

# 자산운용보고서

## 유리트리플알파연금저축증권투자신탁[주식혼합]

(운용기간 : 2016년06월03일 ~ 2016년09월02일)

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>)

# 목 차

- 1 **공지사항**
- 2 **펀드의 개요**
  - ▶ 기본정보
  - ▶ 재산현황
- 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

- 고객님이 가입하신 펀드는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률'(현행법률)의 적용을 받습니다.
  - 고객님이 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로써 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는 고객님이 가입한 자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
  - 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파연금지축증권자투자신탁[주식혼합]의 자산운용회사인 '유리자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '동부증권,미래에셋증권,삼성증권,펀드온라인코리아,하나금융투자,한국투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
  - 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.
- 각종 보고서 확인 : 유리자산운용(주) [www.yurieasset.co.kr](http://www.yurieasset.co.kr) / 02-2168-7900  
금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

## 2. 펀드의 개요

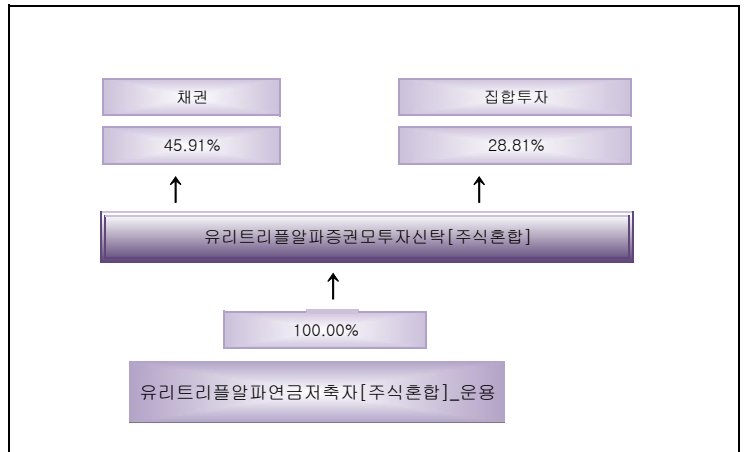
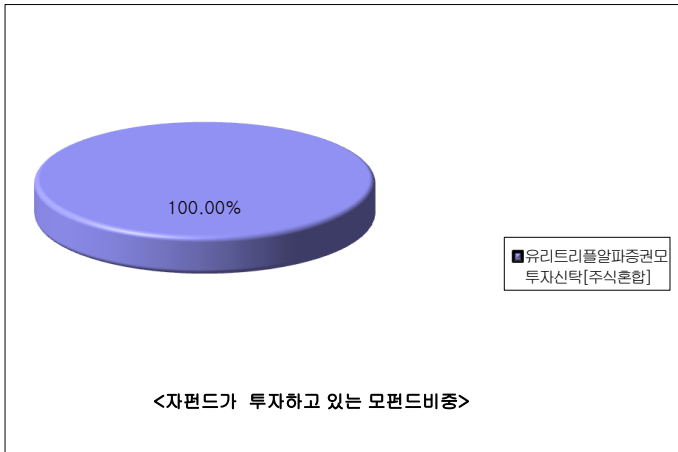
### ▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
유리트리플알파연금지축증권자투자신탁[주식혼합]_운용, 유리트리플알파연금지축증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-e, 유리트리플알파연금지축증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC1, 유리트리플알파연금지축증권자투자신탁[주식혼합]_ClassS-P, 유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]		2등급	AO092, AO111, AO110, BE669, AO091
펀드의 종류	혼합주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.03.03
운용기간	2016.06.03 ~ 2016.09.02	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용(주)	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	동부증권,미래에셋증권,삼성증권,펀드온라인코리아,하나금융투자,한 국투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	<b>1. 투자대상</b> 이 펀드는 신탁재산의 80% 이상을 국내 상장주식에 투자하는 모펀드인 '유리트리플알파증권모투자신탁(주식혼합)'펀드에 100% 이하로 투자하는 자펀드 입니다. 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, 롱숏전략, 공모주 및 이 벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 그러나 상기의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 자산운용사, 신탁업자, 판매회사 등 이 펀드와 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또 는 투자목적의 달성을 보장하지 않습니다.		
	<b>2. 투자전략</b> 이 투자신탁은 롱숏전략, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하 는 '유리 트리플 알파 증권 모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하여 자본소득을 추구하는 자투자신탁입니다. 단기대출 및 금융기관에의 예치 등 유동성자산에의 투자는 수익증권의 환매를 원활하게 하고 투자 대기자금의 활용을 위해 투자신탁 자산 총액의 10% 이하로 운용할 계획입니다. 다만, 집합투자업자가 수익자에게 최선의 이익이 된다고 판단하는 경우에 투자신탁 자산총액의 20% 이하의 범위 내에서 10%를 초과할 수 있습니다.  가) 롱숏(Long/Short) 및 차익거래 전략 - 저평가된 자산을 매수함과 동시에 고평가된 자산을 매도하여 수익을 추구합니다. : 우선주/보통주, 섹터간, 섹터내, 스타일별 등의 시장중립형 롱숏전략을 활용하여 수익을 추구합니다. - 현·선물 지수차익거래, ETF차익거래 등을 통해 수익을 추구합니다. : 고(저)평가된 선물 매도(매수) & 저(고)평가된 현물 매수(매도)  나) 공모주 및 이벤트 활용 전략 - 공모기업의 펀더멘탈, 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.		
	<b>3. 위험관리</b> 운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 및 위험관리실무위 원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 당사 내부의 운용업무에 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 수행합니 다. 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 집합투자증권에 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
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_운용	자산 총액 (A)	10,999	10,819	-1.63
	부채 총액 (B)	5	6	37.52
	순자산총액 (C=A-B)	10,994	10,813	-1.65
	발행 수익증권 총 수 (D)	10,956	10,731	-2.06
	기준가격 <sup>주)</sup> (E=C/D×1000)	1,003.44	1,007.67	0.42
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1	기준가격	1,000.11	1,000.98	0.09
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e	기준가격	1,001.18	1,003.13	0.19
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P	기준가격	0.00	999.20	-0.08

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

금분기에는 보통주-우선주 괴리확대를 이용해 주요 대형 우선주의 차익거래 전략 (우선주 매수, 보통주 매도)의 비중을 6% 수준까지 확대하였습니다. 이벤트 부문에서는 7건의 IPO 진입 및 이익 청산이 있었으며, 3건의 신규 블록딜을 활용한 포지션 진입이 있었습니다. 전략별로는 8월 말 기준 우선주차익거래 비중 6%, 바스켓롱숏 비중 3%, 섹터 내 롱숏 1%, 이벤트 0.4%로 포트폴리오를 구성하였습니다

#### ▶ 투자환경 및 운용 계획

국내증시는 대외적으로 1)도이치 뱅크 사태의 확산 여부, 2)OPEC 감산 합의에 따른 세부적인 합의 도출 여부, 3)중국 경착륙 우려 및 위안화 안정 여부, 4)유럽중앙은행 및 일본은행의 추가적인 경기 부양 정책, 5)유가와 환율의 움직임이 증시의 방향을 결정할 것으로 보이며, 대내적으로는 6)국내 기업실적 개선 여부, 7)외국인을 비롯한 기관들의 수급 변화 여부가 중요한 변수가 될 것으로 판단됩니다.

연말 배당시즌이 다가옴에 따라 작년말 이후 장기적인 조정을 받은 우선주의 강세전환을 예상하며, 이에 따라 우선주매수-보통주매도 포지션의 수익기회 확대를 이용하여 우선주 차익거래를 적극적으로 활용할 예정입니다. IPO 또한 10월, 11월에 기회가 증가하나, 최근 IPO시장의 고평가 우려 및 기대수익률 저하에 따라 철저한 위험관리를 통해 안정적인 수익을 확보하고자 합니다.

▶ 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
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_운용	0.42	0.77	1.67	2.90
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_C/C1	0.09	0.10	0.66	1.54
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_C/C-e	0.19	0.31	0.99	1.98
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_C/S-P	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_운용	2.90	8.08	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_C/C1	1.54	5.27	-	-
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_C/C-e	1.98	6.16	-	-
유리트리플알파연금지축자[주식혼합]_C/S-P	-	-	-	-

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	-6	19	0	7	3	0	0	0	0	15	0	37
당 기	41	20	0	6	-30	0	0	0	0	10	-6	41

4. 자산현황

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

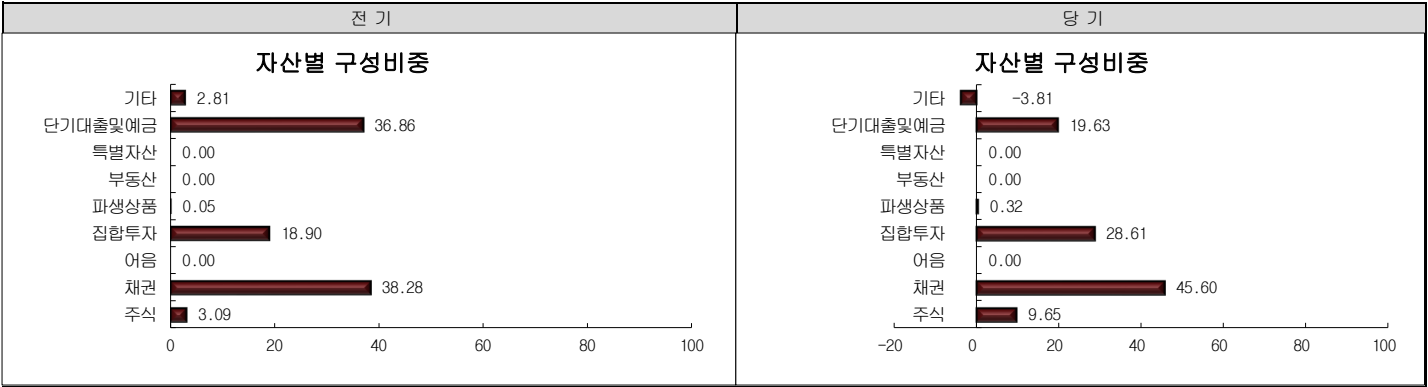
▶ 자산구성현황

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		단기대출및예 금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	1,044	4,934	0	3,095	35	0	0	0	0	2,124	-412	10,819
(0.00)	(9.65)	(45.60)	(0.00)	(28.61)	(0.32)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(19.63)	-(3.81)	(100.00)
합 계	1,044	4,934	0	3,095	35	0	0	0	0	2,124	-412	10,819

\* ( ) : 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 구분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및예 금	기타	자산별합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
매수 포지션 (0.00)	1,044 (9.65)	4,934 (45.60)	0 (0.00)	3,095 (28.61)	35 (0.32)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,275 (11.79)	436 (4.03)	10,819 (100.00)
매도 포지션 (0.00)	154 (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)	154 (100.00)
순포지 션 (0.00)	890 (8.35)	4,934 (46.26)	0 (0.00)	3,095 (29.02)	35 (0.32)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,275 (11.96)	436 (4.09)	10,666 (100.00)

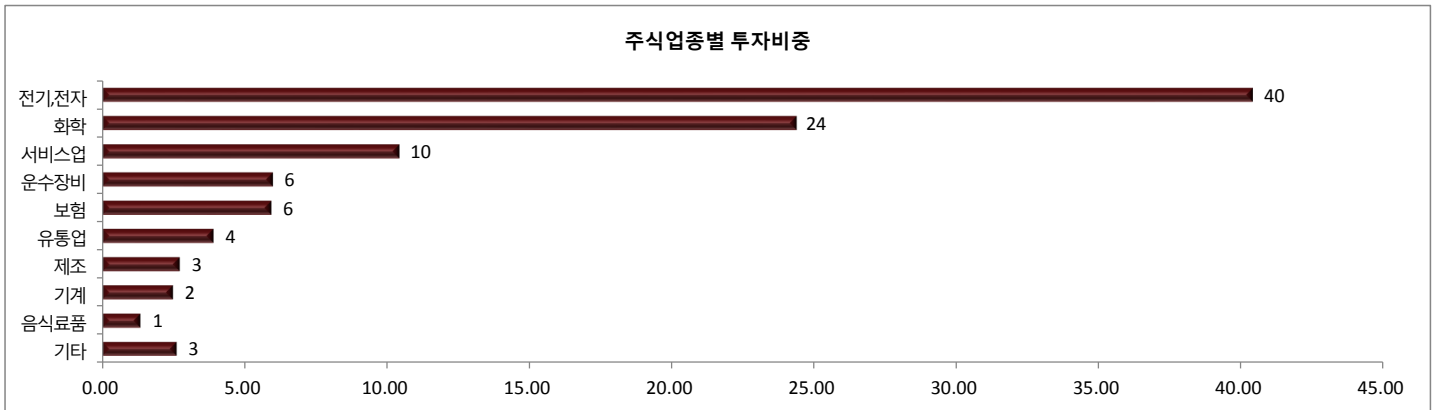
## ▶ 주식업종별 투자비중

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 : %)

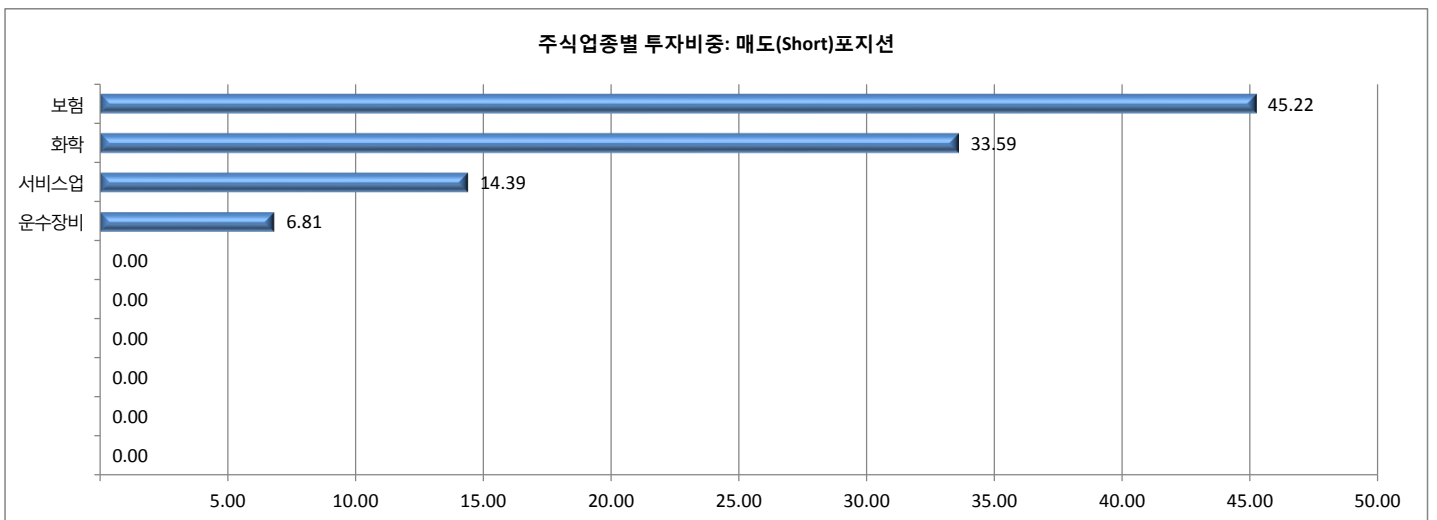
	종목명	비중		종목명	비중
1	전기,전자	40.40	6	유통업	3.89
2	화학	24.30	7	제조	2.71
3	서비스업	10.40	8	기계	2.47
4	운수장비	5.97	9	음식료품	1.34
5	보험	5.92	10	기타	2.60

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	45.22	6		
2	화학	33.59	7		
3	서비스업	14.39	8		
4	운수장비	6.81	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	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS	13.00	6	채권	국고02000-1712(14-6)	6.55
2	채권	통안0171-1704-02	11.74	7	채권	통안0127-1708-01	4.85
3	집합투자증권	KBSTAR 단기통안채	11.19	8	단기상품	REPO매수(20160902)	4.37
4	채권	우리은행18-03013갑-26	8.21	9	단기상품	은대(신한은행)	3.73
5	단기상품	CD(수협중앙회 160902-161202)	8.06	10	채권	농업금융채권(은행)2015-11011.5Y-D	3.17

※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	1,264	1,271	대한민국	KRW	2015-04-02	2017-04-02		-	11.74
우리은행18-03013갑-26	875	888	대한민국	KRW	2014-03-26	2017-03-26		AAA	8.21
국고02000-1712(14-6)	700	709	대한민국	KRW	2014-12-10	2017-12-10		-	6.55
통안0127-1708-01	525	525	대한민국	KRW	2016-08-09	2017-08-09		-	4.85
농업금융채권(은행)2015-11011.5	341	343	대한민국	KRW	2015-11-27	2017-05-27		AAA	3.17

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

## ▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 단기채권PLUS	수익증권	삼성자산운용	1,401	1,406	대한민국	KRW	13.00
KBSTAR 단기통안채	수익증권	KB자산운용	1,202	1,210	대한민국	KRW	11.19

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
예금	신한은행	2014-03-03	67	0.92		대한민국	KRW
예금	신한은행	2014-01-27	336	0.92		대한민국	KRW
REPO매수	KIDB자금중개	2016-09-02	437	0.01		대한민국	KRW
CD	수협중앙회	2016-09-02	875	1.33	2016-12-02	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	71	10,044	8	11,636	2109000507
박주호	퀀트운용팀장	1969	60	9,480			2109000457
윤준수	채권운용본부장	1967	86	27,089	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, 매매중개수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

	구 분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
유리트리플알파연금저축자[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**	0.13	0.00	0.14	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1.40	0.01	1.74	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.16	0.00	0.35	0.00
		합계	1.56	0.01	2.09	0.02
증권거래세	2.12	0.02	3.01	0.03		
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1	자산운용사	10.97	0.11	10.84	0.11	
	판매회사	21.68	0.21	21.42	0.21	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.64	0.01	0.63	0.01	
	일반사무관리회사	0.38	0.00	0.38	0.00	
	보수합계	33.68	0.33	33.26	0.33	
	기타비용**	0.19	0.00	0.19	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1.30	0.01	1.61	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.15	0.00	0.32	0.00
		합계	1.46	0.01	1.93	0.02
증권거래세	1.97	0.02	2.79	0.03		
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e	자산운용사	0.83	0.11	0.87	0.11	
	판매회사	0.82	0.11	0.86	0.11	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.05	0.01	0.05	0.01	
	일반사무관리회사	0.03	0.00	0.03	0.00	
	보수합계	1.73	0.23	1.80	0.23	
	기타비용**	0.01	0.00	0.01	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.10	0.01	0.13	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.03	0.00
		합계	0.11	0.01	0.15	0.02
증권거래세	0.15	0.02	0.22	0.03		
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P	자산운용사	0.00	0.00	0.00	0.05	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.03	
	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	0.08	
	기타비용**	0.00	0.00	0.00	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.01
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 비율을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

▶ 총보수,비용비율

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

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_운용	전기	0	0	0.0193	0.0764
	당기	0	0	0.0122	0.0587
종류(Class)별 현황					
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1	전기	1.326	0	1.3456	0.0769
	당기	1.326	0	1.3384	0.0588
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e	전기	0.8995	0	0.917	0.0709
	당기	0.8996	0	0.9111	0.059
유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P	전기	0	0	0	0
	당기	0.6343	0	0.6393	0.0764

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

주3) 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비율을 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 <sup>주)</sup>	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
209,925	18,947	461,862	12,079	116.09	460.55

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

유리트리플알파모[주식혼합]

(단위 : %)

15년12월03일 ~16년03월02일	16년03월03일 ~16년06월02일	16년06월03일 ~16년09월02일
185.99	292.17	116.09

▶ 매매회전을 변동 사유

유리트리플알파모[주식혼합]

(단위 : %)

금분기에는 7-8월 시장변동성 및 거래량이 감소함에 따라 본 펀드의 주요 전략인 우선주 차익거래 포지션 진입 및 청산 기회가 전분기 대비 감소하여 매매회전율이 감소하였습니다.