

# 자산운용보고서

**유리브리콜알파증권자투자신탁[채권혼합]**

(운용기간 : 2021년09월12일 ~ 2021년12월11일)

○ 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](http://www.yurieasset.co.kr))

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

## 1. 공지 사항

1. 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
2. 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로써 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는고객님이 가입한 유리트리플알파증권자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안 분한 결과를 보여주고 있습니다.
3. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)\_운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 'NH농협은행, 한국포스증권, 현대차투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.
4. 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

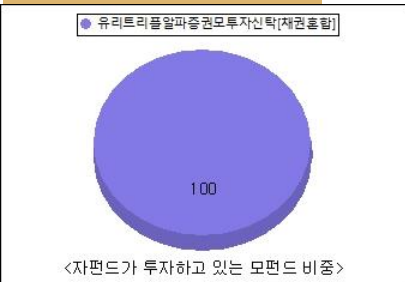
02-2168-7900

## 2. 펀드의 개요

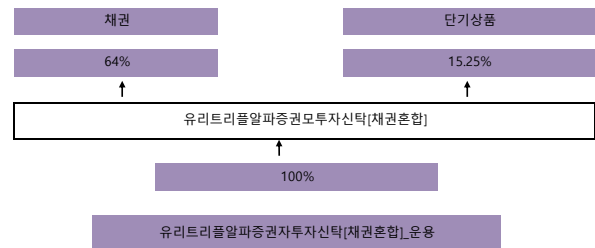
### ▶기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

| 펀드 명칭  |  | 투자위험등급   | 금융투자협회<br>펀드코드  | 고난도 펀드  |
|--|--|----------|---|---------|
| 유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합],운용,<br>유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합],<br>유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합],ClassA,<br>유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합],ClassA-e,<br>유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합],ClassC,<br>유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합],ClassC-W,<br>유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합],ClassC-e,<br>유리트리플알파증권자투자신탁[채권혼합],ClassS |  | 5등급      | AM202,<br>AV714,<br>AM203,<br>AM204,<br>AM205,<br>AM208,<br>AM206,<br>BE671 | 해당하지 않음 |
| 펀드의 종류   | 투자신탁,증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형   | 최초설정일    | 2014.12.12  |         |
| 운용기간   | 2021.09.12 ~ 2021.12.11  | 존속기간     | 추가형으로 별도의<br>존속기간이 없음   |         |
| 자산운용회사   | 유리자산운용   | 펀드재산보관회사 | 신한은행  |         |
| 판매회사   | NH농협은행, 한국포스증권, 현대차투자증권  | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스   |         |
| 상품의 특징   | 이 펀드는 신탁재산의 80% 이상을 국내채권에 투자하는 모펀드인 '유리트리플알파증권모투자신탁 [채권혼합]'에 투자하는 자펀드입니다. 수익증권의 판매를 원활하게 하고 투자대기자금의 활용을 위해 단기대출 및 금융기관에 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 가정하였을때 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[채권혼합]_운용    | 자산 총액(A)          | 237      | 230      | -2.88 |
|                      | 부채총액(B)           |          |          | 0.00  |
|                      | 순자산총액(C=A-B)      | 237      | 230      | -2.88 |
|                      | 발행 수익증권 총 수(D)    | 222      | 216      | -3.02 |
|                      | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 1,064.97 | 1,066.52 | 0.15  |
| 종류(Class)별 기준가격 현황   |                   |          |          |       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A   | 기준가격              | 1,056.79 | 1,056.54 | -0.02 |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A-e | 기준가격              | 999.32   | 999.62   | 0.03  |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C   | 기준가격              | 1,057.70 | 1,056.66 | -0.10 |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W | 기준가격              | 1,030.13 | 1,030.65 | 0.05  |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-e | 기준가격              | 1,005.25 | 1,005.29 | 0.00  |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/S   | 기준가격              | 1,028.97 | 1,030.10 | 0.11  |

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      | 분배금지급금액 | 분배후수탁고 | 기준가격(원) |         | 비고 |
|-------------------------------|-------------|---------|--------|---------|---------|----|
|                               |             |         |        | 분배금 지급전 | 분배금 지급후 |    |
| 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)_운용       | 2021.12.13. | 1       | 217    | 1066.52 | 1060.76 |    |
| 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)_ClassA   | 2021.12.13. | 0       | 92     | 1056.54 | 1056.54 |    |
| 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)_ClassA-e | 2021.12.13. | 0       |        | 999.62  | 999.62  |    |
| 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)_ClassC   | 2021.12.13. | 0       | 36     | 1056.66 | 1056.66 |    |
| 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)_ClassC-e | 2021.12.13. | 0       |        | 1005.29 | 1005.29 |    |
| 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)_ClassC-W | 2021.12.13. | 0       | 92     | 1030.65 | 1029    |    |
| 유리트리플알파증권자투자신탁(채권혼합)_ClassS   | 2021.12.13. | 0       |        | 1030.1  | 1024.96 |    |

주) 분배후수탁고는 제투자 1 백만좌 포함입니다.

▶ 펀드의 투자전략

| 투자전략  |
|---|
| <p>이 투자신탁은 채권을 주된 투자대상으로 하되, 통신탁, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용 전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합]'에 투자 신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하여 자본소득을 추구하는 자투자신탁입니다.</p> <p>&lt;유리트리플알파증권모투자신탁[채권혼합]의 투자전략&gt;</p> <p>○ 통신탁(Long/Short) 및 차익거래 전략</p> <p>- 저평가된 자산을 매수함과 동시에 고평가된 자산을 매도하여 수익을 추구합니다.</p> <p>  : 우선주/보통주, 섹터간, 섹터내, 스타일별 등의 시장중립형 통신탁을 활용하여 수익을 추구합니다.</p> <p>- 현·선물 지수차익거래, ETF차익거래 등을 통해 수익을 추구합니다.</p> <p>  : 고(저)평가된 선물 매도(매수) &amp; 저(고)평가된 현물 매수(매도)</p> <p>○ 공모주 및 이벤트 활용 전략</p> <p>- 공모기업의 펀더멘털, 기업가치, 수급상황 등을 분석을 통해 등록 이후 자본이익 확대 가능성이 높은 공모주를 적극 발굴 및 투자하여 수익을 추구합니다.</p> <p>- 이벤트 투자 전략</p> <p>  : 블록딜(Block Deal), 인수/합병/분사, 공개매수, KOSPI200/MSCI 등의 정기/비정기 종목교체 등의 이벤트를 활용하여 수익을 추구합니다.</p> <p>○ 주식시장 이례현상 활용 전략</p> <p>- 주식시장 월말효과, 시장 과잉반응 등 주식시장의 이례현상을 활용하여 수익을 추구합니다.</p> <p>○ 채권 투자 전략</p> <p>- 채권 듀레이션 6개월 ~ 1년 수준으로 금리상승 위험 노출을 최소화하여 안정적인 이자수익 확보를 추구합니다</p> <p>- 유동성이 풍부한 동안채, 국고채, 은행채 등에 주로 투자하며, 금리 곡선에 따른 교차매매 및 적절한 투자 대상 선정을 통해 추가 수익을 추구합니다.</p> <p>- 국채선물을 활용한 트레이딩 전략을 일부 활용하여 추가 수익을 추구합니다.</p> |

| 위험관리  |
|---|
| <p>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.</p> |

| 수익구조  |
|---|
| <p>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.</p> |

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

|  |
|--|
| <p>해당 기간 펀드의 수익률은 보수 차감 전 기준으로 +0.15%(운용클래스 기준)를 기록하였습니다.</p> <p>바스켓 통신탁 전략은 중시가 여전히 과매도 국면에 진입했다고 판단하여 양(+)의 매수 포지션을 유지하였습니다.</p> <p>페어 트레이딩 전략에서 신규로 진입한 페어는 없었으나, 통신탁 페어, 보통주-우선주 페어 및 개별주식 선물 차익거래 등을 목적으로 실시간으로 모니터링을 지속하고 있습니다.</p> <p>공모주 투자의 경우 대부분 상장일 장 초반 차익실현 목적의 매도를 진행하여 수익을 확정하였으며, 최근 공모주에 대한 관심도가 약화되고 있는 만큼 수요예측 참여는 보수적 관점에서 선별적으로 진행하였습니다.</p> <p>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.</p> |
|--|

▶ 투자환경 및 운용 계획

|   |
|---|
| <p>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 헝다그룹 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 반등하 며 낙폭을 일부 만회하며 마감하였습니다.</p> <p>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 기 대감 등은 긍정적이나, 월 중반 12월 미 통화정책회의 내용과 오미크론 변이에 대한 기존백신의 효능 확인결과에 따라 증시의 방향성이 결정될 것으로 예상하고 있습니다.</p> <p>이에 향후 시장의 방향에 대한 예측으로 접근하기보다 안정적으로 수익을 쌓아가는데 집중할 예정입니다.</p> <p>1) 바스켓 통신탁 전략은 향후 증시 변동 시기와 강도를 모니터링 하며 신중하게 롱 포지션 변화를 가져가고, 2) 안정적인 수익이 기대되는 페어 트레이딩 전략의 투자기회를 적극적으로 포착하고 진입할 계획이며, 3) 공모주 수 요예측 참여는 기존과 같이 보수적 관점에서 선별적으로 진행하고, 4) 중시가 반등하는 시기에 맞춰 기존 Post-IPO 투자의 차익실현과 낙폭과대가 심화된 Post_IPO 종목 신규편입 및 5) 12월 중순 KOSPI200지수의 정기변경에 서 편입/편출 및 비중 확대/축소가 예상되는 종목들에 대한 정기변경일 전후의 적극적인 트레이딩 등을 통해 성과 창출에 주력하겠습니다.</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 |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_운용    | 0.15   | 0.44   | 1.74   | 1.67    |
| (비교지수 대비 성과)         | -      | -      | -      | -       |
| 종류(Class)별 현황        |        |        |        |         |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A   | -0.02  | 0.09   | 1.22   | 0.98    |
| (비교지수 대비 성과)         | -      | -      | -      | -       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A-e | 0.03   | 0.08   | 1.38   | 1.31    |
| (비교지수 대비 성과)         | -      | -      | -      | -       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C   | -0.10  | -0.06  | 1.00   | 0.68    |
| (비교지수 대비 성과)         | -      | -      | -      | -       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W | 0.05   | 0.24   | 1.45   | 1.28    |
| (비교지수 대비 성과)         | -      | -      | -      | -       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-e | -      | 0.13   | 0.53   | 0.53    |
| (비교지수 대비 성과)         | -      | -      | -      | -       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/S   | 0.11   | 0.40   | 1.70   | 1.63    |
| (비교지수 대비 성과)         | -      | -      | -      | -       |

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

| 구분                   | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|
| 유리트리플알파자[채권혼합]_운용    | 1.67  | 4.62  | 7.68  | 14.41 |
| (비교지수 대비 성과)         | -     | -     | -     | -     |
| 종류(Class)별 현황        |       |       |       |       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A   | 0.98  | 3.21  | 5.51  | 10.59 |
| (비교지수 대비 성과)         | -     | -     | -     | -     |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A-e | 1.31  | 1.37  | -1.24 | 1.29  |
| (비교지수 대비 성과)         | -     | -     | -     | -     |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C   | 0.68  | 2.60  | 4.57  | 8.96  |
| (비교지수 대비 성과)         | -     | -     | -     | -     |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W | 1.28  | 3.83  | -     | -     |
| (비교지수 대비 성과)         | -     | -     | -     | -     |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-e | 0.53  | 1.31  | -     | 1.26  |
| (비교지수 대비 성과)         | -     | -     | -     | -     |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/S   | 1.63  | 4.05  | 6.64  | 12.47 |
| (비교지수 대비 성과)         | -     | -     | -     | -     |

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

▶ 손익현황

(단위:백만원)

| 구분 | 증권 |    |    |      | 파생상품 |    | 부동산 | 특별자산 |    | 단기대출 및<br>예금 | 기타 | 손익합계 |
|----|----|----|----|------|------|----|-----|------|----|--------------|----|------|
|    | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내   | 장외 |     | 실물자산 | 기타 |              |    |      |
| 전기 | -1 | 0  | 0  | 0    | 1    | 0  | 0   | 0    | 0  | 0            | 0  | 1    |
| 당기 | -1 | 0  | 0  | 0    | 1    | 0  | 0   | 0    | 0  | 0            | 0  | 0    |

## 4. 자산현황

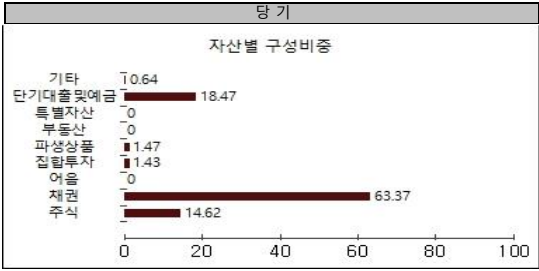
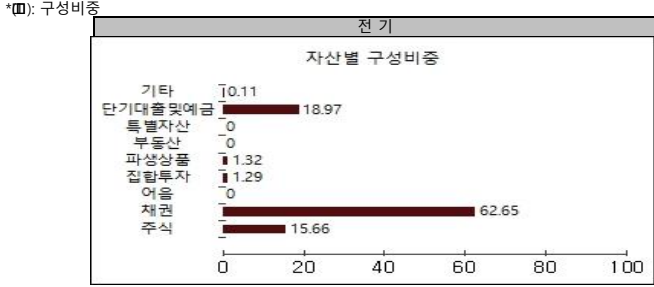
아래 표시된 자산구성 현황은 고객님의 가입한 펀드가 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.

▶ 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 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위:백만원,%)

| 통화별<br>구분 | 증권      |         |        |        | 파생상품   |        | 부동산    | 특별자산   |        | 단기대출 및<br>예금 | 기타     | 자산총액     |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------------|--------|----------|
|           | 주식      | 채권      | 어음     | 집합투자   | 장내     | 장외     |        | 실물자산   | 기타     |              |        |          |
| KRW       | 34      | 146     |        | 3      | 3      | 0      | 0      | 0      | 0      | 42           | 1      | 230      |
| (1.00)    | (14.62) | (63.37) | (0.00) | (1.43) | (1.47) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (18.47)      | (0.64) | (100.00) |
| 합계        | 34      | 146     |        | 3      | 3      | 0      | 0      | 0      | 0      | 42           | 1      | 230      |



주) 위의 결과는 해당 펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 펀드가 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 | 40.88 | 6  | 의약품   | 4.06 |
| 2  | 서비스업 | 12.76 | 7  | 철강및금속 | 2.59 |
| 3  | 금융업  | 9.03  | 8  | 유통업   | 2.54 |
| 4  | 화학   | 8.61  | 9  | 운수장고  | 1.83 |
| 5  | 분수장비 | 8.18  | 10 | 기타    | 9.52 |

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 차지하는 비중을 나타냅니다.

(단위 : %)

| 순위 | 구분   | 종목명                | 비중    | 순위 | 구분     | 종목명              | 비중   |
|----|------|--------------------|-------|----|--------|------------------|------|
| 1  | 채권   | 통안00710-2208-02    | 28.71 | 6  | 단기상품   | 은대(신한은행)         | 3.37 |
| 2  | 채권   | 국고01000-2306(20-3) | 26.01 | 7  | 집합투자증권 | KODEX 단기채권PLUS   | 1.26 |
| 3  | 단기상품 | REPO매수(20211210)   | 14.38 | 8  | 주식     | SK하이닉스           | 0.79 |
| 4  | 채권   | 국고01625-2206(19-3) | 8.65  | 9  | 단기상품   | 증거금(하나금융투자)      | 0.78 |
| 5  | 주식   | 삼성전자               | 4.21  | 10 | 단기상품   | REPO매수(20211210) | 0.72 |

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://diskofia.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   | 126  | 10   | 4.21 | 대한민국 | KRW | 전기전자 |    |
| SK하이닉스 | 14   | 2    | 0.79 | 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    |
|--------------------|------|-----|------|-----|------------|------------|------|------|-------|
| 통안00710-2208-02    | 66   | 66  | 대한민국 | KRW | 2020-08-02 | 2022-08-02 |      | N/A  | 28.71 |
| 국고01000-2306(20-3) | 60   | 60  | 대한민국 | KRW | 2020-06-10 | 2023-06-10 |      | N/A  | 26.01 |
| 국고01625-2206(19-3) | 20   | 20  | 대한민국 | KRW | 2019-06-10 | 2022-06-10 |      | N/A  | 8.65  |

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 만기채권PLUS | 수익증권 | 삼성자산운용 | 3    | 3     | 대한민국 | KRW | 1.26 |

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  |
|--------|------------------|------------|----|------|------------|------|-----|
| REPO매수 | 미래에셋자산운용(우정사업본부) | 2021-12-10 | 33 | 1.20 | 2021-12-13 | 대한민국 | KRW |
| 예금     | 신한은행             | 2014-12-12 | 8  | 0.69 |            | 대한민국 | KRW |
| 승거금    | 하나금융투자           |            | 2  | 0.00 |            | 대한민국 | KRW |
| REPO매수 | 우리자산운용(우정사업본부)   | 2021-12-10 | 2  | 1.15 | 2021-12-13 | 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 <small>주)</small> | 퀀트운용본부장 | 1969 | 26         | 3,732  | 1                       | 708  | 2107000457 |
| 최재영 <small>주)</small> | 채권운용본부장 | 1972 | 28         | 23,125 | 0                       | 0    | 2107000709 |

주1) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 함함.

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<br>2020.06.02 ~ 현재 | 박주호(책임)<br>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 <small>주1)</small> | 금액   | 비율 <small>주1)</small> |
| 유리트리플알파자[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 <small>주2)</small> | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 매매 중개 수수료               | 0.16 | 0.07                  | 0.01 | 0.00                  |
|                      | 단순매매, 중개수수료             |      |                       |      |                       |
|                      | 조사분석업무 등 서비스 수수료        | 0.01 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 합계                      | 0.17 | 0.07                  | 0.01 | 0.00                  |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A   | 증권거래세                   | 0.06 | 0.03                  | 0.01 | 0.01                  |
|                      | 자산운용사                   | 0.09 | 0.09                  | 0.08 | 0.09                  |
|                      | 판매회사                    | 0.08 | 0.08                  | 0.07 | 0.07                  |
|                      | 펀드재산보관회사(신탁업자)          | 0.01 | 0.01                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 일반사무관리회사                | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 보수합계                    | 0.17 | 0.17                  | 0.16 | 0.17                  |
|                      | 기타비용 <small>주2)</small> | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 매매 중개 수수료               | 0.07 | 0.07                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 단순매매, 중개수수료             |      |                       |      |                       |
|                      | 조사분석업무 등 서비스 수수료        | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A-e | 합계                      | 0.07 | 0.07                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 증권거래세                   | 0.03 | 0.03                  | 0.01 | 0.01                  |
|                      | 자산운용사                   | 0.00 | 0.09                  | 0.00 | 0.09                  |
|                      | 판매회사                    | 0.00 | 0.04                  | 0.00 | 0.04                  |
|                      | 펀드재산보관회사(신탁업자)          | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 일반사무관리회사                | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 보수합계                    | 0.00 | 0.13                  | 0.01 | 0.13                  |
|                      | 기타비용 <small>주2)</small> | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 매매 중개 수수료               | 0.00 | 0.09                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 단순매매, 중개수수료             |      |                       |      |                       |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C   | 조사분석업무 등 서비스 수수료        | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 합계                      | 0.00 | 0.09                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 증권거래세                   | 0.00 | 0.03                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 자산운용사                   | 0.03 | 0.09                  | 0.03 | 0.09                  |
|                      | 판매회사                    | 0.05 | 0.15                  | 0.06 | 0.15                  |
|                      | 펀드재산보관회사(신탁업자)          | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 일반사무관리회사                | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 보수합계                    | 0.09 | 0.25                  | 0.09 | 0.24                  |
|                      | 기타비용 <small>주2)</small> | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 매매 중개 수수료               | 0.02 | 0.07                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 단순매매, 중개수수료             |      |                       |      |                       |
|                      | 조사분석업무 등 서비스 수수료        | 0.00 | 0.00                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 합계                      | 0.03 | 0.07                  | 0.00 | 0.00                  |
|                      | 증권거래세                   | 0.01 | 0.03                  | 0.00 | 0.01                  |

|                      |                     |                     |      |      |      |      |
|----------------------|---------------------|---------------------|------|------|------|------|
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W | 자산운용사               |                     | 0.08 | 0.09 | 0.08 | 0.09 |
|                      | 판매회사                |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 펀드재산보관회사(신탁업자)      |                     | 0.00 | 0.01 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 일반사무관리회사            |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 보수합계                |                     | 0.09 | 0.10 | 0.09 | 0.09 |
|                      | 기타비용 <sup>주2)</sup> |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 매매<br>중개<br>수수료     | 단순매매, 중개수수료         | 0.06 | 0.07 | 0.00 | 0.00 |
|                      |                     | 조사분석업무 등<br>서비스 수수료 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      |                     | 합계                  | 0.07 | 0.07 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 증권거래세               |                     | 0.02 | 0.03 | 0.00 | 0.01 |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-e | 자산운용사               |                     | 0.00 | 0.09 | 0.00 | 0.08 |
|                      | 판매회사                |                     | 0.00 | 0.07 | 0.00 | 0.07 |
|                      | 펀드재산보관회사(신탁업자)      |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 일반사무관리회사            |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 보수합계                |                     | 0.00 | 0.16 | 0.00 | 0.16 |
|                      | 기타비용 <sup>주2)</sup> |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 매매<br>중개<br>수수료     | 단순매매, 중개수수료         | 0.00 | 0.07 | 0.00 | 0.00 |
|                      |                     | 조사분석업무 등<br>서비스 수수료 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      |                     | 합계                  | 0.00 | 0.07 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 증권거래세               |                     | 0.00 | 0.03 | 0.00 | 0.01 |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/S   | 자산운용사               |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.04 |
|                      | 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 | 0.04 |
|                      | 기타비용 <sup>주2)</sup> |                     | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 매매<br>중개<br>수수료     | 단순매매, 중개수수료         | 0.00 | 0.07 | 0.00 | 0.00 |
|                      |                     | 조사분석업무 등<br>서비스 수수료 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
|                      |                     | 합계                  | 0.00 | 0.07 | 0.00 | 0.00 |
|                      | 증권거래세               |                     | 0.00 | 0.03 | 0.00 | 0.01 |

\* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율  
\*\* 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 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 |             |
|                      |    | 총보수비용비율 | 매매·중개수수료비율 | 합성총보수비용비율  | 매매·중개수수료 비율 |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_운용    | 전기 | 0       | 0          | 0.0038     | 0.1155      |
|                      | 당기 | 0       | 0          | 0.0038     | 0.1035      |
| 종류(Class)별 현황        |    |         |            |            |             |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A   | 전기 | 0.6794  | 0          | 0.6832     | 0.1081      |
|                      | 당기 | 0.6793  | 0          | 0.6832     | 0.0993      |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/A-e | 전기 | 0.4657  | 0          | 0.4697     | 0.3521      |
|                      | 당기 | 0.4908  | 0          | 0.4946     | 0.1533      |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C   | 전기 | 0.9778  | 0          | 0.9817     | 0.1236      |
|                      | 당기 | 0.978   | 0          | 0.9819     | 0.1069      |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-W | 전기 | 0.3795  | 0          | 0.3833     | 0.1193      |
|                      | 당기 | 0.3794  | 0          | 0.3833     | 0.1055      |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/C-e | 전기 | 0.6446  | 0          | 0.6487     | 0.2255      |
|                      | 당기 | 0.6433  | 0          | 0.6472     | 0.1595      |
| 유리트리플알파자[채권혼합]_C/S   | 전기 | 0.0009  | 0          | 0.0048     | 0.1197      |
|                      | 당기 | 0.0452  | 0          | 0.0491     | 0.1021      |

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 회전을

| 매수    |     | 매도    |     | 매매회전율 <sup>주)</sup> |       |
|-------|-----|-------|-----|---------------------|-------|
| 수량    | 금액  | 수량    | 금액  | 해당기간                | 연환산   |
| 3,148 | 155 | 7,727 | 319 | 15.35               | 61.56 |

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

|                         |  |                         |  |                         |  |
|-------------------------|--|-------------------------|--|-------------------------|--|
| 유리트리플알파모[채권혼합]          |  |                         |  |                         |  |
| 2021-03-12 ~ 2021-06-11 |  | 2021-06-12 ~ 2021-09-11 |  | 2021-09-12 ~ 2021-12-11 |  |
| 52.64                   |  | 69.33                   |  | 15.35                   |  |

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

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

| 투자대상 집합투자기구 현황 |         | 투자대상 집합투자증권<br>보유수(B) | 보유비중<br>(=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 유통주식수 부족, 기업의 횡령, 배임, 분식회계 및 적자 지속 등에 따른 거래정지, 상장폐지 등의 사유로 거래가 시장에서 충분하게 이루어 지지 않을 경우 환금성에 제약이 발생할 수 있으며, 이는 투자신탁재산의 가치하락을 초래하여 손실을 유발합니다.  |
| ※ 기재된 내용 이외의 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.<br>- 주의 단계<br>발생 Event에 대한 자본시장 영향 분석, 운용전략의 조정<br>- 위기 단계<br>위험관리위원회 의결(집합투자기구별(또는 유형별) 운용전략 제한, 유동성 확보계획 등 수립), 위기상황 보고체계 가동<br>- 위급 단계<br>비상대책반 구성하여 위기 상황별 구체적 실행계획의 수립 및 시행, 위험관리위원회 및 집합투자재산평가위원회 결의, 한국금융투자협회 및 금융감독원 등 감독기관과의 대응책 모색<br>○ 부실자산 발생 시 '집합투자재산평가기준'에 따라 집합투자재산평가위원회를 소집하여 관련 규정과 절차에 따라 부실자산 평가방안 등을 결정하여 신탁재산 손실의 최소화를 추구합니다.<br>○ 부실자산에 대해서는 기본적으로 위험관리위원회의 결정에 따라 관리하며 필요시 Task-Force team을 구성하여 운영할 수 있습니다. |
|--|

10. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

|         |      |     |
|---------|------|-----|
| 펀드명칭    | 투자금액 | 수익률 |
| 해당사항 없음 |      |     |

※투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매) 될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.