

자산운용보고서

HDC지수연계증권투자신탁HEN-33호(ELS-파생형)(운용)

(운용기간 : 2018년03월18일 ~ 2018년06월18일)

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 |
|---|---|----------|----------------|
| HDC지수연계증권투자신탁HEN-33호(ELS-파생형)(운용) HDC지수연계증권투자신탁HEN-33호(ELS-파생형)Class A | | 1등급 | C0804 C0805 |
| 펀드의 종류 | 주식파생형, 단위형, 종류형 | 최초설정일 | 2017.12.18 |
| 운용기간 | 2018.03.18 ~ 2018.06.18 | 존속기간 | 2018.06.19 |
| 자산운용회사 | HDC자산운용 | 펀드재산보관회사 | 부산은행 |
| 판매회사 | 수협중앙회, 신한은행, 제주은행 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | 이 투자신탁은 HSI 지수, EUROSTOXX50 지수, NIKKEI225 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 |
|-------------------------|---------------------------------|--------|----------|--------|
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)(운용) | 자산 총액 (A) | 3,642 | 4,030 | 10.67 |
| | 부채 총액 (B) | 0 | 0 | -17.65 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 3,642 | 4,030 | 10.67 |
| | 발행 수익증권 총 수 (D) | 3,903 | 3,898 | -0.11 |
| | 기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000) | 933.19 | 1,033.88 | 10.79 |
| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)A | 기준가격 | 932.65 | 1,032.71 | 10.73 |

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 | |
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)(운용) | 20180619 | 132 | 3,898 | 1,033.88 | 1,000.00 | |
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)A | 20180619 | 128 | 3,903 | 1,032.71 | 1,000.00 | |

주) 분배후수탁고는 재투자 0 백만좌 포함입니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

2017년 12월 18일에 설정된 본 펀드는 HSI지수, EUROSTOXX50지수 및 NIKKEI225지수 변동과 연계되는 파생결합증권에 투자하여 사전에 정해진 초기(반기)상환조건을 달성하면 연4.80% 내외의 수익을 추구하도록 설계된 펀드입니다. 1차 자동조기상환평가일(2018년 6월 14일) 현재 HSI지수는 30,440.17pt로 미국 기준금리 인상 등에 대한 우려감에도 불구하고 GDP 등 경기지표 개선에 힘입어 최초기초자산가격 대비 약4.78% 상승했습니다. □

EUROSTOXX50지수는 3,527.11pt로 유로존 PMI가 재정위기 이전 수준으로 회복하는 등 경기지표가 호조를 보임에도 불구하고 글로벌 증시 하락 영향으로 최초기초자산가격 대비 약2.28% 하락했습니다. □

NIKKEI225지수는 22,738.61pt로 아베노믹스 정책효과 가시화 및 글로벌 경기 개선에 따른 수출회복 등으로 투자심리가 개선되었으나 글로벌 증시 하락 영향으로 최초기초자산가격 대비 약0.71% 약보합세를 보였습니다. 1차 자동조기상환 평가일 현재 세 기초자산의 증가 모두 최초기초자산가격 대비 92% 수준 이상을 충족하여 2018년 6월 19일 자동조기상환될 예정입니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

동 펀드는 2018년 6월 14일 1차 자동조기상환평가일 현재 세 기초자산 증가 모두 상환 조건을 충족하여 자동조기상환이 결정되었으며, 2018년 6월 19일에 원금 및 2.40%(연4.80%) 내외의 수익률로 상환금이 지급될 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|-------------------------|---------|--------|--------|---------|
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)(운용) | 10.78 | 3.39 | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (10.78) | (3.39) | - | - |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)A | 10.72 | 3.27 | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | (10.72) | (3.27) | - | - |
| 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 |
|-------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)(운용) | - | - | - | - |
| (비교지수 대비 성과) | - | - | - | - |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 지수연계HEN-33(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 | | 단기대출및예금 | 기타 | 손익합계 |
|----|----|----|----|------|------|------|-----|------|----|---------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 전기 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -261 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -261 |
| 당기 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 393 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 393 |

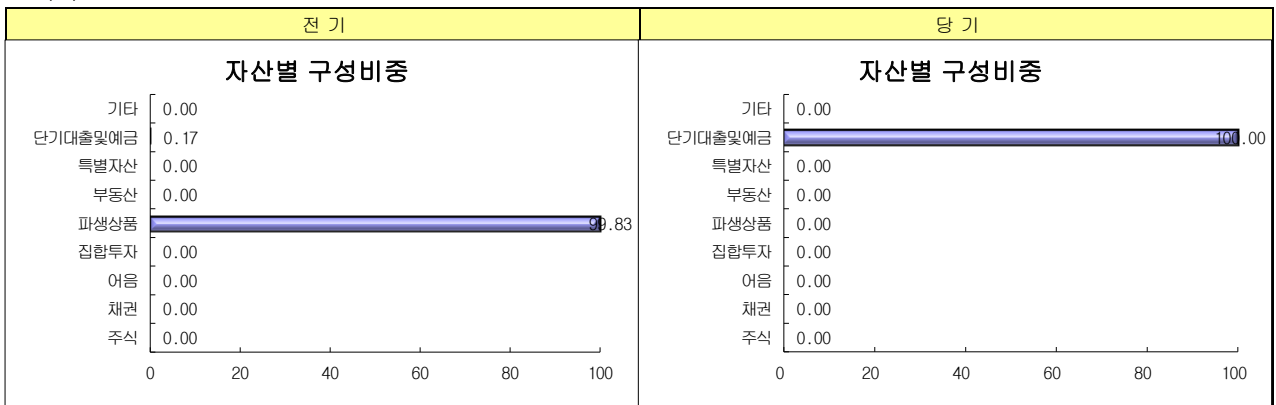
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출및예금 | 기타 | 자산총액 |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|--------|----------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| KRW | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 4,030 | 0 | 4,030 |
| (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 | 4,030 | 0 | 4,030 |

* () : 구성 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| | 구분 | 종목명 | 비중 | | 구분 | 종목명 | 비중 |
|---|----|----------|--------|----|----|-----|----|
| 1 | 당기 | 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 | 2017-12-18 | 4,030 | 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.

펀드기준일: 2018.06.18

*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 |
|-----------------|--------|
| 2017.12.18 ~ 현재 | 유승민 |

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

| | 구분 | 전기 | | 당기 | | |
|-------------------------|----------------------|-----------------------|------|------|------|------|
| | | 금액 | 비율 | 금액 | 비율 | |
| 지수연계HEN-33(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 |
| 지수연계HEN-33(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 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) |
|-------------------------|----|-------------|----------------|---------|
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)(운용) | 전기 | 0.0032 | 0 | 0.0032 |
| | 당기 | 0.0031 | 0 | 0.0031 |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 지수연계HEN-33(ELS-파생형)A | 전기 | 0.2333 | 0 | 0.2333 |
| | 당기 | 0.2318 | 0 | 0.2318 |

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 HDC지수연계증권투자신탁HEN-33호(ELS-파생형)(운용)의 자산운용회사인 HDC자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 부산은행의 확인을 받아 판매회사인 수협중앙회, 신한은행, 제주은행을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 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)