

유리인덱스200주식형펀드 영업보고서

(기간:2003년11월01일 - 2004년01월31일)

1. 자본 변동내용 및 주식매매상황표

1) 자본 변동 현황

(단위:주,백만원)

전분기		증가		감소		금분기	
주식수	금액	주식수	금액	주식수	금액	주식수	금액
86,360,193,164	83,204	7,413,046,125	8,790	29,602,108,037	35,965	64,171,131,252	56,029

- 주 1) 주요 증가요인 : 유상증자(주식배당포함)
 2) 주요 감소요인 : 환매
 3) "주식수"는 당해 증권투자회사의 발행주식수를 의미함. "금액"은 해지조정금 포함.

2) 회사발행주식 매매상황표

(1) 주당순자산가치(NAV)

(단위:원)

금분기(A)	전분기(B)	증감(A-B)	증감율((A-B)/B)	시가(C)	할인율((A-C)/A)
1,280.88	1,151.14	129.74	11.27%		

- 주 1) 시가라 함은 증권거래소 시장(혹은 협회중개시장,KOSDAQ시장)에서 당월말 현재의 종가를 말함
 2) 할인율이라 함은 거래소 시장 혹은 협회중개시장에서 거래되는 당월말 현재의 종가가 주당순자산가치에 비하여 낮은 정도를 의미함
 3) 구체적인 주당순자산가치의 산출내역은 3.요약재무제표를 참조.

(2) 기중 주식거래량 변동현황

① 폐쇄형의 경우

(단위:주)

전분기	금분기	평균거래량(일)	
		최고	최저

② 개방형의 경우

(단위:주)

전분기	신규발행	환매량	금분기	평균거래량(일)
86,360,193,164	7,413,046,125	29,602,108,037	64,171,131,252	597,018,616

2. 자산운용현황

(1) 운용성과에 관한 사항

① 최근 운용성과

(단위:%)

구 분	01월	12월	11월	10월	09월	08월
당해펀드수익률(A)	61.36	55.26	50.94	48.38	34.76	44.23
비교지수수익률(B)	56.71	48.69	46.42	43.36	26.55	37.92
초과수익률(A-B)	4.65	6.57	4.52	5.02	8.21	6.31

주 1) 비교지수: KOSPI200:110.89 / 기준일(01.03.05):70.76

② 주요영업손익 구성현황

(단위:백만원,%)

구 분		평가손익			처분손익			기타손익
		주식	채권	파생상품	주식	채권	파생상품	
금분기	금 액	-878.40	0.00	80.58	7,570.57	-1.30	1,351.51	1,834.60
	비 율	-8.82	0.00	0.81	76.03	-0.01	13.57	18.42
누 계	금 액	15,427.18	0.00	716.95	15,972.22	-1.30	11,200.13	3,403.40
	비 율	33.02	0	1.53	34.19	0.00	23.97	7.29

주 1) 기타손익의 내역(누계): 유가증권상환손실(-0.12) 수입이자(834.33) 배당수익(1767.88) 보수(-609.05) 등

(2) 투자현황에 관한 사항

① 자산구성현황

(단위:백만원,%)

구 분		주식	채권	파생상품	예금	콜론	기타	자산총액
금분기	금 액	63,327.21	0.00	1,057.75	186.76	13,702.74	6,347.01	84,621.47
	비 율	74.84		1.25	0.22	16.19	7.50	100.00
전분기	금 액	79,711.00		879.94	129.23	5,100.52	15,517.84	101,338.52
	비 율	78.66		0.87	0.13	5.03	15.31	100.00

주 1) 기타의 내역: 매수배당금(1360.12) 기타자산(4986.89) 등

② 주식 및 채권의 주요 보유현황 (주식:상위 10종목, 채권:상위 5종목)

(단위:백만원,%)

구 분	종목명	보유주수(액면금액)	시가	자산구성비
주 식	삼성전자	30,990	16,239	19.19
	SK텔레콤	16,470	3,582	4.23
	국민은행	68,790	3,285	3.88
	포스코	18,960	2,967	3.51
	KT	58,460	2,610	3.08
	한국전력	124,550	2,516	2.97
	현대차	44,540	2,214	2.62
	LG전자	28,140	1,764	2.09
	삼성SDI	8,970	1,480	1.75
	신한금융지주회사	56,200	1,093	1.29
채 권				

③ 파생상품 투자현황

(단위:백만원)

구 분	상품명	분기중 투자현황		분기말 투자현황	
		계약수	약정금액	계약수	약정금액
선물매입	KOSPI 200 선물 0403	771	40,227	248	13,088
선물매도	2003년 12월물	823	43,115		
콜옵션매입	KOSPI 200 콜옵션 0402 112.5외2	810	83		
콜옵션매도	KOSPI 200 콜옵션 0401 107.5외3	1,110	108	300	31
풋옵션매입					
풋옵션매도					
기 타					

주 1) 상품별 투자목적:

(3) 투자주식 매매에 관한 사항

① 주요 매매종목(주식:상위 10종목, 채권:상위 5종목)

(단위:주,백만원)

구 분	종목명	매 수		매 도	
		주수(액면)	금액	주수(액면)	금액
주 식	삼성전자	3,300	1,508	15,220	7,342
	국민은행	18,710	863	34,210	1,580
	SK텔레콤	3,170	657	8,590	1,763
	포스코	2,660	419	10,230	1,573
	한국전력	17,230	370	68,370	1,477
	KT	6,400	286	33,660	1,527
	현대차	6,320	303	27,070	1,297
	우리금융지주	56,800	410	111,430	800
	LG전자	3,440	204	15,090	914
	삼성SDI	1,310	169	5,630	776
채 권					

② 주식매매회전율

(단위:백만원)

구 분	당 월	전 월	분 기	반 기
총매수금액	4,304	6,553	16,464	39,723
총매도금액	16,872	7,653	39,668	78,321
합 계	21,176	14,206	56,132	118,044
기간중주식총평잔	69,919	71,055	72,552	77,577
매매회전율	.15	.1	.39	.76

주 1) 매매회전율은 일정기간중 회사가 매제한
주식의 빈도에 관한 비율입니다.

$$\text{매매회전율} = \frac{(\text{총매수금액} + \text{총매도금액}) / 2}{\text{기간중 주식총액 평잔}}$$

3. 요약 재무제표

1) 대차대조표 (전분기: 2003년10월31일 , 금분기: 2004년01월31일)

(단위:백만원)

자 산	금분기	전분기	부채와 자본	금분기	전분기
1.운용자산	83,232.31	100,293.96	부 채		
1) 예치금	186.76	129.23	1. 매수유가증권미지급금	0.00	0.00
2) 콜론	13,702.74	5,100.52	2. 정산미지급금	97.37	83.91
3) 청약증거금	0.00	0.00	3. 매도옵션	30.95	0.00
4) 주식	63,327.21	79,711.00	4. 해지미지급금	2,139.74	1,578.29
5) 채권	0.00	0.00	5. 보수미지급금	124.61	153.05
6) 파생상품	1,057.75	879.94	6. 기타부채	33.16	110.33
7) 기타유가증권	4,957.85	14,473.27	부채총계	2,425.83	1,925.58
2.기타자산	1,389.16	1,044.56	자 본		
1) 미수배당금	1,360.12	0.00	1.자본금	63,273.50	84,085.46
2) 미수입금	0.00	1,025.00	2.해지조정금	-7,244.20	-881.31
3) 기타	29.04	19.57	3. 차기이월이익잉여금	26,166.34	16,208.79
			1) 전기이월이익잉여금	-20,552.23	-20,552.23
			2) 당기순이익	46,718.57	36,761.02
			자본총계	82,195.64	99,412.94
자산총계	84,621.47	101,338.52	부채와자본 합계	84,621.47	101,338.52
주당순자산가치=(자산총액 - 부채총액 + 미지급분배금) / 발행주식총수				1,280.88	1,151.14

2) 손익계산서(기간 : 2003년11월01일 ~ 2004년01월31일)

(단위:백만원)

계정과목명	금분기	누 계
1.투자수익	1,476.56	2,602.35
1) 이자수익	115.27	834.33
2) 배당금수익	1,361.26	1,767.88
3) 기타 투자수익	0.03	0.15
2. 매매수익	8,055.31	53,127.12
1) 주식매매이익	7,323.76	35,667.85
2) 채권매매이익	0.00	0.00
3) 파생상품매매이익	217.60	15,919.63
4) 기타매매이익	513.95	1,539.64
3. 매매손실	-584.52	8,272.60
1) 주식매매손실	631.59	4,268.45
2) 채권매매손실	1.15	1.42
3) 파생상품매매손실	-1,214.48	4,002.55
4) 기타매매손실	-2.78	0.18
4. 매매차익(또는 매매차손)[2-3]	8,639.83	44,854.52
5. 운용비용	158.84	738.30
1) 보관보수	9.18	40.60
2) 판매보수	0.00	0.00
3) 일반사무수탁보수	13.77	60.91
4) 운용보수	114.77	507.54
5) 기타 운용비용	21.12	129.25
6. 법인세 차감전 순이익	9,957.55	46,718.57

4. 투자제한사항 준수여부

* 별첨참조

5. 보유주식에 대한 의결권 행사내역

* 해당사항 없음

6. 공모주 청약, 배분 내역

* 해당사항 없음

7. 감사의 확인

감사 :

송충석

(인)

4. 투자제한사항 준수여부

(1) 법규 제한

제한사항	위반여부	위반내용
동일종목 주식 10%이내 투자	있음	2003.11.5 위반(삼성전자) / 11.10 해소
동일종목 유가증권 10%이내 투자	없음	
동일회사발행 주식 10%이내 투자	없음	
지방채·특수채 30%이내 투자	없음	
사모사채 5%이내 투자	없음	
수익증권 5%이내 투자	없음	
위탁증거금 15%이내	없음	
관계증권사 월간위탁매매 20%이내	없음	

(2) 투자설명서 제한

제한사항	위반여부	위반내용
주식에의 투자 : 순자산가치의 60% 이상	없음	
주식 및 파생상품에의 투자 : 순자산총액의 90%이상	없음	
동일 방향 포지션 한도 : 순자산총액의 100% 초과불가	없음	
현금성 자산 투자 : 순자산총액의 10%이상	있음	11.10 위반/11.12 해소, 1.8 위반/1.15 해소
자산유동화증권 투자 : 자산총액의 10%이하	없음	
주식투자 대상 : 증권거래소 상장주식	없음	