자산운용보고서

유리중장기종합채권증권투자신탁[채권]

(운용기간 : 2024년03월18일 ~ 2024년06월17일)

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
- ▶ 펀드의 투자전략

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 동일 집합투자기구에 대한 투자현황

- ▶ 투자현황

9 위험현황 및 관리방안

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

2. 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리중장기종합채권증권투자신탁[채권]의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사인 'KB증권, 부국증권'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	고난도 펀드
유리중장기종합채권증권투자신탁[채권]운용, 유리중장기종합채권증권투자신탁[채권]A, 유리중장기종합채권증권투자신탁[채권]C-F		5등급	E6061, E6062, E6066	해당사항 없음
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(채권형), 개방형, 추가형, 종류형	최초설정일	2023.09.18	
운용기간	2024.03.18 ~ 2024.06.17	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음	
레버리지(차입 등) 한도	-			
자산운용회사	유리자산운용	펀드재산보관회사	한국씨티은행	
판매회사	KB증권, 부국증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	이 투자신탁은 국고채, 회사채, 은행채, 지방채, 특수채 등 우량등급의 국내채권에 투자신탁재산의 대부분을 투자하여 안정적인 이자수익 및 비교지수 대비 초과수익을 추구하고자 합니다.			

▶ 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
유리중장기종합채권증권[채권]운용	자산 총액(A)	143,491	148,263	3.33
	부채총액(B)	32,037	34,606	8.02
	순자산총액(C=A-B)	111,454	113,657	1.98
	발행 수익증권 총 수(D)	105,569	105,536	-0.03
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,055.75	1,076.95	2.01
종류(Class)별 기준가격 현황				
A	기준가격	1,063.86	1,085.21	2.01
C-F	기준가격	1,055.12	1,075.98	1.98

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
- 기본전략 : 철저한 BM(KIS종합채권지수)분석 하 시장상황에 따른 유연한 대응으로 이자 및 자본 수익 + @추구 - 듀레이션 전략 • 경제동향 및 통화정책 분석을 기반으로 채권 금리의 방향성을 예측하여 BM듀레이션(약 5.6년) +/- 30% 수준에서 탄력적인 듀레이션 조절 • 중장기적 금리전망 및 투자전략에 따라 벤치마크 대비 채권투자비중을 조정 - 커브 전략 • 한국은행 통화정책 방향, 기획재정부 국채발행 계획, 경제 펀더멘탈을 고려한 수익률곡선 분석 : 만기별 채권의 금리 변동성을 파악하여 포트폴리오 구성 • 만기별 비중 조절 전략 수립으로 통한 수익 극대화 - 섹터 및 종목선택 전략 • 신용 채권간의 스프레드 분석을 통한 섹터간/섹터내 저평가 채권 투자 - 상대가치매매 전략 • 저평가 채권은 매수하고 고평가 채권은 매도한 후 저평가/고평가 해소시 교체매매를 통하여 초과수익 달성 • 무리한 듀레이션 변화를 지양하고 안정적인 초과수익 달성 및 수익률 방어에 활용 : 유사 만기 종목간의 교체를 통하여 포트폴리오의 커브 변동성과 리스크를 최소화하면서 유동성 확보 등

위험관리
- 전문 크레딧 분석 인력과 프로세스를 활용하여 엄선된 우량종목에 투자 - 편입종목에 대한 정기/수시 모니터링을 통해 신용리스크 사전통제와 사후관리

수익구조
이 투자신탁은 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 투자자의 주된 이익 또는 손실이 결정됩니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

1~3월 미 CPI가 3개월 연속 컨센서스를 상회하며 연내 기준금리 인하에 대한 기대를 낮춘 가운데 미 경제 호조세가 계속된 여파로 2분기 초까지 시장금리는 상승세를 거듭하였습니다. 그러나 이후 고용지표를 제외한 경제지표가 둔화움직임을 보이는 가운데 ECB와 BOC등 주요국의 금리 인하가 시작되고, 한국 역시 3개월내 인하에 대한 소수의견이 유지되면서 채권시장은 안정세를 나타냈습니다. 특히 6월에는 한미 물가 둔화세가 조금 더 뚜렷해지는 가운데 선제적 기준금리 인하 주장이 대두되며 2분기 채권시장은 전분기말 국고 3년과 10년물이 각각 -14.2bp하락하는 등 강세로 마감하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

유로존, 캐나다, 스위스 등 선진국 중앙은행들이 기준금리 인하를 단행했던 가운데 美 경제 및 물가지표가 예상치를 하회하는 모습을 보이며 9월 연준의 기준금리 인하 가능성이 부각됨에 따라 글로벌 채권금리는 하향 안정되었습니다. 특히 국내 채권시장의 경우 대통령실과 여당에서 금리인하를 압박하는 양상이 연출되며 7월 인하 소수의견 등장, 8월 인하 기대감이 형성되었고 채권금리가 작년말 저점 수준까지 하락하는 랠리를 보였습니다. 금융시장은 9월 연준의 첫 금리인하 가능성을 70% 수준으로 프라이싱하며 연내 2회 정도 인하, 국내 시장 또한 연내 한은의 1회 초과 수준의 인하를 금리에 반영하고 있어 경제 및 물가지표에 따라 변동성은 확대될 수 있습니다.

현재 금리는 연내 기준금리 인하를 1회 이상 기반영한 수준이며 미 경제 지표 둔화로 한/미 기준금리 인하 가능성 자체에 대한 기대는 높아진 상황입니다. 다만, 통화정책을 지나치게 선 반영한 시장에 대한 대응과 추가 펀더멘털 지표를 확인하기 이전까지 3Q보다 4Q 국내 기준금리 인하가 조금 더 유력하다는 판단으로 중립에 가까운 스탠스를 유지하되 분기중 금리 상승시마다 포지션을 확대할 계획입니다.

▶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
유리중장기종합채권증권[채권]운용	2.01	3.09	7.69	-
(비교지수 대비 성과)	(0.24)	(0.59)	(1.24)	-
종류(Class)별 현황				
A	2.01	3.09	-	-
(비교지수 대비 성과)	(0.24)	(0.59)	-	-

C-F	1.98	3.03	7.60	-
(비교지수 대비 성과)	(0.21)	(0.53)	(1.15)	-
비교지수(벤치마크)	1.77	2.50	6.45	-

주)비교지수(벤치마크): KIS 종합채권 만기종합 X 100%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
유리중장기종합채권증권[채권]운용	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
A	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
C-F	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주)비교지수(벤치마크): KIS 종합채권 만기종합 X 100%

※ 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	0	1,044	355	0	-27	0	0	0	0	-198	-3	1,171
당기	0	2,246	286	0	3	0	0	0	0	-293	-5	2,237

4. 자산현황

▶ 자산구성현황

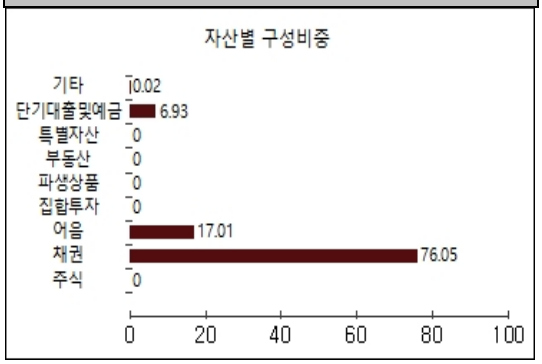
자산구성현황 표를 통해 자산운용보고서 작성 기준일(당기말) 현재 펀드가 보유하고 있는 자산의 내역을 각 자산군 및 통화별로 확인할 수 있습니다. 또한 그래프를 통해 당기말과 전기말 간의 자산별 구성비중을 비교할 수 있습니다.

(단위: 백만원, %)

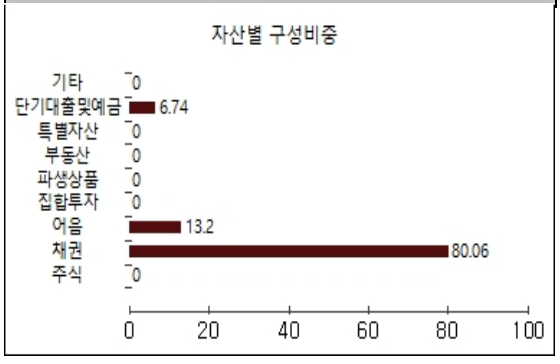
통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	118,695	19,571	0	0	0	0	0	0	9,995	0	148,263
(1.00)	(0.00)	(80.06)	(13.20)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(6.74)	(0.00)	(100.00)
합계	0	118,695	19,571	0	0	0	0	0	0	9,995	0	148,263

*( ): 구성비중

전 기



당 기



▶ 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	국고03250-5403(24-2)	11.02	6	채권	국고03250-3306(23-5)	4.71
2	채권	알씨아이파이낸셜118	6.98	7	채권	국고03875-4309(23-9)	4.45
3	채권	농업금융채권(은행)2023-09이3Y-G(사)	6.96	8	채권	자산관리공사제73회5009-25(사)	3.55

4	채권	SK디스커버리193	6.79	9	채권	삼성카드2640	3.54
5	채권	SK에너지48-2	5.93	10	채권	도로공사843	3.43

▼ 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.

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고03250-5403(24-2)	16,000	16,333	대한민국	KRW	2024-03-10	2054-03-10		N/A	11.02
알씨아이파이낸셜118	10,000	10,347	대한민국	KRW	2023-09-21	2026-09-21		A+	6.98
농업금융채권(은행)2023-09이3Y-G(사)	10,000	10,313	대한민국	KRW	2023-09-19	2026-09-19		AAA	6.96
SK디스커버리193	10,000	10,074	대한민국	KRW	2022-04-27	2025-04-25		A+	6.79
SK에너지48-2	9,000	8,792	대한민국	KRW	2021-04-06	2026-04-06		AA0	5.93
국고03250-3306(23-5)	7,000	6,980	대한민국	KRW	2023-06-10	2033-06-10		N/A	4.71
국고03875-4309(23-9)	6,000	6,599	대한민국	KRW	2023-09-10	2043-09-10		N/A	4.45
자산관리공사제73회5009-25(사	5,000	5,257	대한민국	KRW	2023-09-25	2028-09-25		AAA	3.55
삼성카드2640	5,000	5,254	대한민국	KRW	2023-10-30	2027-10-29		AA+	3.54
도로공사843	5,000	5,088	대한민국	KRW	2023-04-21	2028-04-21		AAA	3.43

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	
이준형 주)	채권운용팀장	1981	33	32,335	0	0	**2109001443**

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
-	-

▶ 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)
유리중장기종합채권증권[채권]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)	2.44	0.00	2.64	0.00

	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	3.20	0.00	3.83	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	3.20	0.00	3.83	0.00
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00
A	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)		0.00	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-F	자산운용사		22.14	0.02	22.56	0.02
	판매회사		2.77	0.00	2.82	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		5.53	0.01	5.64	0.01
	일반사무관리회사		2.77	0.00	2.82	0.00
	보수합계		33.20	0.03	33.84	0.03
	기타비용 주2)		3.10	0.00	3.31	0.00
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	3.20	0.00	3.83	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.00	0.00	0.00	0.00
		합계	3.20	0.00	3.83	0.00
	증권거래세		0.00	0.00	0.00	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율을 나타냅니다.
** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 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)
유리중장기종합채권증권[채권]운용	전기	0.0088	0.0115	0.0203
	당기	0.0093	0.0135	0.0228
A	전기	0.0088	0.0115	0.0203
	당기	0.0093	0.0135	0.0228
C-F	전기	0.1312	0.0115	0.1427
	당기	0.1317	0.0135	0.1452

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 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위: 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

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

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

2023-09-18 ~ 2023-12-17	2023-12-18 ~ 2024.03.17	2024.03.18 ~ 2024.06.17
0	0	0

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

-금리변동위험 : 이 투자신탁에서 주로 투자하는 채권의 가격은 이자율에 의해 결정됩니다. 일반적으로 이자율이 하락하면 채권가격 상승에 의한 자본이득이 발생하고 이자율이 상승하면 채권가격 하락에 의한 자본손실이 발생합니다. 따라서 이자율 상승에 의한 채권가격 하락으로 투자원금액 손실이 발생할 수 있습니다.
-채무불이행 위험 : 이 투자신탁에서 투자하는 채권의 발행주체가 현금흐름의 부족으로 인해 채무를 불이행할 경우 투자한 채권에 대한 이자와 원금의 손실이 발생해 투자원금액 손실이 발생할 수 있고, 아울러 채권의 이자와 원금 등에 대한 회수완료 기간이 길어짐에 따른 환매연기 등으로 기회비용 또한 발생할 수 있습니다.
-환매조건부채권매도 및 운용 관련 위험 : 이 투자신탁은 투자신탁재산을 환매조건부 매도 방식으로 운용할 수 있습니다. 환매조건부채권 (RP)이란 단기 금융상품의 일종으로 일정기간이 지난 후 채권을 다시 매수할 것을 조건으로 현재 채권을 매도하는 거래계약입니다. 따라서 환매조건부채권 매도 거래는 단기간에 자금을 조달하는 성격을 지니며 레버리지 위험을 수반합니다. 또한 환매조건부채권 매도에 의한 자금조달로 금융상품을 매입할 경우 자금의 조달과 운용에 대한 기간의 불일치, 금리 불일치 등 미래의 경제 상황에 따라 조달금리가 운용금리보다 높아져 투자신탁 재산의 손실이 발생할 수 있습니다.
-공정가액 산정위험 : 시장가격이 없는 자산이나 예금과 같은 시가평가가 곤란한 자산에 대해서는 시가를 적용하지 아니하고 공정가액이나 장부가 등을 반영하여 신탁재산의 평가를 합니다. 이러한 평가방법은 자산의 진정한 가치를 반영하지 못할 가능성이 있으며 이로 인해 투자신탁재산 가치의 수익자간 배분이 공정하게 이루어지지 않을 수 있습니다.

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

- 포트폴리오 전체가 시장성 자산으로 구성되어 있어 환매중단 사유가 발생하지 않을 것으로 예상합니다. (단, 자금시장이 경색될 경우 환매 지연의 위험은 상존)

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

'- 포트폴리오 전체가 시장성 자산으로 구성되어 있어 환매중단 사유가 발생하지 않을 것으로 예상합니다. (단, 자금시장이 경색될 경우 환매 지연의 위험은 상존)

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

- 포트폴리오 전체가 시장성 자산으로 구성되어 있어 환매중단 사유가 발생하지 않을 것으로 예상합니다.(단, 자금시장이 경색될 경우 환매 지연의 위험은 상존)

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

- 포트폴리오가 시장성 자산으로 구성되어 있어 환매중단 및 상환연기 가능성은 낮음.자금시장 경색시 보유자산 매도를 통하여 RP매도 비중을 축소함으로써 환매 및 상환에 대응할 계획입니다.

▶ 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
-해당 사항 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 대응 합니다.
- 주의 단계
  : 발생 Event에 대한 자본시장 영향 분석, 운용전략의 조정
- 위기 단계
  : 위험관리위원회 의결(집합투자기구별(또는 유형별) 운용전략 제한, 유동성 확보계획 등 수립), 위기상황 보고체계 가동
- 위급 단계
  : 비상대책반 구성하여 위기 상황별 구체적 실행계획의 수립 및 시행, 위험관리위원회 및 집합투자재산평가위원회 결의, 한국금융투자협회 및 금융감독원 등 감독기관과의 대응책 모색

○ 부실자산 발생 시 '집합투자재산평가기준'에 따라 집합투자재산평가위원회를 소집하여 관련 규정과 절차에 따라 부실자산 평가방안 등을 결정하여 신탁재산 손실의 최소화를 추구합니다.

○ 부실자산에 대해서는 기본적으로 위험관리위원회의 결정에 따라 관리하며 필요시 Task-Force team을 구성하여 운영할 수 있습니다.

10. 자산운용사의 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

(단위: 백만원, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
유리중장기종합채권증권투자신탁[채권]_운용	의무투자	2023-09-18	600	-	-	600	7.60

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 '유리중장기종합채권증권투자신탁[채권]_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 의무투자종료일은 2026.09.17(투자일로부터3년) 입니다. 집합투자업자의 판단에 따라 의무투자종료일 경과 후 해당 고유재산 투자금은 회수될 수 있습니다. 투자금 회수시 회수결과를 자산운용보고서에 기재하고 당사 홈페이지를 통해 공시할 예정입니다.