

자산운용보고서

유리트리플알파증권투자신탁[주식혼합]

(운용기간 : 2015년08월15일 ~ 2015년11월14일)

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

유리자산운용(주)

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 매매회전율 추이

3. 위험관리

운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 및 위험관리실무위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 당사 내부의 운용업실무에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다.

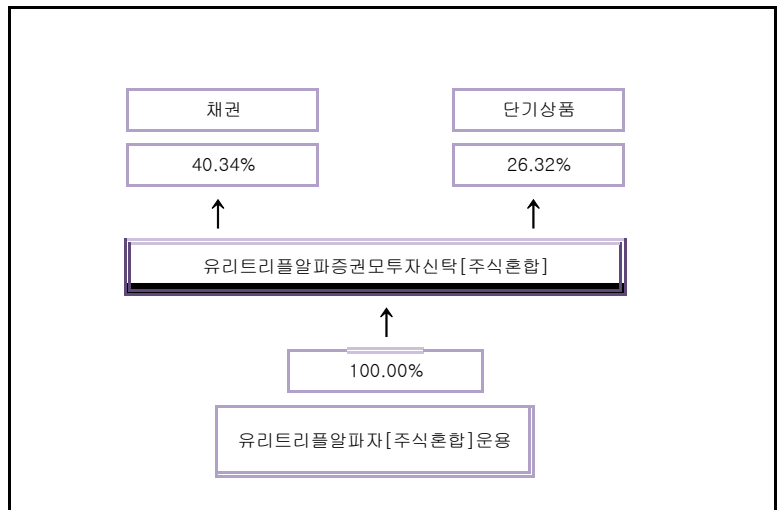
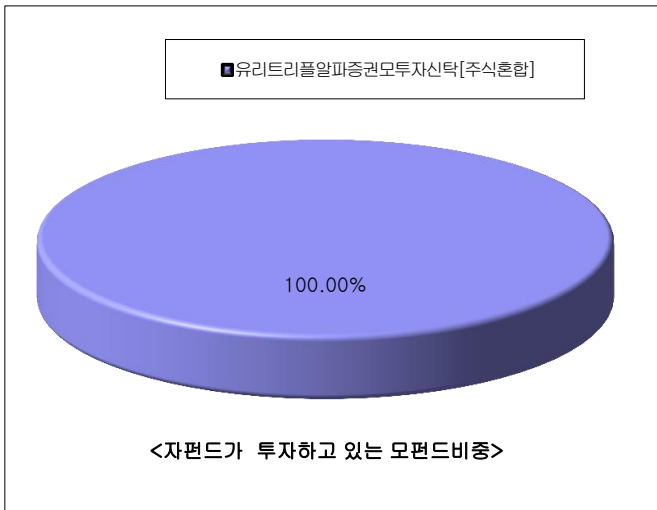
리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다.

위험관리를 위하여 투자환경 및 투자대상자산과 관련한 변화가 발생 시 탄력적으로 포트폴리오 조정을 실시할 계획입니다.

4. 수익구조

이 투자신탁은 '유리 트리플 알파 증권 모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자신탁입니다. 이 투자신탁이 투자하는 '유리 트리플 알파 증권 모투자신탁[주식혼합]'은 국내주식에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 채권에 투자신탁 자산총액의 50% 미만으로 투자하여 자본소득을 추구합니다. 따라서, 모투자신탁이 투자한 주식, 채권 등의 가격변동에 따라 이익 또는 손실이 결정됩니다.

▶ 펀드 구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을때 각 모펀드의 집합투자증권에 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)	107,994	120,433	11.52
	부채 총액 (B)	6	55	806.41
	순자산총액 (C=A-B)	107,988	120,378	11.47
	발행 수익증권 총 수 (D)	103,987	114,974	10.57
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,038.47	1,047.01	0.82
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]A1	기준가격	1,029.69	1,035.19	0.53
유리트리플알파자[주식혼합]A-e	기준가격	1,031.60	1,037.76	0.60
유리트리플알파자[주식혼합]C1	기준가격	1,026.63	1,031.08	0.43
유리트리플알파자[주식혼합]C-e	기준가격	1,030.07	1,035.70	0.55
유리트리플알파자[주식혼합]F	기준가격	1,024.42	1,031.05	0.65
유리트리플알파자[주식혼합]W	기준가격	1,033.51	1,040.33	0.66

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.

※ 분배금 내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
유리트리플알파자[주식혼합]운용	20151116	5,404	114,974	1,047.01	1,000.00	
유리트리플알파자[주식혼합]A1	20151116	1,248	36,709	1,035.19	1,000.00	

유리트리플알파자[주식혼합]A-e	20151116	75	2,046	1,037.76	1,000.00	
유리트리플알파자[주식혼합]C1	20151116	1,436	47,627	1,031.08	1,000.00	
유리트리플알파자[주식혼합]C-e	20151116	44	1,265	1,035.70	1,000.00	
유리트리플알파자[주식혼합]F	20151116	809	26,600	1,031.05	1,000.00	
유리트리플알파자[주식혼합]W	20151116	215	5,532	1,040.33	1,000.00	

주) 분배후수탁고는 분배금이 전부 채투자된다는 가정하에 작성된 자료입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

국내 증시는 8월 미국의 금리인상 및 중국 경기둔화 우려로 인해 글로벌 금융위기에 대한 불안이 커지는 가운데 북한 지정학적 리스크가 증가하는 등 악재가 겹치며 KOSPI기준 1,800선까지 하락하는 모습을 보였습니다. 9월에는 미국의 금리인상 불확실성 지속 및 중국 경기둔화 우려 등 글로벌 금융위기 불안에도 불구하고 환율 경쟁력 회복과 다른 신흥국 대비 양호한 기초체력에 근거하여 강세를 보이면서 하락세를 멈추고 반등하여 상승하였습니다. 10월에는 글로벌 금융위기 불안에도 불구하고 미국의 기준금리 인상 연기, ECB의 추가 양적완화 확대, 중국의 기준금리 및 지급 준비율 인하 등 글로벌 정책 공조로 상승세를 이어나갔습니다.

통신투자 부문에서 현선물 차익거래 포지션의 신규 진입 및 청산이 있었으며, 공모주 부문에서는 일부 종목은 매도 후 이익 실현 하였습니다. 이벤트 부문에서는 분할, 합병, 유상증자 등의 공시에 따라 고평가된 증권을 매도, 저평가되는 증권을 매수하는 포지션에 신규 진입 및 청산을 하였습니다. 추가적으로 K200 특별변경 관련 편입예상 종목 매수하였으며, 블랙딜 등의 이벤트를 활용하여 수익에 기여했습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

통신투자 부문에서는 신규 진입 기회 등을 꾸준히 모니터링 하고 새로운 기회를 발굴하기 위한 노력을 계속할 예정입니다. IPO 부문에서는 아이콘트롤스, 인포마크를 비롯한 다수 기업의 수요예측 진행 예정입니다. 이벤트 부문은 현재 보유 중인 포지션을 기회 수준에 따라 진입하거나 이익실현을 시도할 예정입니다. 이례현상 부문에서 월말효과 전략은 향후 시장 상황에 따라 순자산의 10% 이하 수준에서 투자할 예정입니다.

동 펀드는 세가지 주요 전략인 통신투자, IPO 및 이벤트 투자, 이례현상 활용 매매전략을 통한 다변화된 운용을 추구하고 있습니다. 시장 이벤트를 지속적으로 모니터링 하고 신규로 발생하는 투자 기회를 활용해 지속적으로 수익을 쌓아나갈 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)	0.82 (0.82)	3.04 (3.04)	3.51 (3.51)	4.70 (4.70)
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]A1	0.53	2.45	2.63	3.52
유리트리플알파자[주식혼합]A-e	0.60	2.58	2.82	3.78
유리트리플알파자[주식혼합]C1	0.43	2.25	2.33	3.11
유리트리플알파자[주식혼합]C-e	0.55	2.48	2.67	3.57
유리트리플알파자[주식혼합]F	0.65	2.68	2.71	3.72
유리트리플알파자[주식혼합]W	0.66	2.71	3.01	4.03
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

※ 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)	4.70 (4.70)	13.21 (13.21)	- -	- -

종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]A1	3.52	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]A-e	3.78	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]C1	3.11	9.80	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]C-e	3.57	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]F	3.72	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]W	4.03	-	-	-
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	1,604	215	-	45	153	-	-	-	-	16	96	2,128
당 기	1,828	163	-	35	-1,231	-	-	-	-	34	133	963

4. 자산현황

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

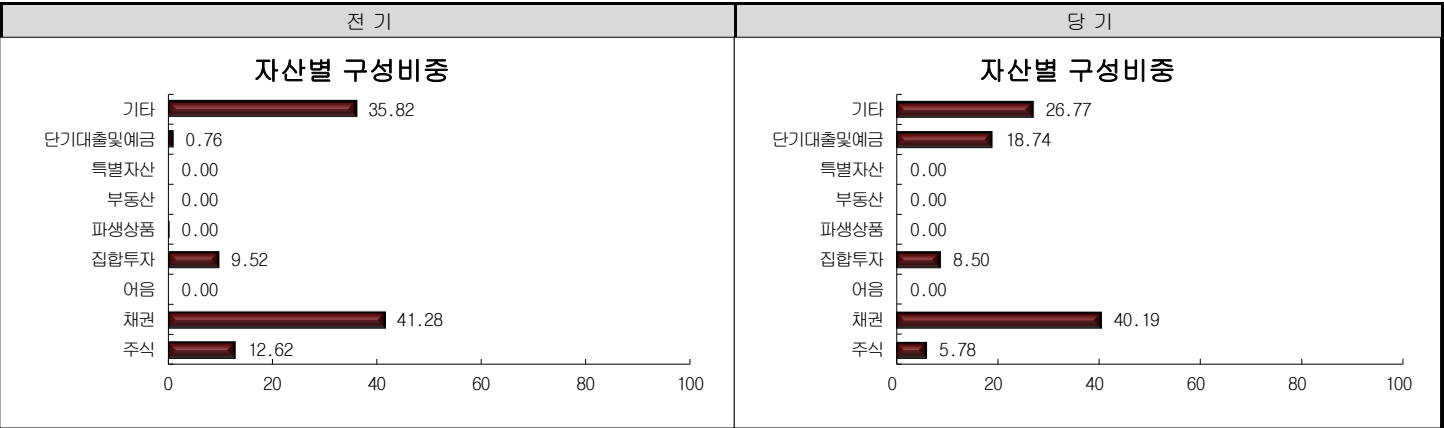
▶ 자산구성현황

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, %)

구분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
통화	6,964	48,398	-	10,235	38	-	-	-	-	22,564	32,234	120,433
비중	(5.78)	(40.19)	-	(8.50)	(0.03)	-	-	-	-	(18.74)	(26.77)	(100.00)
합 계	6,964	48,398	-	10,235	38	-	-	-	-	22,564	32,234	120,433

* () : 구성 비중



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	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및예금	기타	자산별합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
매수 포지션	6,964	48,398	-	10,235	38	-	-	-	-	22,564	32,234	120,433
비중	(5.78)	(40.19)	-	(8.50)	(0.03)	-	-	-	-	(18.74)	(26.77)	(100.00)
매도 포지션	74	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	74
비중	(100.00)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(100.00)
순포지 션	6,891	48,398	-	10,235	38	-	-	-	-	22,564	32,234	120,359
비중	(5.73)	(40.21)	(0.00)	(8.50)	(0.03)	-	-	-	-	(18.75)	(26.78)	(100.00)

▶ 주식업종별 투자비중

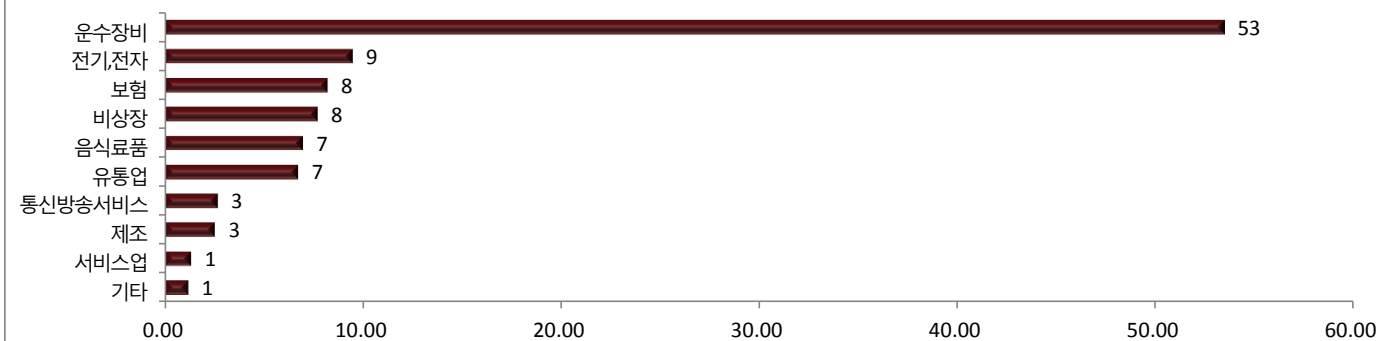
주식업종별 투자비중 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 투자하고 있는 주식자산의 업종별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드가 보유한 주식자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

	종목명	비중		종목명	비중
1	운수장비	53.47	6	유통업	6.70
2	전기,전자	9.44	7	통신방송서비스	2.63
3	보험	8.19	8	제조	2.50
4	비상장	7.68	9	서비스업	1.30
5	음식료품	6.94	10	기타	1.15

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

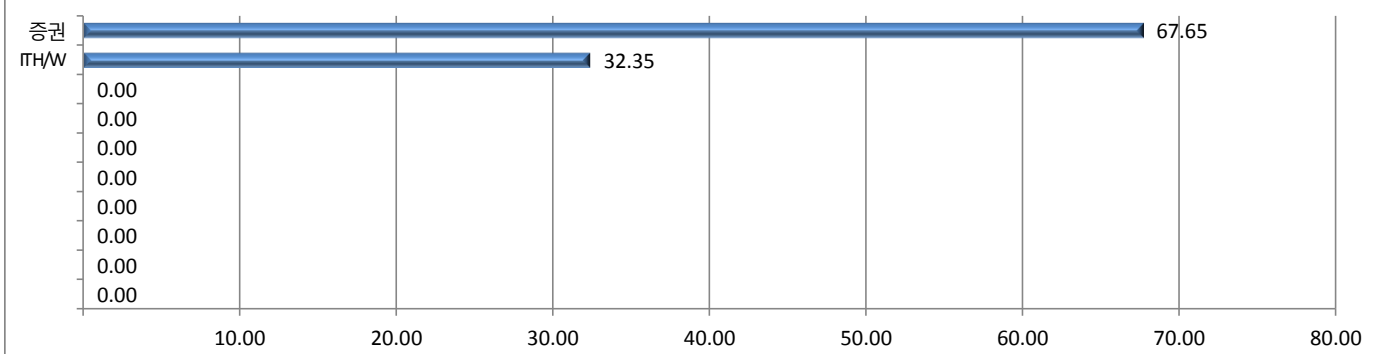
주식업종별 투자비중



▶ 주식업종별 투자비중: 매도(Short)포지션

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	증권	67.65	6		
2	IT H/W	32.35	7		
3			8		
4			9		
5			10		

주식업종별 투자비중: 매도(Short)포지션



▶ 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 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	채권	국고02750-1606(13-3)	12.86	6	단기상품	REPO매수(20151113)	7.68
2	단기상품	은대(신한은행)	10.11	7	집합투자증권	KODEX 단기채권	5.98
3	단기상품	REPO매수(20151113)	9.25	8	채권	산금13신이0300-05-02-1	3.94
4	단기상품	REPO매수(20151113)	9.25	9	채권	국고03000-1612(13-7)	3.14
5	단기상품	콜론(대우증권)	8.63	10	채권	국고03500-1703(12-1)	2.91

※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.

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고02750-1606(13-3)	15,203	15,482	대한민국	KRW	2013-06-10	2016-06-10		-	12.86
산금13신이0300-05-02-1	4,721	4,747	대한민국	KRW	2013-05-02	2016-05-02		AAA	3.94
국고03000-1612(13-7)	3,683	3,782	대한민국	KRW	2013-12-10	2016-12-10		-	3.14
국고03500-1703(12-1)	3,399	3,501	대한민국	KRW	2012-03-10	2017-03-10		-	2.91

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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 단기채권	수익증권	KODEX단기채권	7,098	7,196	대한민국	KRW	5.98

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	2013-11-15	403	1.15		대한민국	KRW
단기대출	대우증권	2015-11-13	10,387	1.53	2015-11-16	대한민국	KRW
예금	신한은행	2014-01-27	11,768	1.15		대한민국	KRW

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

▶ 기타

(단위 : 백만원)

종류	평가금액	비고
기타	32,234	

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	60	9,805	4	2,241	2109000507
박주호	퀀트운용팀장	1969	48	9,568			2109000457
윤준수	채권운용본부장	1967	73	18,480	2	587	2109000319
최재영	채권운용팀장	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

성명	책임/부책임	기간
해당사항 없음		

▶ 해외 운용 수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

6. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

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

(단위 : 백만원, %)

	구 분		전기		당기	
			금액	비율	금액	비율
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**		10.74	0.01	1.82	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	53.15	0.05	17.95	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	6.49	0.01	3.71	0.00
		합계	59.63	0.06	21.66	0.02
	증권거래세		91.80	0.09	56.66	0.05
유리트리플알파자[주식혼합]A1	자산운용사		50.67	0.15	53.57	0.15
	판매회사		42.22	0.13	44.64	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)		2.11	0.01	2.23	0.01
	일반사무관리회사		1.27	0.00	1.34	0.00
	보수합계		96.27	0.29	101.78	0.29
	기타비용**		3.78	0.01	0.79	0.00
		단순매매.중개수수료	18.08	0.05	5.62	0.02

	매매. 중개 수수료	조사분석업무 등 서비스 수수료	2.22	0.01	1.16	0.00
		합계	20.31	0.06	6.78	0.02
	증권거래세		31.28	0.09	17.71	0.05
유리트리플알파자[주식혼합]A-e	자산운용사		2.65	0.15	3.13	0.15
	판매회사		1.10	0.06	1.31	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.11	0.01	0.13	0.01
	일반사무관리회사		0.07	0.00	0.08	0.00
	보수합계		3.93	0.22	4.65	0.22
	기타비용**		0.20	0.01	0.05	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.94	0.05	0.33	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.11	0.01	0.07	0.00
		합계	1.05	0.06	0.40	0.02
	증권거래세		1.62	0.09	1.03	0.05
유리트리플알파자[주식혼합]C1	자산운용사		60.95	0.15	67.62	0.15
	판매회사		91.43	0.23	101.44	0.23
	펀드재산보관회사(신탁업자)		2.54	0.01	2.82	0.01
	일반사무관리회사		1.52	0.00	1.69	0.00
	보수합계		156.44	0.39	173.57	0.39
	기타비용**		4.61	0.01	0.99	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	21.61	0.05	7.15	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2.63	0.01	1.47	0.00
		합계	24.24	0.06	8.62	0.02
	증권거래세		37.18	0.09	22.08	0.05
유리트리플알파자[주식혼합]C-e	자산운용사		1.73	0.15	1.81	0.15
	판매회사		1.30	0.11	1.36	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.07	0.01	0.08	0.01
	일반사무관리회사		0.04	0.00	0.05	0.00
	보수합계		3.15	0.27	3.29	0.27
	기타비용**		0.12	0.01	0.03	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.62	0.05	0.19	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.08	0.01	0.04	0.00
		합계	0.69	0.06	0.23	0.02
	증권거래세		1.05	0.09	0.61	0.05
유리트리플알파자[주식혼합]F	자산운용사		29.68	0.15	37.13	0.15
	판매회사		2.47	0.01	3.09	0.01
	펀드재산보관회사(신탁업자)		1.24	0.01	1.55	0.01
	일반사무관리회사		0.74	0.00	0.93	0.00
	보수합계		34.13	0.17	42.70	0.17
	기타비용**		2.24	0.01	0.55	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	10.49	0.05	3.82	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1.28	0.01	0.81	0.00
		합계	11.77	0.06	4.63	0.02
	증권거래세		18.15	0.09	12.56	0.05
유리트리플알파자[주식혼합]W	자산운용사		4.09	0.15	8.05	0.15
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.17	0.01	0.34	0.01
	일반사무관리회사		0.10	0.00	0.20	0.00
	보수합계		4.36	0.16	8.59	0.16
	기타비용**		0.40	0.01	0.12	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1.41	0.05	0.84	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.16	0.01	0.17	0.00
		합계	1.57	0.06	1.01	0.02
	증권거래세		2.52	0.09	2.68	0.05

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 : 없음

※ 발행분담금내역 : 2,897,130원

※ 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	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파자[주식혼합]운용	전기	0.0022	0.0001	0.0327	0.1841
	당기	0.0014	0	0.0266	0.1514
종류(Class)별 현황					
유리트리플알파자[주식혼합]A1	전기	1.1424	0	1.1749	0.1783
	당기	1.1424	0	1.1704	0.1516
유리트리플알파자[주식혼합]A-e	전기	0.8923	0	0.9255	0.1783
	당기	0.8923	0	0.92	0.1486
유리트리플알파자[주식혼합]C1	전기	1.5424	0	1.5748	0.1835
	당기	1.5424	0	1.5692	0.1528
유리트리플알파자[주식혼합]C-e	전기	1.0922	0	1.1264	0.1759
	당기	1.0923	0	1.1219	0.1509
유리트리플알파자[주식혼합]F	전기	0.6924	0	0.7262	0.2116
	당기	0.6924	0	0.715	0.1522
유리트리플알파자[주식혼합]W	전기	0.6423	0	0.6855	0.1948
	당기	0.6423	0	0.6681	0.1315

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

유리트리플알파모[주식혼합]

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
122,728	10,525	533,111	19,938	156.70	621.70

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

유리트리플알파모[주식혼합]

(단위 : %)

15년02월15일 ~15년05월14일	15년05월15일 ~15년08월14일	15년08월15일 ~15년11월14일
120.89	201.85	156.70

* 회전을 하락 이유: 지수 정기변경에 따른 리밸런싱이 없었고, 지수 특별변경 등 이벤트 대응을 위한 거래만 존재하여 회전율이 하락함.