

자산운용보고서

유리글로벌Top10주식각단기채증권자투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2021년11월02일 ~ 2022년02월01일)

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)

1	공지사항
2	펀드의 개요 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 기본정보 ▶ 재산현황 ▶ 펀드의 투자전략
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 ▶ 환헤지에 관한 사항 ▶ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황 ▶ 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 회전을 ▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이
8	동일 집합투자기구에 대한 투자현황 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 투자현황
9	위험현황 및 관리방안 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험현황 ▶ 나. 주요 위험 관리방안 ▶ 다. 자전거래 현황 ▶ 라. 주요 비상대응 계획
10	자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

1. 공지 사항

1. 고객님이 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
2. 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로서 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는고객님이 가입한 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합), 운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사인 'NH농협은행, SK증권, 광주은행, 교보생명보험, 미래에셋증권, 부국증권, 우리은행, 하나금융투자, 한국프스증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.
4. 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 :

유리자산운용(주)
금융투자협회

www.yurieasset.co.kr
http://dis.kofia.or.kr

02-2168-7900

2. 펀드의 개요

▶기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭	투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	고난도 펀드
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),운용, 유리글로벌Top10플러스증권모투자신탁(주식), 유리크레딧단기채증권모투자신탁(채권), 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class A, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class A-e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class C, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class C-F, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class C-P1e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class C-P2, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class C-P2e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class C-e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class S, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class S-P, 유리글로벌Top10주식과단기채증권투자자산신탁(채권종합),Class S-R	4등급	DH152, DH150, DE628, DH153, DH154, DH156, DH159, DH163, DH164, DH165, DH157, DH166, DH167, DH168	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	2021.08.02	
운용기간	2021.11.02 ~ 2022.02.01	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	한국씨티은행
판매회사	NH농협은행, SK증권, 광주은행, 교보생명보험, 미래에셋증권, 부국증권, 우리은행, 하나금융투자, 한국프스증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 모자형 구조의 자투자신탁으로서 국내 채권에 주로 투자하는 '유리크레딧단기채증권모투자신탁(채권)'에 60% 이상, 외국 주식에 주로 투자하는 '유리글로벌Top10플러스증권모투자신탁(주식)'에 40% 이하 투자할 계획입니다.		

▶펀드 구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을때 각 모펀드의 집합투자증권을 얼마만큼 투자하고 있는지를 보여줍니다.

▶ 재산현황

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

펀드명칭		(단위: 백만원, 백만원, %)		
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),운용	항목	전기말	당기말	증감률
	자산 총액(A)	39,000	37,263	-4.45
	부채총액(B)	47	67	41.53
	순자산총액(C=A-B)	38,952	37,196	-4.51
	발행 수익증권 총 수(D)	38,661	38,036	-1.62
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),운용	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,007.53	977.92	-2.94
	자산 총액(A)	39,000	37,263	-4.45
	부채총액(B)	47	67	41.53
	순자산총액(C=A-B)	38,952	37,196	-4.51
	발행 수익증권 총 수(D)	38,661	38,036	-1.62
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,007.53	977.92	-2.94
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class A	기준가격	1,005.75	974.39	-3.12
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class A-e	기준가격	1,006.08	975.09	-3.08
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class C	기준가격	1,004.80	972.51	-3.21
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class C-F	기준가격	1,006.43	975.73	-3.05
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class C-P1e	기준가격	1,005.85	974.81	-3.09
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class C-P2	기준가격	0.00	983.90	-1.61
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class C-P2e	기준가격	994.36	963.54	-3.10
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class C-e	기준가격	1,004.30	972.87	-3.13
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class S	기준가격	1,005.40	974.50	-3.07
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class S-P	기준가격	1,004.47	973.75	-3.06
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자(채권종합),Class S-R	기준가격	999.80	969.28	-3.05

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.

▶ 펀드의 투자전략

투자전략
이 투자신탁은 모자형 구조의 자투자신탁으로서 국내 채권에 주로 투자하는 '유리크레딧단기채증권모투자신탁(채권)'에 60% 이상, 외국 주식에 주로 투자하는 '유리글로벌Top10플러스증권모투자신탁(주식)'에 40% 이하 투자할 계획입니다. 단기대출 및 금융기관예의 예치 등 유동성자산에의 투자는 투자신탁재산의 10% 이하 범위 내에서 운용할 계획입니다. 다만, 집합투자업자가 수익자에게 최선의 이익이 된다고 판단하는 경우에는 투자신탁 자산총액의 40% 이하의 범위 내에서 10%를 초과할 수 있습니다.

위험관리
환위험관리: 이 투자신탁은 외국통화 표시자산 투자에 따른 환율변동 위험을 방지하기 위해 원/달러 시율 또는 선도한 거래 등(통화관련 장래와 파생상품)을 통해 외국통화 표시자산의 순자산총액의 90±10% 범위에서 한례지를 실행할 계획입니다. 따라서 외화자산에 대한 한례지 비율범위가 자리가 남에 따라 일부 환율변동 위험에 노출될 수 있습니다.
<유리크레딧단기채증권모투자신탁(채권)> - 신용평가등급 A- 이상(단기사채의 경우 A2- 이상)의 채권에 투자하여 신용위험 관리 - 채권 잔존만기 2년 이내로 투자하여 금리상승 리스크 최소화 - 당사 크레딧 유니버스상 선정 및 유관부서와 철저한 검증을 통한 종목 편입
<유리글로벌Top10플러스증권모투자신탁(주식)> - 동일 종목 한도 및 동일 ETF 투자비중을 준수하여 법규 위반 리스크 관리 - 해외 펀드 특성상 시장 및 유?개장의 차이로 인한 신탁재산평가에 대한 시차가 발생할 수 있으며 편입자산의 관리관계 및 외화유동성 관리에 있어서 오퍼레이션 위험이 국내 자산에 비해 높은 수준이므로 이에 대한 철저한 모니터링 수행

수익구조
이 투자신탁에서 투자하는 모투자신탁의 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 투자자의 주된 이익 또는 손실이 결정됩니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드는 운용기간 동안 -2.94%의 수익률(운용클래스 기준)을 기록했습니다. 글로벌 증시는 오미크론 변이의 강력한 전파력이 경기둔화 우려를 자극한 가운데, 기록적인 인플레이션이 연준의 빠른 긴축 행보에 힘을 실으며 증시를 강하게 압박하였습니다. 12월 FOMC의사록에서 초기 금리인상과 양적 축소 스탠스 재확인하며 10년물 국제금리가 빠르게 반등한 영향으로 기술주 위주로 조정폭을 확대하였습니다. 빅테크 기업들 중심으로 1분기 기업 실적 호조가 하단지지를 제공하였으나 러시아와 우크라이나 사이의 지정학적 긴장감이 고조되며 선진국과 신흥국이 동반 악세를 시현하였습니다.

11월 글로벌 증시는 전강악화의 흐름을 보이며 선진국과 신흥국이 동반 하락세를 기록했습니다. 비둘기 FOMC회의, 인프라투자법안 통과, 양호한 경제지표가 상승 동인으로 작용했으나 미국 연준의 테이퍼링 속도전, 높은 물가수준이 초기 금리인상 우려를 자극하여 위험 선호가 후퇴하였습니다. 월말 오미크론 변이 바이러스 발생 소식에 투자심리 급랭하며 하락반전 하였습니다. 통화정책정상화 가속 기대가 덜러감세에 힘을 실으며 신흥국 증시가 낙폭을 확대하였습니다.

12월 글로벌 증시는 오미크론 공포가 빠르게 진정되며 회복된 투자심리가 지수상승을 견인하였습니다. 고용지표 개선, 높은 인플레이션 압력이 미국 연준의 조기긴축 행보를 가속화하여 시장변동성을 확대하였으나 개별기업 실적호조, 견고한 경제지표 및 예상치를 상회한 경제성장률과 코로나19 경우로 치료제 긴급 승인 등 상승재료가 우세하며 상승지지를 제공하였습니다. 다만, 미중 갈등 심화가 지속되었고 변이 바이러스 확산 등 차이나 리스크가 재차 확대되며 신흥국 증시를 압박한 영향으로 선진국과의 디커플링이 심화되는 모습을 보였습니다.

1월 글로벌 증시는 극심한 변동성 장세를 보이며 1월 효과에 대한 투자자들의 기대가 실망으로 되돌려진 기간이었습니다. 오미크론의 강력한 전파력이 경기둔화 우려를 자극한 가운데, 12월 FOMC 의사록발표 이후 연준의 긴축 행보 강화, 국제금리와 유가 급등, 러시아-우크라이나 긴장 고조 및 중동지역 지정학적 리스크가 증시의 발목을 잡으며 가파른 조정세를 보였습니다. 월말, FOMC회의 이후 금융시장 불확실성이 소폭 진정되었고 애플 등 대형 빅테크 기업들의 실적호조가 반등세를 이끌어 추가하락은 제한되었습니다. 에너지가격 상승 및 저가매수 등에 일부 신흥국증시 선방하며 선진국 대비 우수한 상대성과를 시현하였습니다.

기술주의 조정이 두드러진 기간이었습니다. 물가지표가 매월 사상최고치를 경신하는 등 인플레이션 장기화 우려가 지속되면서 주요국가 중앙은행의 긴축 행보가 빨라졌습니다. 금리인상 가속 우려는 미국 국제 금리 상승압력으로 작용하며 고블류, 고베타 대형 테크기업들의 부진으로 이어졌습니다. 미국 10년물 국제 금리도 가파르게 상승하며 그동안 풍부한 유동성 환경에서 상승폭이 컸던 종목들 위주로 조정압력이 심화되었습니다. 4분기 기업실적 개선이 증시 하단을 단단히 지지할 것이라고 기대했으나 빅테크 기업들은 엇갈리는 실적을 기록하며 추가변동성이 확대되었고 특히 가이던스가 약했던 기업들은 속절없이 폭락하는 모습을 보였습니다.

편입종목 대부분이 하락한 가운데, 애플과 마스터카드가 상승하며 펀드성과 방어에 기여하였습니다. 그 동안 높은 상승탄력으로 플러스 성과에 기여했던 엔비디아, ASML, 마이크로 소프트 등 업종 대표주들이 일제히 급락세를 시현하여 수익률을 되돌렸습니다. 미국 연준의 초기 금리인상 및 대차대조표 축소 등 빠르게 강해진 긴축스탠스에 대형 테크 종목 위주로 강력한 하방압력이 가해졌습니다. 애플은 강력한 상품경쟁력과 비즈니스 모델로 장기 성장성이 기대되며 사상 처음으로 시가총액 3조 달러를 기록하는 등 실적 호조와 함께 차별화된 대장주의 모습을 보였습니다. 오미크론 우려가 진정되고 위드코로나가 가시화되면서 리오프닝 기대감이 마스터카드도 탄탄한 상승흐름을 나타내며 성과 기여도를 높였습니다.

여닝시즌을 맞이하여 빅테크 기업들은 실적 결과와 가이던스 향방에 따라 극명하게 엇갈리는 흐름을 보였습니다. 애플은 분기 최대 매출을 달성하며 높은 상승세를 유지하였으나 넷플릭스는 양호한 실적에도 가입자수 가이던스가 시장 예상치를 크게 하회하자 애플 폭락에 급락세를 보였습니다.

펀드는 종목교체를 마무리하며 시장변동성 확대국면을 대응하였습니다. 마이크로 실적발표 이후 메모리반도체 얼황 턴어라운드 기대감을 반영하여 메모리반도체 대표 종목인 삼성전자를 편입하였습니다. 테이퍼링 가속에 따른 금리인상이 금융주 실적개선으로 이어질 것으로 기대되며 뱅크오브아메리카를 신규 편입하였습니다. 3분기 실적 부진 및 가이던스 예상치 하회하며 하락세를 면치 못했던 페이콤은 편출하는 한편 내부고발자 폭로 등 부정적인 뉴스가 집중되면 메타플랫폼과 반도체 섹터 내, 동종 업종에서 투자매력이 상대적으로 약할 것으로 예상되는 TSMC를 편출하여 시장상향변화에 유연하게 대처하며 효율적인 성과방어에 주력하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

글로벌증시는 높아진 인플레이션 우려와 지정학적 리스크가 확대되며 극심한 변동성 장세를 보이는 가운데, 러시아와 우크라이나 사이의 전쟁 상황, 미·중 갈등 양상, 3월 FOMC회의 및 원자재가격 흐름에 민감하게 반응하며 등락을 거듭할 것으로 전망됩니다.

시장 예상과는 달리 러시아와 우크라이나 사이에 벌어져 전원이 장기화되고 있으나 휴전 협상을 위한 노력이 지속되고 있는 만큼 추가 폭락은 제한될 것으로 보입니다. 다만, 전쟁위기로 행해진 韓리시가 경제제재는 원자재 가격 급등으로 이어지며 유가를 비롯한 니켈, 천연가스, 밀 등 주요 커머티티 가격이 폭주세를 보이고 있습니다. 가격이나 높은 물가수준에 상품가격까지 급등하며 글로벌 인플레이션 압력이 한층 가중되면서 스태그플레이션 우려가 부각되고 있다는 점은 부담입니다. 통화정책 불확실성도 주요 변수입니다. 파월 미국 연준의장이 3월 25bp 금리인상을 시사하면서 가파른 금리인상 우려는 경감되었지만 높은 인플레이션 레벨이 지속되고 있고 연준의 물가 통제 의지가 명확하다는 상황을 감안하면 긴축 속도가 빨라질 수 있다는 점도 배제하기 힘들 것으로 보입니다.

다만 최근 시장의 변수에 시장이 과민하게 반응한 측면이 있고 충분한 조정으로 밸류에이션 부담이 많이 낮아진 점, 여전히 글로벌 선도기업들은 높은 가격결정력으로 인플레이션 국면에서도 장기성장을 지속할 수 있다는 점은 긍정적입니다. 주요 선진국들 중심으로 오미크론 변이가 찾아들고 경제 리오프닝이 진행되고 있다는 점도 하방지지를 제공할 것으로 예상됩니다.

지정학적 리스크가 다소 진정되고, 주요국 중앙은행의 긴축 경로가 예상치에 부합할 경우, 실적 개선이 기대되는 종목들 중심으로 수익률 되돌림을 시도할 것으로 기대되는 이유입니다.

편입종목들은 계속되는 조정 국면에서 매도세가 집중되었습니다. 극심한 안전자산 선호로 채권금리가 하락하며 밸류에이션 부담은 다소 경감되었으나 고공행진을 거듭하는 원자재가격에 전반적인 경기우려가 커지고 있는 상황입니다. 펀드는 급변하고 있는 시장 상황에서 주 중매매를 자제하며 편입종목들의 밸류에이션을 재점검 하는 등 장기 안정적인 성과제고에 집중할 예정입니다. 최근 가격조정이 심화된 일부 종목에 대해서는 저가 매수기회를 활용하고, 개별 종목의 핵심 성장전망을 모니터링 하는 등 가격결정력을 확보한 기업들이 자본기에도 실적개선 기대감이 높다는 점을 감안하여 전략적으로 편입을 상향 조정하는 등 장기성과 제고에 최선을 다하겠습니다.

▶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.

구분		최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_운용		-2.94	-2.21	-	-
(비교지수 대비 성과)		(0.37)	(-0.37)	-	-
종류(Class)별 현황					
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A		-3.12	-2.56	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A-e		-3.08	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C		-3.21	-2.75	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-F		-3.05	-2.43	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P1e		-3.09	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2e		-3.10	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-e		-3.13	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S		-3.07	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-P		-3.06	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-R		-3.05	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
비교지수(벤치마크)		-3.31	-1.84	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): NASDAQ100 USD Index(T-1) X 30% + KOS1120 X 65% + CALL X 5%

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

구분		최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_운용		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
종류(Class)별 현황					
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A-e		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-F		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P1e		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2e		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-e		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-P		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-R		-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)		-	-	-	-
비교지수(벤치마크)		0.00	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): NASDAQ100 USD Index(T-1) X 30% + KOS1120 X 65% + CALL X 5%

※ 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	258	-36	9	72	-145	-22	0	0	0	0		6	-2	141
당기	-960	84	30	-150	-151	-90	0	0	0	0		13	93	-1,132

4. 자산현황

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

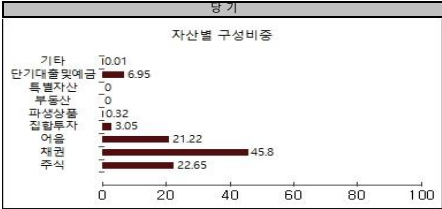
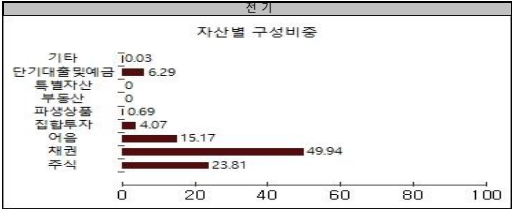
▶ 자산구성현황

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				
USD	7,538	0		1,136	0	-81	0	0	0	0		625	0	9,218
(1205.50)	(20.23)	(0.00)	(0.00)	(3.05)	(0.00)	-(0.22)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)		(1.68)	(0.00)	(24.74)
KRW	902	17,067	7,906	0	201	0	0	0	0	0		1,964	5	28,045
(1.00)	(2.42)	(45.80)	(21.22)	(0.00)	(0.54)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)		(5.27)	(0.01)	(75.26)
합계	8,440	17,067	7,906	1,136	201	-81	0	0	0	0		2,589	5	37,263

*①: 구성비중



주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산내역 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 발생 할 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	비중
1	Software	32.06	6	전기전자	10.68
2	Semiconductors	18.61			
3	Retailing	16.66			
4	Diversified Financial Services	11.24			
5	Hardware	10.75			

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

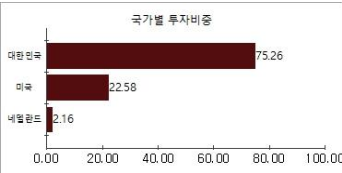
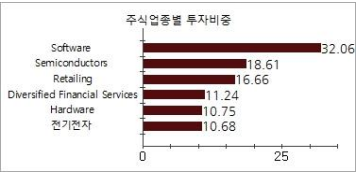
▶ 국가별 투자비중

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	대한민국	75.26			
2	미국	22.58			
3	네덜란드	2.16			

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



▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	환헤지란 환을 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 상승 하는 때에는 환이익 획득 기회를 상실하여 투자신탁의 성과에 불리하게 작용합니다. 환헤지에는 일정한 비용이 수반되며 이러한 비용은 투자신탁의 성과에 하락시키는 원인이 됩니다.

(단위 : %, 백만원)

투자설명서 상의 목표 환헤지 비율	기준일(22.02.01)현재 환헤지 비율	환헤지 비용 (21.11.02 ~ 22.02.01)	환헤지로 인한 손익 (21.11.02 ~ 22.02.01)
외국통화 표시자산의 순자산총액의 90±10%	94.4	1,6781	-233

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

▼ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황

▶ 통화선물

(단위: 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
미국달러 F 202202	매도	434	5,243	

▶ 선도환

(단위: 계약, 백만원)

종류	거래상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	실행가액	평가금액	비고
FWD KRW/USD 220215	주협은행	USD	매도	2022-02-15	3,536,700,000	3,536,700,000	-80,971,448	

▶ 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	채권	한일시멘트2-2	5.44	6	채권	엘에스전선19-2	3.55
2	어음	CPI(케이비국민카드0927-0523)	5.34	7	채권	웅산105	3.36
3	채권	하다카드196-1	5.29	8	채권	현대캐피탈8-1	2.69
4	단기장종	본대(씨티은행)	5.27	9	채권	교보증권7-1	2.69
5	채권	한화솔루션270	4.03	10	채권	롯데건설136-1	2.67

※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.

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보통기관	신용등급	비중
한일시멘트2-2	2,000	2,028	대한민국	KRW	2018-04-17	2023-04-17		A+	5.44
하다카드196-1	2,000	1,970	대한민국	KRW	2021-04-08	2023-08-08		AA0	5.29
한화솔루션270	1,500	1,502	대한민국	KRW	2020-04-21	2023-04-21		AA-	4.03
엘에스전선19-2	1,300	1,324	대한민국	KRW	2018-02-09	2023-02-09		A+	3.55
웅산105	1,250	1,253	대한민국	KRW	2020-04-27	2023-04-27		A0	3.36
현대캐피탈8-1	1,000	1,001	대한민국	KRW	2020-06-09	2023-06-09		A+	2.69
교보증권7-1	1,000	1,001	대한민국	KRW	2019-08-09	2022-08-09		AA-	2.69
롯데건설136-1	1,000	993	대한민국	KRW	2021-09-14	2023-09-14		A+	2.67

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

종목명	액면가액	평가액	발행일	상환일	보통기관	신용등급	비중
CPI(케이비국민카드0927-0523)	2,000	1,988	2021-09-27	2022-05-23		A1	5.34

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

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	평가기관	취득일자	금액	만기일	발행국가	통화
예금	한국씨티은행	2021-08-02	1,963	0.92	대한민국	KRW

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 역원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		펀드개수	성과보수가 있는 펀드 및 영업계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모		펀드개수	운용규모	
안재성 *1)	해외투자본부장	1972	17	4,851	0	0		2117000117
	채권운용본부장	1972	28	24,486	0	0		

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
2021.08.02 ~ 현재	안재정
2021.08.02 ~ 현재	최재영

▶ 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 *1)	금액	비율 *1)
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_운용	자산운용사	0.00	0.00	0.00
	판매회사	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	3.57	0.01	3.40
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00
	보수합계	3.57	0.01	3.40
	기타비용 *2)	3.89	0.01	3.88
	단순매매, 중계수수료	10.42	0.03	7.25
	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	10.42	0.03	7.44
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	9.44	0.09	14.22
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A	판매회사	8.09	0.08	12.19
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1.94	0.02	2.84
	일반사무관리회사	0.54	0.01	0.81
	보수합계	20.01	0.19	30.07
	기타비용 *2)	1.17	0.01	1.72
	단순매매, 중계수수료	1.92	0.02	3.03
	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	1.92	0.02	3.11
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	0.26	0.04	0.94
	판매회사	0.11	0.09	0.40
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A-e	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.05	0.02	0.19
	일반사무관리회사	0.01	0.00	0.05
	보수합계	0.43	0.14	1.58
	기타비용 *2)	0.03	0.01	0.11
	단순매매, 중계수수료	0.03	0.01	0.20
	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.01
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	0.03	0.01	0.21
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	0.00	0.09	0.07
	판매회사	0.01	0.18	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.02	0.01
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.01	0.28	0.22
	기타비용 *2)	0.00	0.01	0.01
	단순매매, 중계수수료	0.00	0.03	0.01
	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	0.00	0.03	0.01
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	18.08	0.09	16.67
	판매회사	1.55	0.01	1.43
	펀드재산보관회사(신탁업자)	4.29	0.02	3.35
	일반사무관리회사	1.03	0.01	0.95
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-F	보수합계	24.95	0.12	22.40
	기타비용 *2)	2.81	0.01	2.03
	단순매매, 중계수수료	8.38	0.04	3.58
	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.09
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	8.38	0.04	3.67
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	0.00	0.01	0.11
	판매회사	0.00	0.01	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.02
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.01
	보수합계	0.00	0.03	0.20
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P1e	기타비용 *2)	0.00	0.00	0.01
	단순매매, 중계수수료	0.00	0.00	0.01
	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	0.00	0.00	0.01
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	0.00	0.00	0.00
	판매회사	0.00	0.01	0.05
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.01
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.01
	보수합계	0.00	0.00	0.16
	기타비용 *2)	0.00	0.00	0.01
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2	단순매매, 중계수수료	0.00	0.00	0.00
	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	0.00	0.00	0.00
	판매회사	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.00
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.00	0.00	0.00
	기타비용 *2)	0.00	0.00	0.00
	단순매매, 중계수수료	0.00	0.00	0.00
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2e	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	0.00	0.01	0.02
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	0.01	0.05	0.19
	판매회사	0.01	0.03	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.01	0.04
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.01
	보수합계	0.01	0.10	0.36
	기타비용 *2)	0.00	0.00	0.02
	단순매매, 중계수수료	0.00	0.01	0.04
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-e	조자문적입부 등	0.00	0.00	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
	합계	0.00	0.01	0.02
	증권거래세	0.00	0.00	0.00
	자산운용사	0.69	0.08	1.67
	판매회사	0.69	0.08	1.67
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.13	0.02	0.33
	일반사무관리회사	0.04	0.00	0.10
	보수합계	1.54	0.19	3.76
	기타비용 *2)	0.07	0.01	0.20
	단순매매, 중계수수료	0.08	0.01	0.36

유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S	자산운용사		0.06	0.08	0.07	0.09
	판매회사		0.02	0.03	0.03	0.03
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.02	0.01	0.02
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.01
	보수합계		0.10	0.13	0.12	0.14
	기타비용 ※)		0.01	0.01	0.01	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.01	0.02	0.02
		소자문착입부 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.01	0.01	0.02	0.02
		합계	0.00	0.00	0.00	0.00
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-P	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
	자산운용사		0.02	0.07	0.04	0.09
	판매회사		0.00	0.01	0.01	0.02
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.02	0.01	0.02
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.04	0.11	0.06	0.13
	기타비용 ※)		0.00	0.01	0.00	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.01	0.02
		소자문착입부 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.00	0.01	0.01	0.02
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-R	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
	자산운용사		0.00	0.07	0.01	0.09
	판매회사		0.00	0.01	0.00	0.01
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.02
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.10	0.01	0.12
	기타비용 ※)		0.00	0.01	0.00	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.02
		소자문착입부 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.02

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

		해당 펀드		상위펀드 비율 합산	
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_운용	구분	총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	상위총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
종류(Class)별 현황					
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A	전기	0.7074	0.00497	0.7854	0.071
	당기	0.7074	0.00622	0.7834	0.0743
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class A-e	전기	0.5566	0.00014	0.6208	0.0412
	당기	0.5571	0.00032	0.6305	0.0702
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C	전기	1.082	0	1.1699	0.1173
	당기	1.103	0.00002	1.1768	0.0756
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-F	전기	0.4374	0.01514	0.5373	0.1621
	당기	0.4374	0.01156	0.5255	0.1212
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P1e	전기	0.5914	0	0.6543	0.0321
	당기	0.5954	0.00003	0.6472	0.0455
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2	전기	0	0	0	0
	당기	0	0	0.0525	0.0349
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-P2e	전기	0.6415	0	0.702	0.0349
	당기	0.6457	0.00005	0.7172	0.0719
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class C-e	전기	0.7572	0.0004	0.8242	0.0422
	당기	0.7573	0.00065	0.8301	0.0668
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S	전기	0.534	0.00003	0.6134	0.0649
	당기	0.534	0.00003	0.6109	0.0712
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-P	전기	0.4727	0.00001	0.5521	0.0571
	당기	0.473	0.00002	0.5481	0.0669
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_Class S-R	전기	0.4423	0	0.5095	0.045
	당기	0.4529	0	0.5237	0.0689

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.
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 회전율

매수		매도		매매회전율 주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
33,736	3,825	15,883	3,772	40.27	159.77

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

2021-08-01 ~ 2021-08-01		2021-08-02 ~ 2021-11-01		2021-11-02 ~ 2022-02-01	
0.00		2.00		40.27	

※ 회전을 변동 사유 : 펀드는 편입종목 교체로 인해 전기 대비 매매회전율이 증가했습니다.

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권	
집합투자기구명	발행종수(A)	보유수(B)	보유비율 (=A/B*100%)
해당시장 없음	0	0	0

9. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등
1. 원금손실위험 - 이 투자신탁은 예금보장법에 의한 보호를 받지 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있습니다. 따라서 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재하며 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전적으로 투자자가 부담하며 위탁회사나 판매회사 등 어떠한 당사자도 투자손실에 대하여 책임을 지지 않습니다. 또한 환매수수료가 부과되는 기간 중에 환매한 경우에는 환매수수료의 부과로 인해 투자손실이 발생하거나 손실의 폭이 더욱 확대될 수 있습니다.
2. 주식가격 변동위험 - 이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 외국 주식에 투자하기 때문에 외국 주식의 가격변동으로 인한 손실위험에 노출됩니다. 또한, 투자신탁재산의 가치는 투자대상종목 발행회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화에 따라 급격히 변동될 수 있습니다.
3. 환율변동위험 - 이 투자신탁은 외국통화로 표시된 자산에 투자함으로써 환율변동위험에 노출됩니다. 즉, 이 투자신탁 측은 모두투자신탁 에서 투자하는 외국주식 및 집합투자증권 등은 외화로 표시되어 거래되기 때문에 해당 통화가 원화 대비 가치가 하락할 경우 투자원 금액의 손실이 발생할 수 있습니다. 이 투자신탁은 외국통화 표시자산 투자에 따른 환율변동 위험을 방지하기 위해 원/달러 선물 또는 선도환 거래등 (통화관련 장내외 파생상품)을 통해 외화통화 표시자산 순자산총액의 80±10% 범위에서 환헤지를 실행할 계획입니다. 따라서, 외화자산에 대한 현재지 비율범위가 차이가 남에 따라 일부 환율변동 위험에 노출될 수 있습니다. 또한, 당해 투자신탁은 주기변동, 환율변동, 외환시장 상황의 급변동 등의 시장상황에 따라 실제 헤지비용이 목표 헤지비용과 상이할 수 있으며 설정/ 해지, 비용부담, 운용자의 판단 등에 따른 현재지 실행 비율에 따라 이 투자신탁의 일부 또는 전부가 환율변동 위험에 노출될 수 있습니다.
4. 포트폴리오 집중투자위험 - 이 투자신탁은 일부 산업에 속하는 주식 등에 선택적으로 집중 투자할 수 있으며 이에 따라 변동성 및 투자한 특정 섹터의 위험이 미치는 영향력이 동일유형의 일반적인 투자신탁 혹은 해당 시장에 비하여 상대적으로 클 수 있습니다. 또한 특정 섹터의 집중투자로 인해 환율변동과 정치적인 불확실성 등 특별한 위험을 수반한 기업에도 투자할 수 있습니다.
2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등
- 환매중단 등 위험발생가능성 낮음

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등
- 위기관리기준에 따라 가격변동, 신용등급변동, 대량환매 점진 발생단계에 따라 대응 및 이상매매 모니터링
- 펀드별 유동성 관리 프로세스 정립
- 해외투자자산의 유동성 문제가 발생하는 경우에 대비한 비상대책 확립
- 해외 재간접펀드 투자 시 역외 운용사의 운용능력 및 리스크관리 능력 확인 및 사후관리 점검

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등
- 해당 사항 없음

3. 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등
- 해당 사항 없음

▶ 다. 자전거래 현황

1. 자전거래규모				
최근 3개월		최근 6개월		최근 9개월
0		0		0
2. 최근 1년간 자전거래 발생 시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차 등				
- 해당 사항 없음				

▶ 라. 주요 비상대응계획

○ 대량 환매를 야기하거나 재해·전염병 등으로 인하여 업무 연속성을 확보하기 곤란한 위기상황 발생 시 회사의 ‘위험관리기준’내 마련된 ‘CONTINGENCY PLAN’ 운용지침에 따라 위기상황별 세부 운영계획을 마련하여 대응합니다. - 주의 단계 발생 Event에 대한 자본시장 영향 분석, 운용전략의 조정 - 위기 단계 위험관리위원회 의결(집합투자기구별(또는 유형별) 운용전략 제한, 유동성 확보계획 등 수립), 위기상황 보고체계 가동 - 위급 단계 비상대책반 구성하여 위기 상황별 구체적 실행계획의 수립 및 시행, 위험관리위원회 및 집합투자재산평가위원회 결의, 한국금융투자협회 및 금융감독원 등 감독기관과의 대응책 모색 ○ 부실자산 발생 시 ‘집합투자재산평가기준’에 따라 집합투자재산평가위원회를 소집하여 관련 규정과 절차에 따라 부실자산 평가방안 등을 결정하여 신탁재산 손실의 최소화를 추구합니다. ○ 부실자산에 대해서는 기본적으로 위험관리위원회의 결정에 따라 관리하며 필요시 Task-Force team을 구성하여 운영할 수 있습니다.
--

10. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

펀드명칭	투자금액	수익률
유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁(채권혼합) Class C-f	400	-3.05

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