961,067	0	966,961,067	1,933,922,133	2,900,883,200
8.33%	-2,900,883,200	-1,933,922,133	-966,961,067	0	966,961,067	1,933,922,133	2,900,883,200
0%	-2,900,883,200	-1,933,922,133	-966,961,067	0	966,961,067	1,933,922,133	2,900,883,200
-8.33%	-2,900,883,200	-1,933,922,133	-966,961,067	0	966,961,067	1,933,922,133	2,900,883,200
-16.67%	-2,900,883,200	-1,933,922,133	-966,961,067	0	966,961,067	1,933,922,133	2,900,883,200
-25%	-2,900,883,200	-1,933,922,133	-966,961,067	0	966,961,067	1,933,922,133	2,900,883,200

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

225

# 펀드명 : 한화 PLUS 200선물인버스2X증권상장지수투자신탁(주식)

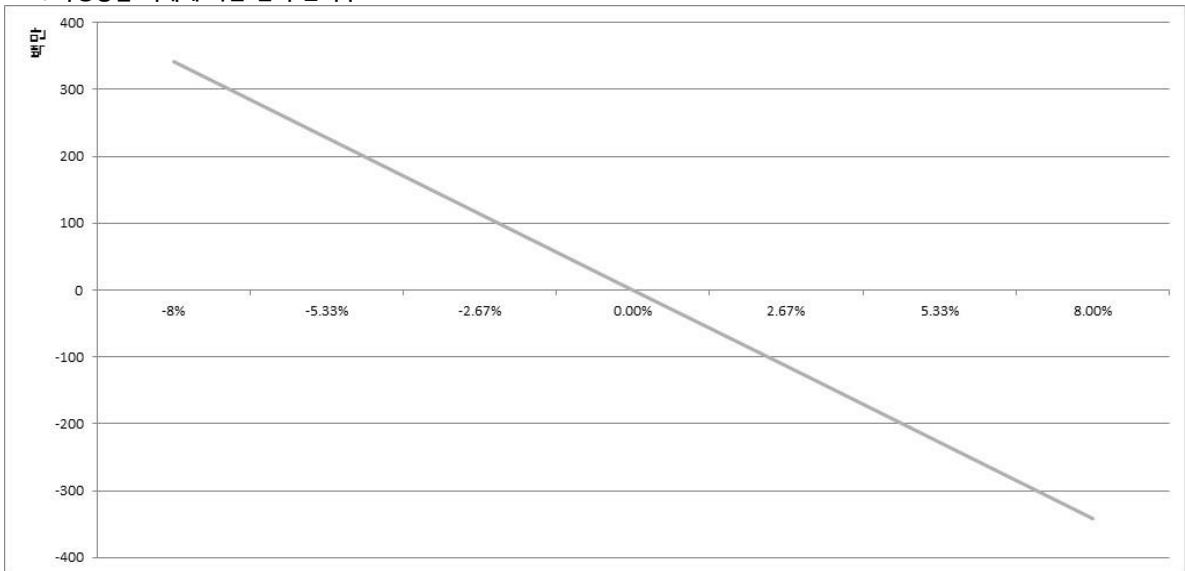
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	148	0	148	장내
누계	주가지수	선물	0	4,278	-4,278	장내
합계			0	4,278	-4,278	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

342

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	342,171,000	228,114,000	114,057,000	0	-114,057,000	-228,114,000	-342,171,000
16.67%	342,171,000	228,114,000	114,057,000	0	-114,057,000	-228,114,000	-342,171,000
8.33%	342,171,000	228,114,000	114,057,000	0	-114,057,000	-228,114,000	-342,171,000
0%	342,171,000	228,114,000	114,057,000	0	-114,057,000	-228,114,000	-342,171,000
-8.33%	342,171,000	228,114,000	114,057,000	0	-114,057,000	-228,114,000	-342,171,000
-16.67%	342,171,000	228,114,000	114,057,000	0	-114,057,000	-228,114,000	-342,171,000
-25%	342,171,000	228,114,000	114,057,000	0	-114,057,000	-228,114,000	-342,171,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

455

# 펀드명 : 한화 PLUS 200선물레버리지증권상장지수투자신탁(주식)

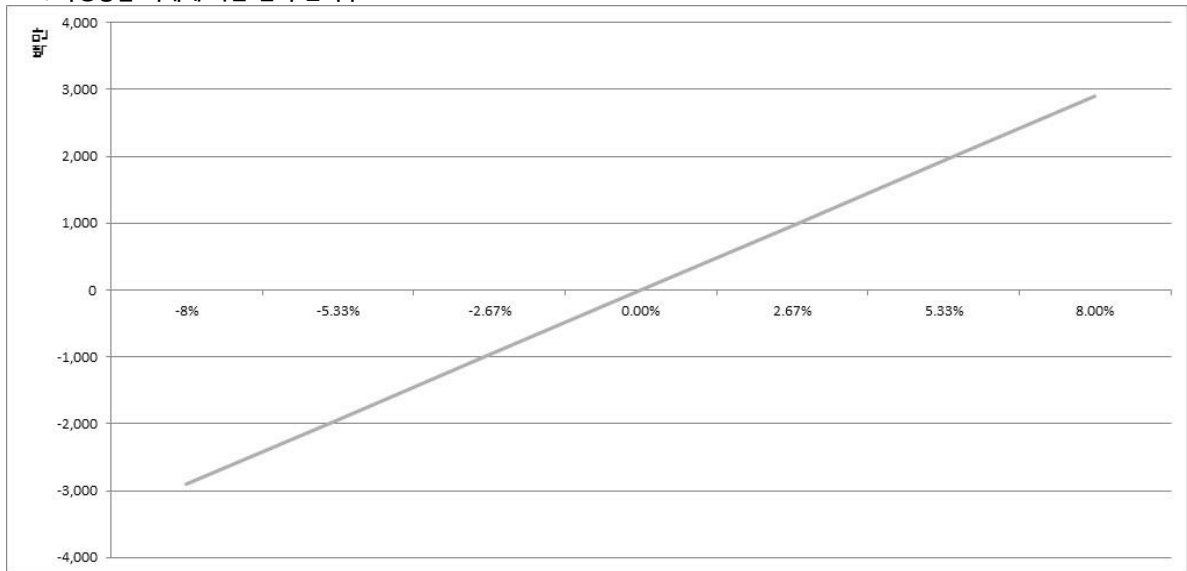
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	443	0	443	장내
누계	주가지수	선물	36,290	0	36,290	장내
합계			36,290	0	36,290	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,903

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,902,554,000	-1,935,036,000	-967,518,000	0	967,518,000	1,935,036,000	2,902,554,000
16.67%	-2,902,554,000	-1,935,036,000	-967,518,000	0	967,518,000	1,935,036,000	2,902,554,000
8.33%	-2,902,554,000	-1,935,036,000	-967,518,000	0	967,518,000	1,935,036,000	2,902,554,000
0%	-2,902,554,000	-1,935,036,000	-967,518,000	0	967,518,000	1,935,036,000	2,902,554,000
-8.33%	-2,902,554,000	-1,935,036,000	-967,518,000	0	967,518,000	1,935,036,000	2,902,554,000
-16.67%	-2,902,554,000	-1,935,036,000	-967,518,000	0	967,518,000	1,935,036,000	2,902,554,000
-25%	-2,902,554,000	-1,935,036,000	-967,518,000	0	967,518,000	1,935,036,000	2,902,554,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

3,860

# 펀드명 : 한화 PLUS 심천차이넥스트증권상장지수투자신탁(주식-

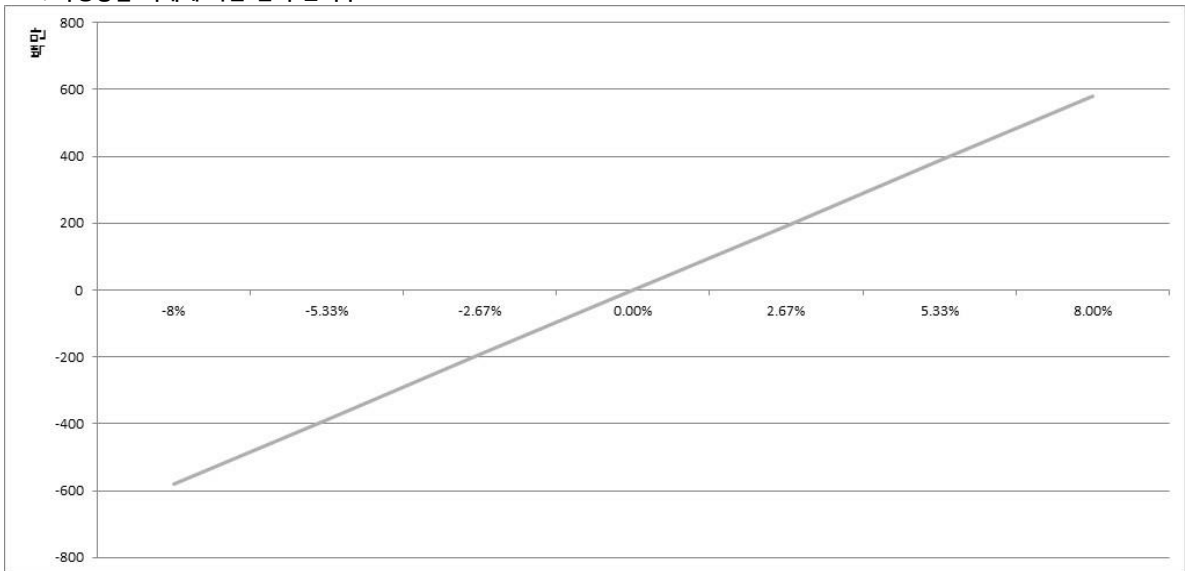
공시일: 2025-12-29

## 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	7,254	0	7,254	장외
합계			7,254	0	7,254	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

580

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-580,340,321	-386,893,547	-193,446,774	0	193,446,774	386,893,547	580,340,321
16.67%	-580,340,321	-386,893,547	-193,446,774	0	193,446,774	386,893,547	580,340,321
8.33%	-580,340,321	-386,893,547	-193,446,774	0	193,446,774	386,893,547	580,340,321
0%	-580,340,321	-386,893,547	-193,446,774	0	193,446,774	386,893,547	580,340,321
-8.33%	-580,340,321	-386,893,547	-193,446,774	0	193,446,774	386,893,547	580,340,321
-16.67%	-580,340,321	-386,893,547	-193,446,774	0	193,446,774	386,893,547	580,340,321
-25%	-580,340,321	-386,893,547	-193,446,774	0	193,446,774	386,893,547	580,340,321

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

978

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

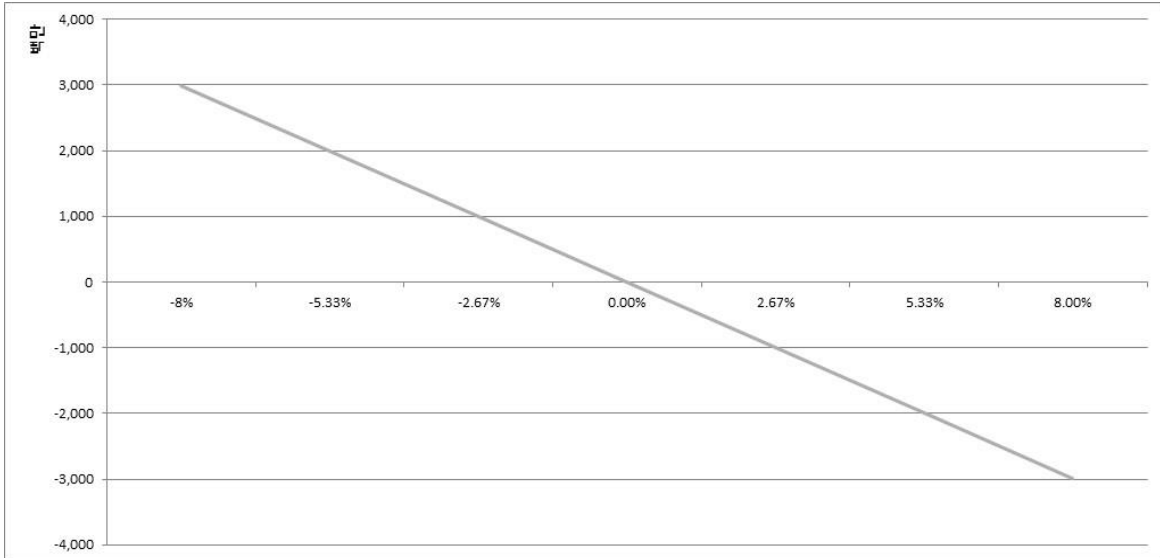
공시일: 2025-12-29

## 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	37,534	-37,534	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	1,504	0	1,504	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	21	-21	장외
합계			1,504	37,554	-36,050	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

3,000

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)

2,711

# 펀드명 : 한화 PLUS 국채선물10년증권상장지수투자신탁(채권-파

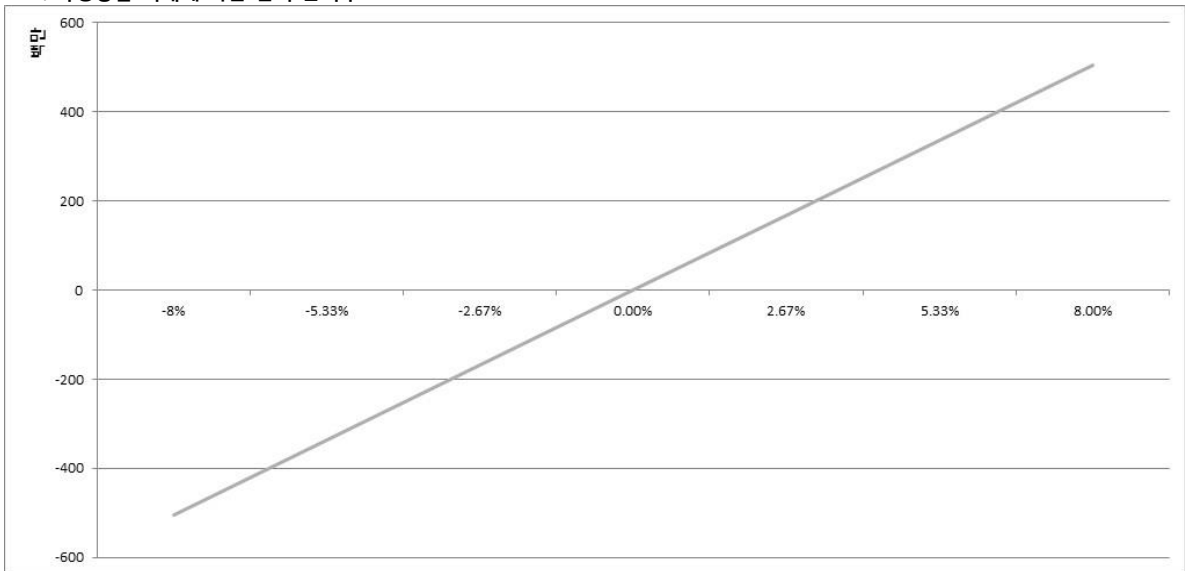
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	680	0	680	장내
누계	유가증권	선물	6,342	0	6,342	장내
합계			6,342	0	6,342	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

505

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-505,254,400	-336,836,267	-168,418,133	0	168,418,133	336,836,267	505,254,400
16.67%	-505,254,400	-336,836,267	-168,418,133	0	168,418,133	336,836,267	505,254,400
8.33%	-505,254,400	-336,836,267	-168,418,133	0	168,418,133	336,836,267	505,254,400
0%	-505,254,400	-336,836,267	-168,418,133	0	168,418,133	336,836,267	505,254,400
-8.33%	-505,254,400	-336,836,267	-168,418,133	0	168,418,133	336,836,267	505,254,400
-16.67%	-505,254,400	-336,836,267	-168,418,133	0	168,418,133	336,836,267	505,254,400
-25%	-505,254,400	-336,836,267	-168,418,133	0	168,418,133	336,836,267	505,254,400

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

125

# 펀드명 : 한화 PLUS 국채선물3년증권상장지수투자신탁(채권-파

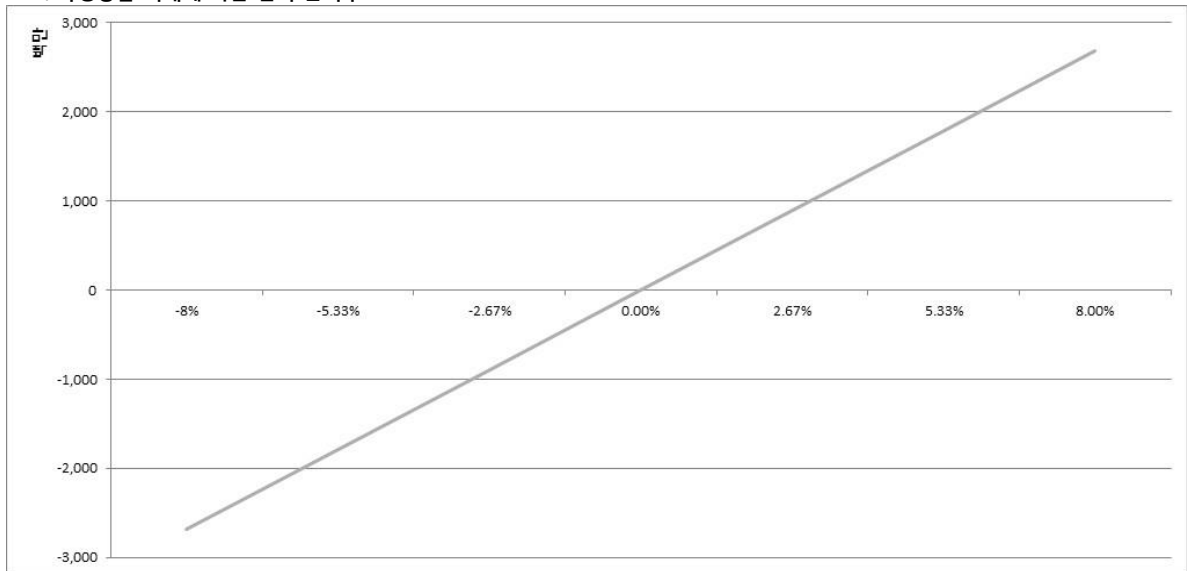
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,056	0	1,056	장내
누계	유가증권	선물	33,696	0	33,696	장내
합계			33,696	0	33,696	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

2,690

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-2,690,063,200	-1,793,375,467	-896,687,733	0	896,687,733	1,793,375,467	2,690,063,200
16.67%	-2,690,063,200	-1,793,375,467	-896,687,733	0	896,687,733	1,793,375,467	2,690,063,200
8.33%	-2,690,063,200	-1,793,375,467	-896,687,733	0	896,687,733	1,793,375,467	2,690,063,200
0%	-2,690,063,200	-1,793,375,467	-896,687,733	0	896,687,733	1,793,375,467	2,690,063,200
-8.33%	-2,690,063,200	-1,793,375,467	-896,687,733	0	896,687,733	1,793,375,467	2,690,063,200
-16.67%	-2,690,063,200	-1,793,375,467	-896,687,733	0	896,687,733	1,793,375,467	2,690,063,200
-25%	-2,690,063,200	-1,793,375,467	-896,687,733	0	896,687,733	1,793,375,467	2,690,063,200

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

209

# 펀드명 : 한화 PLUS 코스닥150선물인버스증권상장지수투자신탁(

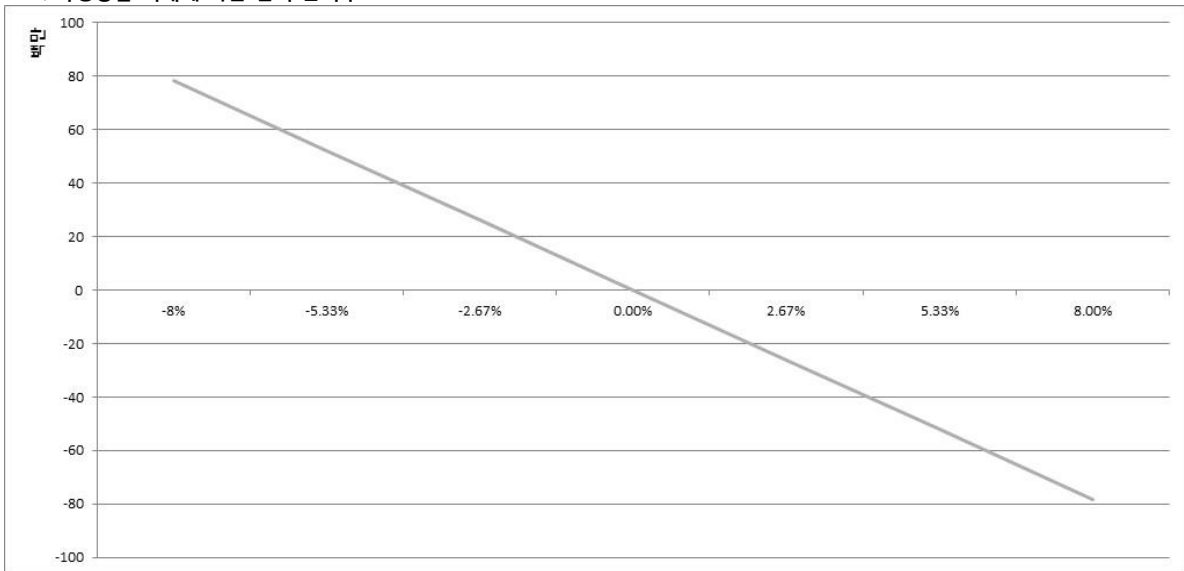
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	15	0	15	장내
누계	주가지수	선물	0	971	-971	장내
합계			0	971	-971	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

78

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	78,230,880	52,153,920	26,076,960	0	-26,076,960	-52,153,920	-78,230,880
16.67%	78,230,880	52,153,920	26,076,960	0	-26,076,960	-52,153,920	-78,230,880
8.33%	78,230,880	52,153,920	26,076,960	0	-26,076,960	-52,153,920	-78,230,880
0%	78,230,880	52,153,920	26,076,960	0	-26,076,960	-52,153,920	-78,230,880
-8.33%	78,230,880	52,153,920	26,076,960	0	-26,076,960	-52,153,920	-78,230,880
-16.67%	78,230,880	52,153,920	26,076,960	0	-26,076,960	-52,153,920	-78,230,880
-25%	78,230,880	52,153,920	26,076,960	0	-26,076,960	-52,153,920	-78,230,880

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

114

# 펀드명 : 한화 PLUS 미국테크TOP10레버리지증권상장지수투자신

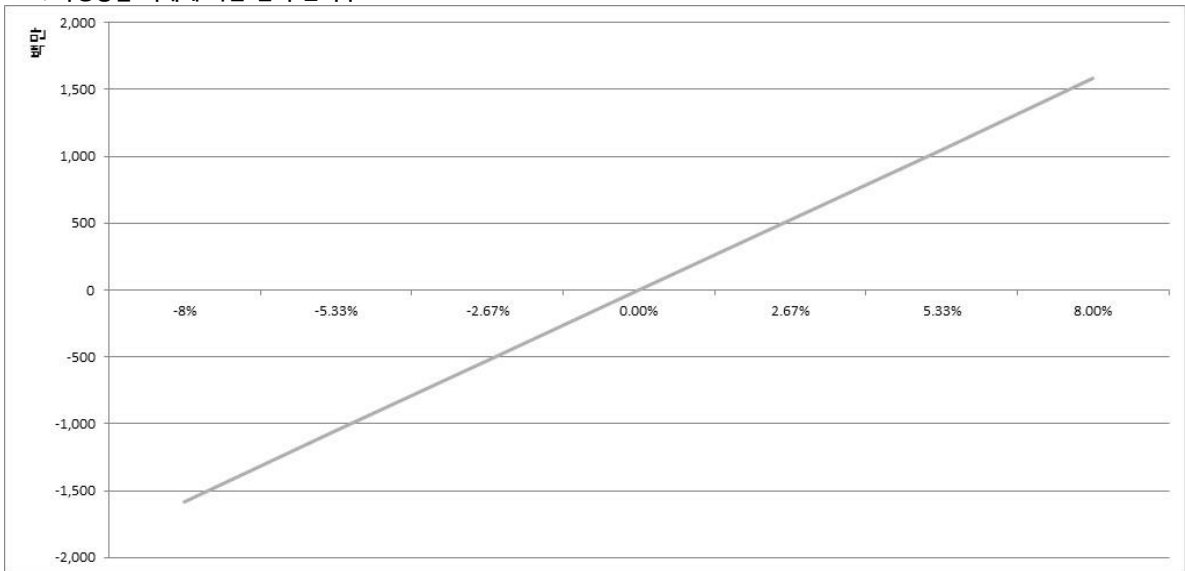
공시일: 2025-12-29

## 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	19,770	0	19,770	장외
합계			19,770	0	19,770	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,582

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-1,581,633,588	-1,054,422,392	-527,211,196	0	527,211,196	1,054,422,392	1,581,633,588
16.67%	-1,581,633,588	-1,054,422,392	-527,211,196	0	527,211,196	1,054,422,392	1,581,633,588
8.33%	-1,581,633,588	-1,054,422,392	-527,211,196	0	527,211,196	1,054,422,392	1,581,633,588
0%	-1,581,633,588	-1,054,422,392	-527,211,196	0	527,211,196	1,054,422,392	1,581,633,588
-8.33%	-1,581,633,588	-1,054,422,392	-527,211,196	0	527,211,196	1,054,422,392	1,581,633,588
-16.67%	-1,581,633,588	-1,054,422,392	-527,211,196	0	527,211,196	1,054,422,392	1,581,633,588
-25%	-1,581,633,588	-1,054,422,392	-527,211,196	0	527,211,196	1,054,422,392	1,581,633,588

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,735

# 펀드명 : 한화 PLUS 일본엔화초단기국채증권상장지수투자신탁(

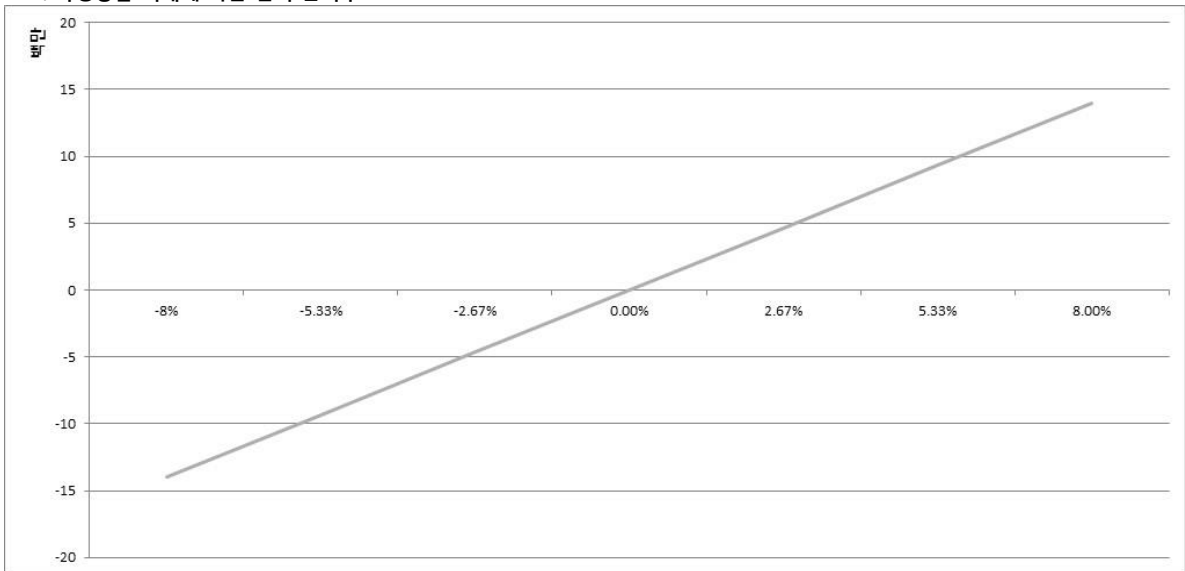
공시일: 2025-12-29

## 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	175	0	175	장외
합계			175	0	175	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-13,971,614	-9,314,409	-4,657,205	0	4,657,205	9,314,409	13,971,614
16.67%	-13,971,614	-9,314,409	-4,657,205	0	4,657,205	9,314,409	13,971,614
8.33%	-13,971,614	-9,314,409	-4,657,205	0	4,657,205	9,314,409	13,971,614
0%	-13,971,614	-9,314,409	-4,657,205	0	4,657,205	9,314,409	13,971,614
-8.33%	-13,971,614	-9,314,409	-4,657,205	0	4,657,205	9,314,409	13,971,614
-16.67%	-13,971,614	-9,314,409	-4,657,205	0	4,657,205	9,314,409	13,971,614
-25%	-13,971,614	-9,314,409	-4,657,205	0	4,657,205	9,314,409	13,971,614

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

9

# 펀드명 : 한화 PLUS 고배당주위클리커버드콜증권상장지수투자신

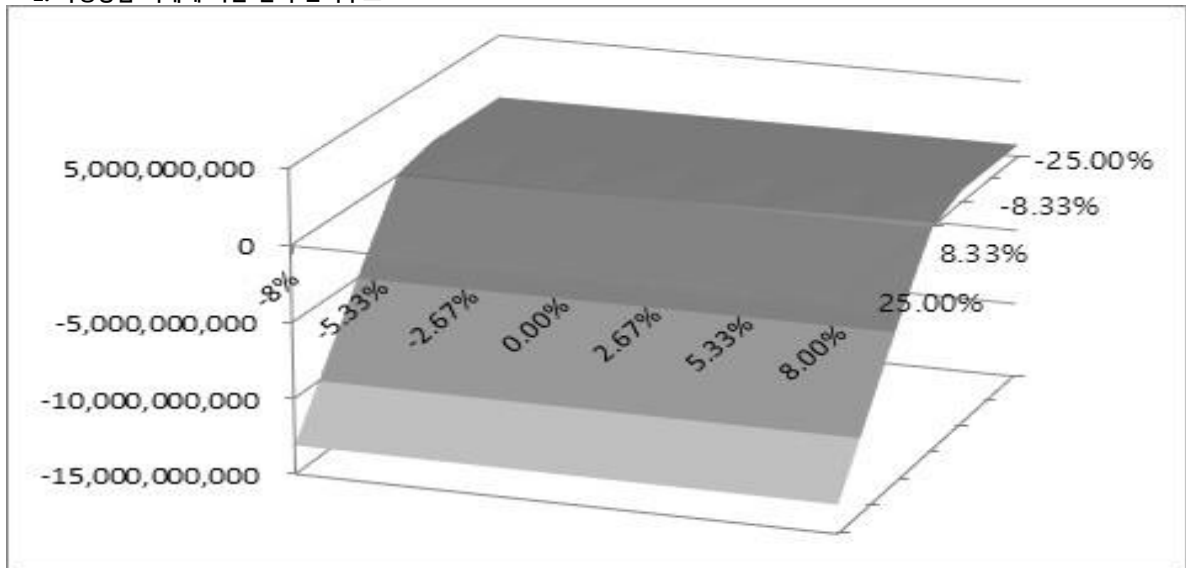
공시일: 2025-12-29

## 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	168,173	-168,173	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	854	0	854	장내
합계			854	168,173	-167,319	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

13,090

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)

1,222

# 펀드명 : 한화 PLUS 미국배당증가성장주데일리커버드콜증권상장

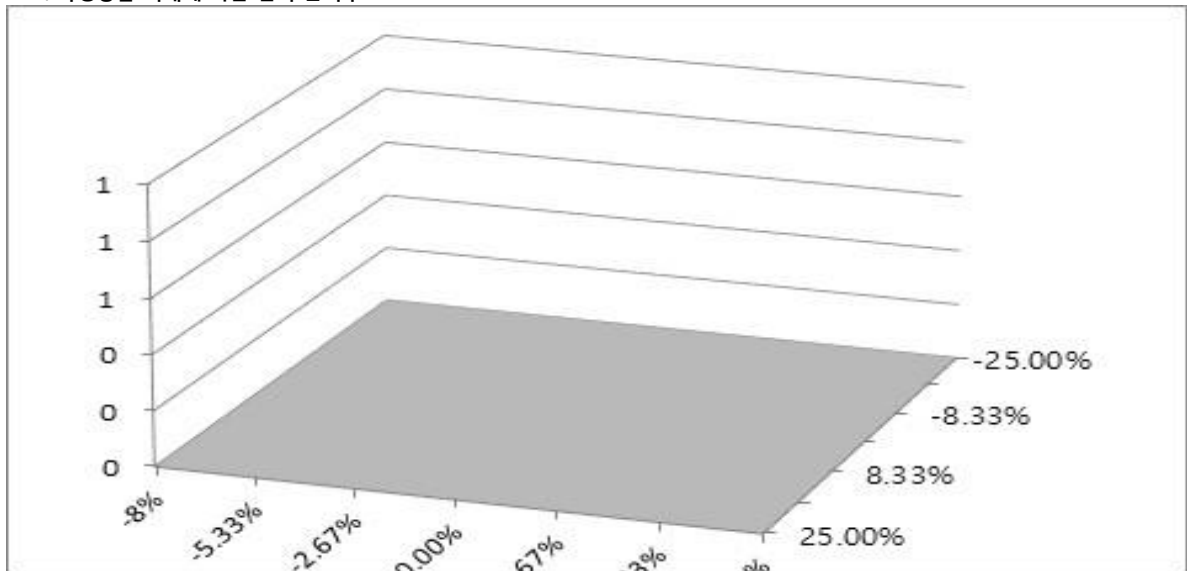
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	옵션	9	2,507	-2,498	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,507	-2,507	장내
합계			0	2,507	-2,507	

## 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%	0	0	0	0	0	0	0
16.67%	0	0	0	0	0	0	0
8.33%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
-8.33%	0	0	0	0	0	0	0
-16.67%	0	0	0	0	0	0	0
-25%	0	0	0	0	0	0	0

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,119

# 펀드명 : 한화 PLUS 고배당주위클리고정커버드콜증권상장지수투

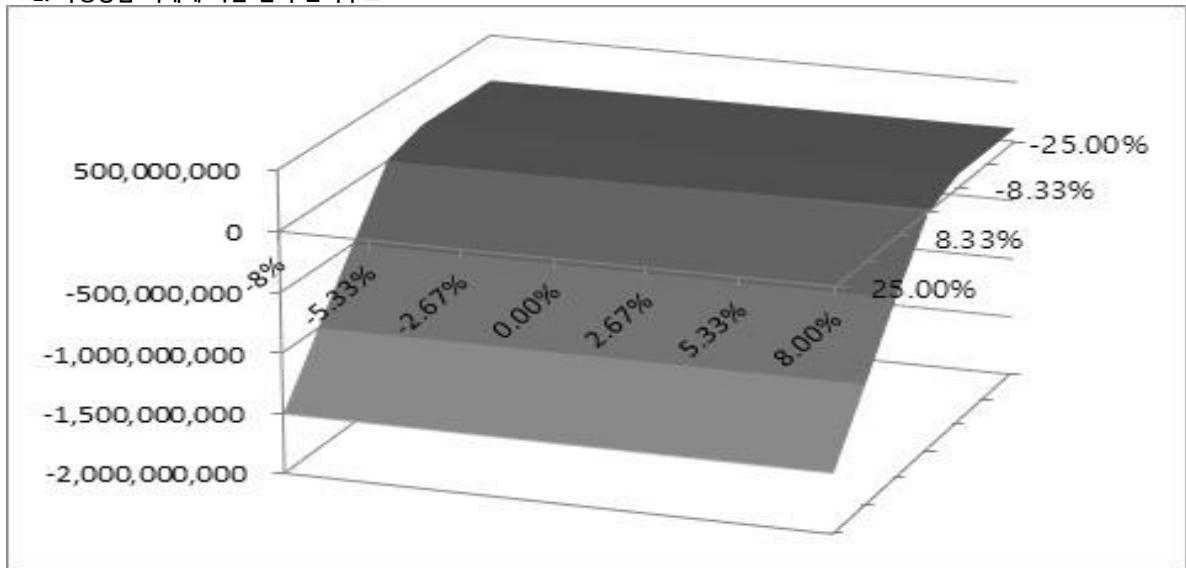
공시일: 2025-12-29

## 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	19,178	-19,178	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21	0	21	장내
합계			21	19,178	-19,156	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,510

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)

312

# 펀드명 : 한화 PLUS K방산레버리지증권상장지수투자신탁(주식-

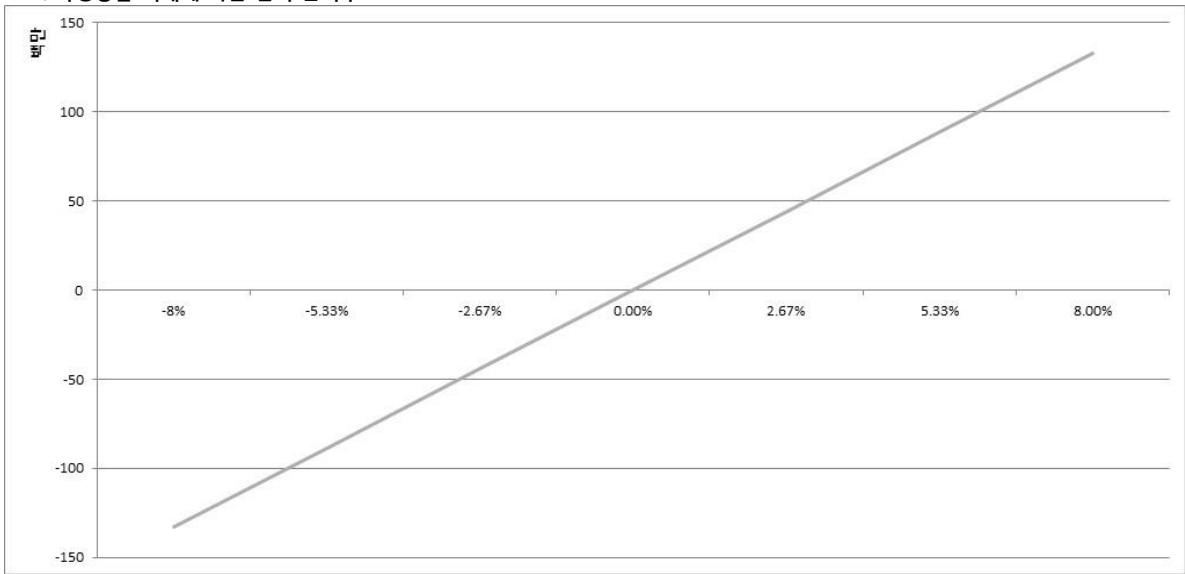
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	113	-113	장내
누계	유가증권	선물	9,770	0	9,770	장내
합계			9,770	0	9,770	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

133

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)

2,087

# 펀드명 : 한화 PLUS 차이나항생테크위클리타겟커버드콜증권상장

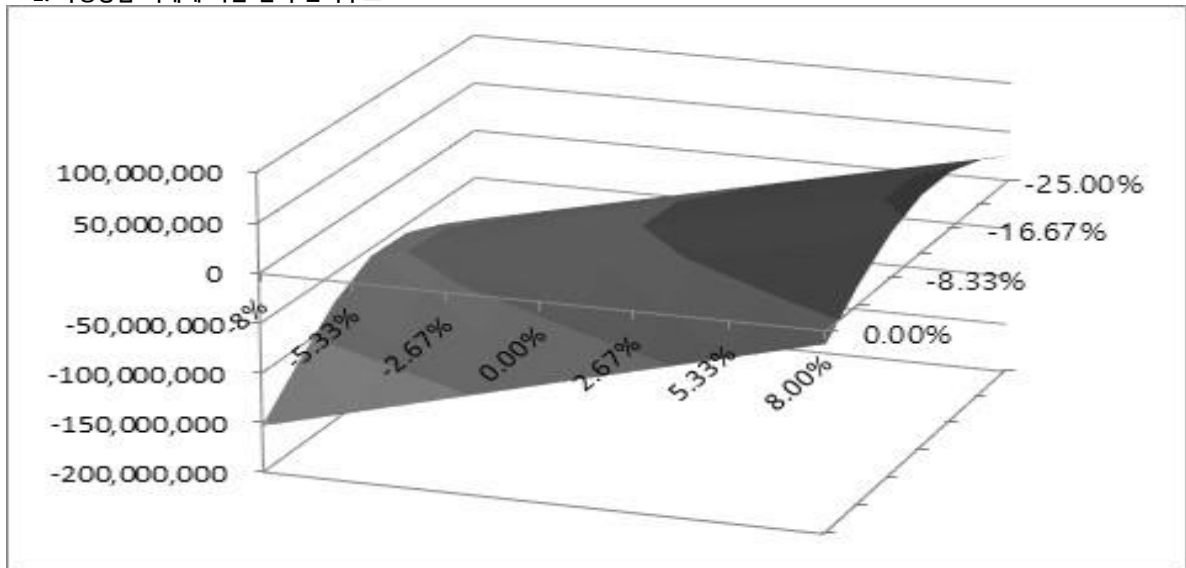
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	옵션	0	2,252	-2,251	장내
누계	주가지수	옵션	0	2,252	-2,252	장내
신규	주가지수	선물	819	819	0	장내
누계	주가지수	선물	819	0	819	장내
합계			819	2,252	-1,433	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

153

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-94,358,306	-74,603,942	-58,837,797	-57,766,248	-78,724,431	-113,887,638	-153,163,425
16.67%	-74,213,896	-54,238,119	-39,156,219	-38,510,890	-57,974,092	-91,299,869	-129,546,939
8.33%	-54,109,419	-34,033,273	-19,620,017	-19,255,476	-37,366,759	-68,894,381	-105,996,976
0%	-34,063,901	-13,991,162	-201,176	0	-16,874,282	-46,667,298	-82,535,783
-8.33%	-14,094,511	5,893,864	19,122,216	19,255,545	3,525,148	-24,608,224	-59,180,609
-16.67%	5,785,267	25,631,638	38,367,308	38,511,166	23,848,480	-2,703,639	-35,942,822
-25%	25,566,200	45,233,915	57,547,589	57,766,868	44,108,978	19,060,952	-12,828,352

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,270

## 펀드명 : PLUS 테슬라위클리커버드콜채권혼합-파생

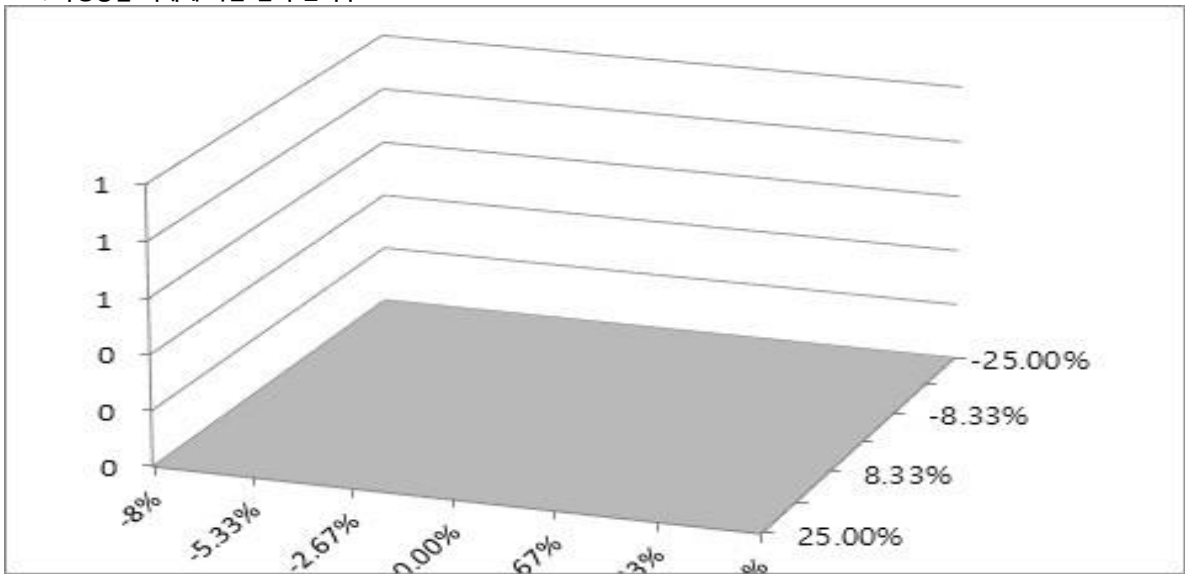
공시일: 2025-12-29

### 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	3,932	-3,932	장내
합계			0	3,932	-3,932	

### 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%	0	0	0	0	0	0	0
16.67%	0	0	0	0	0	0	0
8.33%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
-8.33%	0	0	0	0	0	0	0
-16.67%	0	0	0	0	0	0	0
-25%	0	0	0	0	0	0	0

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,557

# 펀드명 : 한화2.2배레버리지인덱스증권투자신탁(주식-파생재간)

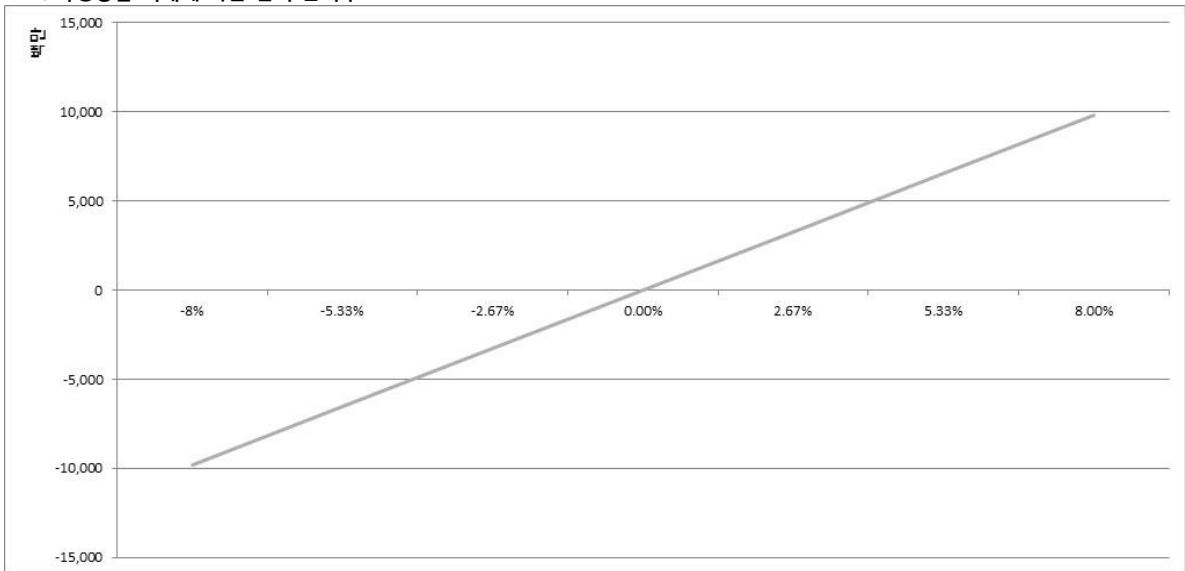
공시일: 2025-12-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	122,589	0	122,589	장내
합계			122,589	0	122,589	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

9,805

변동성	기초자산의 가격						
	-8%	-5.33%	-2.67%	0%	2.67%	5.33%	8%
25%	-9,804,969,000	-6,536,646,000	-3,268,323,000	0	3,268,323,000	6,536,646,000	9,804,969,000
16.67%	-9,804,969,000	-6,536,646,000	-3,268,323,000	0	3,268,323,000	6,536,646,000	9,804,969,000
8.33%	-9,804,969,000	-6,536,646,000	-3,268,323,000	0	3,268,323,000	6,536,646,000	9,804,969,000
0%	-9,804,969,000	-6,536,646,000	-3,268,323,000	0	3,268,323,000	6,536,646,000	9,804,969,000
-8.33%	-9,804,969,000	-6,536,646,000	-3,268,323,000	0	3,268,323,000	6,536,646,000	9,804,969,000
-16.67%	-9,804,969,000	-6,536,646,000	-3,268,323,000	0	3,268,323,000	6,536,646,000	9,804,969,000
-25%	-9,804,969,000	-6,536,646,000	-3,268,323,000	0	3,268,323,000	6,536,646,000	9,804,969,000

(단위: 백만원)

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

13,038

# 펀드명 : 한화차이나H 스피드업1.5배증권 모투자신탁(주식-파생)

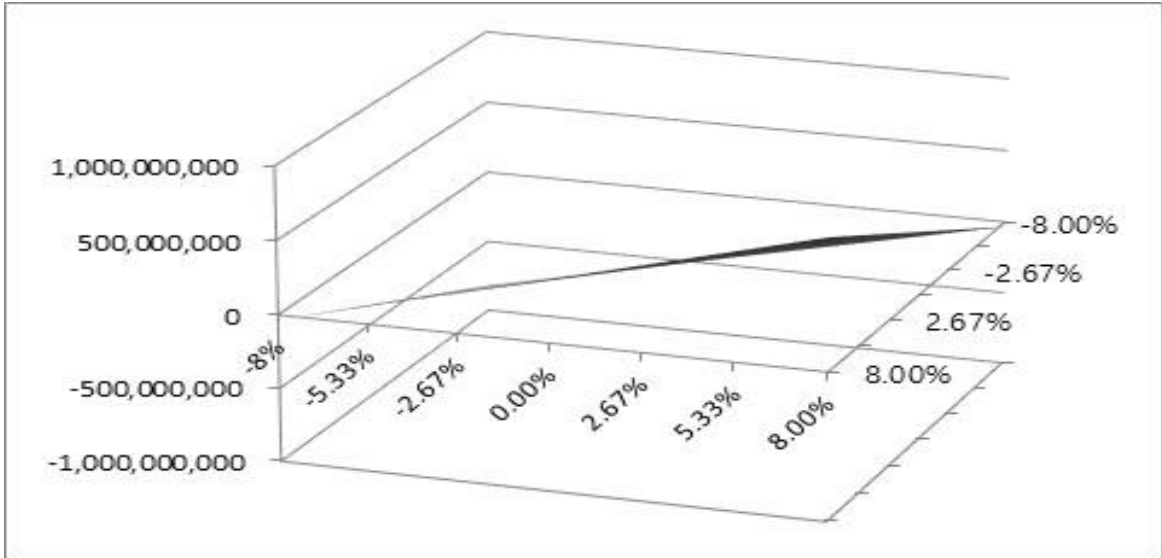
공시일: 2025-12-29

## 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	650	-650	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	5,310	0	5,310	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	40	-40	장외
합계			5,310	689	4,620	

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

817

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)

658