

영업보고서(2001년04월)

유리인덱스200주식형펀드

1. 자본 변동내용 및 주식매매상황표

1) 자본 변동 현황

(단위:주,백만원)

전기말		증가		감소		금기말	
주식	금액	주식수	금액	주식수	금액	주식수	금액
		14,468,667,083	14,033			14,468,667,083	14,033

주 1) 주요 증가요인 : 유상증자

2) 주요 감소요인 : 해당사항 없음

3) "주식수"란 함은 당해 증권투자회사의 발행주식수를 의미하는 것임

2) 회사발행주식 매매상황표

(1) 주당순자산가치

(단위:원)

주당순자산가치(NAV)				주 가			
전기말	최고	최저	금기말	전기말	최고	최저	금기말
	1,035.43	872.79	1,035.43				

(2) 월중 주식거래량 변동현황

(1) 폐쇄형의 경우

(단위:주)

전 기 말	금 기 말	평균거래량(일)	
		최고	최저

(2) 개방형의 경우

(단위:주)

전 기	신규발행	환매량	금 기	평균거래량(일)
	16,883,313,823	2,414,646,740	14,468,667,083	410,594,906

2. 자산운용현황

(1) 운용성과에 관한 사항

1) 최근 운용성과

(단위:%)

구 분	N월	N-1월	N-2월	N-3월	N-4월	N-5월
당해펀드수익률(A)	3.54	-6.60				
비교지수수익률(B)	2.39	-7.91				
초과수익률(A-B)	1.15	1.31				

(2) 주요영업손익 구성현황

(단위:백만원,%)

구 분		평가손익			처분손익			기타손익
		주식	채권	파생상품	주식	채권	파생상품	
금 기	금 액	279		470	-6		189	17
	비 율	29.36		49.55	-0.61		19.87	1.82
부 계	금 액	279		470	-6		189	17
	비 율	29.36		49.55	-0.61		19.87	1.82

주 1) 기타손익의 내역: 유가증권상환손익+배당금수익+수입이자-기타비용-보수

(2) 투자현황에 관한 사항

(1) 자산구성현황

(단위:백만원,%)

구 분		주식	채권	파생상품	예금	콜론	기타	자산총액
금 기	금 액	7,615		987	81	7,201	261	16,145
	비 율	47.16		6.12	.5	44.6	1.62	100
전 기	금 액							
	비 율							

주 1) 기타의 내역: 청약증거금, 무형자산, 선납원천세등

(2) 주식 및 채권의 주요 보유현황

(단위:백만원,%)

구 분	종목명	보유주수(액면금액)	시가	자산구성비
주 식	삼성전자	7,070	1,619	7.18
	SK텔레콤	3,570	809	3.59
	한국통신공사	12,740	803	3.56
	한국전력	25,870	589	2.61
	포항제철	3,920	384	1.70
	현대차	11,550	238	1.05
	국민은행	12,530	195	0.87
	주택은행	6,160	154	0.68
	신한은행	13,020	152	0.68
	S-Oil	4,560	148	0.66
채 권				

3 파생상품 투자현황

(단위: 주, 백만원)

구 분	상품명	기중 투자현황		기말 투자현황	
		계약수	약정금액	계약수	약정금액
선물매입	2001년03월물	478	16,364	190	6,408
선물매도					
콜옵션매입					
콜옵션매도					
풋옵션매입					
풋옵션매도					
기 타					

(3) 투자주식 매매에 관한 사항

1 주요 매매종목

(단위: 백만원, %)

구 분	종목명	매 수		매 도	
		주수(백면)	금액(원)	주수(백면)	금액(원)
주 식	삼성전자	7,070	1,509,950,000		
	한국통신공사	12,740	767,494,000		
	SK텔레콤	3,570	762,960,000		
	한국전력	25,870	588,090,000		
	포항제철	3,920	371,577,000		
	현대차	11,550	205,672,500		
	국민은행	12,530	191,619,500		
	신한은행	13,020	153,264,000		
	주택은행	6,160	149,644,000		
	S-Oil	4,560	141,615,500		
채 권					

(2) 주식매매회전률

(단위: 백만원, %)

구 분	당 월	전 월	분 기	반 기
총매수금액	3,195	4,152	7,347	7,347
총매도금액	9	6	16	16
합 계	3,204	4,158	7,362	7,362
가간중주식총평잔	4,521	2,487	3,592	3,592
매매회전률	.35	.84	.34	.17

3. 요약 재무제표

1) 대차대조표

(단위:백만원)

자 산	금기	전기	부채와 자본	금기	전기
1. 운용자산	15,884		부 채		
1) 예차금	81		1. 매수유가증권미지급금	1,084	0
2) 콜옵션	7,201		2. 정산미지급금	1	0
3) 청산증거금	0		3. 매도옵션	0	0
4) 주권	7,615	0	4. 해지미지급금	70	0
5) 채권	0	0	5. 보수미지급금	8	0
6) 파생상품	987		6. 기타부채	1	0
8) 기타유가증권	0		부채총계	1,164	0
2. 기타자산	261		자 본		
			1. 자본금	14,033	0
			2. 차기이월이익잉여금	949	
			1) 전기이월이익잉여금	0	0
			2) 당기순이익	949	
			자본총계	14,981	
자산총계	16,145		부채와자본 합계	16,145	
주당순자산가치=(자산총액 - 부채총액) / 발행주식총수				1,035.43	

2) 손익계산서

(단위:백만원)

계정과목명	금 기		누 계	
1. 투자수익		37		37
1) 이차수익	35		35	
2) 배당금수익	0		0	
3) 기타 투자수익	2		2	
2. 매매수익		1,644		1,644
1) 주식매매이익	319		319	
2) 채권매매이익	0		0	
3) 파생상품매매이익	1,325		1,325	
4) 기타매매이익	0		0	
3. 매매손실		712		712
1) 주식매매손실	46		46	
2) 채권매매손실	0		0	
3) 파생상품매매손실	667		667	
4) 기타매매손실	0		0	
4. 매매차익(또는 매매차손)		931		931
5. 운용비용		20		20
1) 보관보수	1		1	
2) 판매보수	0		0	
3) 일반사무수탁보수	1		1	
4) 운용보수	7		7	
5) 기타 운용비용	12		12	
6. 법인세 차감전 순이익		949		949

4. 투자제한사항 준수여부

* 별첨참조

5. 감사의 확인

감사 :

송충석



기간 : 2001.02.01~04.30

[펀드명] 유리인덱스이백주식형펀드

■ 법규 제한

제한사항	준수여부
동일종목 주식 10%이내 투자	위반사항 없음
동일종목 유가증권 10%이내 투자	위반사항 없음
동일회사발행 주식 10%이내 투자	위반사항 없음
지방채·특수채 30%이내 투자	위반사항 없음
사모사채 5%이내 투자	위반사항 없음
수익증권 5%이내 투자	위반사항 없음
위탁증거금 15%이내	03.06 위반
관계증권사 월간위탁매매 20%이내	위반사항 없음

■ 투자설명서 제한

제한사항	준수여부
주식 및 파생상품에의 투자 : 순자산총액의 90%이상	위반사항 없음
주식에의 투자 : 순자산가치의 60% 이상	03.10 이후 위반지속
현금성 자산 투자 : 순자산총액의 10%이상	위반사항 없음
자산유동화증권 투자 : 자산총액의 10%이하	위반사항 없음
주식투자 대상 : 증권거래소 상장주식	위반사항 없음