

자산운용보고서

유리스팩포커스전문투자형사모증권투자신탁[주식혼합]

(운용기간 : 2021년08월29일 ~ 2021년11월28일)

o 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 투자에 관한 사항

향후 LG에너지솔루션, 현대엔지니어링 등 투자자들의 기대가 높은 기업들이 수요예측을 본격화 될 예정입니다. 이에 따라 공모주 시장에 대한 관심이 다시금 높아질 전망입니다. 전반적으로 높은 경쟁률을 기록하며 긍정적인 시장 분위기가 유지될 것으로 전망하고 있지만, 시장 불확실성 확대 등 리스크 요인 또한 보다 더 부각될 수 있는 환경이 조성되고 있습니다. 따라서 밸류에이션 매력이 높고 오버행 우려가 적은 기업들을 중심으로 투자자들의 수요가 편중될 것으로 예상하고 있으며, 해당 성격에 부합하는 기업들을 중심으로 수요예측에 참여, 리스크 대비 수익률을 높여갈 계획입니다. 현재 해당 펀드는 목표하는 스펙 비중을 하회하고 있습니다. 상장 스펙들의 가격이 전반적으로 하향 매입화 되었다는 점에걸, 향후 저평가된 스펙이 있는 경우 시장 매입을 진행할 계획입니다. 더불어 지속적인 스펙 수요예측 참여를 통해 목표비중까지 채워나갈 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
유리스팩포커스전문투자형사모증권(주식혼합)	-2.07	10.03	20.47	26.41
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리스팩포커스전문투자형사모증권(주식혼합)	26.41	34.31	-	-
(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	335	-1	0	0	0	0	0	0	0	0	-7	327
당기	-53	-1	0	0	0	0	0	0	0	1	-7	-60

4. 자산현황

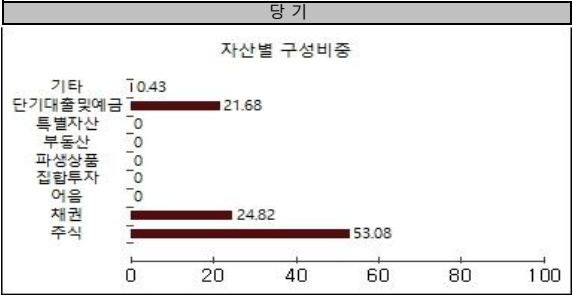
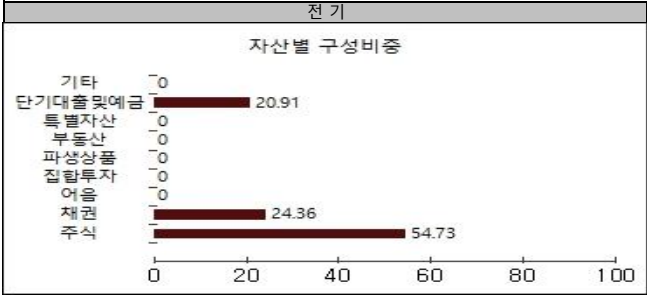
▶ 자산구성현황

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 구성비
중을 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	1,503	703	0	0	0	0	0	0	0	614	12	2,832
(1.00)	(53.08)	(24.82)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(21.68)	(0.43)	(100.00)
합계	1,503	703	0	0	0	0	0	0	0	614	12	2,832

*단위: 구성비중



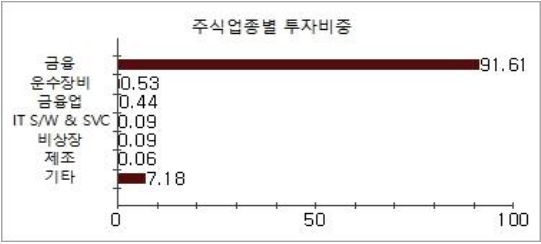
▶주식업종별 투자비중

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 나
타냅니다.

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	금융	91.61	6	제조	0.06
2	운수장비	0.53	7	기타	7.18
3	금융업	0.44			
4	IT S/W & SVC	0.09			
5	비상장	0.09			

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	단기상품	은대(국민은행)	21.68	6	주식	대신밸런스제7호스팩	4.81
2	채권	국고00750-2303(21-3)	10.51	7	주식	대신밸런스제8호스팩	4.32
3	주식	케이비제18호스팩	8.10	8	주식	미래에셋대우스팩3호	4.19
4	채권	국고03750-2206(12-3)	7.28	9	주식	케이비17호스팩	3.81
5	채권	국고01000-2306(20-3)	7.03	10	주식	케이비제19호스팩	3.26

▼ 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.

▶ 국내자산		(단위: %)		
대분류		중분류	소분류	편입비중
증권	채무증권	국채, 지방채, 특수채		-
		사채권	전환사채, 교환사채, 신주인수권부사채(분리/비분리), 이익참가부사채 등	24.82
	지분증권	주식	보통주, 종류주	53.08
		기타 지분증권	집합투자증권, 출자증권	-
	기타증권	신주인수권	신주인수권증권, 신주인수권증서	-
		기타 수익증권, 투자계약증권	-	
파생상품		장내	선도, 선물, 스왑, 옵션, 기타파생상품 등	-
		장외	선도, 선물, 스왑, 옵션, 기타파생상품 등	-
금융상품		MMDA		-
		콜론	담보콜, 신용콜, 적콜	-
		REPO	점유개정, 환매조건부	-
		정기예금	정기예금, CMA, 기타예금	21.68
		MMT		-
		발행어음		-
		기타어음(CP 제외)		-
		CD	비등락DC, 등락DC	-
		기업어음증권	비예탁CP, 예탁CP	-
		기타금융상품	기타 현금성자산	-
		FX거래	현물환(S), 선물환(W)	-
		유형자산	광물, 농·축·수산물, 운송기계(선박·항공), 원자재	-
		무형자산	지적재산권, 영업권, 공업소유권, 광업권 등	-
특별자산	대여(대출)	금전채권, 대출채권, 대출금, 대여금	-	
	신탁수익권	금전신탁, 유가증권신탁, 금전채권신탁 등	-	
	기타자산	출자금, 출자지분, 매출채권, 사업지분(권리) 등	-	
	부동산	부동산(토지·건물 등), 부동산계약관리(매매·임대 등), 부동산임대관리, 부동산위탁관리 등(부동산 실물 및 제권리 포함)	-	

주) 편입비중은 자산총액 대비 차지하는 비중을 기재한다.

▶ 해외자산				(단위: %)
대분류		중분류	소분류	편입비중
해외채무증권		국채, 지방채, 특수채		-
		사채권	전환사채, 교환사채, 신주인수권부사채(분리/비분리), 이익참가부사채 등	-
		기타채권		-
해외지분증권		주식	보통주, 종류주 모두 포함	-
		기타 지분증권	집합투자증권, 출자증권	-
		신주인수권	신주인수권증권, 신주인수권증서	-
해외파생상품		장외파생	ELS, ETN, ELW, DLS, 기타 파생결합증권 등	-
해외		집합투자증권	Mutual Fund, PEF 등	-
집합투자증권		기타증권		-
해외금융상품		콜론		-
해외		유형자산	광물, 농·축·수산물, 운송기계(선박·항공), 원자재	-
유·무형자산		무형자산	지적재산권, 영업권, 공업소유권, 광업권 등	-
해외대여		대여(대출)	금전채권, 대출채권, 대출금, 대여금	-
해외기타자산		기타자산	출자금, 출자지분, 매출채권, 사업지분(권리) 등	-
해외부동산		부동산	부동산(토지·건물 등), 부동산계약관리(매매·임대 등), 부동산임대관리, 부동산위탁관리 등(부동산 실물 및 제권리 포함)	-

주) 편입비중은 자산총액 대비 차지하는 비중을 기재한다.

▶ 시장성·비시장성 자산				(단위: %)
구분		시장성 자산	비시장성 자산	
비중(% , 자산총액기준)		100	0	

주) 금융투자업규정 시행세칙 별책서식 <제45호의6> 일반사모집합투자기구의 정기보고서 IV. 일반사모집합투자기구의 운용현황 3. 시장성·비시장성 자산 비중의 내용을 준용하여 시장성·비시장성자산 비중을 기재한다.

▶ 레버리지 비율		(단위: %)
펀드명		비중
유리스팩포커스전문투자형사모증권투자신탁(주식혼합)		0

주) 금융투자업규정 시행세칙 별책서식 <제45의6> 일반사모집합투자기구의 정기보고서 Ⅲ. 차입 등 레버리지 현황 4. 일반사모집합투자기구의 차입 등 레버리지 한도 위반여부 내용을 준용하여 순자산총액 대비 레버리지 총액 비중을 기재한다.

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		
심규민 ^{주1)}	주식운용본부 사원	1992	16	1,871	1	46	2120000562	

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
2020.06.01 ~ 현재 2019.05.29 ~ 2020.05.29		심규민 김기동

▶ 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)}	
유리스팩포커스전문투자형사모증권(주식혼합)	자산운용사	3.18	0.11	3.22	0.11	
	판매회사	3.53	0.13	3.58	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.18	0.01	0.18	0.01	
	일반사무관리회사	0.11	0.00	0.11	0.00	
	보수합계	6.99	0.25	7.09	0.25	
	기타비용 ^{주2)}		0.02	0.00	0.02	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	2.32	0.08	0.13	0.00
		조사분석업무 등	0.34	0.01	0.01	0.00
		서비스 수수료				
		합계	2.66	0.09	0.14	0.00
증권거래세		2.44	0.09	0.07	0.00	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한것입니다.

※ 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, %)

	구분	총보수·비용비율(A) ^{주1)}	매매·중개수수료비율(B) ^{주2)}	합계(A+B)
유리스팩포커스전문투자형사모증권(주식혼합)	전기	0.9923	0.202	1.1943
	당기	0.9925	0.1634	1.1559

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.

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, %)

유리스팩포커스전문투자형사모증권(주식혼합)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	20,680	61	3.94	15.62

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리스팩포커스전문투자형사모증권(주식혼합)

2021-05-29 ~ 2021-08-28	2021-05-29 ~ 2021-08-28	2021-08-29 ~ 2021-11-28
0.00	62.28	3.94

※ 회전을 변동사유: 보유 스펙 매도 감소에 따라 회전율이 하락했습니다.

8. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

(단위: 백만원, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
-	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 동 펀드가 보유한 스펙들의 거래정지 및 상장폐지 등 유동성 부족이 스펙의 합병승인과 청산 과정에서 일시적으로 발생할 수 있습니다. 더불어 공모 기업 수요예측 참여 후 상장까지 시일이 소요되는 과정에서 일시적 유동성 부족이 발생할 수 있습니다.

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등 대량 펀드 환매 시 일시적 유동성 부족에 따른 환금성 위험이 발생할 수 있습니다.

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등 해당 펀드는 일시적 유동성 부족에 따른 위험을 통제하기 위해서 펀드 설정해지 등에 따른 유동성 리스크를 상시 확인하고 있습니다. 더불어 법규, 약관 및 규약에 따른 포지션 모니터링도 진행, 설정된 수준을 초과하지 않도록 점검하고 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 해당 펀드는 환매중단, 상환연기 등이 발생할 경우 보유 자산의 유동화 노력을 통해 해결할 계획이며, 경우에 따라 자전거래 등을 진행할 수 있습니다.

▶ 다. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 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</p> <p>발생 Event에 대한 자본시장 영향 분석, 운용전략의 조정</p> <p>- 위기 단계</p> <p>위험관리위원회 의결(집합투자기구별(또는 유형별) 운용전략 제한, 유동성 확보계획 등 수립), 위기상황 보고체계 가동</p> <p>- 위기 단계</p> <p>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 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.