

자산운용보고서

유리KOSPI200인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]

(운용기간 : 2016년08월28일 ~ 2016년11월27일)

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

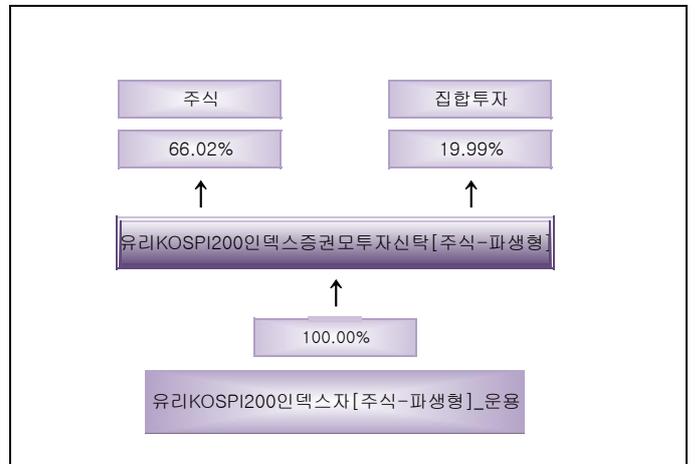
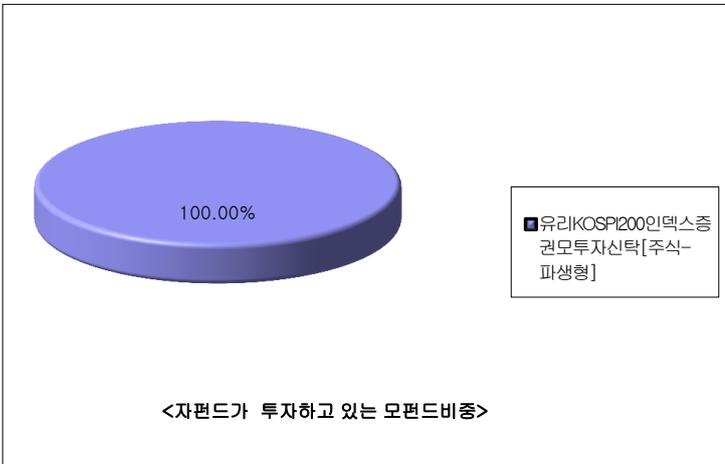
- ▶ 매매주식규모 및 회전율
- ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

4. 수익구조

신탁재산의 대부분을 주식 및 주식관련파생상품에 투자하는 모펀드에 투자하는 펀드로서, 투자대상 주식 시세의 등락 및 배당으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 모펀드에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 펀드의 성과에 영향을 미치게 됩니다. 주식의 시세는 해당 주식 발행기업의 경영성과 및 주식에 대한 시장의 수급 등의 요인에 의해 결정되며 이러한 요인은 경제, 정치, 자연, 사회, 문화 등 다양한 변수의 영향을 받습니다. 투자대상 주식 발행기업의 경영성과가 우수할수록, 투자대상 주식에 대한 수요가 공급보다 클수록 주식의 시세는 상승하는 경향을 나타내어 펀드의 가치가 상승하고, 반대의 경우에는 펀드의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다.

펀드의 성과는 비교지수의 성과와 비교지수 대비 추적오차에 의해 결정됩니다. 일반적으로 '비교지수 대비 추적오차' 보다는 '비교지수의 성과'로부터 월등히 높은 수준의 영향을 받게 됩니다. 비교지수[KOSPI200지수]의 성과와 유사한 성과의 달성을 그 투자목적으로 하는 바, 비교지수의 성과로부터 절대적인 영향을 받습니다. 일반적으로 환매시점의 비교지수가 매입시점의 비교지수보다 높으면 높을수록 큰 투자수익이 발생하며, 반대로 환매시점의 비교지수가 매입시점의 비교지수보다 낮으면 낮을수록 투자손실이 커지게 됩니다. 펀드의 성과는 자본이득, 배당수입, 이자수입으로 구분할 수 있으며 일반적으로 자본이득이 성과에 미치는 영향이 절대적인 비중을 차지합니다.

▶ 펀드 구성



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

▶ 자산현황

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

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_운용	자산 총액 (A)	8,468	8,608	1.65
	부채 총액 (B)	38	0	-99.25
	순자산총액 (C=A-B)	8,431	8,607	2.10
	발행 수익증권 총 수 (D)	8,494	8,810	3.72
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	992.57	977.00	-1.57
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C	기준가격	963.54	944.85	-1.94
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A	기준가격	978.71	961.64	-1.74
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S	기준가격	977.30	960.06	-1.76
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e	기준가격	980.88	964.05	-1.72
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	기준가격	973.27	955.62	-1.81

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

글로벌 주식시장은 8월에는 기업의 실적개선, 경제지표 호조 등의 긍정적인 영향과 지속적인 상승에 따른 차익매출출현, 미국 기준금리 인상 시기 불확실성 증가 등의 부정적인 영향으로 등락을 반복하였습니다. 9월에는 미국 기준금리 인상 시기 연기, 미국 대선 TV토론에서 클린턴의 우세, OPEC 감산 합의, 도이치뱅크 사태의 불확실성 증가 등의 이유로 등락을 반복하면서 보합세를 유지하였습니다. 10월에는 미국 대선 불확실성 및 기준금리 인상 가능성 증가, 영국과 유럽연합이 완전히 단절되는 하드 브렉시트 우려로 투자심리가 위축되며 하락하는 모습을 보였습니다.

국내증시는 8월에는 외국인의 매수세 지속, 한국의 국가 신용등급 상황, 주요국 경제지표 호조에 따른 글로벌 경제침체 우려 완화 등으로 인해 긍정적인 영향을 받으면서 소폭 상승으로 마감을 하였습니다. 9월에는 미국의 기준금리 인상시기를 연기, OPEC 감산 합의 등의 호재에도 불구하고, 북한의 지정학적 리스크 증가, 도이치뱅크 리스크 증가 등의 비우호적인 요인들로 등락을 반복하다가 소폭 상승으로 마감을 하였습니다. 10월에는 미국 대선 불확실성, 미국의 연내 금리 인상 가능성, ECB 테이퍼링 우려, 영국의 하드 브렉시트 우려 등의 이유로 하락세를 보였습니다.

▶ 투자환경 및 운동

다음 분기에는 대외적으로 1)미국 기준금리 인상 불확실성, 2)유럽발 리스크 증가 여부, 3)중국 당국의 한류 규제 강화 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.

이와 같은 주요 이슈에 주목하며 안정적인 포트폴리오 관리에 주력할 것이며, 재무구조가 상대적으로 악화된 그룹 및 기업에 대해서는 지속적인 모니터링을 통해 신용위험을 관리할 예정입니다.

동 펀드는 제한적인 범위 내에서 계량모델(가치모델, 모멘텀모델, 이례현상 등)에 근거한 스타일바스켓 편입, 페어 트레이딩, 공모주(IPO) 투자 등을 통하여 초과수익을 추구할 계획입니다.

▶ 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
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_운용 (비교지수 대비 성과)	-1.57 (-0.02)	4.13 (-0.18)	6.71 (-0.53)	2.23 (0.95)
종류(Class)별 현황				
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C (비교지수 대비 성과)	-1.94 (-0.39)	3.36 (-0.94)	5.54 (-1.71)	0.73 (-0.55)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A (비교지수 대비 성과)	-1.74 (-0.19)	3.76 (-0.54)	6.16 (-1.09)	1.51 (0.23)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S (비교지수 대비 성과)	-1.76 (-0.21)	3.72 (-0.58)	6.09 (-1.15)	1.44 (0.16)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e (비교지수 대비 성과)	-1.72 (-0.17)	3.82 (-0.48)	6.24 (-1.00)	1.63 (0.35)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e (비교지수 대비 성과)	-1.81 (-0.26)	3.62 (-0.68)	5.94 (-1.31)	1.23 (-0.05)
비교지수(벤치마크)	-1.55	4.30	7.24	1.28

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI200 100.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_운용 (비교지수 대비 성과)	2.23 (0.95)	2.59 (3.01)	-1.15 (4.43)	16.34 (7.15)
종류(Class)별 현황				
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C (비교지수 대비 성과)	0.73 (-0.55)	-0.41 (0.00)	-5.44 (0.13)	8.05 (-1.14)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A (비교지수 대비 성과)	1.51 (0.23)	1.16 (1.57)	-3.20 (2.37)	12.34 (3.15)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S (비교지수 대비 성과)	1.44 (0.16)	1.01 (1.42)	-	-
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e (비교지수 대비 성과)	1.63 (0.35)	1.39 (1.80)	-	-
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e (비교지수 대비 성과)	1.23 (-0.05)	0.60 (1.01)	-	-
비교지수(벤치마크)	1.28	-0.41	-5.57	9.19

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI200 100.0%

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

▶ 추적오차

추적오차 표를 통해 자산운용보고서 작성일 현재(당기말) 각 기간에 대해서 인덱스 펀드가 추종하는 지수의 변동을 얼마나 충실히 따라 갔는지를 확인 할 수 있습니다.

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
추적오차	0.88	0.83	1.69

주) 추적오차란 일정기간 동안 인덱스펀드가 추종하는 특정 비교지수의 변동을 얼마나 충실히 따라갔는지를 보여주는 지표로서, 비교지수 수익률 대비 해당 인덱스펀드의 일간 수익률 차이의 표준편차로 기재합니다. 추적오차의 수치가 적을수록 해당 기간 동안 인덱스펀드가 비교지수와 유사하게 움직였음을 의미합니다.

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	362	0	0	139	87	0	0	0	0	4	1	593
당기	-73	0	0	-22	-23	0	0	0	0	3	1	-114

4. 자산현황

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

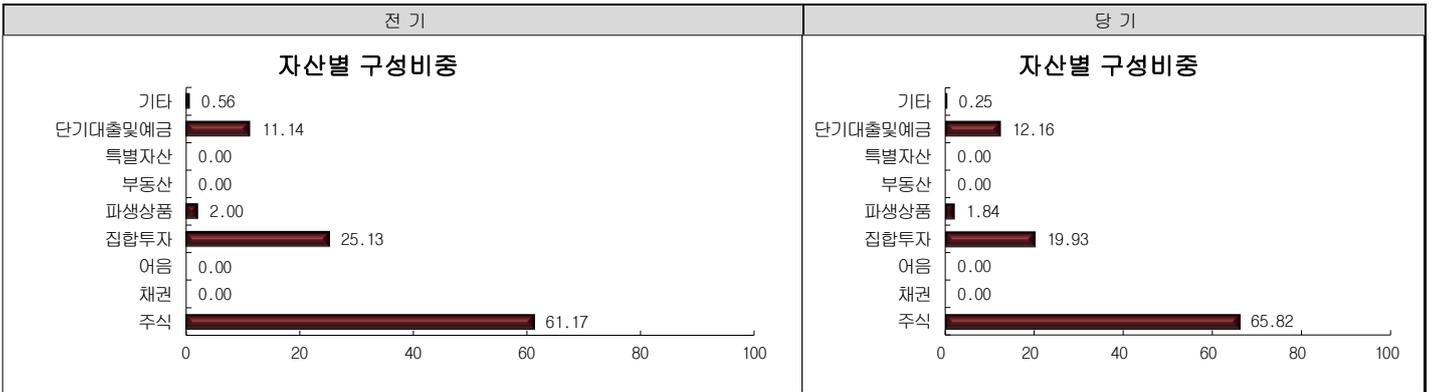
▶ 자산구성현황

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 구성비율을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW (0.00)	5,666 (65.82)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,716 (19.93)	159 (1.84)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,047 (12.16)	21 (0.25)	8,608 (100.00)
합계	5,666	0	0	1,716	159	0	0	0	0	1,047	21	8,608

* () : 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.

▶ 주식업종별 투자비중

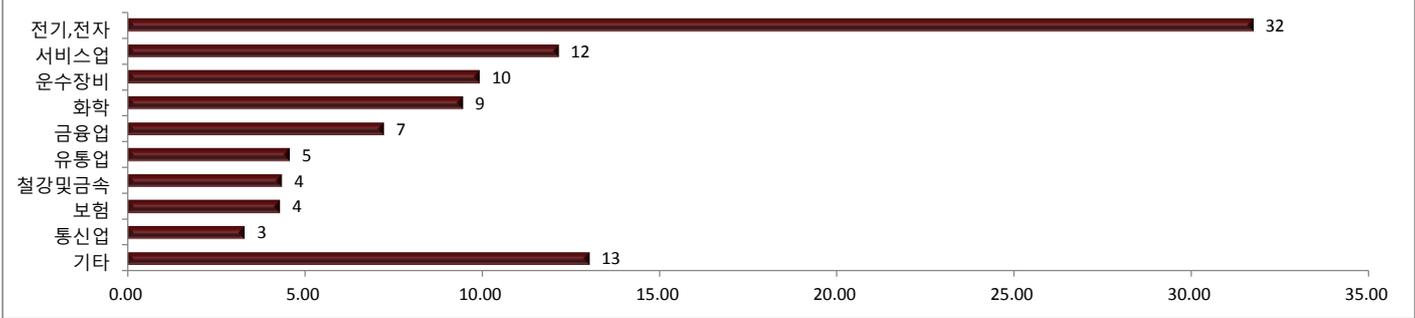
주식업종별 투자비중 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 투자하고 있는 주식자산의 업종별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드가 보유한 주식자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	전기, 전자	31.74	6	유통업	4.57
2	서비스업	12.15	7	철강및금속	4.35
3	운수장비	9.92	8	보험	4.29
4	화학	9.45	9	통신업	3.30
5	금융업	7.22	10	기타	13.01

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

주식업종별 투자비중



▶ 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	주식	삼성전자	6	주식	SK하이닉스
2	파생상품	코스피200 F 201612	7	주식	NAVER
3	단기상품	은대(국민은행)	8	주식	POSCO
4	집합투자증권	TREX 200	9	주식	현대차
5	집합투자증권	TIGER 200	10	주식	신한지주

※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.

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	831	1,370	15.92	대한민국	KRW	전기, 전자	
SK하이닉스	4,753	202	2.35	대한민국	KRW	전기, 전자	
NAVER	211	170	1.97	대한민국	KRW	서비스업	
POSCO	599	158	1.83	대한민국	KRW	철강및금속	
현대차	1,118	152	1.77	대한민국	KRW	운수장비	
신한지주	3,398	149	1.74	대한민국	KRW	금융업	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
TREX 200	수익증권	유리자산운용	930	937	대한민국	KRW	10.89
TIGER 200	수익증권	미래에셋자산운용	769	775	대한민국	KRW	9.01

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 201612	매수	8	1,108	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2007-01-01	2	0.92		대한민국	KRW
예금	국민은행	2012-11-19	1,044	0.92		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	9,794	8	11,636	2109000507
박주호	퀀트운용팀장	1969	60	9,212			2109000457

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, 매매중계수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_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**	0.00	0.00	0.00	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.79	0.01	0.58	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.68	0.01	0.38	0.00
		합계	1.47	0.01	0.96	0.01
		증권거래세	7.94	0.08	1.66	0.02
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C	자산운용사	7.27	0.11	6.14	0.11	
	판매회사	16.79	0.25	14.17	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.50	0.01	0.43	0.01	
	일반사무관리회사	0.25	0.00	0.21	0.00	
	보수합계	24.82	0.37	20.94	0.37	
	기타비용**	0.04	0.00	0.04	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.52	0.01	0.40	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.46	0.01	0.26	0.00
		합계	0.98	0.01	0.66	0.01
		증권거래세	5.36	0.08	1.15	0.02
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A	자산운용사	3.32	0.11	2.53	0.11	
	판매회사	1.69	0.06	1.29	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.23	0.01	0.18	0.01	
	일반사무관리회사	0.11	0.00	0.09	0.00	
	보수합계	5.35	0.18	4.08	0.18	
	기타비용**	0.02	0.00	0.01	0.00	

	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.25	0.01	0.17	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.21	0.01	0.11	0.00
		합계	0.46	0.02	0.28	0.01
	증권거래세		2.39	0.08	0.47	0.02
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S	자산운용사		0.00	0.11	0.00	0.11
	판매회사		0.00	0.08	0.00	0.08
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.20	0.00	0.20
	기타비용**		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
합계		0.00	0.01	0.00	0.01	
증권거래세		0.00	0.08	0.00	0.02	
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e	자산운용사		0.16	0.11	0.12	0.11
	판매회사		0.04	0.03	0.03	0.03
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.22	0.15	0.17	0.15
	기타비용**		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.01	0.01	0.01	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.01	0.01	0.00
		합계	0.02	0.01	0.01	0.01
	증권거래세		0.11	0.08	0.02	0.02
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	자산운용사		0.10	0.11	0.09	0.11
	판매회사		0.12	0.13	0.11	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.23	0.25	0.21	0.25
	기타비용**		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.01	0.01	0.01	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.01	0.00	0.00
		합계	0.01	0.01	0.01	0.01
	증권거래세		0.07	0.08	0.02	0.02

* 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 연평균잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_운용	전기	0	0	0	0.0565
	당기	0	0	0	0.0552
종류(Class)별 현황					
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C	전기	1.4847	0	1.4847	0.0561
	당기	1.4847	0	1.4847	0.0547
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A	전기	0.7025	0	0.7025	0.0575
	당기	0.7025	0	0.7025	0.0564
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S	전기	0.7795	0	0.7795	0.0552
	당기	0.7795	0	0.7795	0.0534
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e	전기	0.5914	0	0.5914	0.0561
	당기	0.5908	0	0.5908	0.0553
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	전기	0.9806	0	0.9806	0.0555
	당기	0.9806	0	0.9806	0.0542

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

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 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 회전을

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
18,734	1,134	9,813	571	10.72	42.54

주) 해당 운용기간 중 매도한 주가가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

(단위 : %)

16년02월28일 ~16년05월27일	16년05월28일 ~16년08월27일	16년08월28일 ~16년11월27일
35.01	42.90	10.72

*매매회전을 변동 사유: KOSPI200정기변경 이벤트의 부재로 매매로 회전을 하락함.