

자산운용보고서

유리 글로벌거래소 증권투자신탁 1호 [주식]

(운용기간 : 2013년09월12일 ~ 2013년12월11일)

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 **비용현황**
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 **투자자산매매내역**
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

전기	-214	0	0	0	543	179	0	0	0	-15	35	528
당기	1,129	0	0	0	419	134	0	0	0	5	-91	1,597

4. 자산현황

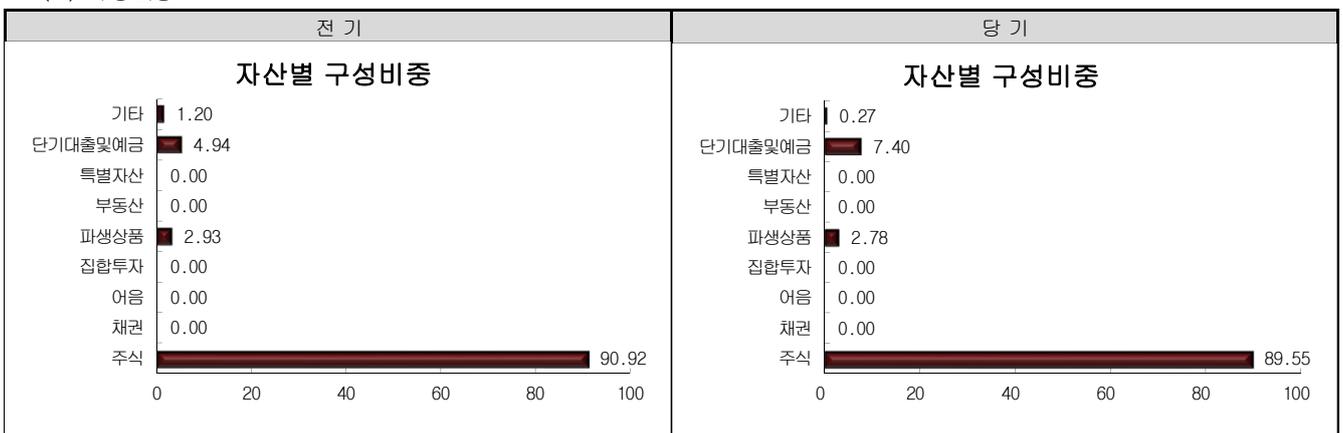
▶ 자산구성현황

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 구성비율을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
AED (286.44)	522 (2.49)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	522 (2.49)
AUD (960.20)	744 (3.55)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1 (0.01)	0 (0.00)	745 (3.55)
BRL (455.67)	1,239 (5.91)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,239 (5.91)
CAD (991.71)	541 (2.58)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	542 (2.58)
EUR (1448.11)	1,677 (8.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	10 (0.05)	0 (0.00)	1,687 (8.05)
GBP (1729.34)	1,485 (7.08)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,485 (7.08)
HKD (135.69)	1,811 (8.64)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,811 (8.64)
JPY (10.25)	1,238 (5.90)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,238 (5.91)
MXN (81.86)	668 (3.18)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	668 (3.18)
MYR (327.45)	475 (2.27)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	475 (2.27)
NZD (870.45)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)
SEK (160.91)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)
SGD (841.71)	1,701 (8.12)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,701 (8.12)
USD (1052.10)	6,426 (30.65)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	80 (0.38)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,249 (5.96)	0 (0.00)	7,756 (37.00)
ZAR (101.56)	246 (1.17)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	246 (1.18)
KRW (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	502 (2.39)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	290 (1.38)	57 (0.27)	849 (4.05)
합 계	18,774	0	0	0	502	80	0	0	0	1,552	57	20,965

* () : 구성 비중



▶ 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		0.00
2			7		
3			8		
4			9		
5			10		

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

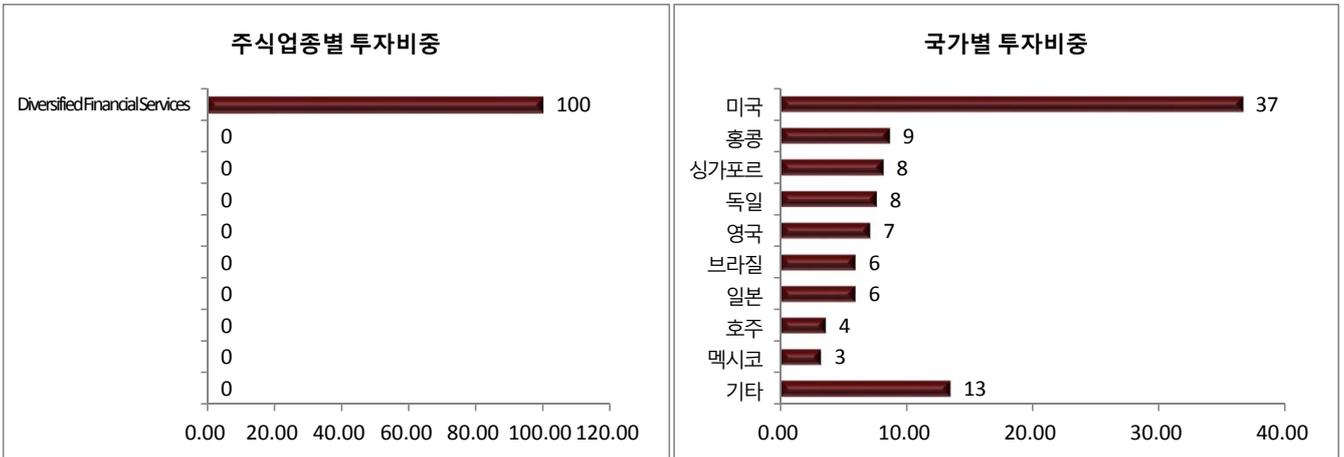
▶ 국가별 투자비중

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	36.61	6	브라질	5.91
2	홍콩	8.64	7	일본	5.91
3	싱가포르	8.12	8	호주	3.55
4	독일	7.58	9	멕시코	3.18
5	영국	7.08	10	기타	13.42

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(13년12월11일) 현재 환헤지 비율
외화표시자산의 순자산총액의 60±10% 범위에서 환헤지 실행	70.65%

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 201312	52.51	6	해외주식	SINGAPORE EXCHANGE LTD	8.12
2	해외주식	INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	8.73	7	해외주식	DEUTSCHE BOERSE AG	7.58
3	해외주식	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	8.64	8	해외주식	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	7.08
4	해외주식	NASDAQ OMX GROUP/THE	8.48	9	단기상품	USD Deposit(CITI)	5.96
5	해외주식	CME GROUP	8.14	10	해외주식	BM&F BOVESPA BOLSA DE VALORES	5.91

※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
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	8,022	1,830	8.73	미국	USD	미분류	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING	100,000	1,811	8.64	홍콩	HKD	미분류	
NASDAQ OMX GROUP/THE	43,436	1,777	8.48	미국	USD	미분류	
CME GROUP	20,350	1,707	8.14	미국	USD	미분류	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	288,340	1,701	8.12	싱가포르	SGD	미분류	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,945	1,589	7.58	독일	EUR	미분류	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PL	53,288	1,485	7.08	영국	GBP	미분류	
BM&F BOVESPA BOLSA DE VALORES	248,275	1,239	5.91	브라질	BRL	미분류	
JAPAN EXCHANGE GROUP	40,000	1,238	5.90	일본	JPY	미분류	
CBOE HOLDINGS INC	20,575	1,112	5.31	미국	USD	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 201312	매도	1,046	11,009	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	USD Deposit	2007-03-13	1,249	0.00	2099-12-31	미국	USD

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

5. 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, 매매중개수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

	구분	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)	2.20	0.01	2.25	0.01	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	2.20	0.01	2.25	0.01	
	기타비용**	2.12	0.01	2.59	0.01	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	6.99	0.03	7.76	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	7	0.03	8	0.04
		증권거래세	0.15	0.00	0.27	0.00
유리글로벌거래소1[주식]A	자산운용사	33.98	0.18	29.44	0.17	
	판매회사	43.69	0.23	37.86	0.22	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	3.40	0.02	2.94	0.02	
	일반사무관리회사	0.73	0.00	0.63	0.00	
	보수합계	81.80	0.42	70.88	0.42	
	기타비용**	0.13	0.00	0.10	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
		증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00

유리글로벌거래소1[주식]C	자산운용사	10.40	0.18	9.06	0.17	
	판매회사	16.35	0.28	14.23	0.27	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1.04	0.02	0.91	0.02	
	일반사무관리회사	0.22	0.00	0.19	0.00	
	보수합계	28.01	0.48	24.38	0.47	
	기타비용**	0.04	0.00	0.03	0.00	
	매매· 중개 수수료	단순매매·중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00		

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 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 연평균잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
유리글로벌거래소1[주식]운용	전기	0.0757	0.0934	0.1691
	당기	0.078	0.1024	0.1804
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소1[주식]A	전기	1.7637	0.0936	1.8573
	당기	1.7659	0.1027	1.8686
유리글로벌거래소1[주식]C	전기	2.0936	0.0937	2.1873
	당기	2.0498	0.1025	2.1523

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

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

6. 투자자산매매내역

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

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	123,110	4,479	22.25	89.26

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

13년03월12일 ~13년06월11일	13년06월12일 ~13년09월11일	13년09월12일 ~13년12월11일
9.56	15.92	22.25