

자산운용보고서

유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2022년11월02일 ~ 2023년02월01일)

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 공지사향

2 펀드의 개요

- ▶ 기본정보
- ▶ 재산현황
- ▶ 펀드의 투자전략

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

8 동일 집합투자기구에 대한 투자현황

- ▶ 투자현황

9 위험현황 및 관리방안

- ▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험현황
- ▶ 나. 주요 위험 관리방안
- ▶ 다. 자전거래 현황
- ▶ 라. 주요 비상대응 계획

10 자산운용사의 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

1. 공지 사항

1. 고객님의 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 정보는 고객님의 가입한 자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안전한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유рил로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁(채권혼합)의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사인 'NH농협은행, SK증권, 광주은행, 교보생명보험, 미래에셋증권, 부국증권, 우리은행, 하나증권, 한국포스증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
4. 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 : 유리자산운용(주) www.yurieasset.co.kr 02-2168-7900

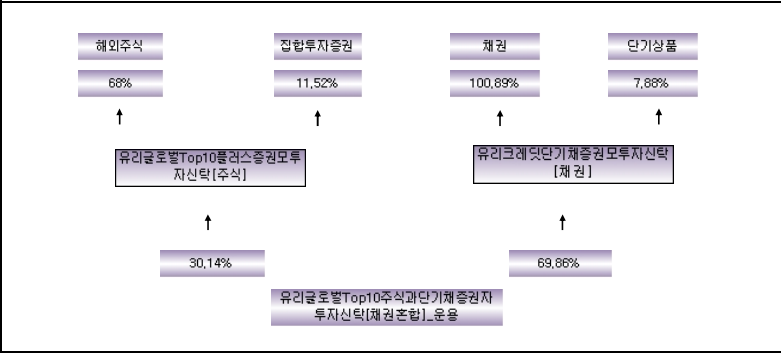
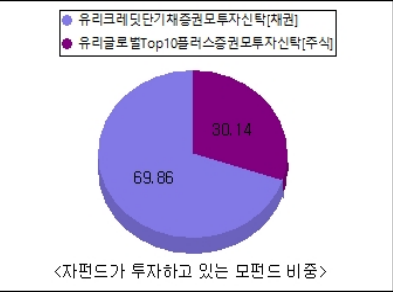
금융투자협회 http://dis.kofia.or.kr

2. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	고난도 펀드
유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_운용, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class A, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class A-e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class C, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class C-F, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class C-P1e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class C-P2, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class C-P2e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class C-W, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class C-e, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class S, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class S-P, 유리글로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁[채권혼합]_Class S-R		4등급	DH152, DH153, DH154, DH156, DH159, DH163, DH164, DH165, DH160, DH157, DH166, DH167, DH168	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2021.08.02	
운용기간	2022.11.02 ~ 2023.02.01	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음	
레버리지(차입 등) 한도	-			
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	한국씨티은행	
판매회사	NH농협은행, SK증권, 광주은행, 교보생명보험, 미래에셋증권, 부국증권, 우리은행, 하나증권, 한국포스증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	이 투자신탁은 국내 우량 크레딧 채권에 선별적으로 투자하여 듀레이션을 1년 수준으로 운용하는 '유리크레딧단기채증권모투자신탁[채권]'에 60% 이상, 글로벌 대표기업 및 업종 내 선도기업 주식에 집중 투자하는 '유리글로벌Top10플러스증권모투자신탁[주식]'에 40% 이하 투자하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다.			

▶ 펀드 구성



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

▶ 자산현황

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

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유рил로벌Top10주식과단기채증권자투자신탁(채권혼합)_운용	자산 총액(A)	28,420	24,128	-15.10
	부채총액(B)	5	30	458.01
	순자산총액(C=A-B)	28,415	24,099	-15.19
	발행 수익증권 총 수(D)	30,865	25,675	-16.82
	기준가격 (E=C/Dx1000)	920.60	938.61	1.96

종류(Class)별 기준가격 현황					
Class A	기준가격	912.41	928.64	1.78	
Class A-e	기준가격	914.10	930.71	1.82	
Class C	기준가격	907.93	923.17	1.68	
Class C-F	기준가격	915.53	932.43	1.85	
Class C-P1e	기준가격	913.57	930.07	1.81	
Class C-P2	기준가격	922.26	938.30	1.74	
Class C-P2e	기준가격	902.66	918.86	1.79	
Class C-W	기준가격	921.84	938.94	1.85	
Class C-e	기준가격	910.65	926.73	1.77	
Class S	기준가격	913.71	930.36	1.82	
Class S-P	기준가격	913.42	930.20	1.84	
Class S-R	기준가격	909.33	926.08	1.84	

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
<p>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.</p> <p><유리크레딧단기채증권모투자신탁(채권)> 이 투자신탁은 국내 우량 크레딧 채권(회사채 및 여전채)에 선별적으로 투자하는 한편, 금리 시장 리스크를 낮추고 안정적 이자수익 창출 위해 만기가 짧은 채권에 주로 투자하여 운용할 계획입니다.</p> <p>[운용 프로세스]</p> <ul style="list-style-type: none"> - Top down(하향식) + Bottom up(상향식) 방식 병행 <ul style="list-style-type: none"> • 내부/외부 리서치 활용하여 경제동향 및 통화정책 분석 기반으로 채권 금리의 방향성 예측 • 상대적으로 이자수익이 높거나, 신용 스프레드 축소 가능성이 높은 채권 위주로 편입 - 크레딧 유니버스 : 전문 크레딧애널리스트의 정량적/정성적 분석을 바탕으로 유니버스 선정 <ul style="list-style-type: none"> • 산업별/기업별 영업실적, 소유구조변경 등 기업신용관련 이슈 조사/분석/관리 • 채권운용본부, 리스크관리본부, 위험관리위원회 등 전사적 검토를 통한 크레딧 유니버스 선정 <p>[세부 운용전략]</p> <ul style="list-style-type: none"> - 듀레이션(편입채권의 가중평균 잔존만기) 1년 수준, 국내 우량 크레딧 채권에 선별적 투자를 통해 안정적인 이자 수익 추구 - 통화정책 변화 및 단기시장 수급에 따른 듀레이션 조절로 초과수익 추구 <p><유리글로벌Top10플러스증권모투자신탁[주식]> 이 투자신탁은 미래 지속 가능한 비즈니스 모델을 보유한 글로벌 대표기업 주식에 집중 투자하여 수익을 추구하는 한편 장기 성장이 기대되는 지수 또는 섹터 ETF 투자를 병행함으로써 추가 수익을 추구합니다.</p> <p>[세부 운용전략]</p> <ul style="list-style-type: none"> - 전략적 포트폴리오 구성 : ①글로벌 대표 기업, 업종 내 선도기업을 선별하여 집중 투자를 통해 장기 성과 추구 <p>전세계 대표 Index(지수)를 구성하는 핵심 종목을 엄선, Buy & Hold 전략을 통해 장기 안정적 수익 추구</p> <ul style="list-style-type: none"> - 펀드 유동성 확보 및 압축된 포트폴리오 관리의 효율성을 위해 ②글로벌 주요 ETF에의 투자 병행 - 전세계 대표 Index(지수) 구성종목의 편입비 변동에 따른 ③분기별 포트폴리오 Rebalancing(리밸런싱) 실시 - 글로벌 대표지수 내 편입종목 변경 및 자금 유출입 동향 등을 고려하여 필요시 포트폴리오 수시 조정 <p>[+ 알파 : ETF 편입 전략]</p> <ul style="list-style-type: none"> - 신탁자산의 20% 내외 편입 운용하여 원활한 유동성 관리 - 대표지수 ETF 및 투자 유망한(미래 성장동력이 기대되는 섹터 등) ETF 선별, 집중 포트폴리오 분산 효과 - 거래량, 유동성, 운용보수 등 정량적 요소 평가 병행

위험관리
<p><유리크레딧단기채증권모투자신탁(채권)></p> <ul style="list-style-type: none"> - 신용평가등급 A- 이상(단기사채의 경우 A2- 이상)의 채권에 투자하여 신용위험 관리 - 채권 잔존만기 2년 이내로 투자하여 금리상승 리스크 최소화 - 당사 크레딧 유니버스 선정 및 유관부서와 철저한 검증을 통한 종목 편입 <p><유리글로벌Top10플러스증권모투자신탁[주식]></p> <ul style="list-style-type: none"> - 동일 종목 한도 및 동일 ETF 투자비중을 준수하여 법규 위반 리스크 관리 - 해외 펀드 특성상 시차 및 휴·개장의 차이로 인한 신탁재산평가에 대한 시차가 발생할 수 있으며 편입자산의 권리관계 및 외화유동성 관리에 있어서 오퍼레이션 위험이 국내 자산에 비해 높은 수준이므로 이에 대한 철저한 모니터링 수행 <p>[환위험 관리 전략]</p> <ul style="list-style-type: none"> - 이 투자신탁은 외국통화 표시자산 투자에 따른 환율변동 위험을 방지하기 위해 원/달러 선물 또는 선도환 거래등 (통화관련 장내외 파생상품)을 통해 외국통화 표시자산의 순자산총액의 90±10% 범위에서 환헤지를 실행할 계획 입니다. 따라서, 외화자산에 대한 환헤지 비율범위가 차이가 남에 따라 일부 환율변동 위험에 노출될 수 있습니다. - 또한, 당해 투자신탁은 주가변동, 환율변동, 외환시장상황의 급변동 등의 시장상황에 따라 실제 헤지비용이 목표 헤지비용과 상이할 수 있으며 설정/해지, 비용부담, 운용자의 판단 등에 따른 환헤지 실행 비율에 따라 이 투자 신탁의 일부 또는 전부가 환율변동 위험에 노출될 수 있습니다.
수익구조
<p>이 투자신탁에서 투자하는 모투자신탁의 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 투자자의 주된 이익 또는 손실이 결정됩니다.</p>

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

운용기간 펀드는 1.96%(운용클래스 기준)의 수익률을 기록했습니다. 글로벌증시는 연준의 긴축강화 우려가 시장을 지속적으로 압박하였으나 예상치를 하회한 물가 지표와 저가 매수세 유입으로 큰 폭 상승했습니다. 연준의 매파적인 스탠스와 더불어 견조한 고용 및 경제지표에 추가 긴축 우려가 가중된 점이 증시에 변동성으로 작용하였으나, 인플레이션이 지난 6월 이후 지속적으로 둔화세를 보였고 특히 임금상승률이 하락하면서 국제금리와 달러화가 낙폭을 확대하였습니다. 낮아진 금리 레벨이 위험자산 선호 심리에 온기를 불어넣으며, 기술주 중심으로 추가 상승을 지지했습니다. 신흥국 증시는 달러의 약세 전환 및 중국의 위드코로나 시행에 따른 리오프닝 기대에 힘입어 강한 상승세를 기록했습니다. (전세계: 11.38%, 선진국: 10.35%, 신흥국: 20.20%)

11월 글로벌 증시는 선진국과 신흥국이 동반 강세를 시현하였습니다. 미국 연준의 긴축 속도조절 기대감이 지수상승을 견인한 가운데 중국증시 급반등 영향으로 신흥국증시가 주식시장 상승을 주도하였습니다. 미국 11월 FOMC회의에서 예상에 부합하는 75bp 금리인상에도 파월 연준의장이 최종 목표금리 상향을 시사하며 긴축 장기화 우려가 시장변동성을 키우기도 했으나, 10월 미국 소비자물가지수(+7.7%/yoy)가 예상치를 하회하면서 강달러와 고금리가 가파르게 하락 전환하며 대형 기술기업 중심의 강세가 이어졌습니다. 중국증시는 정부의 부동산 디벨로퍼 자금조달 지원정책과 코로나 봉쇄 완화 가능성 시사에 급반등세를 보이며 신흥국증시 성과개선을 견인 하였습니다. (전세계: 7.60%, 선진국: 6.80%, 신흥국: 14.64%)

12월 글로벌 증시는 조정압력이 거세지며 선진국 중심으로 낙폭을 확대하였습니다. 둔화된 소비자물가지수(7.1%, yoy), 12월 FOMC회의에서 시장 예상 수준의 긴축 속도 조절(50bp금리 인상) 했으나 점도표상 최종금리를 상향 조정한데다 FOMC의사록에서 매파적 기조가 재확인되며 긴축 장기화 경계감이 높아진 영향으로 국제금리 상승, 증시 하락을 견인하였습니다. 중국 경제활동 재개, 부동산경기 개선 및 빅테크 규제 완화가 경기 회복 기대감을 높이며 신흥국증시가 상대적으로 견조한 흐름을 보였습니다. (전세계: -4.05%, 선진국: -4.34%, 신흥국:-1.64%)

1월 글로벌증시는 상승탄력을 높이며 기대 이상의 성과를 시현하였습니다. 미국 연준의 금리인상사이클 종료 기대감이 우세한 가운데 국제금리와 달러가치가 가파르게 하락하며 위험선호를 자극하였습니다. 중국의 본격적인 리오프닝 영향으로 글로벌경기침체 우려가 경감한데다 미국 대표 기술주들이 예상보다 양호한 실적을 발표하며 반등 폭을 키웠습니다. 중국의 경제활동 재개에 따른 빠른 경기 반등 기대감 속, 미.중간 갈등 양상이 완화되는 등 호재성 재료가 유입되며 선진국과 신흥국이 동반 강세를 나타냈습니다. (전세계: 7.10%, 선진국: 7.00%, 신흥국: 7.85%)

연준의 긴축 속도 조절, 물가 상승세 둔화에 달러 강세가 가파르게 되돌리지면서 글로벌 대형 성장기업의 밸류에이션 부담이 완화되었습니다. 그 동안 가파르게 낙폭을 확대했던 만큼 성과 회복도 속도를 냈으나, 테슬라, 애플 등 대표기업들은 글로벌경기 둔화 여파에 직격탄을 맞으며 하락세를 비켜가지 못했습니다. 엔비디아는 금리 하락과 달러 약세에 환호하며 강세를 이어갔고 데이터센터용 매출이 가시화 될 것이라는 업황 턴어라운드 전망에 급등세를 보였습니다. 마이크로소프트는 최근 핵심테마로 급부상하고 있는 Chat GPT개발사인 오픈 AI에 100억 달러 투자방안을 논의 하는 등 발빠르게 미래 먹거리를 준비하면서 투자자들의 러브콜을 받고 큰 폭 상승했습니다. 다만, 테슬라는 CEO 일론머스크가 트위터 인수 자금을 위해 자사주를 대량으로 매도하였다는 소식과 수요 둔화를 이유로 중국에서 출하량이 크게 감소하며 낙폭을 키웠고, 애플은 중국의 코로나로 인한 생산차질과 글로벌 수요 둔화에 따른 아이폰 판매 부진 우려에 하락했습니다.

펀드는 불확실성이 높은 금융시장 환경이 장기화 될 가능성을 고려하여 포트폴리오 리밸런싱을 실행하였습니다. 개별 종목 이슈에 따라 높은 변동성을 보이는 국면이 지속되었고 실적시즌을 맞이하여 성과 차별화가 뚜렷한 것으로 예상되어 실적 및 가이던스 향방에 따라 편입비를 조정하였습니다. 특히 테슬라, 엔비디아 등 상승추세에 편승한 종목들은 호실적 기대감을 반영하여 선제적으로 편입비를 상향 조정하는 등 성과 개선에 집중하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

글로벌증시는 1월 효과에 제동이 걸리며 제한적인 흐름을 전망합니다. 시장의 가장 큰 관심사로 주목을 받았던 인플레이션은 주요국 중심으로 일제히 추세적인 둔화세가 관찰되고 있고 경기지표도 중국과 유럽을 중심으로 반등세를 보이고 있습니다. 고강도 긴축으로 미국의 상대적인 경기 둔화에도 탄탄한 고용지표가 경기저점을 방어할 것으로 보이는 등 전반적인 증시의 하방 위험이 완화되고 있는 점은 긍정적입니다. 다만 여전히 진행중인 이익전망 하향 조정과 긴축 영향에 따른 경기지표 부진 우려가 경기 불안을 자극할 수 있고 견조한 고용지표의 지속으로 미국 연준의 긴축 기조가 장기화될 수 있다는 점은 변동성 확대 요인입니다.

예상된 경기둔화 사이클은 중국의 빠른 경제회복과 유럽지역의 상대적 경기개선세에 힘입어 약해질 가능성이 있으나 미.중 갈등 고조, 부채한도 협상 등 여전히 투자심리를 제약하는 변수가 상존하고 있다는 점에서, 추가적인 긴축 속도 조절이나 경기 턴어라운드 가시화되기 전까지는 제한적 흐름이 이어질 것으로 예상됩니다

빅테크들의 실적 발표가 마무리되었습니다. 우려했던 어닝시즌은 실적 격차만큼이나 주가의 차별화도 심했던 양상을 보였습니다. 경기침체가 우려되는 상황에서 대형 기술기업들이 대규모 인원 감축, 설비투자 감소 등 구조조정을 단행하였고 이는 효율적인 비용통제 기대로 이어졌습니다. 고강도 긴축에 따른 수요 둔화와 이로 인한 경기침체는 다행히 중국의 전격 리오프닝이 시기를 앞당기며 생각보다 낙관적인 경기 전망으로 전환되고 있어 대형성장주 주가에 하방지지력을 제공할 것으로 예상됩니다. 다만 글로벌 빅테크기업 주가에 가장 큰 놀림목으로 작용했던 강달러와 고금리 상황이 크게 완화되었지만, 탄탄한 고용과 수요 회복 시그널로 인해 재차 달러강세에 힘이 실리고 있다는 점은 부담입니다. 1월 강세로 밸류에이션 매력이 경감된 상황도 추가 상승 전망을 제약할 요소임을 감안하면 변동성 확대요인을 경계하는 접근이 필요한 시기이기도 합니다.

대형 성장주 기업들은 선제적 구조조정을 통해 비용통제를 강화하고 새로운 미래먹거리 마련에 전력을 집중하고 있습니다. 그 동안 충성도 높은 고객 확보와 탄탄한 가격 결정력으로 글로벌 경쟁력을 확고히 다져온 이들 기업은 빠른 성장전략 실행을 통해 독보적인 지위를 이어갈 것으로 예상되어 장기적인 투자매력이 여전히 높다고 판단됩니다.

따라서 펀드는 경기 침체 우려 속 한 발 앞선 구조조정과 투자 지출 감소 등 위기 관리 능력을 제고하고, 장기 성장을 위한 선제적 투자를 통해 글로벌 경쟁력을 높여가는 기업들을 면밀히 모니터링 하며 성과 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.

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
유리글로벌Top10주식과단기채증권자 [채권혼합]_운용	1.96	-1.41	-1.97	-4.02
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

종류(Class)별 현황				
Class A	1.78	-1.76	-2.49	-4.70
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class A-e	1.82	-1.69	-2.38	-4.55
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C	1.68	-1.96	-2.78	-5.07
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-F	1.85	-1.63	-2.30	-4.44
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-P1e	1.81	-1.71	-2.41	-4.59
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-P2	1.74	-1.84	-2.55	-4.63
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-P2e	1.79	-1.73	-2.45	-4.64
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-W	1.85	-1.61	-2.27	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-e	1.77	-1.79	-2.53	-4.74
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class S	1.82	-1.68	-2.37	-4.53
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class S-P	1.84	-1.65	-2.32	-4.47
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class S-R	1.84	-1.64	-2.31	-4.46
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

주)비교지수(벤치마크): BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌Top10주식과단기채증권자 [채권혼합]_운용	-4.02	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
Class A	-4.70	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class A-e	-4.55	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C	-5.07	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-F	-4.44	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-P1e	-4.59	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-P2	-4.63	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-P2e	-4.64	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-W	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class C-e	-4.74	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class S	-4.53	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class S-P	-4.47	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
Class S-R	-4.46	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

주)비교지수(벤치마크): BM없음

※ 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	-479	-26	11	13	-315	-366	0	0	0	10	174	-977
당기	-549	302	15	-79	370	455	0	0	0	31	-81	466

4. 자산현황

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

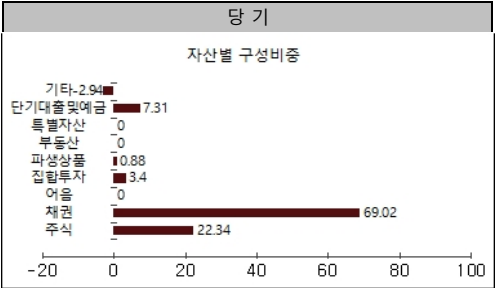
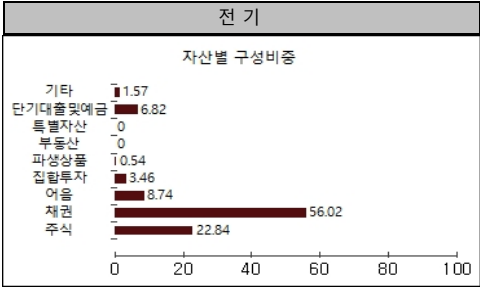
▶ 자산구성현황

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 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			
USD (1231.30)	4,842 (20.07)	0 (0.00)	(0.00)	820 (3.40)	0 (0.00)	9 (0.04)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	434 (1.80)	0 (0.00)	6,105 (25.30)
KRW (1.00)	547 (2.27)	16,653 (69.02)	(0.00)	0 (0.00)	202 (0.84)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,330 (5.51)	-710 (-2.94)	18,023 (74.70)
합계	5,389	16,653		820	202	9	0	0	0	1,764	-710	24,128

*() : 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	비중
1	Software	19.86	6	Semiconductors	10.27
2	Diversified Financial Services	19.23	7	전기전자	10.15
3	Retailing	10.56	8	Hardware	9.02
4	Automobiles & Components	10.47			
5	Health Care Equipment Services	10.44			

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

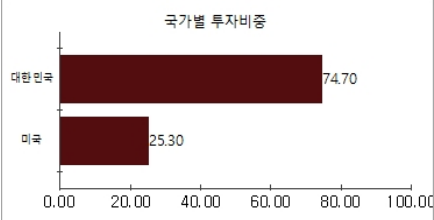
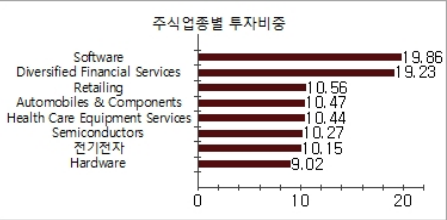
▶ 국가별 투자비중

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	74.70			
2	미국	25.30			

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



▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	환헤지란 환율 변동으로 인한 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총외화자산의 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(23.02.01)현재 환헤지 비율	환헤지 비용 (22.11.02 ~ 23.02.01)	환헤지로 인한 손익 (22.11.02 ~ 23.02.01)
외국통화 표시자산의 순자산총액의 90±10%	87.9	0.6055	805

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 202302	매도	235	2,890	

▶ 선도환

(단위: 계약, 원)

종류	거래상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	취득가액	평가금액	비고
FWD KRW/USD 230221	수협중앙회	USD	매도	2023-02-21	2,469,740,000	2,469,740,000	8,767,725	

▶ 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	한국전력1248	16.98	6	채권	우리은행26-08-이표1.5-갑-12	4.17
2	채권	신한은행26-07-이-2-A	6.24	7	채권	현대캐피코8-1	4.13
3	채권	한화솔루션270	6.20	8	채권	메리츠캐피탈186-1	4.13
4	채권	효성첨단소재262-2	4.99	9	채권	아이비케이캐피탈232-1(지)	4.10
5	채권	하나은행45-08이2갑-12	4.18	10	채권	금호석유화학154-2	4.04

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기 영업보고서 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.

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
한국전력1248	4,000	4,097	대한민국	KRW	2022-08-02	2024-08-02		AAA	16.98
신한은행26-07-이-2-A	1,500	1,505	대한민국	KRW	2022-07-14	2024-07-14		AAA	6.24
한화솔루션270	1,500	1,496	대한민국	KRW	2020-04-21	2023-04-21		AA-	6.20
효성첨단소재262-2	1,200	1,203	대한민국	KRW	2018-05-29	2023-05-29		A+	4.99
하나은행45-08이2갑-12	1,000	1,008	대한민국	KRW	2022-08-12	2024-08-12		AAA	4.18
우리은행26-08-이표1.5-갑-12	1,000	1,007	대한민국	KRW	2022-08-12	2024-02-12		AAA	4.17
현대캐피코8-1	1,000	996	대한민국	KRW	2020-06-09	2023-06-09		A+	4.13
메리츠캐피탈186-1	1,000	996	대한민국	KRW	2021-07-09	2023-04-07		A+	4.13
아이비케이캐피탈232-1(지)	1,000	990	대한민국	KRW	2021-04-14	2023-06-14		AA-	4.10

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

▶ 기타

(단위 : 백만원)

종류	평가금액	비고
REPO매도	1300	

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	
안재정 ^{주)}	해외투자본부장	1972	17	4,974	0	0	2117000117
노승진	해외투자본부 차장	1984					2109000709

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 자산운용 보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
-	-

▶ 해외운용수탁회사

- 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)}	
유리글로벌Top10주식과단기채증권자[채권혼합]_운용	자산운용사		0.00	0.00	0.00	0.00
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		2.85	0.01	2.38	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		2.85	0.01	2.38	0.01
	기타비용 ^{주2)}		3.19	0.01	2.71	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	3.48	0.01	2.54	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.09	0.00	0.08	0.00
		합계	3.58	0.01	2.62	0.01
	증권거래세		0.64	0.00	0.57	0.00
Class A	자산운용사		7.96	0.09	4.16	0.09
	판매회사		6.82	0.08	3.57	0.08
	펀드재산보관회사(신탁업자)		1.68	0.02	0.85	0.02
	일반사무관리회사		0.45	0.01	0.24	0.01
	보수합계		16.91	0.19	8.81	0.19
	기타비용 ^{주2)}		1.06	0.01	0.52	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1.08	0.01	0.51	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.03	0.00	0.02	0.00
		합계	1.11	0.01	0.53	0.01
	증권거래세		0.20	0.00	0.13	0.00
Class A-e	자산운용사		0.88	0.09	0.87	0.09
	판매회사		0.38	0.04	0.37	0.04
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.19	0.02	0.19	0.02
	일반사무관리회사		0.05	0.01	0.05	0.01
	보수합계		1.50	0.15	1.47	0.15
	기타비용 ^{주2)}		0.12	0.01	0.12	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.12	0.01	0.10	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.12	0.01	0.11	0.01
	증권거래세		0.02	0.00	0.02	0.00
Class C	자산운용사		0.13	0.09	0.14	0.09
	판매회사		0.26	0.18	0.28	0.18
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.03	0.02	0.03	0.02
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.01
	보수합계		0.43	0.29	0.45	0.29
	기타비용 ^{주2)}		0.02	0.01	0.02	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.02	0.01	0.02	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.02	0.01	0.02	0.01
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
Class C-F	자산운용사		14.64	0.09	14.41	0.09
	판매회사		1.25	0.01	1.24	0.01
	펀드재산보관회사(신탁업자)		3.10	0.02	3.08	0.02
	일반사무관리회사		0.84	0.01	0.82	0.01
	보수합계		19.83	0.12	19.55	0.12
	기타비용 ^{주2)}		1.94	0.01	1.98	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	2.00	0.01	1.70	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.05	0.00	0.05	0.00
		합계	2.05	0.01	1.75	0.01
	증권거래세		0.37	0.00	0.37	0.00

Class C-P1e	자산운용사		0.24	0.09	0.23	0.09
	판매회사		0.13	0.05	0.12	0.05
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.05	0.02	0.05	0.02
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.01
	보수합계		0.44	0.16	0.41	0.16
	기타비용 <small>주2)</small>		0.03	0.01	0.03	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.03	0.01	0.03	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.03	0.01	0.03	0.01
	증권거래세		0.01	0.00	0.01	0.00
Class C-P2	자산운용사		0.00	0.09	0.00	0.09
	판매회사		0.00	0.12	0.00	0.12
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.02	0.00	0.02
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.01	0.23	0.01	0.23
	기타비용 <small>주2)</small>		0.00	0.01	0.00	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.01	0.00	0.01
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
Class C-P2e	자산운용사		0.29	0.09	0.30	0.09
	판매회사		0.20	0.06	0.21	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.06	0.02	0.06	0.02
	일반사무관리회사		0.02	0.01	0.02	0.01
	보수합계		0.56	0.17	0.59	0.17
	기타비용 <small>주2)</small>		0.04	0.01	0.04	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.04	0.01	0.04	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.04	0.01	0.04	0.01
	증권거래세		0.01	0.00	0.01	0.00
Class C-W	자산운용사		0.15	0.09	0.13	0.09
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.03	0.02	0.03	0.02
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.01
	보수합계		0.19	0.11	0.17	0.11
	기타비용 <small>주2)</small>		0.02	0.01	0.02	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.02	0.01	0.02	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.02	0.01	0.02	0.01
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
Class C-e	자산운용사		1.13	0.09	0.99	0.09
	판매회사		1.13	0.09	0.99	0.09
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.24	0.02	0.21	0.02
	일반사무관리회사		0.06	0.01	0.06	0.01
	보수합계		2.56	0.20	2.26	0.20
	기타비용 <small>주2)</small>		0.15	0.01	0.14	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.15	0.01	0.12	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.16	0.01	0.12	0.01
	증권거래세		0.03	0.00	0.03	0.00
Class S	자산운용사		0.05	0.09	0.05	0.09
	판매회사		0.02	0.03	0.02	0.03
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.02	0.01	0.02
	일반사무관리회사		0.00	0.01	0.00	0.01
	보수합계		0.09	0.14	0.09	0.14
	기타비용 <small>주2)</small>		0.01	0.01	0.01	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.01	0.01	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.01	0.01	0.01

		증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00
Class S-P		자산운용사	0.04	0.09	0.04	0.09
		판매회사	0.01	0.02	0.01	0.02
		펀드재산보관회사(신탁업자)	0.01	0.02	0.01	0.02
		일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
		보수합계	0.06	0.13	0.06	0.13
		기타비용 <small>주2)</small>		0.00	0.01	0.00
		매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.01	0.00
			조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
			합계	0.01	0.01	0.00
		증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00
Class S-R		자산운용사	0.01	0.09	0.01	0.09
		판매회사	0.00	0.01	0.00	0.01
		펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.02	0.00	0.02
		일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
		보수합계	0.01	0.13	0.01	0.13
		기타비용 <small>주2)</small>		0.00	0.01	0.00
		매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00
			조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
			합계	0.00	0.01	0.00
		증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 : 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
유리글로벌Top10주식과단기채증권자 [채권혼합]_운용	전기	0.0008	0.0096	0.0827	0.049
	당기	0.0006	0.0106	0.0835	0.0429
종류(Class)별 현황					
Class A	전기	0.7076	0.00299	0.7904	0.0489
	당기	0.7076	0.00187	0.7849	0.0443
Class A-e	전기	0.5574	0.00033	0.6403	0.0491
	당기	0.5575	0.00044	0.6426	0.0426
Class C	전기	1.1069	0.00005	1.1907	0.0497
	당기	1.1068	0.00007	1.1917	0.0423
Class C-F	전기	0.4376	0.0055	0.5205	0.0491
	당기	0.4377	0.00732	0.5227	0.0426
Class C-P1e	전기	0.5971	0.00009	0.6798	0.049
	당기	0.5961	0.00011	0.6808	0.0422
Class C-P2	전기	0.8537	0	0.9372	0.0496
	당기	0.8629	0	0.9477	0.0421
Class C-P2e	전기	0.647	0.00011	0.7309	0.05
	당기	0.6469	0.00015	0.7318	0.0424
Class C-W	전기	0.4067	0.00006	0.4895	0.049
	당기	0.407	0.00007	0.4927	0.043
Class C-e	전기	0.7575	0.00044	0.84	0.0482
	당기	0.7575	0.00051	0.8429	0.0429
Class S	전기	0.5338	0.00002	0.6167	0.0491
	당기	0.5337	0.00003	0.6187	0.0426
Class S-P	전기	0.4734	0.00001	0.5565	0.0493
	당기	0.4733	0.00002	0.5581	0.0427
Class S-R	전기	0.4574	0	0.5409	0.0492
	당기	0.4576	0.00001	0.541	0.0415

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 회전을 (단위:백만원, %)

유리글로벌Top10플러스증권모[주식]

매수		매도		매매회전을 <small>주)</small>	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
8,035	967	11,000	1,486	28.28	112.18

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이 (단위: %)

유리글로벌Top10플러스증권모[주식]

2022-05-02 ~ 2022-08-01	2022-08-02 ~ 2022-11-01	2022-11-02 ~ 2023-02-01
23.20	28.19	28.28

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황 (단위:주, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=B/A*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
해당사항 없음			

9. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등
- 원금손실위험 : 이 투자신탁은 예금자보호법에 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.
- 크레딧 채권 등 투자에 따른 위험 : 이 투자신탁이 투자하는 회사채를 포함한 크레딧 채권 등은 중도 매각에 따른 할인율이 높습니다. 따라서 투자신탁에서 환매 대금 등의 마련을 위해 보유 채권을 매각할 경우 투자신탁의 수익률에 부정적인 영향을 미칠 수 있으며, 이는 잔존 수익자의 손실로 전가될 수 있습니다. 또한, 시장상황의 급변동, 신용등급의 하락 등으로 대량 환매 등의 상황이 발생할 경우 채권의 매각을 통한 유동성 확보가 어려울 수 있으며, 이로 인해 환매 대금 지급 불가능에 따른 환매연기 등의 사유가 발생 할 수 있습니다.
- 주식가격 변동위험 : 이 투자신탁은 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.
- 환율변동위험 : 이 투자신탁은 외화표시자산에의 투자에 따른 환율변동위험의 관리를 위해 환헤지를 실시할 수 있습니다. 환헤지를 실행할 경우 외국통화의 가치가 원화에 대비하여 하락하는 때에는 환헤지포지션에서 이익이 발생하여 외화자산의 환손실을 상쇄함으로써 투자신탁의 성과에 유리한 영향을 미치지만, 외국통화의 가치가 원화에 비하여 상대적으로 상승하는 때에는 환헤지포지션에서 손실이 발생하여 외화자산에서 발생하는 환이익을 상쇄함으로써 투자신탁의 성과에 불리한 영향을 미치게 됩니다. 환헤지에는 일정한 비용이 수반되며 이러한 비용은 투자신탁의 성과를 하락시키는 원인이 됩니다.
2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등
- 환매중단 등 위험발생가능성 낮음

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등				
1. 위기관리기준에 따라 가격변동, 신용등급변동, 대량환매 점검 발생단계에 따라 대응 및 이상매매 모니터링				
2. 펀드별 유동성 관리 프로세스 정립				
3. 해외투자자산의 유동성 문제가 발생하는 경우에 대비한 비상대책 확립				
4. 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	최근 12개월	
0	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 운용지침'에 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 투자 및 회수에 관한 사항

(단위:백만원, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
유리글로벌Top10주식과단기채증권투자신탁 [채권혼합]_운용	의무투자	2021-08-02	400	-	-	400	-6.76

- 주1) 투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매)될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.
- 주2) 수익률은 작성일 기준 시점의 자산운용사의 고유재산이 실제로 투자된 '유리글로벌Top10주식과단기채증권투자신탁[채권혼합]_C-F'의 투자금액(잔고)에 대한 평가수익률로 산정하며 소수점 둘째자리까지 표시하였습니다
- 주3) 투자금 및 투자잔액은 원본액 기준으로 작성하였습니다
- 주4) 「금융투자업규정」 제7-1조의2에 의거하여, 당사 고유재산 의무투자종료일은 2024.08.01(투자일로부터3년) 입니다. 집합투자업자의 판단에 따라 의무투자종료일 경과 후 해당 고유재산 투자금은 회수될 수 있습니다. 투자금 회수시 회수결과를 자산운용보고서에 기재하고 당사 홈페이지를 통해 공시할 예정입니다.