# 자산운용보고서

보고서 기준일 : 2026년 06월 07일

펀드코드 : 44521

# 하나 블루칩바스켓 증권자투자신탁(V-1호) [주식]

하나자산운용

하나자산운용

# 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]

## 1. 펀드의 개요

### ▶ 기본정보

| 펀드명 | 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식] |
|---|---|
| 투자위험등급 | 2등급 |
| 고난도펀드 | 해당하지 않음 |
| 금융투자협회펀드코드 | 33862 |
| 펀드의 종류 | 투자신탁,증권펀드(주식형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형 |
| 보고대상 운용기간 | 2026.03.08 ~ 2026.06.07 |
| 신탁업자 | 우리은행 |
| 최초설정일 | 2002.03.08 |
| 존속기간 | 설정일~신탁계약의 해지일 |
| 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 판매회사 | KB증권,NH농협은행,SC제일은행,교보증권,국민은행,대신증권,미래에셋증권,부산은행,삼성증권,신한은행,아이엠뱅크(구.대구은행),우리은행,우리투자증권,하나은행,하나증권,한국투자증권,한화투자증권 |
| 레버리지(차입 등) 한도[1] | |
| 상품의 특징 | 이 투자신탁은 국내주식을 법 시행령 제94조제2항4호에서 규정하는 주된 투자대상으로 하여 주식시장 상승에 따른 자본소득을 추구하는 한편, 잔여 신탁재산으로 채권 및 유동성자산에 투자하여 안정적인 이자수익을 추구하는 상품입니다.<br>그러나 이 투자신탁의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 집합투자자·판매회사·신탁업자 등 이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 수익자에 대해 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다. |

| 펀드가 발행하는 집합투자증권의 종류 | 종류(클래스) | 금융투자협회펀드코드 |
|---|---|---|
| | ClassA | 89731 |
| | ClassA-E | BC973 |
| | ClassC-E | 89734 |
| | ClassC-P | BC975 |
| | ClassC1 | 89732 |
| | ClassC2 | 96187 |
| | ClassC5 | 96190 |
| | ClassS | BC974 |
| | ClassS-P2 | D4931 |

[1]레버리지(차입 등) 한도의 경우, 일반 사모집합투자기구에 한하여 작성

### ▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 백만원)

| 성명 | 직위 | 나이 | 운용중인 펀드현황 | | 성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모 | | 협회 등록 번호 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 펀드개수 | 운용규모 | 펀드개수 | 운용규모 | |
| 문예지(책임) | 차장 | 39 | 12 | 44,298 | 0 | 0 | 2120001130 |

※ 성명 뒤 (책임)으로 표시된 운용역이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.
※ 모자형 투자신탁이나 종류형투자신탁의 경우에는, 펀드개수 및 운용규모를 운용펀드 단위로 집계한 수치입니다.

### ▶ 운용전문인력 변경내역

| 기간 | 운용전문인력 |
|---|---|
| 2025.02.12 ~ 현재[주] | 문예지 |
| 2024.06.13 ~ 2025.02.11[주] | 김정표 |
| 2015.06.30~2024.06.12 [주] | 홍성수 |

※ 펀드의 운용전문인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 페이지에서 확인할 수 있습니다. (인터넷 주소 http://dis.kofia.or.kr) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이 할 수 있습니다.

### ▶ 운용경과

증시는 반도체 위주로 가파르게 상승하면서 코스피가 지수기준 40% 가까이 상승하는 초강세장을 보였으며 증시 부양을 위한 정부의 상법개정과 코스닥 부양을 위한 개선 방안 등 정책이 더해지며 전반적으로 강한 장을 보였음. 로봇, AI, 반도체 업황 호조에 더불어 전력 부족을 타개하기위한 인프라 및 신재생 투자까지 기대감을 보이며 상승하였고 동 펀드 역시 높은 반도체 및 전력기기 관련 종목 보유와 코스닥 시총 상위 종목 익스포저로 지수대비 양호한 성과를 거두었음

### ▶ 투자환경 및 운용 계획

버블랠리 후반부, 주도주 쏠림 지속이익 견조 업종 중심 압축 전망. 반도체에 대한 긍정적 뷰는 아직 유지하고 있음. 1)메모리 캐파 증설에 대한 발표가 있었지만 실제로 시장에 공급되는 시점은 27년 후반쯤으로 공급 병목은 유지되는 점, 2) AI CAPEX 규모와 그를 위한 자금 조달에 영향을 미치는 금리 수준이 최근 안정을 찾고 있고 미국 기준 금리 인상 기대가 오히려 완화되고 있는 점, 3) AIDC overcapacity에 대한 우려를 불러왔던 메타의 데이터센터 임대가 엔트로픽 향이 될 수 있다는 기사가 나오는 등 컴퓨팅 용량의 잉여에 대한 우려가 일단락 된 점, 4) 3분기 반도체 ASP도 두자리수대 상승 전망 나오고 있는 점 등 감안하면 펀더멘탈 적으로는 현재 주도 섹터에 대한 비중을 줄여야 할만한 포인트가 보이지 않고 있어 비중을 유지할 계획.

## 2. 수익률 현황

### ▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 블루칩바스켓증권모투자신탁[주식] | 52.94 | 117.87 | 188.05 | 230.36 | 227.09 | 254.47 | - |
| 비교지수대비 성과 | 6.82 | 18.83 | 33.44 | 40.16 | 28.18 | 31.03 | - |
| 블루칩바스켓지V1[주식] | 52.47 | 116.44 | 185.23 | 225.96 | 218.33 | 239.97 | 162.40 |
| 비교지수대비 성과 | 6.35 | 17.41 | 30.62 | 35.76 | 19.42 | 16.54 | 6.17 |
| | 종류(Class)별 현황 | | | | | | |
| ClassA | 52.46 | 116.42 | 185.16 | 225.83 | 218.00 | 239.47 | 161.91 |
| 비교지수대비 성과 | 6.34 | 17.39 | 30.55 | 35.63 | 19.10 | 16.03 | 5.69 |
| ClassA-E | 52.61 | 116.85 | 186.05 | 227.24 | 221.02 | 244.38 | 168.40 |
| 비교지수대비 성과 | 6.49 | 17.81 | 31.44 | 37.04 | 22.11 | 20.95 | 12.18 |
| ClassC-E | 52.38 | 116.19 | 184.71 | 225.14 | 216.62 | 237.27 | 159.07 |
| 비교지수대비 성과 | 6.26 | 17.15 | 30.10 | 34.94 | 17.72 | 13.83 | 2.85 |
| ClassC-P | 52.59 | 116.77 | 185.89 | 226.98 | 220.44 | 243.44 | 167.15 |
| 비교지수대비 성과 | 6.47 | 17.74 | 31.28 | 36.78 | 21.54 | 20.00 | 10.93 |
| ClassC1 | 52.31 | 115.95 | 184.22 | 224.35 | 209.04 | 224.21 | 128.31 |
| 비교지수대비 성과 | 6.19 | 16.91 | 29.61 | 34.15 | 15.95 | 13.39 | 4.42 |

# 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]

| | 종류(Class)별 현황 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ClassC2 | 52.35 | 116.10 | 184.50 | 200.40 | 200.40 | 208.99 | 138.10 |
| 비교지수대비성과 | 6.23 | 17.06 | 29.89 | 29.69 | 29.69 | 25.52 | 10.90 |
| ClassC5 | 52.46 | 116.42 | 185.16 | 225.83 | 218.00 | 239.47 | 161.92 |
| 비교지수대비성과 | 6.35 | 17.39 | 30.55 | 35.63 | 19.10 | 16.03 | 5.70 |
| ClassS | 52.69 | 117.08 | 186.50 | 227.95 | 222.48 | 246.77 | 171.54 |
| 비교지수대비성과 | 6.57 | 18.04 | 31.89 | 37.75 | 23.58 | 23.33 | 15.32 |
| ClassS-P2 | 52.71 | 117.16 | 186.68 | 228.23 | 223.09 | 247.75 | 172.85 |
| 비교지수대비성과 | 6.60 | 18.12 | 32.06 | 38.02 | 24.18 | 24.31 | 16.63 |
| | CDSC 적용펀드 통합 수익률 | | | | | | |
| 블루칩바스켓자V1[주식]C_통합 | 52.44 | 116.37 | 185.07 | 224.81 | 217.03 | 236.11 | 148.97 |
| 비교지수대비성과 | 6.32 | 17.34 | 30.46 | 34.61 | 18.12 | 12.68 | -7.25 |
| 비교지수(벤치마크)[1] | 46.12 | 99.04 | 154.61 | 190.20 | 198.91 | 223.44 | 156.22 |

가. 비교지수(벤치마크) : KOSPI X 100%

나. 벤치마크 변경내용 및 사유 : 해당사항 없음

※ 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.
※ 클래스 펀드의 경우는 최종 설정된 일자를 기준으로 해당 운용기간의 수익률을 계산합니다.
※ C Class의 경우 (C1, C2, C3, C4, C5) 가입기간에 따라 판매보수가 감소하는 체감식 보수체계(CDSC) 적용함에 따라 본 보고서에 표기된 수익률은 개별 투자자의 수익률과 차이가 발생할 수 있으므로, 개별 투자자의 정확한 수익률은 가입하신 판매회사를 통하여 확인하시기 바랍니다.

## 손익현황

(단위: 백만원)

| 구 분 | | 전기 | 당기 |
|---|---|---|---|
| 증권 | 주식 | 17,898 | 31,740 |
| | 채권 | 0 | 0 |
| | 어음 | 3 | 3 |
| | 집합투자기구 | 230 | 281 |
| 파생상품 | 장내 | 0 | 0 |
| | 장외 | 0 | 0 |
| 부동산 | | 0 | 0 |
| 특별자산 | 실물자산 | 0 | 0 |
| | 기타 | 0 | 0 |
| 단기대출 및 예금 | | 3 | 4 |
| 기타 | | 52 | 13 |
| 손익합계 | | 18,185 | 32,041 |

※ 모자형의 경우 전기와 당기의 손익은 모펀드를 기준으로 작성합니다.

## 3. 자산 현황

### 재산현황

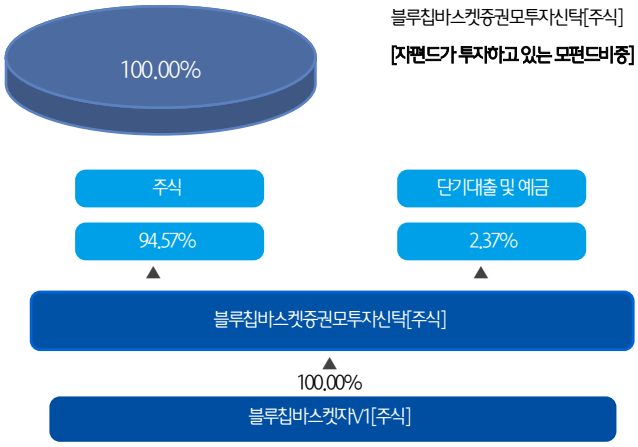
(단위 : 원, 좌, %)

| 구분 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|---|---|---|---|---|
| 블루칩바스켓증권모투자신탁[주식] | 자산총액(A) | 71,598,838,086 | 104,141,426,507 | 45.45 |
| | 부채총액(B) | 4,594,153,763 | 3,677,418,461 | -19.95 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 67,004,684,323 | 100,464,008,046 | 49.94 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 31,446,490,640 | 31,164,072,495 | -0.90 |
| | 기준가격 [1] (E=C/Dx1000) | 2,130.75 | 3,223.71 | 52.94 |
| 블루칩바스켓자V1[주식] | 자산총액(A) | 61,769,100,112 | 92,458,546,360 | 49.68 |
| | 부채총액(B) | 387,707,132 | 302,612,377 | -21.95 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 61,381,392,980 | 92,155,933,983 | 50.14 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 21,743,655,893 | 21,348,065,459 | -1.82 |
| | 기준가격 [1] (E=C/Dx1000) | 2,822.96 | 4,316.83 | 52.47 |
| | 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | |
| ClassA | 기준가격 | 2,751.40 | 4,194.91 | 52.46 |
| ClassA-E | 기준가격 | 2,793.04 | 4,262.51 | 52.61 |
| ClassC-E | 기준가격 | 2,527.83 | 3,851.93 | 52.38 |
| ClassC-P | 기준가격 | 2,789.81 | 4,256.89 | 52.59 |
| ClassC1 | 기준가격 | 2,029.02 | 3,090.43 | 52.31 |
| ClassC2 | 기준가격 | 1,971.78 | 3,004.03 | 52.35 |
| ClassC5 | 기준가격 | 2,772.82 | 4,227.57 | 52.46 |
| ClassS | 기준가격 | 2,798.01 | 4,272.19 | 52.69 |
| ClassS-P2 | 기준가격 | 2,639.97 | 4,021.64 | 52.71 |

1) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령시에 적용하는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행한 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다. 기준가격 증감률 부분은 당기 수익률을 표시합니다.

# 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]

## 펀드 구성




## 펀드의 투자전략

### 가. 투자전략

국내주식 중 산업별 업종대표주식 및 시가총액 50위 이내의 대형 우량주식을 주된 투자대상자산으로 하여 주식시장 상승에 따른 자본소득을 추구하는 한편, 잔여 신탁재산으로 채권 및 유동성자산에 투자하여 안정적인 이자수익을 추구하는 전략을 실행합니다.

-업종대표주 및 블루칩 위주의 장기투자
-포트폴리오 운용전략에 주력
-Bottom-up Approach 에 중심을 둔 운용추구
-필요 시 시장테마 등에 대응한 단기매매도 병행
* 비교지수 : KOSPI 100%

### 나. 위험관리

조직적 리스크관리로 펀드 손실 가능성 최소화 추구
- 리서치팀과의 연계 강화로 매니저 독자판단에 따른 오류 가능성 최소화 추구
- Risk Control 팀, 컴플라이언스팀 등 전담조직에 의한 체계적 펀드 위험 관리

### 다. 수익구조

이 투자신탁은 국내 주식에 주로 투자하는 집합투자기구로서, 주식시장의 가격변동에 따라 주된 이익 또는 손실이 결정됩니다. 그러나, 상기의 투자전략 등이 반드시 달성된다는 보장은 없습니다.

### 라. 추가내용

해당사항 없음

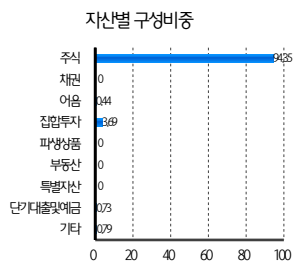
## 자산구성현황

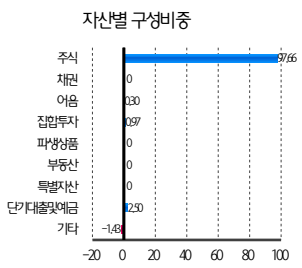
(단위 : 백만원, %)

| 통화별구분 / 환율 | 증 권 | | | | 파생상품 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 |
| KRW | 90,297 | 0 | 276 | 900 | 0 | 0 |
| 1.00 | (97.66) | (0.00) | (0.30) | (0.97) | (0.00) | (0.00) |
| 합 계 | 90,297 | 0 | 276 | 900 | 0 | 0 |

| 통화별구분 / 환율 | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 실물자산 | 기타 | | | |
| KRW | 0 | 0 | 0 | 2,308 | -1,322 | 92,459 |
| 1.00 | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (2.50) | (-1.43) | (100.00) |
| 합 계 | 0 | 0 | 0 | 2,308 | -1,322 | 92,459 |

| 전 기 | 당 기 |
|---|---|
| 자산별 구성비중 | 자산별 구성비중 |



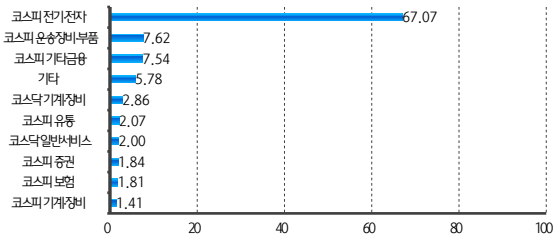

※ ( ) : 구성비중
※ 모자형의 경우, 자산구성현황은 투자자가 가입한 자펀드의 실제 자산구성내역이 아니고, 투자자의 이해를 돕기위해, 모펀드의 자산구성 내역과 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율 등을 감안하여 산출한 것입니다.

## 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

| 순위 | 업종명 | 비중 | 순위 | 업종명 | 비중 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 코스피 전기·전자 | 67.07 | 6 | 코스피 유통 | 2.07 |
| 2 | 코스피 운송장비·부품 | 7.62 | 7 | 코스닥 일반서비스 | 2.00 |
| 3 | 코스피 기타금융 | 7.54 | 8 | 코스피 증권 | 1.84 |
| 4 | 기타 | 5.78 | 9 | 코스피 보험 | 1.81 |
| 5 | 코스닥 기계·장비 | 2.86 | 10 | 코스피 기계·장비 | 1.41 |

주식업종별 투자비율




## 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구 분 | 종목명 | 비중 |
|---|---|---|
| 주식 | 삼성전자 | 30.63 |
| 주식 | SK하이닉스 | 21.71 |
| 주식 | 삼성전기 | 4.72 |
| 단기상품 | 은대(우리은행) | 2.50 |
| 주식 | 현대차 | 2.42 |
| 주식 | SK스퀘어 | 2.34 |
| 주식 | HD현대중공업 | 2.20 |
| 주식 | 두산 | 1.88 |
| 주식 | 삼성물산 | 1.60 |
| 주식 | LG에너지솔루션 | 1.54 |

# 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]

## ▶ 각 자산별 보유종목 내역

**주식**

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종목명 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 |
|---|---|---|---|
| 삼성전자 | 86,075.00 | 28,319.00 | 30.63 |
| SK하이닉스 | 9,696.00 | 20,072.00 | 21.71 |
| 삼성전기 | 2,483.00 | 4,364.00 | 4.72 |
| 현대차 | 3,191.00 | 2,234.00 | 2.42 |
| SK스퀘어 | 1,722.00 | 2,167.00 | 2.34 |
| HD현대중공업 | 3,065.00 | 2,035.00 | 2.20 |
| 두산 | 999.00 | 1,739.00 | 1.88 |
| 삼성물산 | 3,219.00 | 1,482.00 | 1.60 |
| LG에너지솔루션 | 3,431.00 | 1,421.00 | 1.54 |
| **발행국가** | **통화** | **업종** | **비고** |
| 대한민국 | KRW | 코스피 전기.전자 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 전기.전자 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 전기.전자 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 운송장비.부품 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 기타금융 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 운송장비.부품 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 전기.전자 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 유통 | |
| 대한민국 | KRW | 코스피 전기.전자 | |

**단기대출 및 예금**

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종류 | 금융기관 | 금액 |
|---|---|---|
| 예금 | 우리은행 | 2,308.00 |
| **발행국가** | **통화** | **비중** |
| 대한민국 | KRW | 2.50 |

**기타**

(단위 : 백만원)

| 종류 | 평가금액 | 비고 |
|---|---|---|
| 미수입금 | 2,037.00 | |
| 미수배당금 | 13.00 | |

※ 펀드 자산총액에서 차지하는 상위 10개 종목의 보유내역을 기재하되, 자산총액(파생상품의 경우 위험평가액)의 5%를 초과하는 종목이거나 발행주식 총수의 1%를 초과하는 종목(해외주식은 제외)이 있는 경우 그 보유 현황을 기재합니다.

※ 위의 예금은 펀드의 운용 중에 남은 현금을 은행에 일시적으로 맡기는 은행계정대(loans to banking accounts)에 해당하고, 적용금리는 은대금리입니다.

※ 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 작성 기준일이 상이할 수 있습니다.

# 4. 투자자산 매매내역

## ▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 백만원, %)

| 펀드명 | 구분 | 매 수 | | 매 도 | | 매매회전율[1] | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간 | 연환산 |
| 블루칩바스켓증권모투자신탁[주식] | 주식 | 374,090 | 38,297 | 436,774 | 38,166 | 49.70 | 197.17 |
| | ETF | 135,297 | 4,922 | 158,571 | 6,753 | 476.79 | 1,891.61 |

[1] 매매회전율(해당분기)이란 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 말합니다. 매매회전율이 높으면 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.20%)가 발생해 투자자의 펀드비용이 증가합니다.

## ▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

| 펀드명 | 항목 | 해당펀드 | | 상위펀드 비용 합산 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 총보수[1] 비용비율 | 증개수수료 비율 | 합성총보수 비용비율 | 매매 중개[2] 비용비율 |
| 블루칩바스켓자V1[주식] | 전기 | 0.0031 | 0.0000 | 0.0082 | 0.5960 |
| | 당기 | 0.0011 | 0.0000 | 0.0047 | 0.4360 |
| | **종류(Class)별 보수 현황** | | | | |
| ClassA | 전기 | 1.4906 | 0.0000 | 1.4989 | 0.5986 |
| | 당기 | 1.4903 | 0.0000 | 1.4950 | 0.4366 |
| ClassA-E | 전기 | 0.9905 | 0.0000 | 0.9989 | 0.5654 |
| | 당기 | 0.9902 | 0.0000 | 0.9949 | 0.4363 |
| ClassC-E | 전기 | 1.7080 | 0.0000 | 1.7162 | 0.6040 |
| | 당기 | 1.7077 | 0.0000 | 1.7124 | 0.4376 |
| ClassC-P | 전기 | 1.0873 | 0.0000 | 1.0954 | 0.5987 |
| | 당기 | 1.0881 | 0.0000 | 1.0929 | 0.4432 |
| ClassC1 | 전기 | 1.9887 | 0.0000 | 1.9968 | 0.6033 |
| | 당기 | 1.9893 | 0.0000 | 1.9940 | 0.4350 |
| ClassC2 | 전기 | 1.8639 | 0.0000 | 1.8717 | 0.6953 |
| | 당기 | 1.8641 | 0.0000 | 1.8688 | 0.4352 |
| ClassC5 | 전기 | 1.4905 | 0.0000 | 1.4987 | 0.6029 |
| | 당기 | 1.4902 | 0.0000 | 1.4949 | 0.4390 |
| ClassS | 전기 | 0.7553 | 0.0000 | 0.7635 | 0.5989 |
| | 당기 | 0.7550 | 0.0000 | 0.7597 | 0.4330 |
| ClassS-P2 | 전기 | 0.6582 | 0.0000 | 0.6665 | 0.6019 |
| | 당기 | 0.6586 | 0.0000 | 0.6632 | 0.4279 |

[1] 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수와 기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

# 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]

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

※ 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 각 모펀드에 투자한 비율대로 안분하여 환산한 수치입니다.

## 5. 비용 현황

### ▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

| 펀드명 | 구분 | | 전기 | | 당기 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 금액[1] | 비율[2] | 금액[1] | 비율[2] |
| 블루칩바스켓자[V1[주식] | 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[3] | | 1 | 0.00 | 1 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 16 | 0.03 | 16 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 61 | 0.12 | 65 | 0.09 |
| | | 합계 | 77 | 0.15 | 81 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 75 | 0.14 | 70 | 0.10 |
| ClassA | 자산운용사 | | 48 | 0.11 | 67 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 108 | 0.25 | 150 | 0.25 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 3 | 0.01 | 4 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 2 | 0.00 | 2 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 161 | 0.37 | 223 | 0.38 |
| | 기타비용[3] | | 1 | 0.00 | 1 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 13 | 0.03 | 13 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 51 | 0.12 | 52 | 0.09 |
| | | 합계 | 65 | 0.15 | 65 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 63 | 0.14 | 57 | 0.10 |
| ClassA-E | 자산운용사 | | 4 | 0.11 | 6 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 4 | 0.12 | 7 | 0.13 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 8 | 0.24 | 14 | 0.25 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 1 | 0.03 | 1 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 4 | 0.11 | 5 | 0.09 |
| | | 합계 | 5 | 0.14 | 6 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 5 | 0.13 | 5 | 0.09 |
| ClassC-E | 자산운용사 | | 3 | 0.11 | 5 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 8 | 0.30 | 14 | 0.31 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 12 | 0.42 | 19 | 0.43 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 1 | 0.03 | 1 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 3 | 0.12 | 4 | 0.09 |
| | | 합계 | 4 | 0.15 | 5 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 4 | 0.14 | 4 | 0.10 |
| ClassC-P | 자산운용사 | | 0 | 0.11 | 0 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 0 | 0.15 | 0 | 0.15 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0 | 0.27 | 0 | 0.27 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매,중개수수료 | 0 | 0.03 | 0 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.12 | 0 | 0.09 |
| | | 합계 | 0 | 0.15 | 0 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 0 | 0.14 | 0 | 0.10 |

# 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| ClassC1 | 자산운용사 | | 0 | 0.11 | 0 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 0 | 0.37 | 1 | 0.38 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0 | 0.49 | 1 | 0.50 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매중개수수료 | 단순매매,중개수수료 | 0 | 0.03 | 0 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.12 | 0 | 0.09 |
| | | 합계 | 0 | 0.15 | 0 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 0 | 0.13 | 0 | 0.09 |
| ClassC2 | 자산운용사 | | 0 | 0.11 | 0 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 0 | 0.34 | 1 | 0.35 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0 | 0.46 | 1 | 0.47 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매중개수수료 | 단순매매,중개수수료 | 0 | 0.04 | 0 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.14 | 0 | 0.09 |
| | | 합계 | 0 | 0.17 | 0 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 0 | 0.17 | 0 | 0.10 |
| ClassC5 | 자산운용사 | | 2 | 0.11 | 3 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 5 | 0.25 | 6 | 0.25 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 7 | 0.37 | 9 | 0.38 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매중개수수료 | 단순매매,중개수수료 | 1 | 0.03 | 1 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 2 | 0.12 | 2 | 0.09 |
| | | 합계 | 3 | 0.15 | 3 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 3 | 0.14 | 2 | 0.10 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| ClassS | 자산운용사 | | 0 | 0.11 | 1 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 0 | 0.07 | 0 | 0.07 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 1 | 0.19 | 1 | 0.19 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매중개수수료 | 단순매매,중개수수료 | 0 | 0.03 | 0 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.12 | 1 | 0.09 |
| | | 합계 | 1 | 0.15 | 1 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 1 | 0.14 | 1 | 0.09 |
| ClassS-P2 | 자산운용사 | | 0 | 0.11 | 0 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 0 | 0.04 | 0 | 0.04 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0 | 0.16 | 0 | 0.17 |
| | 기타비용[3] | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매중개수수료 | 단순매매,중개수수료 | 0 | 0.03 | 0 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0 | 0.12 | 0 | 0.09 |
| | | 합계 | 0 | 0.15 | 0 | 0.11 |
| | 증권거래세 | | 0 | 0.14 | 0 | 0.09 |

1) 운용기간에 발생한 보수금액
2) 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율
3) 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적 · 반복적으로 지출된 비용으로서 매매 · 중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 해당사항 없음
※ 발행분담금내역 : 해당사항 없음
※ ESG관련내역 : 해당사항 없음

## 6. 동일한 집합투자업자 펀드 투자현황

(단위:주,%)

| 투자대상 집합투자기구 현황 | | 투자대상 집합투자증권 보유수(B) | 보유비중 (=B/A*100(%)) |
|---|---|---|---|
| 집합투자기구명 | 발행총수(A) | | |
| - | - | - | - |

## 7. 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

# 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]

## ▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

### 가. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

- 운용전략상 국내주식에 주로 투자하며, 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자하거나 투자대상종목 발행회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화 등에 의해 투자대상 종목의 유동성 부족 또는 거래정지 등에 따른 환금성에 제약이 발생할 수 있고 이는 집합투자재산의 가치하락을 초래할 수 있음
- 운용전략 상 주식관련장내파생상품에 투자할 수 있으며, 파생상품은 작은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대 효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 높은 위험에 노출될 수 있음
- 투자와 관련한 보다 자세한 위험현황은 투자설명서 등을 참조

### 나. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단 사유 등

환매중단 등 위험발생가능성 낮음

## ▶ 주요 위험 관리 방안

### 가. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

- 모든 거래는 내부 심사를 통해 사전 승인된 거래 상대방하고만 거래를 할 수 있으며 거래상대방에 대해 정기적인 모니터링을 시행
- 투자 대상 발행사별 내부신용등급 및 투자한도를 부여하여 한도 내 투자를 실시하고 있는지 일일 모니터링을 시행
- 펀드 특성별로 부여한 VaR(상대 or 절대) 한도를 일간으로 모니터링하고 있으며 이를 통해 펀드의 최대 손실가능금액을 일정 수준 이내로 관리 및 통제하고 있음
- 주식의 경우 종목별 손실한도를 통해 종목별 최대 손실을 제한하고 있음
- 주식 투자유니버스 선정 시 개별주식의 유동성 고려 (일평균 거래대금 하한 설정 등)
- 최근 1달 일평균 거래량 대비 보유비율이 10일을 초과하는 비유동주식 종목을 월간으로 모니터링 하고 있음
- 집합투자규약 상 파생상품 매매에 따른 위험평가액의 상한을 설정하여 일일 모니터링 시행
- 유형별 주식 매매 부분 평균회전율 대비 크게 벗어나는 펀드 월간으로 모니터링

### 나. 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한 과 수단 등

해당사항 없음

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

해당사항 없음

## ▶ 자전거래 현황

### 가. 자전거래규모

(단위: 원)

| 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|---|---|---|---|
| - | - | - | - |

### 나. 최근 1년간 자전거래 발생 시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위한 실시간 방안, 절차 등

해당사항 없음

## ▶ 주요 비상대응계획

- 예기치 못한 위기상황 발생을 대비하여 대표이사, 부사장 및 각 주요 부서장들로 구성된 위기관리대책위원회 운영
- 5단계의 체계적인 위기관리 대응체계에 따라 각 단계별 임무 수행

1. 위기모니터링 : 상황 별 위기점검지표 일일 모니터링 시행
2. 위기인지/예방 단계 : 한도 초과 발견 시(혹은 위기상황이 심각히 예견될 시)즉시 업무관련부서장에게 통보 및 위기점검분석보고서 작성 제출 요구
3. 위기발생 단계 : 위기상황의 발생 혹은 심각히 예견되는 상황에서 전사적 대응을 위해 적정한 위기등급 발령
4. 위기대응 단계 : 위기관리대책위원회의 심의를 받아 유동성확보방안, 판매사 대응방안 등 위기관리대책 수립 및 시행
5. 사후관리 단계 : 위기상황해소 후 위기발생의 원인, 대응상의 문제점 및 재발방지책 등 검토 및 보고

# 8. 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

(단위: 백만원, %)

| 펀드명 | 분류 |
|---|---|
| | |

| 투자일 | 투자금 | 회수일 | 회수금 |
|---|---|---|---|
| - | - | - | - |

| 투자잔액 | 수익률 |
|---|---|
| - | - |

※ 투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매)될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.
※ 고유재산 투자 분류가 '의무투자'인 경우에는 고유재산 투자의 회수예정일이 경과하기 1개월 이전에 제공되는 자산운용보고서에 고유재산 투자금을 회수할 수 있다는 사실을 기재합니다.
※ 수익률은[(보고서 기준일 수정기준가-투자일 수정기준가/투자일 수정기준가)*100]으로 산출된 값입니다.
※ 투자금, 회수금, 투자잔액은 고유재산 투자이후 이익분배금 수령을 제외한 최초 투자금액 기준으로 작성하였습니다.

# 9. 공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 하나블루칩바스켓증권자투자신탁(V-1호)[주식]의 자산운용회사인 하나자산운용(주)이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 우리은행의 확인을 받은 후에 판매회사를 통해 투자자에게 제공합니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

하나자산운용

■ **주요 공시사항은 금융투자협회의 전자공시와 당사 홈페이지에서 확인이 가능합니다.**
- 하나자산운용(주) 홈페이지 http://www.hanaam.com / 대표전화 02-3771-7800
- 금융투자협회 홈페이지 http://dis.kofia.or.kr / 대표전화 02-2003-9000