

자산운용보고서

유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]

(운용기간 : 2024년03월17일 ~ 2024년06월16일)

○ 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

2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리를록딜공모주증권투자신탁(채권혼합)의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 'DB금융투자, NH투자증권, 기업은행, 대신증권, 미래에셋증권, 부국증권, 삼성증권, 신영증권, 신한은행, 유안타증권, 키움증권, 하나은행, 하나증권, 한국투자증권, 한국포스증권, 한화투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

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
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-e, 유리블록딜공모주증권투자신탁(채권혼합)_ClassS, 유리블록딜공모주증권투자신탁(채권혼합)_ClassS-P		5등급	CH811, CH812, CH813, CL357, CH815, CH819, CH821, CH822, CH824, CH826, CH817, CH828, CH829	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형	최초설정일	2018.12.17	
운용기간	2024.03.17 ~ 2024.06.16	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음	
레버리지(차입 등) 한도	-			
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	하나은행	
판매회사	DB금융투자, NH투자증권, 기업은행, 대신증권, 미래 에셋증권, 부국증권, 삼성증권, 신영증권, 신한은행, 유안타증권, 키움증권, 하나은행, 하나증권, 한국투자 증권, 한국포스증권, 한화투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	이 투자신탁은 채권을 주된 투자대상 자산으로 하여 자산총액의 90% 이하의 범위 내에서 안정적인 수익을 추구하는 것을 목적 으로 하며, 자산총액의 30% 미만의 범위 내에서 블록딜 및 공모주에 투자하여 추가수익을 추구합니다.			

▶ **재산현황**

(단위: 백만원, 백만좌, %)

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
유리블록딜공모주증권투자신탁(채권혼합)_운용	자산 총액(A)	6,107	3,658	-40.09
	부채총액(B)	0	18	18665.44
	순자산총액(C=A-B)	6,107	3,640	-40.39
	발행 수익증권 총 수(D)	5,668	3,344	-41.00
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,077.48	1,088.67	1.04
종류(Class)별 기준가격 현황				
C/A	기준가격	1,076.71	1,086.45	0.90
C/A-e	기준가격	1,077.54	1,087.62	0.94

C/A1	기준가격	1,076.13	1,086.25	0.94
C/C	기준가격	1,075.97	1,084.73	0.81
C/C-F	기준가격	1,076.63	1,086.91	0.95
C/C-P1	기준가격	1,072.25	1,081.87	0.90
C/C-P1e	기준가격	1,072.23	1,082.23	0.93
C/C-P2	기준가격	1,072.44	1,082.04	0.90
C/C-P2e	기준가격	1,076.58	1,086.60	0.93
C/C-e	기준가격	1,075.41	1,084.97	0.89
C/S	기준가격	1,071.39	1,081.93	0.98
C/S-P	기준가격	1,075.06	1,085.48	0.97

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.

▶ 펀드의 투자전략

투자전략
<p>가) 채권 : 투자신탁 자산총액의 90% 이하의 범위 내에서 국고/통안채, 은행채, 회사채 등에 투자하며, 신용등급이 우량(AA- 이상 목표)하고, 듀레이션은 1년 내외를 목표로 하여 유연한 시장대응으로 지속적이고 안정적인 이자수익과 제한된 범위 내에서 자본수익 추구</p> <p>나) 주식 : 투자신탁 자산총액의 30% 미만의 범위 내에서 투자하며, 기존 기관투자자들의 투자영역이었던 블록딜(Block Deal, 상장기업 대상)에 참여 및 투자하여 개인투자자들에게 투자의 기회를 확대하며, 철저한 리서치와 기업탐방을 통해 투자매력도가 높은 공모주에 선별 투자하여 추가수익 추구</p> <p>① 블록딜(Block Deal) 투자전략</p> <ul style="list-style-type: none"> - 블록딜 대상을 상장기업으로 한정 - 네트워크 + 심층 기업분석을 통한 종목발굴 - Blind Deal을 통한 운용의 투명성 확보 <p>② 공모주 투자전략</p> <ul style="list-style-type: none"> - 적극적인 공모주 수요예측 참여를 통한 물량 배정 극대화 추구 - 철저한 리서치와 기업탐방을 통해 투자 매력도가 높은 공모주에 선별 투자 - 공모기업의 펀더멘털, 기업가치, 수급상황 등을 면밀히 분석하여 자본이익 확대 가능성이 높은 우량 공모주에 선별 투자 - 적절한 매도 타이밍을 통한 공모주 프리미엄 이익 확보 및 차익실현

위험관리
<p>운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회 및 위험관리위원회에서 결정합니다.</p> <p>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.</p>

수익구조
<p>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.</p>

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

<p>동 펀드는 안정적인 채권수익률을 기반으로 블록딜 및 공모주 투자를 통해 추가적인 절대수익을 추구하고 있으며 최근 3개월 수익률은 +1.04%(운용클래스 기준)입니다. 주식 기여수익률은 +0.16%, 채권 기여수익률은 +0.67%, 기타(유동 등) 기여수익률은 +0.21%입니다.</p> <p>해당 기간 블록딜 전략으로 투자 내역은 없습니다. 블록딜 시장은 불투명한 증시 전망으로 인해 전년 대비 매력적인 조건의 블록딜 건수가 급감한 상황으로, 불확실한 시장 상황 하에서 보수적인 관점으로 블록딜 투자에 임하였습니다.</p> <p>공모주 전략으로는 해당 기간 총 19건의 투자가 있었고, 평균 수익률은 약 78.9% 수준으로, 펀드 수익률에 약 +0.23% 정도 영향을 끼쳤습니다. '24년 4월~6월 공모주 시장은 16개 신규상장 기업 중 1개 기업을 제외한 모든 기업이 공모가 대비 높은 가격에서 상장일 시초가가 형성되며 불확실한 주식시장 상황 속에서도 긍정적인 공모주 시장 분위기가 유지되는 모습을 보였습니다.</p>
--

▶ 투자환경 및 운용 계획

블록딜 시장의 경우, 불투명한 증시 전망으로 인해 전년 대비 매력적인 조건의 블록딜 건수가 급감한 상황으로 간혹 나오는 블록딜 건수들도 주가, 밸류에이션, 수급 부담이 있는 종목들 위주로 시장에 나오고 있는 상황입니다. 해당 부담이 있는 종목의 경우 블록딜 물량이 출회되며 심한 주가 하락이 초래될 가능성이 높아 보수적 관점의 접근이 필요합니다. 향후 보호예수 기간이 지난 IPO 종목, 메자닌 전환, 지배구조 관련 주요주주 물량 등 블록딜 매도 수요가 지속 발생할 것으로 기대하고 있습니다. 이와 관련된 퍼블릭딜이 발생할 경우 해당 종목에 대한 면밀한 분석을 통해 선별적으로 딜에 참여하여 꾸준한 절대수익을 창출할 수 있도록 노력하겠습니다.

공모주 시장은 글로벌 경기 불확실성 증가, 지정학적 리스크 지속 등 이슈로 인해 증시 전망이 불투명함에 따라 갑작스러운 악재 발발 시 현재 과열된 공모주 시장 분위기가 급격히 냉각될 수 있습니다. 따라서 밸류에이션과 상장일 유통물량 부담이 높은 기업들의 수요예측은 항상 보수적으로 접근하되 공모주 시장 분위기에 유연하게 대응하며 공모주 투자 수익을 극대화하기 위해 노력할 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
유리블록딜공모주증권투자신탁 [채권혼합]_운용	1.04	2.51	4.19	5.41
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
C/A	0.90	2.24	3.78	4.86
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/A-e	0.94	2.30	3.87	4.99
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/A1	0.94	2.31	3.89	5.00
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C	0.81	2.06	3.50	4.48
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-F	0.95	2.34	3.93	5.06
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P1	0.90	2.23	3.75	4.82
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P1e	0.93	2.30	3.86	4.97
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P2	0.90	2.22	3.75	4.81
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P2e	0.93	2.29	3.86	4.96
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-e	0.89	2.21	3.73	4.79
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/S	0.98	2.35	3.91	5.02
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/S-P	0.97	2.35	3.94	5.07
(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
유리블록딜공모주증권투자신탁 [채권혼합]_운용	5.41	9.00	8.87	15.74
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
C/A	4.86	7.86	6.97	11.80
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/A-e	4.99	8.12	7.42	12.72
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-

C/A1	5.00	8.16	7.51	13.04
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C	4.48	7.08	5.69	9.15
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-F	5.06	8.29	7.71	13.38
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P1	4.82	7.79	6.87	11.58
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P1e	4.97	8.09	7.37	12.62
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P2	4.81	7.77	6.84	11.53
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-P2e	4.96	8.08	7.34	12.57
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/C-e	4.79	7.73	6.75	11.35
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/S	5.02	8.14	7.84	13.19
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C/S-P	5.07	8.28	7.65	13.39
(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	35	34	0	0	0	0	0	0	0	9	0	78
당기	10	37	0	0	0	0	0	0	0	12	0	58

4. 자산현황

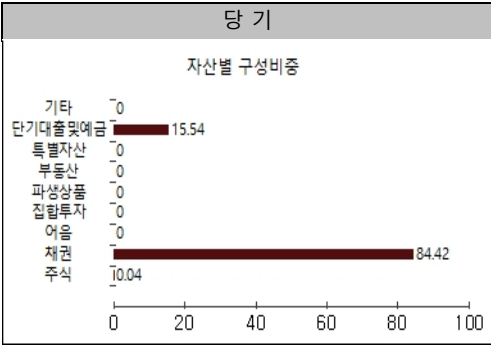
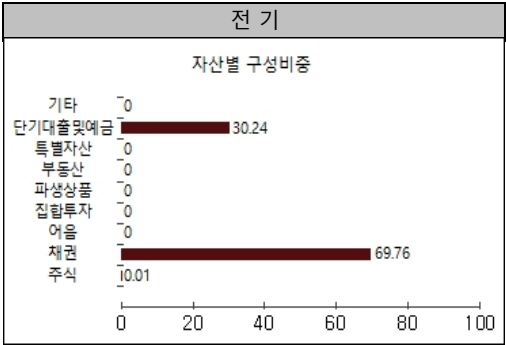
▶ 자산구성현황

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	2	3,088	0	0	0	0	0	0	0	568	0	3,658
(1.00)	(0.04)	(84.42)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(15.54)	(0.00)	(100.00)
합계	2	3,088	0	0	0	0	0	0	0	568	0	3,658

*(): 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 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	국고03625-2509(23-8)	77.54	6	주식	라메디텍공모(보)	0.01
2	단기상품	은대(KEB하나은행)	15.54	7	주식	씨어스테크놀로지공모(보)	0.01
3	채권	통안03730-2411-01	5.50	8	주식	에스오에스랩공모(보)	0.01
4	채권	국고03375-2503(23-3)	1.38				
5	주식	한중엔시에스공모(보)	0.02				

▼ 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
한중엔시에스공모(보)	21	1	0.0	대한민국	KRW	전문기술	
라메디텍공모(보)	22		0.0	대한민국	KRW	기타	
씨어스테크놀로지공모(보)	19		0.0	대한민국	KRW	기타	
에스오에스랩공모(보)	26		0.0	대한민국	KRW	기타	

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
국고03625-2509(23-8)	2,800	2,837	대한민국	KRW	2023-09-10	2025-09-10		N/A	77.54
통안03730-2411-01	200	201	대한민국	KRW	2023-11-09	2024-11-09		N/A	5.50
국고03375-2503(23-3)	50	50	대한민국	KRW	2023-03-10	2025-03-10		N/A	1.38

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	하나은행	2018-12-17	568	2.99	-	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	
최재영 ^{주)}	채권운용본부장	1972	33	32,335	0	0	2109000709
김기동 ^{주)}	주식운용본부장	1985	18	1,324	0	0	2117000860

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
2023.08.11 ~ 현재 2020.06.02 ~ 현재 2018.12.27 ~ 2023.08.10 2020.06.02 ~ 2023.08.10	김기동(책임) 최재영(책임) 김상우(책임) 김기동(부책임)

▶ 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)}
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)}		0.06	0.00	0.06	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.10	0.00	0.23	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.02	0.00	0.01	0.00
		합계	0.12	0.00	0.24	0.00
증권거래세		0.13	0.00	0.05	0.00	
C/A	자산운용사		0.15	0.06	0.13	0.06
	판매회사		0.15	0.06	0.13	0.06
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.02	0.01	0.02	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.01	0.01	0.01
	보수합계		0.32	0.13	0.29	0.13
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.01	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.00	0.01	0.00
증권거래세		0.01	0.00	0.00	0.00	
C/A-e	자산운용사		0.01	0.06	0.02	0.06
	판매회사		0.00	0.03	0.01	0.03
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.01	0.10	0.03	0.10
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.00
증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00	
C/A1	자산운용사		1.92	0.06	1.84	0.06
	판매회사		0.80	0.02	0.77	0.03
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.24	0.01	0.23	0.01
	일반사무관리회사		0.16	0.01	0.15	0.01
	보수합계		3.12	0.10	2.99	0.10
	기타비용 ^{주2)}		0.05	0.00	0.05	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.06	0.00	0.12	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.01	0.00	0.00	0.00
		합계	0.07	0.00	0.12	0.00
증권거래세		0.08	0.00	0.02	0.00	
	자산운용사		0.22	0.06	0.06	0.06
	판매회사		0.54	0.15	0.14	0.15
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.03	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.02	0.01	0.00	0.01
	보수합계		0.80	0.22	0.21	0.22

C/C	기타비용 ^{주2)}		0.01	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.00	0.00	0.00
	증권거래세		0.01	0.00	0.00	0.00
C/C-F	자산운용사		0.14	0.06	0.14	0.06
	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	0.01
	보수합계		0.19	0.08	0.19	0.08
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.01	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.00	0.01	0.00
	증권거래세		0.01	0.00	0.00	0.00
C/C-P1	자산운용사		0.19	0.06	0.19	0.06
	판매회사		0.21	0.07	0.22	0.07
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.02	0.01	0.02	0.01
	일반사무관리회사		0.02	0.01	0.02	0.01
	보수합계		0.44	0.14	0.45	0.14
	기타비용 ^{주2)}		0.01	0.00	0.01	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.00	0.01	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.00	0.01	0.00
	증권거래세		0.01	0.00	0.00	0.00
C/C-P1e	자산운용사		0.22	0.06	0.67	0.06
	판매회사		0.12	0.03	0.36	0.03
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.03	0.01	0.08	0.01
	일반사무관리회사		0.02	0.01	0.06	0.01
	보수합계		0.39	0.10	1.17	0.11
	기타비용 ^{주2)}		0.01	0.00	0.02	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.00	0.05	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.00	0.05	0.00
	증권거래세		0.01	0.00	0.01	0.00
C/C-P2	자산운용사		0.07	0.06	0.07	0.06
	판매회사		0.08	0.07	0.08	0.07
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.01	0.01
	보수합계		0.16	0.14	0.17	0.14
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.01	0.00
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
C/C-P2e	자산운용사		0.07	0.06	0.07	0.06
	판매회사		0.04	0.03	0.04	0.04
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.01	0.01	0.01	0.01
	일반사무관리회사		0.01	0.00	0.01	0.01
	보수합계		0.12	0.11	0.12	0.11
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00

	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.01	0.00
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
C/C-e	자산운용사		0.27	0.06	0.19	0.06
	판매회사		0.34	0.07	0.24	0.08
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.03	0.01	0.02	0.01
	일반사무관리회사		0.02	0.01	0.02	0.01
	보수합계		0.67	0.15	0.47	0.15
	기타비용 ^{주2)}		0.01	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.01	0.00	0.01	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.01	0.00	0.01	0.00
	증권거래세		0.01	0.00	0.00	0.00
C/S	자산운용사		0.00	0.06	0.00	0.06
	판매회사		0.00	0.04	0.00	0.03
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.00	0.01	0.00	0.01
	일반사무관리회사		0.00	0.00	0.00	0.00
	보수합계		0.00	0.11	0.00	0.10
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.00
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
C/S-P	자산운용사		0.00	0.06	0.00	0.05
	판매회사		0.00	0.02	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	0.09	0.00	0.08
	기타비용 ^{주2)}		0.00	0.00	0.00	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	0.00	0.00	0.00	0.00
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 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.

※ ESG관련내역 : 없음

▶ 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	0.0044	0.0089	0.0133
	당기	0.0042	0.0168	0.021
C/A	전기	0.5356	0.0097	0.5453
	당기	0.5355	0.0175	0.553
C/A-e	전기	0.4089	0.0087	0.4176
	당기	0.4118	0.0176	0.4294
C/A1	전기	0.3967	0.009	0.4057
	당기	0.3965	0.0162	0.4127
C/C	전기	0.8962	0.0085	0.9047
	당기	0.8938	0.015	0.9088

C/C-F	전기	0.3358	0.009	0.3448
	당기	0.3355	0.0175	0.353
C/C-P1	전기	0.5665	0.009	0.5755
	당기	0.5663	0.0175	0.5838
C/C-P1e	전기	0.4262	0.0074	0.4336
	당기	0.4264	0.0176	0.444
C/C-P2	전기	0.5738	0.009	0.5828
	당기	0.5736	0.0175	0.5911
C/C-P2e	전기	0.4338	0.009	0.4428
	당기	0.4337	0.0175	0.4512
C/C-e	전기	0.5961	0.0088	0.6049
	당기	0.5955	0.0183	0.6138
C/S	전기	0.4265	0.0092	0.4357
	당기	0.4086	0.0041	0.4127
C/S-P	전기	0.3479	0.0086	0.3565
	당기	0.3184	0.0091	0.3275

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 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, %)

유리블록딜공모주증권투자신탁(채권혼합)_운용

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	439	25	318.16	1262.27

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

(단위: %)

유리블록딜공모주증권투자신탁(채권혼합)_운용

2023-09-17 ~ 2023-12-16	2023-12-17 ~ 2024-03-16	2024-03-17 ~ 2024-06-16
639.63	1311.59	318.16

※회전을 변동 사유 : 이전 기간 대비 공모주 배정금액이 감소하여 매매회전율이 감소하였습니다.

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

- 블록딜 투자위험: 이 투자신탁은 블록딜 전략을 활용하여 수익을 추구합니다. 그러나 투자전략 실행 과정에서 투자신탁 성과에 부정적인 영향을 미칠 수 있습니다. 또한 블록딜 전략 실행 과정에서 시장 참여자들의 경쟁으로 유리한 가격에 그리고 충분한 물량을 취득하는데 있어서도 제약이 있을 수 있습니다.
- 공모주 투자위험: 이 투자신탁은 운용전략에 따라 공모주에 투자하며, 공모주는 기존의 주식보다 큰 가격변동성을 지닐 수 있습니다. 또한 공모주 물량은 한정되어 있어서 동일한 거래를 하려는 시장 참여자들의 경쟁으로 유리한 가격에 그리고 충분한 물량을 취득하는데 있어서도 제약이 될 수 있습니다. 그리고 공모주는 보다 유리한 가격과 더 많은 물량을 확보하기 위하여 일정기간 매도금지 규정(Lock-up)에 종속될 수 있으며, 이 기간 동안 추가적으로 가격이 하락하여 투자자는 투자원금액의 손실이 발생할 수 있습니다.
- 유동성 위험: 투자신탁재산으로 보유하고 있는 종목이 매도금지(Lock-up), 유통주식수 부족, 거래정지, 상장폐지 등의 사유로 거래가 시장에서 충분하게 이루어지지 않을 경우 현금성에 제약이 발생할 수 있으며, 이는 투자신탁재산의 가치하락을 초래하여 손실을 유발합니다.

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등
- 해당사항 없음

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등
<p>- 블록딜 투자는 거래투명성 확보를 위해 퍼블릭딜 위주로 종목 수급상황, 펀더멘털 등을 면밀히 분석한 후 선별적으로 투자를 하고 있습니다. 또한 블록딜 물량 배정 이후 단기간 내 매도하여 주식 보유 위험을 최소화하고 있습니다.</p> <p>- 공모주는 투자대상 선정 시 섹터 매니저의 철저한 리서치를 바탕으로 본부 차원에서 공모참여 의사결정을 수행하여 투자대상을 평가, 선별합니다. 상장 이후에는 확약 등을 고려한 매도 가능일 직후 단기간 내 매도하는 것을 원칙으로 합니다.</p> <p>- 혼합채권형 펀드로서 보유 채권의 가격 하락 위험을 관리하기 위하여 신탁재산의 가중평균만기를 시장에 따라 탄력적으로 대응하되 1년 내외에서 관리하며 국채, 통안채, 은행채(AAA), 특수채(AAA) 등의 유동성이 풍부하고 우량한 채권 위주로 투자하고 있습니다.</p>

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등
- 해당사항 없음

3. 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등
- 해당사항 없음

▶ 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</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>- 위급 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 투자 및 회수에 관한 사항

(단위: 백만원, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
유리블록딜공모주증권투자신탁 [채권혼합]_운용	의무투자	2018-12-17	200	-	-	200	14.69

- 주1) 투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매)될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.
- 주2) 수익률은 작성일 기준 시점의 자산운용사의 고유재산이 실제로 투자된 '유리블록딜공모주증권투자신탁[채권혼합]_C-F'의 투자금액(잔고)에 대한 평가수익률로 산정하며 소수점 둘째자리까지 표시하였습니다.
- 주3) 투자금 및 투자잔액은 원본액 기준으로 작성하였습니다.
- 주4) 「금융투자업규정」 제7-1조의2에 의거하여, 당사 고유재산 의무투자기간이 2021.12.16 (투자일로부터3년) 종료됨을 안내 드립니다. 의무투자기간의 종료가 자금의 회수를 의미하는 것은 아니며, 의무투자기간 경과 후 당사는 「금융투자업규정」에서 정하는 방법에 따라 투자금을 회수할 수 있습니다. 투자금 회수시 회수결과를 자산운용보고서에 기재하고 당사 홈페이지를 통해 공시할 예정입니다.