자산운용보고서

유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2019년09월17일 ~ 2019년12월16일)

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
- ▶ 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 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 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

1. 공지 사항

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

2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 'KEB하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 'DB금융투자, KB증권, NH투자증권, SK증권, 기업은행, 대신증권, 미래에셋대우, 부국증권, 신영증권, 유안타증권, 유진투자증권, 키움증권, 하나금융투자, 하이투자증권, 한국투자증권, 한국포스증권, 한화투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 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
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassA, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassA-e, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassA1, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-F, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P1, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P1e, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P2, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P2e, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-W, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-e, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS-P, 유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS		4등급	CH811, CH812, CH813, CL357, CH815, CH819, CH821, CH822, CH824, CH826, CH820, CH817, CH829, CH828
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형	최초설정일	2018.12.17
운용기간	2019.09.17 ~ 2019.12.16	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	DB금융투자, KB증권, NH투자증권, SK증권, 기업은행, 대신증권, 미래에셋대우, 부국증권, 신영증권, 유안타증권, 유진투자증권, 키움증권, 하나금융투자, 하이투자증권, 한국투자증권, 한국포스증권, 한화투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스

상품의 특징

1. 투자대상

이 펀드는 채권에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 주식에 투자신탁자산총액의 30% 미만으로 투자하며 블록딜 투자전략, 공모주 투자전략 등 다양한 전략을 통해 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 그러나 상기의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며 자산운용사, 신탁업자, 판매회사 등 이 펀드와 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 않습니다.

2. 투자전략

채권에의 투자는 투자신탁 자산총액의 90% 이하의 범위 내에서 국고채, 통안채, 은행채, 회사채 등에 투자하며 신용등급이 우량(AA- 이상 목표)하고 듀레이션은 1년 내외를 목표로 하여 유연한 시장대응으로 지속적이고 안정적인 이자수익과 제한된 범위 내에서 자본수익을 추구 합니다.

주식에의 투자는 투자신탁 자산총액의 30% 미만의 범위 내에서 투자하며 기존 기관투자자들의 투자영역이었던 블록딜에 참여 및 투자하여 개인투자자들에게 투자의 기회를 확대하며 철저한 리서치와 기업탐방을 통해 투자 매력도가 높은 공모주에 선별 투자하여 추가적인 수익을 추구 합니다.

가) 블록딜 투자전략
- 블록딜 대상을 상장기업으로 한정
- 네트워크 + 심층 기업분석을 통한 종목발굴
- Blind Deal을 통한 운용의 투명성 확보

나) 공모주 투자전략
- 적극적인 공모주 수요예측 참여를 통한 물량 배정 극대화 추구
- 철저한 리서치와 기업탐방을 통해 투자 매력도가 높은 공모주에 선별 투자
- 공모기업의 펀더멘탈, 기업가치, 수급상황 등을 면밀히 분석하여 자본이익 확대 가능성이 높은 우량 공모주에 선별 투자
- 적절한 매도 타이밍을 통한 공모주 프리미엄 이익 확보 및 차익실현

3. 위험관리

운용역 개인의 독단의 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회 및 위험관리위원회에서 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.

4. 수익구조

이 투자신탁은 채권에 투자신탁 자산총액의 90% 이하, 주식에 투자신탁 자산총액의 30% 미만으로 투자하여 자본소득을 추구합니다. 따라서 이 투자신탁이 투자한 주식, 채권 등의 가격변동에 따라 이익 또는 손실이 결정됩니다.

▶ 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
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용	자산 총액(A)	35,618	32,249	-9.46
	부채총액(B)	947	77	-91.86
	순자산총액(C=A-B)	34,670	32,172	-7.21
	발행 수익증권 총 수(D)	34,000	31,423	-7.58
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,019.73	1,023.84	0.40
종류(Class)별 기준가격 현황				
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A	기준가격	1,015.23	1,017.16	0.19
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A-e	기준가격	1,016.72	1,019.18	0.24
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A1	기준가격	1,015.78	1,018.48	0.27
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C	기준가격	1,011.82	1,012.24	0.04
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-F	기준가격	1,015.99	1,018.84	0.28
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1	기준가격	1,008.50	1,010.30	0.18
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1e	기준가격	1,010.02	1,012.40	0.24
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2	기준가격	1,009.72	1,011.49	0.18
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2e	기준가격	1,016.99	1,019.36	0.23
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-W	기준가격	1,016.29	1,019.23	0.29
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-e	기준가격	1,013.52	1,015.20	0.17
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/S-P	기준가격	1,011.44	1,014.36	0.29
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS	기준가격	1,006.12	1,008.46	0.23

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	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용	2019.12.17.	521	31,939	1023.84	1007.28	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassA	2019.12.17.	25	2,684	1017.16	1007.9	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassA-e	2019.12.17.	3	236	1019.18	1008.31	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC	2019.12.17.	40	10,190	1012.24	1008.3	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-e	2019.12.17.	0	49	1015.2	1006.88	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-F	2019.12.17.	2	202	1018.84	1007.3	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-W	2019.12.17.	22	1,864	1019.23	1007.29	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P1	2019.12.17.	4	645	1010.3	1003.8	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P1e	2019.12.17.	2	203	1012.4	1003.35	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P2	2019.12.17.	1	153	1011.49	1004.01	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassC-P2e	2019.12.17.	2	167	1019.36	1007.5	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS	2019.12.17.	0	10	1008.46	1002.12	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS-P	2019.12.17.	0		1014.36	1005.7	
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassA1	2019.12.17.	177	15,465	1018.48	1006.88	

주) 분배후수탁고는 재투자 792 백만좌 포함입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 펀드는 채권혼합형 펀드로서 안정적인 성과를 최우선으로 고려하여 운용해 왔고, 3개월 수익률은 +0.4%(운용 클래스 기준)를 나타내고 있습니다.
블록딜 전략으로 총 1건의 투자가 있었고, 약 +2%의 수익률을 기록하였으며 펀드 수익률에 약 0.1%정도 기여하였습니다. 12월 들어서 주식시장이 반등 분위기를 보임에 따라 블록딜 시장은 이전보다 활성화되는 모습을 보였으며, 당사의 운용전략에 맞는 블록딜 투자 대상 확보에 중점을 두었습니다.
IPO 전략으로는 총 11건의 투자가 있었고, 11건 중 9건이 플러스 수익률을 기록하였습니다. 평균 수익률은 약 40% 수준으로, 펀드 수익률에 약 0.1% 정도 기여하였습니다. 공모주 시장 참여자들이 많아짐에 따라 의미있는 물량 확보에 어려움이 있기 때문에 공모주 투자가 높은 수익률을 기여하지는 못하였습니다. 채권 부문은 안정성을 최우선적으로 운용하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

2019년 주식시장은 연중 내내 박스권 내에서 움직인 가운데, KOSPI 기준으로 7.7% 상승하며 마무리하였습니다. 글로벌 증시와 비교하면 저조한 성과를 나타냈는데, 그 원인으로는 미중 무역분쟁에 의한 피해 우려, 기업들의 실적 부진, MSCI 리밸런싱에 따른 외국인 매도세 등을 들 수 있습니다. 블록딜과 공모주 시장 역시 증시 분위기에 따라 연초와 연말에 상대적 강세를 보이고, 나머지 기간 동안은 약세 흐름을 보였습니다. 공모주의 경우, 작년 총 75개의 기업이 신규상장하였고, 신규상장 기업 공모금액은 5천억원을 모두 미달했습니다. 이는 당초 상장을 계획했던 조단위 기업들이 IPO 일정을 미뤘기 때문입니다. 과거 공모 기업 수익률은 시가총액이 클수록 양호했던 경향이 있었는데, 작년의 경우 공모 규모가 작았음에도 높은 수익률을 기록한 점은 긍정적이라고 판단합니다.
올해 전반적으로 블록딜 및 공모주 시장은 증시 분위기에 동조하여 상반기 강세, 하반기 약세 현상이 나타날 가능성이 높다고 판단되며, 이에 상반기에 집중적으로 투자를 진행하여 수익률을 개선시킬 계획입니다. 블록딜의 경우, 보호예수 기간이 지났으나 주가 하락으로 매도하지 못한 IPO 종목들의 매도 수요가 상반기에 집중될 것으로 보입니다. 이를 상반기에 적극적으로 활용해서 투자할 계획입니다. 또한 하반기에는 대주주 양도세 요건 강화에 따라 매도 수요가 클 것으로 예상되며, 하반기에는 이러한 매도 수요를 잘 활용할 계획입니다. 공모주의 경우, 2020년은 2019년에 찾아볼 수 없었던 조 단위 규모의 대어급 기업들이 순차적으로 IPO 절차에 돌입하며 공모 규모도 큰 폭으로 확대될 것으로 예상됩니다. 시가총액이 큰 기업의 경우, 펀드 기여 수익률이 높기 때문에 적극적으로 참여하여 수익률을 개선시킬 계획입니다.
채권 부문은 지속적으로 안정적 수익률을 최우선으로 운용하도록 하겠습니다.

▶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
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용	0.40	0.97	2.11	2.38
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A	0.19	0.54	1.46	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A-e	0.24	0.64	1.62	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A1	0.27	0.69	1.69	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C	0.04	0.24	1.00	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-F	0.28	0.72	1.74	1.88
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1	0.18	0.52	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1e	0.24	0.63	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2	0.18	0.51	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2e	0.23	0.63	1.63	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-W	0.29	0.74	1.77	1.92
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-e	0.17	0.49	1.39	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/S-P	0.29	0.78	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS	0.23	0.64	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용	2.38	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A-e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-F	1.88	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-W	1.92	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-e	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/S-P	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

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	23	109	0	0	0	0	0	0	0	33	-1	164
당기	29	81	0	4	0	0	0	0	0	25	-3	136

4. 자산현황

▶ 자산구성현황

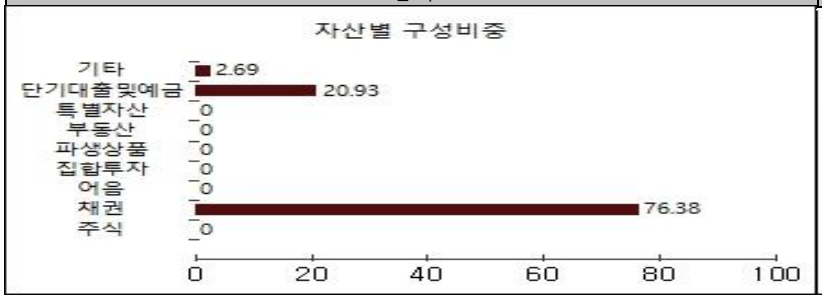
자산구성현황 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 보유하고 있는 자산의 내역을 각 자산군 및 통화별로 확인할 수 있습니다. 또한 그래프를 통해 당기말과 전기말 간의 자산별 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위:백만원,%)

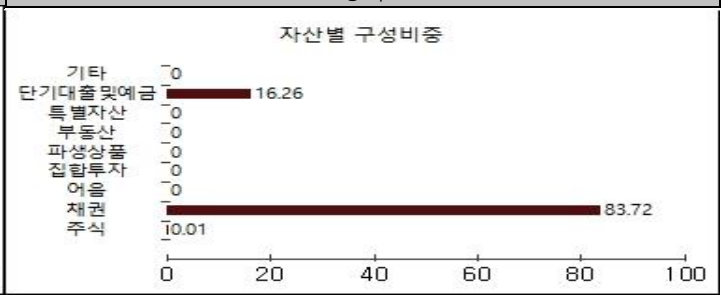
통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	4	27,000	0	0	0	0	0	0	0	5,245	0	32,249
(1.00)	(0.01)	(83.72)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(16.26)	(0.00)	(100.00)
합계	4	27,000	0	0	0	0	0	0	0	5,245	0	32,249

*(□): 구성비중

전 기



당 기



▶ 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	비상장	100.00			

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	국고02000-2112(18-9)	15.69	6	채권	국고02250-2106(18-3)	6.41
2	단기상품	REPO매수(20191216)	15.19	7	채권	통안02050-2010-02	6.26
3	채권	국고01750-2012(17-6)	14.33	8	채권	국고01750-2006(17-2)	6.22
4	채권	통안02140-2006-02	10.28	9	채권	국고02000-2003(15-1)	4.06
5	채권	통안01715-2005-01	9.86	10	채권	국고02000-2103(15-9)	3.14

▼ 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 확인할 수 있습니다.

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고02000-2112(18-9)	5,000	5,061	대한민국	KRW	2018-12-10	2021-12-10		N/A	15.69
국고01750-2012(17-6)	4,600	4,620	대한민국	KRW	2017-12-10	2020-12-10		N/A	14.33
통안02140-2006-02	3,300	3,315	대한민국	KRW	2018-06-02	2020-06-02		N/A	10.28
통안01715-2005-01	3,170	3,180	대한민국	KRW	2019-05-09	2020-05-09		N/A	9.86
국고02250-2106(18-3)	2,040	2,068	대한민국	KRW	2018-06-10	2021-06-10		N/A	6.41
통안02050-2010-02	2,000	2,019	대한민국	KRW	2018-10-05	2020-10-05		N/A	6.26
국고01750-2006(17-2)	2,000	2,004	대한민국	KRW	2017-06-10	2020-06-10		N/A	6.22
국고02000-2003(15-1)	1,300	1,309	대한민국	KRW	2015-03-10	2020-03-10		N/A	4.06
국고02000-2103(15-9)	1,000	1,013	대한민국	KRW	2016-03-10	2021-03-10		N/A	3.14

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	신한BNP자산운용	2019-12-16	4,900	1.42		대한민국	KRW

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	
김상우 주)	주식운용본부장	1968	21	1,274	2	122	**2117000860**
소정섭	주식운용2팀장	1981					2101012318
윤준수 주)	채권운용1본부장	1967	48	33,837	1	611	**2109000319**
최재영	채권운용2본부장	1972					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
없음	

▶ 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)
유리블록딜공모주증권투자신탁[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)		0.68	0.00	2.05	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	8.24	0.03	9.29	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.98	0.00	1.39	0.00
		합계	9.21	0.03	10.68	0.03
	증권거래세		4.62	0.02	6.18	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A	자산운용사		3.21	0.10	3.15	0.10
	판매회사		3.21	0.10	3.15	0.10
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.24	0.01	0.24	0.01
	일반사무관리회사		0.16	0.01	0.16	0.00
	보수합계		6.83	0.21	6.70	0.21
	기타비용 주2)		0.09	0.00	0.20	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.84	0.03	0.87	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.10	0.00	0.13	0.00
		합계	0.95	0.03	1.00	0.03
	증권거래세		0.49	0.02	0.58	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A-e	자산운용사		0.20	0.10	0.17	0.10
	판매회사		0.10	0.05	0.08	0.05
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.02	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.00
	보수합계		0.33	0.16	0.27	0.16
	기타비용 주2)		0.00	0.00	0.01	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.04	0.02	0.04	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.01	0.00
		합계	0.04	0.02	0.04	0.03
	증권거래세		0.02	0.01	0.03	0.01
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A1	자산운용사		11.55	0.10	15.19	0.10
	판매회사		2.89	0.03	3.80	0.02
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.87	0.01	1.14	0.01
	일반사무관리회사		0.58	0.01	0.76	0.00
	보수합계		15.88	0.14	20.89	0.14
	기타비용 주2)		0.34	0.00	1.04	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	3.38	0.03	4.19	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.39	0.00	0.63	0.00
		합계	3.78	0.03	4.83	0.03
	증권거래세		1.87	0.02	2.82	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C	자산운용사		10.33	0.10	11.25	0.10
	판매회사		25.83	0.25	28.12	0.25
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.77	0.01	0.84	0.01
	일반사무관리회사		0.52	0.01	0.56	0.00
	보수합계		37.45	0.37	40.77	0.36
	기타비용 주2)		0.30	0.00	0.73	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	2.68	0.03	2.93	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.31	0.00	0.43	0.00
		합계	2.99	0.03	3.37	0.03
	증권거래세		1.49	0.01	1.92	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-F	자산운용사		0.20	0.10	0.20	0.10
	판매회사		0.02	0.01	0.02	0.01
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.02	0.01	0.02	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.00
	보수합계		0.25	0.12	0.25	0.12
	기타비용 주2)		0.01	0.00	0.01	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.05	0.03	0.06	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.01	0.00
		합계	0.06	0.03	0.06	0.03
	증권거래세		0.03	0.02	0.04	0.02

유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1	자산운용사		0.61	0.10	0.64	0.10
	판매회사		0.68	0.11	0.72	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.05	0.01	0.05	0.01
	일반사무관리회사		0.03	0.01	0.03	0.00
	보수합계		1.36	0.23	1.44	0.22
	기타비용[주2)]		0.02	0.00	0.04	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.16	0.03	0.17	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.00	0.03	0.00
		합계	0.18	0.03	0.20	0.03
	증권거래세		0.09	0.02	0.12	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1e	자산운용사		0.23	0.10	0.21	0.10
	판매회사		0.13	0.06	0.11	0.05
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.02	0.01	0.02	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.00
	보수합계		0.38	0.17	0.35	0.17
	기타비용[주2)]		0.01	0.00	0.01	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.06	0.03	0.06	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.01	0.00
		합계	0.07	0.03	0.07	0.03
	증권거래세		0.04	0.02	0.04	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2	자산운용사		0.19	0.10	0.16	0.10
	판매회사		0.22	0.12	0.19	0.11
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.00
	보수합계		0.43	0.23	0.37	0.23
	기타비용[주2)]		0.01	0.00	0.01	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.05	0.02	0.04	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.01	0.00
		합계	0.05	0.03	0.05	0.03
	증권거래세		0.03	0.01	0.03	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2e	자산운용사		0.23	0.10	0.17	0.10
	판매회사		0.13	0.06	0.10	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.02	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.00
	보수합계		0.38	0.17	0.29	0.17
	기타비용[주2)]		0.01	0.00	0.01	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.05	0.02	0.05	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.01	0.00
		합계	0.06	0.03	0.05	0.03
	증권거래세		0.03	0.01	0.03	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-W	자산운용사		3.43	0.10	3.05	0.10
	판매회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.26	0.01	0.23	0.01
	일반사무관리회사		0.17	0.01	0.15	0.00
	보수합계		3.85	0.11	3.43	0.11
	기타비용[주2)]		0.09	0.00	0.17	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.87	0.03	0.85	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.11	0.00	0.13	0.00
		합계	0.98	0.03	0.98	0.03
	증권거래세		0.51	0.02	0.57	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-e	자산운용사		0.18	0.10	0.09	0.10
	판매회사		0.23	0.13	0.12	0.12
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.00	0.00
	보수합계		0.43	0.24	0.22	0.24
	기타비용[주2)]		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.05	0.03	0.02	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.00	0.00
		합계	0.05	0.03	0.02	0.02
	증권거래세		0.03	0.02	0.01	0.01
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/S-P	자산운용사		0.00	0.10	0.00	0.09
	판매회사		0.00	0.03	0.00	0.02
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.00
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.13	0.00	0.11
	기타비용[주2)]		0.00	0.00	0.00	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.03	0.00	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.01	0.00	0.00
		합계	0.00	0.03	0.00	0.03
	증권거래세		0.00	0.02	0.00	0.02
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS	자산운용사		0.00	0.10	0.01	0.10
	판매회사		0.00	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		0.00	0.16	0.01	0.17
	기타비용[주2)]		0.00	0.00	0.00	0.01
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.03	0.00	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.03	0.00	0.04
	증권거래세		0.00	0.02	0.00	0.02

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역 : 없음

※ 발행분담금내역 : 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	총보수·비용비율(A) 주1)	매매·중개수수료비율(B) 주2)	합계(A+B)
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용	전기	0.007	0.1809	0.1879
	당기	0.0141	0.1569	0.171
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A	전기	0.8588	0.1872	1.046
	당기	0.8646	0.1661	1.0307
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A-e	전기	0.6564	0.2183	0.8747
	당기	0.6606	0.1981	0.8587
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/A1	전기	0.5606	0.1721	0.7327
	당기	0.5694	0.1485	0.7179
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C	전기	1.4602	0.1596	1.6198
	당기	1.4674	0.1414	1.6088
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-F	전기	0.4964	0.2143	0.7107
	당기	0.5013	0.1918	0.6931
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1	전기	0.9102	0.1368	1.047
	당기	0.9184	0.131	1.0494
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P1e	전기	0.6778	0.2328	0.9106
	당기	0.6838	0.1976	0.8814
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2	전기	0.9193	0.1243	1.0436
	당기	0.9264	0.1249	1.0513
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-P2e	전기	0.6882	0.1979	0.8861
	당기	0.6943	0.1723	0.8666
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-W	전기	0.4575	0.214	0.6715
	당기	0.4609	0.1943	0.6552
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/C-e	전기	0.9581	0.211	1.1691
	당기	0.9607	0.1799	1.1406
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C/S-P	전기	0.5376	0.1367	0.6743
	당기	0.523	0.1332	0.6562
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_ClassS	전기	0.6584	0.1274	0.7858
	당기	0.7091	0.1419	0.851

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.

7. 투자자산매매내역

매매주식 규모 및 회전율 표와 최근 3분기 매매회전율 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 0.25%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위:백만원, %)

유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용

매수		매도		매매회전율 주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
60,871	2,232	75,126	2,456	10045.93	40294.12

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

(단위: %)

유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_운용

2019-03-17 ~ 2019-06-16	2019-06-17 ~ 2019-09-16	2019-09-17 ~ 2019-12-16
2775.32	14568.25	10045.93

※ 회전율 변동 사유: 당 분기 투자 횟수가 지난 분기 대비 줄어듦에 따라 회전율이 감소하였습니다.

8. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

(단위 : 백만원, %)

펀드명칭	투자금액	수익률
유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C-F	200	0.28

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