

자산운용보고서

유리트리플알파증권투자신탁[주식혼합]

(운용기간 : 2020년05월15일 ~ 2020년08월14일)

○ 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

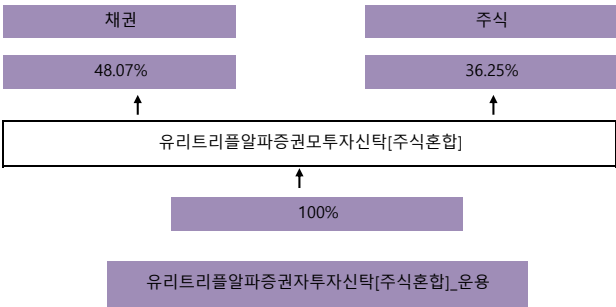
- 1 **공지사항**
- 2 **펀드의 개요**
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 3 **운용경과 및 수익률현황**
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적) 수익률
 - ▶ 손익현황
- 4 **자산현황**
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 5 **투자운용전문인력 현황**
 - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
 - ▶ 해외 운용 수탁회사
- 6 **비용현황**
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 7 **투자자산매매내역**
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이
- 8 **자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항**

	3. 위험관리 운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 등에서 결정합니다. 리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 분석 업무를 수행합니다. 위험관리를 위하여 투자환경 및 투자대상자산과 관련한 변화가 발생 시 탄력적으로 포트폴리오 조정을 실시할 계획입니다.
	4. 수익구조 이 투자신탁은 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자신탁입니다. 이 투자신탁이 투자하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'은 국내주식에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 채권에 투자신탁 자산총액의 50% 미만으로 투자하여 자본소득을 추구합니다. 따라서, 모투자신탁이 투자한 주식, 채권 등의 가격 변동에 따라 이익 또는 손실이 결정됩니다.

▶펀드 구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을대 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[주식혼합]_운용	자산 총액(A)	6,612	6,367	-3.70
	부채총액(B)	1	1	0.42
	순자산총액(C=A-B)	6,610	6,366	-3.70
	발행 수익증권 총 수(D)	6,358	5,892	-7.33
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,039.65	1,080.37	3.92
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	기준가격	1,034.70	1,072.85	3.69
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	기준가격	1,029.66	1,066.95	3.62
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	기준가격	1,023.24	1,060.17	3.61
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	기준가격	1,032.01	1,069.53	3.64
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	기준가격	1,011.35	1,046.93	3.52
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	기준가격	1,036.13	1,075.01	3.75

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

당 분기 펀드의 수익률은 보수 차감 전 기준으로 3.92%(운용클래스 기준)를 기록하였습니다. 페어트레이딩 부분에서는 자동차, 2차전지, 보험, 건설 등 업종 내 페어가 급등하여 해당 페어를 수익청산하였습니다. 특히, 우선주 강세를 보였던 업종의 경우 우선주-보통주 페어를 청산하여 수익 실현하였습니다. 이벤트/IPO 부분에서는 SK바이오팜이 공모주 시장의 분위기를 형성하여 긍정적인 성과를 달성하였으며, Post-IPO 전략으로 상장 이후 하락폭이 큰 종목에 진입하여 추가 수익을 모색하였습니다. 바스켓 통싯전략은 시장의 상승 국면에서는 숏포지션을 축소시켜 상승 모멘텀으로부터의 수익을 추구하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

현재 2.5단계 사회적 거리두기 및 태풍의 피해로 경제 재개에 대한 속도가 완만한 상태를 유지하고 있습니다. 내년까지 백신이 나올 것이라는 긍정적인 전망과 코비드19를 변수가 아닌 상수로 받아들이자는 분위기가 맞물리며 시장 향방을 예측하기 어려운 상태입니다. 국내 코비드19 방역 대책은 세계 최고 수준이지만 하지만 조용한 감염이 이어지고 있어 불확실성을 증폭시키고 있습니다. 하지만 글로벌 제약 업체들이 백신 개발에 총력을 다하고 있고 주요 선진국의 정책 대응 공조가 긴밀해짐에 따라 긍정적인 기대감을 키우고 있습니다. 또한 동화개미로 불리는 개인의 순매수로 인한 긍정적인 수급환경은 유지되고 있으며, 고객예탁금 역시 역사상 최고 수준을 유지하고 있습니다. 향후 시장의 방향이 상승으로 강한 모습을 보일 경우, 바스켓 통싯 전략의 헤지 포지션을 줄여 상승 모멘텀으로부터 수익을 창출할 계획입니다. 또한 주도 업종 및 종목에 관심을 두고 수익 가능한 페어 발굴하여 적극적인 포지션 진입 및 청산을 통해 수익을 추구할 계획입니다. 이벤트/IPO부분에서는 밸류에이션 및 물량 부담이 적은 종목을 중심으로 접근할 예정이며 추가적으로 향후 각종 기업 관련 이벤트를 활용한 초과 수익 기회를 모색할 계획입니다. 특히 9월부터 본격적인 IPO 일정들이 대기하고 있기 때문에 더욱 집중할 예정입니다.
--

▶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[주식혼합]_운용	3.92	0.07	1.22	1.96
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	3.69	-0.37	0.55	1.06
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	3.62	-0.50	0.36	0.80
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	3.61	-0.52	0.32	0.75
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	3.64	-0.47	0.40	0.86
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	3.52	-0.70	0.06	0.40
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	3.75	-0.25	0.74	1.31
(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[주식혼합]_운용	1.96	4.80	8.57	13.55
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	1.06	2.96	5.72	8.62
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	0.80	2.44	4.92	7.26
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	0.75	2.34	4.77	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	0.86	2.55	5.09	7.54
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	0.40	1.63	3.68	5.15
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	1.31	3.47	6.51	9.98
(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	-598	36	0	124	132	0	0	0	0	2	-3	-308
당기	676	11	0	-174	-257	0	0	0	0	0	-2	254

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	2,300	3,050		668	36	0	0	0	0	355	-43	6,367
(1.00)	(36.13)	(47.90)	(0.00)	(10.49)	(0.57)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(5.58)	-(0.67)	(100.00)
합계	2,300	3,050		668	36	0	0	0	0	355	-43	6,367

*☐: 구성비중



주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 순포지션비율

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
매수 포지션 (0.00)	2,300 (36.13)	3,050 (47.9)	0 (0)	668 (10.49)	33 (0.51)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	355 (5.58)	-39 (0.61)	6,367 (100)
매도 포지션 (0.00)	285 (100)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	285 (100)
순포지션 (0.00)	2,015 (33.14)	3,050 (50.14)	0 (0)	668 (10.98)	33 (0.53)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	355 (5.84)	-39 (0.64)	6,082 (100)

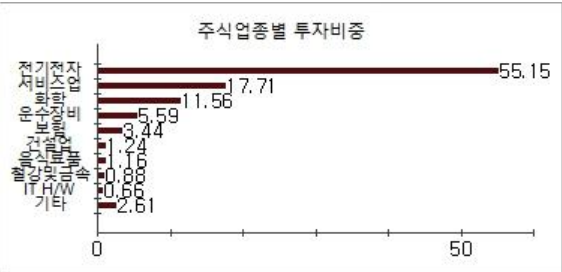
▶ 주식업종별 투자비중

주식업종별 투자비중 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 투자하고 있는 주식자산의 업종별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드가 보유한 주식 자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	55.15	6	건설업	1.24
2	서비스업	17.71	7	음식료품	1.16
3	화학	11.56	8	철강및금속	0.88
4	운수장비	5.59	9	IT H/W	0.66
5	보험	3.44	10	기타	2.61

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 차지 하는 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	채권	국고01625-2206(19-3)	28.49	6	단기상품	은대(신한은행)	5.58
2	주식	삼성전자	9.91	7	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS	4.95
3	채권	통안01810-2102-02	9.71	8	차입주식매도	삼성전자	4.47
4	채권	국고01000-2306(20-3)	9.71	9	차입주식	삼성전자	4.19
5	주식	삼성전자우	5.78	10	집합투자증권	TIGER 200선물인버스2X	4.03

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시 사이트에서 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
삼성전자	10,879	631	9.91	대한민국	KRW	전기전자	
삼성전자우	7,273	368	5.78	대한민국	KRW	전기전자	

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
국고01625-2206(19-3)	1,780	1,814	대한민국	KRW	2019-06-10	2022-06-10		N/A	28.49
통안01810-2102-02	614	618	대한민국	KRW	2019-02-02	2021-02-02		N/A	9.71
국고01000-2306(20-3)	614	618	대한민국	KRW	2020-06-10	2023-06-10		N/A	9.71

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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 단기채권PLUS	수익증권	삼성자산운용	313	315	대한민국	KRW	4.95
TIGER 200선물인버스2X	수익증권	미래에셋자산운용	361	257	대한민국	KRW	4.03

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	2014-01-27	355	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 주)	퀀트운용본부장	1969	26	6,999	1	478	2109000457
최재영 주)	채권운용본부장	1972	40	34,462	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 수사공시 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 2020.06.02 ~ 현재 이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2018.07.08 이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2020.06.01 이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2018.07.08 이 투자신탁의 최초 설정일(2013.11.15) ~ 2020.06.01	박주호(책임) 최재영(책임) 한진규(책임) 윤준수(책임) 박주호(부책임) 최재영(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)	
유리트리플알파자[주식혼합]_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)		1.95	0.03	1.80	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1.39	0.02	1.82	0.03
		조사분석업무 등	0.18	0.00	0.65	0.01
		서비스 수수료				
		합계	1.58	0.02	2.48	0.04
	증권거래세		1.58	0.02	3.77	0.06

유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	자산운용사		0.07	0.15	0.06	0.15
	판매회사		0.03	0.06	0.03	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.10	0.22	0.09	0.22
	기타비용 ^(주2)		0.01	0.02	0.01	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.02	0.01	0.03
		조사분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.01
		서비스 수수료				
		합계	0.01	0.02	0.01	0.04
	증권거래세		0.01	0.02	0.02	0.05
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	자산운용사		5.54	0.15	5.34	0.15
	판매회사		4.62	0.12	4.45	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.23	0.01	0.22	0.01
	일반사무관리회사		0.14	0.00	0.13	0.00
	보수합계		10.53	0.28	10.15	0.29
	기타비용 ^(주2)		0.94	0.03	1.01	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.68	0.02	0.99	0.03
		조사분석업무 등	0.09	0.00	0.36	0.01
		서비스 수수료				
		합계	0.77	0.02	1.35	0.04
	증권거래세		0.75	0.02	2.05	0.06
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	자산운용사		0.37	0.15	0.38	0.15
	판매회사		0.34	0.14	0.35	0.14
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.02	0.01	0.02	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.01	0.00
	보수합계		0.73	0.29	0.76	0.30
	기타비용 ^(주2)		0.06	0.03	0.07	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.05	0.02	0.07	0.03
		조사분석업무 등	0.01	0.00	0.03	0.01
		서비스 수수료				
		합계	0.05	0.02	0.10	0.04
	증권거래세		0.05	0.02	0.15	0.06
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	자산운용사		0.07	0.15	0.07	0.15
	판매회사		0.05	0.11	0.05	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.13	0.27	0.13	0.27
	기타비용 ^(주2)		0.01	0.02	0.01	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.02	0.01	0.03
		조사분석업무 등	0.00	0.00	0.00	0.01
		서비스 수수료				
		합계	0.01	0.02	0.02	0.04
	증권거래세		0.01	0.02	0.03	0.06
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	자산운용사		5.06	0.15	3.87	0.15
	판매회사		7.59	0.22	5.81	0.23
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.21	0.01	0.16	0.01
	일반사무관리회사		0.13	0.00	0.10	0.00
	보수합계		12.99	0.38	9.94	0.39
	기타비용 ^(주2)		0.94	0.03	0.70	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.63	0.02	0.71	0.03
		조사분석업무 등	0.09	0.00	0.26	0.01
		서비스 수수료				
		합계	0.72	0.02	0.97	0.04
	증권거래세		0.74	0.02	1.47	0.06
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	자산운용사		0.14	0.15	0.13	0.15
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.15	0.16	0.14	0.16
	기타비용 ^(주2)		0.02	0.02	0.02	0.03
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.02	0.02	0.02	0.03
		조사분석업무 등				
		서비스 수수료	0.00	0.00	0.01	0.01
		합계	0.02	0.02	0.03	0.04
	증권거래세		0.02	0.02	0.05	0.06

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 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.

(단위: 연환산,%)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파자[주식혼합]_운용	전기	0	0	0.3879	0.1131
	당기	0	0	0.3603	0.1262
종류(Class)별 현황					
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A-e	전기	0.8914	0	1.2263	0.1197
	당기	0.8912	0	1.2098	0.1317
유리트리플알파자[주식혼합]_C/A1	전기	1.1454	0	1.5178	0.1128
	당기	1.1454	0	1.4868	0.1265
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-P1	전기	1.1948	0	1.5561	0.1068
	당기	1.1944	0	1.5249	0.1236
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C-e	전기	1.0925	0	1.472	0.1145
	당기	1.0918	0	1.5277	0.1273
유리트리플알파자[주식혼합]_C/C1	전기	1.5465	0	1.9564	0.1143
	당기	1.5465	0	1.9314	0.1264
유리트리플알파자[주식혼합]_C/W	전기	0.6411	0	1.0325	0.1113
	당기	0.6411	0	0.9908	0.1244

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 회전율

(단위:백만원, %)

유리트리플알파모[주식혼합]

매수		매도		매매회전율 ※)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
47,195	783	39,684	2,447	53.87	213.72

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율을 나타냅니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리트리플알파모[주식혼합]

2019-11-15 ~ 2020-02-14	2020-02-15 ~ 2020-05-14	2020-05-15 ~ 2020-08-14
15.71	21.72	53.87

※ 회전율 변동 사유: 변동성 확대 국면에서 일부 페어 포지션을 수익청산 및 신규 페어 진입으로 회전율이 증가했습니다.

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.