

자산운용보고서

유리글로벌거래소전문투자형사모증권투자신탁제2호(USD)[주식]

(운용기간 : 2023년03월20일 ~ 2023년04월06일)

○ 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(1개월) 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 공지사항

2 펀드의 개요

- ▶ 기본정보
- ▶ 재산현황
- ▶ 펀드의 투자전략

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 회전을
- ▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 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

위험관리

- 운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회 등에서 결정합니다.
- 리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는 지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다.
- 이 투자신탁은 외국통화 표시자산 투자에 따른 환율변동 위험을 방지하기 위한 환헤지 전략을 실행하지 아니할 계획입니다. 이 투자신탁은 매입신청, 한매청구 및 한매대금 지급, 기준가격 산정 등이 미국 달러(USD)로 이루어 지므로 투자대상자산 중 미국 달러(USD)표시 자산의 투자에 따른 환율변동위험에는 노출되지 않습니다. 다만, 미국 달러(USD) 표시 이외의 자산에 투자하는 경우에는 미국 달러(USD)와 미국 달러(USD) 이외의 통화간의 환율 변동 위험에 노출될 수 있습니다.

수익구조

이 투자신탁은 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드는 운용기간 (2023.03.20~2023.04.06) 2.66%(운용클래스 기준)의 수익률을 기록하며 BM(3.55%)대비 -0.89% 부진한 성과를 시현하였습니다.

글로벌 증시는 실리콘밸리은행 파산이 촉발한 금융리스크 확대 우려에도 금융당국의 발 빠른 대응에 힘입어 추가적인 확산이 제한되며 반등세를 이어갔습니다. 3월 FOMC에서는 추가 긴축 가능성을 열어두면서도 기준금리를 25bp 인상하며 예상수준에 부합하는 행보를 보인 가운데 전반적으로 긴축 사이클 종료 기대감이 우세하며 위험자산 선호를 자극하였습니다.

글로벌 은행 리스크는 미국 정부가 적극적인 사태 진화 의지를 피력한 가운데 유럽에서도 UBS의 크레디트스위스(CS) 인수 소식과 더불어 라가르드 ECB 총재가 필요 시 유동성을 투입하겠다고 발언하는 등 이슈 해결에 적극적인 모습을 보이면서 빠르게 진정되었습니다. 이 영향으로 급락했던 은행주들이 반등하며 투자심리를 끌어올리는 등 시장에 우호적으로 작용하였습니다. 금융시스템 리스크가 급부상하면서 상대적으로 탄탄한 재무구조를 보유한 빅테크 기업들에 매수세가 몰리며 급등하였고 금융안정 기대감과 인플레이션 완화에 힘입어 유럽증시가 견조한 흐름을 보이면서 선진국 주도의 강세가 이어졌습니다.

동 기간 달러 인덱스는 소폭 약세를 나타냈습니다. 미국 연준의 금리인상 기조 종료 기대감이 약 달러에 힘을 실었고 유럽지역의 상대적으로 탄탄한 경제지표와 추가 긴축 우려가 유로화 강세로 이어지며 달러가치는 하방 압력을 받았습니다.

펀드는 전부 해지를 앞두고 점진적으로 보유자산을 매각하는 과정에서 개별종목의 상승률을 추종하지 못하였습니다. 안정적인 유동성 확보를 감안하여 편입 자산 매도가 선제적으로 이루어지면서 유동성자산 비중이 상대적으로 높아진 영향으로 벤치마크 수익률을 소폭 하회하였으나 현금성자산의 사전 확보가 중요한 만큼 원활한 자산 처분과 현금화에 집중하였습니다.

▶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
유리글로벌거래소전문사모2(USD) [주식]_운용	4.57	8.27	2.69	-11.17
(비교지수 대비 성과)	(-0.58)	(0.73)	(-2.42)	(-1.09)
종류(Class)별 현황				
C/A	4.16	7.43	1.48	-12.59
(비교지수 대비 성과)	(-0.99)	(-0.11)	(-3.63)	(-2.51)
비교지수(벤치마크)	5.15	7.54	5.11	-10.08

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

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리글로벌거래소전문사모2(USD) [주식]_운용	-11.17	-7.33	21.19	-
(비교지수 대비 성과)	(-1.09)	(1.59)	(0.81)	-
종류(Class)별 현황				
C/A	-12.59	-10.23	15.61	-
(비교지수 대비 성과)	(-2.51)	(-1.31)	(-4.77)	-
비교지수(벤치마크)	-10.08	-8.92	20.38	-

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

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

▶ 손익현황

(단위: 천USD)

[illegible]

4. 자산현황

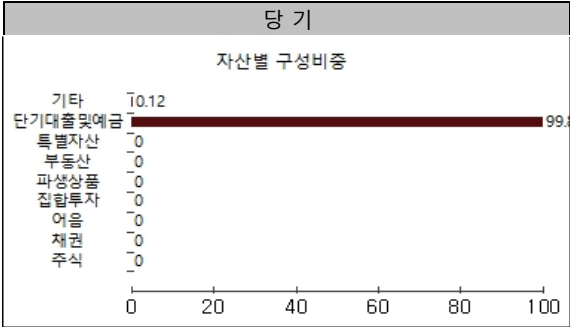
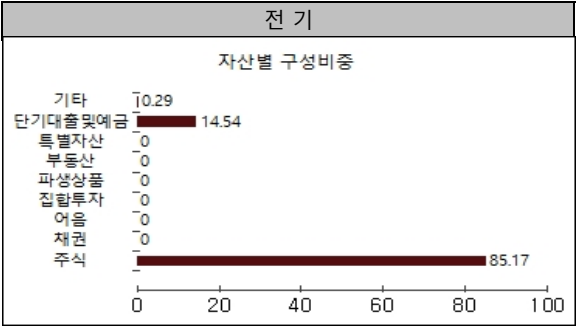
▶ 자산구성현황

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: 천USD, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
USD (1319.10)	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)	99 (99.88)	0 (0.12)	99 (100.00)
합계	0	0	0	0	0	0	0	0	0	99	0	99

*() : 구성비중



▶ 국가별 투자비중

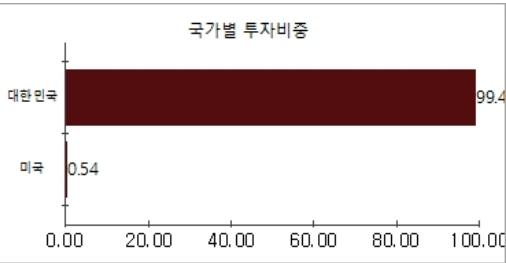
(단위 : %)

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	99.46			
2	미국	0.54			

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.

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	단기상품	USD Deposit(SHINHAN)-KR	99.34				
2	단기상품	USD Deposit(SHINHAN)	0.54				

▼ 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.

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 주, 천USD, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
외화예치금	USD Deposit (SHINHAN)-KR	2019-12-26	99	0.00		대한민국	USD
외화예치금	신한은행	2019-12-20	1	0.00	2099-12-31	미국	USD

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

▶ 국내자산		(단위 : %)			
대분류		중분류	소분류	편입비중	
증권	채무증권	국채, 지방채, 특수채		-	
		사채권	전환사채, 교환사채, 신주인수권부사채(분리/비분리), 이익참가부사채 등	-	
	지분증권	주식	보통주, 종류주		-
		기타 지분증권	집합투자증권, 출자증권		-
		신주인수권	신주인수권증권, 신주인수권증서		-
	기타증권	기타증권	기타 수익증권, 투자계약증권		-
파생상품		장내	선도, 선물, 스왑, 옵션, 기타파생상품 등	-	
		장외	선도, 선물, 스왑, 옵션, 기타파생상품 등	-	
금융상품		MMDA		-	
		콜론	담보콜, 신용콜, 직콜	-	
		REPO	점유개정, 환매조건부	-	
		정기예금	정기예금, CMA, 기타예금	-	
		MMT		-	
		발행어음		-	
		기타어음(CP 제외)		-	
		CD	비등록DC, 등록DC	-	
		기업어음증권	비예탁CP, 예탁CP	-	
		기타금융상품	기타 현금성자산	-	
		FX거래	현물환(S), 선물환(W)	-	
非금융상품	특별자산	유형자산	광물, 농·축·수산물, 운송기계(선박·항공), 원자재	-	
		무형자산	지적재산권, 영업권, 공업소유권, 광업권 등	-	
		대여(대출)	금전채권, 대출채권, 대출금, 대여금	-	
		신탁수익권	금전신탁, 유가증권신탁, 금전채권신탁 등	-	
		기타자산	출자금, 출자지분, 매출채권, 사업지분(권리) 등	-	
	부동산	부동산	부동산(토지·건물 등), 부동산계약관리(매매·임대 등), 부동산임대관리, 부동산위탁 관리 등(부동산 실물 및 제권리 포함)	-	

주) 편입비중은 자산총액 대비 차지하는 비중을 기재한다.

▶ 해외자산				(단위 : %)
대분류	중분류	소분류	편입비중	
해외채무증권	국채, 지방채, 특수채		-	
	사채권	전환사채, 교환사채, 신주인수권부사채(분리/비분리), 이익참가부사채 등	-	
	기타채권		-	
해외지분증권	주식	보통주, 종류주 모두 포함	-	
	기타 지분증권	집합투자증권, 출자증권	-	
	신주인수권	신주인수권증권, 신주인수권증서	-	
해외파생상품	장외파생	ELS, ETN, ELW, DLS, 기타 파생결합증권 등	-	
해외 집합투자증권	집합투자증권	Mutual Fund, PEF 등	-	
해외기타증권	기타증권		-	
해외금융상품	콜론		100	
해외 유·무형자산	유형자산	광물, 농·축·수산물, 운송기계(선박·항공), 원자재	-	
	무형자산	지적재산권, 영업권, 공업소유권, 광업권 등	-	
해외대여	대여(대출)	금전채권, 대출채권, 대출금, 대여금	-	
해외기타자산	기타자산	출자금, 출자지분, 매출채권, 사업지분(권리) 등	-	
해외부동산	부동산	부동산(토지·건물 등), 부동산계약관리(매매·임대 등), 부동산임대관리, 부동산위탁 관리 등(부동산 실물 및 제권리 포함)	-	

주) 편입비중은 자산총액 대비 차지하는 비중을 기재한다.

▶ 시장성·비시장성 자산			(단위 : %)
구분		시장성 자산	비시장성 자산
비중(% , 자산총액기준)		100	0

주) 금융투자업규정 시행세칙 별책서식 <제45호의6> 일반사모집합투자기구의 정기보고서 IV. 일반사모집합투자기구의 운용현황 3. 시장성·비시장성 자산 비중의 내용을 준 용하여 시장성·비시장성자산 비중을 기재한다.

▶ 레버리지 비율

(단위 : %)

펀드명	비중
유리글로벌거래소전문투자형사모증권투자신탁제2호(USD)[주식]_운용	0

주) 금융투자업규정 시행세칙 별책서식 <제45의6> 일반사모집합투자기구의 정기보고서 Ⅲ. 차입 등 레버리지 현황 4. 일반사모집합투자기구의 차입 등 레버리지 한도 위반여부 내용을 준용하여 순자산총액 대비 레버리지 총액 비중을 기재한다.

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 역원)

성명	직위	생년	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
한진규 ^{주)}	CIO	1969	17	5,217	0	0	2109000507
안재정	해외투자본부장	1972					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://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 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: 천USD, %)

	구분	전기		당기	
				금액	비율 ^{주1)}
유리글로벌거래소전문사모2(USD)[주식]_운용	자산운용사		0.00	0.00	0.00
	판매회사		0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.46	0.24	0.50
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.46	0.24	0.50
	기타비용 ^{주2)}		0.46	0.24	0.37
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.06	0.03	0.14
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
		합계	0.06	0.03	0.14
	증권거래세		0.01	0.01	0.02
C/A	자산운용사		0.29	0.15	0.04
	판매회사		0.43	0.22	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.49	0.25	0.50
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.00
	보수합계		1.21	0.62	0.60
	기타비용 ^{주2)}		0.46	0.24	0.37
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.06	0.03	0.14
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00
		합계	0.06	0.03	0.11
	증권거래세		0.01	0.01	0.02

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 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 연평균잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위: 연환산,%)

	구분	총보수·비용비율(A) ^{주1)}	매매·중개수수료비율(B) ^{주2)}	합계(A+B)
유리글로벌버려소전문사모2(USD)[주식]_운용	전기	1.9179	0.117	2.0349
	당기	14.8749	2.1298	17.0047
C/A	전기	3.4951	0.1172	3.6123
	당기	16.4479	2.1304	18.5783

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.
주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(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

(단위: 천USD, %)

유리글로벌버려소전문사모2(USD)[주식]_운용

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
5	2	2,658	171	225.26	4567.72

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리글로벌버려소전문사모2(USD)[주식]_운용

2022-09-20 ~ 2022-12-19	2022-12-20 ~ 2023-03-19	2023-03-20 ~ 2023-04-06
16.81	21.72	225.26

※회전을 변동 사유 : 전부해지에 따른 유동성 확보를 위해 편입자산 매도로 대응하여 매매회전율이 상승하였습니다.

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운영하는 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 예금보호법에 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. 또한 환매수수료가 부과되는 기간 중에 환매한 경우에는 환매수수료의 부과로 인해 투자손실이 발생하거나 손실의 폭이 더욱 확대될 수 있습니다.

- 주식가격 변동위험 : 이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 해외 주식에 투자하므로 이 투자신탁의 성과는 경제·사회·자연현상 등의 영향을 받아 가격이 항상 급격히 변화하여 높은 위험을 지니는 투자대상인 주식의 시세 변화에 그대로 노출됩니다. 또한 이 투자신탁은 주식관련파생상품, 주식관련채권(전환사채 등) 등과 같이 그 가격이 주가에 연동되어 결정되는 자산에도 투자할 수 있는 바, 이러한 자산에 투자할 경우에도 이 투자신탁의 성과는 주식의 시세 변화에 직접적으로 노출된다는 점에 유의하시기 바랍니다.

- 환율변동위험 : 이 투자신탁은 외국통화 표시자산 투자에 따른 환율변동 위험을 방지하기 위한 환헤지 전략을 실행하지 아니할 계획입니다. 이 투자신탁은 매입신청, 환매청구 및 환매대금 지급, 기준가격 산정 등이 미국 달러(USD)로 이루어지므로 투자대상자산 중 미국 달러(USD)표시 자산의 투자에 따른 환율변동 위험에는 노출되지 않습니다. 다만, 미국 달러(USD) 표시 이외의 자산에 투자하는 경우에는 미국 달러(USD)와 미국 달러(USD) 이외의 통화간의 환율변동 위험에 노출될 수 있으며, 이 경우 환율변동에 따른 투자원금액의 손실이 발생할 수 있습니다.

- 집중투자위험 : 이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 특정 업종 주식에 집중적으로 투자하므로 일반적인 주식투자가 수반하는 위험 외에 특정 업종 집중투자에 따른 위험을 추가로 수반합니다.

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 여부 모니터링합니다. 2. 펀드별 유동성 관리 프로세스 정립하여 관리하고 있습니다. 3. 해외투자자산의 유동성 문제가 발생하는 경우에 대비한 비상대책 확립하고 있습니다. 4. 해외 재간접펀드 투자 시 역외 운용사의 운용능력 및 리스크관리 능력 확인 및 사후관리 점검하고 있습니다.
2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등
- 해당사항 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			
- 해당사항 없음			

▶ 라. 주요 비상대응계획

○ 대량 환매를 야기하거나 재해·전염병 등으로 인하여 업무 연속성을 확보하기 곤란한 위기상황 발생 시 회사의 '위기관리기준'내 마련된 'CONTINGENCY PLAN 운용지침'에 따라 위기상황별 세부 운영계획을 마련하여 대응합니다. - 주의 단계 발생 Event에 대한 자본시장 영향 분석, 운용전략의 조정 - 위기 단계 위기관리위원회 의결(집합투자기구별(또는 유형별) 운용전략 제한, 유동성 확보계획 등 수립), 위기상황 보고체계 가동 - 위급 단계 비상대책반 구성하여 위기 상황별 구체적 실행계획의 수립 및 시행, 위기관리위원회 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 실행 자산 손실의 최소화를 추구합니다. ○ 부실자산에 대해서는 기본적으로 위기관리위원회의 결정에 따라 관리하며 필요시 Task-Force team을 구성하여 운영할 수 있습니다.
--

10. 자산운용사의 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

(단위: 천USD, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
- 해당사항 없음							

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