

자산운용보고서

유리트리플알파증권투자신탁[주식혼합]

(운용기간 : 2016년05월15일 ~ 2016년08월14일)

자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

유리자산운용(주)

서울시 영등포구 국제금융로6길 17 부국증권빌딩 9층
(전화 02-2168-7900, <http://www.yurieasset.co.kr>)

- 1 **공지사항**
- 2 **펀드의 개요**
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 자산현황
- 3 **운용경과 및 수익률현황**
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 4 **자산현황**
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 5 **투자운용전문인력 현황**
 - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
 - ▶ 해외 운용 수탁회사
- 6 **비용현황**
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 7 **투자자산매매내역**
 - ▶ 매매주식규모 및 회전을
 - ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

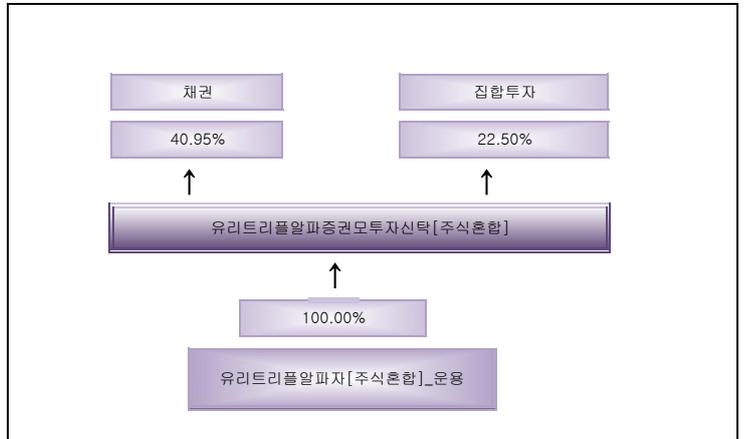
3. 위험관리

운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 및 위험관리실무위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 당사 내부의 운용실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다.
리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다.
위험관리를 위하여 투자환경 및 투자대상자산과 관련한 변화가 발생 시 탄력적으로 포트폴리오 조정을 실시할 계획입니다.

4. 수익구조

이 투자신탁은 '유리 트리플 알파 증권 모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자신탁입니다. 이 투자신탁이 투자하는 '유리 트리플 알파 증권 모투자신탁[주식혼합]'은 국내주식에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 채권에 투자신탁 자산총액의 50% 미만으로 투자하여 자본소득을 추구합니다. 따라서, 모투자신탁이 투자한 주식, 채권 등의 가격변동에 따라 이익 또는 손실이 결정됩니다.

▶ 펀드 구성



* 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을때 각 모펀드의 집합투자증권을 얼마만큼 투자하고 있는지를 보여줍니다.

▶ 재산현황

재산현황 표를 통해 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산 총액 및 기준가격의 추이를 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	자산 총액 (A)	131,768	114,226	-13.31
	부채 총액 (B)	163	242	48.28
	순자산총액 (C=A-B)	131,605	113,984	-13.39
	발행 수익증권 총 수 (D)	130,053	112,007	-13.88
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,011.93	1,017.65	0.57
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	기준가격	1,006.20	1,008.99	0.28
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	기준가격	1,007.45	1,010.88	0.34
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	기준가격	1,004.20	1,005.97	0.18
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	기준가격	1,006.46	1,009.37	0.29
유리트리플알파자[주식혼합]_C/F	기준가격	1,008.45	1,012.38	0.39
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	기준가격	1,008.71	1,012.77	0.40
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	기준가격	1,001.92	1,004.56	0.26
유리트리플알파자[주식혼합]_C/S	기준가격	0.00	1,000.23	0.02

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.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

본 펀드의 해당분기 성과는 운용펀드 기준 0.57%, 연초대비 1.37%를 기록하였습니다.

당 분기 본 펀드는 우선주-보통주 페어의 괴리를 축소에 따른 이익실현 청산 및 괴리를 확대된 신규 페어 진입이 있었으며, 블록딜을 활용한 이벤트 전략, 중소형 IPO를 통한 10여개 종목의 공모주 편입 및 이익 청산이 있었습니다.

또한 변동성 감소 및 우선주 약세에 따른 보통주-우선주 차익거래전략 기회 축소에 따라 주식 바스켓을 매수하고 KOSPI200지수 선물을 매도하는 바스켓 롱숏 전략을 소폭 편입하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

동분기 KOSPI지수는 4.24%의 수익률을 기록하였습니다. 브렉시트로 인한 글로벌 경제 불확실성에 따라 큰 폭의 변동이 있었으나 금리 인하, 기업의 실적 개선 및 외국인 자금 유입 등이 긍정적 요인으로 작용하였습니다.

저금리 환경에 따라 작년 하반기 강세를 보인 배당주 조정에 따라 우선주의 상대적 약세는 지속되었으며, 시장 변동성이 역사적 저점 수준에 머무르면서 본 펀드의 주요 전략인 우선주 차익거래 기회는 감소하였습니다.

그러나 우선주 고평가가 해소되고 대규모 물량 출회에 따른 조정에 따라 우선주의 조정 장세가 마무리되면서 하반기에 접어들어 다시 배당을 목적으로 한 우선주 강세가 예상되고, 아울러 미국의 금리 인상 이슈 재부각에 따라 변동성이 증가할 것으로 예상됨에 따라 차익거래 기회는 증가할 것으로 예상합니다.

▶ 기간(누적)수익률

기간(누적)수익률 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드의 기간별 누적수익률을 확인 할 수 있으며, 비교지수(벤치마크) 성과와 펀드의 성과를 비교하여 볼 수 있습니다.

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	0.57	0.97	1.76	2.60
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	0.28	0.40	0.90	1.44
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	0.34	0.52	1.09	1.69
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	0.18	0.20	0.60	1.03
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	0.29	0.42	0.94	1.49
유리트리플알파자[주식혼합]_C/F	0.39	0.62	1.24	1.89
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	0.40	0.64	1.28	1.95
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	0.26	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/S	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	2.60	8.32	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	1.44	5.89	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	1.69	6.42	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	1.03	5.05	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	1.49	5.99	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/F	1.89	6.57	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	1.95	6.95	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/S	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	30	210	0	67	27	0	0	0	0	180	-7	506
당 기	628	250	0	77	-407	0	0	0	0	125	-68	605

4. 자산현황

아래 표시된 자산구성 현황은 고객님의 가입한 자펀드가 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.

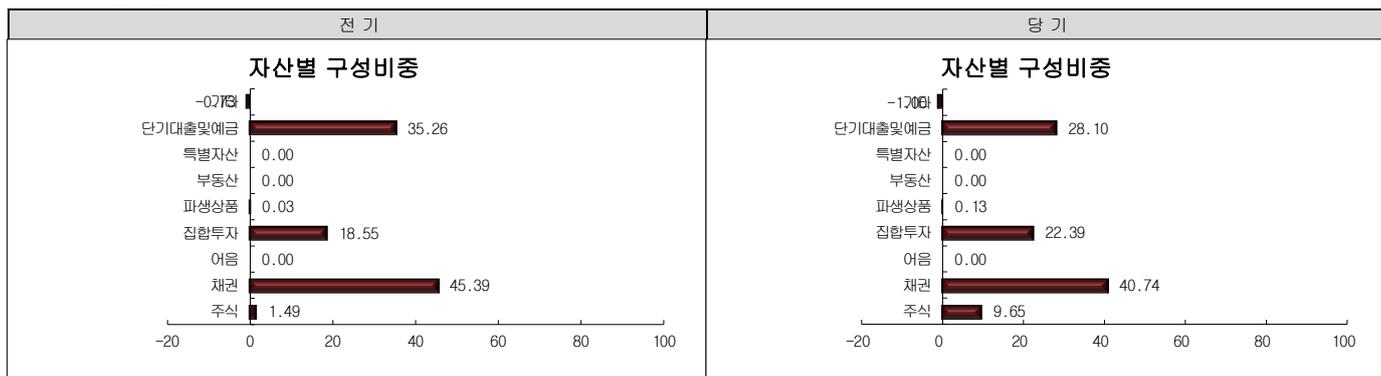
▶ 자산구성현황

자산구성현황 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 보유하고 있는 자산의 내역을 각 자산군 및 통화별로 확인할 수 있습니다. 또한 그래프를 통해 당기말과 전기말 간의 자산별 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW (0.00)	11,019 (9.65)	46,533 (40.74)	0 (0.00)	25,570 (22.39)	149 (0.13)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	32,095 (28.10)	-1,141 (-1.00)	114,226 (100.00)
합계	11,019	46,533	0	25,570	149	0	0	0	0	32,095	-1,141	114,226

* () : 구성 비중



주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 인분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 순포지션비율

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및예금	기타	자산별합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
매수포지션 (0.00)	11,019 (9.65)	46,533 (40.74)	0 (0.00)	25,570 (22.39)	149 (0.13)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	16,202 (14.18)	14,752 (12.91)	114,226 (100.00)
매도포지션 (0.00)	2,647 (100.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2,647 (100.00)
순포지션 (0.00)	8,373 (7.50)	46,533 (41.70)	0 (0.00)	25,570 (22.92)	149 (0.13)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	16,202 (14.52)	14,752 (13.22)	111,579 (100.00)

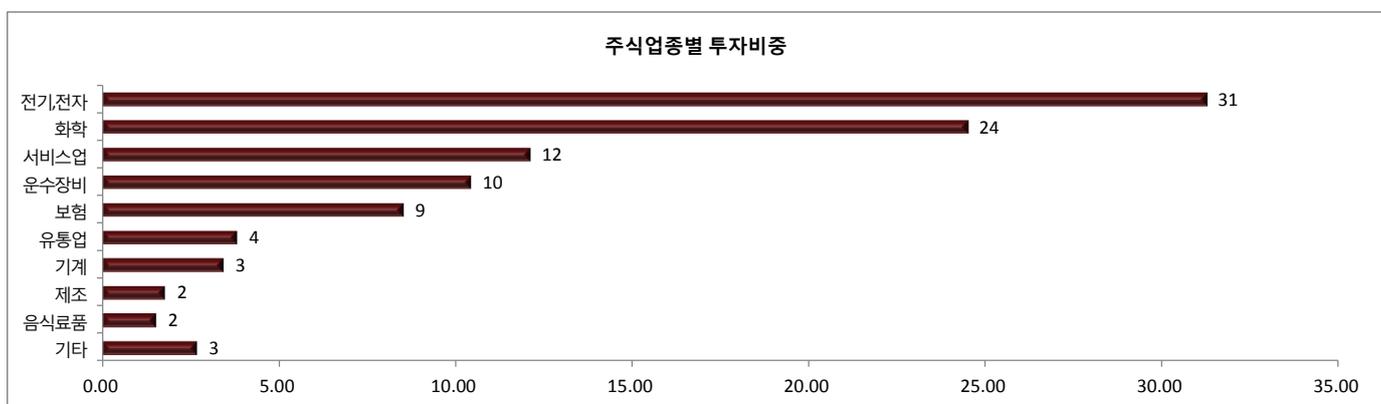
▶ 주식업종별 투자비중

주식업종별 투자비중 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 투자하고 있는 주식자산의 업종별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드가 보유한 주식자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

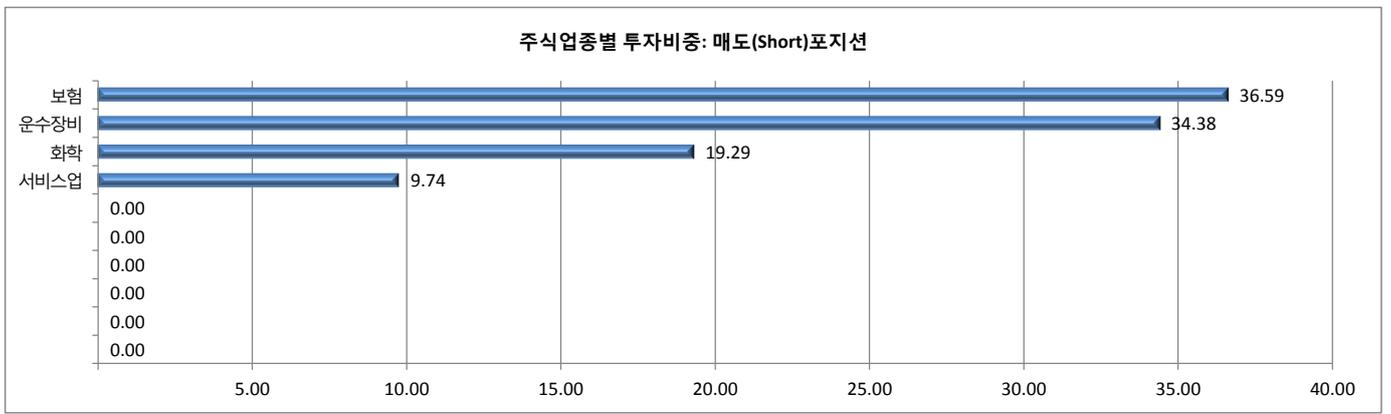
종목명	비중	종목명	비중
1 전기,전자	31.26	6 유통업	3.81
2 화학	24.49	7 기계	3.42
3 서비스업	12.11	8 제조	1.77
4 운수장비	10.43	9 음식료품	1.52
5 보험	8.52	10 기타	2.67

주) 주식종목의 업종 구분은, 국내 주식은 한국거래소의 업종분류기준, 해외 주식은 GICS(국제산업분류기준) 2차 분류를 따릅니다.



▶ 주식업종별 투자비중: 매도(Short)포지션

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	보험	36.59	6		
2	운수장비	34.38	7		
3	화학	19.29	8		
4	서비스업	9.74	9		
5			10		



▶ 투자대상 상위 10종목

투자대상 상위 10종목 표를 통해 전체 자산군을 대상으로 펀드 자산총액에서 차지하는 상위 10개 보유 종목을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드의 자산총액에서 해당 종목이 차지하는 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권	통안0171-1704-02	6	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS
2	단기상품	CD(우리은행 160811-161110)	7	단기상품	REPO매수(20160812)
3	집합투자증권	KBSTAR 단기통안채	8	채권	농업금융채권(은행)2015-11011.5Y-D
4	채권	우리은행18-03013갑-26	9	채권	국고02000-1712(14-6)
5	단기상품	REPO매수(20160812)	10	채권	농금채2012-02015Y-S

*보다 상세한 투자대상자산 내용은 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

각 자산별 보유종목 내역을 통해 투자대상 상위 10종목 및 펀드자산총액의 5% 이상을 차지하는 종목, 또는 발행주식 총 수의 1%를 초과한 종목(해외주식은 제외)을 각 자산군별로 구분하여 확인할 수 있습니다.

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안0171-1704-02	23,609	23,723	대한민국	KRW	2015-04-02	2017-04-02		-	20.77
우리은행18-03013갑-26	9,133	9,269	대한민국	KRW	2014-03-26	2017-03-26		AAA	8.11
농업금융채권(은행)2015-11011.5	3,562	3,594	대한민국	KRW	2015-11-27	2017-05-27		AAA	3.15
국고02000-1712(14-6)	3,197	3,239	대한민국	KRW	2014-12-10	2017-12-10		-	2.84
농금채2012-02015Y-S	2,283	2,335	대한민국	KRW	2012-02-23	2017-02-23		AAA	2.04

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KBSTAR 단기통안채	수익증권	KB자산운용	12,548	12,631	대한민국	KRW	11.06
KODEX 단기채권PLUS	수익증권	삼성자산운용	7,888	7,938	대한민국	KRW	6.95

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
REPO매수	한국자금중개	2016-08-12	7,108	0.01		대한민국	KRW
REPO매수	한국자금중개	2016-08-12	9,133	0.01		대한민국	KRW
CD	우리은행	2016-08-11	15,526	1.34	2016-11-10	대한민국	KRW

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	생년	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
한진규	퀀트운용본부장	1969	59	10,229	8	11,863	2109000507
박주호	퀀트운용팀장	1969	47	9,868			2109000457

윤준수	채권운용본부장	1967	80	23,393	6	8,666	2109000319
최재영	채권운용팀장	1972					2109000709

주1) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함.

주2) 운용중인 다른 집합투자기구 수 및 규모를 산정 할 때 해당 운용팀에서 운용중인 전체 집합투자기구를 대상으로 하며 모자형 구조의 모집합투자기구는 제외합니다.

주3) 펀드의 투자운용인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고 하실 수 있습니다. (인터넷 주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

성명	책임/부책임	기간
해당사항 없음		

▶ 해외 운용 수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

6. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

업자별 보수 지급현황 표를 통해 펀드가 펀드의 운용과 관련된 관계회사(자산운용사, 판매회사, 신탁업자, 일반사무관리회사 등)에 지급한 보수와 비용(기타 비용, 매매중계 수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	자산운용사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.00	0.00	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	0.00	0.00	0.00	0.00	
	기타비용**	5.31	0.00	1.86	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	16.03	0.01	17.70	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2.00	0.00	3.74	0.00
		합계	18.03	0.01	21.44	0.02
	증권거래세	24.64	0.02	30.37	0.02	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	자산운용사	58.56	0.15	57.76	0.15	
	판매회사	48.80	0.12	48.13	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	2.44	0.01	2.41	0.01	
	일반사무관리회사	1.46	0.00	1.44	0.00	
	보수합계	111.27	0.28	109.73	0.29	
	기타비용**	1.97	0.00	0.82	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	5.04	0.01	5.54	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.63	0.00	1.17	0.00
		합계	5.67	0.01	6.71	0.02
	증권거래세	7.73	0.02	9.50	0.02	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	자산운용사	2.55	0.15	1.55	0.15	
	판매회사	1.06	0.06	0.65	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.11	0.01	0.06	0.01	
	일반사무관리회사	0.06	0.00	0.04	0.00	
	보수합계	3.78	0.22	2.31	0.22	
	기타비용**	0.09	0.01	0.02	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.20	0.01	0.14	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.03	0.00	0.03	0.00
		합계	0.23	0.01	0.17	0.02
	증권거래세	0.32	0.02	0.23	0.02	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	자산운용사	69.15	0.15	68.56	0.15	
	판매회사	103.73	0.22	102.84	0.23	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	2.88	0.01	2.86	0.01	
	일반사무관리회사	1.73	0.00	1.71	0.00	
	보수합계	177.49	0.38	175.96	0.39	
	기타비용**	2.32	0.00	0.98	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	5.91	0.01	6.60	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.75	0.00	1.40	0.00
		합계	6.66	0.01	8.00	0.02
	증권거래세	9.10	0.02	11.37	0.03	

유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	자산운용사	1.43	0.15	1.33	0.15	
	판매회사	1.07	0.11	1.00	0.11	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.06	0.01	0.06	0.01	
	일반사무관리회사	0.04	0.00	0.03	0.00	
	보수합계	2.60	0.27	2.42	0.27	
	기타비용**	0.05	0.01	0.02	0.00	
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0.12	0.01	0.13	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.00	0.03	0.00
		합계	0.14	0.01	0.16	0.02
	증권거래세	0.19	0.02	0.22	0.03	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/F	자산운용사	47.69	0.15	45.77	0.15	
	판매회사	3.97	0.01	3.81	0.01	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	1.99	0.01	1.91	0.01	
	일반사무관리회사	1.19	0.00	1.14	0.00	
	보수합계	54.85	0.17	52.64	0.17	
	기타비용**	1.40	0.00	0.65	0.00	
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	4.05	0.01	4.32	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.50	0.00	0.91	0.00
		합계	4.55	0.01	5.22	0.02
	증권거래세	6.24	0.02	7.35	0.02	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	자산운용사	7.65	0.15	9.42	0.15	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.32	0.01	0.39	0.01	
	일반사무관리회사	0.19	0.00	0.24	0.00	
	보수합계	8.16	0.16	10.04	0.16	
	기타비용**	0.25	0.00	0.13	0.00	
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0.67	0.01	0.91	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.08	0.00	0.19	0.00
		합계	0.75	0.01	1.10	0.02
	증권거래세	1.02	0.02	1.59	0.03	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	자산운용사	0.21	0.14	0.60	0.15	
	판매회사	0.19	0.13	0.55	0.14	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.01	0.01	0.03	0.01	
	일반사무관리회사	0.01	0.00	0.02	0.00	
	보수합계	0.41	0.29	1.20	0.30	
	기타비용**	0.00	0.00	0.01	0.00	
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0.03	0.02	0.06	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.01	0.00
		합계	0.03	0.02	0.07	0.02
	증권거래세	0.03	0.02	0.10	0.03	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/S	자산운용사	0.00	0.00	0.00	0.02	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.01	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.00	0.00	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	0.00	0.00	0.00	0.03	
	기타비용**	0.00	0.00	0.00	0.00	
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.00
	증권거래세	0.00	0.00	0.00	0.01	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

* 성과보수내역 : 없음

* 발행분담금내역 :

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

▶ 총보수,비용비율

총보수, 비용비율 표를 통해 투자자가 펀드를 통해 부담한 보수와 비용의 수준을 펀드 순자산 연평균잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	전기	0.0013	0	0.0219	0.0954
	당기	0.0012	0	0.0135	0.059
종류(Class)별 현황					
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	전기	1.1455	0	1.1679	0.0982
	당기	1.1456	0	1.1593	0.0591

유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	전기	0.8948	0	0.9174	0.0978
	당기	0.8948	0	0.9097	0.0568
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	전기	1.5466	0	1.569	0.0969
	당기	1.5467	0	1.5605	0.059
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	전기	1.0953	0	1.1183	0.1015
	당기	1.0953	0	1.1103	0.0582
유리트리플알파자[주식혼합]_C/F	전기	0.6943	0	0.715	0.0909
	당기	0.6943	0	0.7071	0.0588
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	전기	0.6441	0	0.6662	0.0834
	당기	0.6441	0	0.6571	0.0608
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	전기	1.1916	0	1.1974	0.0794
	당기	1.1917	0	1.1977	0.0732
유리트리플알파자[주식혼합]_C/S	전기	0	0	0	0
	당기	0.8396	0	0.8458	0.1104

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·종개수수료 비율이란 매매·종개수수료를 순자산 연평잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·종개수수료의 수준을 나타냅니다.

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

7. 투자자산매매내역

매매주식 규모 및 회전을 표와 최근 3분기 매매회전을 추이 표를 통해 당기 및 최근 3분기 동안에 대해 펀드가 수행한 주식거래의 빈도를 확인 할 수 있습니다. 매매회전이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

유리트리플알파모[주식혼합]

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
211,669	20,120	430,562	11,032	130.19	516.50

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균금액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

유리트리플알파모[주식혼합]

(단위 : %)

15년11월15일 ~16년02월14일	16년02월15일 ~16년05월14일	16년05월15일 ~16년08월14일
220.30	305.01	130.19

▶ 매매회전을 변동 사유

당분기 매매회전율이 전분기 대비 감소한 사유는 시장 변동성 축소에 따라 수익기회가 감소하면서 거래가 감소한 것에 기인합니다. 향후 수익기회 증가에 따라 매매회전율은 이전 수준으로 돌아갈 것으로 예상됩니다.