

자산운용보고서

(운용기간:2009.08.17~2009.11.16)



주요 공지사항

1. 당사는 2009년 4월30일 크레디트스위스와의 합작(JV)이 종료되어 5월 27일 이후부터는 “우리자산운용”으로 사명이 변경됩니다.

*자세한 사항은 한국금융투자협회(www.kofia.or.kr)·판매회사·집합투자업자 인터넷 홈페이지의 설명서 및 규약등을 참조하시거나, 판매회사 및 집합투자업자에게 문의하여 주시기 바랍니다. 단, 투자자의 계좌와 관련된 사항은 가입하신 판매회사(은행, 증권회사, 보험회사 등)에 문의하여 주시기 바랍니다.

■ 이 상품은 증권(주식·파생형) 집합투자기구로서, 추가 입금이 가능한 추가형 집합투자기구입니다. ■ 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의거 집합투자업자가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.



- 1.
- 2.
- 3.
- 4.
- 5.
- 6.
- 7.
- 8.
- 9.

< - >

■ 본 상품은 운용결과에 따른 이익 또는 손실이 투자자에게 귀속됩니다. ■ 가입하시기 전에(투자대상, 환매방법 및 보수 등에 관하여) 투자설명서를 반드시 읽어보시기 바랍니다. ■ 과거의 운용실적이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다. ■ 환율변동에 따라 외화자산의 투자가치가 변동될 수 있습니다. ■ 본 상품은 예금자 보호법에 의하여 보호되지 않으며 실적 배당상품으로 원금의 손실이 발생할 수 있습니다. ■ 당사는 본 상품 등에 관하여 충분히 설명할 의무가 있으며, 투자자는 반드시 영업직원으로부터 상품 등에 대한 충분한 설명을 듣고, 투자 결정을 내리시기 바랍니다.

1.

:

()

2 ()

1 [-]		49076	
[], [] ()	가 ,		2005-05-17
2009.08.17 -2009.11.16			.
			()
•			
(, ,), (, ,)			
* .			

(: , , %)

1 [-]	(A)	474,933,016	460,282,486	-3.08%
	(B)	1,417,943	55,523,895	3815.81%
	(C=A-B)	473,515,073	404,758,591	-14.52%
	(D)	445,327,623	368,587,711	-17.23%
	가 (E=C/D*1000)	1,063.30	1,098.13	3.28%

) 가 가 (), () () 가 .

(: , ,)

2.

가 , , .

10 가 10 가

11 , 가

(S&P500) 20%, (DJ EUROSTOXX50) 10% 가

가 (HSCEI) 20%,

(: %)

	3	6	9	12
1 [-]	3.28%	9.81%	13.02%	13.43%
	3.45%	9.62%	14.26%	17.28%

: S&P GSCI 10%,MSCI_World(USD) 30%,KBP 60%

.

(: %)

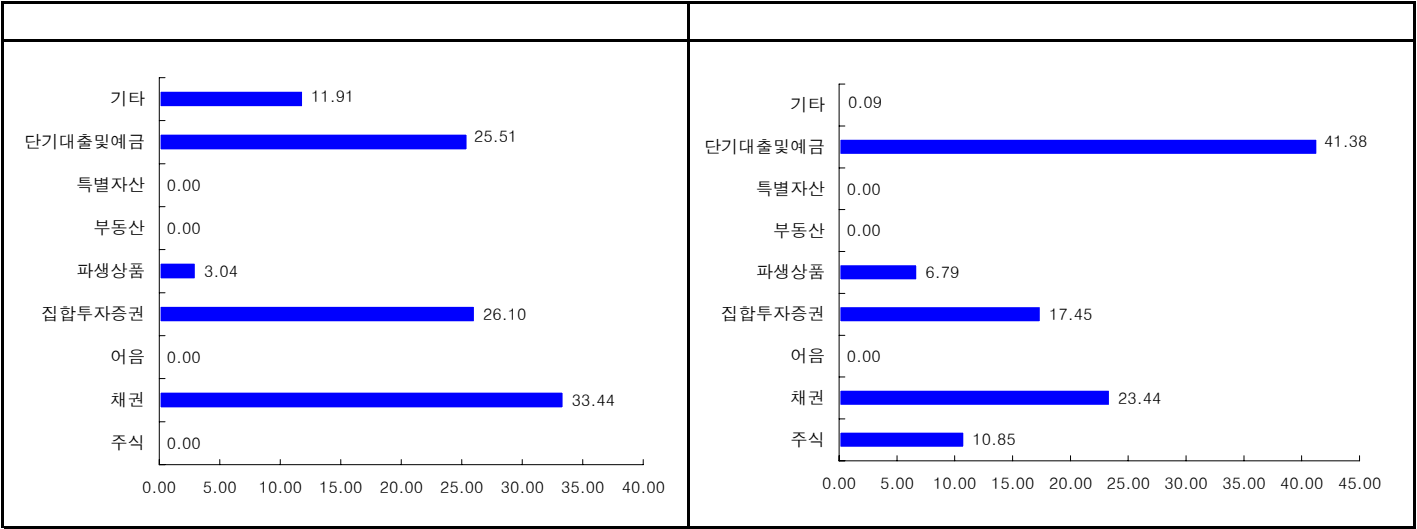
	1	2	3	5
1 [-]	13.43%	9.17%	8.68%	0.00%
	17.28%	8.60%	7.53%	0.00%

: S&P GSCI 10%,MSCI_World(USD) 30%,KBP 60%

.

(:)

	16	0	0	-8	34	0	0	0	0	1	-3	40
	4	1	0	7	8	0	0	0	0	1	-6	14



(: , %)

KRW	0 (0.00)	154 (33.44)	0 (0.00)	0 (0.00)	5 (1.19)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	63 (13.72)	55 (11.91)	277 (60.26)
HKD 149.01	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	9 (1.85)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	9 (1.85)
USD 1,154.80	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	120 (26.10)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	54 (11.78)	0 (0.00)	174 (37.88)
	0 (0.00)	154 (33.44)	0 (0.00)	120 (26.10)	14 (3.04)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	117 (25.51)	55 (11.91)	460 (100.00)

* () :

10

(: %)

1		44-733-2-22	33.44%
2		2009-12 USD912	25.10%
3		MINI H-SHR IDX FU 0911	17.77%
4		SPDR TRUST SERIES 1	17.33%
5			13.72%

6		(USD)	11.78%
7		SPDR DJ EURO STOXX 50 FUND	8.77%
8		(HKD)	1.24%
9			
10			



■ 5

(: , , %)

■ 1%

(: , , %)

■

5

(: , %)

	가	가					
44-733-2-22	150	153	2008-07-22	2010-07-22		RF	100.00%

■

5

(: , %)

■

5

(: , , %)

SPDR TRUST SERIES 1			79	80	2009-10-12	66.39%
SPDR DJ EURO STOXX 50 FUND			37	40	2009-08-11	33.61%

(: ,)

	/			
2009-12 USD912		10	115	10

(: ,)

()

(:)

- /

(: , %)

(:)

(: , %)

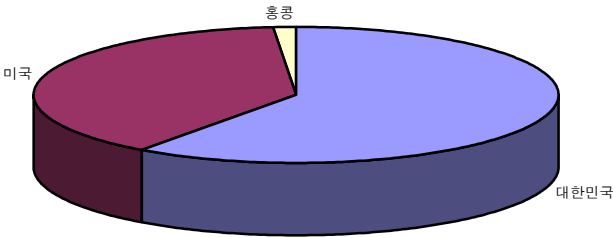
			63	1.61%		
	(USD)		54	0.00%		

(:)

▶ 국가별 투자비중

* 가	가
가	58.55%
	37.88%
	1.24%

() 가
가



주) 위 국가별 투자비중은 편입종목이 거래되는 국가 기준으로 작성이 되었으며 환헤지를 위해 편입한 파생상품(통화선물 및 선도거래 등)들이 거래되는 국가현황*도 함께 반영되어 있습니다. 특히, 통화선물이 주로 거래되는 대한민국과 선도거래의 주된 대상통화 국가**인 미국, 일본, 유럽, 홍콩의 비중은 실제 주식, 집합투자증권, 유동성등 만을 대상으로 산정한 비중과 상이할 수 있습니다.

* 통화선물의 경우 거래국가 기준으로, 선도거래의 경우 거래되는 거래소가 없으므로 대상통화 기준으로 거래국가를 분류하게 됩니다.

** 당사의 경우 주요통화[국제거래상 주요결제수단 중에서 국내 선물환시장에서 거래되는 통화]로 투자되는 부분에 대해 목표 환헤지 수준을 유지하는 환헤지 전략을 실행할 계획이므로 선도거래의 대상통화 국가는 주로 미국, 일본, 유럽, 홍콩 등입니다.

4.

(: ,)

		()				
	2005.05.17	(1974)	48 ()	5,188 ()	2000 / 2001 / 2006	2109000969

)

* 가

(: ,)

5.

(: , %)

				(%)		(%)
-] (4151) ¹ [			0.580	0.400%	0.450	0.400%
			1.170	0.800%	0.890	0.800%
			0.060	0.040%	0.040	0.040%
			0.000	0.000%	0.000	0.000%
			1.810	1.240%	1.380	1.240%

(: %)

-] (4151) ¹ [		1.290%	0.71%
		1.346%	0.44%

) , (Total Expense Ratio)

(•)

가

가 , (•) .



6.

(: , , %)

1 [-]

1,700	35	4,200	90	121.28%	481.18%

) 가 가

(: , %)

1 [-] (4151)

		08 (09.08.17 - 09.09.16)			09 (09.09.17 - 09.10.16)			10 (09.10.17 - 09.11.16)		
		()	()		()	()		()	()	
		35.79	0.01	0.02	90.23	0.02	0.02	0.00	0.00	
		(100%)	(100%)		(100%)	(100%)		(0%)	(0%)	

*

(: , %)

1 [-] (4151)

		08 (09.08.17 - 09.09.16)			09 (09.09.17 - 09.10.16)			10 (09.10.17 - 09.11.16)		
		()	()		()	()		()	()	
		0.00	0.00		0.00			153.81	0.00	0.00
								(74%)	(0%)	

*

(: , %)

1 [-] (4151)

		08 (09.08.17 - 09.09.16)			09 (09.09.17 - 09.10.16)			10 (09.10.17 - 09.11.16)		
		()	()		()	()		()	()	
		0.00	0.00		348.86	0.02	0.01	231.81	0.01	0.01
		(0%)	(0%)		(100%)	(100%)		(100%)	(100%)	

*



7.

(:)

1 [-] (4151)

()						
		2009.10.09			126	

(: , %)

(: , %)

		(가)	
()		1,459	0.0088%
()		32,382	0.1957%

(: ,)

1 [-] (4151)

(:)

1 [-] (4151)



1 [-] (4151)



[1 [-]]
[] ()
.

: 28-2 KT 17
: 02-789-0300
: <http://www.wooriam.com>
<http://dis.fundservice.net>



	6 가 5 가 , 가 가 .
()	() 60% .
()	() 가 10% .
()	() 60% .
()	() 40% .
가 ()	가 가 .
()	가 가 .
()	() 80% .
()	() 가 가 .
	가 가 가 () .
	가 가 , , , , 가
	가 가 , 가 가 .
	가 가 , ,
	가 가 , 가
	가 가 (,) .
	가 () 가 가 , 가 가 , 가 가 .