

# 유리인덱스200주식형펀드 영업보고서

(기간:2001년05월01일 - 2001년07월31일)

## 1. 자본 변동내용 및 주식매매상황표

### 1) 자본 변동 현황

(단위:주,백만원)

초기발		증가		감소		종기말	
주식수	금액	주식수	금액	주식수	금액	주식수	금액
14,468,667,083	14,033	42,765,751,393	45,186	10,155,893,926	10,468	47,078,524,550	48,750

주 1) 주요 증가요인 : 유상증자

2) 주요 감소요인 : 환매

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

### 2) 회사발행주식 매매상황표

#### (1) 주당순자산가치(NAV)

(단위:원)

금액(A)	변동(B)	금액(C)	변동률(D=(A-B)/B)	시가(E)	변동률(F=(A-E)/E)
959.72	1,035.43	-75.71	-7.31%		

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)

종가	평균	최고	최저	평균거래량(단위)

##### ② 개방형의 경우

(단위:주)

종가	신규발행	환매량	금기	평균거래량(단위)
14,468,667,083	42,765,751,393	10,155,893,926	47,078,524,550	705,621,938

## 2. 자산운용현황

### (1) 운용성과에 관한 사항

#### ① 최근 운용성과

(단위:%)

구분	07월	06월	05월	04월	03월	02월
당해펀드수익률(A)	-4.03	5.12	9.11	3.54	-6.60	
비교지수수익률(B)	-5.34	3.45	7.53	2.39	-7.91	
초과수익률(A-B)	1.31	1.67	1.57	1.15	1.31	

주 1) 비교지수: KOSPI200:66.98 / 기준일(01.03.05):70.76

② 주요영업손익 구성현황

(단위:백만원,%)

구분		영업손익			영업외손익			기타손익
		주식	채권	영업외손익	주식	채권	영업외손익	
금 기	금 액	-2,690		-2,611	-54		722	116
	비 율	59.56		57.8	1.2		-15.99	-2.57
누 계	금 액	-2,412		-2,141	-60		911	132
	비 율	67.59		59.99	1.68		-25.52	-3.71

주 1) 기타손익의 내역(누계): 수입이자:199 배당수익:27,보수:-59 기타비용:-35

(2) 투자현황에 관한 사항

① 자산구성현황

(단위:백만원,%)

구분		주식	채권	영업외자산	배당	합계	기타	자산총액
금 기	금 액	23,583		1,145	26	13,102	7,382	45,237
	비 율	52.13		2.53	.06	28.96	16.32	100
전 기	금 액	7,615		987	81	7,201	261	16,145
	비 율	47.16		6.12	.5	44.6	1.62	100

주 1) 기타의 내역: 청약증거금:0, 미수입금:2,358, 무형자산:11,CO:4,987,기타:26

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

(단위:백만원,%)

구분	종목명	보유수량(백만원)	시가	자산구성비
주식	삼성전자	23,600	4,472	6.34
	SK텔레콤	11,570	2,401	3.40
	한국통신공사	40,480	2,162	3.06
	한국전력	83,040	1,719	2.44
	포항제철	13,020	1,148	1.63
	현대차	38,370	846	1.20
	국민은행	41,800	709	1.00
	주택은행	21,590	629	0.89
	신한은행	42,880	525	0.74
	기아차	50,550	438	0.62
채권				

③ 파생상품 투자현황

(단위:주,백만원)

구분	종목명	선물매입		선물매도	
		계약수	계약금액	계약수	계약금액
선물매입	2001년09월물	1,220	44,981	695	25,336
선물매도	2001년09월물	105	3,933		
콜옵션매입					
콜옵션매도					
풋옵션매입					
풋옵션매도					
기 타					

주 1) 상품별 투자목적:

(3) 투자주식 매매에 관한 사항

① 주요 매매종목(주식:상위 10종목, 채권:상위 5종목)

(단위:백만원,%)

구분	종목명	매수		매도	
		주수(백만)	금액(천)	주수(백만)	금액(천)
주식	삼성전자	22,650	4,837,055,000	6,120	1,220,145,000
	SK텔레콤	11,090	2,403,240,000	3,090	636,440,000
	한국통신공사	39,140	2,263,735,000	11,400	626,178,000
	한국전력	80,580	1,891,916,500	23,410	528,944,500
	포항제철	12,460	1,310,788,000	3,360	320,208,000
	현대차	36,720	930,325,000	9,900	241,307,500
	국민은행	40,070	676,618,500	10,800	185,580,000
	주택은행	21,010	588,334,000	5,580	160,936,500
	S-Oil	10,660	386,489,000	7,840	276,777,000
	신한은행	40,960	516,870,000	11,100	138,842,500
채권					

② 주식매매회전율

(단위:백만원,%)

구분	당월	전월	분기	반기
총매수금액	3,292	11,443	27,492	34,839
총매도금액	2,039	6,788	8,827	8,843
합계	5,331	18,232	36,320	43,682
기간중주식총평잔	25,183	22,603	19,658	13,707
매매회전율	.11	.4	.31	.27

주 1) 매매회전율은 일정기간중 회사가 매매한 주식의 반도에 관한 비율입니다.

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

### 3. 요약 재무제표

1) 대차대조표 (전기: 2001년04월30일 , 금기: 2001년07월31일 )

(단위:백만원)

자산	금기	전기	부채	금기	전기
1.운용자산	42,842	15,884	부채		
1) 예치금	26	81	1. 매수유가증권미지급금	0	1,084
2) 콜론	13,102	7,201	2. 정산미지급금	0	1
3) 청약종거금	0	0	3. 매도옵션	0	0
4) 주식	23,583	7,615	4. 해지미지급금	5	70
5) 채권	0	0	5. 보수미지급금	49	8
6) 파생상품	1,145	987	6. 기타부채	1	1
8) 기타유가증권	4,987	0	부채총계	55	1,164
2.기타자산	2,395	261	자본		
			1. 자본금	48,750	14,033
			2. 차기이월이익잉여금	-3,568	949
			1) 전기이월이익잉여금	0	0
			2) 당기순이익	-3,568	949
			자본총계	45,182	14,981
주당순자산가치=(자산총액 - 부채총액) / 발행주식총수				959.72	1,035.43

2) 손익계산서(기간 : 2001년05월01일 ~ 2001년07월31일 )

(단위:백만원)

1.투자수익		190		227
1) 이자수익	163		199	
2) 배당금수익	27		27	
3) 기타 투자수익	0		2	
2. 매매수익		3,002		4,645
1) 주식매매이익	203		522	
2) 채권매매이익	0		0	
3) 파생상품매매이익	2,798		4,123	
4) 기타매매이익	0		0	
3. 매매손실		7,634		8,347
1) 주식매매손실	2,948		2,994	
2) 채권매매손실	0		0	
3) 파생상품매매손실	4,687		5,353	
4) 기타매매손실	0		0	
4. 매매차익(또는 매매차손)		-4,633		-3,702
5. 운용비용		74		94
1) 보관보수	3		4	
2) 판매보수	0		0	
3) 일반사무수탁보수	5		6	
4) 운용보수	42		49	
5) 기타 운용비용	23		35	
6. 법인세 차감전 순이익		-4,517		-3,568

### 4. 투자제한사항 준수여부

\* 별첨참조

### 5. 감사의 확인

감사 : 송충석

## 투자제한사항 준수여부

기간 : 2001.05.01~07.31

[펀드명] 유리인덱스이백주식형펀드

### ▣ 법규 제한

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

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