

자산운용보고서

유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]

(운용기간 : 2015년06월12일 ~ 2015년09월11일)

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

유리자산운용(주)

서울시 영등포구 국제금융로6길 17 부국증권빌딩 9층
(전화 02-2168-7900, www.yurieasset.co.kr)

목 차

1 공지사향

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 투자운용전문인력 현황

- ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
- ▶ 해외 운용 수탁회사

6 비용현황

- ▶ 업자별 보수 지급현황
- ▶ 총보수비용 비율

7 투자자산매매내역

- ▶ 매매주식규모 및 회전율
- ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]운용, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]A, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]A-e, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]C, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]S		1등급	66231, 66229, AQ489, 66230, AQ485
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형	최초설정일	2007.03.12
운용기간	2015.06.12 ~ 2015.09.11	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용(주)	펀드재산보관회사	한국씨티은행
판매회사	HMC투자증권,NH농협은행,NH투자증권,SK증권,골든브릿지증권,기업은행,대구은행,대신증권,부국증권,부산은행,삼성생명보험,신한금융투자,우리은행,유안타증권,키움증권,펀드온라인코리아,하나은행,한국투자증권,한화투자증권,현대증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	1. 투자대상 이 펀드는 전세계 주식시장에 상장된 증권, 선물, 상품 등 각종 거래소와 거래소 유관기관이 발행한 외국주식 등에 투자하는 해외 주식형 펀드로서 주식을 주된 투자대상자산으로 장기적인 자본이득 등을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 이 펀드의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 자산운용회사,판매회사,신탁업자 등 이 펀드와 관련된 어떠한 당사자도 투자자에 대한 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다.		
	2. 투자전략 가) 포트폴리오 구성전략- 신탁재산의 60% 이상을 전세계 주요국가의 증권(Stocks), 선물(Futures), 상품(Commodities) 및 기타 거래대상객체(예: 기후, Co2, 예술품 등) 등이 거래되는 각종 거래소(Exchange)와 거래소 유관기관(독립된 청산소, 대체결제소, 그리고 각종 대안거래소에 출자한 기관(IB, 은행 및 기타 회사 등))에서 발행한 상장주식에 투자합니다.- 당사의 자체기준(정성적 평가 (80%) 및 정량적 평가(20%)에 의해 종목별 등급을 (A, B, C, D 등)부여하고 등급상황에 포트폴리오를 조정합니다 . 등급의 부여는 계량적 요소 외에 비계량적 요소까지 고려하여 운용자의 주관 및 재량에 의해 결정되므로 이펀드 포트폴리오 구성 종목의 요건, 종목간 비중이 객관적 기준에 의해 특정되지는 않는다는 점에 유의하시기 바랍니다. 나) 자산배분 전략- 이 펀드는 운용자의 재량에 의해 주식투자비중 조절 등을 통한 자산배분 전략을 구사할 수 있습니다. 자산배분전략의 의도와달리 주가수준 등이 변화할 경우 펀드의 성과에 불리한 영향을 미치게 됩니다. 다) 기타 - 시장상황에 따라 신탁재산의 일부를 국공채, 통화안정증권, 회사채 등에 투자하여 환매대금의 예비적 확보 및 이자소득을 추구할 예정입니다.※ 상기에 제시된 운용 목표 및 전략은 시장상황 및 운용여건에 따라 변경될 수 있으며 이러한 전략이 반드시 유효하게 투자목적을 실현한다는 보장은 없습니다.		
	3. 위험관리 운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 및 위험관리실위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 운용업 실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다. 리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는 지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다.		

4. 수익구조

신락재산을 주로 해외 주식 등 외화표시자산에 투자하는 이 펀드의 특성과 환헤지 전략의 한계로 인해 이 펀드의 성과는 주식시세의 등락 및 배당과 환율변동으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 주식에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 펀드의 성과에 영향을 미치게 됩니다. 주식의 시세는 해당 주식 발행 기업의 경영성과 및 주식에 대한 시장의 수급 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 펀드의 가치가 상승하는 것이, 반대의 경우에는 펀드의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다. 이 펀드 고유의 운용전략이 유효하게 목표를 달성하여 초과수익이 발생할 경우 이 펀드의 주식투자 성과는 투자대상국의 평균적인 주가상승률을 상회하게 되며 그렇지 않을 경우 투자대상국의 평균적인 주가상승률에 미달하게 됩니다. 운용자의 재량에 따라 적극적인 초과수익전략을 구사하는 특성 상 이 펀드의 주식투자 성과가 투자대상국의 평균적인 주가 변동률에 밀접한 제한 없이 미달할 가능성이 있다는 점에 유의하시기 바랍니다. 이 펀드의 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
유리글로벌거래소1[주식]운용	자산 총액 (A)	12,548	11,522	-8.17
	부채 총액 (B)	79	475	501.00
	순자산총액 (C=A-B)	12,469	11,048	-11.40
	발행 수익증권 총 수 (D)	11,323	10,218	-9.76
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,101.25	1,081.24	-1.82
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리글로벌거래소1[주식]A	기준가격	1,096.68	1,072.08	-2.24
유리글로벌거래소1[주식]C	기준가격	1,096.14	1,071.00	-2.29
유리글로벌거래소1[주식]S	기준가격	1,098.16	1,075.07	-2.10
유리글로벌거래소1[주식]A-e	기준가격	1,097.89	1,074.53	-2.13

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.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

최근 글로벌 증시는 미국 기준 금리 인상 불확실성 및 중국 경기 둔화 우려감으로 인해 전반적으로 하락하였습니다. 미국증시는 고용지표가 호조 및 9월 기준금리 인상 가능성이 확대되며 8월 중순까지 뚜렷한 방향성 없이 횡보세를 거듭하였으나 위안화를 평가절하 하면서 하락세를 보이기 시작했으며, 중국 경기 둔화 우려감이 확산되면서 중국증시가 폭락하고 국제유가가 급락세를 보이자 미국 3대 지수 모두 최근 고점 대비 10% 하락하면서 조정국면에 진입하였습니다. 유럽 역시 중국발 차이나 쇼크를 피해가지 못하는 모습입니다. 월초 유럽증시는 주요 기업들의 실적이 호조세를 보이고 그리스의 3차 구제금융 협상 타결 기대감이 높아지며 상승세를 보였으나 중국 이슈로 인해 급락하였습니다.

미국 금리인상 및 중국 경기둔화 우려는 9월에도 이어질 수 있다는 점에서 단기간 내 증시의 추세전환은 어려워 보인다고 판단됩니다. 특히 중국을 중심으로 글로벌 경기회복세가 우려보다 견조하다는 증거가 나오기 전까지 높은 변동성 장세는 지속될 것으로 예상됩니다. 또한 최근의 글로벌 시장참여자들의 우려가 미국 금리인상보다 중국발 글로벌 경기후퇴 가능성에 있음을 감안하면 본격적인 증시 반등은 중국 경제지표의 회복세 확인 이후에 나타날 가능성이 높다고 보여집니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

미국 금리인상 및 중국발 경제둔화 리스크로 글로벌 증시가 전반적으로 조정을 받고 있는 가운데 동 펀드는 국가별로 차별적인 대응을 하고 있습니다. 홍콩 시장은 전 고점대비 약 40%가량 크게 하락하였으나 동 펀드에서는 하락 시작 시점인 7월 초 일부 차익실현을 하여 비중 축소를 해 놓은 점이 긍정적으로 작용하였습니다. 또한 최근 달러 강세 흐름으로 원달러 헷지 비중을 낮게 유지한 점 또한 수익률 방어에 일조하였습니다. 글로벌 증시 급락국면에서 그동안 상대적으로 견조했던 일본 증시 역시 글로벌 증시 급락에 동조하며 하락반전 하였습니다. 특히 엔달러 환율이 120엔을 하향돌파 하면서 일본 수출주들의 주가 흐름이 단기적으로 부진한 모습을 보인 것이 크게 작용하였습니다. 향후에도 그 동안 낙폭이 과도하게 컸던 시장을 중심으로 비중조절이 이루어질 것이며 달러 강세가 당분간 지속될 것으로 보여지므로 일정 레벨에서 조금씩 헷지 비중을 늘려나갈 계획입니다.

원달러 환율은 1) 중국의 위안화 평가 절하와 2) 글로벌 증시의 폭락세, 3) 북한 리스크 부각, 4) 외국인 주식 자금 이탈 등으로 급등세를 연출하며 8월 중 1,200원을 터치하였으나 북한 이슈 해소와 당국의 속도 조절로 월 후반 상승 속도가 둔화되었습니다. 향후에는 1) 미국 금리인상과 2) 신흥국 통화 불안, 3) 외국인 자금 이탈 등으로 상승 압력이 지속될 것으로 예상되나 금융시장 패닉 진전과 당국의 적극적인 속도 조절, 상단에서의 네고 물량 출하 등으로 상방 경직성을 확인할 것으로 전망됩니다.

▶ 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
유리글로벌버려소1[주식]운용 (비교지수 대비 성과)	-1.82 (4.72)	8.12 (5.11)	12.20 (7.51)	14.52 (11.98)
종류(Class)별 현황				
유리글로벌버려소1[주식]A	-2.24	7.21	10.80	12.62
유리글로벌버려소1[주식]C	-2.29	7.10	10.63	12.40
유리글로벌버려소1[주식]S	-2.10	7.51	11.25	13.23
유리글로벌버려소1[주식]A-e	-2.13	7.45	11.17	13.37
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
유리글로벌버려소1[주식]C_통합 (비교지수 대비 성과)	-2.24 (4.29)	7.21 (4.19)	10.80 (6.11)	12.62 (10.09)
비교지수(벤치마크)	-6.53	3.02	4.69	2.54

주) 비교지수(벤치마크) : S&P/KRX Exchange Index 90.0%, CD91 10.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌버려소1[주식]_운용 (비교지수 대비 성과)	14.52 (11.98)	33.48 (14.59)	73.56 (24.02)	84.38 (29.94)
종류(Class)별 현황				
유리글로벌버려소1[주식]A	12.62	29.12	65.17	69.62
유리글로벌버려소1[주식]C	12.40	28.62	64.00	66.30
유리글로벌버려소1[주식]S	13.23	-	-	-
유리글로벌버려소1[주식]A-e	13.37	-	-	-
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
유리글로벌버려소1[주식]C_통합 (비교지수 대비 성과)	12.62 (10.09)	29.10 (10.21)	65.15 (15.61)	69.60 (15.16)
비교지수(벤치마크)	2.54	18.89	49.53	54.44

주) 비교지수(벤치마크) : S&P/KRX Exchange Index 90.0%, CD91 10.0%

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	1,332	-	-	-	128	21	-	-	-	-1	-50	1,430
당 기	219	-	-	-	-376	-78	-	-	-	-11	38	-208

4. 자산현황

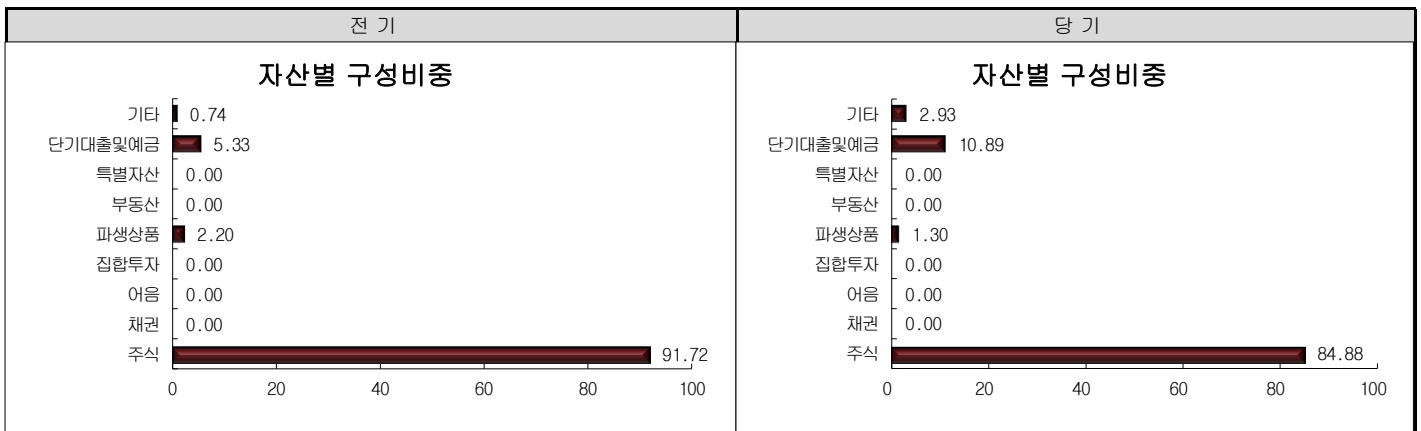
▶ 자산구성현황

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 구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
AED	92	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	92
비중	(0.80)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.80)
AUD	100	0	0	0	0	0	0	0	0	1	0	101
836.49	(0.87)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.01)	(0.00)	(0.88)
BRL	443	0	0	0	0	0	0	0	0	5	0	449
307.49	(3.85)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.04)	(0.00)	(3.89)
CAD	72	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	73
894.43	(0.63)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.63)
EUR	1,712	0	0	0	0	0	0	0	0	22	0	1,734
1337	(14.86)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.19)	(0.00)	(15.05)
GBP	1,089	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,090
1829.8	(9.46)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(9.46)
HKD	703	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	703
152.84	(6.10)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(6.10)
JPY	1,023	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,023
9.8172	(8.88)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(8.88)
MXN	54	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	54
70.59	(0.47)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.47)
MYR	50	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	50
274.99	(0.43)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.43)
NZD	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
747.66	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
SEK	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
142.13	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
SGD	701	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	701
838.88	(6.09)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(6.09)
USD	3,340	0	0	0	0	-34	0	0	0	1,118	0	4,423
1184.5	(28.98)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	-(0.30)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(9.70)	(0.00)	(38.39)
ZAR	400	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	400
86.76	(3.47)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(3.48)
KRW	0	0	0	0	184	0	0	0	0	108	338	630
0	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.60)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.94)	(2.93)	(5.47)
합 계	9,780	0	0	0	184	-34	0	0	0	1,255	338	11,522

* () : 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.

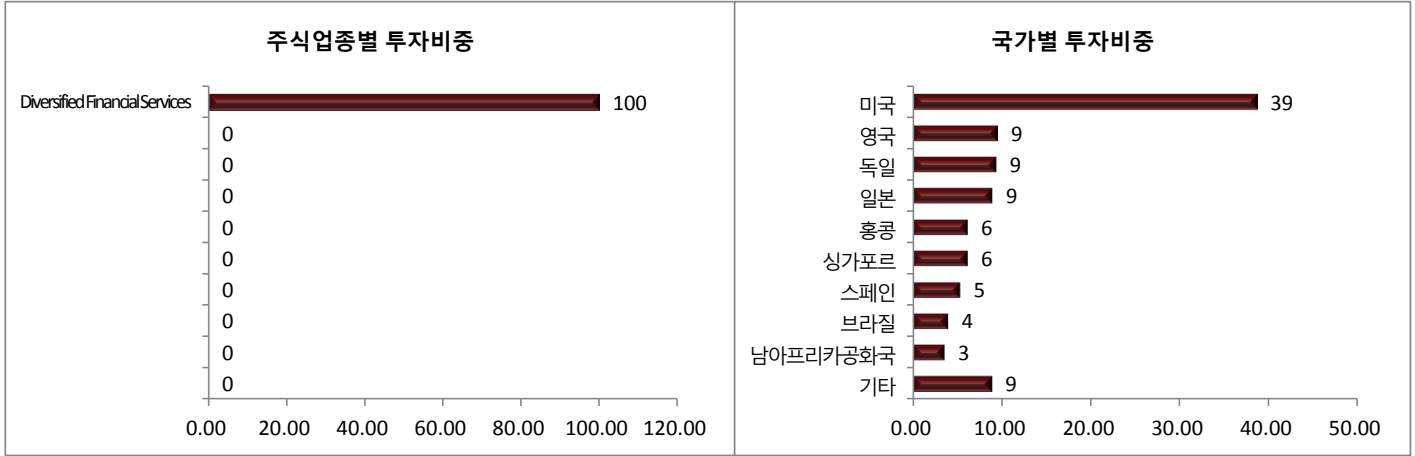
▶ 국가별 투자비중

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	38.69	6	싱가포르	6.09
2	영국	9.46	7	스페인	5.25
3	독일	9.33	8	브라질	3.89
4	일본	8.88	9	남아프리카공화국	3.48
5	홍콩	6.10	10	기타	8.83

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(15년09월11일) 현재 환헤지 비율
외화표시자산의 순자산총액의 60±10% 범위에서 환헤지 실행	57.80%

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 201509	43.71	6	해외주식	JAPAN EXCHANGE GROUP	8.88
2	단기상품	USD Deposit(CITI)	9.70	7	해외주식	CBOE HOLDINGS INC	7.31
3	해외주식	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	9.46	8	해외주식	INTERCONTINENTAL EXCHANGE	7.30
4	해외주식	CME GROUP	9.37	9	해외주식	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	6.10
5	해외주식	DEUTSCHE BOERSE AG	9.33	10	해외주식	SINGAPORE EXCHANGE LTD	6.09

※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 확인할 수 있습니다.

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PL	23,599	1,089	9.46	영국	GBP	미분류	
CME GROUP	9,750	1,079	9.37	미국	USD	미분류	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,000	1,075	9.33	독일	EUR	미분류	
JAPAN EXCHANGE GROUP	28,500	1,023	8.88	일본	JPY	미분류	
CBOE HOLDINGS INC	10,873	842	7.31	미국	USD	미분류	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE	3,022	842	7.30	미국	USD	미분류	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING	24,674	703	6.10	홍콩	HKD	미분류	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	111,940	701	6.09	싱가포르	SGD	미분류	
BOLSAS Y MERCADOS ESPANOL	12,696	605	5.25	스페인	EUR	미분류	
NASDAQ OMX GROUP/THE	9,476	576	5.00	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 201509	매도	425	5,036	

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	1,118	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	퀀트운용본부장	1969	60	9,604	4	2,241	2109000507
박상건	대안투자팀원	1982	138	2,522	-	-	2114000253

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

성명	책임/부책임	기간

▶ 해외 운용 수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

6. 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, %)

	구 분		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)		2.76	0.02	1.46	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		2.76	0.02	1.46	0.01
	기타비용**		3.33	0.02	1.72	0.01
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	8.12	0.06	4.43	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	8.12	0.06	4.43	0.04
	증권거래세		1.02	0.01	0.10	0.00
유리글로벌거래소1[주식]A	자산운용사		19.51	0.18	16.46	0.18
	판매회사		25.08	0.23	21.16	0.23
	펀드재산보관회사(신탁업자)		4.16	0.04	2.79	0.03
	일반사무관리회사		0.42	0.00	0.35	0.00
	보수합계		49.16	0.44	40.76	0.44
	기타비용**		2.72	0.02	1.40	0.02
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	6.48	0.06	3.48	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	6.48	0.06	3.48	0.04
	증권거래세		0.81	0.01	0.08	0.00
유리글로벌거래소1[주식]C	자산운용사		4.84	0.18	4.36	0.18
	판매회사		7.60	0.28	6.85	0.28
	펀드재산보관회사(신탁업자)		1.03	0.04	0.74	0.03
	일반사무관리회사		0.10	0.00	0.09	0.00
	보수합계		13.57	0.50	12.04	0.49
	기타비용**		0.68	0.02	0.37	0.01
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1.61	0.06	0.91	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	1.61	0.06	0.91	0.04
	증권거래세		0.20	0.01	0.02	0.00
유리글로벌거래소1[주식]S	자산운용사		0.02	0.18	0.10	0.18
	판매회사		0.01	0.09	0.05	0.09
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.04	0.02	0.03
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.03	0.31	0.17	0.30
	기타비용**		0.00	0.02	0.01	0.02
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.01	0.07	0.02	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.07	0.02	0.04
	증권거래세		0.00	0.01	0.00	0.00
	자산운용사		0.06	0.18	0.07	0.18
	판매회사		0.04	0.11	0.05	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.04	0.01	0.03
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00

유리글로벌거래소1[주식]_A-e		보수합계		0.11	0.33	0.13	0.32
		기타비용**		0.01	0.02	0.01	0.01
		매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.02	0.06	0.02	0.04
			조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
			합계	0.02	0.06	0.02	0.04
		증권거래세		0.00	0.01	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
- ※ 발행보담금내역 : 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, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
유리글로벌거래소1[주식]운용	전기	0.1429	0.1832	0.3261
	당기	0.1423	0.1859	0.3282
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소1[주식]A	전기	1.8305	0.1834	2.0139
	당기	1.83	0.1864	2.0164
유리글로벌거래소1[주식]C	전기	2.0306	0.1839	2.2145
	당기	2.0294	0.1857	2.2151
유리글로벌거래소1[주식]S	전기	1.2857	0.1954	1.4811
	당기	1.2707	0.1915	1.4622
유리글로벌거래소1[주식]A-e	전기	1.4099	0.242	1.6519
	당기	1.3763	0.1971	1.5734

- 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 수 준을 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 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
49,390	601	334,350	2,514	22.45	89.06

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

14년12월12일 ~15년03월11일	15년03월12일 ~15년06월11일	15년06월12일 ~15년09월11일
17.70	41.20	22.45