

자산운용보고서

유리트리플알파증권투자신탁(주식혼합)

(운용기간 : 2020년08월15일 ~ 2020년11월14일)

○ 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)

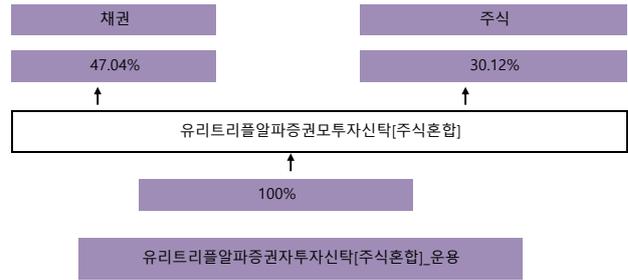
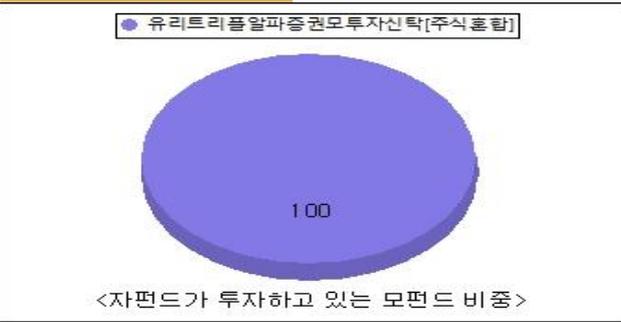
목 차

- 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**

4. 수익구조

이 투자신탁은 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자신탁입니다. 이 투자신탁이 투자하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'은 국내주식에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 채권에 투자신탁 자산총액의 50% 미만으로 투자하여 자본소득을 추구합니다. 따라서, 모투자신탁이 투자한 주식, 채권 등의 가격 변동에 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
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	자산 총액(A)	6,367	5,712	-10.29
	부채총액(B)	1	1	-0.02
	순자산총액(C=A-B)	6,366	5,711	-10.29
	발행 수익증권 총 수(D)	5,892	5,330	-9.54
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,080.37	1,071.42	-0.83
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	기준가격	1,072.85	1,061.57	-1.05
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	기준가격	1,066.95	1,055.05	-1.12
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	기준가격	1,060.17	1,048.22	-1.13
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	기준가격	1,069.53	1,057.75	-1.10
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	기준가격	1,046.93	1,034.21	-1.21
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	기준가격	1,075.01	1,064.38	-0.99

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말함니다.

※ 분배금내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_운용	2020.11.16.	113	5,437	1071.42	1050.29	
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassA1	2020.11.16.	16	3,096	1055.05	1049.97	
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassA-e	2020.11.16.	0	32	1061.57	1050.06	
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC1	2020.11.16.	0	2,035	1034.21	1034.21	
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-e	2020.11.16.	0	41	1057.75	1049.85	
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-W	2020.11.16.	1	41	1064.38	1050.17	
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-P1	2020.11.16.	0	208	1048.22	1047.99	

주) 분배후수탁고는 재투자 122 백만좌 포함입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

당 분기 펀드의 수익률은 보수 차감 전 기준으로 -0.83%(운용클래스 기준)를 기록하였습니다.

페어트레이딩 부분에서는 1개의 페어 포지션에 진입하였습니다. 또한 현물-선물 간 매도 차익거래로 절대 수익을 추구하였습니다.

이벤트/IPO 부분에서는 중소형 기업들 중 시초가가 공모가 대비 높은 수익을 보인 종목이 성과에 긍정적인 기여를 하였습니다. Post-IPO 전략으로 상장 이후 하락폭이 큰 종목에 진입하여 추가 수익을 모색하였습니다.

다만, 바스켓 통샷 전략 부분에서는 시장의 변동성에 대응하기 위하여 완전 헤지를 취한 점은 성과에 부정적인 기여를 하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

12월 현재 백신에 대한 기대감 및 외국인의 긍정적인 수급 환경으로 다소 완만하지만 11월의 상승추세를 이어가고 있습니다.

하지만 연말에 다가올수록 차익 실현에 대한 욕구 및 연말 대주주 이슈로 인하여 지금의 상승추세가 얼마나 더 이어질지에 대한 고찰이 필요한 시점이라고 판단됩니다. 또한 해외는 물론 국내 코로나 재확산에 대한 우려 속에서 투자심리 위축이 지수의 추가적인 상승을 제한시킬 불확실성이 있습니다.

향후 시장의 방향에 대한 예측으로 접근하기보다 안정적으로 수익을 쌓아가는데 집중할 예정입니다. 또한 주도 업종 및 종목에 관심을 두고 수익 가능한 페어 발굴하여 적극적인 포지션 진입 및 청산을 통해 수익을 추구할 계획입니다. 이벤트/IPO 부분에서는 밸류에이션 및 물량 부담이 적은 종목을 중심으로 접근할 예정이며 추가적으로 향후 각종 기업 관련 이벤트(유무상증자, 분할/합병, KOSPI200 정기변경 등)를 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
유리트리플알파자[주식혼합]_운용 (비교지수 대비 성과)	-0.83	3.06	-0.76	0.38
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e (비교지수 대비 성과)	-1.05	2.60	-1.42	-0.51
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1 (비교지수 대비 성과)	-1.12	2.47	-1.61	-0.76
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1 (비교지수 대비 성과)	-1.13	2.44	-1.64	-0.81
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e (비교지수 대비 성과)	-1.10	2.49	-1.57	-0.71
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1 (비교지수 대비 성과)	-1.21	2.26	-1.90	-1.16
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W (비교지수 대비 성과)	-0.99	2.73	-1.23	-0.26
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리트리플알파자[주식혼합]_운용 (비교지수 대비 성과)	0.38	3.41	6.16	11.69
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e (비교지수 대비 성과)	-0.51	1.59	3.36	6.84
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1 (비교지수 대비 성과)	-0.76	1.08	2.59	5.50
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1 (비교지수 대비 성과)	-0.81	0.98	2.44	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e (비교지수 대비 성과)	-0.71	1.18	2.75	5.78
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1 (비교지수 대비 성과)	-1.16	0.27	1.37	3.42
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W (비교지수 대비 성과)	-0.26	2.10	4.14	8.18
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

※ 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	676	11	0	-174	-257	0	0	0	0	0	0	-2	254
당기	46	2	0	-61	-34	0	0	0	0	0	0	0	-48

4. 자산현황

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

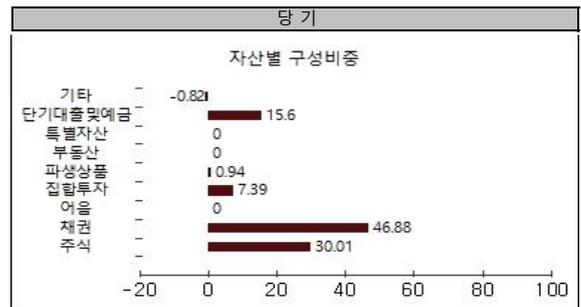
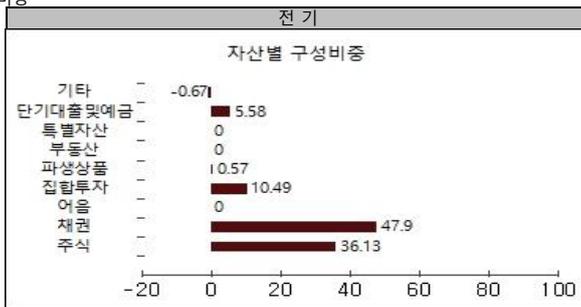
▶ 자산구성현황

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 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	1,714	2,678		422	54	0	0	0	0	891	-47	5,712	
(1.00)	(30.01)	(46.88)	(0.00)	(7.39)	(0.94)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(15.60)	-(0.82)	(100.00)	
합계	1,714	2,678		422	54	0	0	0	0	891	-47	5,712	

* (II): 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 작성된 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

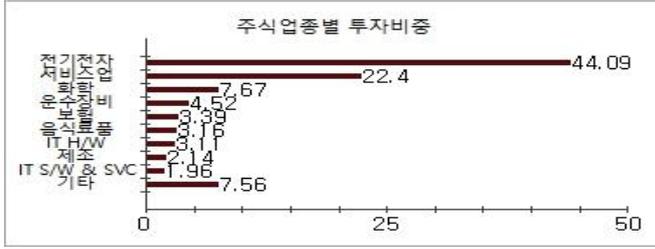
▶ 주식업종별 투자비중

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	전기전자	44.09	6	음식료품	3.16
2	서비스업	22.40	7	IT H/W	3.11
3	화학	7.67	8	제조	2.14
4	운수장비	4.52	9	IT S/W & SVC	1.96
5	보험	3.39	10	기타	7.56

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 종목의 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드의 자산총액에서 해당 종목이 차지하는 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	채권	국고01625-2206(19-3)	31.06	6	채권	통안01810-2102-02	5.27
2	단기상장	은대(신한은행)	15.60	7	주식	SK하이닉스	1.90
3	채권	국고01000-2306(20-3)	10.55	8	주식	NAVER	1.64
4	주식	삼성전자	9.44	9	주식	LG생활건강	1.52
5	집합투자증권	TIGER 200선물인버스2X	7.39	10	주식	카카오	1.49

*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	8,528	539	9.44	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	1,212	109	1.9	대한민국	KRW	전기전자	
NAVER	333	94	1.64	대한민국	KRW	서비스업	
LG생활건강	55	87	1.52	대한민국	KRW	화학	
카카오	232	85	1.49	대한민국	KRW	서비스업	

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
국고01625-2206(19-3)	1,739	1,774	대한민국	KRW	2019-06-10	2022-06-10		N/A	31.06
국고01000-2306(20-3)	600	603	대한민국	KRW	2020-06-10	2023-06-10		N/A	10.55
통안01810-2102-02	300	301	대한민국	KRW	2019-02-02	2021-02-02		N/A	5.27

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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
TIGER 200선물인버스2X	수익증권	미래에셋자산운용	559	422	대한민국	KRW	7.39

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	신한은행	2014-01-27	891	0.23		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	25	2,955	1	478	2109000457
최재영 (주)	채권운용본부장	1972	39	31,639	0	0	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 2020.06.02 ~ 현재	박주호(책임) 최재영(책임) 한진규(책임) 윤준수(책임) 박주호(부책임) 최재영(부책임)
이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2018.07.08	
이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2020.06.01	
이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2018.07.08	
이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2020.06.01	

▶ 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)}	
유리트리플알파자[주식혼합]_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)}	1.80	0.03	0.04	0.00	
	매매	단순매매, 중개수수료	1.82	0.03	1.90	0.03
	중개	조사분석업무 등				
	수수	서비스 수수료	0.65	0.01	0.42	0.01
	료	합계	2.48	0.04	2.32	0.04
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	증권거래세	3.77	0.06	3.12	0.05	
	자산운용사	0.06	0.15	0.05	0.15	
	판매회사	0.03	0.06	0.02	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.01	0.00	0.01	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	0.09	0.22	0.07	0.22	
	기타비용 ^{주2)}	0.01	0.03	0.00	0.00	
	매매	단순매매, 중개수수료	0.01	0.03	0.01	0.03
	중개	조사분석업무 등				
	수수	서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
료	합계	0.01	0.04	0.01	0.04	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	증권거래세	0.02	0.05	0.02	0.05	
	자산운용사	5.34	0.15	5.10	0.15	
	판매회사	4.45	0.13	4.25	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.22	0.01	0.21	0.01	
	일반사무관리회사	0.13	0.00	0.13	0.00	
	보수합계	10.15	0.29	9.69	0.29	
	기타비용 ^{주2)}	1.01	0.03	0.04	0.00	
	매매	단순매매, 중개수수료	0.99	0.03	1.07	0.03
	중개	조사분석업무 등				
	수수	서비스 수수료	0.36	0.01	0.23	0.01
료	합계	1.35	0.04	1.30	0.04	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	증권거래세	2.05	0.06	1.75	0.05	
	자산운용사	0.38	0.15	0.35	0.15	
	판매회사	0.35	0.14	0.32	0.14	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.02	0.01	0.01	0.01	
	일반사무관리회사	0.01	0.00	0.01	0.00	
	보수합계	0.76	0.30	0.69	0.30	
	기타비용 ^{주2)}	0.07	0.03	0.00	0.00	
	매매	단순매매, 중개수수료	0.07	0.03	0.07	0.03
	중개	조사분석업무 등				
	수수	서비스 수수료	0.03	0.01	0.02	0.01
료	합계	0.10	0.04	0.09	0.04	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	증권거래세	0.15	0.06	0.12	0.05	
	자산운용사	0.07	0.15	0.06	0.15	
	판매회사	0.05	0.11	0.05	0.11	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.01	0.00	0.01	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	0.13	0.27	0.12	0.27	
	기타비용 ^{주2)}	0.01	0.03	0.00	0.00	
	매매	단순매매, 중개수수료	0.01	0.03	0.01	0.03
	중개	조사분석업무 등				
	수수	서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
료	합계	0.02	0.04	0.02	0.04	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	증권거래세	0.03	0.06	0.02	0.05	
	자산운용사	3.87	0.15	3.38	0.15	
	판매회사	5.81	0.23	5.06	0.23	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.16	0.01	0.14	0.01	
	일반사무관리회사	0.10	0.00	0.08	0.00	
	보수합계	9.94	0.39	8.66	0.39	
	기타비용 ^{주2)}	0.70	0.03	0.03	0.00	
	매매	단순매매, 중개수수료	0.71	0.03	0.71	0.03
	중개	조사분석업무 등				
	수수	서비스 수수료	0.26	0.01	0.16	0.01
료	합계	0.97	0.04	0.87	0.04	
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	증권거래세	1.47	0.06	1.17	0.05	
	자산운용사	0.13	0.15	0.12	0.15	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.01	0.01	0.00	0.01	
	일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	보수합계	0.14	0.16	0.13	0.16	
	기타비용 ^{주2)}	0.02	0.03	0.00	0.00	
	매매	단순매매, 중개수수료	0.02	0.03	0.02	0.03
	중개	조사분석업무 등				
	수수	서비스 수수료	0.01	0.01	0.01	0.01
료	합계	0.03	0.04	0.03	0.04	
	증권거래세	0.05	0.06	0.04	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 연평잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위: 연환산,%)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수비용비율	매매·중개수수료비율
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	전기	0	0	0.3603	0.1262
	당기	0	0	0.3761	0.112
종류(Class) 별 현황					
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	전기	0.8912	0	1.2098	0.1317
	당기	0.8908	0	1.2729	0.1061
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	전기	1.1454	0	1.4868	0.1265
	당기	1.1454	0	1.4905	0.1144
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	전기	1.1944	0	1.5249	0.1236
	당기	1.1944	0	1.511	0.1169
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	전기	1.0918	0	1.5277	0.1273
	당기	1.0916	0	1.5974	0.1094
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	전기	1.5465	0	1.9314	0.1264
	당기	1.5465	0	1.9646	0.1093
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	전기	0.6411	0	0.9908	0.1244
	당기	0.6411	0	0.9851	0.1126

주1) 총보수비용비율(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. 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.25%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위:백만원, %)

유리트리플알파모[주식혼합]		매주		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산		
36,598	999	64,987	2,048	62.61	248.40		

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

(단위: %)

유리트리플알파모[주식혼합]		
2020-02-15 ~ 2020-05-14	2020-05-15 ~ 2020-08-14	2020-08-15 ~ 2020-11-14
21.72	53.87	62.61

※ 회전을 변동 사유: 공모주 매매 및 이벤트드리븐 전략(MSCI, KOSPI200 정기변경 등)을 통해 선별적으로 매매하는 과정에서 회전율이 상승했습니다.

8. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

(단위 : 백만원, %)

펀드명칭	투자금액	수익률
해당사항 없음		

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