



▶ 주식

(단위: 주, 백만원, %)

| 종목명  | 보유수량    | 평가금액  | 비중   | 발행국가 | 통화  | 업종   | 비고 |
|------|---------|-------|------|------|-----|------|----|
| 삼성전자 | 176,049 | 9,348 | 4.96 | 대한민국 | KRW | 전기전자 |    |

\* 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

| 종목명                | 액면가액  | 평가액   | 발행국가 | 통화  | 발행일        | 상환일        | 보증기관 | 신용등급 | 비중   |
|--------------------|-------|-------|------|-----|------------|------------|------|------|------|
| 국고1125-2509(20-6)  | 9,000 | 8,240 | 대한민국 | KRW | 2020-09-10 | 2025-09-10 |      | N/A  | 4.37 |
| SK290-1            | 7,800 | 7,791 | 대한민국 | KRW | 2019-11-28 | 2022-11-28 |      | AAA  | 4.13 |
| 신한카드2049-3         | 8,000 | 7,471 | 대한민국 | KRW | 2019-10-07 | 2024-10-07 |      | AAA  | 3.96 |
| 국고1500-5003(20-2)  | 9,500 | 5,689 | 대한민국 | KRW | 2020-03-10 | 2050-03-10 |      | N/A  | 3.02 |
| 국고1125-3903(19-6)  | 7,600 | 4,937 | 대한민국 | KRW | 2019-09-10 | 2039-09-10 |      | N/A  | 2.62 |
| 산금22신할100-0707-2   | 5,000 | 4,851 | 대한민국 | KRW | 2022-07-07 | 2023-07-07 |      | AAA  | 2.57 |
| 국고03125-2506(22-4) | 4,900 | 4,816 | 대한민국 | KRW | 2022-06-10 | 2025-06-10 |      | N/A  | 2.56 |

\* 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 집합투자증권

(단위: 좌수, 백만원, %)

| 종목명                 | 종류  | 설정일    | 순자산금액  | 발행국가 | 통화  | 비중   |
|---------------------|-----|--------|--------|------|-----|------|
| 미래에셋연보합채권증권투자신탁(채권) | 채권형 | 19,924 | 17,939 | 대한민국 | KRW | 9.52 |

\* 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 주, 백만원, %)

| 종류 | 금융기관 | 취득일자       | 금액     | 금리   | 만기일 | 발행국가 | 통화  |
|----|------|------------|--------|------|-----|------|-----|
| 예금 | 우리은행 | 2010-04-01 | 21,666 | 2.07 | -   | 대한민국 | KRW |

\* 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 백만원)

| 성명  | 직위  | 나이 | 운용중인 펀드 현황 |           | 성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모 |      | 협회등록번호     |
|-----|-----|----|------------|-----------|-------------------------|------|------------|
|     |     |    | 펀드개수       | 운용규모      | 펀드개수                    | 운용규모 |            |
| 최미영 | 부사장 | 43 | 81         | 2,222,078 | -                       | -    | 2119000125 |
| 이대석 | 차장  | 40 | 81         | 2,222,078 | -                       | -    | 2120001220 |
| 김태현 | 과장  | 39 | 81         | 2,222,078 | -                       | -    | 2119000109 |
| 윤유라 | 대리  | 30 | 81         | 2,222,078 | -                       | -    | 2121001284 |

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

\* 펀드의 투자운용인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간              | 운용전문인력 |
|-----------------|--------|
| 2019.01.25 ~ 현재 | 최미영    |
| 2020.09.17 ~ 현재 | 이대석    |
| 2019.01.24 ~ 현재 | 김태현    |
| 2021.07.16 ~ 현재 | 윤유라    |

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

| 구분             | 전기               |      | 당기   |      |      |
|----------------|------------------|------|------|------|------|
|                | 금액               | 비율   | 금액   | 비율   |      |
| 자산운용사          | 41               | 0.02 | 39   | 0.02 |      |
| 판매회사           | 330              | 0.16 | 327  | 0.17 |      |
| 펀드재산보관회사(신탁업자) | 5                | -    | 5    | -    |      |
| 일반사무관리회사       | 8                | -    | 8    | -    |      |
| 보수합계           | 384              | 0.19 | 379  | 0.19 |      |
| 기타비용           | 1                | -    | 1    | -    |      |
| 매매<br>증개수수료    | 단순매매 증개수수료       | 22   | 0.01 | 24   | 0.01 |
|                | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0    | -    | 0    | -    |
|                | 합계               | 22   | 0.01 | 24   | 0.01 |
| 증권거래세          | 30               | 0.01 | 33   | 0.02 |      |

\* 펀드의 순자산총액(간접간) 대비 비율을 나타냅니다.

\* 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적, 반복적으로 지출된 비용으로서 매매, 증개수수료는 제외합니다.

\* 성과보수내역: 해당 없음

\* 발행분담금내역: 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산, %)

|    | 총보수 비용비율(A) | 매매·증개수수료 비율(B) | 합계(A+B) |
|----|-------------|----------------|---------|
| 전기 | 0.7706      | 0.0431         | 0.8137  |
| 당기 | 0.7684      | 0.0489         | 0.8173  |

\* 총보수비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수비용수준을 나타냅니다.

\* 매매증개수수료 비율이란 매매증개수수료를 순자산 연평균액(보수비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매증개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위: 백만원, %)

| 매수      |        | 매도      |        | 매매 회전율 |        |
|---------|--------|---------|--------|--------|--------|
| 수량      | 금액     | 수량      | 금액     | 해당기간   | 연환산    |
| 375,754 | 16,141 | 372,150 | 14,291 | 28.15  | 111.69 |

\* 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매회전율이 높을수록 매매거래수율(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위: %)

| 2022-01-01 ~ 2022-03-31 | 2022-04-01 ~ 2022-06-30 | 2022-07-01 ~ 2022-09-30 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 29.54                   | 24.13                   | 28.15                   |

7. 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

가. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

- 시장위험 및 개별증권위험: 이 투자신탁은 집합투자증권, 주식, 채권 등 증권에 투자함으로써 개별증권의 가격 변동 및 기타 거시경제지표의 변화에 따른 위험에 노출됩니다. 또한 예상하지 못한 정치·경제상황 등도 운용에 영향을 미칠 수 있으며, 이에 따른 투자원금 손실이 발생할 수 있습니다.

- 유동성 위험: 이 투자신탁에서 투자하는 증권, 시장규모 등을 감안할 때 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자하는 경우 유동성 부족에 따른 환금성 제약이 발생할 수 있으며, 이로 인한 환매 연기나 거래비용 증가 등으로 기회비용 발생과 함께 투자원금 손실이 발생할 수 있습니다.

▶ 주요 위험 관리 방안

가. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

- 신탁약관 및 법규에 따라 투자한도 및 모든 법적 규제 등이 철저히 준수되도록 관리되고 있으며, 내부 투자 가이드라인에 의거하여 투자 전략의 점검, 성과 측정과 위험 관리가 이루어지고 있습니다.

나. 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한과 수단 등  
 해당사항 없음

▶ 주요 비상대응계획

- 재해 등의 위기상황 발생 시 리스크 관리, 투자 자산 모니터링 등 회사의 주요 기능이 계속 수행될 수 있도록 사업연속성계획(BCP)을 마련하고 있습니다.