# 자산운용보고서

보고서 기준일 : 2026년 02월 15일

펀드코드 : 46571

# 하나 파워1.5배레버리지인덱스 증권투자신탁 [주식-파생형]

하나자산운용

하나자산운용

# 하나파워1.5배레버리지인덱스증권투자신탁[주식-파생형]

## 1. 펀드의 개요

### ▶ 기본정보

| 펀드명 | 하나파워1.5배레버리지인덱스증권투자신탁[주식-파생형] |
|---|---|
| 투자위험등급 | 1등급 |
| 고난도펀드 | 해당 |
| 금융투자협회펀드코드 | 28621 |
| 펀드의 종류 | 투자신탁,증권펀드(주식파생형), 개방형, 추가형, 종류형 |
| 보고대상 운용기간 | 2025.11.16 ~ 2026.02.15 |
| 신탁업자 | NH농협은행 |
| 최초설정일 | 2010.08.16 |
| 존속기간 | 설정일~신탁계약의 해지일 |
| 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 판매회사 | KB증권,SC제일은행,대신증권,하나은행,하나증권 |
| 레버리지(차입 등) 한도[1] | |
| 상품의 특징 | 이 투자신탁은 국내 주식 및 국내 주식관련 장내파생상품을 법 시행령 제94조제2항제4호에서 규정하는 주된 투자대상자산으로 하여 KOSPI 200 지수 일일등락률의 1.5배 수익을 추적하는 것을 목적으로 합니다.<br>그러나 이 투자신탁의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 집합투자업자·판매회사·신탁업자 등 이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 수익자에 대해 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다. |

| 펀드가 발행하는 집합투자증권의 종류 | 종류(클래스) | 금융투자협회펀드코드 |
|---|---|---|
| | ClassA | 28622 |
| | ClassA-U | AH571 |
| | ClassC | 28624 |
| | ClassC-E | 28625 |

[1]레버리지(차입 등) 한도의 경우, 일반 사모집합투자기구에 한하여 작성

### ▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 백만원)

| 성명 | 직위 | 나이 | 운용중인 펀드 현황 | | 성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모 | | 협회 등록 번호 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 펀드개수 | 운용규모 | 펀드개수 | 운용규모 | |
| 김상율(책임) | 부장 | 40 | 33 | 2,826,288 | 0 | 0 | 2116000704 |
| 배성영 | 과장 | 36 | 15 | 1,197,748 | 0 | 0 | 2119000419 |

※ 성명 뒤 (책임)으로 표시된 운용역이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.
※ 모자형 투자신탁이나 종류형투자신탁의 경우에는, 펀드개수 및 운용규모를 운용펀드 단위로 집계한 수치입니다.

### ▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|---|---|
| 2025.06.18~ 현재 [부] | 배성영 |
| 2022.02.17 ~ 현재[주] | 김상율 |
| 2022.02.18~2025.06.17 [부] | 김태수 |

※ 펀드의 운용전문인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 페이지에서 확인할 수 있습니다. (인터넷 주소 http://dis.kofia.or.kr) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

### ▶ 운용경과

운용기간 동안 국내 증시는 반도체 업황 개선 기대와 글로벌 AI 투자 확대를 중심으로 강한 상승 흐름을 보였으나, 운용기간 중 AI 밸류에이션 부담과 주요국 통화정책 불확실성 등으로 변동성이 확대되는 모습을 보였습니다. 특히 반도체 업종은 AI 서버 수요 확대와 메모리 슈퍼사이클 기대가 부각되며 삼성전자와 SK하이닉스를 중심으로 지수 상승을 견인했습니다. 이와 함께 글로벌 빅테크의 CAPEX 확대 기대와 마이크론의 어닝 서프라이즈 등이 투자심리를 개선시키는 요인으로 작용했습니다. 한편 외국인은 반도체와 자동차 업종 중심으로 매매를 반복하며 시장 변동성을 확대시켰으나, 패시브 ETF 자금 유입과 개인 투자자의 성장 테마 선호가 이를 일부 상쇄했습니다. 금리 동결 기조와 환율 변동, 글로벌 정책 변화 등 거시환경 불확실성 속에서도 기업 실적 가시성과 반도체 중심의 이익 모멘텀이 부각되며 국내 증시는 여타 신흥국 대비 차별화된 흐름을 보였습니다. 또한 변동성이 확대되는 구간에서는 고배당 및 실적 안정성이 높은 가치주가 상대적으로 견조한 흐름을 보이며 시장의 방어 역할을 수행했습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용 계획

향후 국내 증시는 단기 급등에 따른 피로감을 소화하며 주도주 내에서 로테이션이 발생할 확률이 있습니다. 코스피가 6,000pt를 상회하는 구간에서 밸류에이션 부담이 제기될 수 있으나, 선행 PER이 장기 평균 수준인 10.4배에 머물고 있어 실적 뒷받침이 확인되는 종목들을 중심으로 추가 상승 여력이 존재할 수 있습니다. 국내 정책 측면에서는 3차 상법 개정안 통과 이후 기업들의 실질적인 지배구조 개선과 주주 환원 정책 강화 여부가 핵심 관전 포인트가 될 것입니다. 주주총회 시즌을 맞아 자본 효율성 제고 계획을 구체화하는 기업들이 늘어날 것으로 보이며, 특히 PBR이 낮은 금융, 통신, 지주사 업종을 중심으로 바텀업 방식의 투자 기회가 포착될 확률이 있습니다. 다만 정책 모멘텀이 일단 정점을 통과했다는 인식이 확산될 경우 재료 소멸에 따른 일시적 조정이 나타날 수 있음에 유의해야 합니다. 지정학적 측면에서는 미국의 이란 공습 확대 및 이란의 호르무즈 해협 봉쇄 우려가 국내 증시의 하방 압력을 높일 변수로 작용할 확률이 있습니다. 중동발 분쟁으로 인한 유가 급등은 수입 물가 상승을 유발하여 국내 인플레이션 안정화 기조를 저해할 소지가 있으며, 안전 자산 선호 현상 심화에 따른 달러 강세는 외국인 자금의 이탈을 가속화할 수 있으므로, 분쟁 전개 양상에 따른 에너지 및 방산 섹터의 방어적 활용이 유용할 수 있습니다. 국내 증시 변동성을 높일 수 있는 지정학 이슈들이 산재해 있어 면밀히 모니터링하면서 벤치마크의 안정적 추종을 최우선 목표로 운용할 계획입니다.

## 2. 수익률 현황

### ▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형] | 72.37 | 151.09 | 250.41 | 262.91 | 243.11 | 294.72 | 154.78 |
| 비교지수 대비 성과 | 0.40 | 0.50 | 1.27 | 5.99 | 4.59 | 5.31 | 10.14 |
| | 종류(Class)별 현황 | | | | | | |
| ClassA | 72.45 | 151.32 | 250.85 | 263.50 | 244.17 | 296.62 | 157.23 |
| 비교지수 대비 성과 | 0.48 | 0.73 | 1.71 | 6.58 | 5.64 | 7.21 | 12.59 |
| ClassA-U | 72.44 | 151.24 | 250.70 | 263.25 | 243.59 | 295.59 | 156.06 |
| 비교지수 대비 성과 | 0.46 | 0.65 | 1.55 | 6.34 | 5.07 | 6.18 | 11.42 |
| ClassC | 72.28 | 150.66 | 249.49 | 261.43 | 239.58 | 288.41 | 147.91 |
| 비교지수 대비 성과 | 0.30 | 0.07 | 0.34 | 4.51 | 1.05 | -1.00 | 3.27 |
| ClassC-E | 72.28 | 150.89 | 250.00 | 262.38 | 242.20 | 293.36 | 153.73 |
| 비교지수 대비 성과 | 0.31 | 0.30 | 0.85 | 5.46 | 3.68 | 3.96 | 9.09 |

# 하나파워1.5배레버리지인덱스증권투자신탁[주식-파생형]

가. 비교지수(벤치마크) : KOSPI200 * 1.5 X 100%

나. 벤치마크 변경내용 및 사유 : 해당사항 없음

※위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.
※클래스 펀드의 경우는 최종 설정된 일자를 기준으로 해당 운용기간의 수익률을 계산합니다.
※C Class의 경우 (C1, C2, C3, C4, C5) 가입기간에 따라 판매보수가 감소하는 체감식 보수체계(CDSC) 적용함에 따라 본 보고서에 표기된 수익률은 개별 투자자의 수익률과 차이가 발생할 수 있으므로, 개별 투자자의 정확한 수익률은 가입하신 판매회사를 통하여 확인하시기 바랍니다.

## 손익현황

(단위: 백만원)

| 구 분 | | 전기 | 당기 |
|---|---|---|---|
| 증권 | 주식 | 3,284 | 5,542 |
| | 채권 | 0 | 0 |
| | 어음 | 0 | 0 |
| | 집합투자기구 | 1,065 | 2,821 |
| 파생상품 | 장내 | 5,733 | 11,283 |
| | 장외 | 0 | 0 |
| 부동산 | | 0 | 0 |
| 특별자산 | 실물자산 | 0 | 0 |
| | 기타 | 0 | 0 |
| 단기대출 및 예금 | | 27 | 36 |
| 기타 | | 1 | 1 |
| 손익합계 | | 10,111 | 19,682 |

※ 모자형의 경우 전기와 당기의 손익은 모펀드를 기준으로 작성합니다.

# 3. 자산 현황

## 재산현황

(단위 : 원, 좌, %)

| 구분 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|---|---|---|---|---|
| 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형] | 자산총액(A) | 30,114,933,398 | 43,274,355,105 | 43.70 |
| | 부채총액(B) | 1,396,633,038 | 441,602,752 | - 68.38 |
| | 순자산총액 (C=A- B) | 28,718,300,360 | 42,832,752,353 | 49.15 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 10,255,475,900 | 8,862,662,022 | - 13.58 |
| | 기준가격 1) (E=C/Dx1000) | 2,800.29 | 4,832.94 | 72.37 |
| | 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | |
| ClassA | 기준가격 | 2,762.65 | 4,764.21 | 72.45 |
| ClassA- U | 기준가격 | 2,753.08 | 4,747.30 | 72.44 |
| ClassC | 기준가격 | 2,703.60 | 4,657.67 | 72.28 |
| ClassC- E | 기준가격 | 2,732.83 | 4,708.08 | 72.28 |

1) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령시에 적용하는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행한 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다. 기준가격 증감률 부분은 당기 수익률을 표시합니다.

## 펀드의 투자전략

### 가. 투자전략

주식 및 주식관련 장내 파생상품 등 위험자산에 순자산의 150% 수준을 투자하여, KOSPI 200 일일수익률의 1.5배 수준의 수익을 추구 합니다. 이를 위해 투자신탁 순자산의 100% 이하를 KOSPI 200 인덱스 포트폴리오에 투자하고 나머지 부분(150%수준-인덱스포트폴리오 비중)을 KOSPI 200 장내파생상품에 투자하며, 일정 부분은 현금성 자산으로 유지하여 파생상품 증거금, 설정/환매대비 유동성으로 활용 합니다. 시장 변동시마다 매매를 통하여 위험자산에의 투자비중을 유지하도록 조정합니다.

### 나. 위험관리

KOSPI200지수의 복제를 목표로 인덱스 포트폴리오를 구성하고 KOSPI200 지수 구성종목 변경시 또는 추적오차(Tracking Error)발생시 수시로 포트폴리오를 재조정하고, 추적오차(Tracking Error) 모니터링 시스템을 통하여, 추적오차 및 시장대비 변동성을 점검하여 추적오차를 최소하도록 노력 합니다.

### 다. 수익구조

이 투자신탁은 KOSPI200지수 일일수익률의 1.5배의 성과를 추적하는 레버리지 인덱스 집합투자기구이기 때문에 주식시장의 가격 변동에 따라 주된 이익 또는 손실이 결정됩니다. 예를 들어 BM 인 KOSPI200 지수가 하루 동안 1% 상승하거나 하락하면 펀드도 수익이 1.5% 상승하거나 하락하게 됩니다. 그런데 실제 수익률은 인덱스 포트폴리오와 관련 장내 파생 상품으로 구성되는 레버리지 펀드의 특성 때문에 차이가 있을 수 있습니다. 인덱스 포트폴리오와 관련 장내 파생 상품은 장기적으로 같은 손익을 가지나 일별 수익률에서는 차이가 있을 수 있기 때문입니다.

### 라. 추가내용

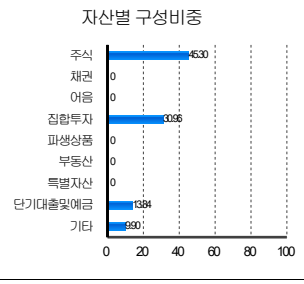
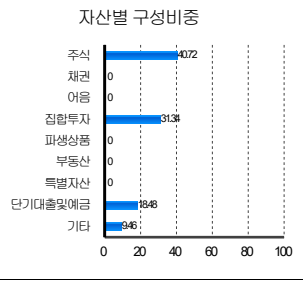
해당사항 없음

## 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

| 통화별구분 환율 | 증 권 | | | | 파생상품 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 |
| KRW | 17,622 | 0 | 0 | 13,561 | 0 | 0 |
| 1.00 | (40.72) | (0.00) | (0.00) | (31.34) | (0.00) | (0.00) |
| 합 계 | 17,622 | 0 | 0 | 13,561 | 0 | 0 |

| 통화별구분 환율 | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 실물자산 | 기타 | | | |
| KRW | 0 | 0 | 0 | 7,996 | 4,095 | 43,274 |
| 1.00 | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (18.48) | (9.46) | (100.00) |
| 합 계 | 0 | 0 | 0 | 7,996 | 4,095 | 43,274 |

| 전 기 | 당 기 |
|---|---|
|  |  |





※( ): 구성비중

※ 모자형의 경우, 자산구성현황은 투자자가 가입한 자펀드의 실제 자산구성내역이 아니고, 투자자의 이해를 돕기위해, 모펀드의 자산구성 내역과 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율 등을 감안하여 산출한 것입니다.

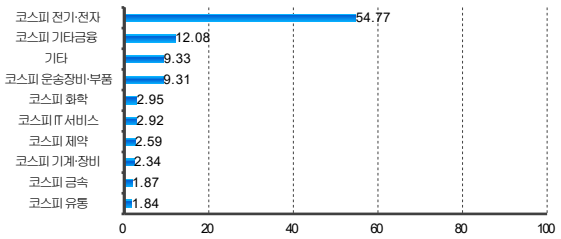
# 하나파워1.5배레버리지인덱스증권투자신탁[주식-파생형]

## ▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

| 순위 | 업종명 | 비중 | 순위 | 업종명 | 비중 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 코스피 전기·전자 | 54.77 | 6 | 코스피 IT 서비스 | 2.92 |
| 2 | 코스피 기타금융 | 12.08 | 7 | 코스피 제약 | 2.59 |
| 3 | 기타 | 9.33 | 8 | 코스피 기계·장비 | 2.34 |
| 4 | 코스피 운송장비·부품 | 9.31 | 9 | 코스피 금속 | 1.87 |
| 5 | 코스피 화학 | 2.95 | 10 | 코스피 유통 | 1.84 |

주식업종별 투자비용




## ▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구 분 | 종목명 | 비중 |
|---|---|---|
| 단기상품 | 은대 | 18.48 |
| 집합투자증권 | 1Q 200액티브 | 16.83 |
| 주식 | 삼성전자 | 12.64 |
| 집합투자증권 | 1Q 머니마켓액티브 | 9.77 |
| 기타 | 증거금(NH투자증권) | 8.46 |
| 주식 | SK하이닉스 | 7.35 |
| 집합투자증권 | TIGER 200 | 2.53 |
| 집합투자증권 | 하나 피가로인덱스 증권투자신탁[주식-파생형] 종류 | 2.21 |
| 주식 | 현대차 | 1.01 |
| 주식 | KB금융 | 0.81 |

## ▶ 각 자산별 보유종목 내역

**주식**

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종목명 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 |
|---|---|---|---|
| 삼성전자 | 30,192.00 | 5,471.00 | 12.64 |
| SK하이닉스 | 3,615.00 | 3,181.00 | 7.35 |
| 현대차 | 872.00 | 435.00 | 1.01 |
| KB금융 | 2,093.00 | 351.00 | 0.81 |

| 발행국가 | 통화 | 업종 | 비고 |
|---|---|---|---|
| 대한민국 | KRW | 코스피 전기·전자 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 전기·전자 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 운송장비·부품 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 기타금융 | |

**집합투자증권**

(단위 : 좌수, 백만원, %)

| 종목명 | 종류 | 자산운용사 | 설정원본 |
|---|---|---|---|
| 1Q 200액티브 | 수익증권 | 하나자산운용 | 5,099.42 |
| 1Q 머니마켓액티브 | 수익증권 | 하나자산운용 | 4,204.80 |
| TIGER 200 | 수익증권 | 미래에셋자산운용 | 618.09 |
| 하나 피가로인덱스 증권투자신탁[주식-파생형] 종류 C형 | 주식형 | 하나자산운용 | 296.60 |

| 순자산금액 | 발행국가 | 통화 | 비중 |
|---|---|---|---|
| 7,283.00 | 대한민국 | KRW | 16.83 |
| 4,227.00 | 대한민국 | KRW | 9.77 |
| 1,097.00 | 대한민국 | KRW | 2.53 |
| 954.00 | 대한민국 | KRW | 2.21 |

**단기대출 및 예금**

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종류 | 금융기관 | 금액 |
|---|---|---|
| 예금 | NH농협은행 | 7,996.00 |

| 발행국가 | 통화 | 비중 |
|---|---|---|
| 대한민국 | KRW | 18.48 |

**기타**

(단위 : 백만원)

| 종류 | 평가금액 | 비고 |
|---|---|---|
| 증거금 | 3,663.00 | |
| 미수배당금 | 37.00 | |
| 기타미수수익 | 0.00 | |

※ 펀드 자산총액에서 차지하는 상위 10개 종목의 보유내역을 기재하되, 자산총액(파생상품의 경우 위험평가액)의5%를 초과하는 종목이거나 발행주식 총수의 1%를 초과하는 종목(해외주식은 제외)이 있는 경우 그 보유 현황을 기재합니다.

※ 위의 예금은 펀드의 운용 중에 남은 현금을 은행에 일시적으로 맡기는 은행계정대(loans to banking accounts)에 해당하고, 적용금리는 은대금리입니다.

※ 보다 상세한 투자대상자산 내역은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다(인터넷 주소 http://dis.kofia.or.kr)
단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성 기준일이 상이할 수 있습니다.

# 4. 투자자산 매매내역

## ▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 백만원,%)

| 펀드명 | 구분 | 매 수 | | 매 도 | | 매매회전율[1] | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간 | 연환산 |
| 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형] | 주식 | 2,547 | 264 | 19,452 | 1,791 | 12.23 | 48.53 |
| | ETF | 150,797 | 3,252 | 81,060 | 1,782 | 17.23 | 68.36 |

[1] 매매회전율(해당분기)이란 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 말합니다. 매매회전율이 높으면 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.20%)가 발생해 투자자의 펀드비용이 증가합니다.

# 하나파워1.5배레버리지인덱스증권투자신탁[주식-파생형]

## ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

| 펀드명 | 2025-05-16~2025-08-15 | | 2025-08-16~2025-11-15 | | 2025-11-16~2026-02-15 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 주식 | ETF | 주식 | ETF | 주식 | ETF |
| 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형] | 20.55 | 51.04 | 22.10 | 44.67 | 12.23 | 17.23 |

## ▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산,%)

| 펀드명 | 항목 | 해당펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 총보수[1] 비용비율 | 중개수수료 비율 | 합성총보수 비용비율 | 매매 중개[2] 비용비율 |
| 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형] | 전기 | 0.0149 | 0.1400 | 0.0149 | 0.1400 |
| | 당기 | 0.0006 | 0.1199 | 0.0006 | 0.1199 |
| | 종류(Class)별 보수 현황 | | | | |
| ClassA | 전기 | 0.8490 | 0.0000 | 0.8641 | 0.1418 |
| | 당기 | 0.8487 | 0.0000 | 0.8500 | 0.1200 |
| ClassA-U | 전기 | 0.9477 | 0.0000 | 0.9627 | 0.1338 |
| | 당기 | 0.9478 | 0.0000 | 0.9498 | 0.1168 |
| ClassC | 전기 | 1.6090 | 0.0000 | 1.6240 | 0.1352 |
| | 당기 | 1.6087 | 0.0000 | 1.6099 | 0.1200 |
| ClassC-E | 전기 | 1.1090 | 0.0000 | 1.1240 | 0.1402 |
| | 당기 | 1.1087 | 0.0000 | 1.1077 | 0.1208 |

[1] 총보수 · 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(보수 · 비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수 비용수준을 나타냅니다.

[2] 매매 · 중개수수료 비율이란 매매 · 중개수수료를 순자산 연평잔액(보수 · 비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매 · 중개수수료의 수준을 나타냅니다.

※ 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 각 모펀드에 투자한 비율대로 안분하여 환산한 수치입니다.

# 5. 비용 현황

## ▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원,%)

| 펀드명 | 구분 | | 전기 | | 당기 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 금액[1] | 비율[2] | 금액[1] | 비율[2] |
| 파워1.5배레버리지인덱스[주식-파생형] | 자산운용사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 판매회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 기타비용[3] | | 1 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 7 | 0.03 | 9 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 2 | 0.01 | 2 | 0.00 |
| | | 합계 | 9 | 0.04 | 10 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 4 | 0.02 | 3 | 0.01 |
| ClassA | 자산운용사 | | 21 | 0.14 | 26 | 0.14 |
| | 판매회사 | | 9 | 0.06 | 11 | 0.06 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 1 | 0.01 | 1 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 1 | 0.00 | 1 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 32 | 0.21 | 39 | 0.21 |
| | 기타비용[3] | | 1 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 4 | 0.03 | 5 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 1 | 0.01 | 1 | 0.00 |
| | | 합계 | 5 | 0.04 | 6 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 2 | 0.02 | 1 | 0.01 |
| ClassA-U | 자산운용사 | | 0 | 0.14 | 1 | 0.14 |
| | 판매회사 | | 0 | 0.09 | 0 | 0.09 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 1 | 0.24 | 1 | 0.24 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 0 | 0.03 | 0 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 |
| | | 합계 | 0 | 0.03 | 0 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 0 | 0.02 | 0 | 0.01 |

# 하나파워1.5배레버리지인덱스증권투자신탁[주식-파생형]

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| ClassC | 자산운용사 | | 6 | 0.14 | 9 | 0.14 |
| | 판매회사 | | 11 | 0.25 | 16 | 0.25 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 18 | 0.41 | 26 | 0.41 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 1 | 0.03 | 2 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.01 | 0 | 0.00 |
| | | 합계 | 2 | 0.03 | 2 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 1 | 0.02 | 1 | 0.01 |
| ClassC-E | 자산운용사 | | 9 | 0.14 | 13 | 0.14 |
| | 판매회사 | | 8 | 0.13 | 11 | 0.13 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 1 | 0.01 | 1 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 19 | 0.28 | 25 | 0.28 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | -0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 2 | 0.03 | 2 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 1 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | | 합계 | 2 | 0.04 | 3 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 1 | 0.02 | 1 | 0.01 |

1) 운용기간에 발생한 보수금액
2) 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율
3) 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적 · 반복적으로 지출된 비용으로서 매매 · 중개수수료는 제외한 것입니다.
※ 성과보수내역 : 해당사항 없음
※ 발행분담금내역 : 해당사항 없음
※ ESG관련내역 : 해당사항 없음

## 6. 동일한 집합투자업자 펀드 투자현황

(단위:주,%)

| 투자대상 집합투자기구 현황 | | 투자대상 집합투자증권 보유수(B) | 보유비중 (=B/A*100(%)) |
|---|---|---|---|
| 집합투자기구명 | 발행총수(A) | | |
| 하나코스피200피가로인덱스증권자투자신탁[주 | 4,303,880,394 | 296,600,367 | 6.89 |
| 하나 1Q 머니마켓액티브증권상장지수투자신탁 [채권] | 16,686,000 | 80,000 | 0.48 |
| 하나 1Q 200액티브증권상장지수투자신탁[주식] | 8,250,000 | 275,190 | 3.34 |

## 7. 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

### ▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

**가. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등**

- 운용전략 상 국내 주식 및 국내 주식관련 장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 KOSPI200 지수 일일등락률의 1.5배 수익률을 추적하는 자본시장법 시행령 제2조 제7호에 따른 고난도 금융투자상품에 해당되며, 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자하거나 투자대상 종목 발행회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화 등에 의해 투자대상종목의 유동성 부족 또는 거래정지 등에 따른 환금성에 제약이 발생할 수 있고 이는 집합투자재산의 가치하락을 초래할 수 있음
- 운용전략 상 주식관련장내파생상품에 투자할 수 있으며, 파생상품은 작은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대 효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 높은 위험에 노출될 수 있음
- 투자와 관련한 보다 자세한 위험현황은 투자설명서 등을 참조

**나. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단 사유 등**

환매중단 등 위험발생가능성 낮음

### ▶ 주요 위험 관리 방안

**가. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등**

- 최근 1달 일평균 거래량 대비 보유비율이 10일을 초과하는 비유동주식 종목을 월간으로 모니터링 하고 있음
- 집합투자규약 상 파생상품 매매에 따른 위험평가액의 상한을 설정하여 일일 모니터링 시행
- 주식 인덱스 구성종목의 유동성위험 수시 점검 및 관리
- 금융투자협회 모범규준에 따라 유동성 스트레스 테스트 정기적으로 실시
- 추적오차(Tracking Error) 모니터링 시스템을 통하여, 추적오차 및 시장대비 변동성을 일간 단위로 점검

**나. 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한 과 수단 등**

해당사항 없음

**다. 환매중단,상환연기 등과 관련된 환매재개,투자금상환 등의 방안 및 절차 등**

해당사항 없음

### ▶ 자전거래 현황

**가. 자전거래규모**

(단위: 원)

| 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|---|---|---|---|
| - | - | - | - |

**나. 최근 1년간 자전거래 발생 시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위한 실시간 방안, 절차 등**

해당사항 없음

### ▶ 주요 비상대응계획

- 예기치 못한 위기상황 발생을 대비하여 대표이사, 부사장 및 각 주요 부서장들로 구성된 위기관리대책위원회 운영
- 5단계의 체계적인 위기관리 대응체계에 따라 각 단계별 임무 수행

1. 위기모니터링 : 상황 별 위기점검지표 일일 모니터링 시행
2. 위기인지/예방 단계 : 한도 초과 발견 시(혹은 위기상황이 심각히 예견될 시)즉시 업무관련부서장에게 통보 및 위기점검분석보고서 작성 제출 요구
3. 위기발생 단계 : 위기상황의 발생 혹은 심각히 예견되는 상황에서 전사적 대응을 위해 적정한 위기등급 발령
4. 위기대응 단계 : 위기관리대책위원회의 심의를 받아 유동성확보방안, 판매사 대응방안 등 위기관리대책 수립 및 시행
5. 사후관리 단계 : 위기상황해소 후 위기발생의 원인, 대응상의 문제점 및 재발방지책 등 검토 및 보고

## 8. 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

(단위: 백만원, %)

| 펀드명 | | | 분류 |
|---|---|---|---|
| | | | |
| 투자일 | 투자금 | 회수일 | 회수금 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| - | - | - | - |
| 투자잔액 | | 수익률 | |
| - | | - | |

※ 투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매)될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.
※ 고유재산 투자 분류가 '의무투자'인 경우에는 고유재산 투자의 회수예정일이 경과하기 1개월 이전에 제공되는 자산운용보고서에 고유재산 투자금을 회수할 수 있다는 사실을 기재합니다.
※ 수익률은[(보고서 기준일 수정기준가-투자일 수정기준가/투자일 수정기준가)*100]으로 산출된 값입니다.
※ 투자금, 회수금, 투자잔액은 고유재산 투자이후 이익분배금 수령을 제외한 최초 투자금액 기준으로 작성하였습니다.

## 9. 공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 하나파워1.5배레버리지인덱스증권투자신탁[주식-파생형]의 자산운용회사인 '하나자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 NH농협은행의 확인을 받은 후에 판매회사를 통해 투자자에게 제공합니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

하나자산운용

■ 주요 공시사항은 금융투자협회의 전자공시와 당사 홈페이지에서 확인이 가능합니다.
- 하나자산운용(주) 홈페이지 http://www.hanaam.com / 대표전화 02-3771-7800
- 금융투자협회 홈페이지 http://dis.kofia.or.kr / 대표전화 02-2003-9000