

자산운용보고서

유리글로벌거래소연금저축증권투자신탁[주식]

(운용기간 : 2018년07월12일 ~ 2018년10월11일)

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

유리자산운용

서울시 영등포구 국제금융로6길 17 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
 - ▶ 환헤지에 관한 사항
 - ▶ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황
 - ▶ 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 주식 매매회전율 추이

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

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_운용	자산 총액(A)	999	1,107	10.85
	부채총액(B)	3	12	367.92
	순자산총액(C=A-B)	996	1,095	9.90
	발행 수익증권 총 수(D)	936	1,044	11.57
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,064.69	1,048.73	-1.50
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/C	기준가격	1,051.47	1,031.25	-1.92
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/C-e	기준가격	1,055.19	1,036.17	-1.80
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/S-P	기준가격	1,056.98	1,038.53	-1.75

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.

※ 분배금내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_운용	2018.10.12.	51	1,044	1048.73	1000	
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/C	2018.10.12.	19	601	1031.25	1000	
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/C-e	2018.10.12.	8	235	1036.17	1000	
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/S-P	2018.10.12.	8	220	1038.53	1000	

주) 분배후수탁고는 재투자 0 백만좌 포함입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

<p>펀드는 해당 운용기간 동안 -1.50%의 수익률을 기록하며 BM(-4.55%)대비 3.05% 성과를 시현하였습니다. 거래소별로 보면 브라질거래소의 상승폭이 눈에 띄었고, 미국 거래소 종목 중 시카고상품거래소(Chicago Mercantile Exchange, CME)가 상승을 주도하며 수익을 방어에 기여한 반면 홍콩, 나스닥, 호주, 런던거래소 등 대부분의 거래소종목이 하락폭을 키우며 수익률 하락요인으로 작용하였습니다.</p>
<p>동 기간 미국과 중국의 무역분쟁의 우려가 심화와 완화를 반복하면서 글로벌 증시도 등락을 거듭하였습니다. 견고한 기업실적 및 양호한 경제 펀더멘탈을 기반으로 미국을 중심으로 한 선진국의 증시가 양호한 모습을 보이는 가운데 신흥국과의 디커플링 양상이 심화되는 분위기였습니다. 신흥국은 대외변수에 민감하게 반응하는 모습을 보였으며 특히 터키발 금융위기는 신흥국 증시를 큰 폭으로 끌어내려 펀드 수익률에 부정적 영향을 미쳤습니다.</p>
<p>7월은 글로벌 무역분쟁, 난민 정책을 둘러싼 독일 정치 불안에도 불구하고 제조업 지표 개선, 기업실적 호조 기대감으로 기술주가 강세를 주도하며 상승세를 이어갔습니다.미국 증시는 2분기 실적 기대에 금융주 랠리가 이어지며 강세를 시현하였고, 고용지표가 호조를 띄면서 매수세가 크게 유입되었습니다. 우려했던 미국과 중국의 무역전쟁에 대한 완화 기대감으로 투자심리가 되살아나며 상승에 무게가 실리기도 했지만, 다시 트럼프의 대중국 추가 관세 부과 소식에 미국과 중국의 무역전쟁이 격화일로로 치달으면서 투자심리를 위축시켰습니다. 하지만 시장은 이미 선반영된 악재(미-중 무역갈등) 보다는 실적호전에 더욱 집중하는 모습이었습니다.</p>
<p>8월 글로벌 증시에서 가장 큰 이벤트는 터키발 금융위기였습니다. 선진국의 경기 펀더멘탈이 나쁘지 않았지만 터키 채권 익스포저가 큰 유럽 국가들 중심으로 하락폭을 확대하였습니다. 그럼에도 불구하고 미국증시는 파월 연준의장의 점진적인 금리인상 코멘트가 완화 스탠스로 해석되면서 증시에 우호적인 분위기를 제공하였고 미국과 멕시코의 NAFTA(북미자유무역협정) 무역협상 타결 및 캐나다와의 협상 가능성 소식에 증시는 상승 기조를 이어갔습니다. 한편 신흥국 증시는 터키발 금융위기가 신흥국증시 전반으로 확대되면서 투자심리 크게 위축시키며 큰 폭 조정을 보였습니다.</p>
<p>9월 선진시장은 실적 호조를 바탕으로 견고한 경제상황을 재확인하면서 소폭 상승하였고, 신흥증시는 부진한 흐름을 이어갔습니다. 뉴욕 증시는 기술주 부진으로 나스닥이 큰 폭으로 하락하였으나 나머지 지수 흐름은 견조한 모습이었습니다. 유럽은 정치 이슈가 부각되며 혼조세를 보였고 유가 상승은 브라질 등 관련국들의 강세를 이끌며 신흥국 하락폭을 일부 되돌렸습니다. 미국과 중국의 무역분쟁 이슈 및 각국의 정치 리스크가 여전히 글로벌 시장의 불확실성으로 남아 있는 가운데 시장은 대외 이벤트에 민감한 모습을 보이고 있습니다.</p>
<p>당사는 전반적으로 주식 비중 축소를 통해 포트폴리오를 조정하였습니다. 여전히 상승세가 전망되는 미국거래소에 대한 투자비중을 소폭 확대하였고, 유럽은 영국 및 독일 거래소 종목편입비를 확대를 통해 추가적인 주가상승에 대비하였습니다. 기간 중 남아프리카공화국의 경제 위기 이슈가 부각되어 해당 종목을 모두 교체하면서 시장상황에 발 빠르게 대응하면서 펀드수익률을 방어하는데 기여하였습니다. 전체적인 포트폴리오 측면에서 관망세를 유지하며 신흥국 비중축소 스탠스는 여전히 유효할 것으로 판단됩니다.</p>

▶ 투자환경 및 운용 계획

<p>미국은 양호한 경제지표가 기대되나 미국과 중국의 무역분쟁 장기화 가능성, 실적 악화 우려로 인한 모멘텀 둔화 등으로 시장 상승을 제한할 것으로 예상됩니다. 유로존 역시 경기 모멘텀 약화와 정치적 불확실성 확대가 투자심리 위축으로 작용할 것으로 예상됩니다. 신흥국은 최근 국가별 디커플링이 심화되는 양상이므로 환율, 유가, 경제 펀더멘탈 및 각국의 정치이슈를 고려하여 국가별 상승과 하락요인이 다르게 작용할 것으로 판단되나 전반적으로는 악세 기조가 전망이 우세합니다.</p>
<p>동 펀드는 향후 개별 국가에 대한 글로벌 수급 및 매크로 환경에 따라 포트폴리오 조정이 필요할 것으로 판단되며 단기적인 손실 방어 및 중장기적 초과수익 추구를 위해 글로벌 투자환경을 밀착 모니터링 할 예정입니다. 무역분쟁 이슈가 여전히 시장 변동성을 확대하는 가운데 글로벌 시장은 대외변수의 불확실성 해소 여부에 따라 시장분위기가 결정될 것으로 예상됩니다. 최근 미국 등 선진국을 중심으로 3분기 실적호조에 대한 기대감이 성장세 둔화 우려로 무게 중심이 옮겨가고 있어 지수상단을 제한할 것으로 보이며 이는 글로벌 전반적으로 하락압력으로 작용할 것으로 예상됩니다.</p>
<p>최근 지수 상승을 견인했던 기술주들의 하락폭 확대, 각국의 정치리스크 부각, 신흥국 금융불안 여진 등 부정적인 요소들이 상존해 있으므로 지역별 상황을 모니터링하고 국가별 민감도에 따라 투자비중을 조정하겠습니다. 중장기적인 관점에서 보수적인 스탠스를 유지할 계획이며, 다만 향후 펀더멘탈 개선이 이루어지는 시점에서는 비중확대를 통해 시장 상승에 참여할 수 있도록 탄력적으로 운용하여 수익률 제고에 만전을 기하겠습니다.</p>

▶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
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_운용	-1.50	-3.17	0.70	4.87
(비교지수 대비 성과)	(3.05)	(5.45)	(6.43)	(4.67)
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/C	-1.92	-4.00	-0.57	3.12
(비교지수 대비 성과)	(2.63)	(4.62)	(5.16)	(2.92)
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/C-e	-1.80	-3.76	-0.21	3.62
(비교지수 대비 성과)	(2.75)	(4.86)	(5.52)	(3.42)
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/S-P	-1.75	-3.65	-0.04	3.85
(비교지수 대비 성과)	(2.80)	(4.97)	(5.69)	(3.65)
비교지수(벤치마크)	-4.55	-8.62	-5.73	0.20

주)비교지수(벤치마크): S&P/KRX Exchange Index(T-1) X 90% + CD91 X 10%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_운용	4.87	31.10	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.67)	(5.72)	-	-
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/C	3.12	26.81	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.92)	(1.43)	-	-
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/C-e	3.62	28.01	-	-
(비교지수 대비 성과)	(3.42)	(2.63)	-	-
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/S-P	3.85	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(3.65)	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.20	25.38	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): S&P/KRX Exchange Index(T-1) X 90% + CD91 X 10%

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

▶ 손익현황

(단위:백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	6	0	0	0	-27	0	0	0	0	1	3	-18
당기	-2	0	0	0	-16	0	0	0	0	2	0	-16

4. 자산현황

아래 표시된 자산구성 현황은 고객님의 가입한 자펀드가 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.

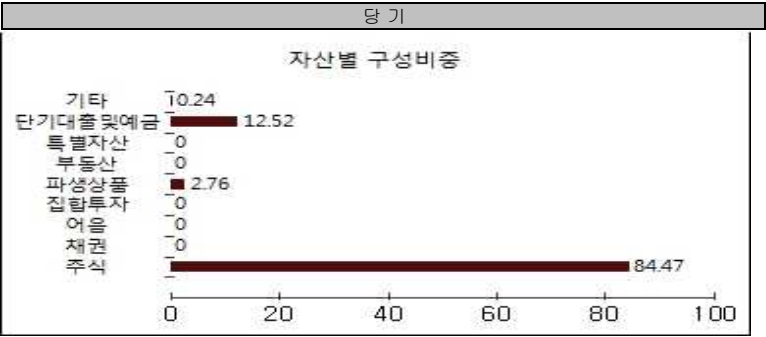
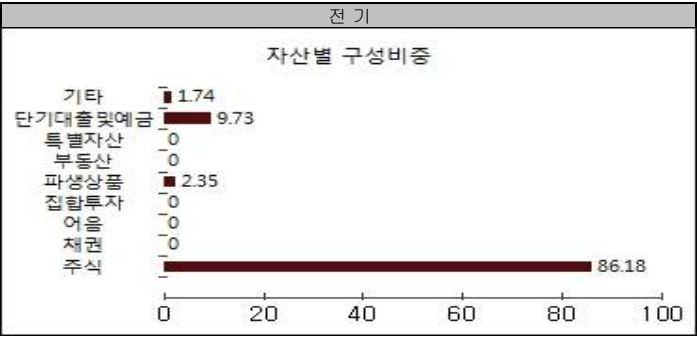
▶ 자산구성현황

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 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
AED (311.56)	2 (0.14)	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)	2 (0.14)
AUD (809.95)	8 (0.68)	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)	8 (0.68)
BRL (304.66)	92 (8.30)	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)	92 (8.30)
CAD (878.08)	21 (1.89)	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)	21 (1.89)
EUR (1320.75)	150 (13.54)	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)	150 (13.55)
GBP (1510.38)	96 (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)	96 (8.64)
HKD (146.03)	58 (5.20)	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)	58 (5.20)
JPY (10.19)	65 (5.86)	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)	65 (5.86)
MXN (59.90)	7 (0.64)	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)	7 (0.64)
MYR (275.20)	5 (0.41)	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)	5 (0.41)
NZD (741.46)	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 (125.56)	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 (827.72)	30 (2.68)	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)	30 (2.68)
USD (1144.40)	404 (36.50)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	111 (10.03)	0 (0.00)	515 (46.53)
ZAR (78.02)	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)
KRW (1.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	31 (2.76)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	28 (2.49)	3 (0.24)	61 (5.49)
합계	935	0		0	31	0	0	0	0	139	3	1,107

*(): 구성비중



주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 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 : %)				
순위	업종명	비중	순위	업종명
1	Diversified Financial Services	100.00		

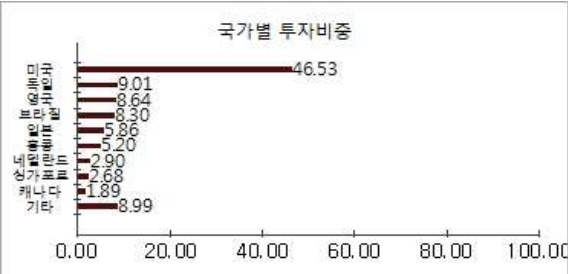
주) 주식종목의 업종 구분은, 국내 주식은 한국거래소의 업종분류기준, 해외 주식은 GICS(국제산업분류기준) 2차 분류를 따릅니다.

▶ 국가별 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 : %)					
순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	미국	46.53	6	홍콩	5.20
2	독일	9.01	7	네덜란드	2.90
3	영국	8.64	8	싱가포르	2.68
4	브라질	8.30	9	캐나다	1.89
5	일본	5.86	10	기타	8.99

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



▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	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.
펀드수익률에 미치는 효과	환헤지를 실행할 경우 외국통화의 가치가 원화에 대비하여 하락하는 때에는 환손실이 발생하지 않아 투자신탁의 성과에 유리하게 작용하는 반면, 외국통화의 가치가 원화에 비하여 상대적으로 상승하는 때에는 환이익 획득 기회를 상실하여 투자신탁의 성과에 불리하게 작용합니다. 환헤지에는 일정한 비용이 수반되며 이러한 비용은 투자신탁의 성과를 하락시키는 원인이 됩니다.

(단위 : %, 백만원)			
투자설명서 상의 목표 환헤지 비율	기준일(18.10.11)현재 환헤지 비율	환헤지 비용 (18.07.12 ~ 18.10.11)	환헤지로 인한 손익 (18.07.12 ~ 18.10.11)
외화표시자산의 순자산총액의 60±10%	61.2	0.2508	-16

주) 환헤지 비용은 통화선물거래에 따른 수수료이며, 선도환거래의 경우 수수료가 계약 환율에 반영되어 있어 별도의 산출은 불가능합니다.

▼ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황

▶ 통화선물

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
미국달러 F 201811	매도	56	640	

▶ 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 : %)							
순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	단기	USD Deposit(CITI)	10.03	6	해외주식	CBOE HOLDINGS INC	8.50
2	해외주식	CME GROUP	9.68	7	해외주식	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	8.30
3	해외주식	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9.04	8	해외주식	NASDAQ OMX GROUP/THE	7.06
4	해외주식	DEUTSCHE BOERSE AG	9.01	9	해외주식	JAPAN EXCHANGE GROUP INC	5.86
5	해외주식	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	8.64	10	해외주식	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	5.20

※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	519	107	9.68	미국	USD	Diversified Financial Services	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,179	100	9.04	미국	USD	Diversified Financial Services	
DEUTSCHE BOERSE AG	681	100	9.01	독일	EUR	Diversified Financial Services	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	1,521	96	8.64	영국	GBP	Diversified Financial Services	
CBOE HOLDINGS INC	806	94	8.5	미국	USD	Diversified Financial Services	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	12,170	92	8.3	브라질	BRL	Diversified Financial Services	
NASDAQ OMX GROUP/THE	833	78	7.06	미국	USD	Diversified Financial Services	
JAPAN EXCHANGE GROUP INC	3,339	65	5.86	일본	JPY	Diversified Financial Services	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	2,004	58	5.2	홍콩	HKD	Diversified Financial Services	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
외화예치금	한국씨티은행	2007-03-13	111	0.00	2099-12-31	미국	USD

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	생년	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
한진규 ^{주1)}	CIO	1969	27	4,429	8	12,575	2109000507

주1) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, ‘책임 운용전문인력’이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함.

주2) 운용중인 다른 집합투자기구 수 및 규모를 산정 할 때 해당 운용팀에서 운용중인 전체 집합투자기구를 대상으로 하며 모자형 구조의 모집합투자기구는 제외합니다.

주3) 펀드의 투자운용인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고 하실 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
2018.01.23 ~ 현재 2016.10.12 ~ 2018.01.22	한진규(책임) 박상건(부책임)

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

6. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

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 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}	
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_운용	자산운용사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.06	0.01	0.07	0.01	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	0.06	0.01	0.07	0.01	
	기타비용 ^{주2)}		0.07	0.01	0.08	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.35	0.03	0.41	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.35	0.03	0.41	0.04
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00	
유리글로벌거래소연금지축증권자[주식]_C/C	자산운용사	0.92	0.16	0.99	0.17	
	판매회사	1.34	0.24	1.44	0.24	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.12	0.02	0.13	0.02	
	일반사무관리회사	0.02	0.00	0.02	0.00	
	보수합계	2.40	0.43	2.59	0.43	
	기타비용 ^{주2)}		0.04	0.01	0.05	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.19	0.03	0.23	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.19	0.03	0.23	0.04
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00	

유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/C-e	자산운용사		0.30	0.16	0.39	0.17
	판매회사		0.22	0.12	0.28	0.12
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.04	0.02	0.05	0.02
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.01	0.00
	보수합계		0.56	0.31	0.73	0.31
	기타비용(주2)		0.01	0.01	0.02	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.06	0.03	0.09	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.06	0.03	0.09	0.04
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/S-P	자산운용사		0.45	0.16	0.41	0.17
	판매회사		0.17	0.06	0.15	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.06	0.02	0.05	0.02
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.01	0.00
	보수합계		0.69	0.25	0.62	0.25
	기타비용(주2)		0.02	0.01	0.02	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.09	0.03	0.09	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.09	0.03	0.09	0.04
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율
 ** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적,반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한 것입니다.

- ※ 성과보수내역 : 없음
- ※ 발행분담금내역 : 없음
- ※ 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

▶ 총보수, 비용비율

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

(단위: 연환산,%)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_운용	전기	0	0.0686	0.0465	0.1636
	당기	0	0.0762	0.0471	0.1508
종류(Class)별 현황					
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/C	전기	1.6787	0.0386	1.726	0.1683
	당기	1.6799	0.0419	1.7272	0.1506
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/C-e	전기	1.2035	0.0124	1.2497	0.1654
	당기	1.2045	0.0149	1.2518	0.1521
유리글로벌거래소연금저축증권자[주식]_C/S-P	전기	0.9734	0.0176	1.0186	0.1526
	당기	0.9758	0.0194	1.0228	0.1513

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 운
 용기간 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 나타
 냅니다.
 주3) 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

7. 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. 매매회전율이 높을
 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위:백만원, %)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
43,000	4,132	549,049	13,183	12.51	49.62

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 나타냅니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리글로벌거래소증권모[주식]					
2018-01-12 ~ 2018-04-11		2018-04-12 ~ 2018-07-11		2018-07-12 ~ 2018-10-11	
18.73		14.11		12.51	