

자산운용보고서

유리자이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]

(운용기간 : 2021년11월03일 ~ 2022년02월02일)

○ 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 ▶ 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"> ▶ 입자별 보수 지급현황 ▶ 총보수비용 비율
7	투자자산매매내역 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 매매주식규모 및 회전율 ▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 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

▶ 투자환경 및 운용 계획

작년부터 선제적인 통화긴축정책을 펼치었던 중국은, 올해 미국의 금리인상과 통화정책 긴축 움직임과 달리 각종 정책금리 인하를 통한 통화완화 정책으로 선화하고 있습니다. 베이징 동계올림픽(2월 4일~2월 20일)을 앞두고 '제로 코로나'의 강력한 코로나 방역정책을 유지하면서 내수소비지표의 회복이 지연되었고, 미국의 금리인상과 양적긴축(QT) 우려로 여타 글로벌 증시와 마찬가지로 중국 증시 역시 준절 연휴 전후에 큰 폭의 조정을 받았습니다.

중국의 2022년 GDP 성장률 전망치가 5% 이하로 하향 조정되면서 경기둔화 우려가 커지고 있습니다. 이미 2021년 선제적인 통화 긴축 움직임을 보였던 중국 당국은 경기둔화를 막기 위해 통화완화 정책을 시행하고 있습니다. 지난 12월 지급준비를 인하와 1년 만기 LPR 인하에 이어 1월에는 1년 만기 LPR 뿐만 아니라 5년 만기 LPR도 인하하고 MLF와 SLF와 같은 각종 정책금리를 인하하며 통화 완화 정책을 통해 경기 부양의 의지를 보이고 있습니다. 지난해 연말부터 부동산 규제를 완화하고 5년 만기 LPR의 소폭 인하를 통해 부동산 시장의 과도한 침체를 막고 있으며, 플랫폼 기업들에게 정부의 핵심 육성 산업인 AI와 클라우드 등 혁신 기술 개발을 장려하며 다시금 성장 동력을 꾀하고 있습니다.

이미 중국 당국은 작년 12월 경제공작회의에서 경기안정을 최우선 과제로 제시하며 경기둔화 우려에 적극적으로 대응하고 있으며, 올해 3월 양회를 앞두고 1월 지방양회에서도 적극적인 경기부양을 예고하며 경제회복의 의지를 내비치고 있습니다. 따라서 미국이나 기타 글로벌 국가들과 달리, 2022년 중국에서는 통화완화정책이 이어지고 정부의 강력한 재정정책이 이어질 것으로 전망하고 있습니다. 코로나19 확산과 그에 따른 강력한 방역정책으로 소비회복이 계속해서 지연되고 있는 상황을 극복하기 위해 인프라와 첨단 기술제조업에 적극적으로 투자하여 그로 인한 소비축진의 선순환을 꾀할 것입니다. 현재 중국 정부는 첨단기술 제조업 육성을 최우선 목표로 하며, 전기차/배터리/자랑용반도체/자율주행/태양광/풍력/원자력 등으로 대표되는 탄소중립과 신소비 산업의 성장을 적극 지원하고 있습니다. 2022년은 해당 산업이 본격적인 성장을 보이는 한 해가 될 것입니다.

1분기 중국 경제는 북경올림픽과 오미크론으로 인한 이동 통제가 지속되면서 소비 둔화가 이어지는 가운데, 미중간의 긴장 관계가 지속되면서 경기둔화가 예상됩니다. 중국 정부는 경기 둔화를 사전적으로 방어하기 위하여 금융 완화정책을 시행하였고, 지방재정 발행을 늘려 부동산시장의 소프트랜딩을 유도하고 있습니다. 올해 5-5.5%의 경제성장률 목표로 재정확대 정책도 예상되고 있습니다. 2분기 이후부터는 금융정책과 재정정책의 효과가 가시화되면서 점진적인 경기 회복이 예상됩니다. 중국 증시는 밸류에이션이 낮고 실적 회복 기대감이 높으며, 정부의 적극적인 자본시장 개방 정책으로 외국인 투자자들의 비중 확대 전략이 이어질 전망입니다.

중국의 향후 경제 성장은 내수성장과 신성장/신에너지 산업의 성장의 두 축으로 압축되고 있습니다. 따라서 전통 백자주 업종 대표주로의 중폭 압축과 중국 정부의 집중 육성 분야인 신성장/신에너지 첨단기술 제조업의 비중 확대를 통해 차별적인 성과를 추구하고 있습니다.

글로벌 주요 국가 대비 중국시장의 밸류에이션 매력도가 매우 높은 상황입니다. 중국 증시의 12개월 예상 PER은 10배 정도로 미국 증시의 절반 수준이라 미국채 금리상승에 따른 추가적인 가격 조정의 리스크는 낮습니다. 중국 정부의 통화완화정책이 실시되고 있고 육성산업에 대한 적극적인 부양 정책이 예고되고 있는 만큼 전기차/배터리, 신에너지(지탄소), 반도체, 로봇AI(자율주행) 등의 산업/업종 내에 속한 기업들에게서 차별적인 실적 성장세는 계속해서 발생할 것으로 판단하고 있습니다. 투자심리 위축으로 인한 일시적인 과매도 상태라고 판단하고 있으며, 지금과 같은 시스템 리스크(시장 리스크)로 인한 증시 하락장에서 포트폴리오 조정/리밸런싱의 기회로 보고 정부 육성 산업군을 중심으로 투자 대상 종목을 선별해 나갈 계획입니다.

▶ 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
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_운용	-10.20	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-8.47)	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/A	-10.55	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-8.82)	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/A-e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C	-10.56	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-8.83)	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-F	-10.45	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-8.72)	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P1e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P2	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P2e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S-P	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S-R	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	-1.73	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): CSI300 Index (SHSZ: CNY/KRW)(T-1) X 90% + CALL X 10%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_운용	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/A	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/A-e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-F	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P1e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P2	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P2e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S-P	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S-R	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): CSI300 Index (SHSZ: CNY/KRW)(T-1) X 90% + CALL X 10%

※ 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		실패자산	기타			
전기	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
당기	-213	0	0	-11	0	0	0	0	0	1	-9	-232

4. 자산현황

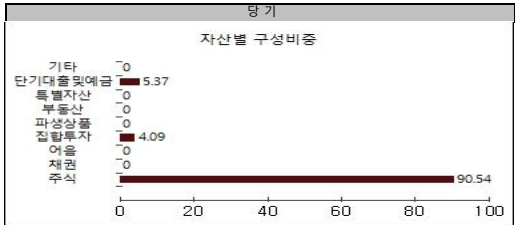
▶ 자산구성현황

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		실패자산	기타			
CNH	1,991	0	0	0	0	0	0	0	0	68	0	2,058
(189.51)	(90.54)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(3.07)	(0.00)	(93.61)
KRW	0	0	0	90	0	0	0	0	0	51	0	140
(1.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(4.09)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(2.30)	(0.00)	(6.39)
합계	1,991	0	0	90	0	0	0	0	0	118	0	2,199

* (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.

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	Semiconductors	22.40	6	Pharmaceuticals & Biotechnology	7.47
2	Materials	17.17	7	Hardware	6.46
3	Food, Beverage & Tobacco	16.05	8	Household & Personal Products	3.49
4	Automobiles & Components	13.34	9	Capital Goods	1.91
5	Consumer Durables & Apparel	10.75	10	기타	0.96

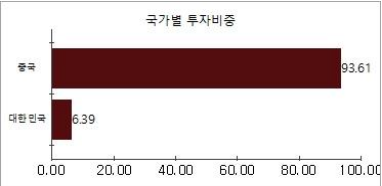
주) 주식종목의 업종 구분은, 국내 주식은 한국거래소의 업종분류기준, 해외 주식은 GICS(국제산업분류기준) 2차 분류를 따릅니다.

▶ 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.

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	중국	93.61			
2	대한민국	6.39			

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



▶ 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.

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	해외주식	BYD CO LTD -A	8.94	6	해외주식	Zhenjiang Huayou Cobalt	4.79
2	해외주식	INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	5.39	7	해외주식	FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	4.42
3	해외주식	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5.20	8	해외주식	WUXI APPTec CO LTD	4.36
4	해외주식	SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	5.06	9	해외주식	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4.08
5	해외주식	Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	4.80	10	해외주식	GOERTEK INC-A	3.81

▼ 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
BYD CO LTD -A	4,300	197	8.9	중국	CNH	Automobiles & Components	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	16,400	118	5.4	중국	CNH	Food, Beverage & Tobacco	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	2,300	114	5.2	중국	CNH	Semiconductors	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2,050	111	5.1	중국	CNH	Food, Beverage & Tobacco	
Gigadevice Semiconductor Beijing Inc	3,800	106	4.8	중국	CNH	Semiconductors	
Zhenjiang Huayou Cobalt	5,500	105	4.8	중국	CNH	Materials	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	10,100	97	4.4	중국	CNH	Semiconductors	
WUXI APPTec CO LTD	4,900	96	4.4	중국	CNH	Semiconductors	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	4,930	90	4.1	중국	CNH	Pharmaceuticals & Biotechnology	
GOERTEK INC-A	9,400	84	3.8	중국	CNH	Food, Beverage & Tobacco	
						Hardware	

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
안재정	해외투자본부장	1972	펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
			17	4,851	0	0	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://dskiforia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2021.11.03 ~ 현재	안재정

▶ 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.

	구분	전기		당기	
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}
유리치아나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식] 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	10.09	0.54
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.00	0.00	10.09	0.54
	기타비용 ^{주2)}	0.00	0.00	10.28	0.55
	매매 중개 수수료	0.00	0.00	2.48	0.13
	자산문적업무 등	0.00	0.00	0.02	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	2.50	0.13
	합계	0.00	0.00	0.59	0.03
유리치아나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식] C/A	증권거래세	0.00	0.00	0.59	0.03
	자산운용사	0.00	0.00	2.45	0.23
	판매회사	0.00	0.00	1.36	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	5.72	0.53
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.06	0.01
	보수합계	0.00	0.00	9.59	0.89
	기타비용 ^{주2)}	0.00	0.00	5.66	0.52
	매매 중개 수수료	0.00	0.00	1.36	0.13
	자산문적업무 등	0.00	0.00	0.01	0.00
	서비스 수수료	0.00	0.00	1.37	0.13
	합계	0.00	0.00	0.36	0.03
	증권거래세	0.00	0.00	0.36	0.03

유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/A-e	자산운용사		0.00	0.00	0.10	0.21
	판매회사		0.00	0.00	0.03	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.21	0.45
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.01
	보수합계		0.00	0.00	0.34	0.72
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.21	0.44
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.05	0.10
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.05	0.10
	증권거래세		0.00	0.00	0.01	0.03
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C	자산운용사		0.00	0.00	0.00	0.19
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.19
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.00	0.77
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.00	1.14
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.00	0.77
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.19
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.19
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.03
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-F	자산운용사		0.00	0.00	0.44	0.23
	판매회사		0.00	0.00	0.01	0.01
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	1.50	0.78
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.01	0.01
	보수합계		0.00	0.00	1.97	1.02
	기타비용 ※)		0.00	0.00	1.49	0.77
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.37	0.19
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.37	0.19
	증권거래세		0.00	0.00	0.06	0.03
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P1	자산운용사		0.00	0.00	0.01	0.19
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.09
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.01	0.28
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.02	0.56
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.01	0.28
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.06
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.06
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.02
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P1e	자산운용사		0.00	0.00	1.11	0.21
	판매회사		0.00	0.00	0.27	0.05
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	2.78	0.53
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.03	0.01
	보수합계		0.00	0.00	4.19	0.81
	기타비용 ※)		0.00	0.00	2.77	0.53
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.67	0.13
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.01	0.00
		합계	0.00	0.00	0.68	0.13
	증권거래세		0.00	0.00	0.15	0.03
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P2	자산운용사		0.00	0.00	0.02	0.19
	판매회사		0.00	0.00	0.01	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.03	0.35
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.06	0.66
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.03	0.35
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.01	0.08
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.01	0.08
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.03
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P2e	자산운용사		0.00	0.00	0.05	0.20
	판매회사		0.00	0.00	0.01	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.09	0.36
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.15	0.62
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.09	0.36
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.02	0.08
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.02	0.08
	증권거래세		0.00	0.00	0.01	0.02
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S	자산운용사		0.00	0.00	0.01	0.16
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.04
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.01	0.17
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.03	0.36
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.01	0.17
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.03
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.03
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.01
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S-P	자산운용사		0.00	0.00	0.01	0.16
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.02
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.01	0.17
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.03	0.35
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.01	0.17
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.03
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.03
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.01
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/S-R	자산운용사		0.00	0.00	0.00	0.15
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.01
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.00	0.18
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.01	0.35
	기타비용 ※)		0.00	0.00	0.00	0.18
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.04
		소자문적업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.04
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.02

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.
** 기타비용이라 회계감사비용, 증기 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외하였거립니다
※ 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	총보수·비용비율(A) ※1)	매매·중개수수료비율(B) ※2)	합계(A+B)
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_운용	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	4.3592	0.5349	4.8941
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/A	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	5.6062	0.5032	6.1094
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/A-e	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	4.8959	0.4317	5.3276
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	7.6063	0.7602	8.3665
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-F	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	7.1186	0.7597	7.8783
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁[주식]_C/C-P1	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	4.032	0.3003	4.3323

유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_C/C-P1e	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	5.6192	0.5477	6.1669
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_C/C-P2	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	4.8541	0.4001	5.2542
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_C/C-P2e	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	4.4779	0.3632	4.8411
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_C/S	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	2.9805	0.1862	3.1667
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_C/S-P	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	2.9208	0.1911	3.1119
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_C/S-R	전기	0.0	0.0	0.0
	당기	3.1042	0.2246	3.3288

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

▶ 매매주식규모 및 회전율

유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_운용

(단위:백만원, %)

매수		매도		매매회전율 %	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
144,423	2,623	23,250	423	26.73	106.03

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_운용

2021-11-02 ~ 2021-11-02	2021-11-02 ~ 2021-11-02	2021-11-03 ~ 2022-02-02
0.00	0.00	26.73

※ 회전을 변동 사유 : 펀드는 설정 이후 자금유입으로 편입비 추종 목적의 주식매수로 대응하여 매매회전율이 증가하였습니다.

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운영하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

(단위: 백만원, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권	보유비중
집합투자기구명	발행총수(A)	보유수(B)	(=A/B*100(%))
0	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

- 원금손실위험 - 이 투자신탁은 예금자보호법에 의한 보호를 받지 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있습니다. 따라서 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실 의 위험이 존재하며 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전적으로 투자자가 부담 하며 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.
- 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.
- 환율변동위험 - 이 투자신탁은 외국통화로 표시된 자산에 투자함으로써 환율변동위험에 노출됩니다 . 즉, 이 투자신탁 또는 모투자신탁 에서 투자하는 외국주식 및 집합투자증권 등은 외화로 표시되어 거래되기 때문에 해당 통화가 원화 대비 가치가 하락할 경우 투자원금액의 손실이 발생할 수 있습니다.
- 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 투자될 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 점검 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	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 고유자산 투자에 관한 사항

(단위 : 백만원, %)

펀드명칭	투자금액	수익률
유리차이나백마주뉴웨이브증권투자신탁(주식)_ Class C-F	200	-10.45

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