

# 자산운용보고서

**유리글로벌거래소특표전환형증권투자신탁[채권]**

(운용기간 : 2019년09월19일 ~ 2019년11월13일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(2개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

## 유리자산운용

서울시 영등포구 국제금융로6길 17 부국증권빌딩 9층  
(전화 02-2168-7900, [www.yurieasset.co.kr](http://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
  - ▶ 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   **자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항**

1. 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.

2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유рил글로벌거래소독점현행증권투자신탁(채권)운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 'KEB하나은행, 경남은행(판매), 광주은행, 기업은행, 대신증권, 부국증권, 유안타증권, 키움증권, 한국투자증권, 한화투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

3. 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 :	유리자산운용(주)	<a href="http://www.yurieasset.co.kr">www.yurieasset.co.kr</a>	02-2168-7900
	금융투자협회	<a href="http://dis.kofia.or.kr">http://dis.kofia.or.kr</a>	

▶기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

▶ **재산현황**

(단위: 백만원, 백만좌, %)

판드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리글로벌거래소속표전환형증권(채권)운용	자산 총액(A)	1,192	958	-19.66
	부채총액(B)			379.23
	순자산총액(C=A-B)	1,192	958	-19.66
	발행 수익증권 총 수(D)	1,110	890	-19.77
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,074.10	1,075.58	0.14
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리글로벌거래소속표전환형증권(채권)A	기준가격	1,072.35	1,073.64	0.12
유리글로벌거래소속표전환형증권(채권)A-e	기준가격	1,072.55	1,073.86	0.12
유리글로벌거래소속표전환형증권(채권)C	기준가격	1,070.98	1,072.25	0.12
유리글로벌거래소속표전환형증권(채권)F	기준가격	1,072.67	1,073.97	0.12

※ **계통민내외** (단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
유리글로벌거래소목표전환형증권투자신탁(채권)운용	2019.11.14.	67	958	1075.58	1000	
유리글로벌거래소목표전환형증권투자신탁(채권)A	2019.11.14.	49	662	1073.64	1000	
유리글로벌거래소목표전환형증권투자신탁(채권)A-e	2019.11.14.	1	10	1073.86	1000	
유리글로벌거래소목표전환형증권투자신탁(채권)C	2019.11.14.	1	18	1072.25	1000	
유리글로벌거래소목표전환형증권투자신탁(채권)F	2019.11.14.	15	202	1073.97	1000	

주) 분배후수탁고는 재투자 67 백만좌 포함입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

채권시장은 글로벌 위험자산 선호로 금리가 상승한 이후 미·중 무역협상이 기존 예상과 다르게 타결되지 않고, 홍콩의 시위가 격화되는 등 안전자산 선호가 다시 재개되었음. 9월말 금융위 금리 인하 이후, 11월 금융통화위원회에서 소수의견 출현하였으나 차익 실현 매물로 인하여 금리는 분기단위로 상승 마감.

본 펀드는 2018년 3월 19일에 설정되어 목표기준가격 달성 후 2019년 5월 14일부로 채권형으로 전환되었으며 집합투자계약 제5조제3항에 의거, 2019년 11월 14일자로 상환되었습니다.

▶ 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
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)운용	0.25	0.91	7.81	9.98
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)A	0.22	0.85	7.56	9.44
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)A-e	0.22	0.86	7.59	9.50
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)C	0.22	0.85	7.43	9.15
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)F	0.22	0.86	7.60	9.54
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	3.70	6.63

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

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)운용	9.98	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)A	9.44	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)A-e	9.50	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)C	9.15	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리글로벌채소목표전환형증권(채권)F	9.54	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	6.63	0.00	0.00	0.00

주) 전환 전 비교지수(벤치마크): S&P/KRX Exchange Index(T-1) X 90% + CD91 X 10%  
전환 후 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	0	6	0	0	0	0	0	0	1	0	6
당기	0	1	0	0	0	0	0	0	0	0	2

4. 자산현황

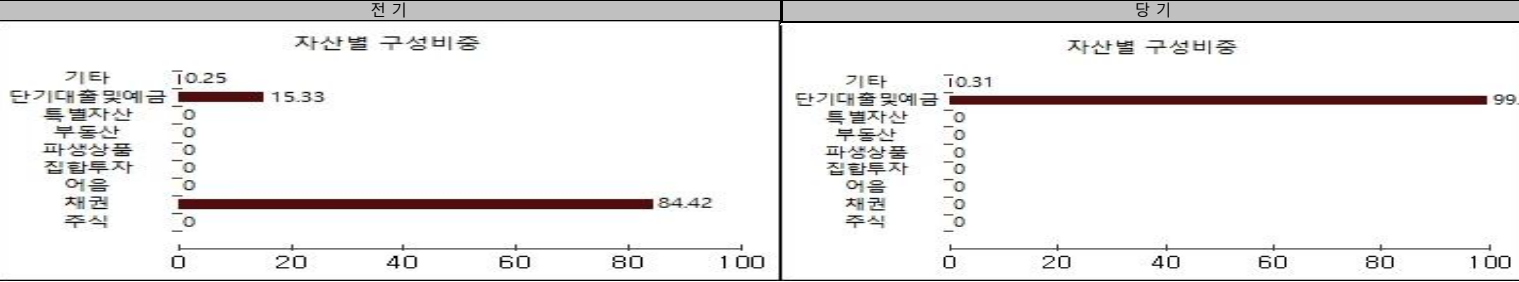
▶ 자산구성현황

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 비교 할 수 있습니다.

(단위:백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	0	0	0	0	0	0	0	0	955	3	958
(1.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(99.69)	(0.31)	(100.00)
합계	0	0	0	0	0	0	0	0	0	955	3	958

\*☐: 구성비중



▶ 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	단기상품	은대(신한은행)	99.69				

▼ 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.

▶ 단기대출 및 예금 (단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	신한은행	2018-03-19	955	0.92		대한민국	KRW

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저) (단위 : 개, 억원)

운용전환	성명	직위	생년	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
				펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
후	김종안 주)	채권운용2차장	1979	51	34,584	1	611	2109001284
전	한진규	CIO	1969	19	4,738	2	579	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
운용전환완료 후(변경일: 2019.05.14) ~ 현재 2018.03.19 ~ 2019.05.13 2018.12.24 ~ 현재	김종안(책임운용인력) 한진규 안재정(부책임운용인력)

▶ 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)
유리글로벌거래소목표전환형증권[채권]운용	자산운용사	0.00	0.00	0.00	0.00
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.00	0.00
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.00	0.00	0.00	0.00
	기타비용 주2)	0.02	0.00	0.01	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00
유리글로벌거래소목표전환형증권[채권]A	자산운용사	0.17	0.02	0.08	0.01
	판매회사	0.04	0.00	0.02	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.05	0.01	0.02	0.00
	일반사무관리회사	0.02	0.00	0.01	0.00
	보수합계	0.27	0.03	0.13	0.02
	기타비용[주2)	0.02	0.00	0.01	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00
유리글로벌거래소목표전환형증권[채권]A-e	자산운용사	0.02	0.02	0.00	0.01
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.01	0.01	0.00	0.00
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.04	0.03	0.00	0.02
	기타비용[주2)	0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00
유리글로벌거래소목표전환형증권[채권]C	자산운용사	0.02	0.02	0.01	0.01
	판매회사	0.01	0.01	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.01	0.01	0.00	0.00
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.05	0.03	0.02	0.02
	기타비용[주2)	0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.00
유리글로벌거래소목표전환형증권[채권]F	자산운용사	0.04	0.02	0.02	0.01
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.01	0.01	0.01	0.00
	일반사무관리회사	0.01	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.06	0.03	0.03	0.02
	기타비용[주2)	0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	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 확인 할 수 있습니다.

(단위: 연환산,%)				
	구분	총보수·비용비율(A) <sup>주1)</sup>	매매·중개수수료비율(B) <sup>주2)</sup>	합계(A+B)
유리글로벌버려래소목표전환형증권(채권)운용	전기	0.1964	0.2524	0.4488
	당기	0.2031	0.2852	0.4883
유리글로벌버려래소목표전환형증권(채권)A	전기	1.0768	0.2509	1.3277
	당기	1.0117	0.2844	1.2961
유리글로벌버려래소목표전환형증권(채권)A-e	전기	0.9542	0.2589	1.2131
	당기	0.9121	0.2985	1.2106
유리글로벌버려래소목표전환형증권(채권)C	전기	1.4782	0.2608	1.739
	당기	1.3257	0.3029	1.6286
유리글로벌버려래소목표전환형증권(채권)F	전기	0.6628	0.2125	0.8753
	당기	0.5309	0.1924	0.7233

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.

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, %)

매주		매도		매매회전율 <sup>주)</sup>	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리글로벌버려래소목표전환형증권(채권)운용					
2019-03-19 ~ 2019-06-18		2019-06-19 ~ 2019-09-18		2019-09-19 ~ 2019-11-13	
790.74		0.00		0.00	

8. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

펀드명	회수일	내용
유리글로벌버려래소목표전환형증권투자신탁(채권)	2019.11.14	투자기간만기도래에 따른 투자금액 2억 전액 회수