

자산운용보고서

HDC클리자드지수연계증권투자신탁SEN-6호
(USD)(ELS-파생형)(운용)

(운용기간 : 2018년05월21일 ~ 2018년08월20일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 집합투자업자가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 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
HDC쿼리자드지수연계증권투자신탁SEN-6호(USD)(ELS-파생형)(운용) HDC쿼리자드지수연계증권투자신탁SEN-6호(USD)(ELS-파생형)Class A HDC쿼리자드지수연계증권투자신탁SEN-6호(USD)(ELS-파생형)Class Ae		1등급	C8844 C8845 C8846
펀드의 종류	주식파생형, 단위형, 종류형	최초설정일	2018.05.21
운용기간	2018.05.21 ~ 2018.08.20	종속기간	2021.06.21
자산운용회사	HDC자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	KEB하나은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 S&P500지수, EUROSTOXX50지수, NIKKEI225지수의 변동과 연계되는 미국 달러화(USD)표시 파생결합증권에 투자신탁 자산총액의 60% 이상 투자하여 기초자산의 변동에 따라 수익을 얻는 것을 목적으로 하는 ELS-파생형 증권 투자신탁입니다.		

▶ 재산현황

(단위: 천USD, 천좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
쿼리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)(운용)	자산 총액 (A)	0	1,189	0.00
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	0	1,189	0.00
	발행 수익증권 총 수 (D)	0	120,116	0.00
	기준가격(₩) (E=C/D×1000)	0.00	9.90	-100.00
종류(Class)별 기준가격 현황				
쿼리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)A	기준가격	0.00	9.89	-1.10
쿼리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)Ae	기준가격	0.00	9.89	-1.10

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.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

2018년 5월 21일에 설정된 본 펀드는 S&P500지수, EUROSTOXX50지수 및 NIKKEI225지수의 변동과 연계되는 파생결합증권에 투자하여 사전에 정해진 조기(만기)상환조건을 달성하면 연4.05% (리자드 조건 충족 시 연6.075%) 내외의 수익을 추구하도록 설계된 펀드입니다. 2018년 8월 20일(보고 기준일) 현재 S&P500지수는 2,857.05pt로 미중 무역갈등에도 불구하고 미국 고용, 소비 관련 지표 호조 및 트럼프정부 정책 기대감 등의 영향으로 최초기초자산가격 대비 약4.54% 상승했습니다. EUROSTOXX50지수는 3,393.67pt로 PMI가 재정위기 이전 수준으로 회복하는 등 경기지표 호조에도 불구하고 유로존 정치적 불확실성으로 투자심리가 다소 둔화되며 최초기초자산가격 대비 약5.01% 하락했습니다. NIKKEI225지수는 22,199.00pt로 아베노믹스 정책효과 가시화 및 글로벌 경기 개선에 따른 수출회복에도 불구하고 글로벌 증시 하락 영향으로 최초기초자산가격 대비 약3.49% 하락했습니다. 보고 기준일 현재 채권평가회사(한국자산평가, KIS채권평가)의 아래의 평가가격을 기초로 산출한 동 펀드의 마감 후 기준가격은 1,023.99원(운용펀드 기준)으로 지난 3개월간 2.40%의 성과를 보이고 있으나, 1차 자동조기상환평가일(2018년 11월 20일) 기초자산의 증가로 자동조기상환 여부가 결정될 예정입니다.

*보고기준일 현재 ELS발행회사 별 채권평가회사 평가가격(채권평가 시초가격 10,000원)
미래에셋대우 9,782.557원(변동률 -2.17%), 신한금융투자 9,782.557원(변동률 -2.17%), 대신증권 9,781.436원(변동률 -2.19%), KB증권 9,782.557원(변동률 -2.17%)

▶ 투자환경 및 운용 계획

S&P500지수는 2018년 FOMC의 금리정책 강도, 단기 상승에 따른 부담스러운 밸류에이션 수준 등 지수의 상승 지속 가능성 판단에는 아직 다양한 변수가 남아 있으나 주요 기업이익 성장 기대감으로 당분간 완만한 상승 흐름은 조금 더 지속될 것으로 예상됩니다. EUROSTOXX50지수는 2018년 5월말 금융시장에 충격을 준 이탈리아 정치적 불확실성은 親유로 성향 재무장관 지명에 따른 내각 구성으로 다소 완화되는 모습을 보이고 있으나, 이탈리아의 유로존 탈퇴 가능성이 제기됨에 따라 단기적으로 증시 변동성은 확대될 것으로 예상합니다. NIKKEI225지수는 2018년 1분기 GDP가 연율로 +0.6%로 9분기 만에 다소 둔화된 모습을 보이고 있으나, 농산물 가격 상승 등에 의한 일시적 요인인 것으로 보입니다. 환율상황에 영향을 많이 받는 일본시장의 특성상 중국 경기변동 등으로 변동성이 다소 증가할 수 있으나 제조업PMI 등 경기지표가 호조를 보이는 점은 당분간 일본 증시에 긍정적으로 반영될 것으로 예상됩니다. 본 펀드가 투자하고 있는 파생결합증권의 각 발행사(KB증권(AA), 신한금융투자(AA), 미래에셋대우(AA), 대신증권(AA-))의 신용위험 변동과 시장상황 변화 및 자동조기상환 가능성 위주로 면밀히 주시하며 관리해 나갈 예정입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)(운용)	-1.04	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-1.04)	-	-	-
종류(Class)별 현황				
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)A (비교지수 대비 성과)	-1.10 (-1.10)	- -	- -	- -
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)Ae (비교지수 대비 성과)	-1.10 (-1.10)	- -	- -	- -
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
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)(운용)	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)A (비교지수 대비 성과)	- -	- -	- -	- -
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)Ae (비교지수 대비 성과)	- -	- -	- -	- -
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

▶ 손익현황

(단위: 천USD)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
당기	0	0	0	0	0	-12	0	0	0	0	0	-12

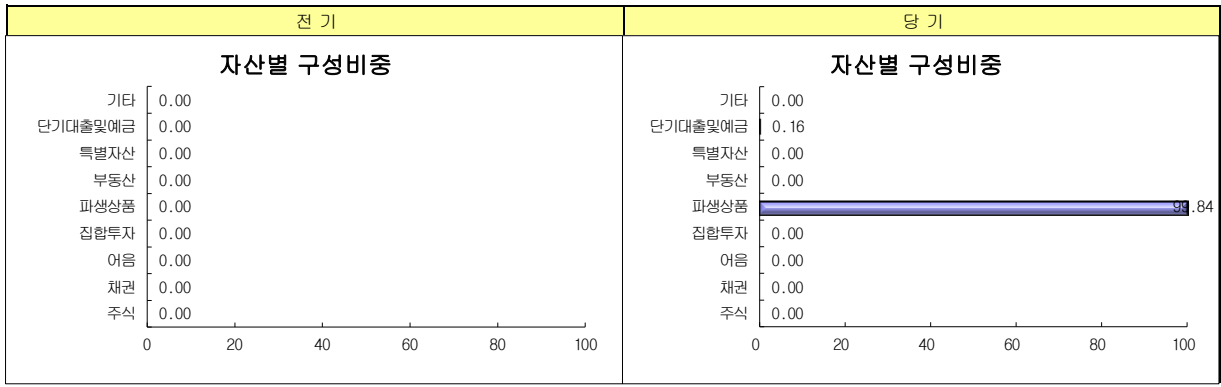
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 천USD, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
USD (1123.10)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,187 (99.84)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2 (0.16)	0 (0.00)	1,189 (100.00)
합계	0	0	0	0	0	1,187	0	0	0	2	0	1,189

* () : 구성 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	장외파생	KB증권(ELS)2018-6481	24.96	6	
2	장외파생	미래에셋대우(ELS)24062	24.96	7	
3	장외파생	신한금융투자(ELS)15757	24.96	8	
4	장외파생	대신증권(ELS)7610	24.96	9	
5	단기	CASH ACCOUNT(USD)	0.16	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

▶ 장외파생상품

(단위: 계약, 천USD)

종류	거래상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	취득가격	평가금액	비고
KB증권(ELS)2018-6481	KB증권	주식	매수	2021-05-24	303,310	300	297	
신한금융투자(ELS)15757	신한금융투자	주식	매수	2021-05-24	303,290	300	297	
미래에셋대우(ELS)24062	미래에셋대우	주식	매수	2021-05-24	303,290	300	297	
대신증권(ELS)7610	대신증권	주식	매수	2021-05-24	303,290	300	297	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 주, 천USD, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
외화예치금	CASH ACCOUNT(USD)	2018-05-21	2	0.00		대한민국	USD

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	70년생	404	10,242	-	-	-

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 : 2018.08.20

*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
2018.02.28 ~ 현재	유승민

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 천USD, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(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	
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)A	자산운용사	0	0.00	1	0.05	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	1	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	
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)Ae	자산운용사	0	0.00	0	0.05	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	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)
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)(운용)	전기	0	0	0
	당기	0.003	0	0.003
종류(Class)별 현황				
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)A	전기	0	0	0
	당기	0.2349	0	0.2349
퀵리자드지수연계SEN-6(USD)(ELS-파생형)Ae	전기	0	0	0
	당기	0.2347	0	0.2347

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: 천USD, %)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식이액의 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 HDC쿼리자드지수연계증권투자신탁SEN-6호(USD)(ELS-파생형)(운용)의 자산운용회사인 HDC자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 KEB하나은행의 확인을 받아 판매회사인 KEB하나은행을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드 재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : HDC자산운용
금융투자협회

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

3215-3000