

운용 목적

- KOSPI200 지수의 투자성과에 근접한 투자수익률 추구

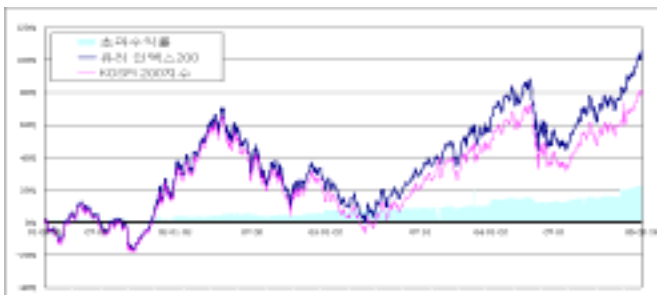
상품개요

- 펀드유형 : 파생상품형, 추가형, 개방형 투자회사
- 가입방법 : 자금 납입일의 익영업일 기준가 적용
- 환매방법 : 4일 환매제 (제3영업일 기준가 적용하여 제4영업일에 지급)
- 환매수수료 : 없음
- 운용대상 : 주식(60%이상), 어음 등(40%이하), 주식관련장내파생상품 등
- 판매수수료 및 보수
 - 판매수수료 (선취) : 매입대금의 1%
 - 총보수 : 연0.60% (운용0.50 / 사무수탁 0.06 / 보관0.04)

운용성과

- 운용기간 : 2001.03.06 ~ 2005.02.28

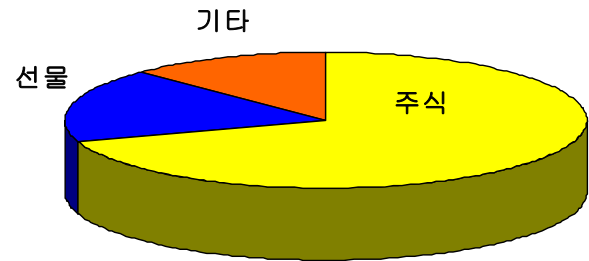
- 운용성과(전구간)



- ※ 벤치마크 = KOSPI200

%	1개월	3개월	6개월	1년	설정후
펀드	7.8	18.4	28.8	17.7	105.9
BM	7.5	15.7	25.5	13.8	82.49

자산구성



구분	주식	채권	선물	기타
비중	79.5%	0%	19.6%	14.3%

※ 05.02.28 기준

과거의 실적이 미래의 성과를 보장하지는 않습니다. 자세한 내용은 투자설명서를 참조하십시오.

운용전략

- 최근 1개월 기준지수를 0.3% 상회한 7.8% 수익률을 기록하였습니다.
- 유리자산운용 고유의 계량적 스코어링 모델을 통해 월별 포트폴리오 리밸런싱을 실시합니다.
- 주식비중을 99% 이상 유지하면서 Enhanced Indexing과 베이스스 현황에 따라 차익거래를 통해 초과수익을 추구할 계획입니다.
- 상시 추적오차 모니터링 시스템을 통해 지수 수익률과의 편차를 최소화합니다.