

자산운용보고서

유리글로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식]

(운용기간 : 2020년11월28일 ~ 2021년02월27일)

○ 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)

| | |
|---|---|
| 1 | 공지사항 |
| 2 | 펀드의 개요 <ul style="list-style-type: none">▶ 기본정보▶ 재산현황 |
| 3 | 운용경과 및 수익률현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 운용경과▶ 투자환경 및 운용계획▶ 기간(누적) 수익률▶ 손익현황 |
| 4 | 자산현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 자산구성현황▶ 투자대상 상위 10종목▶ 각 자산별 보유종목 내역 |
| 5 | 투자운용전문인력 현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 투자운용인력(펀드매니저)▶ 해외 운용 수탁회사 |
| 6 | 비용현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 업자별 보수 지급현황▶ 총보수비용 비율 |
| 7 | 투자자산매매내역 <ul style="list-style-type: none">▶ 매매주식규모 및 회전율▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이 |
| 8 | 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항 |

1. 공지 사항

1. 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식] 운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '삼성증권, 신한은행'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 |
|--|---|----------|-------------------------------------|
| 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식] 운용, 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식]_Class A, 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식]_Class C, 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식]_Class C-F | | 2등급 | D0641, D0642, D0645, D0654 |
| 펀드의 종류 | 투자신탁, 증권펀드(주식형), 개방형, 추가형, 종류형 | 최초설정일 | 2020.02.28 |
| 운용기간 | 2020.11.28 ~ 2021.02.27 | 존속기간 | 추가형으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 자산운용회사 | 유리자산운용 | 펀드재산보관회사 | 신한은행 |
| 판매회사 | 삼성증권, 신한은행 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | 1. 투자대상 이 펀드는 주식을 주된 투자대상자산으로 하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 그러나 상기의 투자목적에 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 집합투자업자, 신탁업자, 판매회사 등 이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다. | | |
| | 2. 투자전략 이 투자신탁은 투자신탁재산의 대부분을 전 세계 증권, 선물, 상품 등이 거래되는 각종 거래소 및 거래소 유관기관 중 상장된 거래소 및 유관기관 주식에 주로 투자하여 장기적으로 투자대상자산의 가치상승에 따른 수익을 추구합니다. 거래소에 상장된 주식에 투자하는 것이 아닌, 상장된 거래소 주식에 투자하는 펀드입니다. [운용프로세스] - 매크로 시장 조사를 통해 국가별 투자비중을 결정합니다. - 종목의 정량적, 정성적 분석 후 Bottom-up(기본 재무분석)을 통한 최종 모델 포트폴리오를 결정합니다. - 최종 모델 포트폴리오에는 매월 리밸런싱 하며 종목 분석 단계에서 이슈가 있는 종목의 경우 편출입을 진행합니다. | | |
| | 3. 위험관리 - 운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회 등에서 결정합니다. - 리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다. [한 위험관리] 이 투자신탁은 외국통화 표시자산 투자에 따른 환율변동 위험을 방지하기 위한 환헤지 전략을 실행하지 아니할 계획입니다. 이 투자신탁은 매입신청, 환매청구 및 환매대금 지급, 기준가격 산정 등이 미국 달러(USD)로 이루어지므로 투자대상자산 중 미국 달러(USD) 표시 자산의 투자에 따른 환율 변동 위험에는 노출되지 않습니다. 다만, 미국 달러(USD) 표시 이외의 자산에 투자하는 경우에는 미국 달러(USD)와 미국 달러(USD) 이외의 통화 간의 환율 변동 위험에 노출될 수 있습니다. | | |
| | 4. 수익구조 이 펀드는 신탁재산의 대부분을 해외 주식에 투자하는 집합투자기구로서 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다. 주식의 시세는 해당 주식 발행 기업의 경영성과 및 주식에 대한 시장의 수요 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 투자신탁의 가치가 상승하는 것이, 반대의 경우에는 투자신탁의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다. 이 투자신탁 고유의 운용전략이 유효하게 목표를 달성하여 초과수익이 발생할 경우 이 투자신탁의 주식투자 성과는 투자대상국의 평균적인 추가상승률을 상회하게 되어 그렇지 않을 경우 투자대상국의 평균적인 추가상승률에 미달하게 됩니다. 운용자의 재량에 따라 적극적인 초과수익전략을 구사하는 특성상 이 투자신탁의 주식투자 성과가 투자대상국의 평균적인 추가변동률에 일정한 제한 없이 미달할 가능성이 있다는 점에 유의하시기 바랍니다. 이 투자신탁의 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 |
|----------------------------|-------------------|-------|-------|--------|
| 유рил로벌거래소증권(USD)[주식] 운용 | 자산 총액(A) | 51 | 56 | 10.70 |
| | 부채총액(B) | 1 | 2 | 143.67 |
| | 순자산총액(C=A-B) | 50 | 54 | 8.96 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 4,589 | 4,624 | 0.77 |
| | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 10.90 | 11.78 | 8.12 |
| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
| 유рил로벌거래소증권(USD)[주식]_C/A | 기준가격 | 10.79 | 11.62 | 7.75 |
| 유рил로벌거래소증권(USD)[주식]_C/C | 기준가격 | 10.79 | 11.61 | 7.65 |
| 유рил로벌거래소증권(USD)[주식]_C/C-F | 기준가격 | 10.83 | 11.69 | 7.91 |

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 | |
| 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식] 운용 | 2021. 3. 2. | 1 | 4,684 | 11.78 | 11.63 | |
| 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식]_Class A | 2021. 3. 2. | 0 | 3,772 | 11.62 | 11.62 | |
| 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식]_Class C | 2021. 3. 2. | 0 | 885 | 11.61 | 11.61 | |
| 유рил로벌거래소증권투자신탁(USD)[주식]_Class C-F | 2021. 3. 2. | 0 | 16 | 11.69 | 11.63 | |

주) 분배후수탁고는 재무자 61 백만좌 포함입니다.

▶ 윤용경과

본 기간 거래소 종목들은 글로벌 주식시장에 동화하며 성과 개선이 이어졌습니다. 그동안 조정폭이 컸던 만큼 대형 거래소 위주로 두드러진 반등세를 보였는데 거래소 유입기업 및 일부 신흥국 거래소 증가가 조정을 완화하면서 추가상승은 제한되었습니다. 바이든 대통령의 강한 경기부양 의지가 금리상승 기대감으로 이어지며 CME거래소 이후 상대적으로 깊은 가격조정을 보였던 CME거래소 및 CBOE거래소가 견조한 흐름을 이어갔습니다. 금리상승에 따른 이자율 패싱 효과 증가가 대입이 CME거래소에 비교적 작용하고도 시장변동성 확대권면에서 옵션거래량 증가가 CME거래소의 주가를 지지하였습니다. 홍콩거래소는 분기 중 30% 이상 급등하며 수익률 기여도를 높였습니다. 미국과 중국의 갈등 구도가 심화(중국 3대 통신사 뉴욕거래소 상장 철회) 때문인지, 알리바바 등 주요 플랫폼 기업 투자 금지, 사오미 등 블랙리스트 기업 투자 금지, 10년 만기 채권 등도 미국 거래소에서 거래중지되는 상황이 재현된 영향으로 중국 본토 투자자들이 홍콩거래소를 통해서 본토 기업 주식을 거래하려는 거래량 폭증한 것이 강력한 상승 동력으로 작용하였습니다. 미국 10년 만기 채권 금리상승, 중국의 통화정책 정상화 우려가 금융시장 변동성을 확대시키며 거래량은 재차 증가하였으나, 이는 거래 수 증가로 주요 수익원인 총 하나인 글로벌거래소 기업에 상승재대로 작용하였습니다. 런던거래소는 브렉시트 이후 거래량 폭락이 대거 유로존 국가들로 이동하는 약세에도 불구하고 레퍼티브트 인수 등이 마무리되면서 사상 최고치 행진을 이어갔습니다. 특히 영국에서 백신 접종을 시작하면서 경제활동재개 기대감이 확대되며 주가가 크게 반등하였습니다. 펀드는 개별 종목 이슈를 빠르게 반영하고 높은 편입비를 유지하면서 비교적수 대비 우수한 성과 시현에 주력하였습니다. 실적 연이러오며 기대되는 미국 대형 거래소 편입비를 점진적으로 상향 조정하고 런던거래소도 매수 강도를 높였습니다. 다만, 미국의 경기회복 기대감에 달리가지가 빠르게 상승하며 신흥국 통화 약세 전환이 관찰되어 신흥국 거래소 기업 투자 비중은 축소하며 반대되는 장세에 대응하였습니다.

금리 상승 기조가 지속되면서 상대적으로 성장주 성격이 강한 거래소 기업들도 조정을 피해 가기는 어려울 것 같으나 분위기에 대한 민감도는 다소 완화될 것으로 예상됩니다. 미국 연방준비제도(FED, 미국 중앙은행)가 3월 FOMC에서 원화절 환화정책에 대한 강력한 의지를 재확인하면서 시정금리 상승이 경기회복을 방해하는 건전한 상수이라는 데 중점을 하는 분위기가 형성될 것으로 보이기 때문입니다. 다만, 여전히 높은 수준의 시장변동성이 결코 한 예시주만을 유지할 것으로 판단되나 금리 상승기마다 의지할만한 나사가 확산될 수 있을 것 같습니다. 다만, 전반적인 펀더멘털의 훼손이 없다는 점을 감안하면 개별 기업의 실적에 매우 중성적이 될 것 같습니다. 꼭 작은 인수, 합병 등은 어떤 지형 환경 중이며 패시브자금 유입 확대 영향으로 거래량 증가도 지속되고 있습니다. 다만, 시정변동성 확대 측면에서 크게 증가했던 거래량은 다소 완화될 것으로 판단되어 거래량 모멘텀은 제한적일 것으로 보입니다. 거래소 기업들은 끊임없이 이 비즈니스 모델 다각화를 통한 장기 지속 가능한 성장에 역량을 집중하고 있습니다. 변화하는 금융환경에 대응하여 미래 먹거리 준비에도 부진한 모습입니다. 최근 비트코인 채굴량 급증하는 상황에서 CBOE거래소는 비트코인 선물 출시 소식을 전하는 등 신상품 개발에도 속도를 내고 있습니다. 변동성에 노출된 거래량 기반 수익구조에서 탈피하고자 하는 움직임도 활발히 관찰되고 있습니다. 탄탄한 캐쉬카우 역할을 하는 다편익자도 부문의 거래소들이 가장 확대하고 있는 사업 부문입니다. 각 거래소마다 데이터 제공 부문을 강화하려는 노력이 이루어지고 있는 이유입니다. 친환경 정책에 발맞추어 다양한 ESG 상품이 출시되고 있으며 경기회복 기대감에 IPO 시장 성장도 기대되고 있습니다. 미중 갈등의 대표적인 수혜자인 홍콩거래소는 변동성 극대화에 성장모멘텀이 다소 완화될 것으로 전망되어 아직실현하는 등 편익성을 축소할 예정입니다. 바이러스 확산세 둔화 상황에서 통화 및 재정정책 확대가 거래소 기업 주가에도 상당 부분 영향을 줄 것으로 예상되며 변화된 투자환경을 숙인하며 수익률 관리에 집중해갈 것입니다.

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|---------------------------|---------|---------|---------|---------|
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_운용 | 8.12 | 4.20 | 14.50 | 17.82 |
| (비교지수 대비 성과) | (0.05) | (0.64) | (-2.52) | (2.14) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_C/A | 7.75 | 3.48 | 13.32 | 16.24 |
| (비교지수 대비 성과) | (-0.32) | (-0.08) | (-3.70) | (0.56) |
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_C/C | 7.65 | 3.27 | 13.01 | 16.10 |
| (비교지수 대비 성과) | (-0.42) | (-0.29) | (-4.01) | (0.42) |
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_C/C-F | 7.91 | 3.77 | 13.81 | 16.90 |
| (비교지수 대비 성과) | (-0.16) | (0.21) | (-3.21) | (1.22) |
| 비교지수(벤치마크) | 8.07 | 3.56 | 17.02 | 15.68 |

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|---------------------------|--------|-------|-------|-------|
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_운용 | 17.82 | - | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (2.14) | - | - | - |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_C/A | 16.24 | - | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (0.56) | - | - | - |
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_C/C | 16.10 | - | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (0.42) | - | - | - |
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_C/C-F | 16.90 | - | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (1.22) | - | - | - |
| 비교지수(벤치마크) | 15.68 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

[illegible]

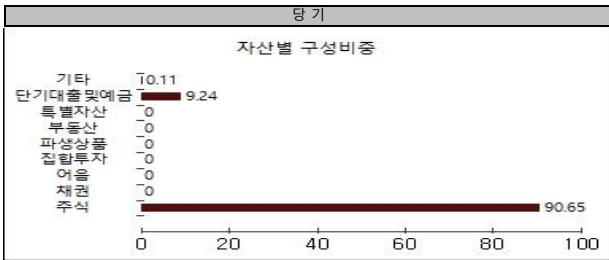
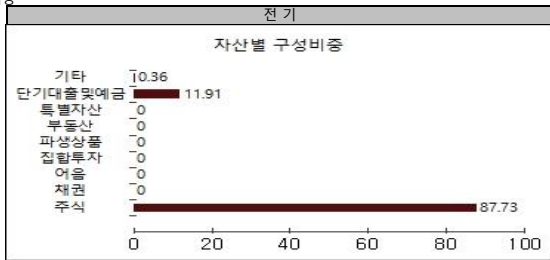
4. 자산현황

▶ 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 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| AUD (880.15) | 1,729 (3.08) | 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) | 1,729 (3.08) |
| BRL (203.13) | 3,617 (6.45) | 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) | 3,617 (6.45) |
| CAD (890.68) | 907 (1.62) | 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) | 907 (1.62) |
| EUR (1365.78) | 5,986 (10.67) | 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) | 5,986 (10.67) |
| GBP (1565.93) | 5,252 (9.37) | 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) | 5,252 (9.37) |
| HKD (144.86) | 6,170 (11.00) | 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) | 6,170 (11.00) |
| JPY (10.58) | 2,329 (4.15) | 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) | 2,329 (4.15) |
| MXN (53.62) | 260 (0.46) | 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) | 260 (0.46) |
| MYR (277.41) | 278 (0.49) | 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) | 278 (0.49) |
| SGD (846.07) | 1,518 (2.71) | 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) | 1,518 (2.71) |
| USD (1123.50) | 22,794 (40.64) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 5,180 (9.24) | 0 (0.00) | 27,974 (49.88) |
| 합계 | 50,840 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 5,180 | 61 | 56,081 |

*단위: 구성비중



▶ 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.

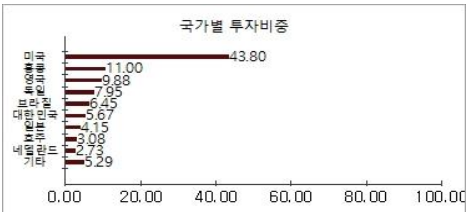
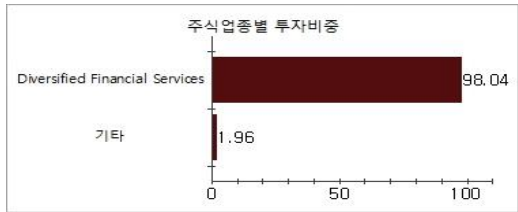
| (단위 : %) | | | | |
|----------|--------------------------------|-------|----|-----|
| 순위 | 업종명 | 비중 | 순위 | 업종명 |
| 1 | Diversified Financial Services | 98.04 | | |
| 2 | 기타 | 1.96 | | |

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 : %) | | | | | |
|----------|-----|-------|----|------|------|
| 순위 | 국가명 | 비중 | 순위 | 국가명 | 비중 |
| 1 | 미국 | 43.80 | 6 | 대한민국 | 5.67 |
| 2 | 홍콩 | 11.00 | 7 | 일본 | 4.15 |
| 3 | 영국 | 9.88 | 8 | 호주 | 3.08 |
| 4 | 독일 | 7.95 | 9 | 네덜란드 | 2.73 |
| 5 | 브라질 | 6.45 | 10 | 기타 | 5.29 |



▶ 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 | 해외주식 | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 11.00 | 6 | 해외주식 | MARKETAXESS HOLDINGS INC | 6.50 |
| 2 | 해외주식 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 9.37 | 7 | 해외주식 | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 6.45 |
| 3 | 해외주식 | CME GROUP | 9.33 | 8 | 해외주식 | NASDAQ OMX GROUP/THE | 6.04 |
| 4 | 해외주식 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 9.06 | 9 | 단기상품 | USD Deposit(SHINHAN)-KR | 5.56 |
| 5 | 해외주식 | DEUTSCHE BOERSE AG | 7.95 | 10 | 해외주식 | CBOE HOLDINGS INC | 4.16 |

▼ 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

| 종목명 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 | 발행국가 | 통화 | 업종 | 비고 |
|------------------------------------|---------|-------|------|------|-----|--------------------------------|----|
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 95,700 | 6,170 | 11.0 | 홍콩 | HKD | Diversified Financial Services | |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 38,810 | 5,252 | 9.4 | 영국 | GBP | Diversified Financial Services | |
| CME GROUP | 25,540 | 5,231 | 9.3 | 미국 | USD | Diversified Financial Services | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 45,389 | 5,084 | 9.1 | 미국 | USD | Diversified Financial Services | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 27,360 | 4,457 | 8.0 | 독일 | EUR | Diversified Financial Services | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 6,610 | 3,647 | 6.5 | 미국 | USD | Diversified Financial Services | |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 364,900 | 3,617 | 6.5 | 브라질 | BRL | Diversified Financial Services | |
| NASDAQ OMX GROUP/THE | 24,130 | 3,386 | 6.0 | 미국 | USD | Diversified Financial Services | |
| CBOE HOLDINGS INC | 23,330 | 2,333 | 4.2 | 미국 | USD | Diversified Financial Services | |

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

▶ 단기대출 및 예금

| 종류 | 금융기관 | 취득일자 | 금액 | 금리 | 만기일 | 발행국가 | 통화 |
|-------|-------------------------|------------|-------|------|-----|------|-----|
| 외화예치금 | USD Deposit(SHINHAN)-KR | 2020-02-28 | 3,119 | 0.00 | | 대한민국 | USD |

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 역원)

| 성명 | 직위 | 생년 | 운용중인 펀드 현황 | | 성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모 | | 협회등록번호 |
|--------------------|---------|------|------------|---------|-------------------------|-----------|------------|
| | | | 펀드개수 | 운용규모 | 펀드개수 | 운용규모 | |
| 안진규 ^{주1)} | CIO | 1969 | 111 | 439,420 | 7 | 2,013,420 | 2109000507 |
| 안재성 | 해외투자본부장 | 1972 | | | | | 2117000117 |

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 작성기 준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|----|--------|
| - | - |

▶ 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, 매매중계수수료)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)} | |
| 유리글로벌벤처소증권(USD)[주식]_운용 | 자산운용사 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| | 판매회사 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 10.00 | 0.02 | 5.55 | 0.01 | |
| | 일반사무관리회사 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 10.00 | 0.02 | 5.55 | 0.01 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | 12.25 | 0.03 | 17.95 | 0.03 | |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 23.16 | 0.05 | 16.49 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 | | | | |
| | | 서비스 수수료 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 합계 | 23.16 | 0.05 | 16.49 | 0.03 |
| | 증권거래세 | 4.39 | 0.01 | 1.05 | 0.00 | |
| 유리글로벌벤처소증권(USD)[주식]_C/A | 자산운용사 | 59.37 | 0.18 | 76.08 | 0.18 | |
| | 판매회사 | 50.89 | 0.15 | 65.21 | 0.15 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 13.67 | 0.04 | 12.09 | 0.03 | |
| | 일반사무관리회사 | 1.27 | 0.00 | 1.63 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 125.21 | 0.37 | 155.01 | 0.36 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | 9.69 | 0.03 | 14.74 | 0.03 | |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 17.79 | 0.05 | 13.33 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 | | | | |
| | | 서비스 수수료 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 합계 | 17.79 | 0.05 | 13.33 | 0.03 |
| | 증권거래세 | 3.34 | 0.01 | 0.85 | 0.00 | |
| 유리글로벌벤처소증권(USD)[주식]_C/C | 자산운용사 | 16.56 | 0.18 | 17.88 | 0.18 | |
| | 판매회사 | 23.65 | 0.25 | 25.55 | 0.25 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 3.88 | 0.04 | 2.84 | 0.03 | |
| | 일반사무관리회사 | 0.35 | 0.00 | 0.38 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 44.44 | 0.47 | 46.65 | 0.46 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | 2.76 | 0.03 | 3.44 | 0.03 | |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 5.26 | 0.06 | 3.10 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 서비스 수수료 | | | | |
| | | 합계 | 5.26 | 0.06 | 3.10 | 0.03 |
| | 증권거래세 | 1.03 | 0.01 | 0.20 | 0.00 | |
| 유리글로벌벤처소증권(USD)[주식]_C/C-F | 자산운용사 | 0.31 | 0.18 | 0.33 | 0.18 | |
| | 판매회사 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0.07 | 0.04 | 0.05 | 0.03 | |
| | 일반사무관리회사 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 0.40 | 0.23 | 0.40 | 0.21 | |
| | 기타비용 ^{주2)} | 0.05 | 0.03 | 0.06 | 0.03 | |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0.10 | 0.06 | 0.06 | 0.03 |
| | | 조사분석업무 등 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 서비스 수수료 | | | | |
| | | 합계 | 0.10 | 0.06 | 0.06 | 0.03 |
| | 증권거래세 | 0.02 | 0.01 | 0.00 | 0.00 | |

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 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 확인할 수 있습니다.

(단위: 연환산, %)

| | 구분 | 총보수·비용비율(A) ^{주1)} | 매매·중개수수료비율(B) ^{주2)} | 합계(A+B) |
|---------------------------|----|----------------------------|------------------------------|---------|
| 유리글로벌거래스증권(USD)[주식]_운용 | 전기 | 0.2852 | 0.4354 | 0.7206 |
| | 당기 | 0.2339 | 0.2898 | 0.5237 |
| 유리글로벌거래스증권(USD)[주식]_C/A | 전기 | 1.664 | 0.3787 | 2.0427 |
| | 당기 | 1.6199 | 0.2577 | 1.8776 |
| 유리글로벌거래스증권(USD)[주식]_C/C | 전기 | 2.0983 | 0.6403 | 2.7386 |
| | 당기 | 2.0429 | 0.4117 | 2.4546 |
| 유리글로벌거래스증권(USD)[주식]_C/C-F | 전기 | 1.2925 | 0.687 | 1.9795 |
| | 당기 | 1.2126 | 0.5349 | 1.7475 |

주1) 총보수비용비율(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 보수비용수준을 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 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 0.25%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위:백만원, %)

유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_운용

| 매주 | | 매도 | | 매매회전율 ^{주)} | |
|---------|--------|---------|-------|---------------------|-------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간 | 연환산 |
| 177,400 | 10,214 | 192,400 | 7,707 | 15.64 | 62.04 |

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리글로벌거래소증권(USD)[주식]_운용

| 2020-05-28 ~ 2020-08-27 | 2020-08-28 ~ 2020-11-27 | 2020-11-28 ~ 2021-02-27 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 39.78 | 2.27 | 15.64 |

※ 회전율 변동 사유: 기간 중 펀드는 환매 대응을 위한 편입자산 매도로 전기에 비해 매매회전율이 증가하였습니다.

8. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

(단위 : 백만원, %)

| 펀드명칭 | 투자금액 | 수익률 |
|---------------------------|------|------|
| 유리글로벌거래소증권(USD)[주식] C/C-F | 200 | 7.91 |

※투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매) 될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.