

자산운용보고서

유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]

(운용기간 : 2009년12월12일 ~ 2010년03월11일)

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

유리자산운용(주)

서울시 영등포구 여의도동 34-2 부국증권빌딩 9층
(전화 02-2168-7900, www.yurieasset.co.kr)

목 차

- 1 집합투자기구의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간수익률
 - ▶ 연평균 수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 책임운용전문인력
 - ▶ 해외 투자운용전문인력
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율

1. 집합투자기구의 개요

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

위험등급 : 1급

집합투자기구 명칭		금융투자협회 펀드코드	
유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]_운용, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]_ClassA, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]_ClassI, 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]_ClassC		66231, 66229, 66388, 66230	
집합투자기구의 종류	주식형, 추가형, 종류형펀드	최초설정일	2007.03.12
운용기간	2009.12.12 ~ 2010.03.11	존속기간	추가형
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	외환펀드서비스
투자매매·중개업자	HMC투자증권,NH투자증권,SK증권,금호증권,기업은행,농협중앙회,대구은행,대신증권,동양종합금융증권,부국증권,부산은행,브릿지증권,삼성생명,신한금융투자,우리은행,우리투자증권,키움닷컴증권,하나은행,한국투자증권,한양증권,한화증권,현대증권		
상품의 특징	<p>1. 투자대상</p> <p>이 투자신탁은 전세계 주식시장에 상장된 증권, 선물, 상품 등 각종 거래소와 거래소 유관기관이 발행한 외국주식 등에 투자하는 해외 주식형 투자신탁으로서 주식을 주된 투자대상자산으로 장기적인 자본이득 등을 추구하는 것을 목적으로 합니다.</p> <p>이 투자신탁의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 집합투자업자·판매회사·신탁업자 등 이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 투자자에 대한 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다.</p>		
	<p>2. 투자전략</p> <p>가) 포트폴리오 구성전략</p> <p>- 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.</p> <p>- 당사의 자체기준(정성적 평가 (80%) 및 정량적 평가(20%))에 의해 종목별 등급을 (A, B, C, D 등)부여하고 등급상향에 포트폴리오를 조정합니다. 등급의 부여는 계량적 요소 외에 비계량적 요소까지 고려하여 운용자의 주관 및 재량에 의해 결정되므로 이 투자신탁 포트폴리오 구성 종목의 요건, 종목간 비중이 객관적 기준에 의해 특정되지는 않는다는 점에 유의하시기 바랍니다.</p> <p>나) 자산배분 전략</p> <p>- 이 펀드는 운용자의 재량에 의해 주식투자비중 조절 등을 통한 자산배분 전략을 구사할 수 있습니다. 자산배분전략의 의도와 달리 주가수준 등이 변화할 경우 투자신탁의 성과에 불리한 영향을 미치게 됩니다.</p> <p>다) 기타</p> <p>- 시장상황에 따라 신탁재산의 일부를 국공채, 통화안정증권, 회사채 등에 투자하여 환매대금의 예비적 확보 및 이자소득을 추구할 예정입니다.</p> <p>※ 상기에 제시된 운용 목표 및 전략은 시장상황 및 운용여건에 따라 변경될 수 있으며 이러한 전략이 반드시 유효하게 투자목적 실현한다는 보장은 없습니다.</p>		
	<p>3. 위험관리</p> <p>운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 리스크관리위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 운용업 실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다.</p> <p>리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는 지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다.</p>		
	<p>4. 수익구조</p> <p>- 신탁재산을 주로 해외 주식 등 외화표시자산에 투자하는 이 투자신탁의 특성과 환헤지 전략의 한계로 인해 이 투자신탁의 성과는 주식시세의 등락 및 배당과 환율변동으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 주식에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 투자신탁의 성과에 영향을 미치게 됩니다.</p> <p>- 주식의 시세는 해당 주식 발행 기업 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 투자신탁의 가치가 상승하는 것이, 반대의 경우에는 투자신탁의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다.</p> <p>- 이 투자신탁 고유의 운용전략이 유효하게 목표를 달성하여 초과수익이 발생할 경우 이 투자신탁의 주식투자 성과는 투자대상국의 평균적인 주가상승률을 상회하게 되며 그렇지 않을 경우 투자대상국의 평균적인 주가상승률에 미달하게 됩니다. 운용자의 재량에 따라 적극적인 초과수익전략을 구사하는 특성 상 이 투자신탁의 주식투자 성과가 투자대상국의 평균적인 주가변동률에 일정한 제한 없이 미달할 가능성이 있다는 점에 유의하시기 바랍니다.</p> <p>- 이 투자신탁의 성과는 자본이득, 배당수입, 이자수입으로 구분할 수 있으며 일반적으로 자본이득이 성과에 미치는 영향이 절대적인 비중을 차지합니다.</p>		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만자, %)

집합투자자기구명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리글로벌거래소1[주식]_운용	자산 총액 (A)	84,215	80,524	-4.38%
	부채 총액 (B)	286	437	52.78%
	순자산총액 (C=A-B)	83,929	80,087	-4.58%
	발행 수익증권 총 수 (D)	94,587	89,889	-4.97%
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	887.32	890.95	0.41%
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리글로벌거래소1[주식]_C/A	기준가격	767.62	767.63	1.30E-05
유리글로벌거래소1[주식]_C/C	기준가격	754.03	752.22	-0.24%
유리글로벌거래소1[주식]_C/I	기준가격	776.98	778.21	0.16%

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 집합투자기구의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

※ 분배금 내역

(단위 : 백만원, 백만자)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
유리글로벌거래소1[주식]_운용	2010-03-12	0	89,889	890.95	890.95	
유리글로벌거래소1[주식]_C/A	2010-03-12	0	62,348	767.63	767.63	
유리글로벌거래소1[주식]_C/C	2010-03-12	0	19,349	752.22	752.22	
유리글로벌거래소1[주식]_C/I	2010-03-12	0	22,281	778.21	778.21	

주)분배후수탁고는 분배금이 전부 재투자된다는 가정하에 작성된 자료입니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 펀드는 최근 3개월동안 0.41%의 상승을 기록하였으며, -1.91%의 하락을 보인 다우존스 글로벌 거래소 지수(비교지수)를 2.32% 아웃퍼폼하였습니다. 경기회복에 대한 기대감으로 인해 2010년 1월, 상승출발한 글로벌 증시는 중국의 지급준비율 인상 등 긴축 움직임과 미국 정부의 은행규제안 등이 악재로 작용하며 부진한 모습을 보였습니다. 또한 2월에는 그리스, 스페인, 포르투갈 정부의 높은 재정적자 문제가 유럽 전체의 문제로 확대되면서 투자자들의 불안심리를 가중시켰습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

2월초 이후, 글로벌 증시를 움츠리게 했던 그리스 등 유럽 국가들의 높은 재정적자 문제는 점차 해결의 실마리를 찾고 있는 것으로 보입니다. 문제의 진원지인 그리스의 최근 주가가 큰 폭의 반등세를 보이고 있고, 서유럽 국가들의 CDS 프리미엄이 반락 추세를 나타내는 점 등을 통해 이를 확인할 수 있습니다. 최근 BOA, 시티그룹, 웰스파고 등 주요 은행들이 미 정부의 부실자산구제 프로그램 자금을 상환하기로 결정하고, 향후 수익성 개선에 대한 전망을 내놓는 등 금융섹터에 우호적인 뉴스들도 거래소들의 주가에 긍정적으로 작용할 전망입니다.

미국 및 유럽의 전통적 증권거래소들이 최근 양호한 주가 흐름을 보이고 있는 가운데, 기존의 디스카운트 요인이었던 거래량 감소와 대안 거래소들의 위험 등이 점차 완화되고 있어 이들 거래소에 대한 지속적인 관심이 필요한 시점이라고 판단됩니다. 또한 미국 경기가 회복되는 시점에서, 미국 증시와 높은 상관관계를 가진 동시에, 과거 높은 상승 탄력을 보여주었던 멕시코 증시에 대한 관심도 유효해 보이기 때문에, 멕시코 거래소에 대한 신규 편입을 고려하고 있습니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
유리글로벌거래소1[주식]_운용 (비교지수 대비 성과)	0.41 (2.32)	-2.49 (-2.86)	-0.35 (2.13)	47.00 (-20.77)
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소1[주식]_C/I (비교지수 대비 성과)	0.16 (2.07)	-2.99 (-3.37)	-1.11 (1.37)	45.56 (-22.22)
유리글로벌거래소1[주식]_C/A (비교지수 대비 성과)	0.00 (1.91)	-3.31 (-3.68)	-1.59 (0.89)	44.64 (-23.13)
유리글로벌거래소1[주식]_C/C (비교지수 대비 성과)	-0.24 (1.67)	-3.79 (-4.17)	-2.32 (0.17)	43.27 (-24.50)
비교지수(벤치마크)	-1.91	0.37	-2.48	67.77

주) 비교지수(벤치마크) : CD91 10.0%, DJ Exchange Index 90.0%.

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

▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌거래소1[주식]_운용 (비교지수 대비 성과)	47.00 -(20.77)	-10.85 -(7.24)	-3.78 (0.85)	0.00 (0.00)
종류(Class)별 현황				
유리글로벌거래소1[주식]_C/I (비교지수 대비 성과)	45.56 -(22.22)	-11.78 -(8.17)	0.00 (4.63)	0.00 (0.00)
유리글로벌거래소1[주식]_C/A (비교지수 대비 성과)	44.64 -(23.13)	-12.39 -(8.78)	-5.43 -(0.80)	0.00 (0.00)
유리글로벌거래소1[주식]_C/C (비교지수 대비 성과)	43.27 -(24.50)	-13.27 -(9.66)	-6.38 -(1.75)	0.00 (0.00)
비교지수(벤치마크)	67.77	-3.61	-4.63	0.00

주) 비교지수(벤치마크) : CD91 10.0%, DJ Exchange Index 90.0%,

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	-4,319	0	0	0	2,340	0	0	0	0	42	-480	-2,417
당 기	-682	0	0	1	2,094	0	0	0	0	-545	-664	204

3. 자산현황

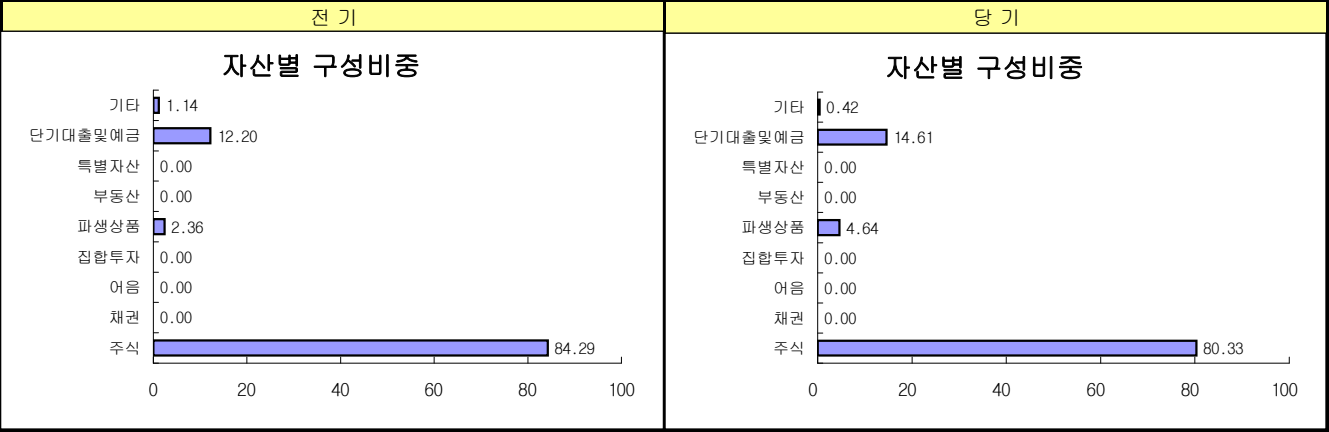
▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
EUR (1546.12)	5,834 (7.24)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,109 (1.38)	0 (0.00)	6,943 (8.62)
USD (1133.60)	30,442 (37.80)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	8,539 (10.60)	0 (0.00)	38,980 (48.41)
SGD (810.32)	3,444 (4.28)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	3,444 (4.28)
GBP (1696.66)	1,377 (1.71)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,377 (1.71)
CAD (1104.60)	2,734 (3.39)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2,734 (3.40)
JPY (12.54)	1,577 (1.96)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,577 (1.96)
BRL (641.01)	4,473 (5.55)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	4,473 (5.55)
ZAR (152.57)	3,200 (3.97)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1 (0.00)	0 (0.00)	3,200 (3.97)
AED (308.65)	540 (0.67)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	540 (0.67)
NZD (791.71)	992 (1.23)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	992 (1.23)
HKD (146.10)	4,045 (5.02)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	4,045 (5.02)
SEK (158.85)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)
MYR (341.60)	1,942 (2.41)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,942 (2.41)
PHP (24.79)	1,032 (1.28)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,032 (1.28)
AUD (1036.45)	3,054 (3.79)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1 (0.00)	0 (0.00)	3,055 (3.79)

KRW	0	0	0	0	3,736	0	0	0	0	2,115	338	6,189
(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(4.64)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(2.63)	(0.42)	(7.69)
합 계	64,685	0	0	0	3,736	0	0	0	0	11,765	338	80,524

* () : 구성 비중



▶ 주식업종별 투자비중

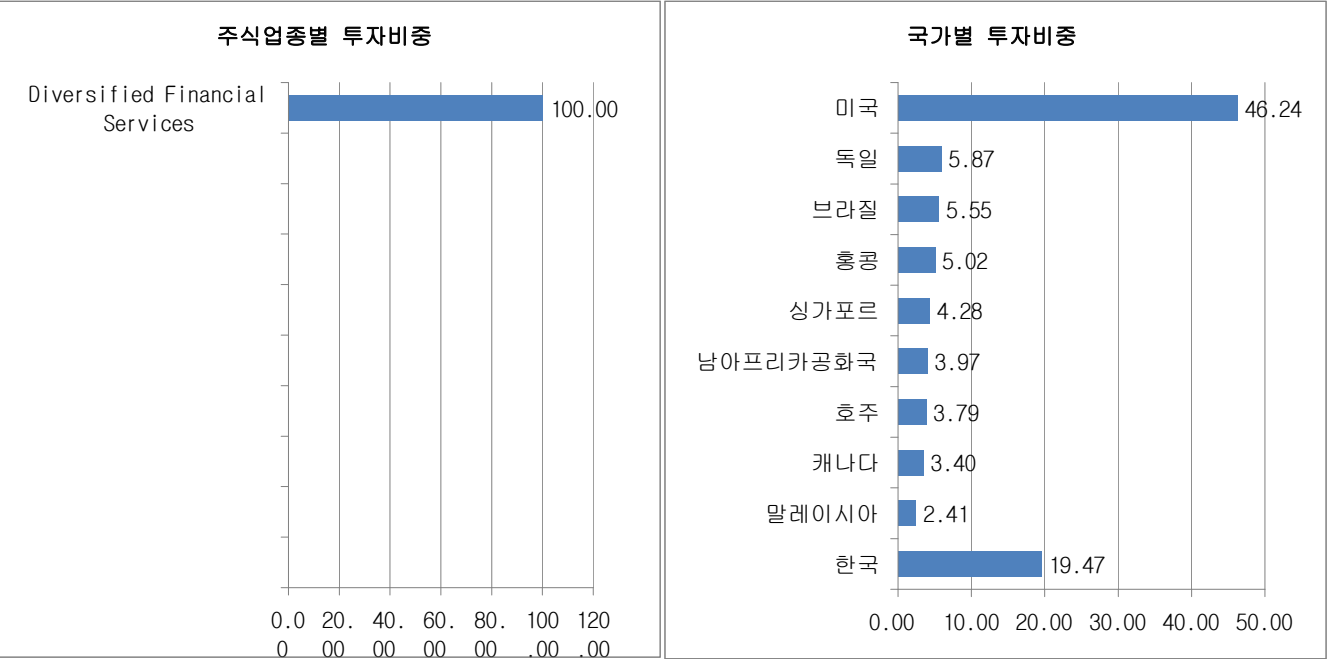
(단위 : %)

	종목명	비중		종목명	비중
1	Diversified Financial Services	100.00	6		
2			7		
3			8		
4			9		
5			10		

▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

	국가명	비중		국가명	비중
1	미국	46.24	6	남아프리카공화국	3.97
2	독일	5.87	7	호주	3.79
3	브라질	5.55	8	캐나다	3.40
4	홍콩	5.02	9	말레이시아	2.41
5	싱가포르	4.28	10	한국	19.47



▶ 환헤지에 관한 사항

투자설명서상의 목표 환헤지비용	기준일(10년03월11일) 현재 환헤지 비율
외화표시자산의 순자산총액의 60±10% 범위에서 환헤지 실행	63.16%

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.

[환헤지 여부, 환헤지 비용 및 효과 등]

이 투자신탁은 외화표시자산에의 투자에 따른 환율변동 위험의 관리를 위해 환헤지를 실시합니다. 환헤지란 선물환 계약 등을 이용하여 환율의 변동으로 인한 위험을 억제하는 것을 뜻합니다. 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. 환헤지 비용은 통화별로 차이가 있으나 대략 연간 기준으로 1%~2%사이인 것으로 분석 됩니다

- 현실적으로 완전한 환헤지는 불가능하므로 이 투자신탁은 외화표시자산의 순자산총액의 60±10% 범위에서 환헤지를 실행할 예정입니다. 하지만 투자신탁의 설정/해지, 환율전망, 외환시장 상황, 비용부담, 운용자의 판단 등에 따라 실제 헤지비용은 예정 헤지비용의 범위를 벗어날 수 있고 실제 헤지비용이 예정 헤지비용에 비해 불리한 사후적 성과를 초래할 수 있습니다.

- 접근 가능한 시장이 형성되어 있지 않거나 과도한 비용을 수반하는 등의 사유로 환헤지가 용이하지 않은 통화로 표시되는 외화자산에 대해서는 헤지 거래를 실행하지 않거나 당해 통화와의 상관관계가 비교적 높은 통화로 대신하여 헤지 거래를 실행할 예정입니다. 이로 인해 환헤지가 적절히 이루어 지지 않거나 상당한 수준의 의도되지 않은 외환관련 손실 또는 이익이 발생할 수 있습니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	단기상품	USD Deposit(CITI)	10.60	6	해외주식	IntercontinentalExchange Inc	4.79
2	해외주식	CME Group	7.63	7	해외주식	Singapore Exchange Ltd	4.28
3	해외주식	Nasdaq OMX Group/The	5.58	8	해외주식	NYSE Euronext CO INC.	4.27
4	해외주식	BM&F BOVESPA SA	5.55	9	해외주식	Johannesburg Stock Exchange	3.97
5	해외주식	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	5.02	10	해외주식	ASX Ltd	3.79

*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

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	비고
CME Group	17,600	6,143	9.50	
Nasdaq OMX Group/The	196,170	4,496	6.95	
BM&F BOVESPA SA	581,965	4,472	6.91	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	206,900	4,044	6.25	
IntercontinentalExchange Inc	30,900	3,853	5.96	

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
1004유로화선물	매도	475	7,355	2,957
1004달러선물	매도	3,815	43,223	3,735

주) 개별계약등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일
예금	USD Deposit	2007-03-13	8,538	0.00	2099-11-11

주) 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 책임운용전문인력

성명	운용개시일	직위 (연령)	운용종인 다른 집합투자기구 현황		주요 경력 및 운용실적(최근5년)	협회등록번호
			집합투자기 구의 수 (개)	운용 규모 (백만원)		
최병로	2007-03-12	본부장 (46)	27	148,468	KAIST금융공학 석사, 한국투자신탁 (90.1~02.2), 플러스자산운용(03.3~05.4), 당사(05.5~현 재)	2109000213
					유리명품VISTA글로벌증권투자신탁[주식]	
					성과보수가 있는 집합투자기구 운용규모	
					개수 : 0개 규모 : 0백만원	

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함

※집합투자기구의 운용전문인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 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
2007.03(투자신탁의 최초설정일) ~ 현재	최병로(대안투자본부)

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구 분	전 기		당 기	
		금액	비율	금액	비율
유리글로벌거래소1[주식]_운용	집합투자업자	0	0.00	0	0.00
	투자매매·중개업자	0	0.00	0	0.00
	신탁업자	7	0.01	5	0.01
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
	보수합계	7	0.01	5	0.01
	기타비용**	8	0.01	6	0.01
	매매·중개수수료	46	0.05	44	0.06
유리글로벌거래소1[주식]_C/A	집합투자업자	95	0.17	83	0.17
	투자매매·중개업자	123	0.22	107	0.22
	신탁업자	10	0.02	8	0.02
	일반사무관리회사	2	0.00	2	0.00
	보수합계	230	0.42	200	0.42
	기타비용**	0	0.00	0	0.00
	매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
유리글로벌거래소1[주식]_C/C	집합투자업자	29	0.17	25	0.17
	투자매매·중개업자	79	0.47	69	0.47
	신탁업자	3	0.02	3	0.02
	일반사무관리회사	1	0.00	1	0.00
	보수합계	112	0.67	97	0.66
	기타비용**	0	0.00	0	0.00
	매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00

유리글로벌거래소1[주식]_C/I	집합투자업자	31	0.17	29	0.17
	투자매매·중개업자	11	0.06	10	0.06
	신탁업자	3	0.02	3	0.02
	일반사무관리회사	1	0.00	1	0.00
	보수합계	47	0.26	43	0.26
	기타비용**	0	0.00	0	0.00
	매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00

* 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

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

※ 성과보수내역 : 없음

※ 발행분담금내역 : 없음

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 집합투자기구	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리글로벌거래소1[주식]_운용	전기	0.0675	0.1949
	당기	0.0674	0.2054
종류(Class)별 현황			
유리글로벌거래소1[주식]_C/A	전기	1.775	0.1958
	당기	1.7639	0.2061
유리글로벌거래소1[주식]_C/C	전기	2.7752	0.1953
	당기	2.7655	0.2062
유리글로벌거래소1[주식]_C/I	전기	1.1053	0.1929
	당기	1.1052	0.2042

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 집합투자기구에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
357,000	4,946	1,257,270	10,127	15.28	61.95

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

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 유리글로벌거래소증권투자신탁1호[주식]_운용의 집합투자업자인 '유리자산운용(주)'이 작성하여 신탁업자인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 투자매매·중개업자인 'HMC투자증권,NH투자증권,SK증권,금호증권,기업은행,농협중앙회,대구은행,대신증권,동양종합금융증권,부국증권,부산은행,브릿지증권,삼성생명,신한금융투자,우리은행,우리투자증권,키움닷컴증권,하나은행,한국투자증권,한양증권,한화증권,현대증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 집합투자기구의 신탁업자 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 유리자산운용(주)
금융투자협회

www.yurieasset.co.kr
<http://dis.fundservice.net>

/ 02-2168-7900

자산보관 • 관리보고서

이 보고서는 집합투자기구재산을 보관• 관리하는 신탁업자가 집합투자재산이 적정하게 운용되었는지 여부 등에 관하여 확인한 내용을 투자자에게 제공하기 위해 “자본시장과 금융투자업에 관한 법률” 제 248 조제 1 항에 따라 작성되었습니다.

신탁업자명 : ㈜ 한국씨티은행

문의가능 전화번호 : (02) 3455-2504 / 3455-2567

1. 집합투자기구의 개요

가. 집합투자기구 명칭:

유리 글로벌거래소 증권투자신탁 1호 (주식)
(종류 A, 종류 C, 종류 C1, 종류 I)

나. 집합투자기구 분류: 증권집합투자기구(주식형), 신탁형, 공모형, 개방형, 추가형, 종류형

다. 보관 • 관리기간: 2009.03.12 - 2010.03.11

라. 집합투자업자: 유리자산운용(주)

마. 투자매매업자, 투자중개업자: 하나은행, 대구은행, 농협중앙회, 중소기업은행, 우리은행, 부산은행, 금호종합금융, 대신증권, 우리투자증권, 현대증권, SK증권, 한화증권, 신한금융투자, 한국투자증권, 한양증권, 동양종합금융증권, 부국증권, NH투자증권, 키움증권, 삼성생명보험, HMC투자증권, 골든브릿지투자증권, 한국투자증권,

2. 집합투자계약의 주요 변경사항

- 2009.05.04 약관(규약) 전면 개정 :

- 1) 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 적용
- 2) 집합투자기구명 변경 :
유리 글로벌거래소 주식투자신탁 1호 →
유리 글로벌거래소 증권투자신탁 1호 (주식)

- 규약 제25조(판매가격) 해외펀드 판매기준가격 적용일 변경:

일자	변경전	변경후
2009.08.27	영업일로부터 제2영업일 (17시 경과 후 3영업일)에 광고되는 기준가격	영업일로부터 제3영업일 (17시 경과 후 4영업일)에 광고되는 기준가격
2009.09.29	영업일로부터 제 3 영업일 (17 시 경과 후 4 영업일)에 광고되는 기준가격	영업일로부터 제 2 영업일 (17 시 경과 후 3 영업일)에 광고되는 기준가격

- 규약 제33조(이익분배) 단서조항 변경 :

일자	변경전	변경후
2009.08.27	신설	이익금이 0보다 작은 경우 분배를 유보한다.
2009.09.29	이익금이 0보다 작은 경우 분배를 유보한다.	삭제

3. 투자운용인력의 변경

- 해당 사항 없음.

4. 집합투자자총회의 결의내용

- 해당 사항 없음.

5. 이해관계인과의 거래의 적격여부를 확인한 경우의 그 내용

- 해당 사항 없음.

6. 회계감사인인 선임 • 해임에 관한 사항

변경전				변경일	변경후			
회계 감사 인명	계약 기간	감사 보수(원)	계약 방법		회계 감사 인명	계약 기간	감사 보수 (원)	계약 방법
에일 회계 법인	1년	2,200,000	서면	2009.10.20	삼일 회계 법인	1년	2,200,000	서면

* 회계감사인 선임비용은 1년에 한번 회계감사 수행을 위해 집합투자
기구에서 공동으로 부담하는 비용임.

7. 법 제247조 제5항 각호의 사항 확인

☐ 투자설명서가 법령 및 집합투자계약에 부합하는지의 여부

- 법령 및 집합투자계약에 부합합니다.

☐ 자산운용보고서의 작성이 적절한지 여부

- 적정하게 작성 되었습니다.

☐ 위험관리방법의 작성이 적절한지 여부

- 본 집합투자기구는 장외파생상품에 투자하지 않아 해당사항
없습니다.

☐ 집합투자재산의 평가가 공정한지 여부

- 집합투자재산의 평가를 공정하게 반영하고 있습니다.

☐ 집합투자재산의 평가결과에 따라 기준가격이 적정하게
산출되었는지 여부

- 집합투자재산의 평가결과에 따라 기준가격이 적정하게
산출되었습니다.

☐ 집합투자업자의 운용지시가 법, 집합투자신규약 또는
투자설명서에 위반된 경우 신탁업자의 시정요구 및 이에 대한
집합투자업자의 이행명세

- 해당 사항 없음.

☐ 집합투자재산별로 미리 정해진 자산배분명세에 따라 매매결과를
공정하게 배분되었는지의 여부

- 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행령 제269조 제1항 제1호
(집합투자업자가 운용하는 전체 집합투자기구의 집합투자재산을
보관 • 관리하는 신탁업자가 둘 이상인 경우 감시의무 면제)에
해당되어 본 항목은 신탁업자의 확인사항이 아닙니다.

8. 그 밖에 투자자 보호에 필요한 사항

- 이 집합투자기구는 실적배당상품으로 은행예금과는 달리
예금보험공사의 보호를 받지 못함에 따라 투자원리금 전액이 보장
또는 보호되지 않습니다.

- 이 집합투자기구의 운용 및 투자 등과 관련한 사항은 해당
판매회사, 집합투자업자(www.yurieasset.co.kr) 및 금융투자협회
(www.kofia.or.kr)의 홈페이지를 이용 할 경우 더 좋은 서비스를
받을 수 있습니다.

- 이 집합투자기구는 해외자산 결제 및 보관을 위하여 씨티은행
홍콩(Citibank N.A. Hong Kong Branch)을 해외보관 대리인으로
사용하고 있으며 해외보관 대리인은 동 업무를 각국의 보관
대리인에게 재위임 할 수 있습니다 .