

자산운용보고서

유리마음편한인덱스증권투자신탁[주식-파생형]_운용

(운용기간 : 2018년03월11일 ~ 2018년06월10일)

○ 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

유리자산운용

서울시 영등포구 국제금융로6길 17 부국증권빌딩 9층
(전화 02-2168-7900, www.yurieasset.co.kr)

목 차

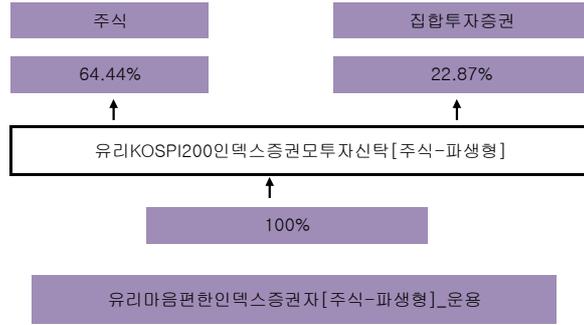
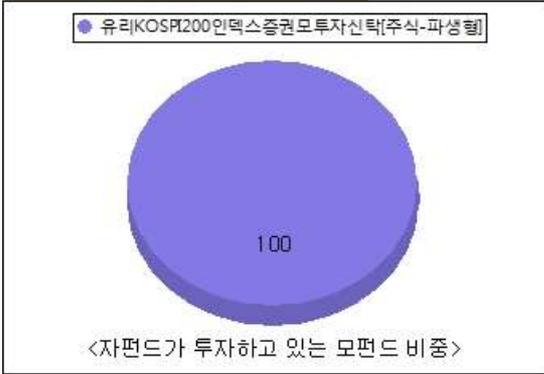
1	공지사항
2	펀드의 개요 <ul style="list-style-type: none">▶ 기본정보▶ 재산현황
3	운영경과 및 수익률현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 운영경과▶ 투자환경 및 운용계획▶ 기간(누적) 수익률▶ 손익현황
4	자산현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 자산구성현황▶ 투자대상 상위 10종목▶ 각 자산별 보유종목 내역
5	투자운용전문인력 현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 투자운용인력(펀드매니저)▶ 해외 운용 수탁회사
6	비용현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 업자별 보수 지급현황▶ 총보수비용 비율
7	투자자산매매내역 <ul style="list-style-type: none">▶ 매매주식규모 및 회전율▶ 최근 3분기 주식 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 수요 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 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



※ 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)	51	54	5.17
	부채총액(B)			0.00
	순자산총액(C=A-B)	51	54	5.17
	발행 수익증권 총 수(D)	52	55	5.96
	기준가격 (E=C/Dx1000)	991.01	983.62	-0.75
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	기준가격	988.35	978.29	-1.02
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	기준가격	987.11	975.83	-1.14
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	기준가격	988.35	978.29	-1.02

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 무역분쟁 우려 완화로 상승하며 출발하였으나, 미국 기술업종 급락, 미국의 3월 통화정책회의 불확실성 및 대중국 관세부과 관련 행정명령에서 촉발된 미-중 무역분쟁 본격화 우려로 인해 큰 폭으로 하락하였습니다. 4월초 미-중 양국의 무역분쟁 격화, 미국 재정적자 확대 우려 및 시리아발 중동 리스크 부각으로 인해 하락하여 출발하였으나, 중국 시진핑 주석의 협상안 제시로 인한 미-중 무역갈등 해소 기대감, 양호한 경제지표와 기업실적, 북한 비핵화 움직임 및 국제유가 상승 등에 힘입어 상승세로 전환되는 모습을 보였습니다. 5월초 미-중 무역분쟁 우려 지속, 미국 금리인상 속도 불확실성 등으로 인해 하락하여 출발하였으나, ①유가 급등, ②북미정상회담 기대감, ③선진국 중앙은행들의 긴축우려 완화 등에 힘입어 상승세로 전환되었습니다. 다만, 월말 들어 이탈리아 정치적 리스크와 '11년 이후 최고치에 도달한 미 국채금리 부담이 투자심리 악화로 이어져 상승폭을 축소하며 강보합권에서 마감하였습니다.

국내 증시는 3월초 글로벌 무역분쟁 우려 완화, 반도체 업황개선 기대감 등에 따라 상승세로 출발하였으나, 미 기술주 급락에 따른 국내 IT업종 약세, 미국 금리인상 속도 관련 불확실성 및 미-중 무역마찰 심화 우려 등으로 인해 상승폭을 대부분 반납하였습니다. 4월초 미-중 무역분쟁 심화 우려로 인해 하락하여 출발하였으나, 시진핑 주석의 협상안 제시에 따른 무역갈등 해소 기대감, 삼성전자 어닝 서프라이즈로 인한 1분기 실적 기대감, 중국 경기회복 기대감, 유가 상승 및 북한 비핵화와 남북 경제협력 기대감에 따른 관련 업종 주가급등 등에 힘입어 KOSPI지수가 2월초 이후 처음으로 2,510pt를 돌파하며 상승 마감하였습니다. 5월초 미-중 무역분쟁 우려가 지속되는 가운데, 미국 금리인상 가속화 우려로 인해 하락하여 출발하였습니다. 이후 유가 급등, 글로벌 반도체 업황개선 기대감에 따른 IT업종 강세에도 불구하고, ①트럼프의 북미정상회담 취소 발언에 따른 남북경협 관련주 급락, ②미-중 무역분쟁 본격화 우려 및 ③이탈리아 정치적 리스크 확산 등에 따른 투자심리 급랭으로 인해 낙폭을 확대하여 KOSPI지수가 한 때 2,400pt를 하향돌파하며 하락세로 마감하였습니다.

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

▶ 투자환경 및 운용 계획

다음 분기는 대외적으로 ①글로벌 무역분쟁 관련 각 당사국들의 대응, ②선진국 중앙은행들의 통화정책 변화 및 미국 국채금리 추이, ③글로벌 경기모멘텀 및 인플레이션 기대감 추이, ④미국/유럽/중국 등 주요국의 경제지표, ⑤원자재 가격과 환율의 움직임 등이 증시의 방향을 결정할 것으로 보이며, 대내적으로는 ①국내 수출지표, ②2분기 기업실적 결과, ③남북경제협력 추진 관련 뉴스 플로우, ④연기금과 외국인인의 수급변화 등이 중요한 변수가 될 것으로 판단됩니다.

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

동 펀드는 제한적인 범위 내에서 계량모델(가치모델, 모멘텀모델, 이례현상 등)에 근거한 스타일바스켓 편입, 페어 트레이딩, 공모주(IPO) 투자 및 기업분할/합병 등의 이벤트 투자 등을 통해 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 (비교지수 대비 성과)	-0.75 (0.10)	-1.64 (1.35)	3.84 (1.39)	3.17 (1.36)
종류(Class)별 현황				
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A (비교지수 대비 성과)	-1.02 (-0.17)	-2.17 (0.82)	3.00 (0.55)	2.06 (0.25)
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C (비교지수 대비 성과)	-1.14 (-0.29)	-2.42 (0.57)	2.61 (0.16)	1.54 (-0.27)
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e (비교지수 대비 성과)	-1.02 (-0.17)	-2.17 (0.82)	3.00 (0.55)	2.05 (0.24)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률 (비교지수 대비 성과)	-1.09 (-0.24)	-2.34 (0.65)	2.69 (0.24)	1.64 (-0.17)
비교지수(벤치마크)	-0.85	-2.99	2.45	1.81

주)비교지수(벤치마크): KOSPI200 X 100%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_운용 (비교지수 대비 성과)	3.17 (1.36)	30.19 (3.68)	23.38 (-1.55)	24.04 (-0.85)
종류(Class)별 현황				
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A (비교지수 대비 성과)	2.06 (0.25)	27.44 (0.93)	19.47 (-5.46)	17.55 (-7.34)
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C (비교지수 대비 성과)	1.54 (-0.27)	26.19 (-0.32)	17.70 (-7.23)	14.66 (-10.23)
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e (비교지수 대비 성과)	2.05 (0.24)	27.44 (0.93)	19.47 (-5.46)	17.55 (-7.34)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률 (비교지수 대비 성과)	26.44 (-0.17)	26.44 (-0.07)	18.04 (-6.89)	15.24 (-9.65)
비교지수(벤치마크)	1.81	26.51	24.93	24.89

주)비교지수(벤치마크): KOSPI200 X 100%

※ 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			
전기	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2
당기	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

4. 자산현황

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

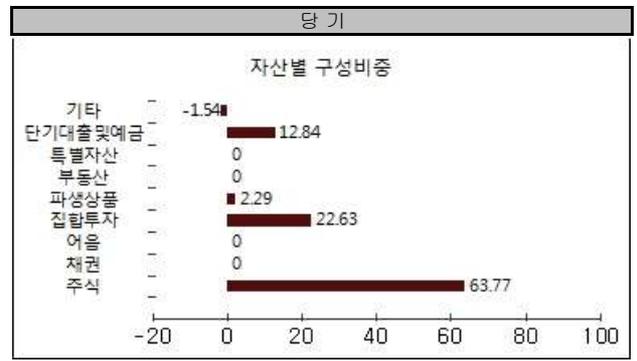
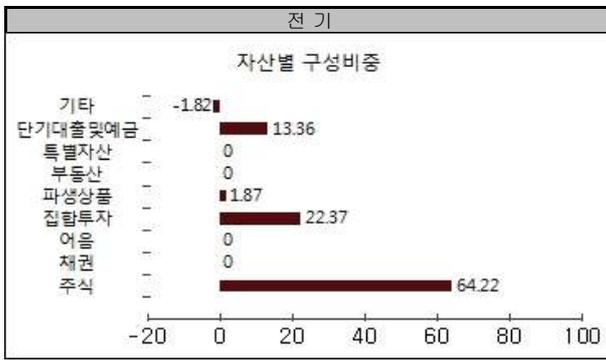
▶ 자산구성현황

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 구성비중을 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 (1.00)	35 (63.77)	0 (0.00)	0 (0.00)	12 (22.63)	1 (2.29)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	7 (12.84)	-1 (-1.54)	54 (100.00)
합계	35	0		12	1	0	0	0	0	7	-1	54

* () : 구성비중



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.

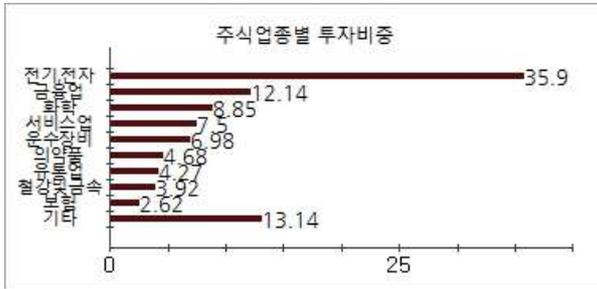
▶ 주식업종별 투자비중

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 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기, 전자	35.90	6	의약품	4.68
2	금융업	12.14	7	유통업	4.27
3	화학	8.85	8	철강및금속	3.92
4	서비스업	7.50	9	보험	2.62
5	운수장비	6.98	10	기타	13.14

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 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	집합투자증권	TREX 200	22.28	6	단기	은대(국민은행)	5.48
2	주식	삼성전자	16.60	7	주식	SK하이닉스	3.54
3	단기	REPO매수(20180608)	7.37	8	주식	POSCO	1.79
4	파생상품	코스피200 F 201809	5.80	9	주식	셀트리온	1.75
5	파생상품	코스피200 F 201806	5.79	10	대여유가증권	셀트리온	1.54

* 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	181	9	16.6	대한민국	KRW	전기, 전자	
SK하이닉스	22	2	3.54	대한민국	KRW	전기, 전자	
POSCO	3	1	1.79	대한민국	KRW	철강및금속	
셀트리온	4	1	1.75	대한민국	KRW	의약품	

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	13	12	대한민국	KRW	22.28

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 201809	매수		3	
코스피200 F 201806	매수		3	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
REPO매수	DB자산운용	2018-06-08	4	1.55		대한민국	KRW
예금	국민은행	2012-12-11	3	1.15		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	9,255	10	13,215	2109000507
박주호	퀀트운용팀장	1969	38	4,539			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 제외함이다.

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

기간	운용전문인력
해당사항 없음	

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

6. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

업자별 보수 지급현황 표를 통해 펀드가 펀드의 운용과 관련된 관계회사(자산운용사, 판매회사, 신탁업자, 일반사무관리회사 등)에 지급한 보수와 비용(기타 비용, 매매 중계수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기	
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}
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 ^{주2)}	0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	0.01	0.01	0.00	0.00
	단순매매, 중개수수료	0.01	0.01	0.00	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
	합계	0.01	0.01	0.01	0.01
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	증권거래세	0.03	0.04	0.03	0.06
	자산운용사	0.01	0.13	0.01	0.14
	판매회사	0.01	0.12	0.01	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.02	0.27	0.02	0.27
	기타비용 ^{주2)}	0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
합계	0.00	0.01	0.00	0.01	
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	증권거래세	0.00	0.04	0.00	0.05
	자산운용사	0.08	0.13	0.04	0.14
	판매회사	0.14	0.25	0.07	0.25
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.23	0.39	0.11	0.40
	기타비용 ^{주2)}	0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	0.01	0.01	0.00	0.00
	단순매매, 중개수수료	0.01	0.01	0.00	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.01
합계	0.01	0.01	0.00	0.01	
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	증권거래세	0.02	0.03	0.01	0.06
	자산운용사	0.02	0.13	0.02	0.14
	판매회사	0.02	0.12	0.02	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계	0.05	0.27	0.05	0.27
	기타비용 ^{주2)}	0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
합계	0.00	0.01	0.00	0.01	

	증권거래세	0.01	0.04	0.01	0.05
--	-------	------	------	------	------

* 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 : 없음

※ 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,%)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_운용	전기	0	0	0	0.0511
	당기	0	0	0	0.0493
종류(Class)별 현황					
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/A	전기	1.0673	0	1.0673	0.0541
	당기	1.0679	0	1.0679	0.0508
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C	전기	1.5629	0	1.5629	0.0509
	당기	1.5615	0	1.5615	0.0493
유리마음편한인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	전기	1.0688	0	1.0688	0.0518
	당기	1.0683	0	1.0683	0.0496

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.

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

(단위:백만원, %)

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
11,800	758	25,087	1,546	26.86	106.58

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 나타냅니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

2017-09-11 ~ 2017-12-10	2017-12-11 ~ 2018-03-10	2018-03-11 ~ 2018-06-10
44.01	20.88	26.86

* 회전을 상승 이유: 벤치마크(KOSPI200지수) 정기변경 등의 이벤트 부재에도 불구하고, 설정/환매와 리밸런싱 등의 사유로 매매가 늘어 회전율이 소폭 상승하였습니다.