

자산운용보고서

유리인덱스200증권투자회사[주식-파생형]

(운용기간 : 2020년02월09일 ~ 2020년05월08일)

○ 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**

	<p>4. 수익구조</p> <p>이 펀드는 회사재산의 대부분을 주식 및 주식관련파생상품에 투자하는 펀드로서 투자대상 주식 시세의 등락 및 배당으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 주식에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 펀드의 성과에 영향을 미치게 됩니다.</p> <p>주식의 시세는 해당 주식 발행기업의 경영성과 및 주식에 대한 시장의 수급 등의 요인에 의해 결정되며 이러한 요인은 경제, 정치, 자연, 사회, 문화 등 다양한 변수의 영향을 받습니다. 투자대상 주식 발행기업의 경영성과가 우수할수록, 투자대상 주식에 대한 수요가 공급보다 클수록 주식의 시세는 상승하는 경향을 나타내어 투자회사의 가치는 상승하고, 반대의 경우에는 투자회사의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다.</p> <p>이 펀드의 성과는 비교지수의 성과와 비교지수 대비 추적오차에 의해 결정됩니다. 이 펀드의 성과는 일반적으로 '비교지수 대비 추적오차' 보다는 '비교지수의 성과'로부터 월등히 높은 수준의 영향을 받게 됩니다.</p> <p>이 펀드는 비교지수(KOSPI200지수)의 성과와 유사한 성과의 달성을 그 투자목적으로 하는 바, 비교지수의 성과로부터 절대적인 영향을 받습니다. 일반적으로 환매시점의 비교지수가 매입시점의 비교지수보다 높으면 높을수록 큰 투자수익이 발생하며, 반대로 환매시점의 비교지수가 매입시점의 비교지수보다 낮으면 낮을수록 투자손실이 커지게 됩니다.</p> <p>시장상황 등에 따라 이 펀드의 성과는 비교지수의 성과와의 괴리, 즉 추적오차를 나타낼 수 있습니다. 비교지수 대비 양(+)의 추적오차 발생시에는 이 펀드가 비교지수 보다 우월할 성과를, 비교지수 대비 음(-)의 추적오차 발생시에는 이 펀드가 비교지수 보다 열등한 성과를 보이게 됩니다. 이러한 추적오차가 이 펀드의 성과에 미치는 영향은 일반적으로 비교지수 자체의 성과가 미치는 영향에 비해서는 낮은 수준이라고 할 수 있습니다.</p> <p>이 펀드의 성과는 자본이득, 배당수입, 이자수입으로 구분할 수 있으며 일반적으로 자본이득이 성과에 미치는 영향이 절대적인 비중을 차지합니다.</p>
--	--

▶ 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
유리인덱스200[주식-파생형]_운용	자산 총액(A)	8,098	7,325	-9.54
	부채총액(B)	24	8	-65.62
	순자산총액(C=A-B)	8,074	7,317	-9.37
	발행 수익증권 총 수(D)	8,156	8,578	5.17
	기준가격 (E=C/Dx1000)	989.86	852.96	-13.83
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리인덱스200[주식-파생형]_C/A	기준가격	959.45	823.59	-14.16
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B	기준가격	978.85	842.32	-13.95
유리인덱스200[주식-파생형]_C/S	기준가격	973.48	837.15	-14.00

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

<p>글로벌 증시는 2월 월초 미국 1월 ISM 제조업 지수 호조, 중국의 미국산 제품 관세 인하 등의 영향으로 상승 출발하였으나, 월 후반 미국 제조업 및 서비스업 지표 하락, 중국 내 코로나19 추가 확진 및 코로나19 전세계 확산 불안감, 유럽 내 산업체인 차질 불안감 확대 및 세계보건기구(WHO)의 코로나19 글로벌 확산에 대한 ‘매우 위험’ 상황 조정 등의 영향으로 낙폭을 확대하며 마감하였습니다. 3월에는 월초 선진국 중앙은행들의 금리인하 기대감 영향으로 상승 출발하였으나, 월 중 산유국 간 원유 전쟁에 따른 유가 폭락, WHO의 코로나19 판데믹 공식 선언, 미국의 재정정책 시행 불확실성 부각, 코로나19 확진자 수 급증에 따른 미국 및 유럽 내 주요 공장 섯다운, 시민들의 이동규제 강화 등의 영향으로 하락세를 지속하였습니다. 다만, 월말 들어 연준의 무제한 양적완화 및 유럽중앙은행의 무제한 국채 매입 시사 발언 등에 힘입어 낙폭을 일부 축소하며 마감하였습니다. 4월에는 월초 미국 3월 비농업고용지표 큰 폭 하락, 코로나19 확산 지속 등의 영향으로 하락 출발한 가운데, 월 중 코로나19 확진자 증가세 둔화, 주요 산유국 감산 합의 기대감, 연방준비위원회의 국채 및 회사채 대규모 매입 발표, 미국의 2조 달러 규모의 코로나19 대응 패키지 발표 등의 영향으로 상승세를 지속하였습니다. 월 후반 원유 선물가격 마이너스, 주요 기업 1분기 실적 우려 등의 영향에도, 1)미국 및 유럽 내 주요지역 경제 재개 기대감 및 2)코로나19 치료제(렘데시비르)의 긍정적인 임상 결과보도 등에 힘입어 미/유럽 증시 중심으로 상승하여 마감하였습니다.</p>
<p>국내 증시는 2월 월초 외국인의 현선을 동반 순매수, 중국의 미국산 제품 관세 인하 소식 등의 영향으로 상승 출발하여, 중국 내 코로나19 감염자수 증가세 둔화, 기관 순매수 등 긍정적인 소식에 힘입어 상승세를 지속하였습니다. 다만, 월 후반 코로나19 확진자 수 급증에 따른 내수 경기 둔화 불안감 속 외국인과 기관의 대규모 순매도, 미국 증시 급락 및 한국은행의 기준금리 동결에 따른 실망감 속 국내 산업 및 내수 업황 우려 등의 영향으로 코스피 2,000pt 선이 붕괴되면서 급락하여 마감하였습니다. 3월에는 주요국 중앙은행의 시장 개입 시사, 연준의 금리인하 및 원/달러 환율 하락 등의 영향으로 상승 출발하였으나, 월 중 국제유가 폭락 속 외국인의 순매도, 미국 내 코로나19 확산 지속, 트럼프 재정정책 통과 지연 우려 등으로 인해 장중 사이드카와 서킷브레이크가 발동하며 급락하여, 중국 실물경제 악화, 원/달러 환율 급등 등의 영향으로 하락세를 지속하였습니다. 다만, 월 후반 들어 한국은행과 미국 연방준비제도(FED)의 600억 달러 규모 통화 스와프 체결 소식, FED의 무제한 양적완화 및 대규모 부양책 상원 통과 소식, 정부의 증권시장 안정펀드 및 2차 추경 소식 등으로 낙폭을 일부 축소하며 마감하였습니다. 4월에는 코로나19 글로벌 확산 기조 영향으로 하락 출발하였으나, 산유국들의 원유 감산 기대감, 삼성전자 및 LG전자 1분기 실적 호조, 연방준비위원회의 대규모 유동성 공급 소식, 정부의 3차 추경 계획 및 10조원 규모의 대책 발표 등에 힘입어 월 중반까지 상승세를 지속하였습니다. 다만, 월 후반 ‘렘데시비르’의 치료효과 논란, 인텔의 실적 가이던스 하향 조정 등의 영향으로 일부 상승폭을 반납하였으나, 1)미국 및 유럽 등 선진국 경제활동 기대감, 2)5월 중국 양회 개최에 따른 외국인과 기관의 동반 순매수 등의 영향으로 상승세를 지속하여 마감하였습니다.</p>
<p>동 펀드는 해당 기간 동안 업종 중립을 원칙으로 안정적인 벤치마크 추종을 위한 포트폴리오 관리에 노력했으며, 종목 선택과 매매 전략 등을 통해 초과수익을 내는데 주안점을 두었습니다.</p>

▶ 투자환경 및 운용 계획

다음 분기는 대외적으로 1)코로나19 치료제 관련 임상 결과 발표, 2)미국 및 유럽 주요국 경제재개 계획 가능성, 3)국제유가를 둘러싼 산유국 간 갈등 확대 여부, 4)세계 각국의 추가적인 경기 부양정책 기대감, 5)미국과 중국 간 무역분쟁 재개 우려, 6)주요국의 경제지표 내용, 7)주요 기업들의 1분기 실적, 및 8)국제유가와 환율의 움직임 등이 증시의 방향을 결정할 것으로 보이며, 대내적으로는 9)정부의 적극적 부양정책 및 10)코로나19 국내 확진자 수 감소 추이, 11)1분기 기업실적 발표, 12)남북 경제협력 관련 뉴스 및 13)연기금과 외국인의 수급 변화 등이 중요한 변수가 될 것으로 판단되는 바, 단기적인 변동성에 주의하면서 안정적인 포트폴리오 관리에 최선을 다할 계획입니다.

이와 같은 주요 이슈에 주목하며 안정적인 포트폴리오 관리에 주력할 것이며, 재무구조가 상대적으로 약화된 그룹 및 기업에 대해서는 지속적인 모니터링을 통해 신용위험을 관리할 계획입니다.

동 펀드는 제한적인 범위 내에서 계량모델(펀더멘탈, 베타 및 모멘텀 모델 등)에 근거한 스타일바스켓 편입, 보통주/우선주간 교체매매, 공모주(IPO) 투자 및 기업분할/합병 등의 이벤트 투자 등을 통해 초과수익을 추구하겠습니다.

▶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.

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
유리인덱스200[주식-파생형]_운용	-13.83	-8.47	2.56	-7.07
(비교지수 대비 성과)	(0.12)	(0.89)	(0.89)	(1.33)
종류(Class)별 현황				
유리인덱스200[주식-파생형]_C/A	-14.16	-9.16	1.40	-8.51
(비교지수 대비 성과)	(-0.21)	(0.20)	(-0.27)	(-0.11)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B	-13.95	-8.72	2.14	-7.59
(비교지수 대비 성과)	-	(0.64)	(0.47)	(0.81)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/S	-14.00	-8.83	1.94	-7.83
(비교지수 대비 성과)	(-0.05)	(0.53)	(0.27)	(0.57)
비교지수(벤치마크)	-13.95	-9.36	1.67	-8.40

주)비교지수(벤치마크): KOSPI200 X 100%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리인덱스200[주식-파생형]_운용	-7.07	-15.76	-10.00	6.82
(비교지수 대비 성과)	(1.33)	(3.00)	(4.42)	(8.43)
종류(Class)별 현황				
유리인덱스200[주식-파생형]_C/A	-8.51	-18.35	-14.11	-1.14
(비교지수 대비 성과)	(-0.11)	(0.41)	(0.31)	(0.47)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B	-7.59	-16.70	-11.50	3.90
(비교지수 대비 성과)	(0.81)	(2.06)	(2.92)	(5.51)
유리인덱스200[주식-파생형]_C/S	-7.83	-17.15	-12.24	8.37
(비교지수 대비 성과)	(0.57)	(1.61)	(2.18)	(9.98)
비교지수(벤치마크)	-8.40	-18.76	-14.42	-1.61

주)비교지수(벤치마크): KOSPI200 X 100%

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

▶추적오차

추적오차 표를 통해 자산운용보고서 작성일 현재(당기말) 각 기간에 대해서 인덱스 펀드가 추종하는 지수의 변동을 얼마나 충실히 따라 갔는지를 확인 할 수 있습니다.

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
유리인덱스200[주식-파생형]_운용	1.56	2.40	1.77

주) 추적오차란 일정기간 동안 인덱스펀드가 추종하는 특정 비교지수의 변동을 얼마나 충실히 따라갔는지를 보여주는 지표로서, 비교지수 수익률 대비 해당 인덱스펀드의 일간 수익률 차이의 표준편차로 기재합니다. 추적오차의 수치가 적을수록 해당 기간 동안 인덱스펀드가 비교지수와 유사하게 움직였음을 의미합니다.

▶ 손익현황

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	318	0	0	126	55	0	0	0	0	2	-1	500
당기	-685	0	0	-272	-140	0	0	0	0	1	-2	-1,097

4. 자산현황

▶ 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.

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	4,583	0	0	1,731	68	0	0	0	0	931	12	7,325
(1.00)	(62.56)	(0.00)	(0.00)	(23.64)	(0.93)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(12.71)	(0.16)	(100.00)
합계	4,583	0	0	1,731	68	0	0	0	0	931	12	7,325

*단위: 구성비중



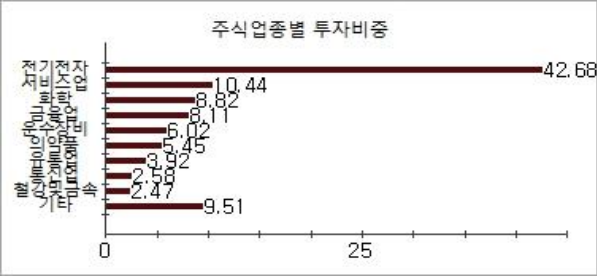
▶ **주식업종별 투자비중**

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 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	42.68	6	의약품	5.45
2	서비스업	10.44	7	유통업	3.92
3	화학	8.82	8	통신업	2.58
4	금융업	8.11	9	철강및금속	2.47
5	운수장비	6.02	10	기타	9.51

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 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	주식	삼성전자	19.67	6	주식	NAVER	2.28
2	집합투자증권	TREX 200	17.07	7	주식	셀트리온	1.82
3	단기상품	보통예금(한국씨티)	12.71	8	집합투자증권	KODEX 200	1.40
4	집합투자증권	TREX 펀더멘탈 200	4.71	9	주식	LG화학	1.37
5	주식	SK하이닉스	4.00	10	주식	삼성SDI	1.25

▼ **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
삼성전자	29,529	1,441	19.7	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	3,446	293	4.0	대한민국	KRW	전기전자	
NAVER	780	167	2.3	대한민국	KRW	서비스업	
셀트리온	633	133	1.8	대한민국	KRW	의약품	
LG화학	285	100	1.4	대한민국	KRW	화학	
삼성SDI	321	92	1.3	대한민국	KRW	전기전자	

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

▶ **집합투자증권**

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
TREX 200	수익증권	유리자산운용	1,483	1,250	대한민국	KRW	17.07
TREX 펀더멘탈 200	수익증권	유리자산운용	426	345	대한민국	KRW	4.71
KODEX 200	수익증권	삼성자산운용	90	103	대한민국	KRW	1.40

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	한국씨티은행	2007-01-01	931	2.45		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 ^{주)}	퀀트운용본부장	1969	28	3,432	1	478	21090000457

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 2001.03.06 ~ 2018.07.08 2001.03.06 ~ 2018.07.08 2010.08.18 ~ 2010.09.10 2008.06.04 ~ 2010.12.01 2010.08.18 ~ 2010.12.24	박주호(책임) 한진규(책임) 박주호(부책임) 김용태(부책임) 안현수(부책임) 강석훈(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, 매매중계수수료)을 확인할 수 있습니다. 또한 당기와 전기의 보수 및 비용 발생현황을 비교할 수 있습니다.

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율 주1)	금액	비율 주1)	
유리인덱스200[주식-파생형]_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 주2)	2.13	0.03	2.11	0.03	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.34	0.00	0.31	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.20	0.00	0.11	0.00
		합계	0.54	0.01	0.42	0.01
	증권거래세	1.50	0.02	0.29	0.00	
유리인덱스200[주식-파생형]_C/A	자산운용사	0.56	0.13	0.48	0.12	
	판매회사	1.12	0.25	0.97	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.03	0.01	0.03	0.01	
	일반사무관리회사	0.03	0.01	0.02	0.01	
	보수합계	1.74	0.39	1.51	0.38	
	기타비용 주2)	0.12	0.03	0.12	0.03	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.02	0.00	0.02	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.01	0.00
		합계	0.03	0.01	0.02	0.01
	증권거래세	0.08	0.02	0.02	0.00	
유리인덱스200[주식-파생형]_C/B	자산운용사	9.68	0.13	8.37	0.12	
	판매회사	0.00	0.00	0.00	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.58	0.01	0.50	0.01	
	일반사무관리회사	0.48	0.01	0.42	0.01	
	보수합계	10.74	0.14	9.29	0.14	
	기타비용 주2)	2.07	0.03	2.05	0.03	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.32	0.00	0.29	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.19	0.00	0.11	0.00
		합계	0.51	0.01	0.40	0.01
	증권거래세	1.41	0.02	0.28	0.00	

유리인텍스200[주식-파생형]_C/S	자산운용사		0.00	0.12	0.00	0.12
	판매회사		0.00	0.07	0.00	0.07
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.00
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.01	0.21	0.00	0.20
	기타비용(주2)		0.00	0.03	0.00	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.00
		서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
	증권거래세		0.00	0.02	0.00	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.
 ** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한것입니다.
 ※ 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 연평균액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위: 연환산,%)

	구분	총보수·비용비율(A) ^{주1)}	매매·중개수수료비율(B) ^{주2)}	합계(A+B)
유리인텍스200[주식-파생형]_운용	전기	0.1007	0.0552	0.1559
	당기	0.1078	0.0567	0.1645
유리인텍스200[주식-파생형]_C/A	전기	1.6583	0.0557	1.714
	당기	1.6698	0.0566	1.7264
유리인텍스200[주식-파생형]_C/B	전기	0.6585	0.0552	0.7137
	당기	0.6672	0.0568	0.724
유리인텍스200[주식-파생형]_C/S	전기	0.9214	0.0563	0.9777
	당기	0.9298	0.0563	0.9861

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.
 주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

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 회전율

(단위:백만원, %)

유리인텍스200[주식-파생형]_운용

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
8,849	344	6,283	118	2.63	10.68

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리인텍스200[주식-파생형]_운용

2019-08-09 ~ 2019-11-08	2019-11-09 ~ 2020-02-08	2020-02-09 ~ 2020-05-08
14.62	12.25	2.63

* 회전을 변경 사유: 벤치마크(KOSPI200) 정기변경 부재 및 설정/환매, 리밸런싱 등의 감소로 매매가 줄어 회전율이 하락하였습니다.

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.