

자산운용보고서

유리트리플알파증권투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2020년03월12일 ~ 2020년06월11일)

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

유리자산운용

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 주식 매매회전율 추이
- 8 **자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항**

1. 공지 사항

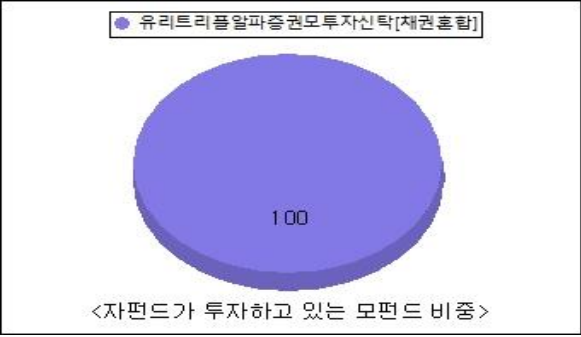
1. 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
2. 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로써 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는고객님이 가입한 유리트리플알파증권자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]_운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 'NH농협은행, 한국포스증권, 현대차투자증권'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 02-2168-7900
 금융투자협회 http://dis.kofia.or.kr

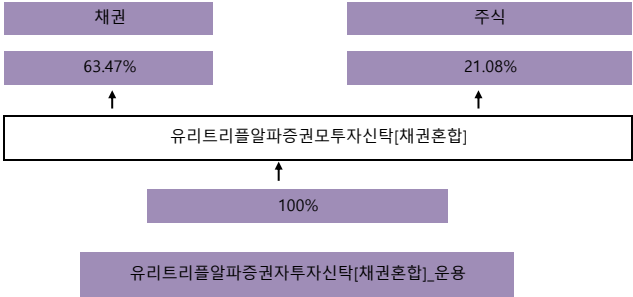
2. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률			
펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]_운용, 유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합], 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]_ClassA, 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]_ClassC, 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]_ClassC-W, 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합]_ClassS		4등급	AM202, AV714, AM203, AM205, AM208, BE671
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.12.12
운용기간	2020.03.12 ~ 2020.06.11	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	NH농협은행, 한국포스증권, 현대차투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	1. 투자대상 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 범위내에서 10%를 초과할 수 있습니다. ※ 유리트리플알파증권모투자신탁 [채권혼합] 투자대상 유리트리플알파증권모투자신탁의 경우 채권에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 국내주식에 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 투자하며 통싯전략, 공모주/이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구합니다.		
	2. 투자전략 이 투자신탁은 채권을 주된 투자대상으로 하되, 통싯전략, 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] • 통싯(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 펀더멘털, 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 교체매매 및 적절한 투자 대상 선정을 통해 추가 수익을 추구합니다. - 국제선물을 활용한 트레이딩 전략을 일부 활용하여 추가 수익을 추구합니다.		
	3. 위험관리 운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 등에서 결정합니다. 리스크관리 본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다. 위험관리를 위하여 투자 환경 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.



▶ 자산현황

자산현황 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)	342	325	-4.80
	부채총액(B)			0.00
	순자산총액(C=A-B)	342	325	-4.80
	발행 수익증권 총 수(D)	330	308	-6.63
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,035.73	1,056.01	1.96
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파자[채권혼합]_C/A	기준가격	1,031.34	1,049.77	1.79
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C	기준가격	1,033.65	1,051.35	1.71
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W	기준가격	1,003.82	1,022.51	1.86
유리트리플알파자[채권혼합]_C/S	기준가격	995.30	1,014.79	1.96

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

당분기 펀드의 수익률은 보수전 기준으로 1.96%(운용클래스 기준)를 기록하였습니다. 우선주 및 바스켓 차익거래 전략이 4월 이후 양호한 흐름을 나타내며 수익률 갭이 플러스로 전환하였고 일정 기준 이상 벌어진 2개 페어는 차익 실현하였습니다. 또한 중소형 IPO 및 블록딜, 회사 분할 및 합병 등에 연관된 2-3개 종목을 편입하여 수익 실현하였습니다. 유지 중인 롱숏 포트폴리오는 보수적으로 접근하고 향후 정상 베이스시 수익 실현할 수 있도록 포트폴리오 베타 관리를 철저히 하겠습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

KOSPI는 3월 급락 이후 반등세를 이어가고 있습니다. 현재 완전한 여름 계절로 접어들고 있지만 코비드19 확진자는 감소하지 않고 소규모 조용한 감염으로 그 위세를 굽히지 않고 있습니다. 미중 무역 갈등이 재차 불거지고 있는 점, 전세계적으로 풀린 유동성에 대한 연준의 정책 방향이 리스크 요인으로 작용하고 있습니다. 시장 변동성의 급격한 상승으로 차익 거래 신규 기회는 감소하고 있습니다. 펀드는 정상 베이스시 회복할 때까지 동종 업종 내 수익률 갭이 확대할 페어 발굴 및 편입에 집중할 계획입니다. IPO는 밸류에이션 및 물량 부담이 적은 종목을 중심으로 접근할 예정이며 추가적으로 향후 각종 기업 관련 이벤트를 활용한 초과 수익 기회를 모색하겠습니다.

▶ 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	1.96	2.00	2.41	3.11
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[채권혼합]_C/A	1.79	1.66	1.89	2.41
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C	1.71	1.51	1.66	2.11
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W	1.86	1.81	2.12	2.73
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]_C/S	1.96	1.48	1.67	2.29
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

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	3.11	6.17	9.49	15.72
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[채권혼합]_C/A	2.41	4.74	7.28	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C	2.11	4.12	6.33	10.20
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W	2.73	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[채권혼합]_C/S	2.29	5.00	7.87	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): BM없음

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

▶ 손익현황

(단위:백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	-2	1	0	1	0	0	0	0	0	0	0	0
당기	7	1	0	-1	-1	0	0	0	0	0	0	6

4. 자산현황

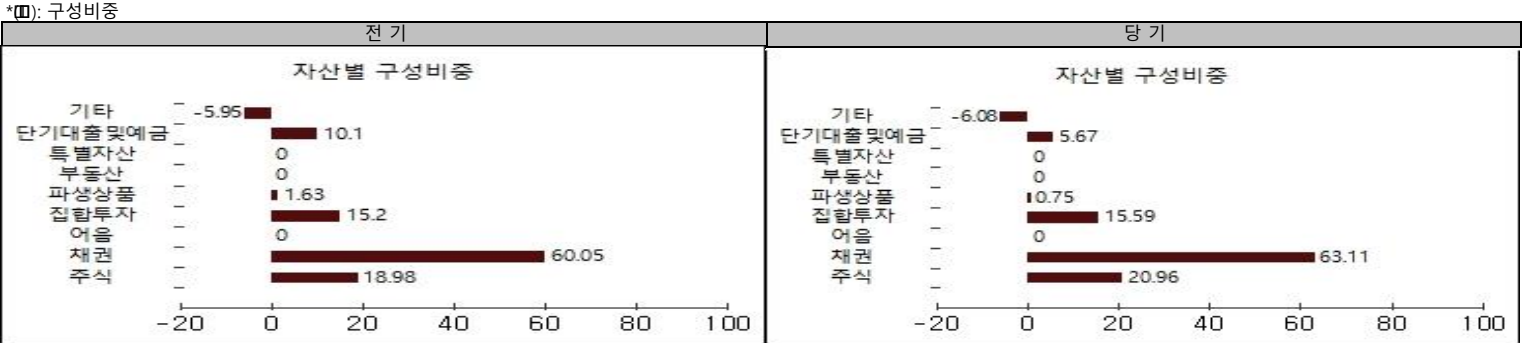
아래 표시된 자산구성 현황은 고객님의 가입한 자펀드가 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.

▶ 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,%)

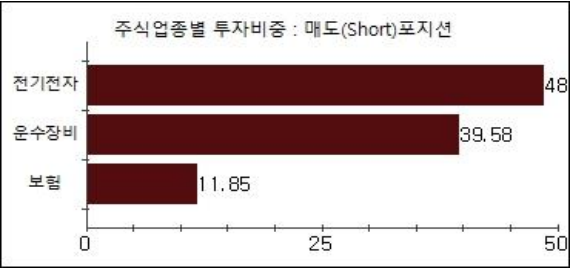
통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	68	205		51	2	0	0	0	0	18	-20	325
(1.00)	(20.96)	(63.11)	(0.00)	(15.59)	(0.75)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(5.67)	-(6.08)	(100.00)
합계	68	205		51	2	0	0	0	0	18	-20	325



▶ 주식업종별 투자비중 : 매도(Short)포지션

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	48.57			
2	운수장비	39.58			
3	보험	11.85			



▶ 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.

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	채권	통안01180-2108-02	23.71	6	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS	6.90
2	채권	통안01810-2102-02	22.65	7	차입주식	삼성전자	6.64
3	채권	국고01625-2206(19-3)	12.79	8	단기상품	은대(신한은행)	5.67
4	차입주식	현대차	8.66	9	주식	LG화학우	4.22
5	집합투자증권	KBSTAR 단기통안채	7.57	10	주식	삼성전자우	4.19

※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.

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
LG화학우	58	14	4.22	대한민국	KRW	화학	
삼성전자우	286	14	4.19	대한민국	KRW	전기전자	
삼성전자	102	6	1.72	대한민국	KRW	전기전자	
LG화학	2	1	0.31	대한민국	KRW	화학	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안01180-2108-02	77	77	대한민국	KRW	2019-08-02	2021-08-02		N/A	23.71
통안01810-2102-02	73	74	대한민국	KRW	2019-02-02	2021-02-02		N/A	22.65
국고01625-2206(19-3)	41	42	대한민국	KRW	2019-06-10	2022-06-10		N/A	12.79

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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KBSTAR 단기통안채	수익증권	KB자산운용	25	25	대한민국	KRW	7.57
KODEX 단기채권PLUS	수익증권	삼성자산운용	22	22	대한민국	KRW	6.90

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	18	0.23		대한민국	KRW

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	
박주호 ㉠	퀀트운용본부장	1969	28	3,397	1	478	2109000457
최재명 ㉠	채권운용본부장	1972	44	36,998	0	0	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

기간	운용전문인력
2018.07.09 ~ 현재 이 투자신탁의 최초 설정일(2014.12.12) ~ 2018.07.08 이 투자신탁의 최초 설정일(2014.12.12) ~ 2018.07.08	박주호(책임) 한진규(책임) 박주호(부책임)

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

6. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

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

		구분	전기		당기	
			금액	비율 주1)	금액	비율 주1)
유리트리플알파자[채권혼합]_운용	매매 중개 수수료	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 주2)	0.33	0.10	0.08	0.02
		단순매매, 중개수수료	0.05	0.02	0.04	0.01
		조자분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.05	0.02	0.05	0.01
		합계	0.05	0.02	0.05	0.01
유리트리플알파자[채권혼합]_C/A	매매 중개 수수료	증권거래세	0.02	0.01	0.02	0.01
		자산운용사	0.18	0.09	0.16	0.09
		판매회사	0.15	0.07	0.14	0.08
		펀드재산보관회사(신탁업자)	0.01	0.00	0.01	0.01
		일반사무관리회사	0.01	0.00	0.00	0.00
		보수합계	0.35	0.17	0.31	0.17
		기타비용 주2)	0.26	0.13	0.04	0.02
		단순매매, 중개수수료	0.03	0.02	0.02	0.01
		조자분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.03	0.02	0.03	0.01
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C	매매 중개 수수료	증권거래세	0.01	0.01	0.01	0.01
		자산운용사	0.04	0.09	0.04	0.09
		판매회사	0.07	0.15	0.07	0.15
		펀드재산보관회사(신탁업자)	0.00	0.00	0.00	0.00
		일반사무관리회사	0.00	0.00	0.00	0.00
		보수합계	0.12	0.24	0.12	0.25
		기타비용 주2)	0.06	0.13	0.01	0.03
		단순매매, 중개수수료	0.01	0.02	0.01	0.01
		조자분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.01	0.02	0.01	0.01
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W	매매 중개 수수료	증권거래세	0.00	0.01	0.00	0.01
		자산운용사	0.06	0.09	0.08	0.09
		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	0.06	0.09	0.09	0.10
		기타비용 주2)	0.00	0.00	0.02	0.02
		단순매매, 중개수수료	0.01	0.02	0.01	0.01
		조자분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.01	0.02	0.01	0.01
유리트리플알파자[채권혼합]_C/S	매매 중개 수수료	증권거래세	0.00	0.00	0.01	0.01
		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 주2)	0.00	0.00	0.00	0.02
		단순매매, 중개수수료	0.00	0.02	0.00	0.01
		조자분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.00	0.02	0.00	0.01

* 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 : 없음

※ 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비율을 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.

		해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파자[채권혼합]_운용	전기	0	0	0.223	0.0911
	당기	0	0	0.2039	0.0875

종류(Class)별 현황					
유리트리플알파자[채권혼합]_C/A	전기	0.6815	0	0.9199	0.0934
	당기	0.6815	0	0.9096	0.0919
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C	전기	0.9816	0	1.2104	0.089
	당기	0.9813	0	1.2008	0.089
유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W	전기	0.3775	0	0.4115	0.0745
	당기	0.3794	0	0.4465	0.0644
유리트리플알파자[채권혼합]_C/S	전기	0.3046	0	0.46	0.1103
	당기	0.2758	0	0.4117	0.1184

- 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 0.25%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전을 (단위:백만원, %)

유리트리플알파모[채권혼합]					
매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
10,800	154	17,065	543	16.15	64.08

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 나타냅니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이 (단위: %)

유리트리플알파모[채권혼합]					
2019-09-12 ~ 2019-12-11		2019-12-12 ~ 2020-03-11		2020-03-12 ~ 2020-06-11	
14.65		10.14		16.15	

※ 회전을 변동 사유: 해당 운용기간 중 룡숏 페어 차익 실현 및 IPO 차익 실현 거래로 매매회전율은 전분기 대비 소폭 증가하였습니다.

8. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

(단위 : 백만원, %)		
펀드명칭	투자금액	수익률
해당사항 없음		

※투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매) 될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.