자산운용보고서

유리 글로벌거래소 증권투자신탁 1호 [주식]

(운용기간 : 2012년12월12일 ~ 2013년03월11일)

자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며,
투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

유리자산운용(주)

서울시 영등포구 여의도동 34-2 부국증권빌딩 9층
(전화 02-2168-7900, www.yurieasset.co.kr)

목 차

1 공지사항

2 펀드의 개요
▶ 기본정보
▶ 재산현황

3 운용경과 및 수익률현황
▶ 운용경과
▶ 투자환경 및 운용계획
▶ 기간(누적)수익률
▶ 손익현황

4 자산현황
▶ 자산구성현황
▶ 투자대상 상위 10종목
▶ 각 자산별 보유종목 내역

5 투자운용전문인력 현황
▶ 투자운용인력(펀드매니저)
▶ 해외 운용 수탁회사

6 비용현황
▶ 업자별 보수 지급현황
▶ 총보수비용 비율

7 투자자산매매내역
▶ 매매주식규모 및 회전율
▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

1. 공지 사항

1. 고객님이 가입하신 펀드는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률'(현행법률)의 적용을 받습니다.

2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]_운용의 자산운용회사인 '유리자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사인 'HMC투자증권,NH농협은행,NH농협증권,SK증권,골든브릿지증권,금호종합금융,기업은행,대구은행,대신증권,동양증권,부국증권,부산은행,삼성생명보험,신한금융투자,우리은행,우리투자증권,이트레이드증권,키움증권,하나은행,한국투자증권,한화투자증권,현대증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

3. 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 : 유리자산운용(주) www.yurieasset.co.kr / 02-2168-7900
금융투자협회 http://dis.kofia.or.kr

2. 펀드의 개요

▶기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]운용, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]A, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]C		1등급	66231 66229 66230
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형	최초설정일	2007.03.12
운용기간	2012.12.12 ~ 2013.03.11	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용(주)	펀드재산보관회사	한국씨티은행
판매회사	HMC투자증권,NH농협은행,NH농협증권,SK증권,골든브릿지증권,금호종합금융,기업은행,대구은행,대신증권,동양증권,부국증권,부산은행,삼성생명보험,신한금융투자,우리은행,우리투자증권,이트레이드증권,키움증권,하나은행,한국투자증권,한화투자증권,현대증권	일반사무관리회사	외환펀드서비스

상품의 특징

1. 투자대상

이 펀드는 전세계 주식시장에 상장된 증권, 선물, 상품 등 각종 거래소와 거래소 유관기관이 발행한 외국주식 등에 투자하는 해외 주식형 펀드로서 주식을 주된 투자대상자산으로 장기적인 자본이득 등을 추구하는 것을 목적으로 합니다.

이 펀드의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 자산운용회사,판매회사,신탁업자 등 이 펀드와 관련된 어떠한 당사자도 투자자에 대한 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다.

2. 투자전략

가) 포트폴리오 구성전략

- 신탁재산의 60% 이상을 전세계 주요국가의 증권(Stocks), 선물(Futures), 상품(Commodities) 및 기타 거래대상객체(예: 기후, Co2, 예술품 등) 등이 거래되는 각종 거래소(Exchange)와 거래소 유관기관(독립된 청산소, 대체결제소, 그리고 각종 대안거래소에 출자한 기관(IB, 은행 및 기타 회사 등)) 에서 발행한 상장주식에 투자합니다.
- 당사의 자체기준(정성적 평가 (80%) 및 정량적 평가(20%)에 의해 종목별 등급을 (A, B, C, D 등)부여하고 등급상황에 포트폴리오를 조정합니다 . 등급의 부여는 계량적 요소 외에 비계량적 요소까지 고려하여 운용자의 주관 및 재량에 의해 결정되므로 이 펀드 포트폴리오 구성 종목의 요건, 종목간 비중이 객관적 기준에 의해 특정되지는 않는다는 점에 유의하시기 바랍니다.

나) 자산배분 전략

- 이 펀드는 운용자의 재량에 의해 주식투자비중 조절 등을 통한 자산배분 전략을 구사할 수 있습니다. 자산배분전략의 의도와 달리 주가수준 등이 변화할 경우 펀드의 성과에 불리한 영향을 미치게 됩니다.

다) 기타

- 시장상황에 따라 신탁재산의 일부를 국공채, 통화안정증권, 회사채 등에 투자하여 환매대금의 예비적 확보 및 이자소득을 추구할 예정입니다.

※ 상기에 제시된 운용 목표 및 전략은 시장상황 및 운용여건에 따라 변경될 수 있으며 이러한 전략이 반드시 유효하게 투자목적을 실현한다는 보장은 없습니다.

3. 위험관리

운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 리스크관리위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 운용업 실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다.

리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는 지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석업무를 수행합니다.

4. 수익구조

신탁재산을 주로 해외 주식 등 외화표시자산에 투자하는 이 펀드의 특성과 환헤지 전략의 한계로 인해 이 펀드의 성과는 주식시세의 등락 및 배당과 환율변동으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 주식에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 펀드의 성과에 영향을 미치게 됩니다.

주식의 시세는 해당 주식 발행 기업의 경영성과 및 주식에 대한 시장의 수급 등의 요인에 의해 결정되며 이러한 요인은 경제,정치,자연,사회,문화 등 다양한 변수의 영향을 받습니다. 투자대상 주식 발행기업의 경영성과가 우수할수록, 투자대상 주식에 대한 수요가 공급보다 클수록 주식의 시세는 상승하는 경향을 나타내어 펀드의 가치가 상승하는 것이, 반대의 경우에는 펀드의 가치가 하락하는 것이 일반적 입니다.

이 펀드 고유의 운용전략이 유효하게 목표를 달성하여 초과수익이 발생할 경우 이 펀드의 주식투자 성과는 투자대상국의 평균적인 주가상승률을 상회하게 되며 그렇지 않을 경우 투자대상국의 평균적인 주가상승률에 미달하게 됩니다. 운용자의 재량에 따라 적극적인 초과수익전략을 구사하는 특성 상 이 펀드의 주식투자 성과가 투자대상국의 평균적인 주가변동률에 일정한 제한 없이 미달할 가능성이 있다는 점에 유의하시기 바랍니다.

이 펀드의 성과는 자본이득, 배당수입, 이자수입으로 구분할 수 있으며 일반적으로 자본이득이 성과에 미치는 영향이 절대적인 비중을 차지합니다.

▶ 재산현황

재산현황 표를 통해 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산 총액 및 기준가격의 추이를 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리글로벌거래소1[주식]운용	자산 총액 (A)	25,117	27,807	10.71
	부채 총액 (B)	76	263	246.47
	순자산총액 (C=A-B)	25,041	27,544	10.00
	발행 수익증권 총 수 (D)	27,024	24,740	-8.45
	기준가격주) (E=C/D×1000)	926.63	1,113.36	20.15
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리글로벌거래소1[주식]A	기준가격	761.93	911.94	19.69
유리글로벌거래소1[주식]C	기준가격	733.31	876.89	19.58

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

※ 분배금 내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
유리글로벌거래소1[주식]운용	2013-03-12	2,804	24,740	1,113.36	1,000.00	
유리글로벌거래소1[주식]A	2013-03-12	0	22,794	911.94	911.94	
유리글로벌거래소1[주식]C	2013-03-12	0	7,579	876.89	876.89	

주)분배후수탁고는 분배금이 전부 재투자된다는 가정하에 작성된 자료입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 펀드는 해당 운용기간 동안 17.39% 상승한 비교지수보다 2.76% 포인트 높은 20.15%의 수익률을 기록하였습니다. 동 기간 비농업부분 고용증가 등의 고용지표 개선, 주택가격 상승세 지속 등의 주택관련 지표 개선 등 대부분의 美 경제 지표가 호조세를 보이면서 미 증시는 견조한 상승세를 보였고 유럽증시도 이탈리아 총선 이슈, 키프로스 구제금융 우려 등으로 일시적 조정을 보이기도 하였지만 대체로 안정적인 흐름을 보이면서 10개월 연속 상승 흐름을 이어갔습니다. 또한 아베노믹스로 대변되는 대규모 양적 완화 정책을 추진하고 있는 일본 증시도 큰 폭의 상승세를 시현하였습니다. 반면에 신흥국 증시는 G2의 경제 회복 속도 둔화 우려감, 선진국 증시로의 자금 이동 등의 영향으로 상대적 상승폭이 제한되는 모습을 보였습니다.

종목별로는 일본 강세장의 영향을 받은 일본거래소가 동기간 96.30% 큰 폭 상승하였고 미국 NYSE Euronext, NASDAG, ICE가 각각 62.86%, 37.14%, 23.33% 상승하였습니다. 반면 홍콩거래소는 9.38%, 브라질 Bovespa 거래소 2.17% 상승하는 등 대체적으로 신흥국 거래소 주식은 선진국 거래소 주식 대비 상승 폭이 제한적인 모습이였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

미국 주택, 고용지표 등 주요 경제지표 호조세, 양적 완화 기조 유지 등으로 경기회복에 대한 기대감은 당분간 이어질 것으로 전망됩니다. 키프로스의 구제금융 우려 등의 불안 요인은 있지만 ECB와 유로존 수호의지, 유로존 은행권의 유동성 개선 등을 감안했을 때 그 영향은 제한적 일 것으로 보입니다. 최근 선진국 증시와 신흥국 증시의 디커플링 현상이 지속된 점, 선진국 시장의 유동성 장세가 당분간 이어질 것이라는 점을 감안하여 중립적 스탠스를 유지하면서 많이 오른 종목 위주의 차익 실현에 주력하는 동시에 가격 메리트가 부각된 종목 위주로 Buy on Dips 전략을 이어갈 계획입니다.

3월 원 달러 환율은 1) 미국의 경기지표 호조세에 따른 달러 강세 2) 키프로스 구제금융 관련 우려 3) 북한관련 지정학적 리스크 부각 등에 기인하여 2.59% 상승하는 모습을 보였습니다. 4월 원 달러 환율은 2월 이후 진행된 미달러화 강세가 최근 둔화되는 분위기 속에 북한 관련 리스크와 엔저에 대한 경계 인식 등으로 현 수준을 중심으로 변동성이 확대되는 모습을 보일 것으로 예상됩니다.

▶ 기간(누적)수익률

기간(누적)수익률 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드의 기간별 누적수익률을 확인 할 수 있으며, 비교지수(벤치마크) 성과와 펀드의 성과를 비교하여 볼 수 있습니다.

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
유리글로벌거래소1[주식]운용	20.15	20.54	28.44	16.78
(비교지수 대비 성과)	(2.76)	(1.23)	(-1.14)	(3.93)
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소1[주식]A	19.69	19.58	26.89	14.85
(비교지수 대비 성과)	(2.30)	(0.27)	(-2.69)	(2.00)
유리글로벌거래소1[주식]C	19.58	19.35	26.52	14.36
(비교지수 대비 성과)	(2.19)	(0.04)	(-3.06)	(1.51)
비교지수(벤치마크)	17.39	19.31	29.58	12.85

주) 비교지수(벤치마크) : CD91 10.0%, S&P/KRX Exchange Index 90.0%

※ 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌거래소1[주식]운용	16.78	13.76	24.96	-0.68
(비교지수 대비 성과)	(3.93)	(6.16)	(5.11)	(-12.04)
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소1[주식]A	14.85	9.98	18.80	-8.81
(비교지수 대비 성과)	(2.00)	(2.39)	(-1.06)	(-20.17)
유리글로벌거래소1[주식]C	14.36	8.82	16.57	-12.31
(비교지수 대비 성과)	(1.51)	(1.23)	(-3.28)	(-23.67)
비교지수(벤치마크)	12.85	7.60	19.86	11.36

주) 비교지수(벤치마크) : CD91 10.0%, S&P/KRX Exchange Index 90.0%

※ 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	-379	0	0	0	538	169	0	0	0	-69	-173	85
당 기	5,034	0	0	0	-193	-35	0	0	0	112	-66	4,853

4. 자산현황

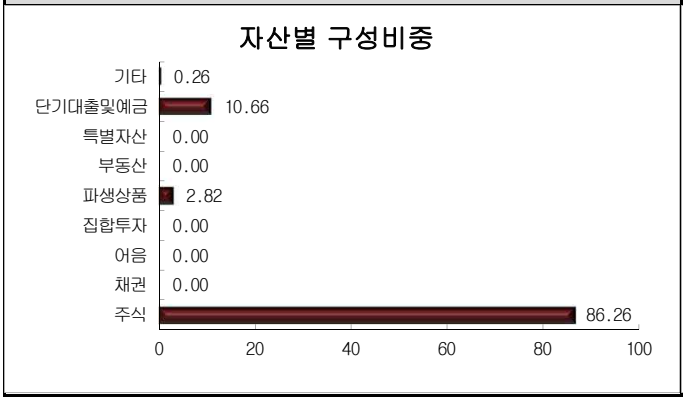
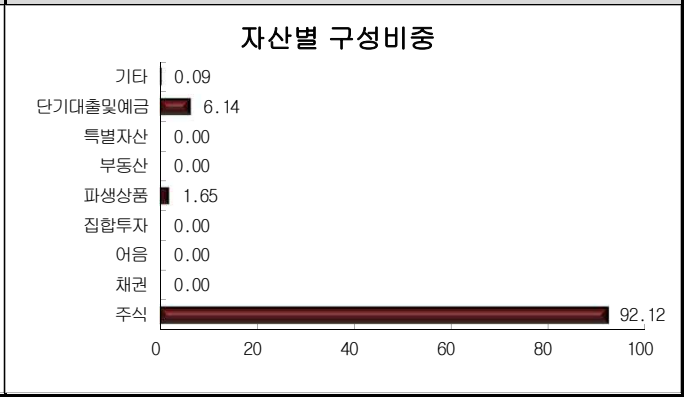
▶ 자산구성현황

자산구성현황 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 보유하고 있는 자산의 내역을 각 자산군 및 통화별로 확인할 수 있습니다. 또한 그래프를 통해 당기말과 전기말 간의 자산별 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원,%)

통화별 구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
AED	275	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	275
(298.06)	(0.99)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.99)
AUD	795	0	0	0	0	0	0	0	0	1	0	796
(1119.27)	(2.86)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(2.86)
BRL	2,454	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2,454
(562.03)	(8.83)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(8.83)
CAD	271	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	271
(1065.50)	(0.97)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.98)
EUR	2,482	0	0	0	0	0	0	0	0	10	0	2,492
(1424.44)	(8.93)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.04)	(0.00)	(8.96)
GBP	1,760	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,760
(1634.97)	(6.33)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(6.33)
HKD	2,351	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2,351
(141.14)	(8.45)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(8.45)
JPY	338	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	338
(11.39)	(1.22)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.22)
MXN	514	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	514
(86.71)	(1.85)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.85)
MYR	441	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	441
(351.86)	(1.59)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.59)
NZD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(898.34)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
SEK	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(171.13)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
SGD	2,434	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2,434
(876.82)	(8.75)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(8.75)
USD	11,253	0	0	0	0	51	0	0	0	957	0	12,261
(1094.80)	(40.47)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.18)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(3.44)	(0.00)	(44.09)
ZAR	250	0	0	0	0	0	0	0	0	1	0	251
(120.24)	(0.90)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.90)
KRW	0	0	0	0	406	0	0	0	0	738	25	1,169
(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.46)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(2.65)	(0.09)	(4.20)
합 계	25,618	0	0	0	406	51	0	0	0	1,708	25	27,807

* ( ) : 구성 비중

전 기	당 기
	

▶ 주식업종별 투자비중

주식업종별 투자비중 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 투자하고 있는 주식자산의 업종별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드가 보유한 주식자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

	종목명	비중		종목명	비중
1	Diversified Financial Services	100.00	6		
2			7		
3			8		
4			9		
5			10		

주) 주식종목의 업종 구분은, 국내 주식은 한국거래소의 업종분류기준, 해외 주식은 GICS(국제산업분류기준) 2차 분류를 따릅니다.

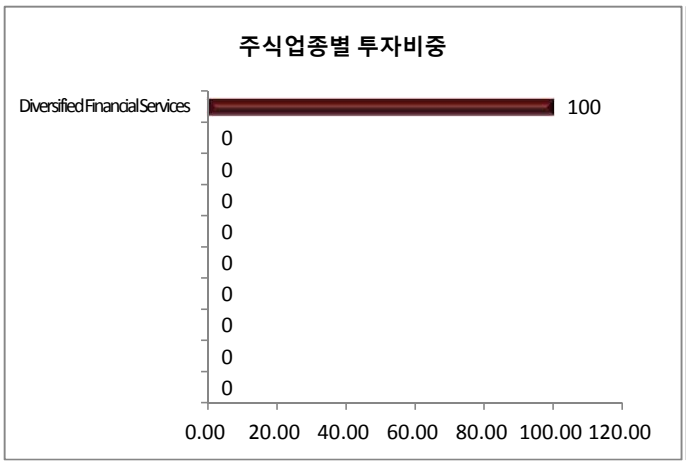
▶ 국가별 투자비중

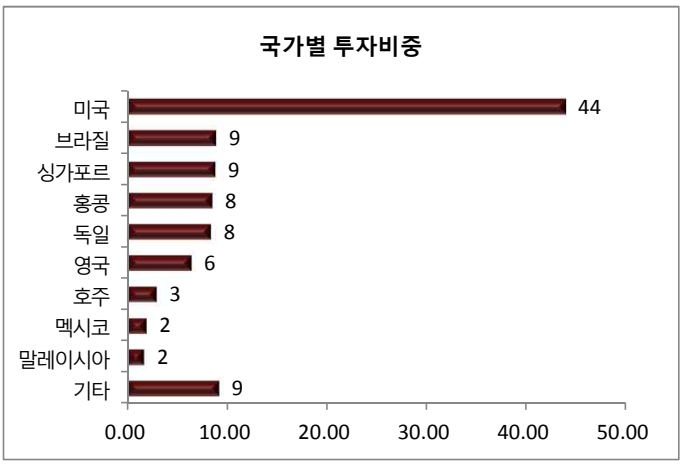
국가별 투자비중을 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 보유하고 있는 전체 자산의 국가별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드 전체 자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

	국가명	비중		국가명	비중
1	미국	43.91	6	영국	6.33
2	브라질	8.83	7	호주	2.86
3	싱가포르	8.75	8	멕시코	1.85
4	홍콩	8.45	9	말레이시아	1.59
5	독일	8.31	10	기타	9.12

주) 종목의 국가 구분은, 해당 종목이 발행된 국가를 기준으로 합니다.





▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지에 관한 사항을 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드 순자산 총액 대비 환헤지 비율을 확인할 수 있으며, 펀드가 목표로 하는 환헤지 비율과 실제 펀드의 환헤지 비율을 비교하여 볼 수 있습니다.

투자설명서상의 목표 환헤지비율	기준일(13년03월11일) 현재 환헤지 비율
외화표시자산의 순자산총액의 60±10% 범위에서 환헤지 실행	55.35%

주) 환헤지란 환율 변동으로 인한 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총 외화자산의 평가액 대비, 환헤지 규모를 비율로 표시한 것을 말합니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

투자대상 상위 10종목 표를 통해 전체 자산군을 대상으로 펀드 자산총액에서 차지하는 상위 10개 보유 종목을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드의 자산총액에서 해당 종목이 차지하는 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	파생상품	미국달러 F 201303	41.19	6	해외주식	SINGAPORE EXCHANGE LTD	8.75
2	해외주식	CME GROUP	9.51	7	해외주식	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	8.45
3	해외주식	NYSE EURONEXT CO INC.	9.42	8	해외주식	DEUTSCHE BOERSE AG	8.31
4	해외주식	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9.21	9	해외주식	NASDAQ OMX GROUP/THE	7.56
5	해외주식	BM&F BOVESPA BOLSA DE VALORES	8.83	10	해외주식	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	6.33

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

▼ 각 자산별 보유종목 내역

각 자산별 보유종목 내역을 통해 투자대상 상위 10종목 및 펀드자산총액의 5% 이상을 차지하는 종목, 또는 발행주식 총 수의 1%를 초과한 종목(해외주식은 제외)을 각 자산군별로 구분하여 확인 할 수 있습니다.

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
CME GROUP	38,750	2,645	9.51	미국	USD	미분류	
NYSE EURONEXT	63,000	2,619	9.42	미국	USD	미분류	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	14,747	2,561	9.21	미국	USD	미분류	
BM&F BOVESPA BOLSA DE VALORES	311,665	2,454	8.83	브라질	BRL	미분류	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	360,000	2,434	8.75	싱가포르	SGD	미분류	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING	120,000	2,351	8.45	홍콩	HKD	미분류	
DEUTSCHE BOERSE AG	32,685	2,310	8.31	독일	EUR	미분류	
NASDAQ OMX GROUP/THE	59,946	2,102	7.56	미국	USD	미분류	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PL	77,828	1,760	6.33	영국	GBP	미분류	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
미국달러 F 201303	매도	1,046	11,453	

주) 투자대상 상위 10종목 및 개별계약등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(작성기준일 : 2013.02.28) (단위 : 개, 억원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
한진규	**책임 운용인력**	**44**	38개	5,607억원	4개	2,226억원	**2109000507**
유승민	부책임 운용인력	43	209개	2,645억원	-	-	2109000520

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함

주) 운용중인 다른 집합투자기구 수 및 규모를 산정 할 때 해당 운용팀에서 운용 중인 전체 집합투자기구를 대상으로 하며 모자형 구조의 모집합투자기구는 제외합니다.

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

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2006.08.(펀드설정일) ~ 2010.09.	**최병로(대안투자본부)**

2010.08 ~ 현재	한진규(퀀트운용본부)

▶해외 운용 수탁회사

회사명	소재	국가명	비고

6. 비용 현황

▶업자별 보수 지급현황

업자별 보수 지급현황 표를 통해 펀드가 펀드의 운용과 관련된 관계회사(자산운용사, 판매회사, 신탁업자, 일반사무관리회사 등)에 지급한 보수와 비용(기타 비용, 매매중계수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

	구 분	전기		당기	
		금액	비율	금액	비율
유리글로벌거래소1[주식]운용	자산운용사	0.00	0.00	0.00	0.00
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	2.12	0.01	2.22	0.01
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	2.12	0.01	2.22	0.01
	기타비용**	2.81	0.01	2.87	0.01
	매매・중개수수료	6.34	0.02	4.84	0.02
	증권거래세	0.20	0.00	1.99	0.01
유리글로벌거래소1[주식]A	자산운용사	33.88	0.17	34.75	0.17
	판매회사	43.57	0.22	44.68	0.22
	펀드재산보관회사(신탁업자)	3.39	0.02	3.48	0.02
	일반사무관리회사	0.73	0.00	0.74	0.00
	보수합계	81.56	0.42	83.65	0.42
	기타비용**	0.16	0.00	0.15	0.00
	매매・중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00
유리글로벌거래소1[주식]C	자산운용사	10.93	0.17	11.20	0.17
	판매회사	20.30	0.32	20.79	0.32
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1.09	0.02	1.12	0.02
	일반사무관리회사	0.23	0.00	0.24	0.00
	보수합계	32.56	0.52	33.35	0.51
	기타비용**	0.05	0.00	0.05	0.00
	매매・중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적.반복적으로 지출된 비용으로서 매매.중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 없음.

※ 발행분담금내역 : 없음.

▶총보수,비용비율

총보수, 비용비율 표를 통해 투자자가 펀드를 통해 부담한 보수와 비용의 수준을 펀드 순자산 연평잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위 : 연환산, %)

		총보수 · 비용비율(A)	매매・중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
유리글로벌거래소1[주식]운용	전기	0.0814	0.0932	0.1746
	당기	0.0792	0.095	0.1742
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소1[주식]A	전기	1.7745	0.0934	1.8679
	당기	1.7676	0.0952	1.8628
유리글로벌거래소1[주식]C	전기	2.2611	0.0934	2.3545
	당기	2.1999	0.0953	2.2952

주1) 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.

주2) 매매.중개수수료 비율이란 매매.중개수수료를 순자산 연평잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매.중개수수료의 수준을 나타냅니다.

7. 투자자산매매내역

매매주식 규모 및 회전율 표와 최근 3분기 매매회전율 추이 표를 통해 당기 및 최근 3분기 동안에 대해 펀드가 수행한 주식거래의 빈도를 확인 할 수 있습니다. 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
27,000	785	69,566	1,666	7.01	28.43

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

12년06월12일 ~12년09월11일	12년09월12일 ~12년12월11일	12년12월12일 ~13년03월11일
0.00	6.82	7.01