

# 유리인덱스200주식형펀드

# 영업보고서

(기간:2001년08월01일 - 2001년10월31일)

## 1. 자본 변동내용 및 주식매매상황표

### 1) 자본 변동 현황

(단위:주,백만원)

전반기		증가		감소		금분기	
주식수	금액	주식수	금액	주식수	금액	주식수	금액
47,078,524,550	48,750	15,839,056,707	15,204	10,694,149,370	9,945	52,223,431,887	54,009

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)

금분기(A)	전반기(B)	증감(A-B)	증감률((A-B)/B)	시가(C)	할인율((A-C)/A)
947.55	959.72	-12.17	-1.27%		

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)

전반기	금분기	평균거래량(일)	
		최고	최저

##### ② 개방형의 경우

(단위:주)

전반기	신규발행	환매량	금분기	평균거래량(일)
47,078,524,550	15,839,056,707	10,694,149,370	52,223,431,887	353,776,081

## 2. 자산운용현황

### (1) 운용성과에 관한 사항

#### ① 최근 운용성과

(단위:%)

구분	10월	09월	08월	07월	06월	05월
당해펀드수익률(A)	-5.24	-15.63	-2.99	-4.03	5.12	9.11
비교지수수익률(B)	-6.11	-16.75	-4.72	-5.34	3.45	7.53
초과수익률(A-B)	0.86	1.12	1.73	1.31	1.67	1.57

주 1) 비교지수: KOSPI200:66.44 / 기준일(01.03.05):70.76

② 주요영업손익 구성현황

(단위:백만원,%)

구분		평가손익			처분손익			기타손익
		주식	채권	파생상품	주식	채권	파생상품	
금분기	금 액	2,499		5,415	-4,892		-4,193	214
	비 율	-261.31		-566.23	511.49		438.4	-22.35
누 계	금 액	87		3,275	-4,952		-3,282	347
	비 율	-1.93		-72.38	109.44		72.54	-7.67

주 1) 기타손익의 내역(누계): 수입이자:528 기타이익:5 보수:-134 기타비용:-88 수입배당금:36

(2) 투자현황에 관한 사항

① 자산구성현황

(단위:백만원,%)

구분		주식	채권	파생상품	예금	물류	기타	자산총액
금분기	금 액	2,201		6,556	94	40,404	371	49,626
	비 율	4.44		13.21	.19	81.42	.75	100
전분기	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

주 1) 기타의 내역: 미수입금:327 무형자산:31 선납원천세:13

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

(단위:백만원,%)

구분	종목명	보유주수(백만주)	시가	자산구성비
주식	삼성전자	2,880	500	0.53
	SK텔레콤	1,020	250	0.27
	한국통신공사	3,640	175	0.19
	한국전력	7,460	152	0.16
	포항제철	1,100	98	0.10
	국민은행	3,640	73	0.08
	현대차	3,320	69	0.07
	주택은행	1,880	63	0.07
	당배인상공사	2,140	39	0.04
	한미은행	4,860	38	0.04
채권				

③ 파생상품 투자현황

(단위:주,백만원)

구분	상품명	분기중 투자현황		분기말 투자현황	
		계약수	약정금액	계약수	약정금액
선물매입	2001년09월물	3,488	111,553	1,455	44,304
선물매도	2001년09월물	1,410	44,443		
콜옵션매입	콜옵션 0108 67.5외2	255	44		
콜옵션매도	콜옵션 0108 67.5외1	600	61		
풋옵션매입	풋옵션 0108 70.0외1	600	9		
풋옵션매도	풋옵션 0108 70.0외2	255	18		
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(백원)	금액(백)	주수(백원)	금액(백)
주식	삼성전자	57,500	10,494,140,000	78,220	13,962,365,000
	SK텔레콤	29,020	6,279,675,000	39,570	8,416,560,000
	한국통신공사	102,300	4,929,827,000	139,140	6,567,013,000
	한국전력	210,040	4,531,189,000	285,620	6,081,526,000
	포항제철	31,140	2,723,257,000	43,060	3,725,788,000
	현대차	93,530	1,882,579,500	128,580	2,596,252,500
	국민은행	102,340	1,897,486,500	140,500	2,504,849,500
	주택은행	53,010	1,651,763,500	72,720	2,178,094,000
	기아차	126,860	1,032,937,700	172,950	1,389,143,400
	당배인삼공사	61,510	1,014,614,000	84,150	1,367,092,000
채권					

② 주식매매회전율

(단위:백만원,%)

구분	당월	전월	분기	반기
총매수금액	3,868	22,314	57,097	84,589
총매도금액	4,858	48,034	76,244	85,072
합계	8,726	70,347	133,341	169,661
기간중주식총평잔	3,001	16,130	14,258	16,979
매매회전율	1.45	2.18	4.68	5.

주 1) 매매회전율은 일정기간중 회사가 매매한 주식의 번도에 관한 비율입니다

매매회전율 =  $\frac{\text{총매수금액} + \text{총매도금액}}{2} \div \text{기간중 주식총액 평잔}$

### 3. 요약 재무제표

1) 대차대조표 (전분기: 2001년07월31일 , 금분기: 2001년10월31일 )

(단위:백만원)

자 산	금분기	전분기	부채와 자본	금분기	전분기
1. 운용자산	49,255	42,842	부 채		
1) 예치금	94	26	1. 매수유가증권미지급금	0	0
2) 콜론	40,404	13,102	2. 정산미지급금	0	0
3) 청약증거금	0	0	3. 매도옵션	0	0
4) 주식	2,201	23,583	4. 해지미지급금	71	5
5) 채권	0	0	5. 보수미지급금	69	49
6) 파생상품	6,556	1,145	6. 기타부채	2	1
8) 기타유가증권	0	4,987	부채총계	142	55
2. 기타자산	371	2,395	자 본		
			1. 자본금	53,523	49,013
			2. 해지조정금	486	-263
			3. 차기이월이익잉여금	-4,525	-3,568
			1) 전기이월이익잉여금	0	0
			2) 당기순이익	-4,525	-3,568
			자본총계	49,484	45,182
자산총계	49,626	45,237	부채와자본 합계	49,626	45,237
주당순자산가치=(자산총액 - 부채총액) / 발행주식총수				947.55	959.72

2) 손익계산서(기간 : 2001년08월01일 ~ 2001년10월31일 )

(단위:백만원)

계정과목명	금분기	누 계
1. 투자수익	342	570
1) 이자수익	330	529
2) 배당금수익	9	36
3) 기타 투자수익	3	5
2. 매매수익	8,008	12,653
1) 주식매매이익	636	1,158
2) 채권매매이익	0	0
3) 파생상품매매이익	7,372	11,495
4) 기타매매이익	0	0
3. 매매손실	9,178	17,525
1) 주식매매손실	3,029	6,023
2) 채권매매손실	0	0
3) 파생상품매매손실	6,149	11,502
4) 기타매매손실	0	0
4. 매매차익(또는 매매차손)	-1,170	-4,872
5. 운용비용	128	222
1) 보관보수	5	9
2) 판매보수	0	0
3) 일반사무수탁보수	8	13
4) 운용보수	63	112
5) 기타 운용비용	53	88
6. 법인세 차감전 순이익	-956	-4,525

4. 투자제한사항 준수여부

\* 별첨참조

5. 감사의 확인

감사 : 송충석



기간 : 2009.08.01~10.31

「펀드명」 유리인덱스이백주식형펀드

#### ■ 법규 제한

법규 제한 사항	위반사항
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
위탁증권금 15%이내	위반사항 없음
관계증권사 월간위탁매매 20%이내	위반사항 없음

#### ■ 투자설명서 제한

주식 및 파생상품에의 투자 : 순자산총액의 90%이상	위반사항 없음
주식예의 투자 : 순자산가치의 60% 이상	09.10 이후 위반지속
현금성 자산 투자 : 순자산총액의 10%이상	위반사항 없음
자산유동화증권 투자 : 자산총액의 10%이하	위반사항 없음
주식투자 배상 : 증권거래소 상장주식	위반사항 없음