

# 투자자를 위한 자산운용 보고서

운영기간 2022 06 04 - 2022 09 03

Professionalism

Distinctiveness

1 ( )

Management

Competitiveness

Transparency



1.

2.

3.

4.

5.

6.

7. ( )

가

8.

9.

# 1. 펀드의 개요

## ▶ 기본정보

<b>적용법률:</b>	자본시장과 금융투자업에 관한 법률	<b>위험등급</b>	2등급(높은위험)
--------------	--------------------	-------------	-----------

펀드명칭		금융투자협회 펀드코드	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식)		17686	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류A		17687	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C4		17691	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류Ce		17693	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-s		18361	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류S		AQ220	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-p2e(퇴직연금)		D7522	
고난도 펀드	해당없음	최초설정일	2009.12.04
운용기간	2022.06.04 - 2022.09.03	존속기간	종료일이 따로 없습니다.
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(주식형), 추가형, 개방형, 종류형		
자산운용회사	플러스자산운용	판매회사	하나금융투자, NH투자증권, 국민은행 외 7개
펀드재산보관회사 (신탁업자)	국민은행	일반사무관리회사	신한아이타스
<b>상품의 특징</b>			
이 집합투자기구 기준가격이 다른 수종의 수익증권을 발행하는 종류형투자신탁으로서 국내주식을 주된 투자 대상자산으로 하여 수익을 추구합니다. 투자신탁 자산총액의 60% 이상을 국내주식에 투자하여 수익을 추구하며 40% 이하를 채권 및 어음 등의 자산에 투자하여 안정적인 수익을 추구합니다.			

주) 펀드의 자세한 판매회사는 금융투자협회 홈페이지 [ <http://dis.kofia.or.kr> ], 운용사 홈페이지 [ <http://www.plusasset.com> ] 에서 확인하실 수 있습니다.

## ▶ 재산현황

(단위: 백만원, %)

\* 아래 표를 통하여 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산총액 및 기준가격의 추이를 비교하실 수 있습니다.

펀드명칭	항목	전 기 말	당 기 말	증감률
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식)	자산총액	17,729	16,028	-9.59
	부채총액	196	430	119.60
	순자산총액	17,534	15,599	-11.04
	기준가격	1,272.99	1,136.30	-10.74
<b>종류(Class)별 기준가격 현황</b>				
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류A	기준가격	1,213.89	1,079.81	-11.05
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C4	기준가격	1,220.43	1,084.70	-11.12
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류Ce	기준가격	1,176.25	1,045.43	-11.12
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-s	기준가격	1,220.67	1,086.30	-11.01
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류S	기준가격	1,475.64	1,313.74	-10.97
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-p2e(퇴직연금)	기준가격	902.12	803.38	-10.95

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

## ※분배금내역

(단위: 백만원, 백만좌)

※해당사항 없음

### ▶ 펀드의 투자전략

투자신탁 자산총액의 60%이상을 국내주식에 투자합니다. 그 외 잔여자산을 채권 및 유동자산에 투자하여 수익을 추구  
(1) 주식 투자전략 : 투자신탁 자산총액의 60%이상을 국내주식에 투자.  
(2) 채권 투자전략: 기본적으로 우량 채권인 국채, 지방채, 특수채 및 사채권에 투자하여 적정 펀드 듀레이션<sup>1)</sup>에 의한 안정적인 이자수익 확보에 주력할 것, 매각 가능한 채권을 중심으로 포트폴리오를 구성하고, 평가 채권의 지속적인 발굴과 적절한 헷지 수단인 동원 등을 통하여 시장변화에 대응.  
주1) 듀레이션이란 채권에서 발생하는 현금흐름의 가중평균만기로서 채권가격의 이자율변화에 대한 민감도를 측정하기 위한 척도.

## 2. 운용경과 및 수익률 현황

### ▶ 운용경과

2022년 글로벌 주식 시장은 지속적으로 어려운 환경에서 벗어나지 못하고 있습니다. 연초 러시아-우크라이나 전쟁으로 인한 지정학적 리스크와 함께 소비자 물가 지수의 가파른 상승으로 인하여 주식 시장은 매우 큰 변동성을 보이고 있습니다. 특히 2분기 이후 미국의 소비자 물가 지수 상승률이 전년 대비 8% 이상을 기록하고 미국 FED의 긴축 강도가 더욱 강화됨에 따라 시장 금리 급등, 달러화 초강세 현상이 나타나고 있습니다. 이러한 상황으로 인하여 글로벌 금융 시장 참여자들은 경기 침체의 폭과 강도에 대한 우려를 전반적인 위험자산 가격에 반영하기 시작하였습니다.  
또한 러시아의 천연가스 공급 중지로 인해 나타나고 있는 유럽 에너지 위기로 인하여 필수 소비재를 제외한 전반적인 소비 위축이 나타나고 있습니다. 최근 들어서는 영국 정책의 불확실성으로 촉발된 파운드 화 급락 및 일부 유럽 금융사 부실 우려 또한 시장의 불확실 요인으로 작용하고 있습니다.  
우리 펀드의 수익률은 이러한 매크로 환경 등으로 인한 전반적인 주식 시장의 급락 흐름에서 벗어나지 못하였습니다. 또한 주 투자 대상인 대형 성장주의 주가가 시장 금리 급등 및 투자자의 위험 회피 성향 강화 영향으로 전체 시장 대비 상대적으로 더 큰 하락 흐름을 보임에 따라 비교 지수 대비 성과 또한 다소 부진한 수준을 기록하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용계획

저희는 최근 금융 시장의 여러 변화를 반영하여 4분기 KOSPI 지수를 2,050~2,400p 수준으로 다소 눈높이를 낮춰 전망하고 있습니다.  
연말까지 미국 및 주요 국가의 긴축 정책 변화는 현재의 소비자 물가 상승의 절대적 수준과 실질적 내용을 고려할 경우 단기간에 기대하기는 쉽지 않다고 생각합니다. 주식 시장의 유의미한 추세 전환을 위해서는 미국의 물가 상승률이 의미 있는 수준까지 하락하면서 이로 인하여 시장 금리 하향 안정, 달러화 가치 하락 전환이 동반되어야만 가능하다고 예상하고 있습니다. 다만 앞서 언급한 요인들이 지난 2개 분기 이상 주식 시장에 상당 부분 반영된 것 또한 사실이기 때문에 주요 국가의 향후 통화 정책 변화, 각국의 정치 일정, 글로벌을 선도하는 핵심 기업의 향후 실적 전망 등에 민감하게 반응하는 변동성 장세가 이어질 가능성이 높다고 예상합니다.

향후 운용계획은 대형 성장주 중심의 포트폴리오를 지속적으로 유지하는 가운데 단기적으로는 상대적으로 경기 둔화 영향을 적게 받는 업종 및 종목에 대한 비중을 상향 조정하는 등의 방식으로 포트폴리오의 수익률 안정성을 추구할 계획입니다. 또한 글로벌 기업 들의 3분기 실적, 4분기 전망 발표 내용 등을 면밀히 분석하여 포트폴리오의 교체 필요성이 있다고 판단될 경우, 적극적으로 반영할 것입니다. 사회/경제적 큰 위기가 지나간 이후 항상 경제 성장을 주도하는 새로운 산업이 탄생하였습니다. 따라서 향후 어떤 산업, 기업이 새로운 시대에 성장을 이끌어 갈 수 있을지 면밀히 분석하고 이를 포트폴리오에 반영할 수 있도록 저희는 이러한 부문에 대해서 리서치 역량을 집중할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위: %)

펀드명칭	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근12개월	최근2년	최근3년	최근5년
	22.06.04 ~ 22.09.03	22.03.04 ~ 22.09.03	21.12.04 ~ 22.09.03	21.09.04 ~ 22.09.03	20.09.04 ~ 22.09.03	19.09.04 ~ 22.09.03	17.09.04 ~ 22.09.03
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식)	-10.74	-14.45	-21.14	-23.68	4.37	42.60	23.63
( 비교지수대비 성과 )	(-0.96)	(-2.16)	(-2.31)	(1.05)	(3.81)	(20.03)	(21.44)
비 교 지 수	-9.78	-12.29	-18.83	-24.73	0.56	22.57	2.19
종류(Class)별 현황							
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류A	-11.05	-15.04	-21.95	-24.72	1.64	37.08	15.67
( 비교지수대비 성과 )	(-1.27)	(-2.75)	(-3.12)	(0.01)	(1.08)	(14.51)	(13.48)
비 교 지 수	-9.78	-12.29	-18.83	-24.73	0.56	22.57	2.19
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C4	-11.12	-15.18	-22.15	-24.97	0.98	35.76	13.80
( 비교지수대비 성과 )	(-1.34)	(-2.89)	(-3.32)	(-0.24)	(0.42)	(13.19)	(11.61)
비 교 지 수	-9.78	-12.29	-18.83	-24.73	0.56	22.57	2.19
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류Ce	-11.12	-15.18	-22.15	-24.97	0.98	35.75	14.75
( 비교지수대비 성과 )	(-1.34)	(-2.89)	(-3.32)	(-0.24)	(0.42)	(13.18)	(12.56)
비 교 지 수	-9.78	-12.29	-18.83	-24.73	0.56	22.57	2.19
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-s	-11.01	-14.97	-21.85	-24.59	1.98	37.76	16.64
( 비교지수대비 성과 )	(-1.23)	(-2.68)	(-3.02)	(0.14)	(1.42)	(15.19)	(14.45)
비 교 지 수	-9.78	-12.29	-18.83	-24.73	0.56	22.57	2.19
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류S	-10.97	-14.90	-21.76	-24.47	2.29	-	-
( 비교지수대비 성과 )	(-1.19)	(-2.61)	(-2.93)	(0.26)	(1.73)	-	-
비 교 지 수	-9.78	-12.29	-18.83	-24.73	0.56	-	-
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-p2e(퇴직연금)	-10.95	-14.85	-21.69	-24.38	-	-	-
( 비교지수대비 성과 )	(-1.17)	(-2.56)	(-2.86)	(0.35)	-	-	-
비 교 지 수	-9.78	-12.29	-18.83	-24.73	-	-	-

\* 비교지수 : (1 \* [KOSPI])

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

주1) 코리아 대표성장 증권1호(주식) 종류S 미운용기간 2017.02.07 ~ 2019.09.23

▶ 추적오차

(단위: %)

\* 해당사항 없음

▶ 손익현황

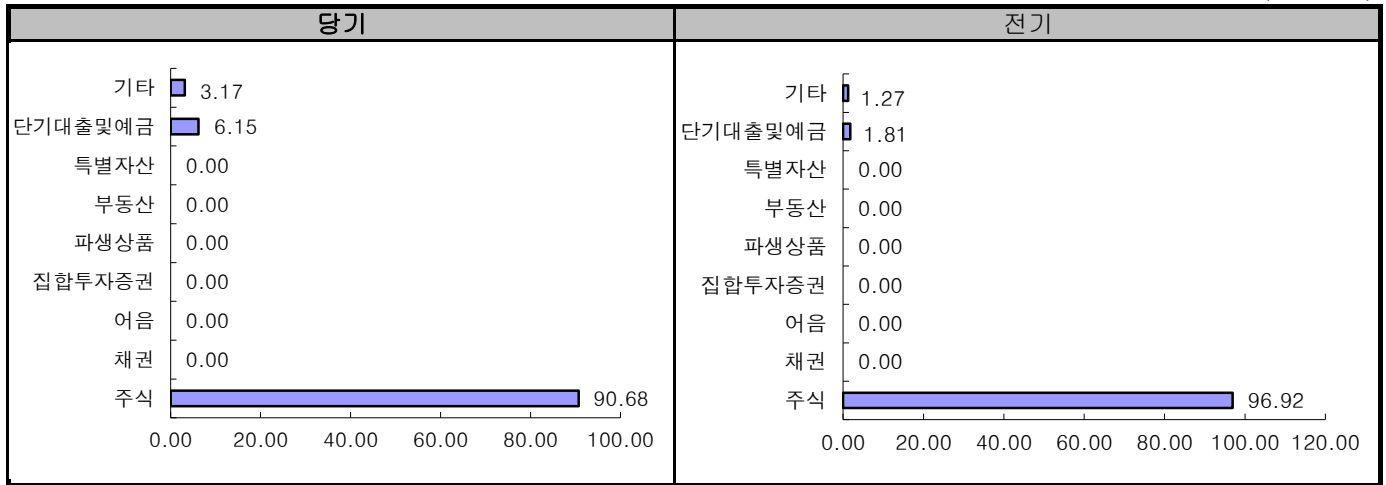
(단위: 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물 자산	기타			
전기	-764	-	-	-	-	-	-	-	-	1	0	-763
당기	-1,880	-	-	-	-	-	-	-	-	3	0	-1,877

### 3. 자산현황

#### ▶ 자산구성현황

(단위: %)



#### [자산구성현황]

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합 투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	14,534 (90.68)	-	-	-	-	-	-	-	-	986 (6.15)	508 (3.17)	16,028 (100.00)
합계	14,534 (90.68)	-	-	-	-	-	-	-	-	986 (6.15)	508 (3.17)	16,028 (100.00)

\* ( ) : 구성 비중

#### ▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	※ 해당사항 없음
펀드수익률에 미치는 효과	※ 해당사항 없음

(단위: %, 원)

투자설명서상의 목표 환헤지 비율	기준일(2022.09.03) 현재 환헤지 비율	(2022.06.04 ~ 2022.09.03) 환헤지 비용	(2022.06.04 ~ 2022.09.03) 환헤지로 인한 손익
-	-	-	-

주) 환헤지란 환율 변동으로 인한 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총 외화자산의 평가액 대비, 환헤지 규모를 비율로 표시한 것을 말합니다.

#### ▶ 환헤지를 위한 파생상품

※ 해당사항 없음

▶ **주요자산보유현황**

- ※ 펀드자산 총액에서 상위 10종목, 자산총액의(파생상품의 경우 위험평가액) 5% 초과 보유종목 및 발행주식 총수의 1% 초과 종목의 보유내역을 보여줍니다.
- ※ 보다 상세한 투자대상자산 내역은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다. (인터넷 주소 : <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ **주식 - Long(매수)**

(단위: 주, 백만원, %)

종 목 명	보유수량	평가액	비중	비고
삼성전자	58,000	3,335	20.80	-
LG에너지솔루션	2,000	964	6.01	-
삼성바이오로직스	1,100	922	5.75	-
현대차	4,000	786	4.90	-
NAVER	3,350	784	4.89	-
SK하이닉스	8,500	779	4.86	-
삼성SDI	1,080	622	3.88	-
한솔케미칼	2,400	516	3.21	-
기아	6,200	501	3.12	-

▶ **주식 - Short(매도)**

※ 해당사항 없음

▶ **채권**

※ 해당사항 없음

▶ **어음**

※ 해당사항 없음

▶ **집합투자증권**

※ 해당사항 없음

▶ **장내파생상품**

※ 해당사항 없음

▶ **장외파생상품**

※ 해당사항 없음

▶ **부동산(임대)**

※ 해당사항 없음

▶ **부동산 - 자금대여/차입**

※ 해당사항 없음

▶ **특별자산**

※ 해당사항 없음

▶ **단기대출 및 예금**

(단위: 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	비고
예금	국민은행		986	2.07		6.15

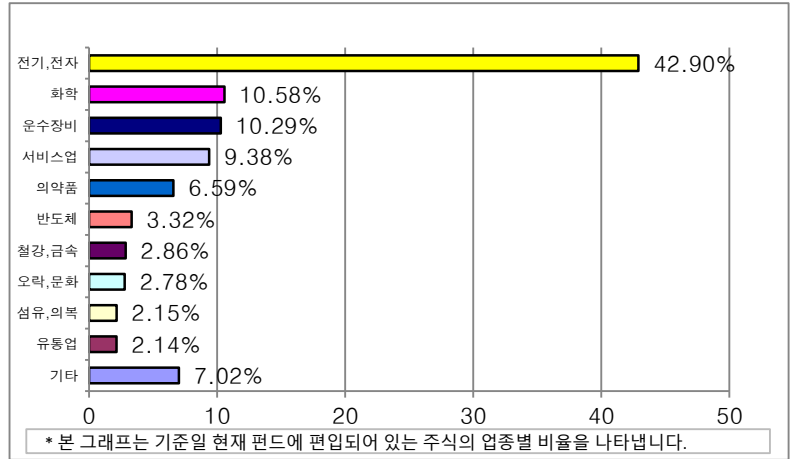
▶ 기타자산

※해당사항 없음

▶ 업종별(국내주식) 투자비중 - Long(매수)

(단위: 백만원, %)

	업종명	평가액	보유비율
1	전기, 전자	6,235	42.90
2	화학	1,537	10.58
3	운수장비	1,495	10.29
4	서비스업	1,363	9.38
5	의약품	957	6.59
6	반도체	483	3.32
7	철강, 금속	416	2.86
8	오락, 문화	404	2.78
9	섬유, 의복	313	2.15
10	유통업	312	2.14
11	기타	1,020	7.02
	합 계	14,534	100.00



주) 보유비율=평가액/총평가액\*100

주) 업종기준은 코스콤 기준

▶ 업종별(국내주식) 투자비중 - Short(매도)

※해당사항 없음

▶ 업종별(해외주식) 투자비중

※해당사항 없음

▶ 국가별 투자비중

발행(상장)국가별 투자비중

\* 일부 해외종목의 경우 거래소 상장국가와 실제 발행국가가 상이할 수 있습니다.

※해당사항 없음



## 4. 투자운용전문인력 현황

### ▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 억원)

성명	운용개시일	직위	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		주요 경력 및 운용내역	협회등록번호
			펀드 개수	운용 규모	개수	운용 규모		
경우현	2016.05.12	책임운용전문인력	15	1,380	3	389	한국외국어대학교 경제학 졸업	2109001273
							2003.12~2005.03 대신증권 지점영업	
							2005.04~2016.03 대신자산운용 주식운용본부 팀장	
							2016.05~현재 플러스자산운용 주식운용본부장	

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, 책임운용전문인력이란 운용전문인력중 투자전략 수립 및 투자 의사 결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

※ 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

기 간	운용전문인력
2016.05.12 - 2022.09.03	경우현

주) 2022.09월 기준 최근 3년간의 운용전문인력 변경 내역입니다.

### ▶ 해외 투자운용전문인력

※ 해당사항 없음

### ▶ 해외 위탁운용

※ 해당사항 없음

## 5. 비용현황

### ▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위: 백만원, %)

펀드 명칭	구 분	전 기		당 기		
		금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식)	자산운용회사	28.18	0.16	25.32	0.16	
	판매회사	22.69	0.13	20.36	0.13	
	플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류A	0.10	0.17	0.09	0.17	
	플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C4	0.07	0.25	0.06	0.25	
	플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류Ce	0.67	0.25	0.55	0.25	
	플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-s	21.79	0.13	19.61	0.13	
	플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류S	0.01	0.09	0.01	0.09	
	플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-p2e(퇴직연금)	0.05	0.06	0.05	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1.34	0.01	1.21	0.01	
	일반사무관리회사	0.67	0.00	0.60	0.00	
	보수 합계	52.88	0.30	47.49	0.30	
	기타비용**	0.09	0.00	0.09	0.00	
	매매· 중개수수료	단순매매·중개 수수료	5.49	0.03	11.10	0.07
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1.17	0.01	2.33	0.02
		합계	6.66	0.04	13.43	0.09
증권거래세	7.62	0.04	16.33	0.10		

\* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 : 해당사항 없음

### ▶ 총보수비용 비율

(단위: 연환산, %)

펀드 명칭	구분	해당 펀드			상위펀드 비용 합산		
		총보수·비용 비율(A)	매매·중개수 수수료비율(B)	합계(A+B)	총보수·비용 비율(A)	매매·중개수 수수료비율(B)	합계(A+B)
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식)	전기	0.00	0.15	0.15	0.00	0.15	0.15
	당기	0.00	0.33	0.34	0.00	0.33	0.34
<b>종류(class)별 현황</b>							
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류A	전기	1.34	-	1.34	1.34	0.15	1.49
	당기	1.34	-	1.34	1.34	0.32	1.67
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C4	전기	1.67	-	1.67	1.67	0.15	1.82
	당기	1.67	-	1.67	1.67	0.33	2.01
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류Ce	전기	1.67	-	1.67	1.68	0.15	1.83
	당기	1.67	-	1.67	1.68	0.34	2.01
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-s	전기	1.18	-	1.18	1.18	0.15	1.33
	당기	1.18	-	1.18	1.18	0.33	1.51
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류S	전기	1.02	-	1.02	1.02	0.15	1.17
	당기	1.02	-	1.02	1.02	0.33	1.36
플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식) 종류C-p2e(퇴직연금)	전기	0.90	-	0.90	0.91	0.15	1.06
	당기	0.90	-	0.90	0.91	0.33	1.24

주1) 총보수, 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수와 기타비용총액을 순자산 연평잔액(보수·비용 차감후 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평잔액(보수·비용 차감후 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

주3) 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

## 6. 투자자산매매내역

### ▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위: 주, 백만원, %)

플러스 코리아 대표성장 증권투자신탁1호(주식)

매 수		매 도		매매회전율 <sup>(주1)</sup>	
수 량	금 액	수 량	금 액	해당기간	연환산
61,135	6,331	73,025	7,099	47.03	186.58

주1) 해당운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

### ▶ 최근3분기 매매회전율 추이

(단위: %)

2021.09.04 ~ 2021.12.03	2021.12.04 ~ 2022.03.03	2022.03.04 ~ 2022.06.03
11.44	19.73	19.17

주) 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료 및 증권거래세 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드 비용이 증가합니다.

## 7. 동일한(해당) 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

※ 해당사항 없음

## 8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

### ▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

#### ① 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

주식형 펀드로 코리아 대표성장 주식에 투자하고 있어 시장상황에 따라 기준가의 변동성이 커질 수 있음.

#### ② 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

해당사항 없음.

### ▶ 주요 위험 관리 방안

#### ① 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

유동성 리스크관리를 위해 거래량(30%) 초과매매 여부, 일별 매수거래관여율(30%) 여부, 누적매수수량이 종목 상장주식수의 5%초과 여부, 당일 매수 수량이 상장주식수의 1% 여부 등을 매일 점검함. 투자유니버스 제외종목(3년연속적자, 투자유의종목 등)들에 대하여 운용을 제한하고 있음. 손절대상종목(손실을 30%이상이고 벤치마크대비 15%이상 언더퍼폼)들을 점검하여 투자위험을 줄이고 있음.

#### ② 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한·수단 등

재간접 펀드에 대한 운용은 타사 펀드의 경우 운용을 제한하고 있음. 타사 펀드에 투자할 경우에는 위험관리(운용보고서 수령 및 운용정보의 주요 항목 요청등)에 대하여 추가적으로 검토하여 조치할 계획임.

#### ③ 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등

환매중단, 상환연기, 부실자산 등 위험이 발생하거나 발생 가능성이 높다고 판단될 때에는 법률과 당사 리스크 관리 규정에 따라 대표이사에게 보고하고 리스크관리위원회와 집합투자평가위원회를 개최하여 고객의 이익을 위해 선관주의의무를 충실히 이행할 것임.

▶ **자전거래 현황**

※해당사항 없음

▶ **자전거래 사유, 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차**

※해당사항 없음

▶ **주요 비상대응계획**

위기 상황 단계 별 대응 조치 정상 단계, 주의단계, 위험단계 로 나눔 정상 단계: 월별, 수시 검사결과 특이사항 미발생시, 대표이사 월별현황 보고 주의 단계: 월별, 수시 검사결과 특이사항 발생시, 원익파악 및 대표이사 보고, 관계자에 대한 주의통보 여부 결정 위험 단계: 월별, 수시 검사결과 중대한 사항 발생시, 리스크관리위원회 보고 후 대응방안 결정, 관계자에 서면통보 및 징계여부 결정
--

**9. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항**

※해당사항 없음