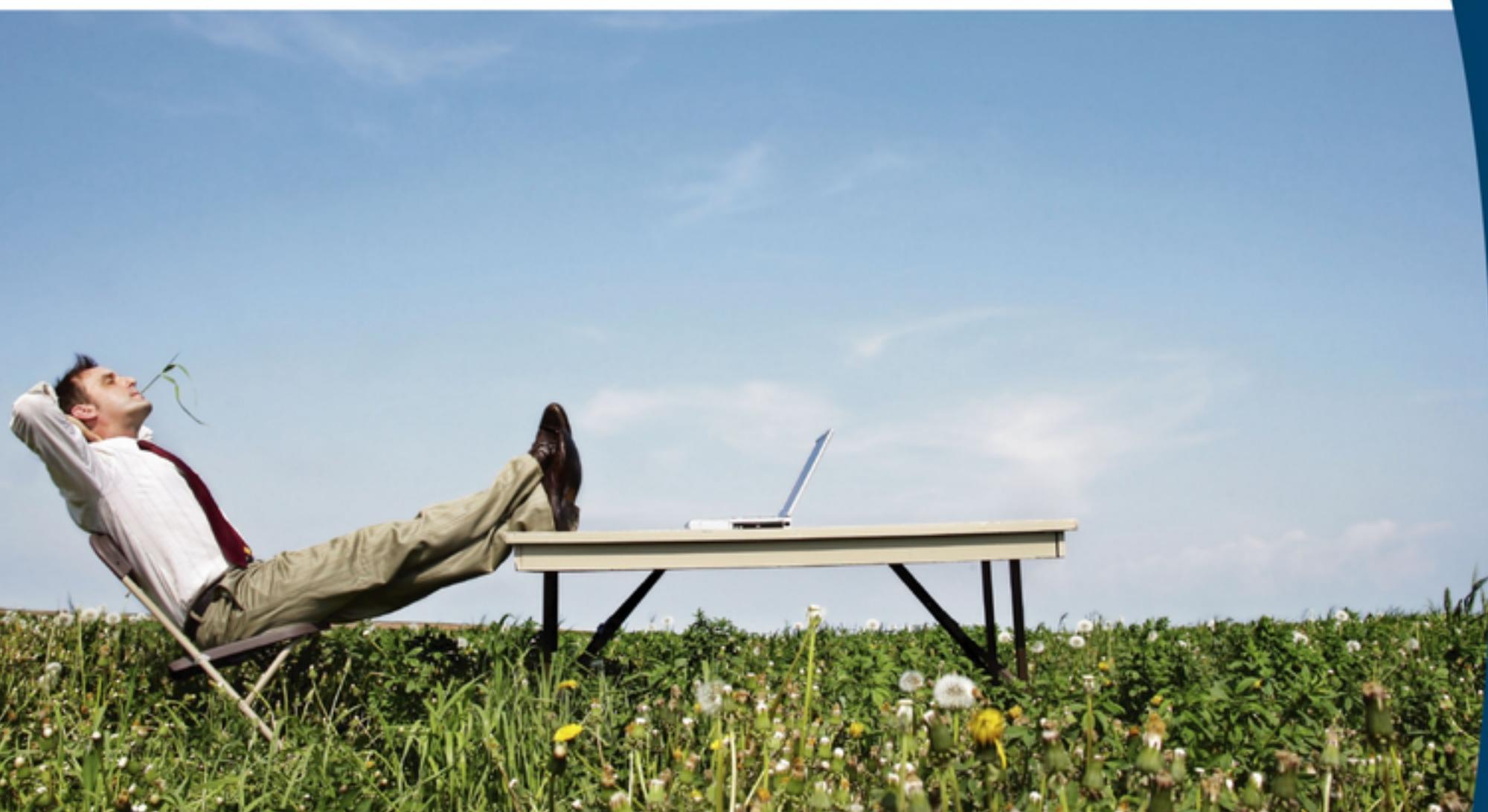


# 인베스 자산운용



## Invest & Relax

서울시 강남구 청담동 21-13  
JP Palace 4층  
[www.invex.co.kr](http://www.invex.co.kr) 02-785-3882

인베스 웰스멘토  
전문투자형 사모투자신탁 제1호(2017.01.03)

Absolute Return

Portable Alpha

Managed Accounts

Investment Advisory

# 인벡스 회사 소개

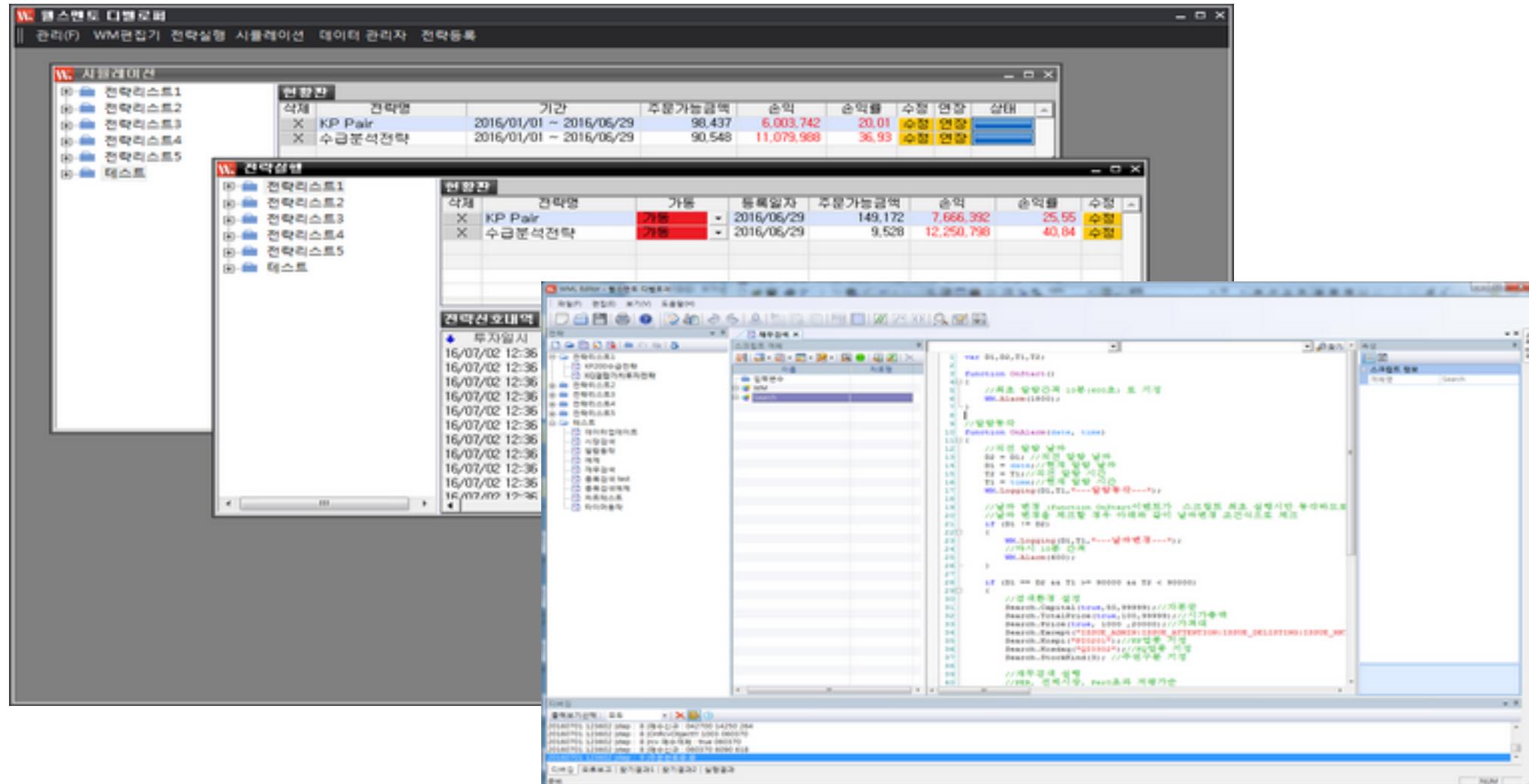
회사명	인벡스 자산운용 (주)
설립일	2008년 5월 23일
등록일	2008년 7월 28일 금융위원회 투자자문업 등록 2009년 6월 26일 금융위원회 투자일임업 등록 2016년 7월 4일 금융위원회 전문사모집합투자업 등록
전문분야	금융공학을 활용한 퀀트시스템 운용 Hedge Fund 운용
대표이사	양 태선
자본금	52 억원
인력 현황	총 10 인
운용자산	총 500 억원
주소	서울특별시 강남구 청담동 21-13 JP Palace 4층
연락처	Tel. 02 785 3882 / Fax. 02 780 3889 <a href="http://www.invex.co.kr">www.invex.co.kr</a>

# 펀드 개요

펀드명 인베스 웰스멘토 전문투자형 사모투자신탁 제 1 호			
운용목표	금융공학기반 퀀트 운용 및 로보매니저 운용 전략 Portfolio로 시장 상승률 플러스 알파의 수익률 추구		
펀드유형	전문투자형, 사모투자신탁, 추가형, 개방형, 혼합자산형		
투자대상	주식, ETF, 국공채, 회사채, 상장 선물, 상장 옵션		
목표수익률	주식시장 수익률 플러스 알파 수익률 추구		
판매수수료 및 연간 보수	구분	A 클래스	C-a 클래스
	판매수수료	1.00 % (선취)	없음
	판매 보수	연 0.5%	연 1.0%
	운용 보수	연 1.00%	
	신탁 보수	연 0.07%	
	사무관리보수	연 0.05%	
성과 보수	연간 초과수익의 10%		
가입 금액	1억원 이상		

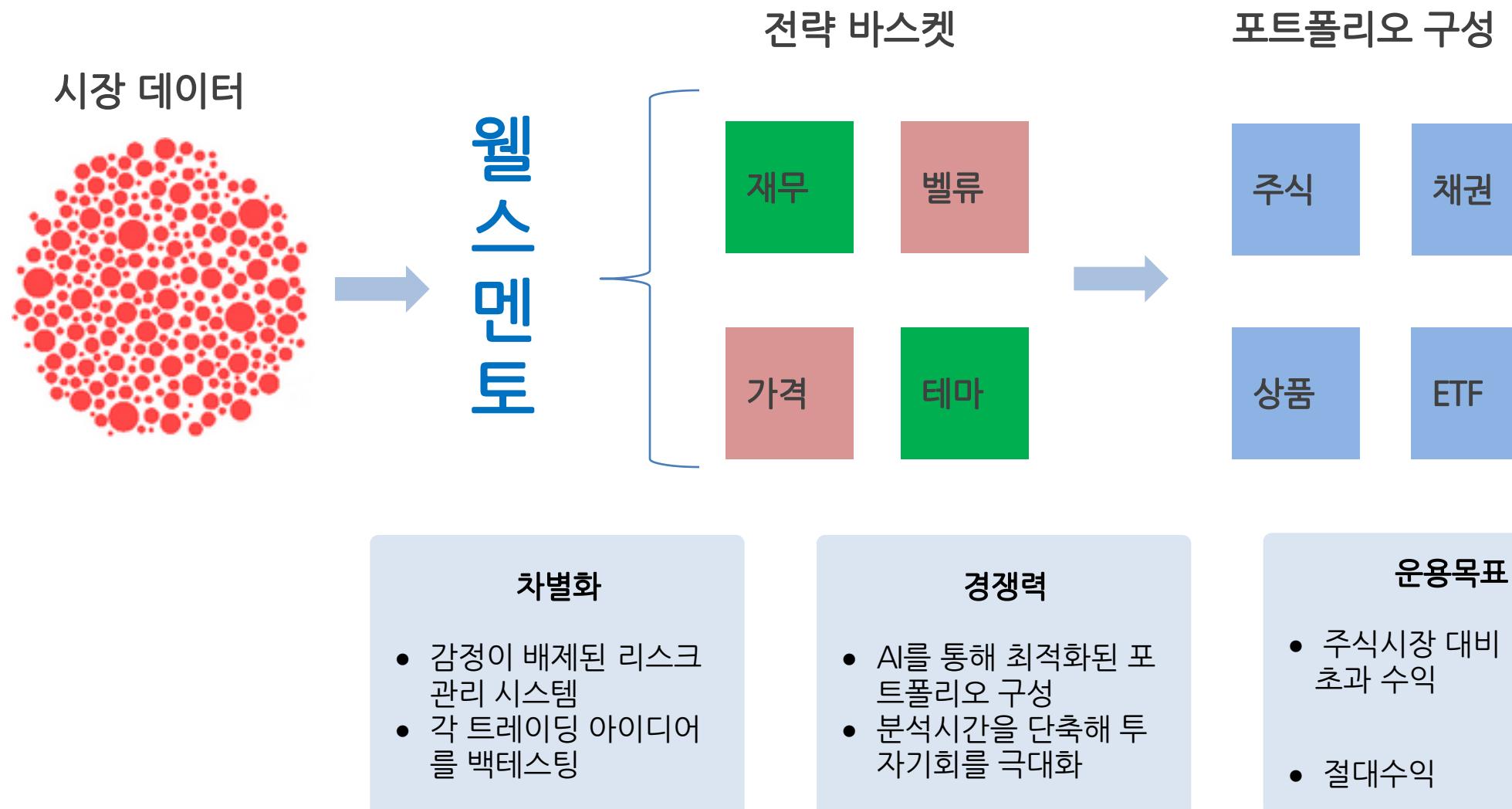
25년간 Trading Software 개발을 선도한 예스스탁의  
운용플랫폼 “웰스멘토”를 활용!

다양한 데이터 분석과 운용전략 프로그램을 통하여  
로보매니저 스타일로 운용!



\* 과거의 운용실적이 미래의 수익률을 보장하는 것은 아닙니다. 운용결과에 따른 이익 또는 손실은 투자자에게 귀속됩니다.

금융 데이터와 지식을 통합해 현 시장상황과 투자 스타일에  
최적화된 투자 전략 포트폴리오 생성 및 운용.



# 인베스 웰스멘토 Highlights

퀀트포트폴리오  
운용

기업, 경제 및 주가 데이터를 입력 변수로 활용하여  
퀀트주식운용모델을 개발하고,  
다수의 모델을 포트폴리오화하여 운용

로보 매니저

운용 모델 자체적으로 주문을 생성하여  
자동매매 모듈을 통하여 로봇이 직접 운용

적극적인  
수익추구

로보 매니저의 적극적인 매매를 통한  
철저한 리스크 관리와 적극적인 수익 추구

# Why 인베스 웰스멘토?

분산 투자

Hedge Fund 투자도 다양한 종류에 분산 투자하여  
자산 운용 효율성을 제고할 필요가 있음

시장 하락 시 방어

시장 하락 시 적극적인 리스크 관리와  
적극적인 매매로 수익 추구 가능

운용 연속성

컴퓨터 모델을 활용하는 인베스 웰스멘토는  
매니저 리스크 없이 운용의 연속성이 매우 높음

## 운용 목표

검증된 알고리즘 매매전략과  
로보매니저 운용전략으로  
“시장수익률+알파” 수익률 추구

## 운용 원칙

- 국내 KOSPI 및 KOSDAQ 상장 주식 투자
- 복수의 알고리즘 전략에 의한 기계적인 매매 실행
- 포트폴리오화 된 전략 배분으로 비체계적위험 제거
- 매매타이밍 분할을 통하여 유동성 위험 최소화

# 인베스 웰스멘토 운용 전략 소개

## 중소형 가치투자전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스피의 중소형주를 대상으로 재무분석모델로 종목을 발굴하여 투자</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 10회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 30종목으로 구성</li><li>중형주와 소형주 투자비중은 50%로 분산</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>정략분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

## K200 수급전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스피200 종목을 대상으로 투자주체수급분석모델로 추세 확률이 높은 종목을 발굴하여 투자</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 20회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 20종목으로 구성</li><li>개별종목의 투자비중은 균등비율로 분산투자</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>투자주체별 수급분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

# 인베스 웰스멘토 운용 전략 소개

## 중형주 마법공식 전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스피200 종목을 투자대상으로 조엘 그린블라트가 제안한 마법공식에 근거하여 자본수익률과 이익수익률이 우수한 종목에 투자</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 20회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 20종목으로 구성</li><li>개별종목의 투자비중은 균등비율로 분산투자</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>정략분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

## KQ 결합 가치투자 전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스닥100 종목을 대상으로 재무분석모델로 종목을 발굴하고 투자주체별 수급정보를 추가로 분석하여 수급이 우량한 종목에 투자</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 20회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 20종목으로 구성</li><li>개별종목의 투자비중은 균등비율로 분산투자</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>정량분석과 투자주체별 수급분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

# 인베스 웰스멘토 운용 전략 소개

## KP우량주 모멘텀 전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스피200 종목을 투자대상으로 평균반전현상이 자주 발생하는 종목을 선정하여 단기 하락과 상승을 이용하여 매매하는 전략</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 30회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 30종목으로 구성</li><li>개별종목의 투자비중은 균등비율로 분산투자</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>패턴분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

## KQ 우량주 모멘텀 전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스닥100 종목을 대상으로 평균반전현상이 자주 발생하는 종목을 선정하여 단기 하락과 상승을 이용하여 매매하는 전략</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 30회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 30종목으로 구성</li><li>개별종목의 투자비중은 균등비율로 분산투자</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>패턴분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

# 인베스 웰스멘토 운용 전략 소개

## 웰스멘토 밸류 A 전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스피200 종목을 투자대상으로 재무분석모델로 종목을 발굴하여 투자</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 10회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 10종목으로 구성</li><li>개별종목의 투자비중은 균등비율로 분산투자</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>정량분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

## 웰스멘토 알파 A 전략

투자비율	순자산의 10% 이내
운용전략	<ul style="list-style-type: none"><li>코스닥100 종목을 대상으로 외국인투자자 수급 상황을 분석하여 종목을 선정하여 매매하는 전략</li><li>매매신호 생성 횟수는 1개월 평균 10회 내외</li><li>포트폴리오는 최대 10종목으로 구성</li><li>개별종목의 투자비중은 균등비율로 분산투자</li></ul>
중요특징	<ul style="list-style-type: none"><li>알고리즘 로직에 의한 자동매매 실행</li><li>수급분석을 바탕으로 한 투자 시스템</li></ul>

# 인베스 핵심 운용 인력

성명	직급	담당업무	주요경력
양태선	대표이사	운용 총괄	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 인베스자산운용 설립</li> <li>• 칸서스자산운용 금융공학본부 본부장</li> <li>• 알파자산운용 금융공학본부 본부장</li> <li>• 델타투자자문 운용총괄상무</li> <li>• Citi은행, State Farm 보험 수석부장</li> <li>• 홍콩, 뉴욕 현지 Hedge Fund 운용</li> <li>• 금융시장경력 28년</li> <li>• Univ. of Pennsylvania, Wharton MBA</li> </ul>
강동원	본부장	주식 운용 총괄	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 블루온투자자문 총괄본부장</li> <li>• BNP Paribas 기업분석 총괄 이사</li> <li>• Donaldson, Lufkin &amp; Jenrette 기업분석 총괄 이사</li> <li>• 현대증권, 신한증권 수석 애널리스트</li> <li>• 금융시장경력 24년</li> <li>• Univ. of Pennsylvania, Wharton MBA</li> </ul>
김기호	이사	Hedge Fund 운용 총괄	<ul style="list-style-type: none"> <li>• NH 투자증권 매니저</li> <li>• 칸서스자산운용 금융공학 본부 퀀트매니저</li> <li>• CFA, CAIA, FRM</li> <li>• 금융시장경력 10년</li> <li>• KAIST 산업공학과</li> </ul>
박진원	이사	공모주 운용 총괄	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 캐나다 Swift 운용역</li> <li>• 캐나다 CIBC Mellon Toronto 운용역</li> <li>• 미국 Mellon Trust 퀀트 애널리스트</li> <li>• 금융시장경력 15년</li> <li>• Boston University, 경영학 학사</li> </ul>

# 인베스 상품 소개

