

# 자산운용보고서

## 유리트리플알파증권투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2015년12월12일 ~ 2016년03월11일)

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](http://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

## 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 정보는 고객님의 가입한 자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파증권투자신탁(채권혼합)의 자산운용회사인 '유리자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 'NH농협은행, 부국증권'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](http://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
유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]운용, 유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합], 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]A1, 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]C		3등급	AM202, AV714, AM203, AM205
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.12.12
운용기간	2015.12.12 ~ 2016.03.11	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용(주)	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	NH농협은행,부국증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	<b>1. 투자대상</b>  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 범위 내에서 10%를 초과할 수 있습니다.  ※ 유리트리플알파증권모투자신탁 [채권혼합] 투자대상 유리트리플알파증권모투자신탁의 경우 채권에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 국내주식에 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 투자하며 롱숏전략, 공모주/이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구합니다.		
	<b>2. 투자전략</b> 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 펀더멘탈, 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 교매매매 및 적절한 투자 대상 선정을 통해 추가 수익을 추구합니다. － 국채선물을 활용한 트레이딩 전략을 일부 활용하여 추가 수익을 추구합니다.		

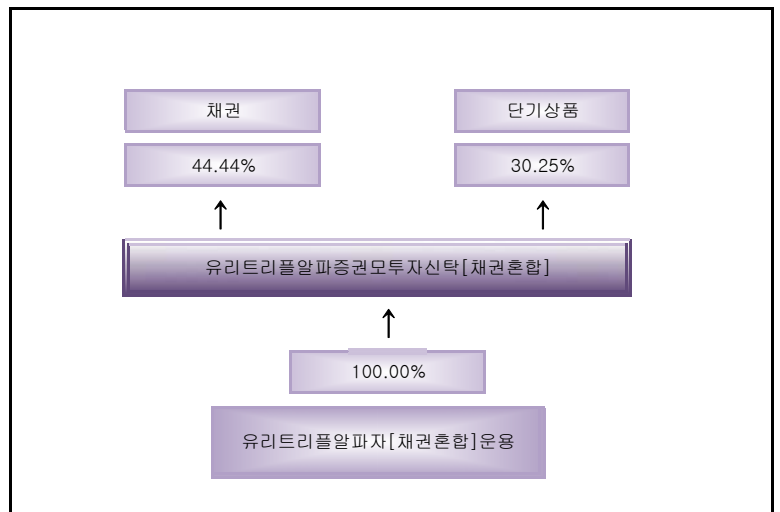
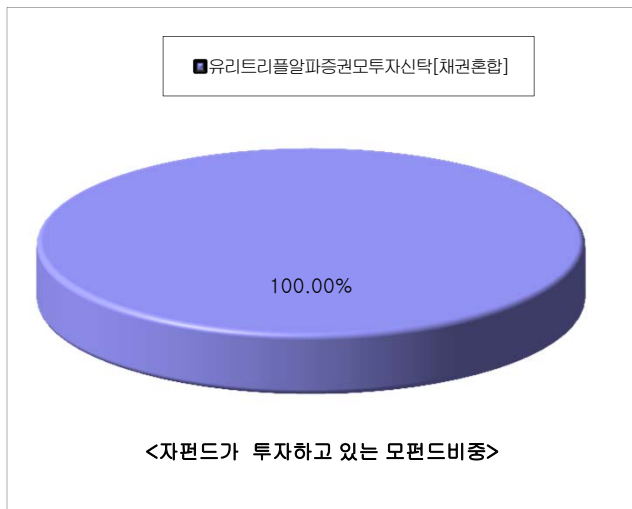
### 3. 위험관리

운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 및 위험관리실무위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 당사 내부의 운용업무처리에 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 '유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자신탁입니다. 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
유리트리플알파자[채권혼합]운용	자산 총액 (A)	1,033	4,069	294.01
	부채 총액 (B)	0	0	0.00
	순자산총액 (C=A-B)	1,033	4,069	294.01
	발행 수익증권 총 수 (D)	993	4,026	305.56
	기준가격 <sup>주)</sup> (E=C/D×1000)	1,040.45	1,010.81	1.08
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파자[채권혼합]A1	기준가격	0.00	1,000.18	0.02
유리트리플알파자[채권혼합]C	기준가격	1,030.32	1,008.34	0.83

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

KOSPI200 지수는 전 분기 대비 -3.93% 하락 마감하였습니다.

국내증시는 12월 금리인상 이후 예상보다 시장 친화적인 옐런 의장의 발언, 주주친화적인 배당확대, 연말 수급개선 등의 이유로 안도렐리 모습을 보였지만, 중국 및 신흥국의 경기 둔화 우려 및 유가 급락으로 하락 마감하였습니다. 1월에는 중국 금융시장의 불안, 유가 급락, 신흥국 통화 약세, 기업 실적 우려 등의 이유로 큰 폭의 하락을 하였습니다. 2월에는 글로벌 금융시장 안정을 위한 정책 공조와 국제 유가의 하락세 둔화 현상이 맞물리면서 증시에 긍정적인 영향을 주며 반등하여 상승 마감하였습니다.

통신투자 부문에서 현선물 차익거래 포지션의 신규 진입 및 청산이 있었으며, 저평가된 주식을 매수하고 고평가된 주식을 매도하는 포지션에 신규 진입 및 청산이 있었습니다. 공모주 부문에서는 일부 종목은 매도 후 이익 실현 하였으며 일부는 상장 후 보유 중에 있습니다. 이벤트 부문에서는 분할, 합병, 유상증자 등의 공시에 따라 고평가된 증권을 매도, 저평가되는 증권을 매수하는 포지션에 신규 진입 및 청산을 하였습니다. 추가적으로 블록딜 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 대림씨앤에스, 동양파일, 레이언스 외 다수 기업 수요예측 예정입니다. 이벤트 부문은 현재 보유 중인 포지션을 기회 수준에 따라 진입하거나 이익실현을 시도할 예정입니다. 이례현상 부문에서 월말효과 전략은 향후 점차 포지션을 늘려 순자산의 10% 이하 수준에서 투자 할 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[채권혼합]운용	1.08	1.69	3.18	4.69
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[채권혼합]A1	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]C	0.83	1.19	2.42	3.67

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[채권혼합]운용	4.69	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[채권혼합]A1	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]C	3.67	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

#### ▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	8	2	-	0	-5	-	-	-	-	1	1	6
당 기	7	3	-	1	0	-	-	-	-	1	2	12

## 4. 자산현황

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

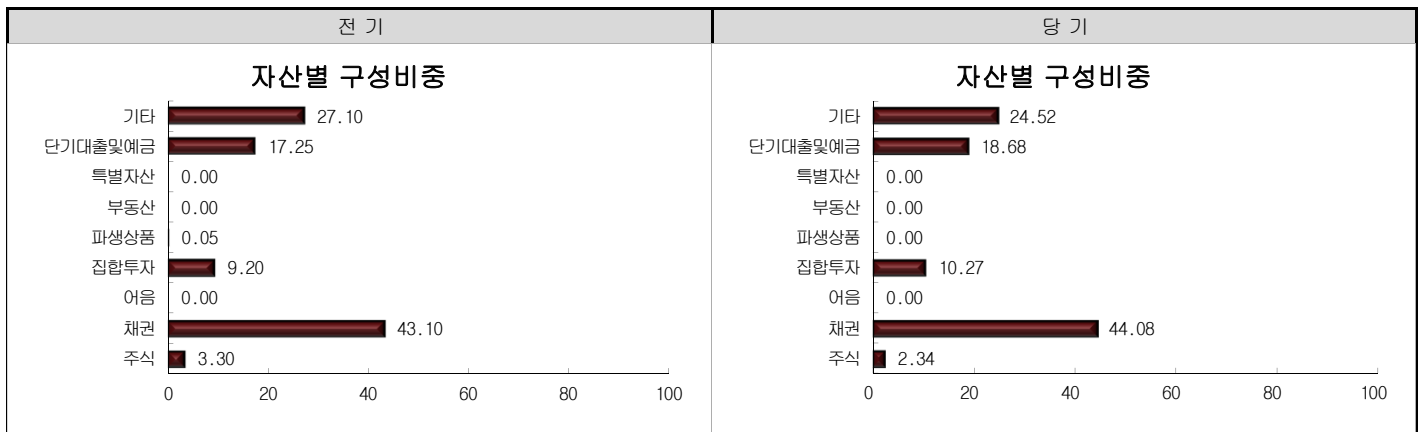
### ▶ 자산구성현황

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	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	95	1,794	-	418	5	-	-	-	-	760	998	4,069
비중	(2.34)	(44.08)	-	(10.27)	(0.12)	-	-	-	-	(18.68)	(24.52)	(100.00)
합 계	95	1,794	-	418	5	-	-	-	-	760	998	4,069

\* ( ) : 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.

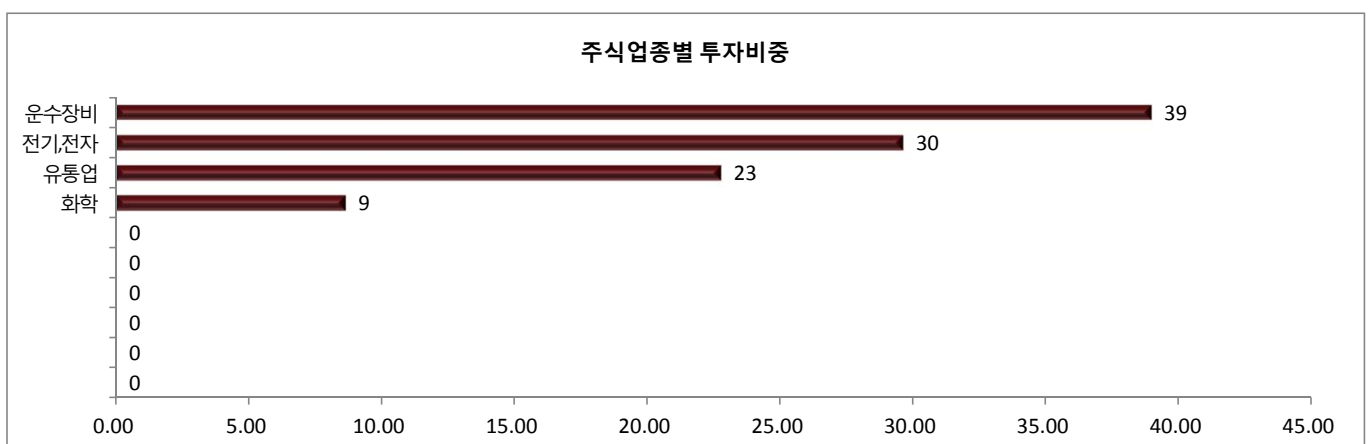
### ▶ 주식업종별 투자비중

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	38.97	6		0.00
2	전기,전자	29.63	7		0.00
3	유통업	22.77	8		0.00
4	화학	8.63	9		0.00
5			10		

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 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	단기상품	은대(신한은행)	18.68	6	단기상품	REPO매수(20160311)	6.11
2	채권	국고03000-1612(13-7)	11.42	7	채권	예보기금특별계정채권2012-1	5.92
3	채권	국고03500-1609(11-5)	11.15	8	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS	5.45
4	단기상품	REPO매수(20160311)	8.83	9	채권	국고02750-1706(14-3)	5.21
5	단기상품	REPO매수(20160311)	8.83	10	채권	국민주택1종11-10	3.90

※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.

## ▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고03000-1612(13-7)	456	465	대한민국	KRW	2013-12-10	2016-12-10		-	11.42
국고03500-1609(11-5)	449	454	대한민국	KRW	2011-09-10	2016-09-10		-	11.15
예보기금특별계정채권 2012-1	235	241	대한민국	KRW	2012-01-04	2017-01-04		AAA	5.92
국고02750-1706(14-3)	207	212	대한민국	KRW	2014-06-10	2017-06-10		-	5.21
국민주택1종11-10	138	159	대한민국	KRW	2011-10-31	2016-10-31		-	3.90

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 단기채권PLUS	수익증권	KODEX 단기채권PLUS	223	222	대한민국	KRW	5.45

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	2014-12-12	33	1.15		대한민국	KRW
예금	신한은행	2014-12-03	727	1.15		대한민국	KRW

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

## ▶ 기타

(단위 : 백만원)

종류	평가금액	비고
기타	998	

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	10,252	4	2,241	2109000507
박주호	퀀트운용팀장	1969	48	10,018			2109000457
윤준수	채권운용본부장	1967	69	22,095	1	57	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

### ▶ 입자별 보수 지급현황

입자별 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, %)

	구 분	전기		당기	
		금액	비율	금액	비율
유리트리플알파자[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**	0.01	0.00	0.02	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.08	0.01	0.13
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.00	0.02
		합계	0.10	0.01	0.15
	증권거래세	0.35	0.03	0.22	0.02
	자산운용사	0.00	0.00	0.24	0.02
	판매회사	0.00	0.00	0.20	0.01



유리트리플알파자[채권혼합]A1	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.01	0.00
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.01	0.00
	보수합계		0.00	0.00	0.46	0.03
	기타비용**		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.00	0.00	0.05	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.01	0.00
		합계	0.00	0.00	0.06	0.00
	증권거래세		0.00	0.00	0.05	0.00
유리트리플알파자[채권혼합]C	자산운용사		0.90	0.09	0.94	0.09
	판매회사		1.54	0.15	1.61	0.15
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.05	0.00	0.05	0.00
	일반사무관리회사		0.03	0.00	0.03	0.00
	보수합계		2.51	0.24	2.63	0.24
	기타비용**		0.01	0.00	0.03	0.00
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0.08	0.01	0.08	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.00	0.02	0.00
		합계	0.10	0.01	0.09	0.01
	증권거래세		0.35	0.03	0.17	0.02

- \* 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 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	중개수수료 비율	합성총보수,비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파자[채권혼합]운용	전기	0	0	0.0024	0.1265
	당기	0	0	0.0039	0.0784
종류(Class)별 현황					
유리트리플알파자[채권혼합]A1	전기	0	0	0	0
	당기	0.6823	0	0.6847	0.0918
유리트리플알파자[채권혼합]C	전기	0.9821	0	0.9846	0.1267
	당기	0.9849	0	0.9889	0.0776

- 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 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

### ▶ 매매주식규모 및 회전율

유리트리플알파모[채권혼합]				단위 : 주, 백만원, %)	
매수		매도		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
14,481	864	53,485	1,117	232.64	933.11

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

유리트리플알파모[채권혼합]

(단위 : %)

15년06월12일 ~15년09월11일	15년09월12일 ~15년12월11일	15년12월12일 ~16년03월11일
148.11	165.83	232.64