자산운용보고서

유리마음편한인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]

(운용기간 : 2016년12월11일 ~ 2017년03월10일)

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. 고객님이 가입하신 펀드는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률'(현행법률)의 적용을 받습니다.

2. 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.

3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리마음편한인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]의 자산운용회사인 '유리자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '국민은행'의 확인을 받아 판매회사인 '국민은행,부국증권,부산은행'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

4. 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 :	유리자산운용(주)	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
유리마음편한인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]_운용, 유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁[주식-파생형], 유리마음편한인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]_C/A, 유리마음편한인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]_C/C, 유리마음편한인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]_C/C-e		1등급	AD623, AE223, AD624, AD626, AD627
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2012.12.11
운용기간	2016.12.11 ~ 2017.03.10	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용(주)	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	국민은행,부국증권,부산은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	**1. 투자대상** 이 투자신탁은 자산총액의 100% 이하를 "유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁[주식-파생형]"에 투자하는 증권투자신탁으로 신탁재산의 60% 이상을 주식 및 주식관련 장내파생상품에 투자합니다. <모투자신탁의 내용> 장기 자본이득 등의 획득을 목적으로 펀드 재산의 대부분을 주식 및 주식관련 파생상품에 투자합니다. 펀드의 순자산가치의 변동률이 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 변동률과 유사하도록 운용하되, 제한된 범위 내에서 한국 종합주가지수200 (KOSPI200) 대비 초과수익을 추구합니다. 그러나 펀드의 성과가 목적한 바 대로 달성된다는 보장은 없으며, 자산운용사, 판매회사, 신탁업자 등 이 펀드와 관련된 어떠한 당사자도 수익자에 대한 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 않습니다. 비교지수인 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 변동률에 근접한 성과의 달성을 위해, 한국종합주가지수200(KOSPI200)을 구성하고 있는 종목과 관련 장내파생상품에 주로 투자합니다. 다만, 추적오차의 최소화 등을 위하여 필요하다고 판단하는 경우 KOSPI200 구성 종목 이외의 종목에도 투자할 수 있습니다. **2. 투자전략** (1) 이 투자신탁에 관한 내용 이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 "유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁[주식-파생형]"에 투자하여 운용합니다. 유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁[주식-파생형]은 국내 주식 및 주식관련파생상품에 주로 투자하여 KOSPI200 지수와 유사한 수준의 수익을 추구합니다. (2) 모투자신탁에 관한 내용 [지수추종전략] 이 펀드는 부분복제기법을 적용하여 비교지수의 성과를 추적하는 방식으로 운용됩니다. 부분복제기법이란 추적오차를 감안하여 비교지수 구성종목의 일부를 추출하고, 추출된 종목을 대상으로 투자 비중을 결정하여 포트폴리오를 구성하는 지수추종기법 입니다. 시장상황의 변화에 따른 종목별 구성비중 등을 고려하여 정기적으로 포트폴리오를 재조정합니다. [초과수익 추구 전략] ■ 시장상황에 따라 포트폴리오를 일정 수준 비교지수와 다르게 구성하여 초과수익을 추구합니다. ■ 기업의 인수, 합병, 실적 모멘텀 등 이벤트를 활용한 종목별 대응으로 초과수익을 추구합니다. ■ 주식 및 파생상품간 스왑 거래 및 파생상품간의 스왑거래를 활용하여 초과수익을 추구합니다. ■ 스프레드 매매 및 장단기 시장흐름에 따른 비중조절을 통해 초과수익을 추구합니다. [추적오차 관리 전략] 비교지수의 특성을 고려하여 추적오차를 가급적 줄일 수 있도록 포트폴리오를 구성합니다. 추적오차가 주어진 허용범위(1일 기준 ±0.5%)를 초과하는 경우에는 원인 분석 후 수시로 포트폴리오를 재조정 합니다. [현금성 자산 운용전략] 주식 및 파생상품에 투자하고 남은 자산은 원활한 환매 대응과 투자자금의 안정성 확보를 위하여 금융기관에 예치 또는 자금중개회사를 통하여 자금중개거래를 할 수 있는 금융기관에 4영업일 이내의 콜거래를 통하여 운용합니다.		

3. 위험관리

운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위해, 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회 및 위험관리위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 당사 내부의 운용업실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다. 일정한 기준에 따라 선정된 여러 주식의 주가수준을 종합한 지수인 비교지수의 성과에 근접한 성과를 추구하는 것을 목표로 하므로 주가 수준 하락에 대한 별도의 위험관리 전략을 구사하지 않습니다. 따라서 주가 수준의 전반적인 하락 시에는 펀드의 가치 역시 비교지수의 하락에 그대로 노출 된다는 점에 유의하셔야 합니다.

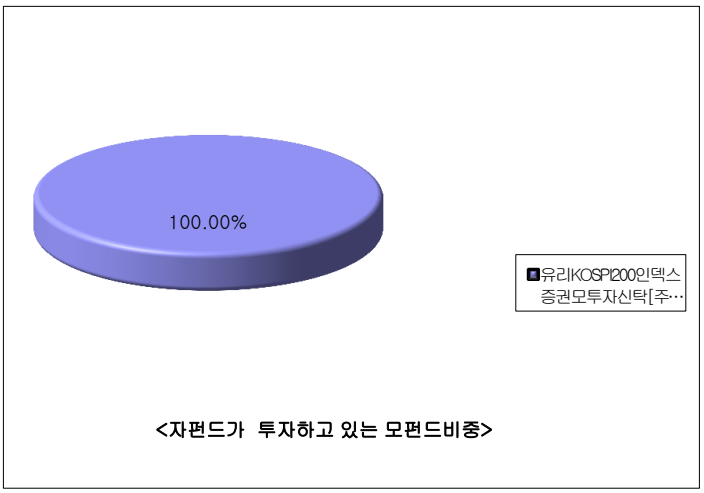
이 펀드는 KOSPI200의 성과에 근접한 수준의 수익률을 달성할 것으로 예상되지만 시장상황, 운용여건 등의 다양한 사유로 인하여 비교지수인 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 수익률과 펀드 성과 간의 차이, 즉 추적오차가 발생할 수 있습니다. 이러한 추적오차는 지수추종을 목적으로 하는 펀드의 위험요소가 됩니다. 자산운용사는 추적오차를 최소화하기 위하여 포트폴리오 재조정 등의 다양한 보완방안을 실행할 예정이나, 추적오차 발생 가능성을 완전히 배제할 수 없다는 점에 유의하셔야 합니다.

4. 수익구조

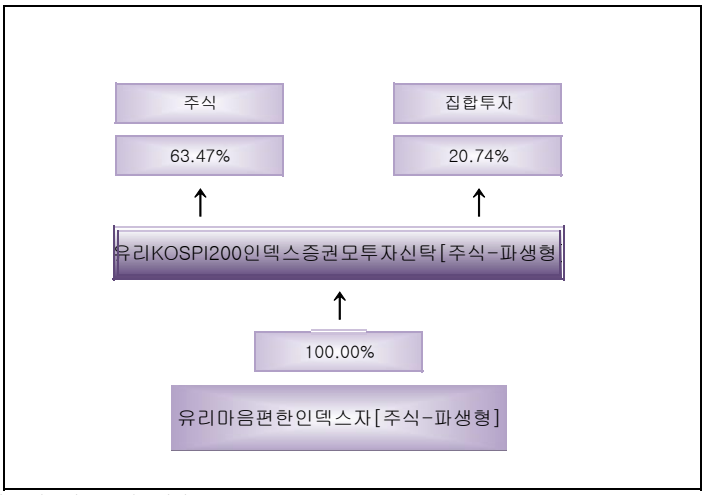
신탁재산의 대부분을 주식 및 주식관련파생상품에 투자하는 모펀드에 투자하는 펀드로서, 투자대상 주식 시세의 등락 및 배당으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 모펀드에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 펀드의 성과에 영향을 미치게 됩니다. 주식의 시세는 해당 주식 발행기업의 경영성과 및 주식에 대한 시장의 수급 등의 요인에 의해 결정되며 이러한 요인은 경제,정치,자연,사회,문화 등 다양한 변수의 영향을 받습니다. 투자대상 주식 발생기업의 경영성과가 우수할수록, 투자대상 주식에 대한 수요가 공급보다 클수록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



<자펀드가 투자하고 있는 모펀드비중>



※ 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
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_운용	자산 총액 (A)	220	198	-9.74
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	220	198	-9.74
	발행 수익증권 총 수 (D)	231	197	-14.74
	기준가격주) (E=C/D×1000)	949.20	1,004.85	5.86
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	기준가격	917.45	968.71	5.59
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	기준가격	899.30	948.41	5.46
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	기준가격	915.73	966.90	5.59

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 증시는 12월에는 FOMC에 대한 경계심리에도 경제지표 호조, 트럼프 정책 기대감, 연말 랠리 기대감 등으로 상승을 하였습니다. 1월에는 트럼프 정부의 보호무역정책 및 반이민정책 이행 과정으로 인한 불확실성 증가, 영국 총리의 유럽연합 완전탈퇴 발언 등으로 투자심리가 위축되며 상승이 제한되는 모습을 보였습니다. 2월에는 지속된 상승으로 높아진 시장 밸류에이션 부담과 3월 금리인상 우려 부각에 따른 차익실현 매물로 상승이 제한되는 모습을 보였습니다.
국내증시는 12월에는 미국 기준금리 인상 관련 불확실성 해소, 국내외 경제 및 기업실적 개선 및 연말 배당 기대감, 외국인의 순매수 등의 이유로 긍정적인 영향을 받으면서 상승을 하였습니다. 1월에는 글로벌 경제지표가 호조를 보이면서 투자심리가 개선되고, 반도체 업황의 개선, 실적개선 기대감, 자사주 소각 등의 이유로 삼성전자를 필두로 한 전기전자 업종이 크게 상승하여 상승으로 마감을 하였습니다. 2월에는 대내외 불확실성 증가에 따른 차익실현 매물 출회로 상승 흐름이 약화되는 모습을 보였습니다. 동 펀드는 해당 기간 동안 업종 중립을 원칙으로 안정적인 포트폴리오를 유지하는 한편, 일부 계량모델을 활용한 종목 선택과 매매 전략을 적용해 초과수익을 추구했습니다.

▶ 투자환경 및 운용

다음 분기는 대외적으로 1)트럼프 정부의 정책 불확실성 부각(예산안 발표예정), 2)중국 당국의 사드(THAAD) 배치관련 보복 우려, 3)유럽발 정치적 리스크 확산(3~4월 네덜란드/프랑스 총선), 4)미국 부채한도 협상, 5)3월 FOMC 회의에서의 기준금리 인상여부, 6)유가와 환율의 움직임이 증시의 방향을 결정할 것으로 보이며, 대내적으로는 7)탄핵심판 선고 여부 및 결과, 8)소비심리 회복 여부, 9)외국인을 비롯한 기관들의 수급변화 여부가 중요한 변수가 될 것으로 판단되는 바, 단기적인 변동성에 주의하면서 안정적인 포트폴리오 관리에 최선을 다할 계획입니다. 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
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_운용	5.86	7.36	10.79	13.79
(비교지수 대비 성과)	(1.50)	(1.54)	(1.42)	(1.00)
종류(Class)별 현황				
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	5.59	6.80	9.92	12.59
(비교지수 대비 성과)	(1.23)	(0.97)	(0.55)	(-0.19)
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	5.46	6.54	9.52	12.04
(비교지수 대비 성과)	(1.10)	(0.72)	(0.15)	(-0.74)
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	5.59	6.80	9.92	12.59
(비교지수 대비 성과)	(1.23)	(0.98)	(0.55)	(-0.19)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]C_통합	5.49	6.60	9.61	12.15
(비교지수 대비 성과)	(1.13)	(0.77)	(0.23)	(-0.63)
비교지수(벤치마크)	4.36	5.82	9.37	12.78

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
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_운용	13.79	5.05	3.03	-
(비교지수 대비 성과)	(1.00)	(-3.11)	(-3.97)	-
종류(Class)별 현황				
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	12.59	2.80	-0.25	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.19)	(-5.36)	(-7.25)	-
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	12.04	1.78	-1.74	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.74)	(-6.38)	(-8.74)	-
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	12.59	2.80	-0.25	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.19)	(-5.36)	(-7.25)	-

CDSC 적용펀드 통합 수익률					
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]C_통합	12.15	1.97	-1.43	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.63)	(-6.18)	(-8.43)	-
비교지수(벤치마크)	12.78	8.16	7.00	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI200 100.0%

※ 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	2	0	0	1	0	0	0	0	0	0	0	3
당 기	8	0	0	2	2	0	0	0	0	0	0	12

4. 자산현황

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

▶ 자산구성현황

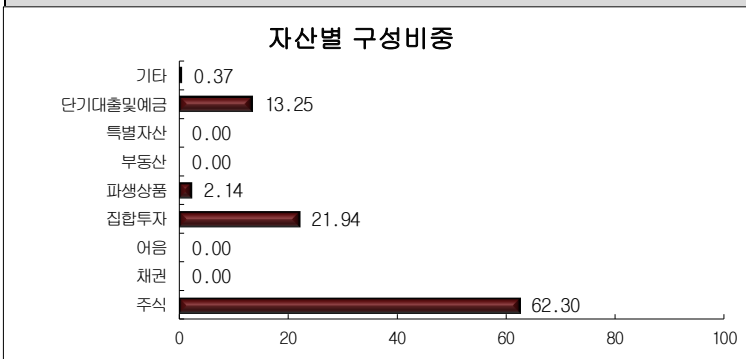
자산구성현황 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 보유하고 있는 자산의 내역을 각 자산군 및 통화별로 확인할 수 있습니다. 또한 그래프를 통해 당기말과 전기말 간의 자산별 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원,%)

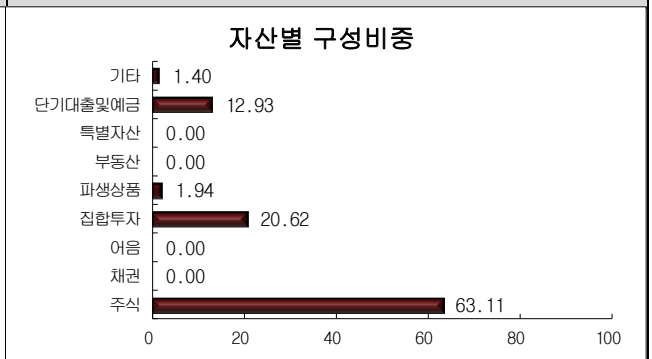
통화별 구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	125	0	0	41	4	0	0	0	0	26	3	198
(0.00)	(63.11)	(0.00)	(0.00)	(20.62)	(1.94)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(12.93)	(1.40)	(100.00)
합 계	125	0	0	41	4	0	0	0	0	26	3	198

* ( ) : 구성 비중

전 기



당 기



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.

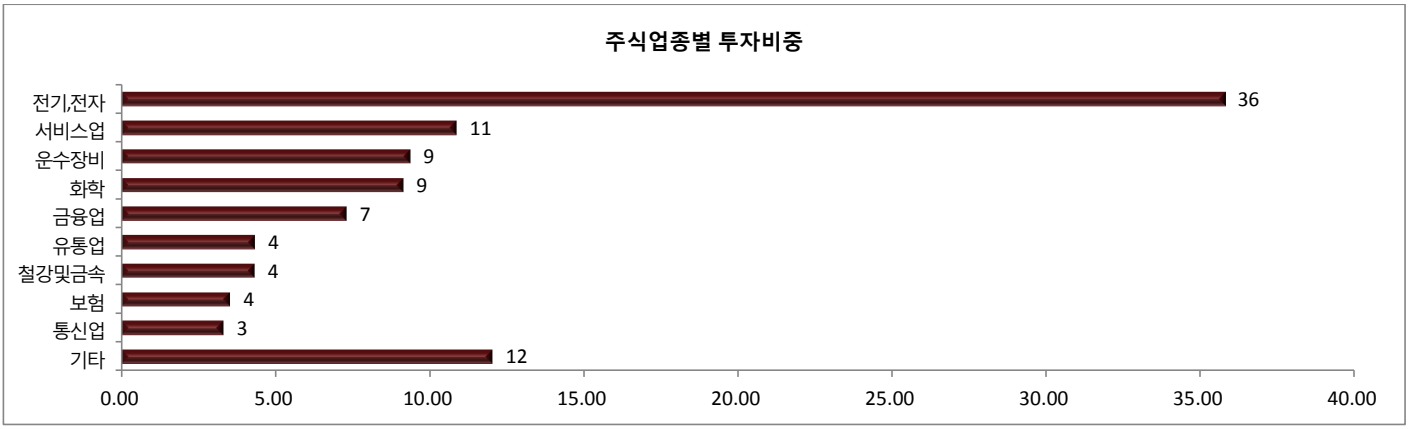
▶ 주식업종별 투자비중

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 : %)

	종목명	비중		종목명	비중
1	전기,전자	35.79	6	유통업	4.33
2	서비스업	10.87	7	철강및금속	4.32
3	운수장비	9.37	8	보험	3.53
4	화학	9.14	9	통신업	3.31
5	금융업	7.30	10	기타	12.04

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



▶ 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	TREX 200	18.24	6	단기상품	REPO매수(20170310)	2.68
2	주식	삼성전자	17.82	7	주식	SK하이닉스	2.39
3	파생상품	코스피200 F 201706	14.60	8	집합투자증권	TIGER 200	2.34
4	단기상품	REPO매수(20170310)	7.14	9	주식	현대차	1.84
5	단기상품	은대(국민은행)	3.11	10	주식	NAVER	1.78

※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
삼성전자	18	35	17.82	대한민국	KRW	전기,전자	
SK하이닉스	96	5	2.39	대한민국	KRW	전기,전자	
현대차	25	4	1.84	대한민국	KRW	운수장비	
NAVER	4	4	1.78	대한민국	KRW	서비스업	

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	34	36	대한민국	KRW	18.24
TIGER 200	수익증권	미래에셋자산운용	4	5	대한민국	KRW	2.34

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 201706	매수	0	14	

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	국민은행	2012-12-11	0	0.92		대한민국	KRW
REPO매수	서울외국환중개	2017-03-10	6	0.01		대한민국	KRW
예금	국민은행	2012-11-19	6	0.92		대한민국	KRW

REPO매수	한국자금중개	2017-03-10	15	0.01		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

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
유리마음편한인덱스자[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.중개수수료	단순매매.중개수수료	0.02	0.01	0.02	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.01	0.01	0.00
		합계	0.03	0.01	0.02	0.01
	증권거래세		0.11	0.05	0.09	0.04
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	자산운용사		0.05	0.13	0.02	0.13
	판매회사		0.04	0.12	0.02	0.12
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.09	0.27	0.04	0.27
	기타비용**		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		합계	0.01	0.01	0.00	0.01
	증권거래세		0.02	0.05	0.01	0.03
	자산운용사		0.19	0.13	0.20	0.13
	판매회사		0.35	0.25	0.36	0.25

유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.01	0.00
	보수합계		0.55	0.39	0.58	0.39
	기타비용**		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매.중개수수료	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	0.02	0.01
	증권거래세		0.07	0.05	0.06	0.04
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	자산운용사		0.05	0.13	0.06	0.13
	판매회사		0.05	0.12	0.05	0.12
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.10	0.27	0.11	0.27
	기타비용**		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		합계	0.01	0.01	0.00	0.01
	증권거래세		0.02	0.05	0.02	0.04

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 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
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_운용	전기	0	0	0.0034	0.0759
	당기	0	0	0	0.0525
종류(Class)별 현황					
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	전기	1.0829	0	1.0864	0.0758
	당기	1.0799	0	1.0799	0.0525
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	전기	1.5843	0	1.5878	0.0764
	당기	1.5799	0	1.5799	0.0525
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	전기	1.0829	0	1.0861	0.0749
	당기	1.0799	0	1.0799	0.0529

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 회전율 표와 최근 3분기 매매회전율 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 회전율

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
9,907	354	27,515	1,652	23.00	93.28

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

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

(단위 : %)

16년06월11일 ~16년09월10일	16년09월11일 ~16년12월10일	16년12월11일 ~17년03월10일
40.25	26.31	23.00