

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 회전율
 - ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

1. 공지 사항

1. 고객님의 가입하신 펀드는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률'(현행법률)의 적용을 받습니다.
2. 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로써 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는 고객님의 가입한 자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안전한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_운용의 자산운용회사인 '유리자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 'KB투자증권, NH투자증권, SK증권, 국민은행, 대신증권, 동부증권, 메리츠종합금융증권, 미래에셋대우, 미래에셋증권, 부국증권, 삼성생명보험, 삼성증권, 신한금융투자, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나금융투자, 한국투자증권, 현대증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
4. 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 :

유리자산운용(주)
금융투자협회

www.yurieasset.co.kr
<http://dis.kofia.or.kr>

/ 02-2168-7900

2. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭	투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_운용, 유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합], 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassA-e, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassA1, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-F, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-P1, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-W, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-e, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC1, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassS	2등급	AM167, AO091, AM197, AM196, AM200, B7605, AM201, AM199, AM198, BE670
펀드의 종류	혼합주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일
운용기간	2016.05.15 ~ 2016.08.14	존속기간
자산운용회사	유리자산운용(주)	펀드재산보관회사
판매회사	KB투자증권, NH투자증권, SK증권, 국민은행, 대신증권, 동부증권, 메리츠종합금융증권, 미래에셋대우, 미래에셋증권, 부국증권, 삼성생명보험, 삼성증권, 신한금융투자, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나금융투자, 한국투자증권, 현대증권	신한은행
상품의 특징	1. 투자대상 이 펀드는 신탁재산의 80% 이상을 국내 상장주식에 투자하는 모펀드인 '유리트리플알파증권모투자신탁(주식혼합)'펀드에 100% 이하로 투자하는 자펀드입니다. 단기 대출 및 금융기관에의 예치 등 유동성 자산에의 투자는 펀드 재산의 10% 범위 내에서 운용할 계획입니다. 단 다음에 해당하는 경우 10%를 초과할 수 있습니다. 1. 환매를 원활하게 하고 투자대기자금을 효율적으로 운용하기 위하여 필요한 경우 2. 수익자에게 최선의 이익이 된다고 판단하는 경우에 투자신탁 자산총액의 20% 이하의 범위 내에서 10% 초과 가능 [유리트리플알파증권모투자신탁(주식혼합)]의 투자대상 이 펀드는 국내주식에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 채권에 투자신탁 자산총액의 50% 미만으로 투자하며, 통신평전락, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 그러나 상기의 투자목적에 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 자산운용사, 신탁업자, 판매회사 등 이 펀드와 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 않습니다.	일반사무관리회사
	2. 투자전략 이 투자신탁은 통신평전락, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 '유리트리플 알파 증권 모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하여 자본소득을 추구하는 자투자신탁입니다. 단기대출 및 금융기관에의 예치 등 유동성 자산에의 투자는 수익증권의 환매를 원활하게 하고 투자 대기자금의 활용을 위해 투자신탁 자산총액의 10% 이하로 운용할 계획입니다. 다만, 집합투자업자가 수익자에게 최선의 이익이 된다고 판단하는 경우에 투자신탁 자산총액의 20% 이하의 범위 내에서 10%를 초과할 수 있습니다. 가) 통신평(Long/Short) 및 차익거래 전략 - 자평가된 자산을 매수함과 동시에 고평가된 자산을 매도하여 수익을 추구합니다. : 우선주/보통주, 섹터간, 섹터내, 스타일별 등의 시장중립형 통신평전락을 활용하여 수익을 추구합니다. - 현·선물 지수차익거래, ETF차익거래 등을 통해 수익을 추구합니다. : 고(자)평가된 선물 매도(매수) & 저(고)평가된 현물 매수(매도) 나) 공모주 및 이벤트 활용 전략 - 공모기업의 펀더멘털, 기업가치, 수급상황 등을 분석을 통해 등록 이후 자본이익 확대 가능성이 높은 공모주를 적극 발굴 및 투자하여 수익을 추구합니다. - 이벤트 투자 전략 : 블록딜(Block Deal), 인수/합병/분사, 공개매수, KOSPI200 / MSCI 등의 정기/비정기 종목교체 등의 이벤트를 활용하여 수익을 추구합니다. 다) 주식시장 이례현상 활용 전략 - 주식시장 월말효과, 시장 과잉반응 등 주식시장의 이례현상을 활용하여 수익을 추구합니다. ※ 월말효과란, 월말 마지막 며칠 동안과 월초 처음 며칠 동안 일시적으로 주가가 상승하는 현상을 말합니다. ※ 상기에 제시된 운용전략은 시장상황 및 운용여건에 따라 변경될 수 있습니다.	하나펀드서비스

3. 위험관리

운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 및 위험관리실무위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 당사 내부의 운용업실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다.

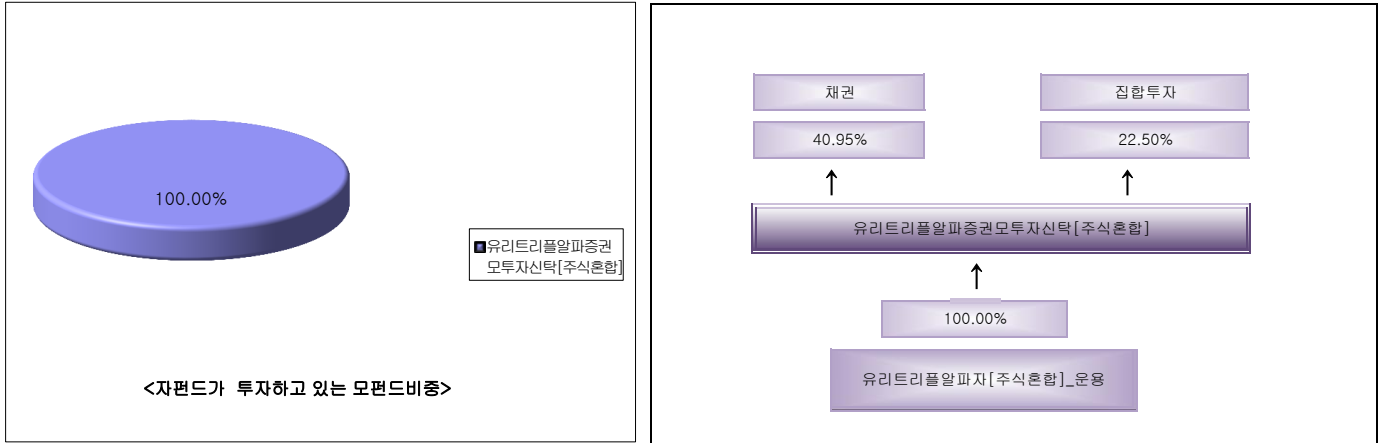
리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다.

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, 백만자, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리트리플알파[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				
유리트리플알파[주식혼합]_C/A1	기준가격	1,006.20	1,008.99	0.28
유리트리플알파[주식혼합]_C/A-e	기준가격	1,007.45	1,010.88	0.34
유리트리플알파[주식혼합]_C/C1	기준가격	1,004.20	1,005.97	0.18
유리트리플알파[주식혼합]_C/C-e	기준가격	1,006.46	1,009.37	0.29
유리트리플알파[주식혼합]_C/F	기준가격	1,008.45	1,012.38	0.39
유리트리플알파[주식혼합]_C/W	기준가격	1,008.71	1,012.77	0.40
유리트리플알파[주식혼합]_C/C-P1	기준가격	1,001.92	1,004.56	0.26
유리트리플알파[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 총최수로 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)

구 분	증 권				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.

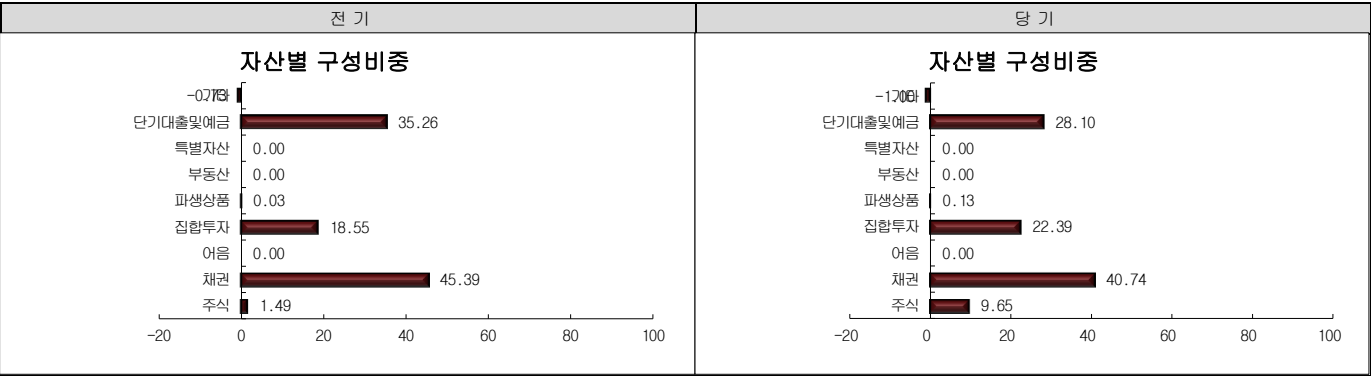
▶ 자산구성현황

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

(단위 : 백만원,%)

통화별 구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	11,019	46,533	0	25,570	149	0	0	0	0	32,095	-1,141	114,226
(0.00)	(9.65)	(40.74)	(0.00)	(22.39)	(0.13)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(28.10)	-(1.00)	(100.00)
합 계	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 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 순포지션비율

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

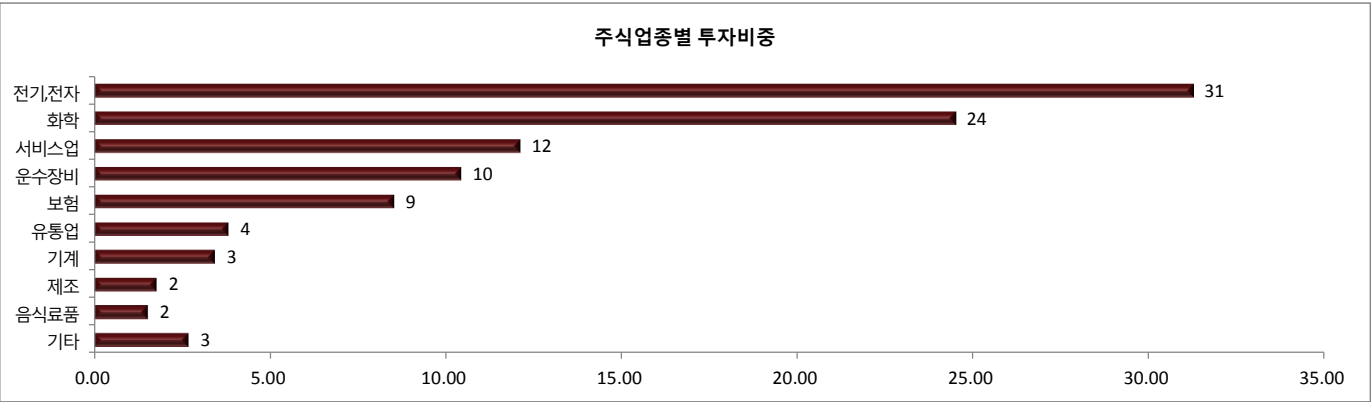
▶ 주식업종별 투자비중

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 : %)

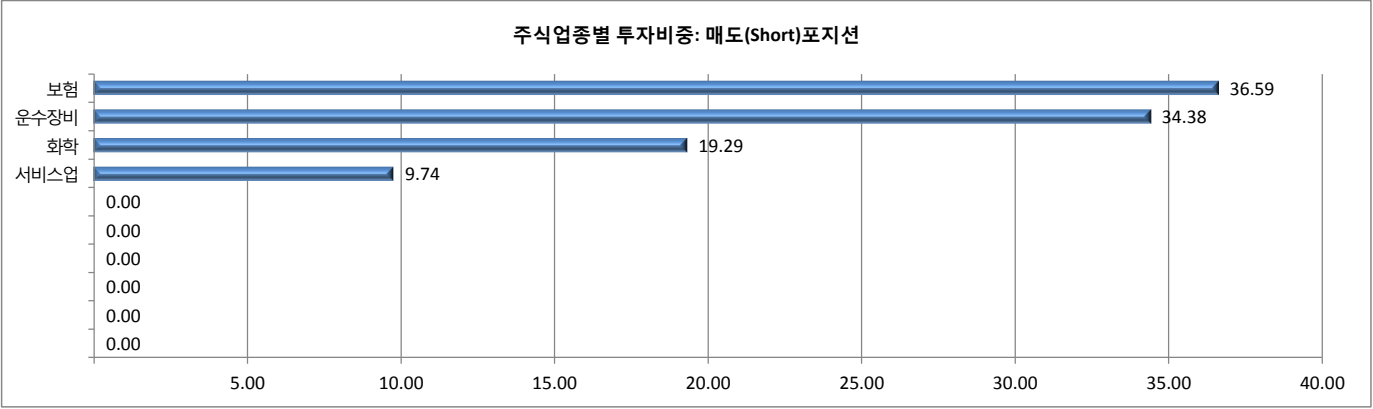
	종목명	비중		종목명	비중
1	전기,전자	31.26	6	유통업	3.81
2	화학	24.49	7	기계	3.42
3	서비스업	12.11	8	제조	1.77
4	운수장비	10.43	9	음식료품	1.52
5	보험	8.52	10	기타	2.67

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	20.77	6	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS	6.95
2	단기상품	CD(우리은행 160811-161110)	13.55	7	단기상품	REPO매수(20160812)	5.92
3	집합투자증권	KBSTAR 단기통안채	11.06	8	채권	농업금융채권(은행)2015-11011.5Y-D	3.15
4	채권	우리은행18-03013갑-26	8.11	9	채권	국고02000-1712(14-6)	2.84
5	단기상품	REPO매수(20160812)	8.00	10	채권	농금채2012-02015Y-S	2.04

※ 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, %)						
	구 분	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. 중개 수수료	단순매매.총개수수료	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. 중개 수수료	단순매매.총개수수료	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. 중개 수수료	단순매매.총개수수료	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. 중개 수수료	단순매매.총개수수료	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. 중개 수수료	단순매매.총개수수료	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(기간평잔) 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 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 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.