

자산운용보고서

유리트리플알파팩티브직연금융증권자투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2019년06월03일 ~ 2019년09월02일)

o 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**
 - ▶ 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 주식 매매회전율 추이
- 8 **자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항**

1. 공지 사항

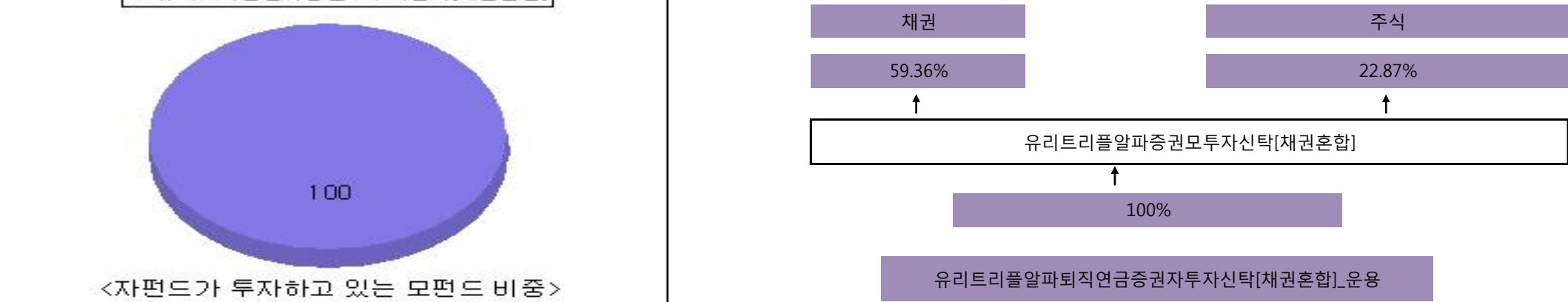
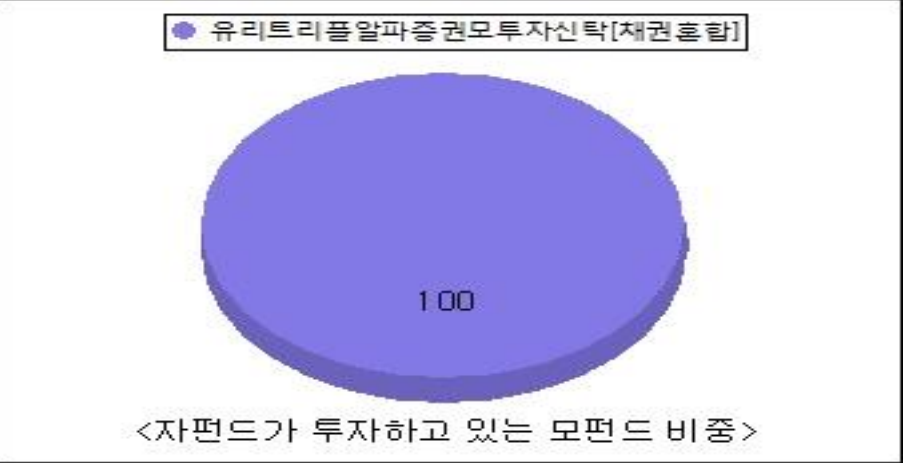
1. 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
2. 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로써 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는고객님이 가입한 유리트리플알파퇴직연금증권자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파퇴직연금증권자투자신탁(채권혼합)_운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '교보생명보험, 미래에셋대우, 삼성증권, 하나금융투자, 한화투자증권'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)	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
유리트리플알파퇴직연금증권자투자신탁[채권혼합]_운용, 유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합], 유리트리플알파퇴직연금증권자투자신탁[채권혼합]_ClassC, 유리트리플알파퇴직연금증권자투자신탁[채권혼합]_ClassC-e		4등급	AV716, AV714, AV717, BX455
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.12.03
운용기간	2019.06.03 ~ 2019.09.02	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	교보생명보험, 미래에셋대우, 삼성증권, 하나금융투자, 한 화투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	1. 투자대상 이 펀드는 신탁재산의 80% 이상을 국내채권에 투자하는 모펀드인 '유리트리플알파증권모투자신탁 [채권혼합]'에 투자하는 자펀드입니다. 수익증권의 환매를 원활하게 하고 투자대기자금의 활용을 위해 단기대출 및 금융기관에 10% 이하를 예치합니다. 다만, 집합투자업자가 수익자에게 최선의 이익이 된다고 판단하는 경우에는 투자신탁 자산총액의 20% 이하의 범위내에서 10%를초과할 수 있습니다.		
	2. 투자전략 이 투자신탁은 채권을 주된 투자대상으로 하되, 롱숏전략, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용 전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하여 자본소득을 추구하는 자투자신탁입니다. [모투자신탁의 투자전략] • 롱숏(Long/Short) 및 차익거래 전략 - 저평가된 자산을 매수함과 동시에 고평가된 자산을 매도하여 수익을 추구합니다. - 현·선물 지수차익거래, ETF차익거래 등을 통해 수익을 추구합니다. • 공모주 및 이벤트 활용 전략 - 공모기업의 펀더멘털, 기업가치, 수급상황 등을 분석을 통해 등록 이후 자본이익 확대 가능성이 높은 공모주를 적극 발굴 및 투자하여 수익을 추구합니다. - 이벤트 투자 전략 • 주식시장 이례현상 활용 전략 - 주식시장 월말효과, 시장 과잉반응 등 주식시장의 이례현상을 활용하여 수익을 추구합니다. • 채권 투자 전략 - 채권 듀레이션 6개월 ~ 1년 수준으로 금리상승 위험 노출을 최소화하여 안정적인 이자수익 확보를 추구합니다 - 유동성이 풍부한 통안채, 국고채, 은행채 등에 주로 투자하며, 금리 곡선에 따른 교체매매 및 적절한 투자 대상 선정을 통해 추가 수익을 추구합니다. - 국제선물을 활용한 트레이딩 전략을 일부 활용하여 추가 수익을 추구합니다.		
	3. 위험관리 운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 등에서 결정합니다. 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 '유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자 신탁입니다. 이 투자신탁이 투자하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합]'은 채권에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 주식에 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 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
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_운용	자산 총액(A)	19,192	18,936	-1.33
	부채총액(B)			0.00
	순자산총액(C=A-B)	19,192	18,936	-1.33
	발행 수익증권 총 수(D)	18,313	18,000	-1.71
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,047.95	1,052.03	0.39
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C	기준가격	1,044.39	1,046.52	0.20
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e	기준가격	1,036.66	1,039.37	0.26

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**

당분기 펀드의 수익률은 보수전 기준으로 0.39%(운용펀드 기준)를 기록하였습니다. 우선주 차익거래 전략은 8월말 MSCI 지수변경에 따른 외국인 매도 충격으로 우선주가 보통주 대비 상대적으로 약세를 보였으나 이후 양호한 흐름을 보이면서 수익률 향상에 기여하였습니다. 다수의 중소형 IPO 및 블록딜, 회사분할 및 합병 등에 연관된 종목을 편입하여 수익 실현하였으며 바스켓 롱숏전략은 시장하락과 함께 변동성이 증가하면서 소폭 부진한 흐름을 보였습니다.

▶ **투자환경 및 운용 계획**

국내 증시는 8월초에 1,900선을 하회하기도 하였으며 이후 뚜렷한 방향성 없이 시장 변동성이 확대된 상태입니다. 미·중무역협상 장기화에 따른 경기하강 우려감이 높아져 지수대는 하락하였지만 역설적으로 FRB 통화 완화 등 정책에 대한 기대감이 상승하면서 변동성이 증가하였고 업종별, 종목별 수익률 차별화가 진행중입니다. 시장 변동성이 상승하면서 차익 거래 신규 기회는 증가할 것으로 예상됨에 따라 펀드는 적극적인 포지션 진입 및 청산을 통해 수익을 추구할 계획입니다. IPO는 밸류에이션 및물량 부담이 적은 종목을 중심으로 접근할 예정이며 추가적으로 향후 각종 기업 관련 이벤트를 활용한 초과 수익 기회를 모색할 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
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_운용	0.39	1.49	2.40	3.14
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C	0.20	1.11	1.84	2.39
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e	0.26	1.23	2.01	2.62
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_운용	3.14	6.59	8.96	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C	2.39	5.05	6.60	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e	2.62	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

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			
전기	-11	70	0	93	57	0	0	0	0	4	-9	205
당기	-147	70	0	32	123	0	0	0	0	4	-11	72

4. **자산현황**

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

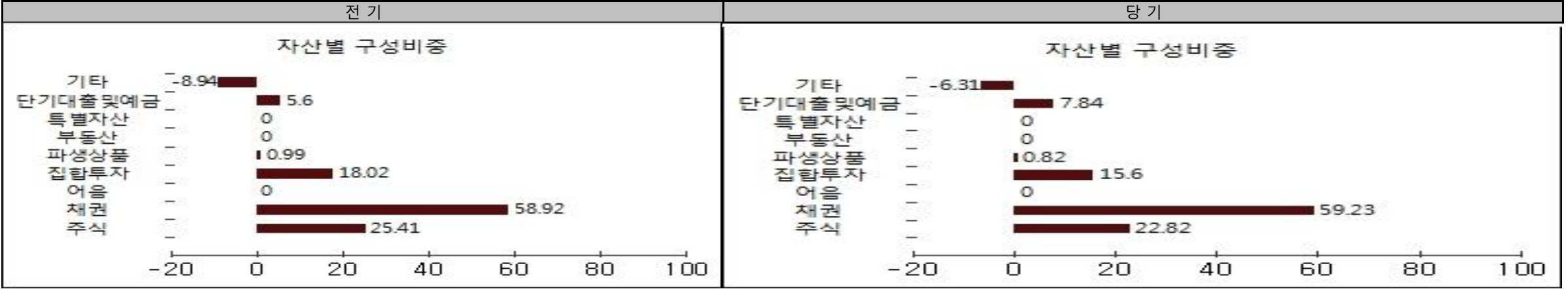
▶ **자산구성현황**

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	4,321	11,216		2,953	155	0	0	0	0	1,485	-1,195	18,936
(1.00)	(22.82)	(59.23)	(0.00)	(15.60)	(0.82)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(7.84)	-(6.31)	(100.00)
합계	4,321	11,216		2,953	155	0	0	0	0	1,485	-1,195	18,936

*[□]: 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.

▶ 순포지션비율

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
매수	4,321 (22.82)	11,216 (59.23)	0 (0)	2,953 (15.6)	158 (0.83)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	302 (1.60)	-15 (0.08)	18,936 (100)
매도	1,284 (100)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	1,284 (100)
순포지션	3,037 (17.21)	11,216 (63.54)	0 (0)	2,953 (16.73)	158 (0.9)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	302 (1.71)	-15 (0.08)	17,652 (100)

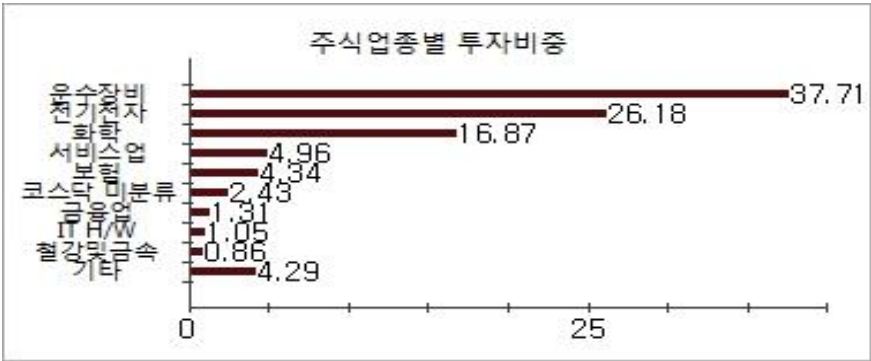
▶ 주식업종별 투자비중

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	운수장비	37.71	6	코스닥 미분류	2.43
2	전기전자	26.18	7	금융업	1.31
3	화학	16.87	8	IT H/W	1.05
4	서비스업	4.96	9	철강및금속	0.86
5	보험	4.34	10	기타	4.29

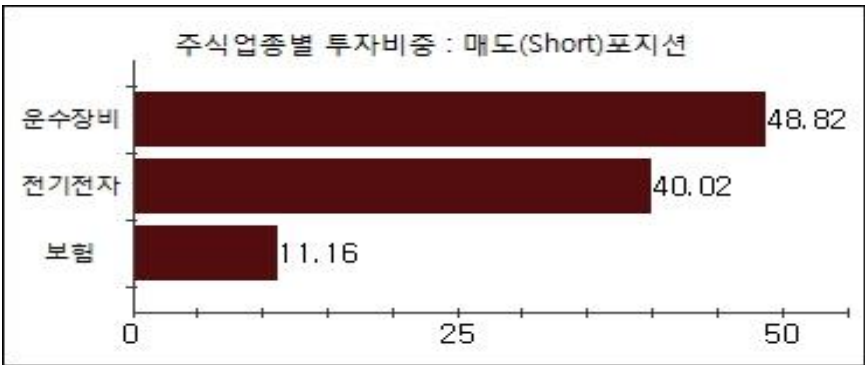
주) 주식종목의 업종 구분은, 국내 주식은 한국거래소의 업종분류기준, 해외 주식은 GICS(국제산업분류기준) 2차 분류를 따릅니다.



▶ 주식업종별 투자비중 : 매도(Short)포지션

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	운수장비	48.82			
2	전기전자	40.02			
3	보험	11.16			



▶ 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	채권	통안02120-2004-02	37.80	6	단기상품	REPO매수(20190902)	6.24
2	채권	통안02060-1912-02	12.56	7	차입주식	삼성전자	6.17
3	차입주식	현대차	8.04	8	주식	현대차2우B	5.85
4	집합투자증권	KBSTAR 단기통안채	7.09	9	채권	통안01180-2108-02	5.20
5	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS	6.33	10	채권	통안02140-2006-02	3.67

※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
현대차2우B	12,824	1,108	5.85	대한민국	KRW	운수장비	

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
통안02120-2004-02	7,093	7,158	대한민국	KRW	2018-04-02	2020-04-02		N/A	37.80
통안02060-1912-02	2,374	2,379	대한민국	KRW	2017-12-02	2019-12-02		N/A	12.56
통안01180-2108-02	985	985	대한민국	KRW	2019-08-02	2021-08-02		N/A	5.20
통안02140-2006-02	690	695	대한민국	KRW	2018-06-02	2020-06-02		N/A	3.67

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	1,333	1,342	대한민국	KRW	7.09
KODEX 단기채권PLUS	수익증권	삼성자산운용	1,192	1,198	대한민국	KRW	6.33

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
REPO매수	대신자산운용(우정사업본부)	2019-09-02	1,182	1.57		대한민국	KRW

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
박주호 ^{주)}	퀀트운용본부장	1969	33	3,592	9	16,238	2109000457
윤준수 ^{주)}	채권운용1본부장	1967	51	33,989	6	12,635	2109000319
최재영	채권운용2본부장	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			
기간		운용전문인력	
2018.07.09 ~ 현재		박주호(책임)	
이 투자신탁의 최초 설정일(2014.12.03) ~ 2018.07.08		한진규(책임)	
이 투자신탁의 최초 설정일(2014.12.03) ~ 2018.07.08		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, 매매중개수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

							(단위: 백만원, %)	
		구분		전기		당기		
				금액	비율 <small>주1)</small>	금액	비율 <small>주1)</small>	
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_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 <small>주2)</small>	7.58	0.04	9.09	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	2.86	0.02	2.72	0.01		
		조사분석업무 등	0.34	0.00	0.37	0.00		
		서비스 수수료						
		합계	3.19	0.02	3.09	0.02		
		증권거래세	3.08	0.02	2.13	0.01		
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C			자산운용사	11.68	0.06	11.56	0.06	
			판매회사	21.03	0.11	20.80	0.11	
			펀드재산보관회사(신탁업자)	0.93	0.01	0.92	0.01	
			일반사무관리회사	0.47	0.00	0.46	0.00	
			보수합계	34.11	0.18	33.75	0.18	
			기타비용 <small>주2)</small>	7.53	0.04	9.03	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	2.79	0.02	2.67	0.01		
		조사분석업무 등	0.33	0.00	0.36	0.00		
		서비스 수수료						
		합계	3.12	0.02	3.04	0.02		
		증권거래세	3.01	0.02	2.09	0.01		
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e			자산운용사	0.26	0.06	0.23	0.06	
			판매회사	0.23	0.06	0.21	0.06	
			펀드재산보관회사(신탁업자)	0.02	0.01	0.02	0.01	
			일반사무관리회사	0.01	0.00	0.01	0.00	
			보수합계	0.53	0.13	0.46	0.13	
			기타비용 <small>주2)</small>	0.16	0.04	0.17	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.06	0.02	0.05	0.01		
		조사분석업무 등	0.01	0.00	0.01	0.00		
		서비스 수수료						
		합계	0.07	0.02	0.06	0.02		
		증권거래세	0.07	0.02	0.04	0.01		

* 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 : 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 연평균액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위: 연환산,%)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_운용	전기	0	0	0.2542	0.0788
	당기	0	0	0.2557	0.0739
종류(Class)별 현황					
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C	전기	0.7323	0	0.9866	0.0789
	당기	0.7323	0	0.9882	0.074
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e	전기	0.5065	0	0.7721	0.0782
	당기	0.5066	0	0.7696	0.0744

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(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 0.25%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

(단위:백만원, %)

유리트리플알파모[채권혼합]

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
6,536	382	26,587	866	19.27	76.44

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리트리플알파모[채권혼합]

2018-12-03 ~ 2019-03-02	2019-03-03 ~ 2019-06-02	2019-06-03 ~ 2019-09-02
54.55	17.66	19.27

※ 회전을 변동 사유: 해당 운용기간 중 매매회전율은 전분기 대비 소폭 증가하였습니다.

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.