

자산운용보고서

유리KOSPI200인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]

(운용기간 : 2019년02월28일 ~ 2019년05월27일)

- 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)

1	공지사항
2	펀드의 개요 <ul style="list-style-type: none">▶ 기본정보▶ 재산현황
3	운용경과 및 수익률현황 <ul style="list-style-type: none">▶ 운용경과▶ 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
8	자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

3. 위험관리

운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위해, 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회에서 결정합니다. 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 노출된다는 점에 유의하셔야 합니다.

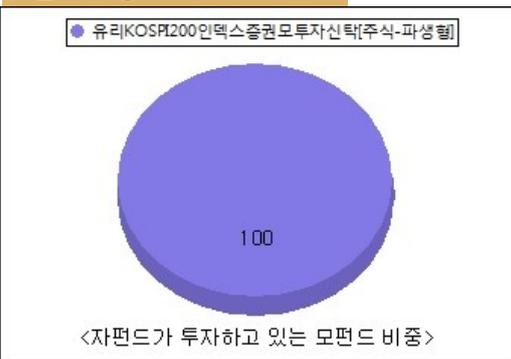
이 펀드는 KOSPI200의 성과에 근접한 수준의 수익률을 달성할 것으로 예상되지만 시장상황, 운용여건 등의 다양한 사유로 인하여 비교지수인 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 수익률과 펀드 성과 간의 차이, 즉 추적오차가 발생할 수 있습니다. 이러한 추적오차는 지수추종을 목적으로 하는 펀드의 위험요소가 됩니다. 자산운용사는 추적오차를 최소화하기 위하여 포트폴리오 재조정 등의 다양한 보완방안을 실행할 예정이나, 추적오차 발생 가능성을 완전히 배제할 수 없다는 점에 유의하셔야 합니다.

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 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.

▶ 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)	6,833	5,911	-13.50
	부채총액(B)	90	8	-91.21
	순자산총액(C=A-B)	6,743	5,903	-12.46
	발행 수익증권 총 수(D)	6,046	5,764	-4.67
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,115.27	1,024.12	-8.17
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리KOSPI200인덱스자(주식-파생형)_C/C	기준가격	1,091.10	998.12	-8.52
유리KOSPI200인덱스자(주식-파생형)_C/A	기준가격	1,103.21	1,011.25	-8.34
유리KOSPI200인덱스자(주식-파생형)_C/S	기준가격	1,101.82	1,009.80	-8.35
유리KOSPI200인덱스자(주식-파생형)_C/A-e	기준가격	1,105.18	1,013.32	-8.31
유리KOSPI200인덱스자(주식-파생형)_C/C-e	기준가격	1,098.91	1,006.56	-8.40

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 3월 초 미·중 무역협상 불확실성, 주요국 경제지표 부진으로 인해 하락하여 출발하였으나, 이후 미 소매지표 호조, 브렉시트 우려완화 및 미·중 무역협상 타결 기대감에 힘입어 상승세로 전환되었습니다. 월 중 유럽 제조업지표 부진, 미 장단기 금리차 역전으로 인해 글로벌 경기둔화 우려가 재부각되며 재차 하락세로 전환되기도 하였으나, 월 말 들어 유가강세, 미·중 무역협상 진전 및 미 시장금리 반등 등에 힘입어 상승세를 유지하며 마감하였습니다. 4월에는 월 초 미·중 제조업지표 호조에 힘입어 상승하여 출발한 가운데, 독일 수출지표 부진, 미-EU간 무역마찰 가능성 및 IMF의 경제성장을 하향조정 등의 부정적인 이슈에도 불구하고 미 중앙은행의 경기전망에 대한 자신감 표명, 미·중 무역협상 타결 기대감, 주요국 경제지표 개선에 따른 글로벌 경기둔화 우려 완화, 주요 기업들의 양호한 1분기 실적결과 및 유가상승세 지속 등에 힘입어 미/유럽 증시 중심으로 상승하여 마감하였습니다. 5월에는 월 초 5월 미 통화정책회의의 실망감, 실적기대감 약화 및 유가급락 등으로 인해 하락하여 출발한 가운데 미국의 자동차 수입관세 인상 연기, 미/독일 경제지표 호조 등의 긍정적인 이슈에도 불구하고 1)미국의 대중 관세부과에 따른 미·중 무역갈등 장기화 우려, 2)영국 내 브렉시트 협상 관련 정치적 불협화음, 3)미국의 중국 IT기업 화웨이 거래제한 돌입, 4)미국 주택지표 부진 및 5)미국의 멕시코산 물품에 대한 관세부과 발표 등의 영향으로 하락세를 지속하며 마감하였습니다.

국내 증시는 3월 북미정상회담 결렬에 따른 매출 출회, 주요국 경제지표 부진 및 반도체업종 주가악화로 인해 하락하여 출발한 가운데 월 중 미 소매지표 호조, 중국증시 강세 및 미·중 무역협상 타결 기대감 등에 힘입어 상승세로 전환되기도 하였으나 월 후반 들어 북미관계 불안감, 유럽 제조업지표 부진, 미 장단기 금리차 역전과 경기둔화 심화우려 및 미·중 무역협상 불확실성 등으로 인해 하락세를 지속하며 마감하였습니다. 4월에는 미·중 제조업지표 호조, 기관/외국인의 동반 순매수에 힘입어 상승하여 출발한 가운데, 선진국 중앙은행들의 완화적 통화정책 기조, 미·중 무역협상 진전 기대감 및 주요국 경제지표 개선 등에 힘입어 월 중반까지 상승세를 지속하였으나 월 후반 들어 차익실현 매물출회, 경기부양책 기대감 약화로 인한 중국증시 하락반전, 미-EU간 무역마찰 가능성 및 한국은행의 성장을 전망치 하향조정 등의 여파로 하락세로 전환되며 상승폭을 일부 반납하며 마감하였습니다. 5월에는 월 초 5월 미 통화정책회의에서 연준의장의 금리인하 가능성 일축, 원-달러환율 상승세 지속 등의 영향으로 하락하여 출발한 가운데, 월 중 주요국 경제지표 호조 지속, 미국의 화웨이 제재 반사이익 기대감에 따른 IT업종 주가강세 등은 긍정적이었으나, 1)미·중 양국의 관세부과 개시에 따른 미·중 무역갈등 우려 재부각, 2)브렉시트 관련 영국 내 정치적 불확실성 3)원-달러환율 상승세 지속 및 4)5월말 MSCI의 중국A주 편입비용 확대에 따른 외국인의 대규모 매도세 출현 등의 영향으로 낙폭을 확대하여, 1월 이후 KOSPI지수가 2,050pt선을 재차 하회하며 큰 폭의 하락세를 기록하였습니다.

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)미·중 정상회담 성사여부 및 협상내용, 2)EU 의회선거, 브렉시트 정책 관련 유럽법 정치적 불확실성, 3)선진국 중앙은행들의 통화정책 변화, 4)미국/중국 등 주요국의 증시흐름, 5)중국의 경기부양 정책변화 여부, 6)주요국의 경제지표 내용, 7)주요 기업들의 2분기 실적 및 8)국제유가와 환율의 움직임 등이 증시의 방향을 결정할 것으로 보이며, 대내적으로는 9)국내 수출지표 및 내수경기 변화, 10)국내 주요 기업들의 2분기 실적, 11)남북 경제협력 관련 뉴스 및 12)연기금과 외국인의 수급변화 등이 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 계획입니다.

동 펀드는 제한적인 범위 내에서 계량모델(펀더멘탈, 베타, 모멘텀 모델 등)에 근거한 스타일바스켓 편입, IPO 투자 및 Event-driven 전략 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	-8.17	-1.19	-9.06	-14.91
(비교지수 대비 성과)	(0.27)	(1.63)	(1.87)	(1.96)
종류(Class)별 현황				
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C	-8.52	-1.91	-10.08	-16.18
(비교지수 대비 성과)	(-0.08)	(0.91)	(0.85)	(0.69)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A	-8.34	-1.53	-9.54	-15.51
(비교지수 대비 성과)	(0.10)	(1.29)	(1.39)	(1.36)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S	-8.35	-1.55	-9.58	-15.56
(비교지수 대비 성과)	(0.09)	(1.27)	(1.35)	(1.31)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e	-8.31	-1.48	-9.47	-15.42
(비교지수 대비 성과)	(0.13)	(1.34)	(1.46)	(1.45)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	-8.40	-1.67	-9.74	-15.75
(비교지수 대비 성과)	(0.04)	(1.15)	(1.19)	(1.12)
비교지수(벤치마크)	-8.44	-2.82	-10.93	-16.87

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
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_운용	-14.91	-10.74	15.03	10.91
(비교지수 대비 성과)	(1.96)	(3.12)	(5.71)	(9.36)
종류(Class)별 현황				
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C	-16.18	-13.35	10.06	3.01
(비교지수 대비 성과)	(0.69)	(0.51)	(0.74)	(1.46)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A	-15.51	-11.98	12.65	7.10
(비교지수 대비 성과)	(1.36)	(1.88)	(3.33)	(5.55)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S	-15.56	-12.10	12.41	6.74
(비교지수 대비 성과)	(1.31)	(1.76)	(3.09)	(5.19)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e	-15.42	-11.79	13.01	7.68
(비교지수 대비 성과)	(1.45)	(2.07)	(3.69)	(6.13)
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	-15.75	-12.47	11.72	5.62
(비교지수 대비 성과)	(1.12)	(1.39)	(2.40)	(4.07)
비교지수(벤치마크)	-16.87	-13.86	9.32	1.55

주)비교지수(벤치마크): KOSPI200 X 100%

※ 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
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_운용	0.78	2.35	1.73

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	311	0	0	118	52	0	0	0	0	3	0	485
당기	-355	0	0	-128	-63	0	0	0	0	2	1	-543

4. 자산현황

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

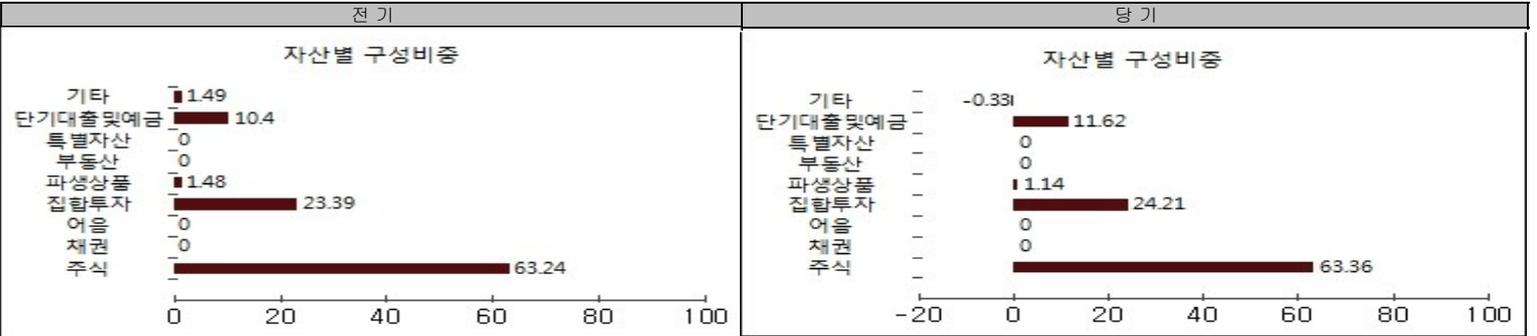
▶ 자산구성현황

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 (1.00)	3,745 (63.36)	0 (0.00)	0 (0.00)	1,431 (24.21)	68 (1.14)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	687 (11.62)	-19 (-0.33)	5,911 (100.00)
합계	3,745	0	0	1,431	68	0	0	0	0	687	-19	5,911

* (□): 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.

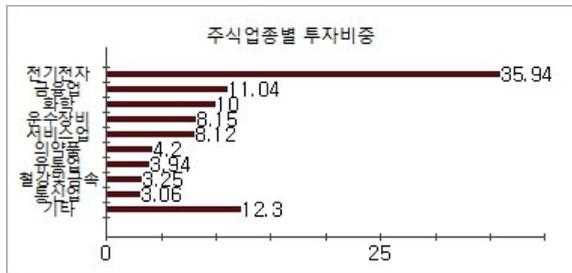
▶ 주식업종별 투자비중

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

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	35.94	6	의약품	4.20
2	금융업	11.04	7	유통업	3.94
3	화학	10.00	8	철강및금속	3.25
4	운수장비	8.15	9	통신업	3.06
5	서비스업	8.12	10	기타	12.30

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	24.12	6	주식	현대차	1.60
2	주식	삼성전자	16.89	7	주식	셀트리온	1.40
3	단기상품	은대(국민은행)	11.62	8	주식	KB금융	1.37
4	주식	SK하이닉스	3.16	9	주식	POSCO	1.36
5	주식	신한지주	1.61	10	주식	LG화학	1.25

※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	23,408	998	16.89	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	2,793	187	3.16	대한민국	KRW	전기전자	
신한지주	2,027	95	1.61	대한민국	KRW	금융업	
현대차	700	95	1.6	대한민국	KRW	운수장비	
셀트리온	476	83	1.4	대한민국	KRW	의약품	
KB금융	1,764	81	1.37	대한민국	KRW	금융업	
POSCO	343	80	1.36	대한민국	KRW	철강및금속	
LG화학	227	74	1.25	대한민국	KRW	화학	

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	1,473	1,425	대한민국	KRW	24.12

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2012-11-19	686	1.38		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	
박주호 ^{주)}	퀀트운용본부장	1969	35	3,877	8	12,575	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

기간	운용전문인력
2018.07.09 ~ 현재 이 투자신탁의 최초 설정일(2006.08.28) ~ 2018.07.08 이 투자신탁의 최초 설정일(2006.08.28) ~ 2018.07.08	박주호(책임) 한진규(책임) 박주호(부책임)

▶ 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, 매매중계수수료)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)}	
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 ^{주2)}	0.12	0.00	0.26	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.38	0.01	0.29	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.27	0.00	0.21	0.00
		합계	0.65	0.01	0.50	0.01
	증권거래세	2.37	0.04	1.84	0.03	
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C	자산운용사	3.52	0.11	3.46	0.11	
	판매회사	8.12	0.25	8.00	0.24	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.24	0.01	0.24	0.01	
	일반사무관리회사	0.12	0.00	0.12	0.00	
	보수합계	12.01	0.37	11.83	0.36	
	기타비용 ^{주2)}	0.08	0.00	0.15	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.19	0.01	0.15	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.14	0.00	0.11	0.00
		합계	0.33	0.01	0.26	0.01
	증권거래세	1.22	0.04	0.97	0.03	
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A	자산운용사	1.74	0.11	1.76	0.11	
	판매회사	0.88	0.06	0.90	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.12	0.01	0.12	0.01	
	일반사무관리회사	0.06	0.00	0.06	0.00	
	보수합계	2.80	0.18	2.84	0.17	
	기타비용 ^{주2)}	0.04	0.00	0.08	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.09	0.01	0.08	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.07	0.00	0.05	0.00
		합계	0.16	0.01	0.13	0.01
	증권거래세	0.57	0.04	0.44	0.03	
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S	자산운용사	0.00	0.11	0.00	0.10	
	판매회사	0.00	0.07	0.00	0.07	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.00	0.01	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	0.00	0.19	0.01	0.19	
	기타비용 ^{주2)}	0.00	0.00	0.00	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.01	0.00	0.01
	증권거래세	0.00	0.04	0.00	0.03	
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e	자산운용사	1.08	0.11	0.97	0.11	
	판매회사	0.28	0.03	0.25	0.03	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.08	0.01	0.07	0.01	
	일반사무관리회사	0.04	0.00	0.03	0.00	
	보수합계	1.47	0.15	1.32	0.14	
	기타비용 ^{주2)}	0.02	0.00	0.04	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.06	0.01	0.04	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.04	0.00	0.03	0.00
		합계	0.10	0.01	0.07	0.01
	증권거래세	0.36	0.04	0.27	0.03	
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	자산운용사	0.62	0.11	0.58	0.11	
	판매회사	0.71	0.13	0.67	0.12	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.04	0.01	0.04	0.01	
	일반사무관리회사	0.02	0.00	0.02	0.00	
	보수합계	1.40	0.25	1.32	0.24	
	기타비용 ^{주2)}	0.01	0.00	0.03	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.03	0.01	0.03	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.00	0.02	0.00
		합계	0.06	0.01	0.04	0.01
	증권거래세	0.22	0.04	0.16	0.03	

* 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 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	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_운용	전기	0.0091	0	0.0091	0.0398
	당기	0.01	0	0.01	0.0348
종류(Class)별 현황					
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C	전기	1.4802	0	1.4895	0.0408
	당기	1.4802	0	1.4902	0.0354
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A	전기	0.7	0	0.7091	0.0399
	당기	0.7001	0	0.7104	0.0347
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/S	전기	0.7588	0	0.7666	0.0403
	당기	0.7558	0	0.7666	0.0349
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/A-e	전기	0.59	0	0.5986	0.0365
	당기	0.59	0	0.5998	0.0334
유리KOSPI200인덱스자[주식-파생형]_C/C-e	전기	0.9798	0	0.9886	0.0398
	당기	0.9798	0	0.9898	0.0351

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

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위:백만원, %)

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
9,824	449	16,318	770	15.03	61.64

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

(단위: %)

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

2018-08-28 ~ 2018-11-27	2018-11-28 ~ 2019-02-27	2019-02-28 ~ 2019-05-27
2.90	18.27	15.03

* 회전율 변동 사유 : 벤치마크(KOSPI200지수) 정기변경 부재 및 설정/환매, 리밸런싱 등의 감소로 매매가 줄어 회전율이 하락하였습니다.

8. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

(단위 : 백만원, %)

펀드명칭	투자금액	수익률
해당사항 없음		

* 투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매) 될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.