

자산운용보고서

유리Daily인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]

(운용기간 : 2021년12월13일 ~ 2022년03월12일)

○ 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)

1	공지사항
2	펀드의 개요 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 기본정보 ▶ 재산현황 ▶ 펀드의 투자전략
3	운용경과 및 수익률현황 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 운용경과 ▶ 투자환경 및 운용계획 ▶ 기간(누적) 수익률 ▶ 손익현황
4	자산현황 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 자산구성현황 ▶ 투자대상 상위 10종목 ▶ 각 자산별 보유종목 내역
5	투자운용전문인력 현황 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 투자운용인력(펀드매니저) ▶ 해외 운용 수탁회사
6	비용현황 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 업자별 보수 지급현황 ▶ 총보수비용 비율
7	투자자산매매내역 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 매매주식규모 및 회전율 ▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이
8	동일 집합투자기구에 대한 투자현황 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 투자현황
9	위험현황 및 관리방안 <ul style="list-style-type: none"> ▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험현황 ▶ 나. 주요 위험 관리방안 ▶ 다. 자전거래 현황 ▶ 라. 주요 비상대응 계획
10	자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

1. 공지 사항

- 고객님이 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
- 고객님이 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로써 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는고객님이 가입한 유리Daily인덱스증권자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
- 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리Daily인덱스증권자투자신탁(주식-파생형)의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '부국증권, 신한은행'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
- 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 : 유리자산운용(주)
금융투자협회

www.yurieasset.co.kr
http://dis.kofia.or.kr

02-2168-7900

2. 펀드의 개요

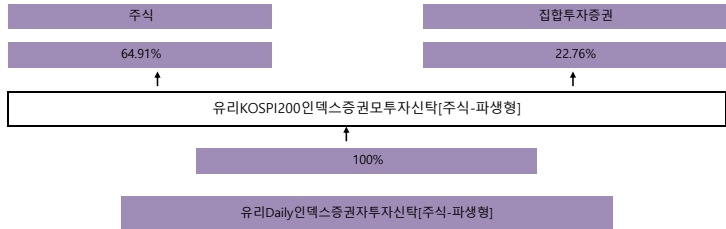
▶기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	고난도 펀드
유리Daily인덱스증권자투자신탁[주식-파생형]		2등급	70255	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(주식파생형), 개방형, 추가형, 모자형	최초설정일	2007.06.13	
운용기간	2021.12.13 ~ 2022.03.12	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음	
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	신한은행	
판매회사	부국증권, 신한은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	이 투자신탁은 ‘유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁(주식-파생형)’에 투자신탁 자산총액의 90% 이상을 투자하여 KOSPI200(목표주가지수)에 근접한 수익률을 추구하되 제한된 범위 내에서 KOSPI200 대비 초과수익을 추구하는 전략을 통해 자본이득을 추구합니다.			

▶펀드 구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을때 각 모펀드의 집합투자증권을 얼마만큼 투자하고 있는지를 보여줍니다.



▶ 재산현황

재산현황 표를 통해 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산 총액 및 기준가격의 추이를 비교할 수 있습니다.

(단위: 백만원, 백만차, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리Daily인덱스자(주식-파생형)	자산 총액(A)	1,238	1,143	-7.68
	부채총액(B)	3	2	-24.16
	순자산총액(C=A-B)	1,235	1,141	-7.64
	발행 수익증권 총 수(D)	820	832	1.54
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,506.63	1,370.43	-9.04

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.

▶ 펀드의 투자전략

투자전략
<p>이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 '유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁(주식-파생형)'에 투자하여 운용합니다.</p> <p><유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁(주식-파생형)></p> <p>장기 자본이득 등의 획득을 목적으로 투자신탁 재산의 대부분을 국내주식 및 국내주식관련 파생상품에 투자하여 이 투자신탁의 순자산가치의 변동률이 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 변동률과 유사하도록 운용하되 제한된 범위 내에서 한국종합주가지수200 (KOSPI200) 대비 초과수익을 추구합니다.</p> <p>○ 기본투자방침</p> <ul style="list-style-type: none">이 투자신탁의 비교지수인 한국종합주가지수200(KOSPI200)의 변동률에 근접한 성과의 달성을 위해 한국종합주가지수200(KOSPI200)을 구성하고 있는 종목과 관련 장내파생상품에 주로 투자합니다. 다만, 추적오차의 최소화 등을 위하여 필요하다고 판단하는 경우 KOSPI200 구성 종목 이외의 종목에도 투자할 수 있습니다. <p>○ 지수추종전략</p> <ul style="list-style-type: none">이 집합투자지구는 부분복제기법을 이용하여 비교지수의 성과를 추적하는 방식으로 운용됩니다. 부분복제기법이란 추적오차를 감안하여 비교지수 구성종목의 일부를 추출하고, 추출된 종목을 대상으로 투자비중을 결정하여 포트폴리오를 구성하는 지수추종기법을 의미합니다.시장상황의 변화에 따른 종목별 구성비중 등을 고려하여 정기적으로 포트폴리오를 재조정합니다. <p>○ 초과수익추구전략</p> <ul style="list-style-type: none">이 투자신탁은 시장 상황에 따라 포트폴리오를 일정 수준 비교지수와 다르게 구성하여 초과수익을 추구할 수 있으며, 또한 초과 수익 달성을 위해 스왑거래, 이벤트를 활용한 종목별 매매, 스프레드 매매 및 장단기 시장흐름에 따른 비중조정 등 다양한 초과수익 추구 전략으로 운용할 수 있습니다 <p>○ 추적오차관리전략</p> <ul style="list-style-type: none">비교지수의 특성을 고려하여 추적오차를 가급적 줄일 수 있도록 포트폴리오를 구성합니다.추적오차가 주어진 허용범위(1일 기준 0.5%)를 초과하는 경우 원인 분석 후 수시로 포트폴리오를 재조정 합니다. <p>○ 현금성자산 운용전략</p> <ul style="list-style-type: none">주식 및 파생상품에 투자하고 남은 자산은 원활한 환매대응과 투자자금의 안정성 확보를 위하여 금융기관에의 예치 또는 자금중개회사를 통하여 자금중개거래를 할 수 있는 금융기관에 4영업일 이내의 클레어를 통하여 운용합니다.

위험관리

운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 등에서 결정합니다.

이 투자신탁은 일정한 기준에 따라 선정된 여러 주식의 추가수준을 종합한 지수인 비교지수의 성과에 근접한 성과를 추구하는 것을 목표로 하므로 추가 수준 하락에 대한 별도의 위험관리 전략을 구사하지 않습니다. 따라서 추가 수준의 전반적인 하락 시에는 이 투자신탁의 가치 역시 비교지수의 하락에 그대로 노출 된다는 점에 유의하여야 합니다.

수익구조
<p>이 투자신탁은 이투자신탁의 모투자신탁인 “유리KOSPI200인덱스증권모투자신탁(주식·파생형)” 수익증권에 대부분을 투자하므로 이러한 모투자신탁의 수익구조는 모투자신탁의 투자비용만큼 당해 투자신탁에 영향을 주게 됩니다.</p> <p><모투자신탁의 수익구조></p> <ul style="list-style-type: none"> - 이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 국내주식 및 국내주식관련파생상품에 투자하는 집합투자기구로서 투자대상 주식 시세의 등락 및 배당으로부터 절대적인 영향을 받습니다. 그 밖에 주식에 투자하고 남은 자산에서 발생하는 이자수입 및 평가손익 등이 이 투자신탁의 성과에 영향을 미치게 됩니다. - 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 발생기업의 경영성과가 우수할수록, 투자대상 주식에 대한 수요가 공급보다 클수록 주식의 시세는 상승하는 경향을 나타내어 투자신탁의 가치는 상승하고, 반대의 경우에는 투자신탁의 가치가 하락하는 것이 일반적입니다. - 이 투자신탁의 성과는 비교지수의 성과와 비교지수 대비 추적오차에 의해 결정됩니다. 이 투자신탁의 성과는 일반적으로 ‘비교지수 대비 추적오차’ 보다는 ‘비교지수의 성과’로부터 월등히 높은 수준의 영향을 받게 됩니다. - 이 투자신탁은 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. - 이 투자신탁의 성과는 자본이득, 배당수입, 이자수입으로 구분할 수 있으며 일반적으로 자본이득이 성과에 미치는 영향이 절대적인 비중을 차지합니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

<p>글로벌 증시는 12월에는 미 보건당국의 오미크론 우려 완화 발언, 미 식품의약국(이하 FDA)의 오미크론 특화백신 승인 간소화 논의, 기술주 위주의 저가 매수세 유입 및 공급망 차질과 인플레이션 관련 우려 완화 등에 힘입어 상승세로 마감하였습니다. 22년 1월에는 월초 경기회복 기대감으로 인한 저가 매수세 유입 등에 힘입어 상승하여 출발하였으나, 미 중앙은행(Fed)의 긴축속도 가속화 우려, 오미크론 변이 확산에 따른 소비감소 우려 등의 영향으로 하락세로 전환하였습니다. 월 중반 이후 미 통화정책회의(FOMC) 경계감 지속, 고용지표 부진으로 인한 경기둔화 우려, 대형 기술주의 추가부진, 우크라이나 사태 관련 미-러시아간 갈등 고조 등의 영향으로 하락세를 확대하였으나, 월말 들어 저가 매수세 유입, 대형 기술주 실적 기대감 및 미 국제금리 하락반전 등의 긍정적인 이슈들에 힘입어 낙폭을 소폭 되돌리며 마감하였습니다. 2월에는 월초 주요 기업들의 호실적 기대감, 미 국제금리 하락 등에 힘입어 상승하여 출발하였으나, 메타플랫폼의 실적부진으로 인한 기술주 중심 추가약세, 미 소비자물가지수(CPI) 지표의 추가상승에 따른 시장금리 상승압력 확대 및 러시아의 우크라이나 침공 가능성 부각 등의 영향으로 하락세로 전환하였습니다. 월 중반 경제재개(리오프닝) 관련 업종 강세 등의 긍정적인 요인에도 불구하고 러시아의 우크라이나 침공 현실화, 3월 미 중앙은행(이하 연준)의 금리인상 가능성에 따른 시장금리 추가상승 등의 영향으로 하락세를 확대하였으나, 월말 들어 저가 매수세 유입, 미국의 러시아 제재 발표 및 러시아-우크라이나 간 중전협상 추진 등의 긍정적인 이슈들에 힘입어 낙폭을 소폭 회복하며 마감하였습니다. 3월에는 월초 우크라이나 지정학적 불안감 지속, 미국/유럽의 대러 제재 강화 등의 영향으로 하락하여 출발한 가운데, 미 연방준비위원회(이하 연준)의 긴축 부담 완화, 국제유가 하락전환 등의 긍정적인 영향에도 불구하고 러시아-우크라이나 전쟁 장기화, 천연가스 등의 원자재 가격 급등 불안감 및 물가상승(인플레이션) 지속 부담 등의 영향으로 하락세를 지속하였습니다.</p> <p>국내 증시는 12월에는 반도체 가격 상승에 따른 업황회복 기대감, 중국 인민은행의 지급준비를 인하 소식, 오미크론에 대한 화이자 부스닥샷의 효과 확인 소식 등의 긍정적인 요인으로 인해 상승폭을 확대하며 마감하였습니다. 22년 1월에는 실적 개선 기대감, 외국인의 순매수 전환 등에 힘입어 상승하여 출발하였으나, 미 중앙은행(Fed)의 긴축속도 가속화 우려, 원-달러환율 상승, 국내의 오미크론 변이 확산세 확대 및 국내 1월 금융통화위원회의 기준금리 인상과 추가 금리인상 예고 등의 영향으로 하락세로 전환하였습니다. 월 중반 이후 1)글로벌 긴축기조 경계감, 2)글로벌 경기둔화 우려, 3)미 대형 기술주의 추가부진, 4)유가 상승으로 인한 인플레이션(물가상승) 압력 가중, 5)러시아-우크라이나간 군사충돌 우려, 6)대형 IPO인 LG 에너지솔루션 상장으로 인한 수급공백 등의 영향으로 하락세를 확대하였으나, 월말 들어 LG에너지솔루션 상장 이슈중료로 인한 수급공백 완화, 대형주 중심의 저가 매수세 유입 등의 긍정적인 이슈들에 힘입어 낙폭을 소폭 축소하며 마감하였습니다. 2월에는 월초 설 연휴 휴장기간 중 글로벌 증시의 상승세 등에 힘입어 상승하여 출발하였으나, 반도체/리오프닝 관련주 강세, 금융주 호실적 발표 등의 긍정적인 요인에도 불구하고 러시아의 우크라이나 침공 긴장감 고조, 미국의 긴축 압박 및 원-달러환율 상승 부담 등의 영향으로 하락세로 전환하였습니다. 월 중반 한 때 미-러시아간 장관급 회담 추진에 따른 지정학적 리스크 완화 기대, 중국의 물가 안정세 등에 힘입어 소폭 회복세를 나타내기도 하였으나, 러시아의 우크라이나 침공 현실화, 미 연준의 금리인상 가능성에 따른 시장금리 추가상승의 영향으로 재차 하락세로 전환하였습니다. 월말 들어 저가 매수세 유입, 러시아-우크라이나 간 중전협상 기대감 등에 힘입어 반등이 나타나며 소폭 상승세로 마감하였습니다. 3월에는 월초 우크라이나 지정학적 불안감 지속 등의 영향으로 보합권 수준에서 출발한 가운데, 미 연준의 긴축부담 완화, 국제유가 하락전환 등의 긍정적인 요인에도 불구하고 우크라이나 원자력발전소 화재로 인한 지정학적 리스크 지속, 천연가스 등의 원자재 가격 급등 불안감, 원-달러환율 추가상승에 따른 외국인의 순매도 확대 및 물가상승(인플레이션) 지속 부담 등의 영향으로 하락세를 지속하였습니다.</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

<p>다음 분기는 대외적으로 1)국내외 코로나19 신규 확진자 수 추이, 2)미 고용지표, 소비자물가지수의 발표내용, 3)미 연준의 3월 FOMC 의사록 내용, 4)사회복지 법안 관련 미 정치 이슈, 5)러시아-우크라이나간 전쟁 진행양상, 6)미 국제금리 변화, 7)국내외 주요 기업들의 1분기 실적 결과, 8)미국/중국/유럽 등 주요국의 증시 흐름, 9)주요국의 경제지표 결과, 10)국제유가/환율의 움직임, 11)국내 사회적 거리두기 정책과 내수경기 변화, 12)국내 주요 경제지표 결과 및 13)연기금과 외국인의 수급변화 등의 주요 이슈에 주목하면서, 안정적인 포트폴리오 관리에 최선을 다할 계획입니다.</p> <p>동 펀드는 주요 재무지표를 기준으로 중목의 투자비중을 결정하는 KOSPI200지수의 수익률을 추종합니다.</p> <p>200여개에 넘는 대중소형 종목에 투자하여 국내 증시에 대한 폭넓은 분산투자 효과를 기대할 수 있습니다. 단기적이고 적극적인 초과수익 추구보다, 장기적이고 안정적인 수익을 위해 노력하겠습니다.</p>

▶ 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	
유리Daily인덱스자[주식·파생형]	-9.04	-11.36	-15.83	-11.65	
(비교지수 대비 성과)	(1.68)	(1.70)	(2.07)	(2.97)	
비교지수(벤치마크)	-10.72	-13.06	-17.90	-14.62	

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	
유리Daily인덱스자[주식·파생형]	-11.65	51.71	36.79	42.49	
(비교지수 대비 성과)	(2.97)	(8.22)	(8.86)	(12.00)	
비교지수(벤치마크)	-14.62	43.49	27.93	30.49	

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.

(단위 : %)				
구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년	
유리Daily인덱스자[주식·파생형]	4.27	3.10	2.54	

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

(단위:백만원)												
구분	주식	채권	여음	집합투자	파생상품	부동산		특별자산		단기대출 및	기타	손익합계
					장내	장외		실물자산	기타	예금		
전기	-15	0	0	-9	-3	0	0	0	0	0	-2	-28
당기	-69	0	0	-29	-15	0	0	0	0	0	-2	-115

4. 자산현황

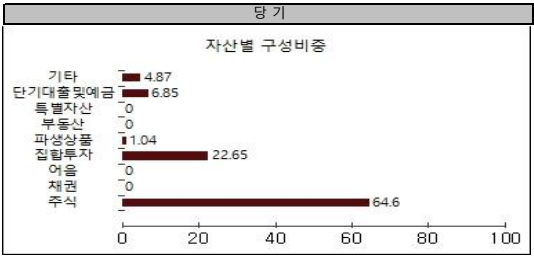
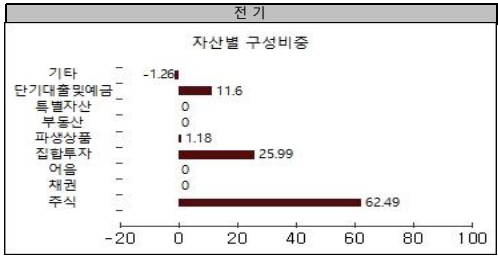
아래 표시된 자산구성 현황은 고객님이 가입한 펀드가 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안전한 결과를 보여주고 있습니다.

▶ 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 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위:백만원,%)												
통화별 구분	증권			파생상품	부동산		특별자산		단기대출 및	기타	자산총액	
	주식	채권	여음	집합투자	장내	장외	실물자산	기타	예금			
KRW	738	0		259	12	0	0	0	78	56	1,143	
(1.00)	(64.60)	(0.00)	(0.00)	(22.65)	(1.04)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(6.85)	(4.87)	(100.00)	
합계	738	0		259	12	0	0	0	78	56	1,143	

***(U)**: 구성비중



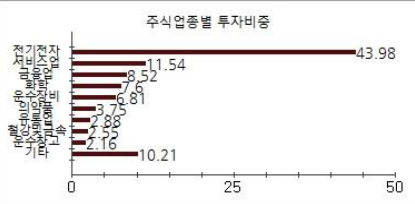
주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ 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	43.98	6	의약품	3.75
2	서비스업	11.54	7	유통업	2.88
3	금융업	8.52	8	철강및금속	2.55
4	화학	7.60	9	운수창고	2.16
5	운수장비	6.81	10	기타	10.21

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 종목들을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드의 자산총액에서 해당 종목이 차지하는 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	집합투자증권	TREX 200	20.56	6	주식	NAVER	2.49
2	주식	삼성전자	18.75	7	주식	LG에너지솔루션	2.14
3	기타	REPO매수(20220311)	8.20	8	집합투자증권	KODEX 레버리지	2.09
4	단기상품	본대(국민은행)	6.55	9	주식	카카오	1.81
5	주식	SK하이닉스	3.72	10	주식	삼성SDI	1.40

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기경영보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기경영보고서 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 확인할 수 있습니다.

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	3,060	214	18.75	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	363	43	3.72	대한민국	KRW	전기전자	
NAVER	86	28	2.49	대한민국	KRW	서비스업	
LG에너지솔루션	62	24	2.14	대한민국	KRW	전기전자	
카카오	203	21	1.81	대한민국	KRW	서비스업	
삼성SDI	33	16	1.4	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	주익증권	유리자산운용	251	235	대한민국	KRW	20.56
KODEX 레버리지	주익증권	삼성자산운용	26	24	대한민국	KRW	2.09

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	국민은행	2012-11-19	75	0.92		대한민국	KRW

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

▶ 기타

(단위 : 백만원)

종류	평가금액	비고
REPO매도	94	

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
박주호*	퀀트운용본부장	1969	24	3,343	0	0	2109000457

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 선정 할 때 해당 운용팀에서 운용중인 전체 집합투자기구를 대상으로 하며 모하형 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	박주호

▶ 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.

(단위: 백만원, %)					
	구분	전기		당기	
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}
유리Daily인덱스자[주식·파생형]	자산운용사	1.33	0.11	1.30	0.11
	판매회사	0.92	0.07	0.90	0.07
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.11	0.01	0.11	0.01
	일반사무관리회사	0.05	0.00	0.05	0.00
	보수합계	2.40	0.20	2.36	0.19
	기타비용 ^{주2)}	0.03	0.00	0.04	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.07	0.01	0.28
		조사분석업무 등			0.0477
		서비스 수수료			0.01
		합계	0.15	0.01	0.35
	증권거래세	0.31	0.03	0.02	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율
** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적, 반복적으로 지출된 비용으로서 매매, 중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 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,%)					
유리Daily인덱스자[주식·파생형]	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
	전기	0.7844	0	0.7934	0.0477
	당기	0.7844	0	0.7953	0.1149

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.
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 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위:백만원, %)					
유리KOSPI200인덱스모[주식·파생형]					
매수		매도		매매회전율 ^{주1)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
29,105	1,736	2,137	78	1.24	5.01

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

유리KOSPI200인덱스모[주식·파생형]			(단위: %)
2021-06-13 ~ 2021-09-12		2021-09-13 ~ 2021-12-12	2021-12-13 ~ 2022-03-12
42.78		17.85	1.24

※ 회전을 변동 사유 : 리밸런싱 및 벤치마크(KOSPI200지수) 정기변경 등의 이벤트 부재로 인해 회전율이 하락하였습니다.

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
유리TREX200증권장기지투자신탁[주식]	250,000	6,331	2.50

9. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등
주식가격 변동위험: 이 투자신탁은 신탁재산의 대부분을 주식에 투자하므로, 이 투자신탁의 성과는 경제·사회·자연현상 등의 영향을 받아 가격이 항상 급격히 변화하여 높은 위험을 지니는 투자대상인 주식의 시세 변화에 그대로 노출됩니다. 비체계적 위험: 이 투자신탁의 고유한 운용전략 및 목표의 특성과 운용역의 재량에 의해 이 투자신탁의 포트폴리오는 시장 포트폴리오(비교지수의 포트폴리오)와 일부 상이하게 구성됩니다. 이로 인해 이 투자신탁은 시장의 평균적인 위험 외에 포트폴리오의 특성으로 인한 위험, 즉 비체계적인 위험을 추가로 수반하며 이는 시장평균(비교지수) 성과에 미달하는 성과를 유발할 수 있습니다. 유동성 위험: 투자신탁재산으로 보유하고 있는 종목이 유동주식수 부족, 기업의 횡령, 배임, 분식회계 및 적자 지속 등에 따른 거래정지, 상장폐지 등의 사유로 거래가 시장에서 충분하게 이루어 지지 않을 경우 현금성에 제약이 발생할 수 있으며, 이는 투자신탁재산의 가치하락을 초래하여 손실을 유발합니다. ※ 기재된 내용 이외 추가적인 위험이 발생할 수 있습니다. 본 자료에 고지되지 않은 보다 자세한 사항은 투자설명서를 참고하여 주시기 바랍니다.

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

대량의 펀드 환매 시 발생 가능한 환매 중단, 상환 연기 등 현금성 제약의 위험이 있을 수 있습니다.

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등
법규, 약관 및 규약의 범위 내 유동성 및 포지션 관리, 보유 종목에 대한 재무적 리스크 점검 및 재무, 영업활동 및 신용관련 이슈발생 종목의 사후 관리 등을 통해 신용위험, 유동성 위험 등을 최소화하기 위해 노력하고 있습니다.

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등
해당사항 없습니다.

3. 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등
법규, 약관 및 규약이 정하는 바에 따라 환매연기 사유의 전부 또는 일부가 해소된 경우 수익자에 대해 환매재개의 뜻을 통지하고 환매대금을 지급하는 절차를 진행할 수 있습니다.

▶ 다. 자전거래 현황

1. 자전거래규모			
최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
0	0	0	0

2. 최근 1년간 자전거래 발생 시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차 등
해당사항 없습니다.

▶ 라. 주요 비상대응계획

- 대량 환매를 야기하거나 재해-전염병 등으로 인하여 업무 연속성을 확보하기 곤란한 위기상황 발생 시 회사의 '위험관리기준'내 마련된 'CONTINGENCY PLAN 운용지침'에 따라 위기상황별 세부 운영계획을 마련하여 대응합니다.
- 주의 단계
발생 Event에 대한 자본시장 영향 분석, 운용전략의 조정
- 위기 단계
위험관리위원회 의결(집합투자기구별(또는 유형별) 운용전략 제한, 유동성 확보계획 등 수립), 위기상황 보고체계 가동
- 위급 단계
비상대책반 구성하여 위기 상황별 구체적 실행계획의 수립 및 시행, 위험관리위원회 및 집합투자재산평가위원회 결의, 한국금융투자협회 및 금융감독원 등 감독기관과의 대응책 모색
- 부실자산 발생 시 '집합투자재산평가기준'에 따라 집합투자재산평가위원회를 소집하여 관련 규정과 절차에 따라 부실자산 평가방안 등을 결정하여 신탁재산 손실의 최소화를 추구합니다.
- 부실자산에 대해서는 기본적으로 위험관리위원회의 결정에 따라 관리하며 필요시 Task-Force team을 구성하여 운영할 수 있습니다.

10. 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.