

자산운용보고서

유리인덱스200증권투자회사[주식-파생형]

(운용기간 : 2017년08월09일 ~ 2017년11월08일)

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
 - ▶ 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 회전을
 - ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

상품의 특징

3. 위험관리

운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 리스크관리위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 운용업 실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다.

이 펀드는 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 이 투자회사의 가치 역시 비교지수의 하락에 그대로 노출 된다는 점에 유의하여야 합니다.

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

※ 이 펀드는 상기에 제시된 운용목표의 달성 및 운용전략의 실행을 위해 적극적인 매매전략을 구사할 수 있으며 이러한 적극적인 매매는 높은 거래비용을 유발합니다. 적극적인 매매가 의도한 목적을 달성한다는 보장은 없으며 매매의 결과로 인한 손익이 매매비용을 상쇄하지 못하거나 매매의 의도와 다른 방향으로 자산의 시장가격이 변동할 경우 펀드의 투자성과에 크고 작은 불리한 영향을 미치게 됩니다.

4. 수익구조

이 펀드는 회사재산의 대부분을 주식 및 주식관련파생상품에 투자하는 펀드로서 투자대상 주식 시세의 등락 및 배당으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 주식에 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 투자회사의 가치는 상승하고, 반대의 경우에는 투자회사의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다.

이 펀드의 성과는 비교지수의 성과와 비교지수 대비 추적오차에 의해 결정됩니다. 이 펀드의 성과는 일반적으로 '비교지수 대비 추적오차' 보다는 '비교지수의 성과'로부터 월등히 높은 수준의 영향을 받게 됩니다.

이 펀드는 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.

시장상황 등에 따라 이 펀드의 성과는 비교지수의 성과와의 괴리, 즉 추적오차를 나타낼 수 있습니다. 비교지수 대비 양(+의 추적오차 발생시에는 이 펀드가 비교지수 보다 우월할 성과를, 비교지수 대비 음(-)의 추적오차 발생시에는 이 펀드가 비교지수 보다 열등한 성과를 보이게 됩니다. 이러한 추적오차가 이 펀드의 성과에 미치는 영향은 일반적으로 비교지수 자체의 성과가 미치는 영향에 비해서는 낮은 수준이라고 할 수 있습니다.

이 펀드의 성과는 자본이득, 배당수입, 이자수입으로 구분할 수 있으며 일반적으로 자본이득이 성과에 미치는 영향이 절대적인 비중을 차지합니다.

▶ 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
유리인덱스200[주식-파생형]-운용	자산 총액 (A)	11,920	11,981	0.51
	부채 총액 (B)	9	2	-81.10
	순자산총액 (C=A-B)	11,911	11,980	0.58
	발행 수익증권 총 수 (D)	10,156	9,514	-6.32
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,172.86	1,259.16	7.36
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리인덱스200[주식-파생형]-C/A	기준가격	1,125.47	1,203.84	6.96
유리인덱스200[주식-파생형]-C/B	기준가격	1,169.76	1,254.18	7.22
유리인덱스200[주식-파생형]-C/S	기준가격	1,167.90	1,251.32	7.14

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 8월 월초 트럼프 대통령의 북한에 대한 강경한 입장표명과 이후 북한의 '광 포위사격' 엄포로 촉발된 지정학적 리스크 부각, 미국 트럼프 정부의 정책 불확실성으로 인해 선진국 중심으로 약세를 나타냈으나, 월 후반 들어 북한발 지정학적 리스크 완화로 인해 낙폭을 축소하며 혼조세로 마감하였습니다. 9월에는 월초 북한의 6차 핵실험으로 인한 지정학적 리스크 재부각에 하락세로 출발하였으나, 미국의 9월 통화정책회의에서 올해 미국의 경제성장률을 상향조정하면서 긍정적인 전망을 제시한 점이 호재로 작용하여 상승세로 전환하여 마감하였습니다. 10월에는 미국의 예산안 통과 이후 세제개편 기대감 확산, 주요국 경제지표 호조, 양호한 3분기 실적 및 국제유가 상승 등이 호재로 작용하여 상승세가 지속되는 모습이 나타났으나, 월말 들어 증시 고평가 부담에 따른 차익실현 매물 출회로 상승세가 다소 약화되었습니다.

국내 증시는 8월 월초 지난 8개월간의 증시 상승에 따른 차익실현 욕구와 북한발 지정학적 리스크 부각에 따른 외국인인 매도세 영향으로 KOSPI지수가 2,310pt선까지 하락하였으나, 월말 들어 북한발 지정학적 리스크 완화에 힘입어 낙폭을 축소하며 2,360pt선까지 회복하며 마감하였습니다. 9월에는 월초 트럼프 대통령의 "한미 FTA 재검토" 발언과 북한의 핵실험 여파로 KOSPI지수가 2,310pt선까지 하락하며 약세로 출발하였으나, 점차 북한 리스크가 완화되는 가운데 시장에 우호적이었던 미국 통화정책회의의 결과와 미국 반도체 업종의 주가강세에 따른 삼성전자 등 국내 주요 IT기업들의 주가상승에 힘입어 KOSPI지수가 2,430pt 부근까지 회복하며 마감하였습니다. 10월에는 월초 추석연휴 동안의 글로벌 증시호조로 인해 상승세로 출발하였으며, 1)국내외 경제지표 호조에 따른 경기모멘텀 강화, 2)양호한 3분기 기업실적, 3)한국은행의 경제성장률 전망치 상향조정, 4)한-중간 갈등해소 조짐에 따른 중국소비 관련 업종의 주가반등 및 5)국제유가 상승 등의 연이은 호재 속에 KOSPI지수가 2,520pt선을 돌파하며 사상 최고치를 재차 경신하여 마감하였습니다.

동 펀드는 해당 기간 동안 업종 중립을 원칙으로 안정적인 벤치마크 추종을 위한 포트폴리오 관리에 노력했으며, 종목 선택과 매매 전략 등을 통해 초과수익을 내는데 주안점을 두었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

다음 분기는 대외적으로 1)세계개편안 의회통과 관련 미국 트럼프 대통령의 정치적 불확실성, 2)미/중/유럽 등 주요국의 경제지표, 3)브렉시트 협상 관련 영-EU간 불화, 독일 정부구성 등의 정치적 리스크, 4)선진국 중앙은행의 긴축 통화정책 돌입, 5)한미간 금리차 축소에 따른 자금유출 우려 및 6)원자재 가격 및 환율의 움직임 등이 증시의 방향을 결정할 것으로 보이며, 대내적으로는 7)국내 수출지표 및 4분기 기업실적 개선 기대감, 8)연말 쇼핑시즌 내수소비 활성화 여부 및 9)연기금과 외국인의 수급변화 등이 중요한 변수가 될 것으로 판단됩니다.

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

동 펀드는 제한적인 범위 내에서 계량모형(가치모형, 모멘텀모형, 이례현상 등)에 근거한 스타일바스켓 편입, 보통주/우선주간 교체매매, 공모주(IPO) 투자 및 기업분할/합병 등의 이벤트 투자 등을 통해 초과수익을 추구하겠습니다.

▶ 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
유리인덱스200[주식-파생형]_운용 (비교지수 대비 성과)	7.36 (-0.43)	12.55 (-0.10)	25.92 (-0.26)	34.10 (1.76)
종류(Class)별 현황				
유리인덱스200[주식-파생형]_C/A (비교지수 대비 성과)	6.96 (-0.82)	11.70 (-0.95)	24.53 (-1.65)	32.12 (-0.22)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B (비교지수 대비 성과)	7.22 (-0.57)	12.25 (-0.41)	25.42 (-0.76)	33.39 (1.05)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/S (비교지수 대비 성과)	7.14 (-0.64)	12.07 (-0.58)	25.13 (-1.04)	30.36 (-1.97)
비교지수(벤치마크)	7.79	12.65	26.18	32.34

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
유리인덱스200[주식-파생형]_운용 (비교지수 대비 성과)	34.10 (1.76)	38.54 (3.55)	42.64 (6.10)	46.35 (11.30)
종류(Class)별 현황				
유리인덱스200[주식-파생형]_C/A (비교지수 대비 성과)	32.12 (-0.22)	34.39 (-0.59)	36.24 (-0.31)	35.38 (0.33)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B (비교지수 대비 성과)	33.39 (1.05)	37.04 (2.06)	40.32 (3.77)	42.35 (7.30)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/S (비교지수 대비 성과)	30.36 (-1.97)	26.46 (-8.52)	38.91 (2.36)	- -

비교지수(벤치마크)	32.34	34.99	36.55	35.05
------------	-------	-------	-------	-------

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 확인할 수 있습니다.

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
추적오차	0.66	0.77	1.82

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	358	0	0	140	63	0	0	0	0	1	0	562
당기	542	0	0	184	111	0	0	0	0	4	-1	840

4. 자산현황

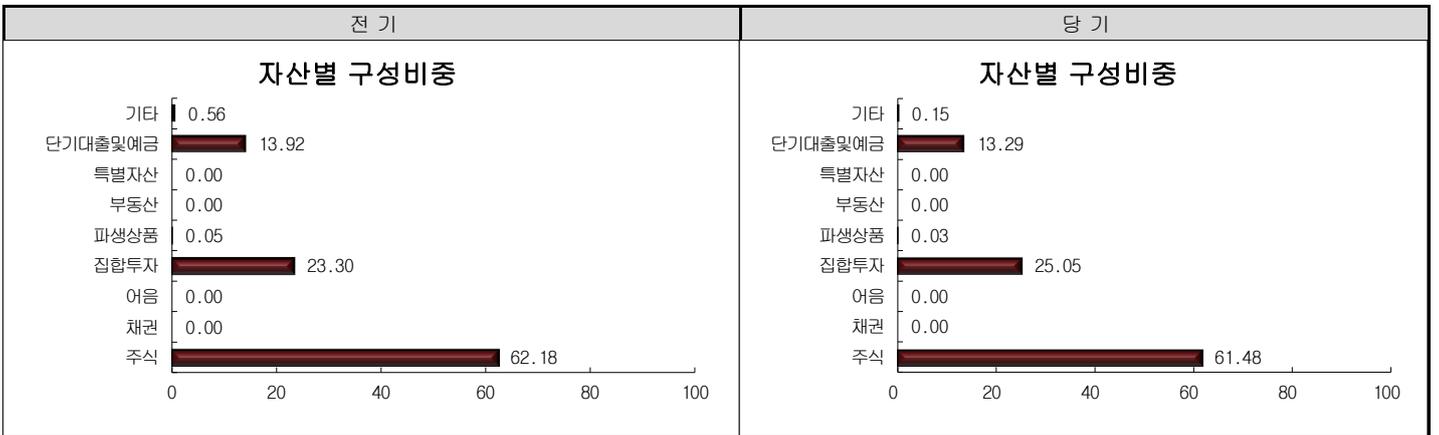
▶ 자산구성현황

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	7,367	0	0	3,001	3	0	0	0	0	1,593	18	11,981
(0.00)	(61.48)	(0.00)	(0.00)	(25.05)	(0.03)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(13.29)	(0.15)	(100.00)
합계	7,367	0	0	3,001	3	0	0	0	0	1,593	18	11,981

* () : 구성 비중



▶ 주식업종별 투자비중

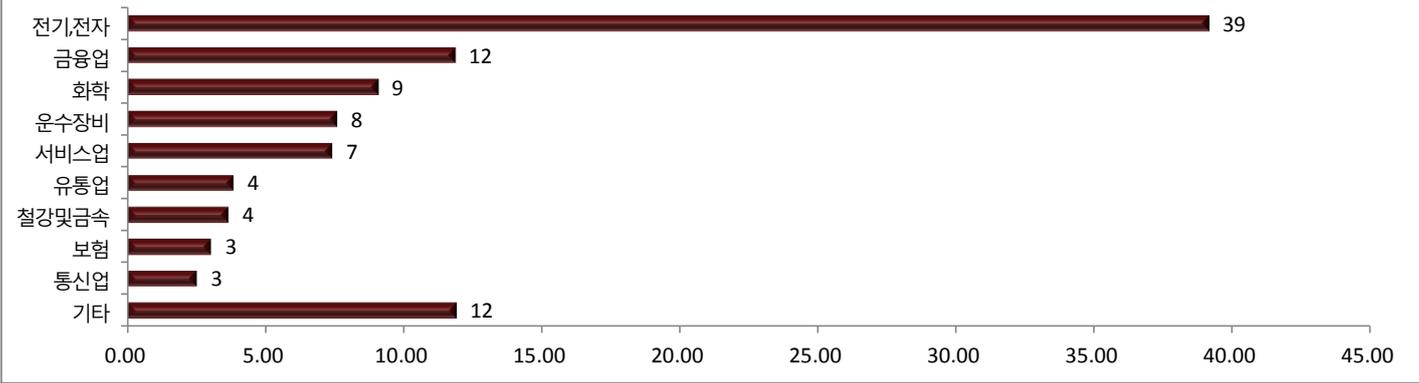
주식업종별 투자비중 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 투자하고 있는 주식자산의 업종별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드가 보유한 주식자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

순위	종목명	비중	순위	종목명	비중
1	전기, 전자	39.15	6	유통업	3.84
2	금융업	11.86	7	철강및금속	3.65
3	화학	9.07	8	보험	3.03
4	운수장비	7.58	9	통신업	2.51
5	서비스업	7.41	10	기타	11.90

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	구분	종목명	비중	구분	구분	종목명	비중
1	집합투자증권	TREX 200	18.62	6	주식	SK하이닉스	3.15
2	주식	삼성전자	18.29	7	주식	현대차	1.53
3	파생상품	코스피200 F 201712	12.72	8	주식	POSCO	1.47
4	기타	REPO매수(20171108)	12.52	9	주식	NAVER	1.45
5	집합투자증권	TREX 펀더멘탈 200	6.11	10	주식	KB금융	1.33

*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	772	2,191	18.29	대한민국	KRW	전기,전자	
SK하이닉스	4,531	377	3.15	대한민국	KRW	전기,전자	
현대차	1,182	183	1.53	대한민국	KRW	운수장비	
POSCO	556	176	1.47	대한민국	KRW	철강및금속	
NAVER	204	173	1.45	대한민국	KRW	서비스업	
KB금융	2,775	159	1.33	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	1,791	2,231	대한민국	KRW	18.62
TREX 펀더멘탈 200	수익증권	유리자산운용	609	732	대한민국	KRW	6.11

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 201712	매수	18	1,524	

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
REPO매수	DB자산운용	2017-11-08	1,500	1.20		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	56	8,412	11	13,265	2109000507
박주호	퀀트운용팀장	1969	48	6,455			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
한진규	책임	2001.03.06 ~ 현재
김용태	부책임	2010.08.18 ~ 2010.09.10
안현수	부책임	2008.06.04 ~ 2010.12.01
강석훈	부책임	2010.08.18 ~ 2010.12.24
박주호	부책임	2001.03.06 ~ 현재

▶ 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, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
유리인덱스200[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**	2.26	0.02	1.89	0.02	
	매매, 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.63	0.01	0.67	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.27	0.00	0.21	0.00
		합계	0.91	0.01	0.88	0.01
		증권거래세	2.98	0.02	2.71	0.02

유리인덱스200[주식-파생형]_C/A	자산운용사	1.00	0.13	0.97	0.13	
	판매회사	2.00	0.25	1.94	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.06	0.01	0.06	0.01	
	일반사무관리회사	0.05	0.01	0.05	0.01	
	보수합계	3.11	0.39	3.01	0.39	
	기타비용**	0.16	0.02	0.13	0.02	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.04	0.01	0.04	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.00	0.01	0.00
		합계	0.06	0.01	0.06	0.01
	증권거래세	0.20	0.02	0.18	0.02	
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B	자산운용사	14.04	0.13	13.85	0.13	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.84	0.01	0.83	0.01	
	일반사무관리회사	0.70	0.01	0.69	0.01	
	보수합계	15.58	0.14	15.37	0.14	
	기타비용**	2.17	0.02	1.83	0.02	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.59	0.01	0.62	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.26	0.00	0.20	0.00
		합계	0.85	0.01	0.82	0.01
	증권거래세	2.79	0.03	2.53	0.02	
유리인덱스200[주식-파생형]_C/S	자산운용사	0.00	0.13	0.00	0.13	
	판매회사	0.00	0.08	0.00	0.08	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.01	0.00	0.01	
	일반사무관리회사	0.00	0.01	0.00	0.01	
	보수합계	0.00	0.22	0.00	0.21	
	기타비용**	0.00	0.02	0.00	0.02	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.01	0.00	0.01
	증권거래세	0.00	0.03	0.00	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 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, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
유리인덱스200[주식-파생형]_운용	전기	0.1521	0.0346	0.1867
	당기	0.1539	0.0316	0.1855
종류(Class)별 현황				
유리인덱스200[주식-파생형]_C/A	전기	1.7151	0.0343	1.7494
	당기	1.7144	0.0315	1.7459
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B	전기	0.7093	0.0347	0.744
	당기	0.7111	0.0316	0.7427
유리인덱스200[주식-파생형]_C/S	전기	0.9871	0.0284	1.0155
	당기	0.9773	0.0285	1.0058

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 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

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

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
8,312	339	15,208	905	12.39	49.17

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

17년02월09일 ~17년05월08일	17년05월09일 ~17년08월08일	17년08월09일 ~17년11월08일
14.65	13.31	12.39