

자산운용보고서

HDC리자드지수연계증권투자신탁KSEb-26호(ELS-파생형)(운용)

(운용기간 : 2018년03월15일 ~ 2018년06월17일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 집합투자업자가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(4개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

HDC자산운용

서울시영등포구국제금융로8길11대영빌딩2층
(전화 3215-3000, <http://www.hdcasset.com>)

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	
HDC리자드지수연계증권투자신탁KSEb-26호(ELS-파생형)(운용) HDC리자드지수연계증권투자신탁KSEb-26호(ELS-파생형)Class A		1등급	C0699 C0700	
펀드의 종류	주식파생형, 단위형, 종류형	최초설정일	2017.12.15	
운용기간	2018.03.15 ~ 2018.06.17	존속기간	2018.06.18	
자산운용회사	HDC자산운용	펀드재산보관회사	부산은행	
판매회사	KEB하나은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	이 투자신탁은 KOSPI200 지수, S&P500 지수, EUROSTOXX Banks 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
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)(운용)	자산 총액 (A)	3,250	3,384	4.11
	부채 총액 (B)	0	0	-69.05
	순자산총액 (C=A-B)	3,250	3,384	4.11
	발행 수익증권 총 수 (D)	3,288	3,284	-0.11
	기준가격 ^주 (E=C/D×1000)	988.62	1,030.45	4.23
종류(Class)별 기준가격 현황				
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)A	기준가격	988.06	1,029.28	4.17

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

※ 분배금 내역

(단위: 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)(운용)	20180618	100	3,284	1,030.45	1,000.00	
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)A	20180618	96	3,288	1,029.28	1,000.00	

주) 분배후수탁고는 재투자 0 백만좌 포함입니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

2017년 12월 15일에 설정된 본 펀드는 KOSPI200지수, S&P500지수 및 EUROSTOXX Banks지수의 변동과 연계되는 파생결합증권에 투자하여 사전에 정해진 조기(반기)상환조건을 달성하면 연4.10% (리자드 조건 충족 시 연6.15%) 내외의 수익을 추구하도록 설계된 펀드입니다. 1차 자동조기상환평가일(2018년 6월 12일) 현재 KOSPI200지수는 316.84pt로 전년대비 양호한 기업이익 전망치에도 불구하고 미-중 무역 및 통상갈등 영향으로 최초기초자산가격 대비 약2.88% 하락했습니다. □ S&P500지수는 2,786.85pt로 미국 고용, 소비 관련 지표 호조 및 트럼프정부 정책 기대감 등으로 최초기초자산가격 대비 약4.15% 상승했습니다. □ EUROSTOXX Banks지수는 114.96pt로 유로존 PMI가 재정위기 이전 수준으로 회복하는 등 경기지표가 호조를 보임에도 불구하고 이탈리아 정치적 불확실성으로 최초기초자산가격 대비 약12.95% 하락했습니다. 1차 자동조기상환 평가일 현재 세 기초자산의 증가 모두 최초기초자산가격 대비 87% 수준 이상을 충족하여 2018년 6월 18일 자동조기상환될 예정입니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

동 펀드는 2018년 6월 12일 1차 자동조기상환평가일 현재 세 기초자산 증가 모두 상환 조건을 충족하여 자동조기상환이 결정되었으며, 2018년 6월 18일에 원금 및 2.05%(연4.10%) 내외의 수익률로 상환금이 지급될 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)(운용)	4.64	3.04	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.64)	(3.04)	-	-
종류(Class)별 현황				
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)A	4.59	2.92	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.59)	(2.92)	-	-
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
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)(운용)	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)A	-	-	-	-
(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	-38	0	0	0	0	0	-37
당기	0	0	0	0	0	137	0	0	0	0	0	137

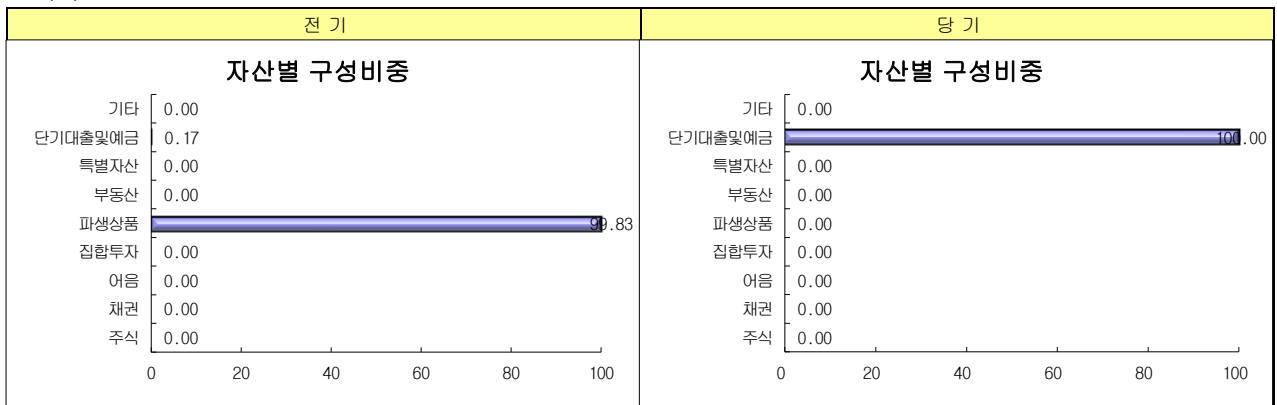
3. 자산현황

▶ 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	3,384	0	3,384
(1.00)	(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	3,384	0	3,384

* () : 구성 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	단기	은대(부산은행)	100.00	6			
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	2017-12-15	3,384	1.15		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	파생상품운용본부장	70년 생	331	8,377	-	-	2109000520

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임투자운용인력이며, '책임투자운용인력'이란 투자운용인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함.

펀지기준일 : 2018.06.17

*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
2017.12.15 ~ 현재	유승민

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)(운용)	자산운용사	0	0.00	0	0.00	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.00	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, □ 중개 □ 수수료	단순매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 □ 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.00	0	0.00	
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)A	자산운용사	2	0.05	2	0.05	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	2	0.06	2	0.06	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, □ 중개 □ 수수료	단순매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 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 예탁 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)
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)(운용)	전기	0.003	0	0.003
	당기	0.003	0	0.003
종류(Class)별 현황				
리자드지수연계KSEb-26(ELS-파생형)A	전기	0.2329	0	0.2329
	당기	0.2291	0	0.2291

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.

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 HDC리자드지수연계증권투자신탁KSEb-26호(ELS-파생형)(운용)의 자산운용회사인 HDC자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 부산은행의 확인을 받아 판매회사인 KEB하나은행을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 HDC자산운용
금융투자협회

<http://www.hdcasset.com>
<http://dis.kofia.or.kr>

3215-3000

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 제192조 제1항, 동법 시행령 제223조 제3호 및 제4호)