

자산운용보고서

HDC지수연계증권투자신탁HE-20호(ELS-파생형)

(운용기간 : 2017년08월22일 ~ 2017년11월21일)

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

HDC자산운용(주)

서울시 영등포구 국제금융로8길 11 대영빌딩 2층
(전화 02-3215-3000, <http://www.hdcasset.com>)

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
HDC지수연계증권투자신탁HE-20호(ELS-파생형)		1등급	BQ110
펀드의 종류	주식파생형, 단위형, 일반형	최초설정일	2017.05.22
운용기간	2017.08.22 ~ 2017.11.21	존속기간	2017.11.22
자산운용회사	HDC자산운용(주)	펀드재산보관회사	부산은행
판매회사	대구은행, 부산은행, 수협중앙회, 신한은행, 우리은행, 제주은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 HSCEI 지수 와 EUROSTOXX50 지수의 변동과 연계되는 파생결합증권에 투자신탁 자산총액의 60% 이상 투자하여 기초자산의 변동에 따라 수익을 얻는 것을 목적으로 하는 ELS-파생형 증권투자신탁입니다.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
HDC지수연계HE-20(ELS-파생형)	자산 총액 (A)	3,985	4,227	6.05
	부채 총액 (B)	2	2	1.83
	순자산총액 (C=A-B)	3,983	4,225	6.06
	발행 수익증권 총 수 (D)	4,125	4,125	0.00
	기준가격(주) (E=C/D×1000)	965.58	1,024.06	6.06

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

※ 분배금 내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
HDC지수연계HE-20(ELS-파생형)	20171122	99	4,125	1,024.06	1,000.00	

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

2017년 5월 22일에 설정된 본 펀드는 HSCEI 지수(홍콩H지수)와 EUROSTOXX50 지수의 변동과 연계되는 파생결합증권에 투자하여 사전에 정해진 조기(만기)상환조건을 달성하면 연3.10% 내외의 수익을 추구하도록 설계된 펀드입니다. 1차 자동조기상환평가일(2017년 11월 17일) 현재 HSCEI지수는 11,608.73pt로 미국 기준금리 인상 이슈로 단기 변동성이 확대되는 모습을 보였으나, 중국 정부의 재정 확대 정책 시행과 금융 완화 정책 지속 기대감 등으로 최초기초자산가격 대비 약11.90% 상승하는 강세를 보였으며, EUROSTOXX50지수는 3,547.46pt 유로존 PMI가 재정위기 이전 수준으로 회복하는 등 경기지표가 호조를 보임에도 불구하고 기업실적 부진으로 투자심리가 둔화되며 최초기초자산가격 대비 약0.81% 약보합세를 보였습니다. 1차 자동조기상환 평가일 현재 두 기초자산의 증가 모두 최초기초자산가격 대비 90% 수준 이상을 충족하여 2017년 11월 22일 자동조기상환될 예정입니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

동 펀드는 2017년 11월 17일 1차 자동조기상환평가일 현재 두 기초자산 증가 모두 상환 조건을 충족하여 자동조기상환이 결정되었으며, 2017년 11월 22일에 원금 및 1.55%(연3.10%) 내외의 수익률로 상환금이 지급될 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
HDC지수연계HE-20(ELS-파생형)	6.06	2.41	-	-
(비교지수 대비 성과)	(6.06)	(2.41)	-	-
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
HDC지수연계HE-20(ELS-파생형)	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

▶ **손익현황**

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	0	0	0	0	0	-140	0	0	0	0	-2	-142
당기	0	0	0	0	0	243	0	0	0	0	-2	241

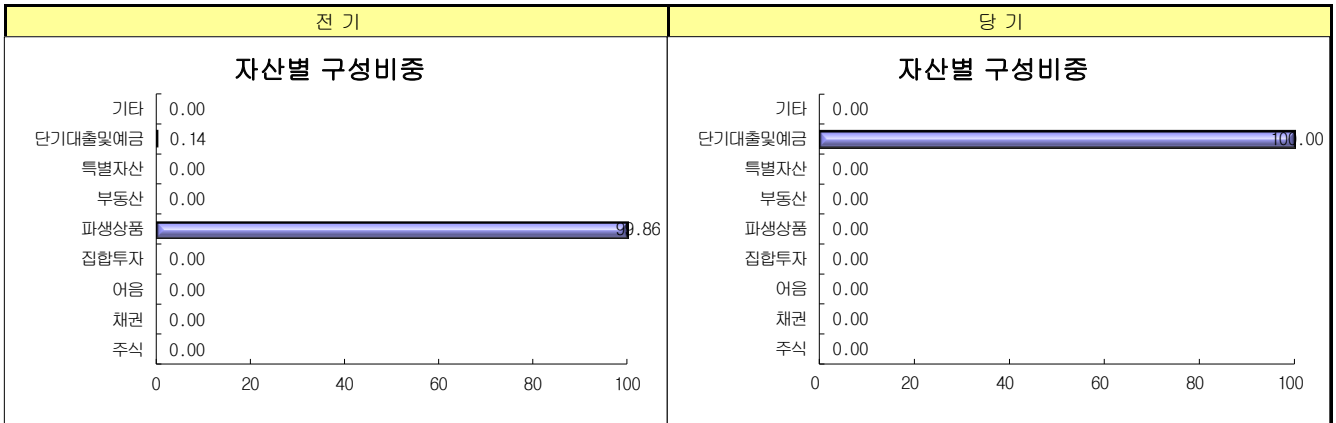
3. 자산현황

▶ **자산구성현황**

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	0	0	0	0	0	0	0	0	4,227	0	4,227
(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(100.00)	(0.00)	(100.00)
합계	0	0	0	0	0	0	0	0	0	4,227	0	4,227

* () : 구성 비중



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	단기상품	은대(부산은행)	100.00	6			0.00
2				7			
3				8			
4				9			
5				10			

※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**

▶ **단기대출 및 예금**

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	부산은행	2017-05-22	4,227	0.92		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
유승민	구조화파트장	70년생	39	4,347	10	2,634	2109000520

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.

※투자운용전문인력 현황은 2017.11.01 기준입니다.

※펀드의 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
-	-

▶ 해외 운용 수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
-	-	-	-

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
HDC지수연계HE-20(ELS-파생형)	자산운용사	2	0.04	2	0.04	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	2	0.05	2	0.05	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
		소자문석업부 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
		증권거래세	0	0.00	0	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
		HDC지수연계HE-20(ELS-파생형)	전기	0.1952
	당기	0.1951	0	0.1951

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.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
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 매매회전을 추이

(단위 : %)

0.00	0.00	0.00
------	------	------

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 HDC지수연계증권투자신탁HE-20호(ELS-파생형)의 자산운용회사인 'HDC자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '부산은행'의 확인을 받아 판매회사인 '대구은행, 부산은행, 수협중앙회, 신한은행, 우리은행, 제주은행'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : HDC자산운용(주) <http://www.hdcasset.com> / 02-3215-3000

금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모가 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있습니다. 또한 법적단서에 의거하여 향후 불가피하게 임의해지를 통해 정리될 수 있음을 알려드립니다. (자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제 192조 제1항, 동법 시행령 제 223조 제3호 및 제4호)