

자산운용보고서

유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]

(운용기간 : 2021년04월09일 ~ 2021년06월29일)

○ 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)

| | |
|---|--|
| 1 | 공지사항 |
| 2 | 펀드의 개요 <ul style="list-style-type: none">▶ 기본정보▶ 재산현황 |
| 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▶ 환헤지에 관한 사항▶ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황▶ 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 | 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항 |

1. 공지 사항

- 고객님이 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행법률)의 적용을 받습니다.
- 고객님이 가입하신 펀드는 모자형 구조의 펀드로써 이 자산운용보고서에서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는고객님이 가입한 유리글로벌천연가스증권자H펀드가 해당 모펀드에 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.
- 고객님이 가입하신 펀드는 2019년 7월 28일(공지사유 발생일 기준 자본시장 법령상 소규모 펀드에 해당하여 회사가 2019년 8월 1일 관련 수시공시를 한 바 있습니다. 소규모 펀드는 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하여 법192조 제1항 단서에 의거하여 2021년 6월 30일자로 임의해지되었습니다.
- 이 보고서는 자본시장법에 의해 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]운용의 자산운용회사인 '유리자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사인 'DB금융투자, SK증권, 미래에셋증권, 부국증권, 신한금융투자, 이베스트투자증권, 키움증권, 한국투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.
- 고객님의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 조회할 수 있습니다.

각종 보고서 확인 : 유리자산운용(주)
금융투자협회

www.yurieasset.co.kr
http://dis.kofia.or.kr

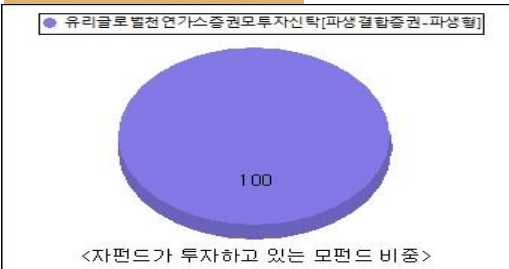
02-2168-7900

2. 펀드의 개요

▶기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

| 펀드 명칭 | | 투자위험등급 | 금융투자협회 펀드코드 |
|--|--|----------|---|
| 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]운용, 유리글로벌천연가스증권모투자신탁[파생결합증권-파생형], 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/A, 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/A-e, 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/C, 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/C-e | | 1등급 | 16694, 16749, 16695, 16736, 16696, 16737 |
| 펀드의 종류 | 투자신탁,증권펀드(혼합주식파생형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형 | 최초설정일 | 2009.10.09 |
| 운용기간 | 2021.04.09 ~ 2021.06.29 | 존속기간 | 2021.06.30 |
| 자산운용회사 | 유리자산운용 | 펀드재산보관회사 | 한국씨티은행 |
| 판매회사 | DB금융투자, SK증권, 미래에셋증권, 부국증권, 신한금융투자, 이베스트투자증권, 키움증권, 한국투자증권 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | 1. 투자대상 이 펀드는 신탁재산의 50% 이상을 천연가스 관련 파생결합증권에 투자하는 모펀드인 '유리글로벌천연가스증권모투자신탁[파생결합증권-파생형]' 수익증권에 투자하는 증권(파생형)투자신탁으로 외화표시자산에의 투자에 따른 환율변동 위험의 관리를 위해 외화표시자산의 일부에 대해 환헤지를 실시합니다. (외화표시자산의 순자산총액에 대한 75±25% 범위 내에서 환헤지 실시 계획) 그러나 상기의 투자목적에 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 자산운용회사, 신탁업자, 판매회사 등 이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다. | | |
| | 2. 투자전략 이 투자신탁이 주로 투자하는 모투자신탁은 천연가스 관련 상장집합투자기구(ETF, 레버리지ETF 포함), 현금성 자산 등에 투자할 수 있습니다. (투자 대상 종목 선정 기준) - 기초자산 성과와의 근접성 - 시장 접근성 및 유동성 - 발행사의 신용도, 디폴트 위험, 세부 투자전략 등 위의 내용을 바탕으로 투자 대상 종목을 선정할 예정이며, 새로운 천연가스 관련 증권의 상장, 새로운 천연가스 관련 인덱스의 출시에 따라 투자 대상종목은 확대될 예정입니다. (자산배분전략) 상기 선별기준에 의하여 선정된 종목을 유동성 및 변동성, 기초자산 성과의 괴리율 등을 분석하여 해당 운용팀에서 전략적 자산배분을 수행합니다. 개별 종목 비중의 조정은 기초자산의 움직임, 각종 지표의 변동 등에 따라 조정할 계획입니다. ※ 상기에 따른 롤오버 전략은 기초자산의 운용전략에 따라 변동될 가능성이 있으며 이에 따라 손익구조에 영향이 발생할 수 있습니다. ※ 기초자산의 운용전략이 변경되는 경우 변동되는 부분에 대한 투자자의 정확한 이해를 위하여 공시를 할 계획이며, 공시는 판매회사 및 집합투자업자 홈페이지에 게시하는 등의 방법으로 수행할 계획입니다. | | |
| | 3. 위험관리 운용역 개인의 독단에 의한 의사결정을 지양하기 위하여 중요한 의사결정 사항은 자산운용전략위원회, 위험관리위원회 등에서 결정합니다. 리스크관리본부에서 각종 법령 및 규정, 지침, 내규가 지켜지는 지를 모니터링하고 독립적으로 펀드의 실적평가 및 업무를 수행합니다. | | |
| | 4. 수익구조 이 펀드는 모펀드인 '유리글로벌천연가스증권모투자신탁[파생결합증권-파생형]' 수익증권에 대부분을 투자하므로 이러한 모펀드의 수익구조는 모펀드의 투자비용만큼 당해 투자신탁에 영향을 주게 됩니다. | | |
| | | | |

▶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 |
|----------------------------|-------------------|--------|--------|---------|
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_운용 | 자산 총액(A) | 429 | 341 | -20.57 |
| | 부채총액(B) | 1 | | -100.00 |
| | 순자산총액(C=A-B) | 428 | 341 | -20.39 |
| | 발행 수익증권 총 수(D) | 2,642 | 1,981 | -25.02 |
| | 기준가격 (E=C/Dx1000) | 161.90 | 171.90 | 6.18 |

| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
|-------------------------------|------|--------|--------|------|
| 유리글로벌천연가스증권자H[파생결합증권-파생형]_C/A | 기준가격 | 153.10 | 162.49 | 6.13 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A-e | 기준가격 | 153.84 | 163.27 | 6.13 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C | 기준가격 | 147.74 | 156.79 | 6.13 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C-e | 기준가격 | 149.67 | 158.84 | 6.13 |

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 | 분배금지급액 | 분배후수탁고 | 기준가격(원) | | 비고 |
|-------------------------------------|-------------|--------|--------|---------|---------|----|
| | | | | 분배금 지급전 | 분배금 지급후 | |
| 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_운용 | 2021. 6.30. | 0 | 1,981 | 171.9 | 171.9 | |
| 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/A | 2021. 6.30. | 0 | 1,247 | 162.49 | 162.49 | |
| 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/C | 2021. 6.30. | 0 | 45 | 156.79 | 156.79 | |
| 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/A-e | 2021. 6.30. | 0 | 786 | 163.27 | 163.27 | |
| 유리글로벌천연가스증권자투자신탁H[파생결합증권-파생형]_C/C-e | 2021. 6.30. | 0 | 15 | 158.84 | 158.84 | |

주) 분배후수탁고는 재투자 0 백만좌 포함입니다.

3. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

| |
|---|
| <p>펀드는 운용기간 6.18%의 수익률(운용클래스 기준)을 기록하며 BM(31.51%) 대비 25.34% 부진한 운용성과를 기록하였습니다. 수에즈 운하 사태로 유럽 지역 공급 차질 이슈에 이어 운용 기간 중반 이후부터 북미 지역 각지에서 초고는 현상 이 일어나 냉방수요가 크게 상승하는 등 수요와 공급 모두 천연가스 가격을 끌어올렸습니다.</p> <p>4월 천연가스 선물은 수에즈 운하 사태로 LNG 수출 물량의 유럽 내 공급이 지연됐고, 미국 캘리포니아 주에서 천연가스 채굴을 중단하는 조치를 취하겠다고 발표해 미국 내 생산 감소 기대에 가격이 상승세를 보였습니다. 특히 아시아 주요 국들에서 겨울을 대비해 급변 하반기 및 내년 초 인도 물량을 선구매하면서 가격을 추가적으로 견인하였습니다.</p> <p>5월 천연가스 선물 가격은 미국 및 유럽의 기온이 지역에 따라 평년보다 높고, 낮은 온도가 지속되면서 냉난방 수요를 견인, 상승세를 보였으나, 카타르의 LNG 수출 증가 계획 등의 이슈로 변동성을 보이다 더운 여름 날씨 전망에 반등하며 상승 마감했습니다. 특히 월 중순 이후 미국 중부 일부 지역에서 30도를 넘는 고온 현상이 이어져 천연가스 선물 가격은 지난 2월 이후 처음으로 3달러 선을 돌파했습니다.</p> <p>6월 천연가스 시장은 미국 전역에 걸친 고온현상에 따른 수요 증가 및 타이탄한 수급 환경이 지속되며 2018년 12월 이후 2년 6개월 만에 가장 긴 상승æl리를 계속했습니다. 특히 미국 북서부 많은 지역에서 관측 사상 최고 기온을 기록하는 등 냉방수요로 인한 전력 소모가 선을 가격을 끌어올렸습니다.</p> <p>펀드는 천연가스 관련 자산의 편입 비중이 신타케산의 40% 이하로 제한되어 있어 펀드 수익률은 비교지수 대비 낮은 수준을 기록했습니다. 또한, 월달러 환율이 상승하면서 외화자산에 대한 평가 이익이 펀드의 플러스 수익률에 기여하였지 만, 달러 해지 포지션이 펀드 수익률에 부정적으로 작용하면서 상승곡 일부를 상쇄하였습니다. 등 펀드는 2021년 6월 30일 소규모펀드 임의해지를 위해 편입 자산을 전량 매도하였습니다.</p> |
|---|

▶ 투자환경 및 운용 계획

| |
|--|
| <p>펀드는 2021년 6월 30일 “자본시장 및 금융투자업에 관한 법률 제192조(투자신탁의 해지) 제1항 및 집합투자규약 제45조(집합투자기구의 해지) 제1항 제3호”에 의거해 임의해지 되었습니다.</p> |
|--|

▶ 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 |
|-------------------------------|----------|----------|---------|----------|
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_운용 | 5.12 | 7.96 | -2.82 | 5.52 |
| (비교지수 대비 성과) | (-21.94) | (-35.08) | (-3.65) | (-29.93) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A | 5.08 | 7.86 | -2.96 | 5.34 |
| (비교지수 대비 성과) | (-21.98) | (-35.18) | (-3.79) | (-30.11) |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A-e | 5.08 | 7.87 | -2.95 | 5.34 |
| (비교지수 대비 성과) | (-21.98) | (-35.17) | (-3.78) | (-30.11) |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C | 5.07 | 7.85 | -2.98 | 5.30 |
| (비교지수 대비 성과) | (-21.99) | (-35.19) | (-3.81) | (-30.15) |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C-e | 5.07 | 7.85 | -2.97 | 5.30 |
| (비교지수 대비 성과) | (-21.99) | (-35.19) | (-3.80) | (-30.15) |
| 비교지수(벤치마크) | 27.06 | 43.04 | 0.83 | 35.45 |

주)비교지수(벤치마크): S&P GSCI Natural Gas ER(T-1) X 90% + CD91 X 10%

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

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|-------------------------------|----------|---------|---------|---------|
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_운용 | 5.52 | -11.77 | -14.85 | -18.69 |
| (비교지수 대비 성과) | (-29.93) | (23.33) | (29.79) | (41.00) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A | 5.34 | -12.09 | -15.32 | -19.43 |
| (비교지수 대비 성과) | (-30.11) | (23.01) | (29.32) | (40.26) |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A-e | 5.34 | -12.07 | -15.29 | -19.38 |
| (비교지수 대비 성과) | (-30.11) | (23.03) | (29.35) | (40.31) |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C | 5.30 | -12.16 | -15.42 | -19.61 |
| (비교지수 대비 성과) | (-30.15) | (22.94) | (29.22) | (40.08) |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C-e | 5.30 | -12.15 | -15.40 | -19.57 |
| (비교지수 대비 성과) | (-30.15) | (22.95) | (29.24) | (40.12) |
| 비교지수(벤치마크) | 35.45 | -35.10 | -44.64 | -59.69 |

주)비교지수(벤치마크): S&P GSCI Natural Gas ER(T-1) X 90% + CD91 X 10%

※ 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 | 0 | 0 | -2 | -5 | 0 | 0 | 0 | 0 | 8 | -5 | -5 |
| 당기 | 0 | 0 | 0 | 31 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | -7 | 25 |

4. 자산현황

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

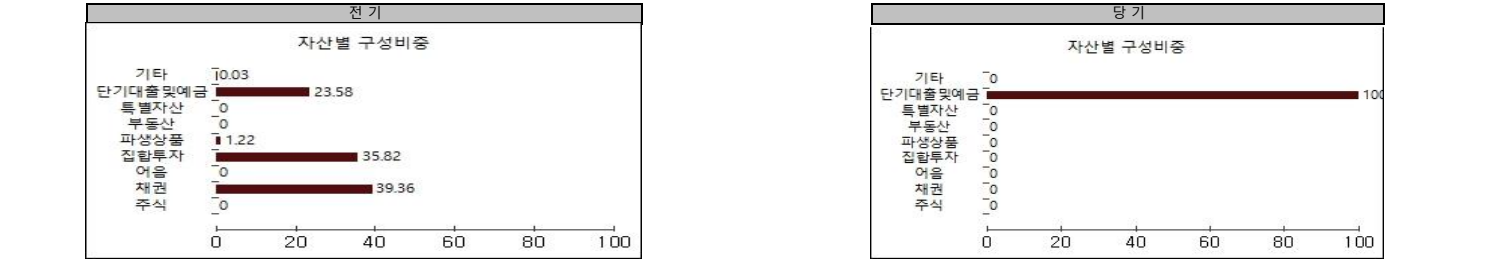
▶ 자산구성현황

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 | 0 | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 341 | 0 | 341 |
| (1.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (100.00) | (0.00) | (100.00) |
| 합계 | 0 | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 341 | 0 | 341 |

*☐: 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.

▶ 환헤지에 관한 사항

| | |
|---------------|---|
| 환헤지란? | 환헤지란 환율 변동으로 인한 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총 외화자산의 평가액 대비, 환헤지 규모를 비율로 표시한 것을 말합니다. |
| 펀드수익률에 미치는 효과 | 환헤지를 실행할 경우 외국통화의 가치가 원화에 대비하여 하락하는 때에는 환손실이 발생하지 않아 투자신탁의 성과에 유리하게 작용하는 반면, 외국통화의 가치가 원화에 비하여 상대적으로 상승하는 때에는 환이익 획득 기회를 상실하여 투자신탁의 성과에 불리하게 작용합니다. 환헤지에는 일정한 비용이 수반되며 이러한 비용은 투자신탁의 성과를 하락시키는 원인이 됩니다. |

| | | | |
|----------------------------------|---------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|
| 투자설명서 상의 목표 환헤지 비율 | 기준일(21.06.29)현재 환헤지 비율 | 환헤지 비용 (21.04.09 ~ 21.06.29) | 환헤지로 인한 손익 (21.04.09 ~ 21.06.29) |
| 외화표시자산의 순자산총액에 대한 75±25% 범위 내 | 0.0 | 0.0504 | 0 |

주) 환헤지 비용은 통화선물거래에 따른 수수료이며, 선도환거래의 경우 수수료가 계약 환율에 반영되어 있어 별도의 산출은 불가능합니다.

▶ 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.

| | | | | | | | |
|----|------|----------|--------|----|----|-----|----|
| 순위 | 구분 | 종목명 | 비중 | 순위 | 구분 | 종목명 | 비중 |
| 1 | 단기상품 | 은네(씨티은행) | 100.00 | | | | |

※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.

▶ 단기대출 및 예금

| | | | | | | | |
|----|--------|------------|-----|------|-----|------|-----|
| 종류 | 금융기관 | 취득일자 | 금액 | 금리 | 만기일 | 발행국가 | 통화 |
| 예금 | 한국씨티은행 | 2009-10-09 | 341 | 0.23 | | 대한민국 | KRW |

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

5. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

| 성명 | 직위 | 생년 | 운용중인 펀드 현황 | | 성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모 | | 협회등록번호 |
|--------------------|---------|------|------------|-------|-------------------------|------|------------|
| | | | 펀드개수 | 운용규모 | 펀드개수 | 운용규모 | |
| 한진규 ^{주1)} | CIO | 1969 | 16 | 3,635 | 0 | 0 | 2109000507 |
| 안재정 | 해외투자본부장 | 1972 | | | | | 2117000117 |

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 |
|------------------------------------|---------------------|
| 2010.08.18 ~ 현재 2018.12.24 ~ 현재 | 한진규(책임) 안재정(부책임) |

▶ 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) | |
| 유리글로벌선연가스자비[파생결합증권-파생형]_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 | 0.09 | 0.02 | |
| | 일반사무관리회사 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 0.00 | 0.00 | 0.09 | 0.02 | |
| | 기타비용 주2) | | 0.04 | 0.01 | 0.29 | 0.07 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중계수수료 | 0.06 | 0.01 | 0.23 | 0.06 |
| | | 조사분석업무 등 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 서비스 수수료 | | | | |
| | | 합계 | 0.06 | 0.01 | 0.23 | 0.06 |
| 유리글로벌선연가스자비[파생결합증권-파생형]_C/A | 증권거래세 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| | 자산운용사 | 0.03 | 0.01 | 0.03 | 0.01 | |
| | 판매회사 | 0.03 | 0.01 | 0.02 | 0.01 | |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | 0.04 | 0.02 | 0.08 | 0.04 | |
| | 일반사무관리회사 | 0.01 | 0.00 | 0.01 | 0.00 | |
| | 보수합계 | 0.11 | 0.04 | 0.14 | 0.06 | |
| | 기타비용 주2) | | 0.03 | 0.01 | 0.18 | 0.08 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중계수수료 | 0.04 | 0.01 | 0.14 | 0.06 |
| | | 조사분석업무 등 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 서비스 수수료 | | | | |
| | | 합계 | 0.04 | 0.01 | 0.14 | 0.06 |
| | | 증권거래세 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 자산운용사 | 0.02 | 0.01 | 0.02 | 0.01 |
| | 판매회사 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | 0.01 | |

| | | | | | | |
|-------------------------------|-------------------------|-------------|------|------|------|------|
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A-e | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0.03 | 0.02 | 0.05 | 0.04 |
| | 일반사무관리회사 | | 0.01 | 0.00 | 0.01 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0.07 | 0.04 | 0.09 | 0.06 |
| | 기타비용 <small>주2)</small> | | 0.02 | 0.01 | 0.11 | 0.07 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0.02 | 0.01 | 0.09 | 0.06 |
| | | 조사문적업무 등 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 서비스 수수료 | | | | |
| | | 합계 | 0.02 | 0.01 | 0.09 | 0.06 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C | 증권거래세 | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 자산운용사 | | 0.00 | 0.01 | 0.00 | 0.01 |
| | 판매회사 | | 0.00 | 0.02 | 0.00 | 0.02 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0.00 | 0.02 | 0.00 | 0.03 |
| | 일반사무관리회사 | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0.01 | 0.05 | 0.01 | 0.07 |
| | 기타비용 <small>주2)</small> | | 0.00 | 0.01 | 0.01 | 0.07 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0.00 | 0.01 | 0.01 | 0.06 |
| | | 조사문적업무 등 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 서비스 수수료 | | | | |
| | | 합계 | 0.00 | 0.01 | 0.01 | 0.06 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C-e | 증권거래세 | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 자산운용사 | | 0.00 | 0.01 | 0.00 | 0.01 |
| | 판매회사 | | 0.00 | 0.02 | 0.00 | 0.02 |
| | 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0.00 | 0.01 | 0.00 | 0.04 |
| | 일반사무관리회사 | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | 보수합계 | | 0.00 | 0.05 | 0.00 | 0.07 |
| | 기타비용 <small>주2)</small> | | 0.00 | 0.01 | 0.00 | 0.06 |
| | 매매 중개 수수료 | 단순매매, 중개수수료 | 0.00 | 0.01 | 0.00 | 0.06 |
| | | 조사문적업무 등 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | | 서비스 수수료 | | | | |
| | | 합계 | 0.00 | 0.01 | 0.00 | 0.06 |
| | 증권거래세 | | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율
** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적, 반복적으로 지출된 비용으로서 매매, 중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 없음
※ 발행보담금내역 : 없음

※ 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

▶ 총보수, 비용비율

총보수, 비용비를 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 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_운용 | 전기 | 0 | 0.0523 | 0.0207 | 0.0551 |
| | 당기 | 0.0372 | 0.0525 | 0.0993 | 0.0936 |
| 종류(Class)별 현황 | | | | | |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A | 전기 | 0.1794 | 0.0289 | 0.2005 | 0.0552 |
| | 당기 | 0.1795 | 0.02969 | 0.2829 | 0.0957 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/A-e | 전기 | 0.1692 | 0.02109 | 0.1896 | 0.0549 |
| | 당기 | 0.1692 | 0.02069 | 0.2642 | 0.091 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C | 전기 | 0.2178 | 0.00113 | 0.2392 | 0.0549 |
| | 당기 | 0.2175 | 0.00117 | 0.3161 | 0.0943 |
| 유리글로벌천연가스자H[파생결합증권-파생형]_C/C-e | 전기 | 0.2082 | 0.00119 | 0.2266 | 0.0561 |
| | 당기 | 0.2065 | 0.00095 | 0.279 | 0.0863 |

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 0.25%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드의 비용이 증가합니다.

▶ 매매주식규모 및 회전을

| (단위:백만원, %) | | | | | |
|------------------------|----|----|----|-------------------------|------|
| 유리글로벌천연가스모[파생결합증권-파생형] | | | | | |
| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 <small>주)</small> | |
| 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 비율을 나타냅니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전을 추이

| | | |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| (단위: %) | | |
| 유리글로벌천연가스모[파생결합증권-파생형] | | |
| 2020-10-09 ~ 2021-01-08 | 2021-01-09 ~ 2021-04-08 | 2021-04-09 ~ 2021-06-29 |
| 0.00 | 0.00 | 0.00 |

8. 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.