

자산운용보고서

유리트리플알파증권투자신탁[주식혼합]

(운용기간 : 2023년08월15일 ~ 2023년11월14일)

○ 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)

목 차

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 투자 및 회수에 관한 사항

1. 공지 사항

- 1. 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
- 2. 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로서 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는 고객님의 가입한 자펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
- 3. 고객님의 가입하신 펀드는 2022년 11월 24일(공지사유 발생일 기준) 자본시장 법령상 소규모 펀드에 해당하여 회사가 2022년 12월 01일 관련 수시공시를 한 바 있습니다. 소규모 펀드는 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있고 법192조 제1항 단서에 의거하여 투자자에 대한 별도의 통보나 동의 없이 자산운용사가 임의해지 할 수 있음을 알려드립니다.
- 4. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리트리플알파증권투자신탁(주식혼합)_운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 'KB증권, NH투자증권, SK증권, 국민은행, 미래에셋증권, 삼성생명보험, 삼성증권, 키움증권, 하나증권, 한국투자증권, 한국포스증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.
- 5. 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

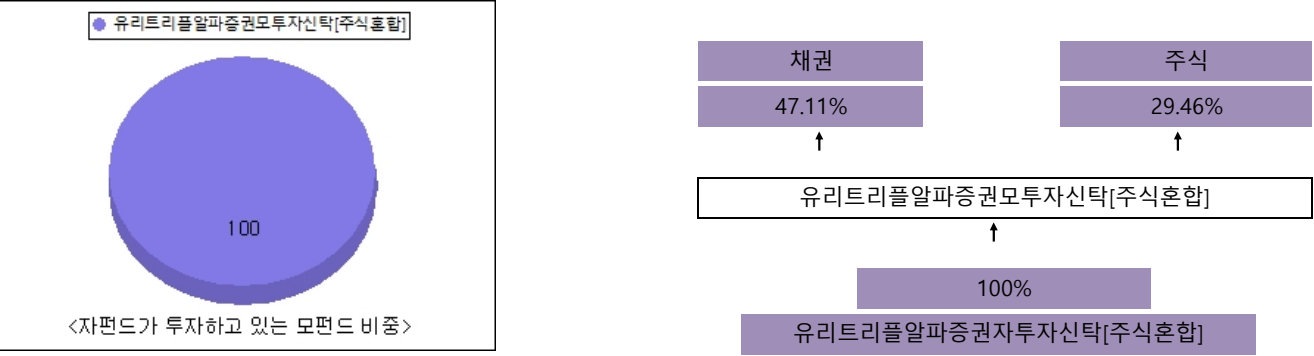
http://dis.kofia.or.kr

2. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	고난도 펀드
유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_운용, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassA-e, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassA1, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-P1, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-e, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC1, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassS, 유리트리플알파증권자투자신탁[주식혼합]_ClassC-W		5등급	AM167, AM197, AM196, B7605, AM199, AM198, BE670, AM201	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(혼합주식형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2013.11.15	
운용기간	2023.08.15 ~ 2023.11.14	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음	
레버리지(차입 등) 한도	-			
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	신한은행	
판매회사	KB증권, NH투자증권, SK증권, 국민은행, 미래에셋 증권, 삼성생명보험, 삼성증권, 키움증권, 하나증권, 한국투자증권, 한국포스증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	이 투자신탁은 국내 주식에 주로 투자하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'을 주된 투자 대상자산으로 하며, 롱 숏전략, 공모주/이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다.			

▶ 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[주식혼합]_운용	자산 총액(A)	1,497	1,485	-0.82
	부채총액(B)	1	0	-100.00
	순자산총액(C=A-B)	1,496	1,485	-0.76
	발행 수익증권 총 수(D)	1,425	1,406	-1.30
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,050.39	1,056.08	0.54
종류(Class)별 기준가격 현황				
C/A-e	기준가격	1,043.59	1,046.92	0.32
C/A1	기준가격	1,041.56	1,044.20	0.25
C/C-P1	기준가격	1,039.24	1,041.74	0.24
C/C-e	기준가격	1,041.91	1,044.93	0.29
C/C1	기준가격	1,023.34	1,024.91	0.15
C/S	기준가격	990.10	995.44	0.54
C/W	기준가격	1,045.50	1,049.48	0.38

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 [주식혼합]_운용	2023.11.15.	22	1,427	1056.08	1040.41	
ClassA1	2023.11.15.	3	700	1044.2	1040.46	
ClassA-e	2023.11.15.	0	10	1046.92	1040.47	
ClassC1	2023.11.15.	0	449	1024.91	1024.91	
ClassC-e	2023.11.15.	0	1	1044.93	1040.33	
ClassC-W	2023.11.15.	0	41	1049.48	1040.5	
ClassC-P1	2023.11.15.	1	229	1041.74	1038.52	
ClassS	2023.11.15.	0		995.44	995.44	

주) 분배후수탁고는 재투자 24 백만좌 포함입니다.

▶ 펀드의 투자전략

투자전략
<p>이 투자신탁은 모자형 구조의 자투자신탁으로서, 국내 주식에 주로 투자하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자합니다.</p> <p><유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]></p> <p>이 투자신탁은 국내주식에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 채권에 투자신탁 자산총액의 50% 미만으로 투자하며, 롱숏전략, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 증권투자신탁입니다.</p> <p>가) 롱숏(Long/Short) 및 차익거래 전략</p> <p>- 저평가된 자산을 매수함과 동시에 고평가된 자산을 매도하여 수익을 추구합니다. : 우선주/보통주, 섹터간, 섹터내, 스타일별 등의 시장중립형 롱숏전략을 활용하여 수익을 추구합니다.</p> <p>- 현·선물 지수차익거래, ETF차익거래 등을 통해 수익을 추구합니다. : 고(저)평가된 선물 매도(매수) & 저(고)평가된 현물 매수(매도)</p>

- 나) 공모주 및 이벤트 활용 전략
- 공모기업의 펀더멘털, 기업가치, 수급상황 등을 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.
- 다) 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.
- 라) 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.
 - 국채선물을 활용한 트레이딩 전략을 일부 활용하여 추가 수익을 추구합니다.

위험관리
운용역 개인의 독단의 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.
수익구조
이 투자신탁은 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'에 투자신탁 자산총액의 80% 이상을 투자하는 자투자신탁입니다. 이 투자신탁이 투자하는 '유리트리플알파증권모투자신탁[주식혼합]'은 국내주식에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 채권에 투자신탁 자산총액의 50% 미만으로 투자하여 자본소득을 추구합니다. 따라서, 모투자신탁이 투자한 주식, 채권 등의 가격변동에 따라 이익 또는 손실이 결정됩니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

해당 기간 동안 국내 증시는 9월 중순까지 미 엔비디아社의 양호한 실적발표에 따른 반도체 업종 주가강세 지속, 시장 예상수준과 유사했던 잭스홀 미팅 안도감, 중국 금리인하와 증시 활성화 정책 발표, 미 경제지표 부진에 따른 중앙은행의 추가 금리인상 우려 완화 등에 힘입어 상승세를 나타낸 증시는 이후 10월 말까지 1)미 TSMC社의 장비납품 연기 요청소식에 따른 반도체 수요부진 우려 부각, 2)유가상승 지속에 따른 물가지표 상승전환 우려, 3)예상보다 매파적이었던 9월 미 통화정책회의의 결과, 4)금리 상승과 달러 강세 확대, 5)미 연방정부의 업무정지(셧다운) 우려, 6)이스라엘-하마스 전쟁 본격화 및 7)미 알파벳社와 테슬라社의 실적부진에 따른 반도체/2차전지 업종 주가급락 등의 영향으로 분기 초 상승분 이상의 큰 폭의 하락세를 나타냈습니다. 다만, 11월 들어 양호한 국내 10월 수출지표, 예상보다 완화적이었던 미 11월 통화정책회의와 고용지표 둔화에 따른 시장금리 급락, 미-중 무역갈등 완화 기대감 및 국내 공매도 전면금지 조치 발표 등에 힘입어 낙폭을 일부 만회하며 마감하였습니다.

해당 기간 펀드의 수익률은 보수 차감 전 기준으로 0.54%(운용클래스 기준)를 기록하였습니다.

바스켓 룡샷 전략은 최근 증시가 큰 폭의 하락세를 나타냄에 따라 증시 반등에 대비하여 전반적으로 양(+)의 매수 포지션을 유지하였습니다. 페어 트레이딩 전략에서는 삼성전자 종목의 우선주 페어 포지션을 유지한 가운데, 보통주-우선주 비율이 최근 1년 최고치 수준을 상향돌파한 현대차 종목의 포지션 청산을 진행하였습니다. 공모주 투자의 경우 대부분 상장일 장 초반 차익실현 목적의 매도를 진행하여 수익을 확정하였으며. 추가적으로 실적 대비 과도하게 주가 수준이 높은 종목에 대한 비중 축소(숏 포지션)와 실적 성장성, 수급 등이 양호한 반도체/리오프닝(소비회복) 관련 업종 등의 주요 개별종목 투자, KOSPI200, KOSDAQ150 및 MSCI 등 주요 주가지수의 편입종목 변경 이벤트 대응 등을 통해 성과 개선에 주력하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

다음 분기 국내 증시는 낮은 지분율과 신흥국 수출여건 회복 기대에 따른 외국인의 수급개선 지속 가능성, 금리인상 종료 또는 '24년 상반기 금리인하 개시 기대에 따른 시장금리 하향 안정화, 중국의 공격적인 경기부양책 및 반도체 업황 턴어라운드 가능성 등은 긍정적이나, 미국 중심의 글로벌 경기침체 심화 우려, 미 중앙은행의 통화정책 변화 관련 불확실성 상존, 이스라엘-하마스 전쟁 장기화 부담, 인플레이션 고착화 우려, 2차전지 업종의 수급쏠림 전환에 따른 주가폭락 또는 신용불안 가능성 및 '23년 4분기 실적 불확실성 등의 영향으로 보험권 수준에서 등락을 반복할 것으로 예상하고 있습니다.

이에 향후 시장의 방향에 대한 예측으로 접근하기보다 안정적으로 수익을 쌓아가는데 집중할 예정입니다. 1) 바스켓 룡샷 전략은 양(+)의 매수 포지션을 축소해 손실을 확정하기보다 시장상황을 면밀히 모니터링하여 증시가 상승하는 구간에서 당분간 비중을 유지할 계획이고, 2) 안정적인 수익이 기대되는 페어 트레이딩 전략의 투자기회를 적극적으로 포착하고 진입할 계획이며, 3) 공모주 수요예측 참여는 기존과 같이 면밀한 분석을 기반으로 선별적으로 진행하고, 4) 증시가 반등하는 시기에 맞춰 기존 Post-IPO 투자의 차익실현과 낙폭과대가 심화된 Post_IPO 종목 신규편입 및 5) 지수변경 이벤트, 실적 및 수급 등이 양호한 다수의 개별종목들에 대한 적극적인 트레이딩 등을 통해 성과를 개선하는 데 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
유리트리플알파자 [주식혼합]_운용	0.54	1.67	2.38	3.38
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
C/A-e	0.32	1.22	1.71	2.48
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/A1	0.25	1.09	1.52	2.21
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P1	0.24	1.07	1.48	2.16
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-e	0.29	1.15	1.59	2.30
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C1	0.15	0.89	1.21	1.81
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/S	0.54	1.67	2.62	2.62
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/W	0.38	1.35	1.90	2.73
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

주)비교지수(벤치마크): BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리트리플알파자 [주식혼합]_운용	3.38	1.39	3.78	7.32
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
C/A-e	2.48	-0.38	1.07	2.68
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/A1	2.21	-0.89	0.29	1.37
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P1	2.16	-0.99	0.15	1.13
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-e	2.30	-0.76	0.49	1.68
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C1	1.81	-1.68	-0.90	-0.63
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/S	2.62	-0.46	-0.46	-1.42
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/W	2.73	0.11	1.82	3.96
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

주)비교지수(벤치마크): BM없음

※ 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	25	5	0	-10	-5	0	0	0	0	1	0	17
당기	-11	6	0	7	4	0	0	0	0	2	0	8

4. 자산현황

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

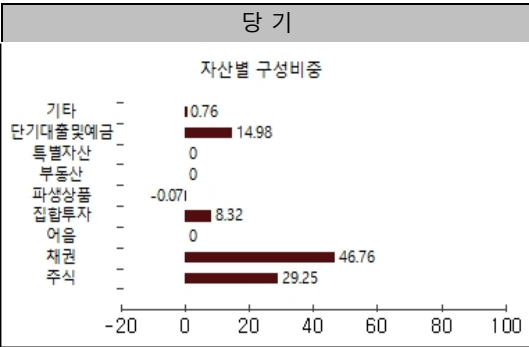
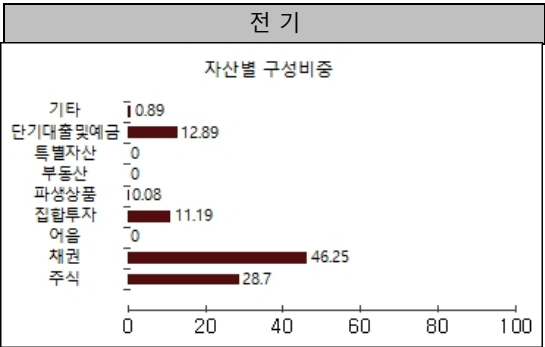
▶ 자산구성현황

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 구성비율을 비교할 수 있습니다.

(단위:백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	434	694	0	124	-1	0	0	0	0	223	11	1,485
(1.00)	(29.25)	(46.76)	(0.00)	(8.32)	-(0.07)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(14.98)	(0.76)	(100.00)
합계	434	694	0	124	-1	0	0	0	0	223	11	1,485

*() : 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.

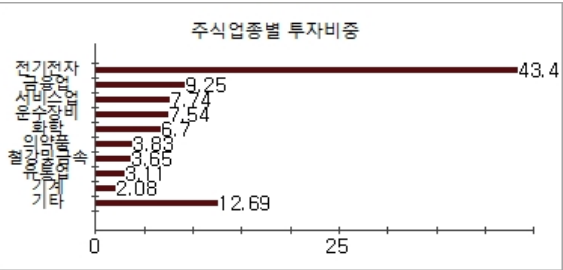
▶ 주식업종별 투자비중

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	43.41	6	의약품	3.83
2	금융업	9.25	7	철강및금속	3.65
3	서비스업	7.74	8	유통업	3.11
4	운수장비	7.54	9	기계	2.08
5	화학	6.70	10	기타	12.69

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	국고03500-2403(14-2)	46.76	6	주식	SK하이닉스	1.90
2	단기상품	은대(신한은행)	14.98	7	주식	POSCO홀딩스	0.83
3	집합투자증권	TIGER 200선물인버스2X	8.15	8	기타	증거금(하나증권)	0.75
4	주식	삼성전자	5.69	9	주식	NAVER	0.69
5	주식	삼성전자우	2.93	10	주식	현대차	0.66

※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	1,193	85	5.69	대한민국	KRW	전기전자	
삼성전자우	761	44	2.93	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	216	28	1.9	대한민국	KRW	전기전자	
POSCO홀딩스	26	12	0.83	대한민국	KRW	철강및금속	
NAVER	51	10	0.69	대한민국	KRW	서비스업	
현대차	55	10	0.66	대한민국	KRW	운수장비	

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
국고03500-2403(14-2)	690	694	대한민국	KRW	2014-03-10	2024-03-10		N/A	46.76

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

▶ 집합투자증권

(단위 : 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
TIGER 200선물인버스2X	수익증권	미래에셋자산운용	121	121	대한민국	KRW	8.15

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	2014-01-27	222	2.99	-	대한민국	KRW

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

▶ 기타

(단위 : 백만원)

종류	평가금액	비고
증거금	11	

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	생년	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
박주호 ^{주)}	퀀트운용본부장	1969	26	6,747	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 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	박주호(책임)

▶ 해외운용수탁회사

- 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)}
유리트리플알파자[주식혼합]_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)}		0.01	0.00	0.01	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.09	0.01	0.10	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.08	0.01	0.03	0.00
		합계	0.17	0.01	0.13	0.01
	증권거래세		0.46	0.03	0.02	0.00
C/A-e	자산운용사		0.01	0.15	0.01	0.15
	판매회사		0.01	0.06	0.01	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.02	0.22	0.02	0.22
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		합계	0.00	0.01	0.00	0.01
	증권거래세		0.00	0.03	0.00	0.00
C/A1	자산운용사		1.14	0.15	1.10	0.15
	판매회사		0.95	0.13	0.92	0.13
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.05	0.01	0.05	0.01
	일반사무관리회사		0.03	0.00	0.03	0.00
	보수합계		2.17	0.29	2.10	0.29
	기타비용 ^{주2)}		0.01	0.00	0.01	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.04	0.01	0.05	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.04	0.01	0.01	0.00
		합계	0.08	0.01	0.06	0.01
	증권거래세		0.22	0.03	0.01	0.00
C/C-P1	자산운용사		0.35	0.15	0.36	0.15
	판매회사		0.32	0.14	0.33	0.14
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.01	0.00
	보수합계		0.70	0.30	0.71	0.30
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.01	0.02	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.01	0.00	0.00
		합계	0.03	0.01	0.02	0.01
	증권거래세		0.07	0.03	0.00	0.00
	자산운용사		0.01	0.15	0.00	0.15
	판매회사		0.00	0.11	0.00	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.00	0.00	0.00

C/C-e	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.01	0.27	0.00	0.26
	기타비용 <small>주2)</small>		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		합계	0.00	0.01	0.00	0.00
C/C1	증권거래세		0.00	0.03	0.00	0.00
	자산운용사		0.73	0.15	0.70	0.15
	판매회사		1.10	0.23	1.04	0.23
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.03	0.01	0.03	0.01
	일반사무관리회사		0.02	0.00	0.02	0.00
	보수합계		1.88	0.39	1.79	0.39
	기타비용 <small>주2)</small>		0.01	0.00	0.01	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.03	0.01	0.03	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.01	0.01	0.00
		합계	0.05	0.01	0.04	0.01
C/S	증권거래세		0.15	0.03	0.01	0.00
	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	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		합계	0.00	0.01	0.00	0.01
C/W	증권거래세		0.00	0.03	0.00	0.00
	자산운용사		0.06	0.15	0.06	0.15
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.07	0.16	0.07	0.16
	기타비용 <small>주2)</small>		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.01	0.00	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		합계	0.00	0.01	0.00	0.01
	증권거래세		0.01	0.03	0.00	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 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 비율을 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	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
유리트리플알파자 [주식혼합]_운용	전기	0	0	0.0024	0.0431
	당기	0	0	0.0025	0.0351

종류(Class)별 현황					
C/A-e	전기	0.8811	0	0.8835	0.0427
	당기	0.8834	0	0.8859	0.0353
C/A1	전기	1.1419	0	1.1444	0.043
	당기	1.1419	0	1.1444	0.0351
C/C-P1	전기	1.1912	0	1.1937	0.0428
	당기	1.1912	0	1.1937	0.0353
C/C-e	전기	1.0654	0	1.0679	0.0429
	당기	1.0385	0	1.041	0.0185
C/C1	전기	1.5421	0	1.5445	0.0438
	당기	1.5422	0	1.5447	0.0353
C/S	전기	0	0	0.0024	0.0428
	당기	0	0	0.0025	0.0352
C/W	전기	0.6389	0	0.6414	0.0428
	당기	0.6389	0	0.6414	0.0352

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[주식혼합]

매수		매도		매매회전율 <small>주)</small>	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
705	39	1,476	28	2.40	9.52

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리트리플알파모[주식혼합]

2023-02-15 ~ 2023-05-14	2023-05-15 ~ 2023-08-14	2023-08-15 ~ 2023-11-14
6.22	48.16	2.40

※회전을 변동 사유 : 우선주 페어 트레이딩 등의 차익거래 전략 실행, 설정/해지 및 KOSPI200 지수 정기변경에 따른 바스켓 리밸런싱 등과 관련된 매매가 줄어 회전이 이 하락하였습니다.

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

(단위:주, %)

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

9. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등
<p>- 원금손실위험 : 이 투자신탁은 예금자보호법에 의한 보호를 받지 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있습니다. 따라서 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재하며 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전적으로 투자자가 부담하며 위탁회사나 판매회사 등 어떠한 당사자도 투자손실에 대하여 책임을 지지 않습니다. 또한 환매수수료가 부과되는 기간 중에 환매한 경우에는 환매수수료의 부과로 인해 투자손실이 발생하거나 손실의 폭이 더욱 확대될 수 있습니다.</p> <p>- 주식이격 변동위험 : 이 투자신탁은 신탁재산의 일부를 주식 및 주식관련 파생상품에 투자하므로 이 투자신탁의 성과는 시세가 항상 크게 변화하여 높은 위험을 지니는 투자대상인 주식 및 주식관련 파생상품의 시세 변화에 노출되는데 유의하여야 합니다.</p> <p>- 투자전략상 위험 : 이 투자신탁은 통신평가, 공모주 및 이벤트 활용전략, 주식시장 이례현상 활용전략, 채권투자전략 등 다양한 전략을 활용하여 수익을 추구합니다. 그러나 이러한 투자전략 실행 과정에는 투자신탁 성과에 부정적 영향을 미칠 수 있는 여러가지 변수가 존재합니다. 주식 및 주식관련 파생상품에 투자하는 과정에서 매매시 시장 충격 및 비용 지출, 상/하한가 제한, 거래 정지 등에 의해 영향을 받을 수 있습니다. 또한, 투자신탁의 대량 환매, 빈번한 설정/해지가 있을 시에도 부정적 영향을 받을 수 있습니다. 이처럼 여러가지 변수에 의해 투자전략이 실패할 수 있으며, 이로 인해 투자원금 손실이 발생할 수 있습니다.</p> <p>- 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 현금성에 제약이 발생할 수 있으며, 이는 투자신탁재산의 가치하락을 초래하여 손실을 유발합니다.</p>

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 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

<p>○ 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.</p> <p>- 주의 단계 발생 Event에 대한 자본시장 영향 분석, 운용전략의 조정</p> <p>- 위기 단계 위험관리위원회 의결(집합투자기구별(또는 유형별) 운용전략 제한, 유동성 확보계획 등 수립), 위기상황 보고체계 가동</p> <p>- 위급 단계 비상대책반 구성하여 위기 상황별 구체적 실행계획의 수립 및 시행, 위험관리위원회 및 집합투자재산평가위원회 결의, 한국금융투자협회 및 금융감독원 등 감독기관과의 대응책 모색</p> <p>○ 부실자산 발생 시 '집합투자재산평가기준'에 따라 집합투자재산평가위원회를 소집하여 관련 규정과 절차에 따라 부실자산 평가방안 등을 결정하여 신탁재산 손실의 최소화를 추구합니다.</p> <p>○ 부실자산에 대해서는 기본적으로 위험관리위원회의 결정에 따라 관리하며 필요시 Task-Force team을 구성하여 운영할 수 있습니다.</p>
--

10. 자산운용사의 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

(단위: 백만원, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
- 해당사항 없음							

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