

자산운용보고서

유리트리플알파팩티브직연금융증권자투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2021년09월03일 ~ 2021년12월02일)

○ 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특
정기간(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 ▶ 기본정보 ▶ 재산현황 ▶ 펀드의 투자전략
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	동일 집합투자기구에 대한 투자현황 ▶ 투자현황
9	위험현황 및 관리방안 ▶ 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

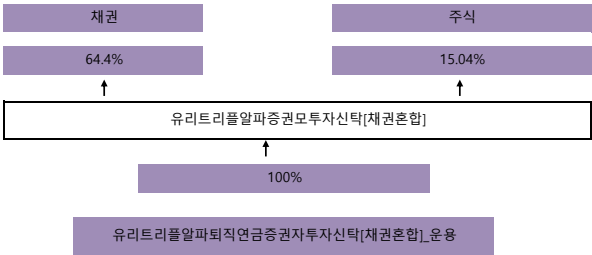
- | | | | |
|-------------|---------------------|--|--------------|
| 각종 보고서 확인 : | 유리자산운용(주)
금융투자협회 | www.yurieasset.co.kr
http://dis.kofia.or.kr | 02-2168-7900 |
|-------------|---------------------|--|--------------|

2. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	고난도 펀드
유리트리플알파퇴직연금증권투자신탁(채권혼합)_운용, 유리트리플알파증권모투자신탁(채권혼합), 유리트리플알파퇴직연금증권투자신탁(채권혼합)_ClassC, 유리트리플알파퇴직연금증권투자신탁(채권혼합)_ClassC-e		5등급	AV716, AV714, AV717, BX455	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2014.12.03	
운용기간	2021.09.03 ~ 2021.12.02	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음	
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	신한은행	
판매회사	교보생명보험, 미래에셋증권, 삼성증권, 하나금융투자, 한화투자증권, 현대차투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	이 펀드는 신탁재산의 80% 이상을 국내채권에 투자하는 모펀드인 '유리트리플알파증권모투자신탁(채권혼합)'에 투자하는 자펀드입니다. 수익증권의 원활한 판매, 투자대 기자금의 활용을 위해 단기대출 및 금융기관에 신탁재산의 10% 이하를 예치합니다. 다만, 집합투자업자가 수익자에게 최선의 이익이 된다고 판단하는 경우에는 투자신탁 자산총액의 20% 이하의 범위내에서 10%를 초과할 수 있습니다.			

▶ 펀드 구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을대 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, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_운용	자산 총액(A)	13,793	13,520	-1.98
	부채총액(B)			0.00
	순자산총액(C=A-B)	13,793	13,520	-1.98
	발행 수익증권 총 수(D)	12,932	12,710	-1.71
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,066.60	1,063.71	-0.27
종류(Class) 별 기준가격 현황				
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C	기준가격	1,061.07	1,056.26	-0.45
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e	기준가격	1,053.34	1,049.16	-0.40

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.

※ 분배금내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급액	분배후수탁고	기존가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
유리트리플알파티직연금증권자투자신탁[채권혼합]_운용	2021.12. 3.	75	12,781	1063.71	1057.81	
유리트리플알파티직연금증권자투자신탁[채권혼합]_ClassC	2021.12. 3.	0	11,815	1056.26	1056.26	
유리트리플알파티직연금증권자투자신탁[채권혼합]_ClassC-e	2021.12. 3.	0	969	1049.16	1048.88	

주) 분배후수탁고는 재투자 71 백만좌 포함입니다.

▶ 펀드의 투자전략

투자전략
이 투자신탁은 롱숏전략, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하여 자본소득을 추구하는 자투자신탁입니다. [유리트리플알파증권모투자신탁(채권혼합)의 투자전략] 이 투자신탁은 채권에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 국내주식에 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 투자하며, 롱숏전략, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구합니다. ○ 롱숏(Long/Short) 및 차익거래 전략 - 저평가된 자산을 매수함과 동시에 고평가된 자산을 매도하여 수익을 추구합니다. : 우선주/보통주, 섹터간, 섹터내, 스타일별 등의 시장중립형 롱숏전략을 활용하여 수익을 추구합니다. - 현현물 지수차익거래, ETF 차익거래 등을 통해 수익을 추구합니다. : 고(저)평가된 선물 매도(매수) & 저(고)평가된 현물 매수(매도) ○ 공모주 및 이벤트 활용 전략 - 공모기업의 펀드멘탈, 기업가치, 수급상황 등 분석을 통해 등록 이후 자본이익 확대 가능성이 높은 공모주를 적극 발굴 및 투자하여 수익을 추구합니다. - 이벤트 투자 전략 : 블록딜(Block Deal), 인수/합병/분사, 공개매수, KOSPI200/MSCI 등의 정기/비정기 종목교체 등의 이벤트를 활용하여 수익을 추구합니다. ○ 주식시장 이례현상 활용 전략 - 주식시장 월말효과, 시장 과잉반응 등 주식시장의 이례현상을 활용하여 수익을 추구합니다. ※ 월말효과란, 월말 마지막 며칠 동안과 월초 처음 며칠 동안 일시적으로 주가가 상승하는 현상을 말합니다. ○ 채권 투자 전략 - 채권 듀레이션 6개월~1년 수준으로 금리상승 위험 노출을 최소화하여 안정적인 이자수익 확보를 추구합니다. - 유동성이 풍부한 통안채, 국고채, 은행채 등에 주로 투자하며, 금리 곡선에 따른 교체매매 및 적절한 투자 대상 선정을 통해 추가 수익을 추구합니다. - 국제선물을 활용한 트레이딩 전략을 일부 활용하여 추가 수익을 추구합니다.

위험관리
운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정사항은 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 발생시 탄력적으로 포트폴리오 조정을 실시할 계획입니다.

수익구조
이 투자신탁은 '유리트리플알파증권모투자신탁(채권혼합)'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자신탁입니다. 이 투자신탁이 투자하는 '유리트리플알파증권모투자신탁(채권혼합)'은 채권에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 주식에 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 투자하여 자본소득을 추구합니다. 따라서, 모투자신탁이 투자한 주식, 채권 등의 가격변동에 따라 이익 또는 손실이 결정됩니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

해당 기간 펀드의 수익률은 보수 차감 전 기준으로 -0.27%(운용클래스 기준)를 기록하였습니다. 바스켓 롱숏 전략은 증시가 여전히 과매도 국면에 진입했다고 판단하여 양(+)의 매수 포지션을 유지하였습니다. 페어 트레이딩 전략에서 신규로 진입한 페어는 없었으나, 롱숏 페어, 보통주-우선주 페어 및 개별주식 선물 차익거래 등을 목적으로 실시간으로 모니터링을 지속하고 있습니다. 공모주 투자의 경우 대부분 상장일 장 초반 차익 실현 목적의 매도를 진행하여 수익을 확정하였으며, 최근 공모주에 대한 관심이 약화되고 있는 만큼 수익예측 참여는 보수적 관점에서 선별적으로 진행하였습니다. 이벤트 투자 전략에서는 1) SK텔레콤 분할 관련하여 분할 전 대비 분할 후 존속법인과 신설법인의 합산 시가총액 상승을 기대하여 일부 매수를 실행하고, 2) MSCI 및 KOSPI200 지수의 편입/편출 및 비중 확대/축소 예상 종목을 대상으로 매매를 수행하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

해당 기간 동안 국내 증시는 11월 말까지 오미크론 변이 확산관련 공포감, 미 국제금리 상승세 및 물가상승 확대 부담, 국내외 중앙은행의 조기 긴축정책 우려, 반도체 업황둔화 우려, 중국 형다그룹 디폴트 가능성 및 미-중 무역갈등 우려 등의 대내외 리스크 요인들로 인해 하락세가 지속되었으나, 12월 초 반도체 업황회복 기대, 기관/외국인의 매수세 유입, 중국의 완화적 통화정책 시행 및 오미크론 변이에 대한 불안감 완화 등에 힘입어 반등하며 낙폭을 일부 만회하며 마감하였습니다. 국내 증시는 대내외 불확실성 요인들로 인해 높은 변동성이 지속되는 가운데, 증시 저평가 매력에 따른 저가 매수세 유입, 환율 안정화에 따른 외국인 수급개선 가능성 및 견조한 수출지속에 따른 국내 수출주 중심의 실적 기대감 등은 긍정적이나, 월 중반 12월 미 통화정책회의 내용과 오미크론 변이에 대한 기존백신의 효능 확인결과에 따라 증시의 방향성이 결정될 것으로 예상하고 있습니다. 이에 향후 시장의 방향에 대한 예측으로 접근하기보다 안정적으로 수익을 쌓아가는데 집중할 예정입니다. 1) 바스켓 롱숏 전략은 향후 증시 반등 시기와 강도를 모니터링 하며 신중하게 롱 포지션 변화를 가져가고, 2) 안정적인 수익이 기대되는 페어 트레이딩 전략의 투자기회를 적극적으로 포착하고 진입할 계획이며, 3) 공모주 수익예측 참여는 기존과 같이 보수적 관점에서 선별적으로 진행하고, 4) 증시가 반등하는 시기에 맞춰 기존 Post-IPO 투자의 차익실현과 낙폭과대가 심화된 Post-IPO 종목 신규편입 및 5) 12월 중순 KOSPI200지수의 정기변경에서 편입/편출 및 비중 확대/축소가 예상되는 종목들에 대한 정기변경일 전후의 적극적인 트레이딩 등을 통해 성과 창출에 주력하겠습니다.
--

▶ 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
유리트리플알파파티직연금자[채권혼합]_운용	-0.27	0.38	1.35	1.41
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파파티직연금자[채권혼합]_C/C	-0.45	0.01	0.79	0.67
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파파티직연금자[채권혼합]_C/C-e	-0.40	0.13	0.96	0.90
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
※ 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.				
구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리트리플알파파티직연금자[채권혼합]_운용	1.41	4.51	7.42	14.17
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리트리플알파파티직연금자[채권혼합]_C/C	0.67	2.99	5.09	10.07
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리트리플알파파티직연금자[채권혼합]_C/C-e	0.90	3.45	5.80	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
※ 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	51	0	0	-1	41	0	0	0	0	1	-1	91
당기	-126	-1	0	1	86	0	0	0	0	4	0	-37

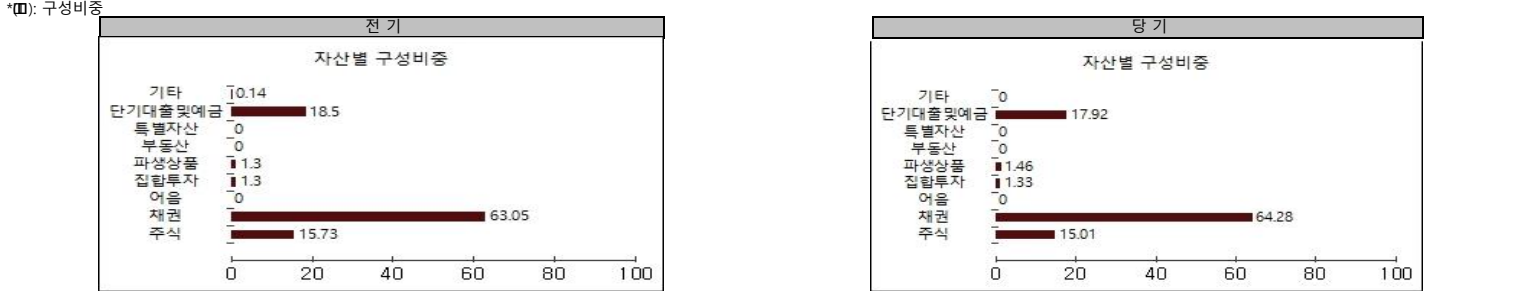
4. 자산현황

아래 표시된 자산구성 현황은 고객님의 가입한 자펀드가 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.

▶ **자산구성현황**

(단위:백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	2,029	8,691		180	198	0	0	0	0	2,422	0	13,520
(1.00)	(15.01)	(64.28)	(0.00)	(1.33)	(1.46)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(17.92)	(0.00)	(100.00)
합계	2,029	8,691		180	198	0	0	0	0	2,422	0	13,520



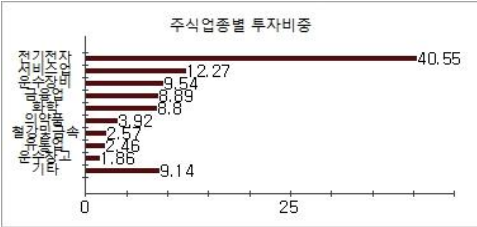
주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	40.55	6	의약품	3.92
2	서비스업	12.27	7	철강및금속	2.57
3	운수장비	9.54	8	유통업	2.46
4	금융업	8.89	9	운수장고	1.86
5	화학	8.80	10	기타	9.14

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



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	채권	통안00710-2208-02	29.03	6	주식	삼성전자	4.29
2	채권	국고01000-2306(20-3)	26.43	7	집합투자증권	KODEX 단기채권PLUS	1.28
3	단기상품	은대(신한은행)	12.10	8	단기상품	증거금(하나금융투자)	0.91
4	채권	국고01625-2206(19-3)	8.82	9	주식	SK하이닉스	0.81
5	단기상품	REPO매수(20211202)	5.82	10	주식	NAVER	0.61

※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	7,651	580	4.29	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	910	109	0.81	대한민국	KRW	전기전자	
NAVER	205	82	0.61	대한민국	KRW	서비스업	

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
통안00710-2208-02	3,934	3,925	대한민국	KRW	2020-08-02	2022-08-02		N/A	29.03
국고01000-2306(20-3)	3,590	3,574	대한민국	KRW	2020-06-10	2023-06-10		N/A	26.43
국고01625-2206(19-3)	1,180	1,192	대한민국	KRW	2019-06-10	2022-06-10		N/A	8.82

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	172	173	대한민국	KRW	1.28

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	2014-12-03	1,635	0.69		대한민국	KRW
REPO매수	우리자산운용	2021-12-02	787	0.87	2021-12-03	대한민국	KRW
증거금	하나금융투자		124	0.00		대한민국	KRW

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 주)	퀀트운용본부장	1969	26	3,732	1	708	2109000457
최재영 주)	채권운용본부장	1972	28	23,125	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 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 2020.06.02 ~ 현재	박주호(책임) 최재영(책임)

▶ 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)	
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_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)	0.14	0.00	0.13	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	9.55	0.07	0.72	0.01
		조사분석업무 등	0.45	0.00	0.13	0.00
		서비스 수수료				
		합계	10.00	0.07	0.85	0.01
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C	증권거래세	3.90	0.03	0.68	0.00	
	자산운용사	8.26	0.06	7.91	0.06	
	판매회사	14.87	0.11	14.25	0.11	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.66	0.01	0.63	0.01	
	일반사무관리회사	0.33	0.00	0.32	0.00	
	보수합계	24.12	0.18	23.11	0.18	
	기타비용 주2)	0.21	0.00	0.19	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	8.93	0.07	0.67	0.01
		조사분석업무 등	0.42	0.00	0.12	0.00
		서비스 수수료				
		합계	9.35	0.07	0.80	0.01
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e	증권거래세	3.64	0.03	0.63	0.01	
	자산운용사	0.57	0.06	0.61	0.06	
	판매회사	0.51	0.06	0.55	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.05	0.01	0.05	0.01	
	일반사무관리회사	0.02	0.00	0.02	0.00	
	보수합계	1.15	0.13	1.23	0.13	
	기타비용 주2)	0.01	0.00	0.01	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.63	0.07	0.05	0.01
		조사분석업무 등	0.03	0.00	0.01	0.00
		서비스 수수료				
		합계	0.65	0.07	0.06	0.01
	증권거래세	0.25	0.03	0.05	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 연평잔액에 대한 비율로 확인 할 수 있습니다.

(단위: 연환산,%)					
	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	매매·중개수수료비율	합정총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_운용	전기	0	0	0.0038	0.1149
	당기	0	0	0.0038	0.1003
종류(Class)별 현황					
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C	전기	0.7323	0	0.7361	0.1144
	당기	0.7323	0	0.7362	0.1001
유리트리플알파퇴직연금자[채권혼합]_C/C-e	전기	0.507	0	0.5108	0.1251
	당기	0.507	0	0.5109	0.1049

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

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위:백만원, %)

유리트리플알파모(채권혼합)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
5,411	255	6,760	300	14.32	57.43

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 나타냅니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리트리플알파모(채권혼합)

2021-03-03 ~ 2021-06-02	2021-06-03 ~ 2021-09-02	2021-09-03 ~ 2021-12-02
47.45	71.26	14.32

※ 회전을 변동 사유 : 차익거래 전략 실행, 설정/해지 및 바스켓 리밸런싱 등과 관련된 매매가 줄어 회전율이 하락하였습니다.

8. 동일할[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

(단위: 백만원, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
해당사항 없음	0	0	0

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 충분히 이루어 지지 않을 경우 환금성에 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 환금성 제약의 위험이 있을 수 있습니다.

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 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. 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한과 수단 등
해당사항 없음
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 없음			

▶ 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.