

자산운용보고서

유리트리플알파연금저축증권투자신탁[주식혼합]

(운용기간 : 2016년12월03일 ~ 2017년03월02일)

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

1. 고객님의 가입하신 펀드는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률'(현행법률)의 적용을 받습니다.
2. 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로서 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는 고객님의 가입한 자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파연금저축증권자투자신탁[주식혼합]의 자산운용회사인 '유리자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '동부증권,미래에셋대우,미래에셋증권,삼성증권,펀드온라인코리아,하나금융투자,한국투자증권'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

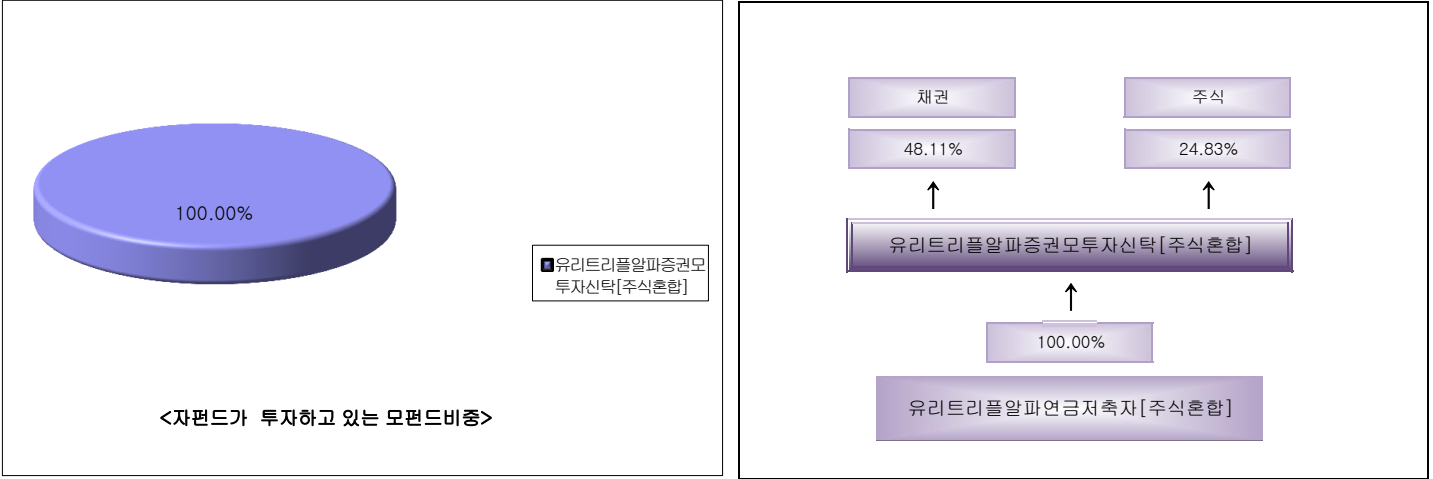
2. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

| 펀드 명칭 | | 투자위험등급 | 금융투자협회 펀드코드 |
|---|--|----------|---|
| 유리트리플알파연금저축증권자투자신탁[주식혼합]_운용, 유리트리플알파연금저축증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-e, 유리트리플알파연금저축증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC1, 유리트리플알파연금저축증권자투자신탁[주식혼합]_ClassS-P, 유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합] | | 2등급 | AO092, AO111, AO110, BE669, AO091 |
| 펀드의 종류 | 혼합주식형, 추가형, 종류형, 모자형 | 최초설정일 | 2014.03.03 |
| 운용기간 | 2016.12.03 ~ 2017.03.02 | 존속기간 | 추가형으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 자산운용회사 | 유리자산운용(주) | 펀드재산보관회사 | 신한은행 |
| 판매회사 | 동부증권,미래에셋대우,미래에셋증권,삼성증권,펀드온라인코리아,하나금융투자, 한국투자증권 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 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, 통신평가, 공모주 및 이벤트 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 또는 투자목적의 달성을 보장하지 않습니다. | | |
| | 2. 투자전략 이 투자신탁은 통신평가, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 '유리 트리플 알파 증권 모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하여 자본소득을 추구하는 자투자신탁입니다. 단기 대출 및 금융기관에의 예치 등 유동성자산에의 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) 통신평가(Long/Short) 및 차익거래 전략 - 저평가된 자산을 매수함과 동시에 고평가된 자산을 매도하여 수익을 추구합니다. : 우선주/보통주, 섹터간, 스타일별 등의 시장중립형 통신평가 전략을 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 펀더멘털, 기업가치, 급급상황 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. | | |

| | |
|--|---|
| | 3. 위험관리 운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회 및 위험관리위원회에서 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, 백만좌, %)

| 펀드명칭 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|--------------------------|---------------------------------|----------|----------|--------|
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_운용 | 자산 총액 (A) | 10,441 | 9,375 | -10.21 |
| | 부채 총액 (B) | 41 | 16 | -61.22 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 10,400 | 9,359 | -10.01 |
| | 발행 수익증권 총 수 (D) | 10,304 | 9,211 | -10.61 |
| | 기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000) | 1,009.27 | 1,016.13 | 0.68 |
| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1 | 기준가격 | 999.27 | 1,002.79 | 0.35 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e | 기준가격 | 1,002.48 | 1,007.06 | 0.46 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P | 기준가격 | 999.30 | 1,004.60 | 0.53 |

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.

※ 분배금 내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

| 구분 | 분배금지급일 | 분배금지급금액 | 분배후수탁고 | 기준가격(원) | | 비고 |
|--------------------------|----------|---------|--------|----------|----------|----|
| | | | | 분배금 지급전 | 분배금 지급후 | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_운용 | 20170303 | 123 | 9,211 | 1,016.13 | 1,002.77 | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1 | 20170303 | 2 | 8,746 | 1,002.79 | 1,002.59 | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e | 20170303 | 2 | 559 | 1,007.06 | 1,002.75 | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P | 20170303 | 0 | 0 | 1,004.60 | 1,000.00 | |

주) 분배후수탁고는 분배금이 전부 재투자된다는 가정하에 작성된 자료입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동분기 본 펀드의 수익률은 보수전 기준 0.68%를 기록하였습니다.

1월 이후 삼성전자의 자사주 매입 개시 이후 우선주의 상대성과가 개선되면서 삼성전자 우선주 페어 포지션에 대한 점진적인 이익실현이 있었으며 기타 대형 우선주 페어의 변동성이 확대됨에 따라 비중 확대하였습니다. 바스켓 통신평의 성과가 개선 지속되었고 섹터내 기업간 통신평 전략 비중을 점진적으로 확대하였습니다. (약 4% 수준)

당분기 다수의 중소형 IPO에 참여하여 비중은 크지 않았으나 수익실현하였고, Post-IPO 전략으로 상장후 공모가 하회하는 종목에 진입 및 이익 청산하였습니다. 기존 이벤트 포지션(블록딜)에 대한 일부 이익청산하였으며, 신규 블록딜 2건에 신규 진입하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용

국내 증시는 국내외 경제지표 호조, 글로벌 증시 상승에 따른 투자심리 개선, 외국인 순매수 지속으로 연초 이후의 상승세를 지속하였으나, 분기 후반으로 갈수록 대내외 불확실성 증가에 따른 차익실현 매물 출회로 상승세가 약화되는 모습을 보였습니다. 수주증가 모멘텀이 부각된 건설업과 업종 순환에 성격의 저가매수세가 유입된 의약품 업종이 강세를 보인 반면, 차익실현 매물이 출회된 전기전자와 보수적 가이던스로 인해 투자심리가 약화된 보험 업종은 약세를 보였습니다.

연초이후 지속적으로 시장 변동성이 감소하여 2월 23일 KOSPI 변동성지수가 사상 최저치를 기록하는 등 낮은 변동성이 유지되고 있는 점이 펀드 성과 개선을 제약하고 있으나, 미국, 유럽 등의 지정학적 리스크 증가에 따라 점진적으로 변동성은 증가할 것으로 예상됩니다. 변동성 증가는 차익거래기회의 증가로 이어져 펀드 성과에 긍정적인 효과를 가져올 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 |
|--------------------------|--------|--------|--------|---------|
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_운용 | 0.68 | 0.84 | 1.26 | 1.61 |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1 | 0.35 | 0.18 | 0.27 | 0.28 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e | 0.46 | 0.39 | 0.59 | 0.71 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P | 0.53 | 0.54 | - | - |

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_운용 | 1.61 | 5.98 | 14.93 | - |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1 | 0.28 | 3.22 | 10.48 | - |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e | 0.71 | 4.10 | - | - |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P | - | - | - | - |

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 | 4 | 9 | 0 | 10 | -9 | 0 | 0 | 0 | 0 | 5 | -1 | 17 |
| 당 기 | 248 | 23 | 0 | -34 | -166 | 0 | 0 | 0 | 0 | 4 | -7 | 69 |

4. 자산현황

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

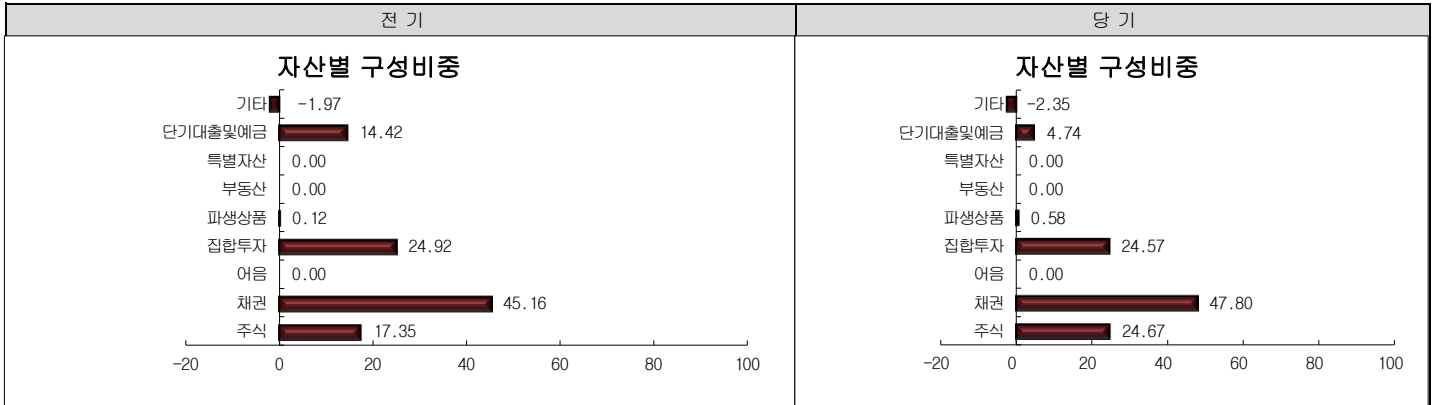
▶ 자산구성현황

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 | 증 권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|---------------|------------------|------------------|-------------|------------------|--------------|-------------|-------------|-------------|-------------|---------------|-----------------|-------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| KRW (0.00) | 2,313 (24.67) | 4,481 (47.80) | 0 (0.00) | 2,303 (24.57) | 54 (0.58) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 444 (4.74) | -220 (-2.35) | 9,375 (100.00) |
| 합 계 | 2,313 | 4,481 | 0 | 2,303 | 54 | 0 | 0 | 0 | 0 | 444 | -220 | 9,375 |

* () : 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 산출한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 순포지션비율

| 통화별 구분 | 증 권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출및 예금 | 기타 | 자산별합계 |
|---------------------|------------------|------------------|-------------|------------------|--------------|-------------|-------------|-------------|-------------|---------------|-----------------|-------------------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 매수 포지션 (0.00) | 2,313 (24.67) | 4,481 (47.80) | 0 (0.00) | 2,303 (24.57) | 54 (0.58) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 444 (4.74) | -220 (-2.35) | 9,375 (100.00) |
| 매도 포지션 (0.00) | 238 (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) | 238 (100.00) |
| 순포지 션 (0.00) | 2,075 (22.71) | 4,481 (49.05) | 0 (0.00) | 2,303 (25.21) | 54 (0.59) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 0 (0.00) | 444 (4.86) | -220 (-2.41) | 9,137 (100.00) |

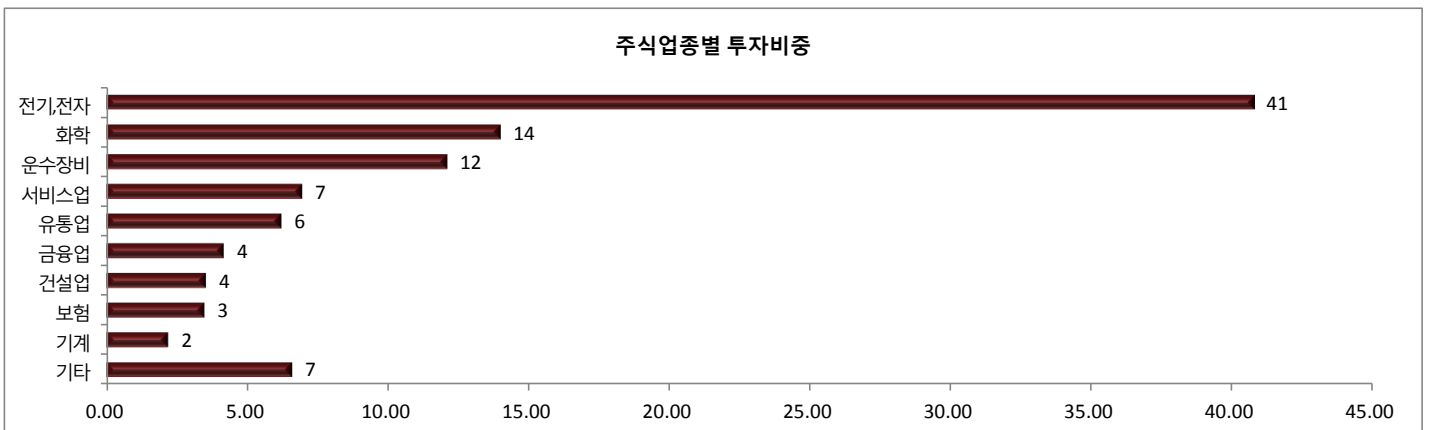
▶ 주식업종별 투자비중

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 : %)

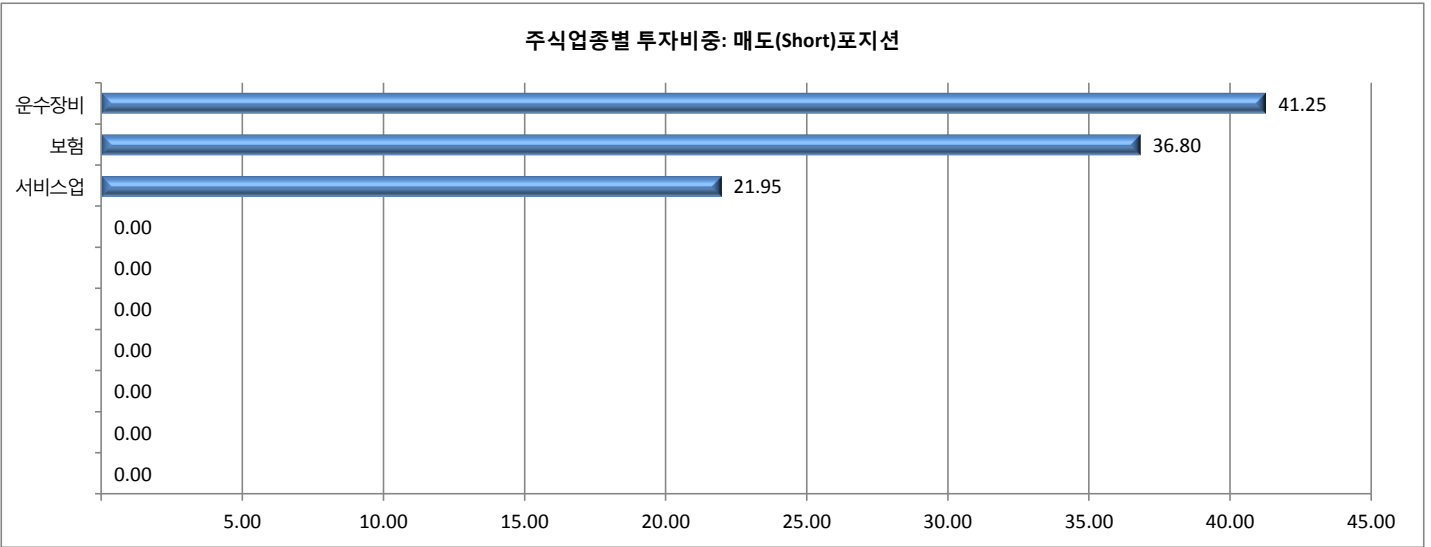
| | 종목명 | 비중 | | 종목명 | 비중 |
|---|--------|-------|----|-----|------|
| 1 | 전기, 전자 | 40.79 | 6 | 금융업 | 4.17 |
| 2 | 화학 | 14.00 | 7 | 건설업 | 3.53 |
| 3 | 운수장비 | 12.10 | 8 | 보험 | 3.47 |
| 4 | 서비스업 | 6.95 | 9 | 기계 | 2.19 |
| 5 | 유통업 | 6.21 | 10 | 기타 | 6.59 |

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 | 운수장비 | 41.25 | 6 | | |
| 2 | 보험 | 36.80 | 7 | | |
| 3 | 서비스업 | 21.95 | 8 | | |
| 4 | | | 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 | 농업금융채권(은행)2016-06월1Y-B | 12.55 | 6 | 채권 | 국고05750-1809(08-5) | 7.28 |
| 2 | 집합투자증권 | KBSTAR 단기통안채 | 11.69 | 7 | 주식 | 삼성전자우 | 7.22 |
| 3 | 집합투자증권 | KODEX 단기채권PLUS | 10.12 | 8 | 단기상품 | 은대(신한은행) | 4.74 |
| 4 | 파생상품 | 삼성전자 F 201703 (10) | 7.57 | 9 | 채권 | 통안0149-1802-02 | 4.67 |
| 5 | 채권 | 통안0145-1806-02 | 7.43 | 10 | 채권 | 국민은행3612할인일01-06 | 3.74 |

※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 확인 할 수 있습니다.

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종목명 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 | 발행국가 | 통화 | 업종 | 비고 |
|-------|------|------|------|------|-----|-------|----|
| 삼성전자우 | 432 | 677 | 7.22 | 대한민국 | KRW | 전기,전자 | |

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

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

| 종목명 | 액면가액 | 평가액 | 발행국가 | 통화 | 발행일 | 상환일 | 보증기관 | 신용등급 | 비중 |
|--------------------|-------|-------|------|-----|------------|------------|------|------|-------|
| 금융채권(은행)2016-06월 | 1,181 | 1,177 | 대한민국 | KRW | 2016-06-10 | 2017-06-10 | | AAA | 12.55 |
| 통안0145-1806-02 | 697 | 696 | 대한민국 | KRW | 2016-06-02 | 2018-06-02 | | - | 7.43 |
| 국고05750-1809(08-5) | 626 | 682 | 대한민국 | KRW | 2008-09-10 | 2018-09-10 | | - | 7.28 |
| 통안0149-1802-02 | 437 | 438 | 대한민국 | KRW | 2016-02-02 | 2018-02-02 | | - | 4.67 |
| 국민은행3612할인일01-0 | 354 | 350 | 대한민국 | KRW | 2016-12-06 | 2017-12-06 | | AAA | 3.74 |

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 | 1,095 | 1,096 | 대한민국 | KRW | 11.69 |
| KODEX 단기채권PLUS | 수익증권 | 삼성자산운용 | 947 | 948 | 대한민국 | KRW | 10.12 |

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

| 종목 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 비고 |
|---------------------|-------|-----|---------|----|
| 삼성전자 F 201703 (10) | 매도 | 35 | 710 | |

주) 투자대상 상위 10종목 및 개별계약등의 위험평가액이 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 | 15 | 0.92 | | 대한민국 | KRW |
| 예금 | 신한은행 | 2014-01-27 | 429 | 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 | 63 | 7,506 | 7 | 11,127 | 2109000507 |
| 박주호 | 퀀트운용팀장 | 1969 | 55 | 6,891 | | | 2109000457 |
| 윤준수 | 채권운용본부장 | 1967 | 91 | 23,624 | 6 | 6,304 | 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, 매매중계수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

| | 구 분 | 전기 | | 당기 | |
|-----------------------|----------------|------|------|------|------|
| | | 금액 | 비율 | 금액 | 비율 |
| 유리트리플알파연금지축자[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** | 0.14 | 0.00 | 5.94 | 0.06 |

| | | | | | | |
|--------------------------|------------------|---------------------|-------|------|-------|------|
| | 매매. 중개 수수료 | 단순매매.중개수수료 | 2.36 | 0.02 | 2.38 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0.25 | 0.00 | 0.28 | 0.00 |
| | | 합계 | 2.60 | 0.02 | 2.66 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 2.72 | 0.03 | 3.23 | 0.03 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1 | 자산운용사 | | 10.53 | 0.11 | 9.84 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 20.82 | 0.21 | 19.46 | 0.21 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0.61 | 0.01 | 0.57 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0.37 | 0.00 | 0.34 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 32.34 | 0.33 | 30.22 | 0.33 |
| | 기타비용** | | 0.19 | 0.00 | 5.60 | 0.06 |
| | 매매. 중개 수수료 | 단순매매.중개수수료 | 2.19 | 0.02 | 2.22 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0.23 | 0.00 | 0.26 | 0.00 |
| | | 합계 | 2.42 | 0.02 | 2.48 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 2.52 | 0.03 | 3.02 | 0.03 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e | 자산운용사 | | 0.83 | 0.11 | 0.70 | 0.11 |
| | 판매회사 | | 0.82 | 0.11 | 0.69 | 0.10 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0.05 | 0.01 | 0.04 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | | 0.03 | 0.00 | 0.02 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 1.72 | 0.22 | 1.45 | 0.22 |
| | 기타비용** | | 0.01 | 0.00 | 0.41 | 0.06 |
| | 매매. 중개 수수료 | 단순매매.중개수수료 | 0.17 | 0.02 | 0.15 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0.02 | 0.00 | 0.02 | 0.00 |
| | | 합계 | 0.19 | 0.02 | 0.17 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 0.20 | 0.03 | 0.21 | 0.03 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P | 자산운용사 | | 0.00 | 0.10 | 0.00 | 0.10 |
| | 판매회사 | | 0.00 | 0.06 | 0.00 | 0.06 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 일반사무관리회사 | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0.00 | 0.16 | 0.00 | 0.16 |
| | 기타비용** | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.06 |
| | 매매. 중개 수수료 | 단순매매.중개수수료 | 0.00 | 0.02 | 0.00 | 0.02 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 합계 | 0.00 | 0.02 | 0.00 | 0.03 |
| | 증권거래세 | | 0.00 | 0.03 | 0.00 | 0.03 |

* 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 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 | 0.0117 | 0.0673 |
| | 당기 | 0 | 0 | 0.06 | 0.0842 |
| 종류(Class)별 현황 | | | | | |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C1 | 전기 | 1.326 | 0 | 1.3379 | 0.0674 |
| | 당기 | 1.3224 | 0 | 1.3828 | 0.0844 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/C-e | 전기 | 0.8996 | 0 | 0.9105 | 0.0682 |
| | 당기 | 0.8972 | 0 | 0.9549 | 0.0833 |
| 유리트리플알파연금저축자[주식혼합]_C/S-P | 전기 | 0.6394 | 0 | 0.6446 | 0.0908 |
| | 당기 | 0.6423 | 0 | 0.7406 | 0.0978 |

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 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. 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전을

유리트리플알파모[주식혼합] (단위 : 주, 백만원, %)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율(주) | |
|---------|-------|---------|-------|----------|--------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간 | 연환산 |
| 184,396 | 9,156 | 216,753 | 9,683 | 52.30 | 212.11 |

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

유리트리플알파모[주식혼합] (단위 : %)

| 16년06월03일 ~16년09월02일 | 16년09월03일 ~16년12월02일 | 16년12월03일 ~17년03월02일 |
|----------------------|----------------------|----------------------|
| 116.09 | 55.33 | 52.30 |