

자산운용보고서

유리 피가로스마트인덱스 증권투자신탁 [주식]

운용기간 : 2011년 8월 5일 ~ 2011년 11월 4일

자산운용보고서는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률'(자본시장법)에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

유리자산운용(주)

서울시 영등포구 여의도동 34-2 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 비용현황

- ▶ 업자별 보수 지급현황
- ▶ 총보수비용 비율

6 투자자산매매내역

- ▶ 매매주식규모 및 회전율
- ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

1. 공지 사항

1. 고객님의 가입하신 펀드는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률'(현행법률)의 적용을 받습니다.

2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유틸피가로스마트인덱스증권투자신탁[주식]운용의 자산운용회사인 '유틸자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '기업은행'의 확인을 받아 판매회사인 '하나대투증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

3. 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 : 유리자산운용(주) www.yurieasset.co.kr / 02-2168-7900
 금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

2. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

| 펀드 명칭 | | 투자위험등급 | 금융투자협회 펀드코드 |
|---|---|----------|-----------------------|
| 유리피가로스마트인덱스증권투자신탁[주식]운용 유리피가로스마트인덱스증권투자신탁[주식]C-e | | 2등급 | 86687, 86688 |
| 펀드의 종류 | 주식형, 추가형, 종류형 | 최초설정일 | 2008.08.05 |
| 운용기간 | 2011.08.05 ~ 2011.11.04 | 존속기간 | 추가형으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 자산운용회사 | 유리자산운용(주) | 펀드재산보관회사 | 기업은행 |
| 판매회사 | 하나대투증권 | 일반사무관리회사 | 외환펀드서비스 |
| 상품의 특징 | <p>1. 투자대상 장기 자본이득 등의 획득을 목적으로 펀드 재산의 대부분을 국내 주식에 투자하여 이 펀드의 순자산가치의 변동률을 “스마트인덱스”의 변동률과 유사하도록 운용하되 제한된 범위 내에서 “스마트인덱스”대비 초과수익을 추구합니다. 그러나 이 펀드의 성과가 목적인 바 대로 달성된다는 보장은 없으며, 자산운용회사, 판매회사, 신탁업자 등 이 펀드와 관련된 어떠한 당사자도 수익자에 대한 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다. “스마트인덱스”는 시가총액이 아닌 주요 재무지표를 가중하는 내재가치가중방식의 주가지수구성기법인 스마트인덱스(펀더멘털인덱스) 방식에 의해 산출되는 주가지수입니다. 이러한 스마트인덱스(펀더멘털인덱스) 방식의 주가지수가 기존의 시가총액방식 주가지수에 비해 열등한 성과를 나타낼 경우 이 펀드의 성과가 일반적인 주가 수준의 변동률에 미달하게 된다는 점에 유의하시기 바랍니다. 이 펀드의 비교지수인 “스마트인덱스”의 변동률에 근접한 성과의 달성을 위해 “스마트인덱스”를 구성하고 있는 구성하고 있는 주식 종목에 주로 투자하되 관련 장내파생상품에도 신탁재산의 일부를 투자할 수 있습니다. 다만, 추적오차의 최소화 등을 위하여 필요하다고 판단하는 경우 “스마트인덱스” 구성 종목 이외의 종목에도 투자할 수 있습니다.</p> <p>2. 투자전략 [지수추종전략] 이 펀드는 부분복제기법을 적용하여 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 재조정을 기본으로 하여 시장상황에 따라 포트폴리오를 재조정합니다. [초과수익 추구 전략] - 시장상황에 따라 포트폴리오를 일정 수준 비교지수와 다르게 구성하여 초과수익을 추구합니다. - 기업의 인수, 합병, 실적 모멘텀 등 이벤트를 활용한 종목별 대응으로 초과수익을 추구합니다. - 주식 및 파생상품간 스왑 거래 및 파생상품간의 스왑거래를 활용하여 초과수익을 추구합니다. - 스프레드 매매 및 장단기 시장흐름에 따른 비중조절을 통해 초과수익을 추구합니다. [추적오차 관리 전략] 비교지수의 특성을 고려하여 추적오차를 가급적 줄일 수 있도록 포트폴리오를 구성합니다. 추적오차가 주어진 허용범위(1일 기준 $\pm 0.5\%$)를 초과하는 경우 원인 분석 후 수시로 포트폴리오를 재조정 합니다. [현금성 자산 운용전략] 주식 및 파생상품에 투자하고 남은 자산은 원활한 환매대응과 투자자금의 안정성 확보를 위하여 금융기관에의 예치 또는 자금증개회사를 통하여 자금증개거래를 할 수 있는 금융기관에 4영업일 이내의 콜거래를 통하여 운용합니다.</p> <p>3. 위험관리 운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 리스크관리위원회 등에서 결정하며, 일상적인 업무처리는 당사 내부의 운용업무실에 정해진 표준업무처리절차를 따르도록 함으로써 불필요한 리스크 발생을 줄일 수 있도록 합니다. 이 펀드는 일정한 기준에 따라 선정된 여러 주식의 주가수준을 종합한 지수인 비교지수의 성과에 근접한 성과를 추구하는 것을 목표로 하므로 주가 수준 하락에 대한 별도의 위험관리 전략을 구사하지 않습니다. 따라서 주가 수준의 전반적인 하락 시에는 이 펀드의 가치 역시 비교지수의 하락에 그대로 노출 된다는 점에 유의하셔야 합니다. 이 펀드는 “스마트인덱스”의 성과에 근접한 수준의 수익률을 달성할 것으로 예상되지만 시장상황, 운용여건 등의 다양한 사유로 인하여 비교지수인 “스마트인덱스”의 수익률과 이 펀드의 성과 간의 차이, 즉 추적오차가 발생할 수 있습니다. 이러한 추적오차는 이 펀드와 같이 지수추종을 목적으로 하는 펀드의 위험요소가 됩니다. 자산운용사는 추적오차를 최소화하기 위하여 포트폴리오 재조정 등의 다양한 보완방안을 실행할 예정이나, 추적오차 발생 가능성을 완전히 배제할 수 없다는 점에 유의하셔야 합니다.</p> | | |

| | |
|--------|---|
| 상품의 특징 | <p>4. 수익구조</p> <p>이 펀드는 신탁재산의 대부분을 주식에 주로 투자하는 펀드로서 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.</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 펀드의 가치는 상승하고, 반대의 경우에는 펀드의 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 "스마트인덱스"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>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 |
|------------------------|---------------------------------|----------|--------|--------|
| 유리피가로스마트인덱스 [주식]운용 | 자산 총액 (A) | 17,377 | 19,656 | 13.11 |
| | 부채 총액 (B) | 330 | 160 | -51.31 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 17,048 | 19,495 | 14.36 |
| | 발행 수익증권 총 수 (D) | 11,736 | 20,561 | 75.20 |
| | 기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000) | 1,452.63 | 948.16 | -5.18 |
| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
| 유리피가로스마트인덱스 [주식]C-e | 기준가격 | 1,131.49 | 948.01 | -5.20 |

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

유럽 재정위기가 발목을 잡으면서 여전히 펀더멘탈 효과보다는 매크로 이슈가 시장을 움직였습니다. 특히 대형주 위주로 하락세를 보였고, 경기방어주를 제외한 대부분 종목들이 하락세를 보였습니다. 한 때 유럽의 해결 의지가 시장에 반영되면서 코스피 지수는 11월말 1,800선을 회복하기도 하였습니다.

12월 증시는 연말에 기대되는 윈도우 드레싱, 배당이벤트, 그리고 산타 랠리와 같은 소비모멘텀 등이 투자심리 회복에 기여할 것으로 보입니다. 그러나 최근 유럽의 해결 의지는 긍정적이지만 여전히 유로존의 불확실성이 해소되지 못한 상황은 위험요인입니다. 또한 삼성전자를 제외한 기업이익 모멘텀은 여전히 약하다는 판단이며 이익추정치 하향 조정은 당분간 지속될 것으로 보입니다. 따라서 12월 코스피 지수는 일부 긍정적인 요인보다는 매크로 불확실성과 약한 이익모멘텀으로 인하여 상승여력이 제한된 좁은 박스권 움직임을 보일 것으로 판단합니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

지난 3개월간 -5.18%의 수익률을 기록하며 벤치마크 성과를 소폭 웃돌았습니다. 미국 신용 등급 이슈와 유로존 재정위기 등 매크로 이슈로 인해 시장이 충격을 받으면서 펀더멘탈 효과가 제대로 발휘되기 힘든 환경이 이어졌습니다. 특히 퀀트 펀드들이 시장 수익률과 큰 괴리를 보여 부진한 모습을 이어갔으며 성장주 및 모멘텀 주식이 초과 성과를 보이고 있어 가치주 관련 주식은 다소 부진한 모습을 보였습니다.

펀드는 KOSPI 및 KOSDAQ의 대/중/소형주 전 영역을 대상으로 주요 재무지표를 기준으로 종목투자비중을 결정하는 스마트 인덱스(펀더멘탈 인덱스) 포트폴리오를 구성합니다. 스마트 인덱스 포트폴리오 구성에 있어서는 국내 전문 인덱스 공급자 FnGuide와의 인덱스 라이선스 계약에 기반하여 비교 지수를 추종합니다.

제한적인 범위 내에서 계량 모델에 근거한 페어트레이딩(pair trading) 및 보통주/우선주간 교체 매매를 통해 추가적인 초과수익을 추구하며 투자신탁의 유동성을 유지하기 위해 주가지수선물 및 옵션에 약 5% 수준을 투자할 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 |
|-----------------------|--------|---------|--------|---------|
| 유리피가로스마트인덱스 [주식]운용 | -5.18 | -12.96 | -9.34 | -1.18 |
| (비교지수 대비 성과) | (0.18) | (-0.46) | (0.11) | (1.36) |
| 비교지수(벤치마크) | -5.37 | -12.50 | -9.45 | -2.54 |

주) 비교지수(벤치마크) : FN_Smart Index 100.0%

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

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|-----------------------|--------|--------|--------|-------|
| 유리피카로스마트인덱스 [주식]운용 | -1.18 | 23.93 | 83.36 | - |
| (비교지수 대비 성과) | (1.36) | (4.62) | (7.35) | - |
| 비교지수(벤치마크) | -2.54 | 19.31 | 76.00 | - |

주) 비교지수(벤치마크) : FN_Smart Index 100.0%

※ 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 |
|------|--------|--------|-------|
| 추적오차 | 1.27 | 1.01 | 1.47 |

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)

| 구 분 | 증 권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|-----|----------|-----|-----|-------|--------|-----|-----|------|-----|--------------|-----|----------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 전 기 | -1,270.6 | 0.0 | 0.0 | -30.4 | -118.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 9.7 | 1.0 | -1,408.3 |
| 당 기 | -706.1 | 0.0 | 0.0 | 30.6 | -17.3 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 13.0 | 5.6 | -674.1 |

4. 자산현황

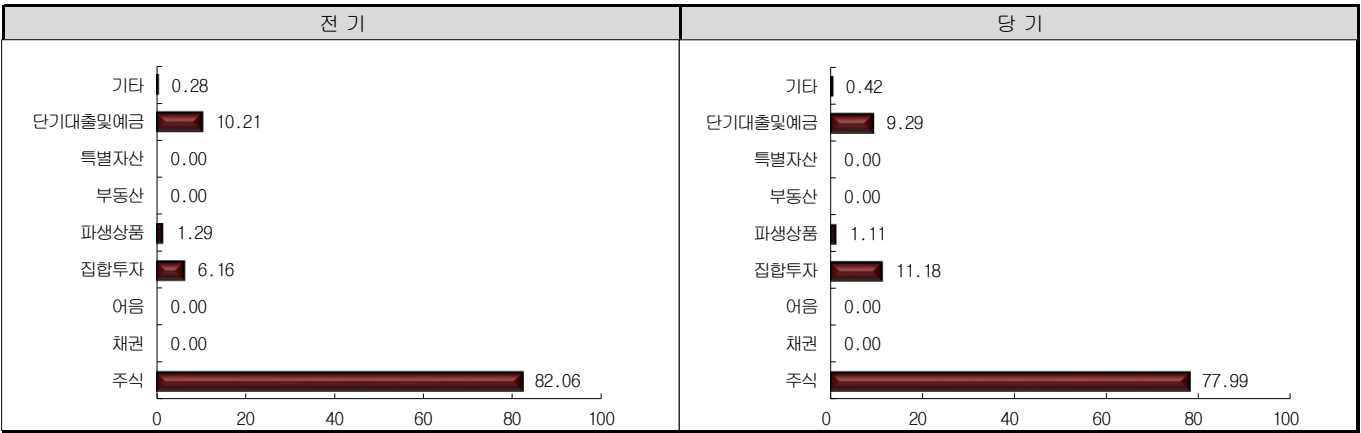
▶자산구성현황

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 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 백만원,%)

| 통화별 구 분 | 증 권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|------------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------------|--------|----------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| KRW | 15,330 | 0 | 0 | 2,198 | 219 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1,826 | 83 | 19,656 |
| (0.00) | (77.99) | (0.00) | (0.00) | (11.18) | (1.11) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (9.29) | (0.42) | (100.00) |
| 합 계 | 15,330 | 0 | 0 | 2,198 | 219 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1,826 | 83 | 19,656 |

* () : 구성 비중



▶주식업종별 투자비중

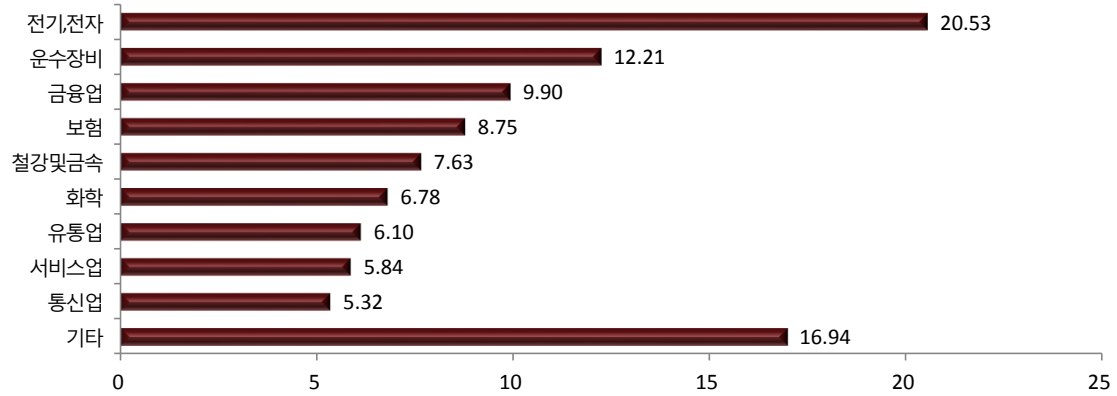
주식업종별 투자비중 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 투자하고 있는 주식자산의 업종별 구성 현황을 확인할 수 있습니다. 각 비중은 펀드가 보유한 주식자산 내에서의 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

| | 종목명 | 비중 | | 종목명 | 비중 |
|---|-------|-------|----|------|-------|
| 1 | 전기,전자 | 20.53 | 6 | 화학 | 6.78 |
| 2 | 운수장비 | 12.21 | 7 | 유통업 | 6.10 |
| 3 | 금융업 | 9.90 | 8 | 서비스업 | 5.84 |
| 4 | 보험 | 8.75 | 9 | 통신업 | 5.32 |
| 5 | 철강및금속 | 7.63 | 10 | 기타 | 16.94 |

주) 주식종목의 업종 구분은, 국내 주식은 한국거래소의 업종분류기준, 해외 주식은 GICS(국제산업분류기준) 2차 분류를 따릅니다.

주식업종별 투자비중



▶ 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 : %)

| | 구분 | 종목명 | 비중 | | 구분 | 종목명 | 비중 |
|---|--------|----------------|-------|----|--------|------------|------|
| 1 | 주식 | 삼성전자 | 10.49 | 6 | 주식 | 현대차 | 3.97 |
| 2 | 단기상품 | 콜론(교보증권) | 9.16 | 7 | 집합투자증권 | TREX 중소형가치 | 2.56 |
| 3 | 파생상품 | KOSPI200선물1112 | 8.99 | 8 | 주식 | KT | 2.45 |
| 4 | 집합투자증권 | TREX 펀더멘탈 200 | 7.29 | 9 | 주식 | 신한지주 | 2.26 |
| 5 | 주식 | POSCO | 4.16 | 10 | 주식 | 삼성생명 | 2.05 |

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 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 | 2,052 | 2,062 | 10.49 | 대한민국 | KRW | 전기,전자 | |
| POSCO | 2,160 | 818 | 4.16 | 대한민국 | KRW | 철강및금속 | |
| 현대차 | 3,276 | 779 | 3.97 | 대한민국 | KRW | 운수장비 | |
| KT | 12,960 | 480 | 2.45 | 대한민국 | KRW | 통신업 | |
| 신한지주 | 10,200 | 443 | 2.26 | 대한민국 | KRW | 금융업 | |
| 삼성생명 | 4,622 | 402 | 2.05 | 대한민국 | KRW | 보험 | |

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 펀더멘탈 200 | 수익증권 | 유리자산운용 | 1,351 | 1,432 | 대한민국 | KRW | 7.29 |
| TREX 중소형가치 | 수익증권 | 유리자산운용 | 524 | 502 | 대한민국 | KRW | 2.56 |

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

| 종목 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 비고 |
|-----------------|-------|-----|---------|----|
| 코스피200 F 201112 | 매수 | 14 | 1,767 | |

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

| 종류 | 금융기관 | 취득일자 | 금액 | 금리 | 만기일 | 발행국가 | 통화 |
|------|------|------------|-------|------|------------|------|-----|
| 단기대출 | 교보증권 | 2011-11-04 | 1,800 | 3.30 | 2011-11-07 | 대한민국 | KRW |

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

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

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, %)

| | 구 분 | 전기 | | 당기 | |
|--------------------|----------------|------|------|------|------|
| | | 금액 | 비율 | 금액 | 비율 |
| 유리피가로스마트인덱스[주식]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** | 1.28 | 0.01 | 1.32 | 0.01 |
| | 매매·중개수수료 | 4.11 | 0.02 | 8.11 | 0.05 |
| 유리피가로스마트인덱스[주식]C-e | 자산운용사 | 1.06 | 0.01 | 1.08 | 0.01 |
| | 판매회사 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0.85 | 0.01 | 0.87 | 0.01 |
| | 일반사무관리회사 | 0.63 | 0.00 | 0.65 | 0.00 |
| | 보수합계 | 2.54 | 0.02 | 2.60 | 0.02 |
| | 기타비용** | 0.09 | 0.00 | 0.12 | 0.00 |
| | 매매·중개수수료 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 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.

▶ 총보수,비용비율

총보수, 비용비율 표를 통해 투자자가 펀드를 통해 부담한 보수와 비용의 수준을 펀드 순자산 연평균잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위 : 연환산, %)

| | | 총보수·비용비율(A) | 매매·중개수수료 비율(B) | 합계(A+B) |
|--------------------|----|-------------|----------------|---------|
| 유리피가로스마트인덱스[주식]운용 | 전기 | 0.0167 | 0.0957 | 0.1124 |
| | 당기 | 0.0209 | 0.1248 | 0.1457 |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 유리피가로스마트인덱스[주식]C-e | 전기 | 0.1394 | 0.0957 | 0.2351 |
| | 당기 | 0.1224 | 0.1248 | 0.2472 |

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

매매주식 규모 및 회전을 표와 최근 3분기 매매회전을 추이 표를 통해 당기 및 최근 3분기 동안에 대해 펀드가 수행한 주식거래의 빈도를 확인할 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, %)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율* | |
|--------|-------|--------|-----|--------|-------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 해당기간 | 연환산 |
| 94,411 | 3,546 | 23,134 | 669 | 4.86 | 19.30 |

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

| 11년02월05일 ~11년05월04일 | 11년05월05일 ~11년08월04일 | 11년08월05일 ~11년11월04일 |
|----------------------|----------------------|----------------------|
| 12.23 | 10.44 | 4.86 |