자산운용보고서

공지사항

고객님이 가입하신 펀드는 『자본시장과 금융투자업에 관한 법률(신규 설정)』의 적용을 받습니다.

이 보고서는 자본시장법에 의해 하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]의 자산운용사인 하이자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '한국외환은행'의 확인을 받아 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드자산보관자(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 하이자산운용 http://www.hi-am.com / 02-727-2700
금융투자협회 http://dis.fundservice.net

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

위험등급 : 3등급

펀드명칭	금융투자협회 펀드코드
하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]	A0746
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합A	A0747
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합C	A0748
하이중소형주플러스30증권자투자신탁1호채권혼합C-E	A0749

펀드의 종류	투자신탁/증권(혼합채권)/추가형/개방형/종류형/모자형	최초설정일	2011-02-28
운용기간	3개월(2011-11-28 ~ 2012-02-27)	존속기간	추가형
자산운용사	하이자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	한국외환은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	하이투자증권 삼성증권 골든브릿지증권		
상품의 특징	- 모자형구조의 자투자신탁으로서 국내채권에 주로 투자하는 채권형 모투자신탁을 주된 투자대상자산으로 하여 투자신탁 자산총액의 60% 이상 투자하고, 성장성이 높은 저평가 우량 중소형 종목에 투자하는 주식형 모투자신탁에 30% 이하를 투자하여 안정적인 이자소득을 바탕으로 추가적 자본차익을 추구하는 것으로서 비교지수 대비 초과수익을 추구 - 비교지수 : KOBI120 73% + [KOSPI 30% + 중형주 60% + 소형주 5% + CD 5%] 27%		

☞ 위험등급 : 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 1등급(매우 높은 위험) 부터 5등급(매우 낮은 위험) 까지 투자위험 등급을 5단계로 분류함.
☞ 1등급 - 매우 높은 위험, 2등급 - 높은 위험, 3등급 - 중간 위험, 4등급 - 낮은 위험, 5등급 - 매우 낮은 위험

▶ 펀드 구성

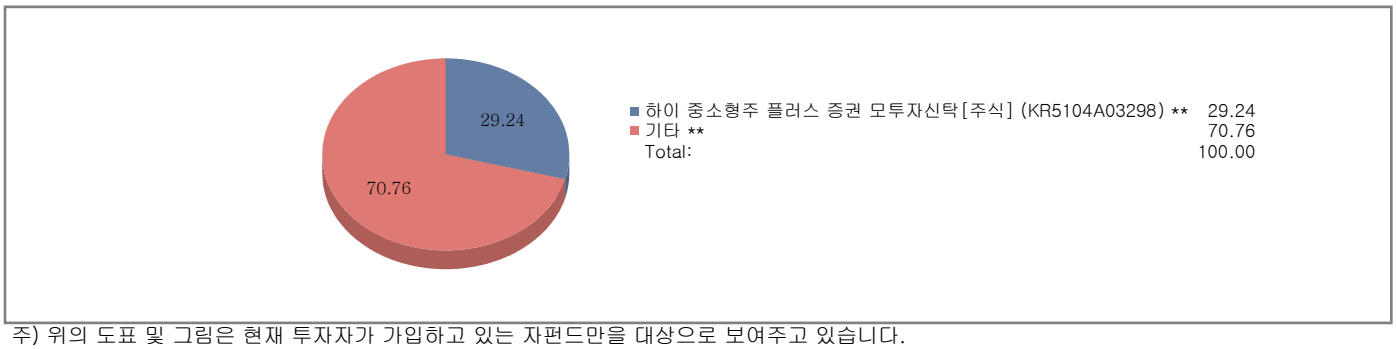
주된 투자대상

실제투자

모펀드	비중 (%)*
하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (KR5104A03298) **	0.34

수익증권 매입

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]



주) 위의 도표 및 그림은 현재 투자자가 가입하고 있는 자펀드만을 대상으로 보여주고 있습니다.
* 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비중을 나타냅니다.
** 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을 때 각 모펀드의 집합투자증권을 얼마만큼 투자하고 있는지를 보여줍니다.

수익증권 매입

종류형 펀드	종류(Class)별	A	B	C	D	E	F	H	I	P	W	J	기타
	비중(%)***	34.59	-	65.36	-	0.05	-	-	-	-	-	-	-

*** 자펀드에 편입되어 있는 각 종류(Class)별 구성비중을 나타낸 수치입니다.

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]	전기말	당기말	증감률
자산 총액	2,052,061,462	2,086,057,959	1.66
부채 총액	107,589	107,890	0.28
순자산총액	2,051,953,873	2,085,950,069	1.66
기준가격	1,003.29	1,020.19	1.68

(단위 : 원, 좌/주, %)

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]	전기말	당기말	증감률
자산 총액	195,188,404,416	195,697,460,712	0.26
부채 총액	3,252,846,824	14,257,820,905	338.32
순자산총액	191,935,557,592	181,439,639,807	-5.47
기준가격	855.83	882.22	3.08

(단위 : %)

종류(Class)별 기준가격 현황	전기말	당기말	증감률
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합A	995.98	1,010.25	1.43
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합C	994.39	1,007.63	1.33
하이중소형주플러스30증권자투자신탁1호채권혼합C-E	956.65	970.04	1.40

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.

주) 위 당기말 기준가격은 결산부기준가격이며, 재투자기준가격은 클래스 A(1000.00) 클래스 C(1000.00) 클래스 C-E(970.04) 입니다.

※ 분배금내역 (단위 : 백만원, 좌)

분배금 기준일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2012-02-27	0	2,044,668,428	1,020.19	1,020.19	하이중소플30자1[채혼
2012-02-27	7	712,381,397	1,010.25	1,000.00	하이중소플30자1채혼A
2012-02-27	10	1,348,432,543	1,007.63	1,000.00	하이중소플30자1채혼C
2012-02-27	0	1,055,283	970.04	970.04	하이중플30자1채혼C-E

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

<주식부문>
- 11월 말 미국의 양호한 경제지표와 함께 중국의 지준율 인하, 유로화와 달러간 통화스왑이 결정되었습니다. 이에 따라 글로벌 정책공조에 대한 기대감이 높아지며, 12/1 지수는 큰폭 상승하며 시작하였습니다. 그러나, 12월 시장은 뚜렷한 모멘텀 없이 흘러내리는 모습을 보였습니다. 예상치 못한 김정일 위원장의 사망으로 원/달러 환율이 급등하고 투자심리가 위축되면서 KOSPI는 1770포인트까지 밀렸으나, 대북 관련 리스크 영향은 기존과 마찬가지로 제한적이었습니다. 12월 업종별로는 건설, IT, 음식료, 전기가스, 증권, 의약품 업종의 수익률이 우수하였고, 은행, 서비스업, 화학, 철강, 운수장비, 운수창고, 보험 업종이 부진하였습니다. 1월 코스피는 1)ECB의 LTRO(3년만기 자금을 1%금리로 공급)를 통한 유동성 공급과 유로지역 금융 신용경색 완화, 2)예상을 상회한 중국의 4분기 GDP로 경기 경착륙 우려가 완화되면서 크게 상승하였습니다. 글로벌 금융시장에서 위험자산에 대한 선호현상이 촉발되면서, 외국인 매수세도 큰폭으로 유입되었습니다. 업종별로는 삼성전자를 제외한 IT, 정유화학, 철강중심의 소재, 기계조선과 운송이 포함된 산업재, 그리고 은행과 증권업종 등 금융주가 강세를 보였으며 자동차, 음식료, 통신, 유틸리티등이 약세를 보였습니다. 2월은 국내 거시 경제지표 부진에도 불구하고 미국 주택 및 고용지표의 개선 및 유럽재정위기의 완화, 엘피다의 파산 등 해외발 호재와 함께 외국인 매수의 지속으로 KOSPI지수가 3% 넘는 상승세를 이어갔습니다. 업종별로는 조선, 기계, IT, 운송, 정유 등 소재 및 산업재, 반도체 관련주의 상승세가 두드러졌습니다. 방어적 성격을 가진 유틸리티, 통신, 제약 등은 약세를 보였습니다. 동 펀드는 금융, 철강, 건설업종에서 수익률이 양호하였으나, 운수장비, 화학, 서비스업에서 수익률이 부진하여 BM대비 부진한 수익률을 시현하였습니다.

<채권 부문>
- 11월 채권시장은 전강후약의 흐름을 보였습니다. 월초 호주와 ECB가 기준금리를 인하하는 등 글로벌 통화 완화 기조 분위기 속에 국내 기준금리 인하에 대한 기대감이 상승하였고, 이탈리아 국채 금리가 7%를 넘나드는 등 유럽 재정 위기 지속의 영향으로 금리는 하락세를 나타냈습니다. 그러나 11월 금통위 결과 조기 금리인하 기대감이 줄어들었고, 환율 상승과 외국인 자금 이탈 루머 등의 영향으로 금리가 상승 전환하였습니다. 월말에는 카자흐스탄 중앙은행의 채권매수 소식으로 금리 상승분을 일부 되돌리며 전월대비 하락 마감하였습니다. 장단기 스프레드는 소폭 확대되었고, 신용스프레드는 축소되는 모습을 보였습니다.
- 12월 채권시장은 만기별로 등락이 엇갈리는 모습을 보였습니다. 월초 채권 금리는 유럽 재정 위기 이슈로 인해 하락 출발하였으나, 월 중반 김정일 사망 소식으로 급등세를 나타내었습니다. 이후 국내 기관의 저가매수세 유입으로 채권금리는 점차 상승폭을 축소하였고, 월말 외국인들이 대규모 국채선물 순매수에 나서면서 채권금리는 중기물 위주로 하락 마감하였습니다. 수익률 곡선에서는 MMF 자금 유출의 영향으로 단기물이 약세를 보였고, 중기물은 강세, 장기물은 장기투자기관의 소극적인 매수로 약세를 보였습니다. 신용 스프레드는 공사채를 제외한 전 섹터에 걸쳐 확대되는 모습을 보였습니다.
- 1월 채권시장은 좁은 박스권에서 횡보하며 만기별로 등락이 엇갈리는 모습을 보였습니다. 월초 금통위를 앞두고 지준율 인상 가능성이 대두되어 금리 상승흐름을 보였으나, 금통위에서 성장의 하방위험을 강조하며 7개월 연속 금리를 동결하였고 금통위 이후 금리 상승폭은 축소되었습니다. 연말 빠져나갔던 MMF자금이 재유입되고 설연휴를 앞두고 단기물에 대한 수요가 높았으며, 장기투자기관의 매수세 유입과 국내 경기지표 둔화의 영향으로 장기물에 대한 수요도 높아 단기물과 장기물이 강세를 보였습니다. 신용스프레드는 전 섹터에 걸쳐 축소되었으며 특히 2년이하 중단기물의 강세가 두드러지는 모습을 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

<주식부문>
- 연초이후 KOSPI가 10% 이상 오르며 향후 주가향방에 대한 고민은 커지고 있는 상황입니다. 1) 중국의 양회가 시작되면서 긴축완화 및 경기부양책 기대감, 2) 미국의 경기회복 기대감, 3) 일본, ECB 등 유동성 완화조치에 따른 글로벌 유동성 지속, 4) EU 정상회의에서 신재정 협약 체결 기대 등 긍정적인 요인에도 불구하고, 1) PIGS 대규모 채권만기 롤오버, 2) 외국인 매수 강도 약화 가능성 및 주식형 펀드 환매 지속, 3) 신재정협약 과정에서 유럽권 국가들의 갈등, 4) 이란발 지정학적 리스크 부각에 따른 유가상승의 리스크 요인들이 남아 있습니다. 1~2월의 상승세가 가팔랐던 만큼 3월의 상승세는 완만해질 것으로 예상하고 있습니다. 다만, 풍부한 글로벌 유동성이 유지되고 있어, 당분간 상승세는 유지될 것으로 예상합니다. 1~2월 동안 진행한 포트폴리오 리밸런싱은 거의 진행되었으며, IT와 기계, 화학, 철강 등 경기민감주의 비중확대를 유지할 계획입니다. 내수 및 금융주에서는 개별 경쟁력이 있거나, 니치 시장에서 선전하고 있는 업체 중심으로 종목을 선별해서 보유할 계획입니다.

<채권 부문>
- 2월 채권시장은 전월에 이어 좁은 박스권내에서 횡보하는 흐름을 보일 전망입니다. 미국의 경제지표 호조가 지속되고 있고 유로존 협상 타결에 대한 기대가 높아지면서 위험 자산 선호현상으로 채권금리는 단기적으로 약세를 보일 것으로 예상됩니다. 그러나 유로존 문제가 완전히 해결되기에는 시간이 많이 소요될 것으로 보여 여전히 변동성이 적은 흐름을 보일 것으로 예상되며, 금리가 박스권 상단을 돌파하면 매수세가 유입되어 재차 반락하는 장세가 전망됩니다. 장단기 스프레드는 소폭 축소될 것으로 전망되며 신용스프레드는 우량 회사채를 중심으로 소폭 축소될 것으로 전망됩니다.
- 2월에는 제한된 범위내의 듀레이션 조정과 섹터비중 조정을 시행할 예정입니다. 마찰적 요인으로 금리 상승시에는 재차 매수세 유입에 따른 금리하락이 예상되므로, 금리상승시마다 중장기물 비중을 확대하여 듀레이션을 늘리고 금리하락시에 이익을 실현하는 전략을 구사할 예정입니다. 저평가된 신용물을 발굴할 경우에는 통안채 등 무위험채를 매도하여 신용물 비중을 확대할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]	0.56	1.68	1.42	-1.80	2.02
하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]	1.18	3.08	-1.28	-15.79	-6.87
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합A	0.48	1.43	0.92	-2.53	1.03
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합C	0.45	1.33	0.71	-2.84	0.76
하이중소형주플러스30증권자투자신탁1호채권혼합C-E	0.47	1.40	0.86	-2.62	-
비교지수	0.73	3.24	3.11	2.07	4.49

비교지수(Bench Mark) = KOBI120 73% + [KOSPI 30% + 중형주 60% + 소형주 5% + CD 5%] 27% ☜자펀드 기준의 비교지수입니다.

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

▶ 연평균 수익률

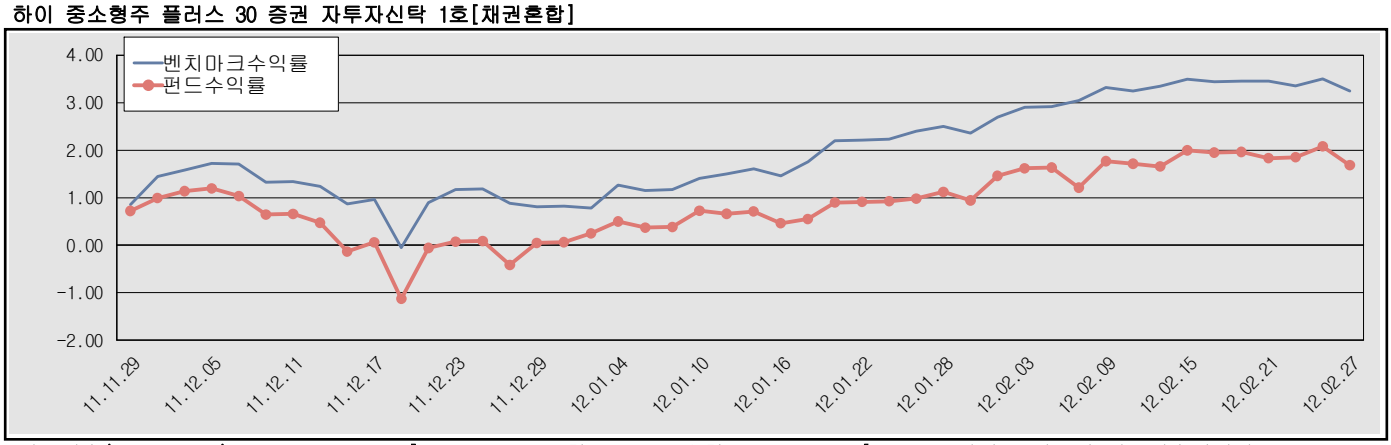
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]	2.02	-	-	-
하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]	-6.87	-	-	-
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합A	1.03	-	-	-
하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합C	0.76	-	-	-
하이중소형주플러스30증권자투자신탁1호채권혼합C-E	-	-	-	-
비교지수	4.49	-	-	-

비교지수(Bench Mark) = KOBI120 73% + [KOSPI 30% + 중형주 60% + 소형주 5% + CD 5%] 27% ☜자펀드 기준의 비교지수입니다.

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

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]



비교지수(Bench Mark) = KOBI120 73% + [KOSPI 30% + 중형주 60% + 소형주 5% + CD 5%] 27% ☜자펀드 기준의 비교지수입니다.

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

▶ 손익현황

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합] (단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	-	-	-	34	-	-	-	-	-	1	0	35
전기손익	-	-	-	-7	-	-	-	-	-	1	0	-6

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	5,082	-	1	66	-	-	-	-	-	52	942	6,143
전기손익	-8,087	-	-	-	-	-	-	-	-	65	-361	-8,383

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합] (단위 : 백만원, %)

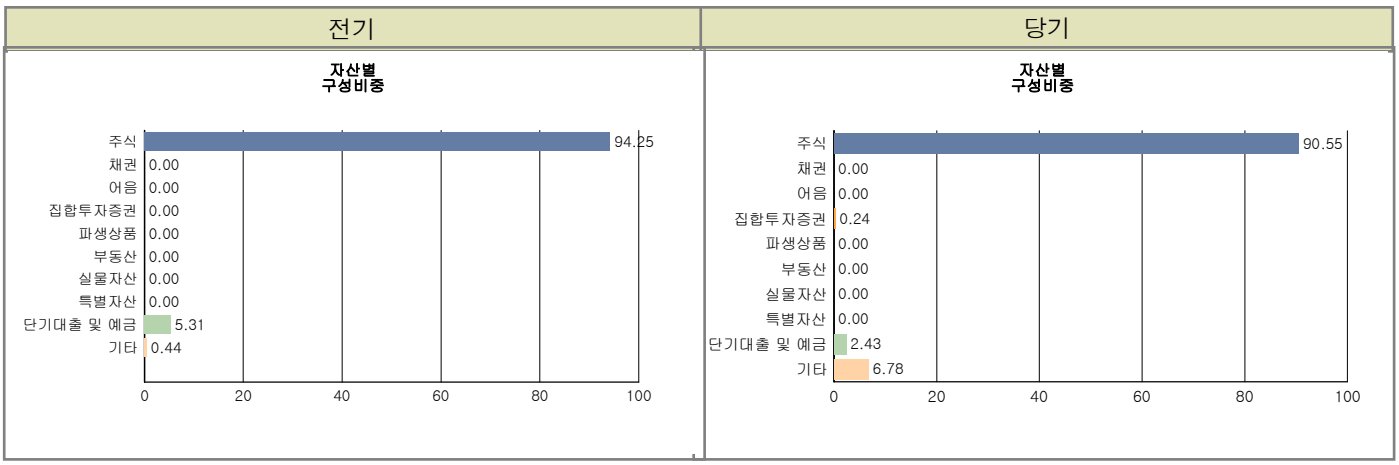
통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	-	-	-	1,981 (94.94)	-	-	-	-	-	106 (5.06)	-	2,086 (100.00)
합계	-	-	-	1,981 (94.94)	-	-	-	-	-	106 (5.06)	-	2,086 (100.00)

※ ( )내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	177,198 (90.55)	-	-	466 (0.24)	-	-	-	-	-	4,758 (2.43)	13,276 (6.78)	195,697 (100.00)
합계	177,198 (90.55)	-	-	466 (0.24)	-	-	-	-	-	4,758 (2.43)	13,276 (6.78)	195,697 (100.00)

※ ( )내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.



주) 위 자산구성 그래프는 모펀드 기준의 구성현황 입니다.

▶ 업종별,국가별 투자비중

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]

주식투자 상위 10종목

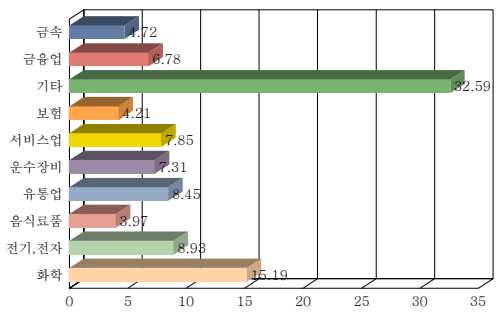
종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
삼성전자	4.36	하이닉스	3.91
에스엠	3.09	LG화학	3.01
태광	2.79	CJ제일제당	2.77
GS리테일	2.63	기아차	2.36
호텔신라	2.30	SK C&C	2.29

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]

업종별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
화학	15.19	전기,전자	8.93
유통업	8.45	서비스업	7.85
운수장비	7.31	금융업	6.78
금속	4.72	보험	4.21
음식료품	3.97	기타	32.59

[업종별 투자비중]



주1) 기준일 현재 펀드에 편입되어 있는 주식의 업종별 비율을 나타냅니다.
주2) 위 업종구분은 한국증권거래소의 업종구분에 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	주식	삼성전자	3.95	2	주식	하이닉스	3.54
3	주식	에스엠	2.80	4	주식	LG화학	2.73
5	주식	태광	2.53	6	주식	CJ제일제당	2.51
7	단기대출및예금	예금	2.43	8	주식	GS리테일	2.38
9	주식	기아차	2.14	10	주식	호텔신라	2.08

* 보다 상세한 투자대상자산 내역은 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

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	6,594	7,721,574,000	4.36
하이닉스	248,180	6,936,631,000	3.91
에스엠	101,183	5,484,118,600	3.09
LG화학	13,730	5,340,970,000	3.01
태광	168,140	4,951,723,000	2.79

※ 비중 : 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

■ 총 발행수량의 1% 초과 종목

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]

종목	보유수량	평가금액	비중 ※	비 고
디아이씨	519,240	3,598,333,200	2.03	2.39
코스맥스	202,520	3,220,068,000	1.82	1.49
이노와이어	80,109	2,158,937,550	1.22	1.33
화승알앤에이	117,060	1,849,548,000	1.04	1.81
IHQ	419,010	1,277,980,500	0.72	1.02
원익쿼츠	134,003	1,098,824,600	0.62	1.06

※ 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

해당사항 없음

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

■ 상위 5개 종목

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합] (단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
하이 굿초이스증권 모	수익증권	하이자산운용	1,370,672,775	1,370,672,775	2011-03-02	0.00
하이중소플러증모[주]	수익증권	하이자산운용	609,851,630	609,851,630	2011-03-02	0.34

※ 비중 : 자펀드가 해당 모펀드에서 차지하는 비중

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : 원)

종 목	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	취득일	비 중
하이Q트리플증1[주]CF	수익증권	하이자산운용	449,096,000	465,632,000	2011-12-20	100.00

※ 비중 : 보유한 전체 집합투자증권 중 해당 수익증권이 차지하는 비중

▶ 장내파생상품

해당사항 없음

▶ 장외파생상품

해당사항 없음

▶ 부동산(임대)

해당사항 없음

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

해당사항 없음

▶ 특별자산

해당사항 없음

▶ 단기대출 및 예금

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	한국외환은행		105,533,554	2.76		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	기업은행		4,757,929,539	2.76		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	11,656,334,598	

주) 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성 명	운용개시일	직위	운용중인 다른 펀드 현황		주요 경력 및 운용내역(최근5년)	협회등록번호
			펀드 수	운용 규모		
임은미		부장 73xxxx-xxxxxxx	10	198,130	서울대학교 소비자경제학 피데스증권 리서치센터 애널리스트 현) 하이자산운용 주식운용2팀	2109000861

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합]

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	-	-	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	-	-	
일반사무관리회사	-	-	-	-	
보수 합계	-	-	-	-	
기타비용**	-0	-0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식]

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	-	-	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	-	-	
일반사무관리회사	-	-	-	-	
보수 합계	-	-	-	-	
기타비용**	1	0.00	1	0.00	
매매/중개수수료	318	0.16	537	0.28	

하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합A

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	1	0.10	1	0.10	
판매회사	1	0.14	1	0.14	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	2	0.25	2	0.25	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합C (단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	1	0.10	1	0.10	
판매회사	3	0.24	3	0.24	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	5	0.35	5	0.35	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

하이중소형주플러스30증권자투자신탁1호채권혼합C-E (단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	0	0.09	0	0.09	
판매회사	0	0.18	0	0.19	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	-	-	
일반사무관리회사	-	-	-	-	
보수 합계	0	0.28	0	0.28	
기타비용**	-	-	-	-	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

* 펀드의 순자산평잔 대비 비율
** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적/반복적으로 지출된 비용으로서 매매/중개수수료는 제외한 것입니다.

▶ 총보수비용 비율

하이 중소형주 플러스 30 증권 자투자신탁 1호[채권혼합] (단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	0.00	0.01	0.19
당기	0.00	0.00	0.01	0.33

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	0.64	0.00	0.64
당기	0.00	1.10	0.00	1.10

하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합A (단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.99	0.00	1.00	0.19
당기	0.99	0.00	1.00	0.33

하이중소형주플러스30증권 자투자신탁1호 채권혼합C (단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.39	0.00	1.40	0.19
당기	1.39	0.00	1.40	0.33

하이중소형주플러스30증권자투자신탁1호채권혼합C-E (단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.09	0.00	1.10	0.20
당기	1.13	0.00	1.13	0.35

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio) 이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔(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 회전율

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
5,987,092	212,338,929,735	8,574,647	225,535,345,707	121.39	486.90

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율.
※ 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

하이 중소형주 플러스 증권 모투자신탁[주식] (단위 : %)

2011-11-28 ~ 2012-02-27	2011-08-28 ~ 2011-11-27	2011-05-28 ~ 2011-08-27
121.39	65.58	112.97

자산보관.관리보고서

이 보고서는 집합투자재산을 보관.관리하는 신탁업자가 집합투자재산이 적정하게 운용되었는지 여부 등에 관하여 확인한 내용을 투자자에게 제공하기 위해 <자본시장과 금융투자업에 관한 법률> 제248조 제1항에 따라 작성되었습니다.

신탁업자명 : (주)한국외환은행 증권수탁부

1. 집합투자기구의 개요

가. 집합투자기구 명칭 : **하이 중소형주 플러스 30증권 자투자신탁 1호[채권혼합]**
(Class A, C, C-E)
나. 분류 : 증권 집합투자기구
다. 보관.관리기간 : 2011.02.28 ~ 2012.02.27
라. 집합투자업자 : 하이자산운용㈜
마. 투자매매업자.투자중개업자 : 하이투자증권㈜,삼성증권㈜,골든브릿지증권㈜

2. 집합투자규약의 주요 변경사항

- 해당기간중 집합투자규약의 변경이 없었습니다.

3. 투자운용인력의 변경

- 해당기간중 신탁회사가 통보받거나 하이자산운용㈜이 수시공시한 운용전문인력의 변경이 없었습니다

4. 집합투자자총회의 결의내용

- 해당기간중 신탁회사가 통보받거나 하이자산운용㈜이 수시공시한 의결내용이 없습니다.

5. 이해관계인과의 거래의 적격여부를 확인한 경우의 그 내용

- 해당기간중 신탁회사가 통보받은 이해관계인과의 거래가 없습니다.

6. 회계감사인의 선임.교체.해임에 관한 사항

변경전				변경일	변경후			
회계 감사인	계약 기간	감사 보수	계약 방법		회계 감사인	계약 기간	감사 보수	계약 방법
해당사항 없음								

7. 법 제247조 제5항 각 호의 사항 확인

□ 투자설명서가 법령 및 집합투자규약에 부합하는지의 여부
- 법 제247조 제5항 제1호에 의거 투자설명서가 법령 및 집합투자규약에 부합함을 확인하였습니다

□ 자산운용보고서의 작성이 적정한지 여부
- 법 제247조 제5항 제2호에 의거 자산운용보고서가 적정하게 작성되었음을 확인하였습니다

□ 위험관리방법의 작성이 적정한지 여부
- 장외파생상품을 법에서 정한 한도(10%) 이상 편입하지 않았기 때문에 해당사항이 없습니다

□ 집합투자재산의 평가가 공정한지의 여부
- 집합투자재산평가위원회의 의결사항을 통보받은 범위내에서 공정하지 않다고 판단해야 할 내용을 찾지 못했습니다.

□ 집합투자재산의 평가결과에 따라 기준가격이 적정하게 산출되었는지의 여부
- 해당기간중 기준가격의 편차가 시행규칙 제24조 제2항에서 규정한 1,000분의 3을 넘는 경우를 발견하지 못했습니다.

□ 집합투자업자의 운용지시가 법,집합투자규약 또는 투자설명서에 위반된 경우 신탁업자 또는 투자회사 감독이사의 시정요구 및 이에 대한 집합투자업자의 이행명세
- 해당기간중 법령 및 집합투자규약상 위반내역을 발견하지 못했습니다.

□ 집합투자증권의 추가발행시 기존 투자자의 이익을 해칠 염려가 없는지 여부
- 환매금지형 집합투자기구가 아니기 때문에 해당사항이 없습니다.

□ 집합투자재산별로 미리 정해진 자산배분명세에 따라 매매결과가 공정하게 배분되었는지의 여부
- 신탁회사가 직접 감시업무를 수행하기 곤란한 사항으로, 집합투자업자가 2개 이상의 신탁회사와 거래할 경우에는 신탁회사의 감시의무 대상에서 제외되었습니다.

8. 그 밖에 투자자 보호에 필요한 사항

- 이 투자신탁은 2011.12.21일자로 수익증권 평가 오류 사유로 기준가격 오류수정이 있었습니다.
- 이 투자신탁의 운용 및 투자에 관한 보다 자세한 사항은 해당 집합투자업자의 홈페이지를 이용하시기 바랍니다.