

자산운용보고서

유리Daily인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]

(운용기간 : 2021년06월13일 ~ 2021년09월12일)

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 모투자 구조의 펀드로서 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는 고객님의 가입한 유리Daily인덱스증권자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리Daily인덱스증권자투자신탁(주식·파생형)의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '부국증권, 신한은행'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
유리Daily인덱스증권자투자신탁(주식-파생형)		2등급	70255
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(주식파생형), 개방형, 추가형, 모자형	최초설정일	2007.06.13
운용기간	2021.06.13 ~ 2021.09.12	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	부국증권, 신한은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스

1. 투자대상

이 투자신탁은 '유리KOSPI200인덱스증권투자신탁[주식-파생형]'에 투자신탁 자산총액의 90% 이상을 투자하여 KOSPI200(목표주가지수)에 근접한 수익률을 추구하되 제한된 범위 내에서 KOSPI200 대비 초과수익을 추구하는 전략을 통해 자본이득을 추구합니다.

그러나 상기의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 집합투자업자, 신탁업자, 판매회사 등 이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다.

2. 투자전략

이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 '유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁[주식-파생형]'에 투자하여 운용합니다.

<유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁[주식-파생형]>

장기 자본이득 등의 획득을 목적으로 투자신탁 재산의 대부분을 국내주식 및 국내주식관련 파생상품에 투자하여 이 투자신탁의 순자산가치의 변동률이 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 변동률과 유사하도록 운용하되 제한된 범위 내에서 한국종합주가지수200 (KOSPI200) 대비 초과수익을 추구합니다.

- 기본투자방침
- 이 투자신탁의 비교지수인 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 변동률에 근접한 성과의 달성을 위해 한국종합주가지수200(KOSPI200)을 구성하고 있는 종목과 관련 장내파생상품에 주로 투자합니다. 다만, 추적오차의 최소화 등을 위하여 필요하다고 판단하는 경우 KOSPI200 구성 종목 이외의 종목에도 투자할 수 있습니다.
- 지수추종전략
- 이 집합투자기구는 부분복제기법을 이용하여 비교지수의 성과를 추적하는 방식으로 운용됩니다. 부분복제기법이란 추적오차를 감안하여 비교지수 구성종목의 일부를 추출하고, 추출된 종목을 대상으로 투자비중을 결정하여 포트폴리오를 구성하는 지수추종기법을 의미합니다.
 - 시장상황의 변화에 따른 종목별 구성비중 등을 고려하여 정기적으로 포트폴리오를 재조정합니다.

- 초과수익추구전략
- 이 투자신탁은 시장 상황에 따라 포트폴리오를 일정 수준 비교지수와 다르게 구성하여 초과수익을 추구할 수 있으며, 또한 초과 수익 달성을 위해 스왑거래, 이벤트를 활용한 종목별 매매, 스프레드 매매 및 장단기 시장흐름에 따른 비중조절 등 다양한 초과수익 추구 전략으로 운용할 수 있습니다
- 추적오차관리전략
- 비교지수의 특성을 고려하여 추적오차를 가급적 줄일 수 있도록 포트폴리오를 구성합니다.
 - 추적오차가 주어진 허용범위(1일 기준 0.5%)를 초과하는 경우 원인 분석 후 수시로 포트폴리오를 재조정 합니다.

- 현금성자산 운용전략
- 주식 및 파생상품에 투자하고 남은 자산은 원활한 환대응과 투자자금의 안정성 확보를 위하여 금융기관에의 예치 또는 자금증개회사를 통하여 자금증개거래를 할 수 있는 금융기관에 4영업일 이내의 골거래를 통하여 운용합니다.

3. 위험관리

운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 등에서 결정합니다. 이 투자신탁은 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 투자신탁의 가치 역시 비교지수의 하락에 그대로 노출 된다는 점에 유의하여야 합니다.

상품의 특징

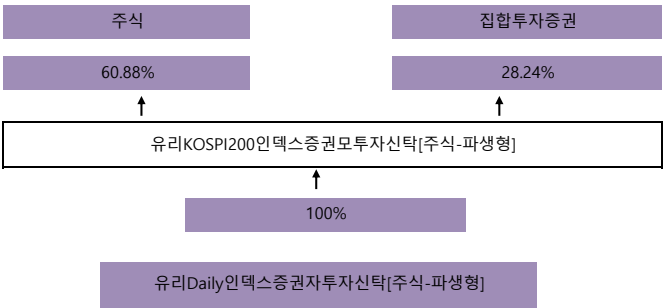
4. 수익구조

이 투자신탁은 이투자신탁의 모투자신탁인 “유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁(주식-파생형)” 수익증권에 대부분을 투자하므로 이러한 모투자신탁의 수익구조는 모투자신탁의 투자비율만큼 당해 투자신탁에 영향을 주게 됩니다.

<모투자신탁의 수익구조>

- 이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 국내주식 및 국내주식관련파생상품에 투자하는 집합투자기구로서 투자대상 주식 시세의 등락 및 배당으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 주식에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 투자신탁의 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 발생기업의 경영성과가 우수할수록, 투자대상 주식에 대한 수요가 공급보다 클수록 주식의 시세는 상승하는 경향을 나타내어 투자신탁의 가치는 상승하고, 반대의 경우에는 투자신탁의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다.
- 이 투자신탁의 성과는 비교지수의 성과와 비교지수 대비 추적오차에 의해 결정됩니다. 이 투자신탁의 성과는 일반적으로 ‘비교지수 대비 추적오차’ 보다는 ‘비교지수의 성과’로부터 월등히 높은 수준의 영향을 받게 됩니다.
- 이 투자신탁은 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.
- 이 투자신탁의 성과는 자본이익, 배당수입, 이자수입으로 구분할 수 있으며 일반적으로 자본이익이 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
유리Daily인덱스자[주식-파생형]	자산 총액(A)	2,315	1,510	-34.77
	부채총액(B)	4	3	-31.51
	순자산총액(C=A-B)	2,311	1,507	-34.78
	발행 수익증권 총 수(D)	1,394	975	-30.04
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,658.35	1,546.13	-5.04

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 6월 후반 미 파월 연준 의장의 온건 발언 속 인플레이션 우려 완화, 미 인프라 부양안 합의 소식 등에 힘입어 상승세로 전환하여 마감하였습니다. 7월에는 월초 미국 실업률 지표 개선 및 연방준비위원회(Fed.)의 조기 긴축 우려 완화 소식 등의 영향으로 상승 출발한 가운데, 월 중 내내 유럽 경제지표 호조, 6월 연방 공개시장 의사록에서의 조기 긴축 시그널 부재 등이 이어지며 상승세를 지속하였습니다. 7월 후반, 테슬라를 비롯한 미 대형 기술주 강세 영향, 미국/유로존 제조업 지표 시장 예상치 상회, 연방준비위원회의 조기 테이퍼링 우려 완화 등의 영향으로 상승세를 지속하여 마감하였습니다. 8월에는 월초 미국 인프라 법안 마무리 소식, 주요 은행 호실적 발표 등의 영향으로 유럽 증시를 중심으로 상승 출발하여, 글로벌 기업들의 2분기 호실적 발표 지속, 긴축 우려 진정에 따른 저가 매수세 유입, 미국 7월 비농업 고용지표 예상치 상회 및 7월 소비자물가지수 시장 예상치 부합 등 긍정적인 소식이 월 중 내내 이어지며 상승세를 지속하였습니다. 다만 월 중반 이후, 중국 실물지표 부진, 아프간 지정학적 리스크 부각, 7월 연방준비위원회 의사록 공개에 따른 조기 테이퍼링 우려감 확대 등의 영향으로 상승 폭이 일부 축소되기도 하였으나, 1) 화이자 백신 정식 승인에 따른 위험자산 선호심리 강화, 2) 조기 테이퍼링 우려감 진정, 3) 잭스홀 이벤트 소멸 및 4) 미 국채 금리 하락 속 대형 기술주 강세 등의 영향으로 상승세를 지속하여 마감하였습니다. 9월에는 월초 잭스홀 이벤트 소멸, 미 국채금리 하락으로 인한 대형 기술주 강세 등의 영향으로 상승하여 출발하였으나 델타 변이 확산 우려, 미 중앙은행(이하 연준)의 베이지북 내 경기둔화 문구 포함에 의해 하락세로 전환하였습니다.

국내 증시는 6월 후반 들어 차익실현 매물 출회, 미국의 이라크 공습 소식 및 델타 변이 바이러스 확산 우려에 상승폭을 소폭 반납하며 마감하였습니다. 7월에는 월초 중국 제조업 지표 부진과 연동하여 기관/외국인의 동반 차익실현 매물 출회 영향으로 하락 출발하여, 2분기 실적 기대감 및 연방준비위원회의 조기 긴축 우려 완화 등 긍정적인 소식에도 국내 델타 변이 바이러스 확산, 한국은행 총재의 매파적인 발언 등 부정적인 소식이 월 중 내내 상존하며 하락세를 지속하였습니다. 월 후반 들어, 연방준비위원회에서의 완화적 통화 정책 기조 재확인 등의 영향으로 투자심리가 다소 완화되기도 하였으나, 중국 및 홍콩 증시 급락에 따른 투자심리 위축, 국내 기업 2분기 실적 피크아웃 우려 확대 등의 영향으로 하락하여 마감하였습니다. 8월에는 월초 7월 수출 지표 호조 속 저가 매수세 유입 영향으로 상승 출발하여, 반도체 수출 역대 최고치 기록, 삼성전자/카카오 등 대형주 중심의 순매수세 유입 등 상승 요인에도 불구하고, 국내 코로나19 신규 확진자 수 급등, 미 고용지표 발표를 앞둔 경계심리 등의 영향으로 하락 반전하여, 1) 델타 변이 바이러스 확산, 2) 조기 테이퍼링 우려감 확대, 3) 연방준비위원회 인사들의 매파적인 발언, 4) 4분기 D램 가격 급락 전망에 따른 반도체 관련주 업황 우려감 확대, 5) 중국, 미국 등 글로벌 경제 지표 부진, 6) 7월 연방준비위원회의 의사록에서의 조기 테이퍼링 우려감 확대, 7) 중국 정부의 대출 우대금리 동결에 따른 글로벌 유동성 축소 우려감 등의 영향으로 하락세를 지속하였습니다. 월 후반, 수출입 지표 개선, 원/달러 환율 상승세 진정, 삼성전자의 대규모 투자 확대 소식, 파월 연방준비위원회 의장의 비둘기적 발언 등의 영향으로 하락폭을 일부 축소하여 마감하였습니다. 9월에는 월초 미 국채금리 하락으로 인한 IT 업종 강세 등의 영향으로 상승하여 출발하였으나, 외국인의 대규모 순매수 유입에도 불구하고 연준 베이지북에서의 경기판단 하향, 국내외 플랫폼 기업 규제 확대 불안감 등의 영향으로 하락세로 전환되었습니다.

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) 코로나19 신규 확진자 수 추이, 2) 미국의 고용지표 결과(10/8일; 이하 현지시간), 3) 미국의 소비자물가지수 발표(10/13일) 전후 인플레이션 우려 확대 가능성, 4) 테이퍼링 발표 관련 미 연준의 11월 FOMC 회의(11/2~3일) 경계감, 5) 미-중 무역갈등 확산 여부, 6) 미 국채금리 변화, 7) 주요 기업들의 3분기 실적 결과, 8) 글로벌 증시 흐름 및 9) 국제유가/환율의 움직임 등이 증시의 방향을 결정할 것으로 보이며, 대내적으로는 10) 국내 코로나19 백신 접종 이슈 및 확진자 수 추이, 11) 국내 통화정책회의(10/12일; 한국시간), 12) 국내 주요 기업들의 3분기 실적 결과 및 13) 연기금과 외국인의 수급 변화 등이 중요한 변수가 될 것으로 판단되는 바, 단기적인 변동성에 주의하면서 안정적인 포트폴리오 관리에 최선을 다할 계획입니다.

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 계량모델(펀더멘탈, 베타, 모멘텀 모델 등)에 근거한 스타일바스켓 편입, IPO(공모주) 투자, 페어 트레이딩 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
유리Daily인덱스자[주식-파생형]	-5.04	-0.32	12.54	31.67
(비교지수 대비 성과)	(0.52)	(1.47)	(2.75)	(2.52)
비교지수(벤치마크)	-5.56	-1.79	9.79	29.15

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
유리Daily인덱스자[주식-파생형]	31.67	58.11	48.68	76.32
(비교지수 대비 성과)	(2.52)	(7.21)	(8.88)	(13.19)
비교지수(벤치마크)	29.15	50.90	39.80	63.13

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
유리Daily인덱스자[주식-파생형]	0.91	1.85	2.14

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	77	0	0	29	9	0	0	0	0	0	-4	111
당기	-49	0	0	-21	-9	0	0	0	0	0	-4	-82

4. 자산현황

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

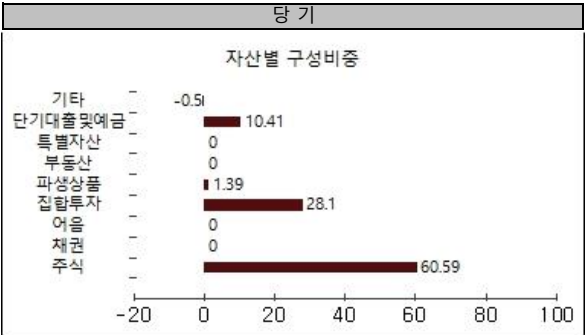
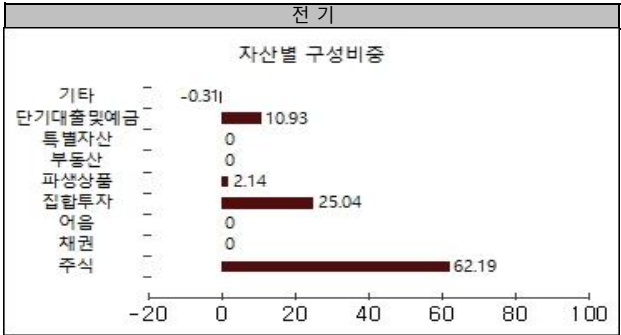
▶ 자산구성현황

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	915	0		424	21	0	0	0	0	157	-8	1,510
(1.00)	(60.59)	(0.00)	(0.00)	(28.10)	(1.39)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(10.41)	-(0.50)	(100.00)
합계	915	0		424	21	0	0	0	0	157	-8	1,510

*[표]: 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.

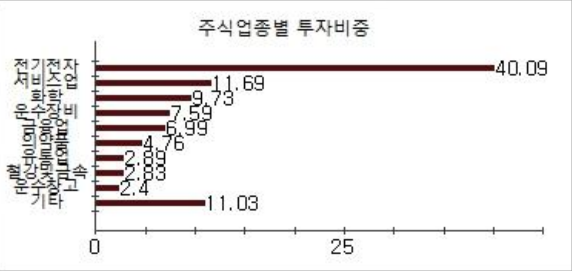
▶ **주식업종별 투자비중**

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	40.09	6	의약품	4.76
2	서비스업	11.69	7	유통업	2.89
3	화학	9.73	8	철강및금속	2.83
4	운수장비	7.59	9	운수장고	2.40
5	금융업	6.99	10	기타	11.03

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 차지 하는 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	집합투자증권	TREX 200	28.10	6	주식	NAVER	2.03
2	주식	삼성전자	17.12	7	주식	카카오	1.97
3	단기상품	REPO매수(20210910)	7.46	8	주식	삼성SDI	1.90
4	주식	SK하이닉스	2.89	9	주식	LG화학	1.67
5	단기상품	은대(국민은행)	2.67	10	주식	현대차	1.43

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시 사이트에서 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
삼성전자	3,434	259	17.12	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	416	44	2.89	대한민국	KRW	전기전자	
NAVER	74	31	2.03	대한민국	KRW	서비스업	
카카오	228	30	1.97	대한민국	KRW	서비스업	
삼성SDI	38	29	1.9	대한민국	KRW	전기전자	
LG화학	34	25	1.67	대한민국	KRW	화학	
현대차	104	22	1.43	대한민국	KRW	운수장비	

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	379	424	대한민국	KRW	28.10

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	우리자산운용	2021-09-10	113	0.92	2021-09-13	대한민국	KRW
예금	국민은행	2012-11-19	40	0.46		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 ㉠	퀀트운용본부장	1969	26	3,587	1	708	2109000457

주1) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, ‘책임 운용전문인력’이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행 하는 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

▶ 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 주1)	금액	비율 주1)	
유리Daily인덱스자[주식-파생형]	자산운용사	2.48	0.11	1.77	0.11	
	판매회사	1.72	0.08	1.22	0.08	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.20	0.01	0.14	0.01	
	일반사무관리회사	0.09	0.00	0.06	0.00	
	보수합계	4.49	0.20	3.19	0.20	
	기타비용 주2)		0.06	0.00	0.05	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.80	0.04	0.34	0.02
		조사분석업무 등	0.19	0.01	0.20	0.01
		서비스 수수료				
		합계	0.99	0.04	0.54	0.03
	증권거래세	1.26	0.06	0.98	0.06	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적, 반복적으로 지출된 비용으로서 매매, 중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 없음

※ 발행보담금내역 : 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	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리Daily인덱스자[주식-파생형]	전기	0.7891	0	0.7937	0.0981
	당기	0.7871	0	0.7938	0.114

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. 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, %)

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
44,866	2,892	34,300	2,244	42.78	169.74

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

(단위: %)

유리KOSPI200인덱스모[주식-파생형]

2020-12-13 ~ 2021-03-12	2021-03-13 ~ 2021-06-12	2021-06-13 ~ 2021-09-12
23.48	39.05	42.78

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.