미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁

(일반상품-파생형)

작성운용기간: 2015년 02월 16일 ~ 2015년 05월 15일

이 자산운용보고서는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제88조(자산운용보고서의 교부)'에서 정한 바에 따라 「미래에셋 자산운용(주)」이 작성했으며, 투자자가 가입한 펀드의 지난 2개월간의 운용 및 변동사항에 대한 결과를 요약한 것입니다.

원칙을 지키는 투자 - MIRAE ASSET 미래에셋자산운용

한눈에 보는 펀드운용성과

미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)

작성운용기간: 2015년 02월 16일 ~ 2015년 05월 15일

이 보고서는 자본시장법에 따라 「미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)」 의 자산운용사인 미래에셋자산운용이 작성하였으며 신탁업자인 신한은행의 확인을 받아 투자매매 / 중개업자를 통해 투자자에게 제공합니다.

내 펀드 수익률!

(단위 : %, %p)

펀드 \ 비교시점	최근 3개월	최근 1년	최근 5년	설정일
	2015.02.15 ~ 2015.05.15	2014.05.15 ~ 2015.05.15	2010.05.15 ~ 2015.05.15	
펀드 (비교지수대비 성과)	1.19 (-1.90)	-27.00 (-0.89)	-3.78 (+7.32)	2006.08.16
비교지수 (벤치마크)	3.09	-26.11	-11.10	

* 위 투자실적은 과거 실적을 나타낼 뿐 운용실적을 보장하는 것은 아닙니다.
* 위 펀드의 투자실적은 펀드의 종류형별로 수익률이 달라질 수 있으므로 자세한 사항은 운용상세 보고를 참조하시기 바랍니다.

전체보유증권 및 유동성 자산

* 전체 보유자산(주식, 채권, 단기대출 및 예금 등)의 상위 주요종목 리스트입니다.

(단위 : 백만원, %)

종목		순자산	비중
채권	통안0276-1506-02	5,031	21.72
채권	국고0400-1603(11-1)	4,102	17.71
채권	통안0222-1610-02	3,328	14.37
기타	기타자산	3,181	13.74
채권	통안0290-1512-02	2,531	10.93

펀드매니저의 한마디!

펀드매니저 : 권정훈

국제 유가가 최근 반등하였지만, 추가적으로 60달러 이상 지속되기에는 재고 부담이 남아있는 것으로 분석됩니다. 80년 만의 최고 수준인 미 원유 재고가 감소세로 돌아선다고 해도 속도가 빠르지 않는다면, 과잉 공급 지속 전망으로 유가의 추가 반등은 제한적일 것으로 전망됩니다.

자산운용보고서 확인 방법 안내

- 이 자산운용보고서의 내용은 펀드 전체에 관한 내용입니다.
- 투자자의 계좌별 수익률 정보 확인 및 고객정보의 변경은 펀드를 가입하신 판매회사 지점에 연락하시거나 판매회사의 홈페이지를 통하여 확인하시기 바랍니다.

- 미래에셋자산운용 고객센터 (☎ 1577-1640)
- 미래에셋자산운용 홈페이지
  http://investments.miraeasset.com 접속 → 투자상품 → 펀드상품 찾기 → 펀드명 입력 → 펀드정보
- 금융투자협회 전자공시 서비스
  http://dis.kofia.or.kr 접속 → (상단) 전체메뉴 → 펀드공시 → 보고서 선택 → 자산운용보고서 선택 → 펀드명 입력 → 조회
- 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행령 제92조(자산운용보고서) 에서 정한바에 따라 이메일로 자산운용보고서를 받아 보실 수 있습니다.
- 자산운용보고서는 3개월마다 정기적으로 고객님께 발송해 드리고 있으며, 이메일 수령 신청을 통해 더욱 편리하게 자산운용 보고서를 관리 하실 수 있습니다.
- E-mail 전환신청은 가입하신 판매회사에서 변경하실 수 있습니다.

이 자산운용보고서는 '자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제88조(자산운용보고서의 교부)'에서 정한 바에 따라 「미래에셋 자산운용(주)」 이 작성했으며, 투자자가 가입한 펀드의 지난 2개월간의 운용 및 변동사항에 대한 결과를 요약한 것입니다.

원칙을 지키는 투자 - MIRAE ASSET 미래에셋자산운용

펀드 개요

이 투자신탁은 일반상품(농산물, 축산물, 광산물, 에너지 등에 속하는 물품 및 이 물품을 원료로 하여 제조하거나 가공한 물품)을 기초자산으로 하는 장내파생상품에 주로 투자하는 펀드입니다.

운용 경과

WTI 기준으로 40달러 수준까지 하락했던 유가가 50달러 후반을 회복하면서 상승세를 보였습니다. 공급 측면 변화가 현재의 상승세를 주도하였습니다. 미 에너지정보국(EIA)은 5월 미국 Shale오일 생산량이 감소할 것으로 예상하며, 이는 2014년 하반기 유가 하락 이후 처음으로 생산량 감소로 나타낸 것입니다. 수요 측면에서도 여름철 가솔린 수요기를 대비한 정제활동이 증가할 것이라는 전망도 유가 상승을 견인하였습니다.

운용 성과

펀드(운용펀드기준)의 수익률은 비교지수 대비 하회하는 수익률을 기록 하였습니다.

운용 계획

국제 유가가 최근 반등하였지만, 추가적으로 60달러 이상 지속되기에는 재고 부담이 남아있는 것으로 분석됩니다. 80년 만의 최고 수준인 미 원유 재고가 감소세로 돌아선다고 해도 속도가 빠르지 않는다면, 과잉 공급 지속 전망으로 유가의 추가 반등은 제한적일 것으로 전망됩니다. 당분간 국제 유가는 수급과 지정학적 리스크 요인에 따라 높은 변동성으로 등락을 반복할 것으로 예상합니다.
본 펀드는 인덱스 펀드로서 비교 지수의 안정적인 추종을 목표로 하고 있습니다. 동 펀드는 상기 목적을 충실하게 달성하기 위해서 리스크와 비용을 감안한 최적 복제를 추구하고 있습니다. 아울러 환율 변동에 따른 리스크를 제거하기 위해서 환노출분에 대해 환헷지를 수행하고 있습니다.

운용 상세 보고

미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)

1. 공지사항

■ 수시공시에 대한 사항은 금융투자협회 전자공시(http://dis.fundservice.net)/펀드공시/수시공시를 참조하시기 바랍니다.

■ 고객님이 가입하신 펀드는 "자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행 법률)" 의 적용을 받습니다.

2. 펀드의 개요

기본 정보

펀드의 설정일, 운용기간, 위험등급, 펀드의 특징 등 펀드의 기본사항입니다.

펀드	금융투자협회 펀드코드	최초설정일	운용기간
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)	59254	2006.08.16	2006.08.16 ~ 2015.05.15
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)종류A	59255	2006.08.16	2006.08.16 ~ 2015.05.15
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)종류B	59256	2006.08.16	2006.08.16 ~ 2015.05.15
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)종류I	77402	2008.04.18	2008.04.18 ~ 2015.05.15
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)종류C-W	97855	2012.06.21	2012.06.21 ~ 2015.05.15
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)종류S	AR694	2014.05.13	2014.05.13 ~ 2015.05.15

위험등급	1등급(매우높음)
펀드의종류	투자신탁/특별자산파생/추가형/개방형/종류형
보고서 작성기간	2015년 02월 16일 ~ 2015년 05월 15일
존속기간	이 상품은 추가형 상품으로 종료일이 없습니다.
자산운용사	미래에셋자산운용
일반사무관리회사	미래에셋펀드서비스
펀드재산보관회사(신탁업자)	신한은행
판매회사	당사 홈페이지에서 확인하실 수 있습니다. (Http://investments.miraeasset.com)
상품의 특징	이 투자신탁은 RICI(Rogers International Commodity Index) Excess Return 지수수익률을 추적하기 위해 해외의 거래소에서 거래되는 장내파생상품에 주로 투자하며, 투자목적 달성을 위해 추적오차율 최소화를 추구합니다.

재산 현황

펀드재산 현황

당기말과 전기말 간의 펀드 순자산 총액과 펀드 기준가격의 추이입니다.

미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형) (단위 : 백만원, 원, %)

항목	전기말	당기말	증감률
자산 총액(A)	23,656	23,159	-2.10
부채 총액(B)	96	11	-88.34
순자산 총액(C=A-B)	23,559	23,148	-1.75
기준가격	582.45	589.37	1.19

■ 자산총액 : 펀드운용자금 총액입니다.

■ 부채총액 : 펀드에서 발생한 비용의 총액입니다.

■ 순 자 산 : '자산 - 부채'로서 순수한 펀드자금 총액입니다.

■ 기준가격 : 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매) 하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

종류별(Class)별 기준가격 현황

(단위 : 원, %)

항목	전기말	당기말	증감률
종류A	518.17	522.25	0.79
종류B	532.73	537.35	0.87
종류I	533.93	539.49	1.04
종류C-W	751.80	759.72	1.05
종류S	723.58	730.63	0.97

3. 수익률 현황

기간 수익률

각 기간의 비교지수대비 펀드수익률입니다.

■ 비교지수 : RICI(Rogers International Commodity Index) Excess Return

실물자산(또는 "상품"이라고도 함)㈜을 기초자산으로 하는 "상품선물"등으로 이루어진 상품지수
RICI는 상품의 국제적인 수출입 동향 및 주요 상품소비국가의 내수환경 등에 관한 지표를 기초로 국제무역 및 상거래상 기여도가 큰 종목 중 국제적으로 투자가 가능한 종목을 인덱스에 편입합니다.
(타 인덱스와 달리 상품의 생산량은 고려하지 않습니다.)

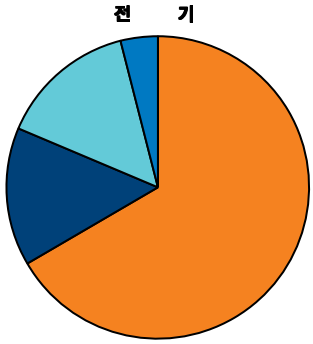
(단위 : %, %p)

비교시점 / 펀드	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일
	2015.02.15~ 2015.05.15	2014.11.15~ 2015.05.15	2014.08.15~ 2015.05.15	2014.05.15~ 2015.05.15	2013.05.15~ 2015.05.15	2012.05.15~ 2015.05.15	2010.05.15~ 2015.05.15	
운용펀드 (비교지수대비 성과)	1.19 (-1.90)	-14.34 (-3.49)	-23.05 (-2.94)	-27.00 (-0.89)	-21.36 (+0.72)	-17.92 (+3.49)	-3.78 (+7.32)	2006.08.16
종류A (비교지수대비 성과)	0.79 (-2.30)	-15.07 (-4.22)	-24.05 (-3.93)	-28.26 (-2.15)	-24.01 (-1.93)	-22.03 (-0.62)	-11.79 (-0.70)	2006.08.16
종류B (비교지수대비 성과)	0.87 (-2.22)	-14.92 (-4.07)	-23.85 (-3.74)	-28.01 (-1.90)	-23.48 (-1.40)	-21.20 (+0.21)	-10.07 (+1.03)	2006.08.16
종류I (비교지수대비 성과)	1.04 (-2.05)	-14.61 (-3.76)	-23.42 (-3.30)	-27.46 (-1.36)	-22.34 (-0.26)	-19.44 (+1.97)	-6.72 (+4.38)	2008.04.18
종류C-W (비교지수대비 성과)	1.05 (-2.04)	-14.58 (-3.73)	-23.39 (-3.27)	-27.42 (-1.31)	-22.27 (-0.20)			2012.06.21
종류S (비교지수대비 성과)	0.97 (-2.12)	-14.72 (-3.87)	-23.53 (-3.42)	-27.59 (-1.49)				2014.05.13
비교지수(벤치마크)	3.09	-10.85	-20.12	-26.11	-22.08	-21.41	-11.10	2014.05.13

※ 위 투자실적은 과거 실적을 나타낼 뿐 미래의 운용실적을 보장하는 것은 아닙니다.

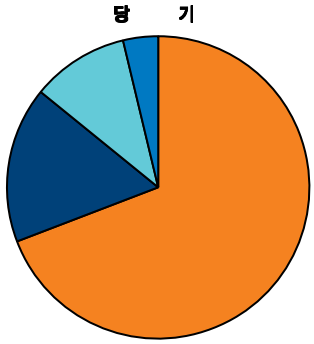
4. 자산현황

자산별 투자비중



■ 채 권 : 66.59%
■ 기 타 : 14.77%
■ 집합투자증권 : 14.67%
■ 단기대출/예금 : 3.97%

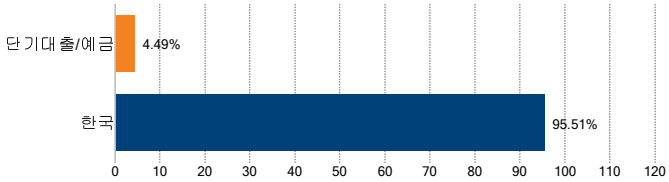
■선물, 스왑거래의 경우 비중에서 생략됩니다.



■ 채 권 : 69.17%
■ 기 타 : 16.70%
■ 집합투자증권 : 10.39%
■ 단기대출/예금 : 3.74%

■선물, 스왑거래의 경우 비중에서 생략됩니다.

국가별 투자비중



■펀드의 국가별 비중은 자산의 발행국을 기준으로 합니다.따라서 실제 자산이 거래되는 국가와의 차이가 발생할 수 있습니다.
■투자종목의 산정이 불가한 집합투자기구의 경우 국가별투자비중은 미분류집합투자로 표기합니다.

환헤지에 관한 사항

해외 자산의 환헤지 비율입니다.

투자설명서상의 목표 환헤지 비율
이 투자신탁은 상품(Commodity)를 기초로 하는 해외선물에 주로 투자합니다. 해외 상품선물 거래시 위탁증거금율은 5~15% 수준이며, 이 투자신탁의 환헤지 전략은 외화로 평가되는 부분인 위탁증거금을 주요대상으로 합니다. 아울러 이러한 환헤지 전략은 결과적으로 투자신탁재산 중 외화자산의 90%이상을 환헤지하는 효과를 기대하고 이루어지게 됩니다.
다만, 투자원본이 매우 적거나 비용이 많이드는 경우 등 환헤지전략을 수행하기에 부적절한 경우로 판단되는 경우에는 환헤지 전략을 수행하지 않을 수 있습니다. 이것은 이 투자신탁이 주로 해외자산에 투자하지만 외국통화에의 노출정도는 비교적 낮게 유지되는 파생상품투자신탁으로서의 특성을 고려한 것입니다. 또한 환헤지를 수행하는 과정에서 거래수수료 등의 추가적인 비용이 발생합니다.

■ 현재 환헤지 비율

92.14

- 환헤지란 환율 변동으로 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총 외화자산의 평가액대비, 환헤지 규모를 비율로 표시한 것을 말합니다.
- 당사는 현재(작성일기준) 미국(USD) / 홍콩(HKD) / 일본(JPY) / 호주(AUD) / 말레이시아(MYR) / 타이완 (TWD) / 영국(GBP) / 유럽(EUR) / 스위스(CHF) 통화에 대하여 환헤지를 실행하고 있습니다.
- 환헤지비용은 환헤지관련 파생상품의 계약환율에 포함되어 있어 별도의 산출은 불가능합니다.

주요 자산보유 현황

■펀드자산총액에서 전체 보유자산(주식,채권,단기대출 및 예금 등)의 상위 10종목, 자산총액의 5% 초과 보유종목 및 발행주식 총수의1% 초과 종목의 보유내역을 보여줍니다.
■파생상품의 거래 발생시 모두 기재되며, 통화선물 및 통화선물환 등 환헤지 목적의 파생상품의 거래 발생내역은 생략됩니다.
■보다 상세한 투자대상자산 내역은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷 주소 http://dis.kofia.or.kr)
단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

운용 상세 보고

미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)

채 권

(단위 : 백만원, %)

종목	액면가액	평가액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중	비고
통안0276-1506-02	5,000	5,031	2013.06.02	2015.06.02			21.72	자산 5%초과
국고0400-1603(11-1)	4,000	4,102	2011.03.10	2016.03.10			17.71	자산 5%초과
통안0222-1610-02	3,300	3,328	2014.10.02	2016.10.02			14.37	자산 5%초과
통안0290-1512-02	2,500	2,531	2013.12.02	2015.12.02			10.93	자산 5%초과
국고0350-1609(11-5)	1,000	1,029	2011.09.10	2016.09.10			4.44	

집합투자증권

집합투자기구에 투자함으로써 별도의 수수료가 부가됩니다.

(단위 : 좌, 백만원, %)

종목	종류	집합투자업자	설정원본	순자산금액	비중	비고
TIGER 농산물선물(H)	집합투자증권	미래에셋자산운용	200,000	1,356	5.86	자산 5%초과
TIGER 구리실물	집합투자증권	미래에셋자산운용	150,000	1,050	4.53	

단기대출 및 예금

(단위 : 백만원, %)

구분	금융기관	단기대출(예금)일자	단기대출(예금)액	적용금리	상환(만기)일	비중	비고
외화예금	신한은행		449	0	2099.12.31	1.94	
콜론	중소기업은행	2015.05.15	300	1.73	2015.05.18	1.30	

기 타

(단위 : 백만원, %)

구분	종목명	취득가액	비중	비고
기타자산	파생증거금	3,181	13.74	자산 5%초과

운용 상세 보고

미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)

장내파생상품 계약현황

(단위 : 백만원, %)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
BRENT CRUDE FUT ICE SEPT 095	매수	67	4,928	
CORN FUT CBOT JUL 075	매수	225	4,495	
CORN FUT CBOT DEC 125	매도	190	3,968	
CRUDE OIL FUT NYMX SEPT 095	매수	45	3,016	
COTTON NO.2 FUT NYBOT JUL 075	매수	36	1,300	
GOLD 100 OZ FUT COMEX DEC 125	매수	7	933	
GASOLINE RBOB FUT NYMX SEPT 095	매수	9	819	
SILVER FUT COMEX DEC 125	매수	8	762	
NATURAL GAS FUT NYMX SEPT 095	매수	18	601	
WHEAT FUT KCB JUL 075	매수	20	590	
SOYBEAN FUT CBOT NOV 115	매수	10	509	
MILL WHEAT EURO SEPT 095	매수	35	381	
HEATING OIL FUT NYMX SEPT 095	매수	4	370	
LIVE CATTLE FUT CME AUG 085	매수	5	330	
SOYBEAN OIL FUT CBOT SEPT 095	매수	15	326	
SOYBEAN MEAL FUT CBOT SEPT 095	매수	10	325	
ZINC 3MO ($) (LME) MAY 055	매수	5	313	
COFF ROBUSTA 10TN JUL 075	매수	15	285	
COCOA FUTURE DEC 125	매수	8	275	
GAS OIL FUT ICE SEPT 095	매수	4	268	
RAPESEED EURO NYSE LIFFE AUG 085	매수	12	263	
PALLADIUM FUT NYMX SEPT 095	매수	3	254	
PLATINUM FUT NYMX JUL 075	매수	4	252	
LEAD 3MO ($) (LME) JUL 075	매수	4	214	
ALUMINIUM 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	4	203	
ALUMINIUM 3MO ($) (LME) JUL 075	매수	4	202	
ZINC 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	3	188	
FCOJ-A FUT NYBOT JUL 075	매수	10	187	
TIN 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	2	172	
WHITE SUGAR (LIF) AUG 085	매수	8	161	
LEAN HOGS FUT CME OCT 105	매수	5	159	
ALUMINIUM 3MO ($) (LME) JUN 065	매수	3	151	
ALUMINIUM 3MO ($) (LME) MAY 055	매수	3	150	
LUMBER FUT CME JUL 075	매수	4	122	
OAT FUT CBOT JUL 075	매수	8	107	
LEAD 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	2	107	
LEAD 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	2	107	
LEAD 3MO ($) (LME) JUL 075	매수	2	107	
ROUGH RICE FUT CBOT JUL 075	매수	5	105	
ALUMINIUM 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	2	101	

NICKEL 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	1	90	
TIN 3MO ($) (LME) AUG 085	매수	1	86	
RUBBER FUT TCOM OCT 105	매수	8	80	

5. 펀드매니저(운용전문인력)현황

펀드매니저

운용을 담당하는 펀드매니저 정보입니다.

(단위 : 개, 억원)

이름	권정훈	운용중인 펀드의 수	27
연령	40	운용중인 펀드의 규모	2,856
직위	책임운용전문인력	성과보수가 있는 펀드 및 일임계약	개수 : 0
협회등록번호	02109001078		운용규모 : 0

* '책임운용전문인력'은 운용전문인력을 이끄는 책임자로서 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등을 주도적이고 핵심적으로 수행합니다.

책임매니저 변경내역

최근 3년 동안의 책임펀드 매니저 변경 내용입니다.

기간	책임펀드매니저
2006.08.16~2007.08.31	이준용
2007.08.31~현재	권정훈

* 펀드매니저 변경내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷주소 http://dis.kofia.or.kr)

6. 비용현황

총보수 비용 비율

펀드에서 부담하는 보수, 기타비용 및 매매중개수수료를 연간 단위로 환산한 수치입니다.

(단위 : 연환산, %)

펀드	구분	총보수 · 비용비율(A)*	매매 · 중개수수료 비율(B)**	합계(A+B)
운용펀드	전기	0.17	0.61	0.78
	당기	0.18	0.46	0.64
종류A	전기	1.86	0.61	2.47
	당기	1.87	0.46	2.33
종류B	전기	1.52	0.61	2.13
	당기	1.53	0.46	1.99
종류I	전기	0.79	0.62	1.41
	당기	0.8	0.46	1.26
종류C-W	전기	0.7	0.61	1.31
	당기	0.73	0.47	1.20
종류S	전기	1.05	0.77	1.82
	당기	1.06	0.4	1.46

- 총보수 비용 비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균 잔액(보수,비용 차감 전 기준)으로 나눈 비율로서 해당운용기간 중 투자자가 부담한 총보수 비용수준을 나타냅니다.
- 매매,중개수수료 비율이란 매매,중개수수료를 순자산 연평균 잔액(보수,비용 차감 전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 실제 부담하게 되는 매매,중개수수료의 수준을 나타냅니다.

보수 및 비용지급 현황

펀드에서 부담하는 보수, 기타비용, 매매중개수수료 및 증권거래세입니다.

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기	
	금액	비율	금액	비율
자산운용사	22	0.09	30	0.13
판매회사	28	0.12	37	0.16
종류A	10	0.04	14	0.06
종류B	17	0.07	23	0.10
종류I	0	0.00	0	0.00
종류C-W	0	0.00	0	0.00
종류S	0	0.00	0	0.00
펀드재산보관회사(신탁업자)	1	0.01	2	0.01
일반사무관리회사	1	0.00	1	0.00
보수 합계	52	0.22	70	0.31
기타비용*	15	0.03	20	0.04
조사분석서비스비용	0	0.00	0	0.00
매매체결서비스비용	51	0.10	52	0.11
증권거래세	0	0.00	0	0.00

기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적/반복적으로 지출된 비용이며, 매매/중개수수료는 제외한 것입니다.

7. 투자자산 매매내용

매매주식규모 및 회전율

해당 기간의 매매량, 매매금액, 매매회전율입니다.

(단위 : 백만원 , %)

매수		매도		매매회전율*
수량	매매금액	수량	매매금액	
0	0	0	0	0.00

*매매회전율(해당분기)이란 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율을 말합니다. 매매회전율이 높으면 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%)가 발생해 투자자의 펀드비용이 증가합니다.

최근 3분기 매매회전율 추이

최근 3분기의 매매회전율 추이입니다.

(단위 : %)

기간	매매회전율
2014.08.16 ~ 2014.11.15	-
2014.11.16 ~ 2015.02.15	30.62
2015.02.16 ~ 2015.05.15	-

펀드 용어 해설

미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산투자신탁(일반상품-파생형)

집합투자기구(=펀드)

2인 이상의 투자금을 재산 가치가 있는 자산에 투자하여 운용하고 그 결과를 투자자들에게 배분합니다. 특정 자산을 취득하거나 처분하는 등의 방법으로 운용하되 그 운용 과정에서 투자자의 지시를 받지는 않습니다. 투자신탁, 투자회사, 뮤추얼펀드, 투자기구 등으로 부르기도 하나 보통은 '펀드'라고 합니다.

집합투자업자

2인 이상의 투자금을 재산 가치가 있는 자산에 투자하여 운용하는 회사입니다. 보통은 '운용사'라고 합니다.
* 집합투자기구(펀드)를 운용하는 회사입니다.

펀드자산보관회사

신탁재산을 관리하는 회사입니다. 신탁업자라고도하며 보통 은행이 맡습니다.
※현행법은 위탁받은 투자자의 자산을 운용사의 고유재산과 분리하여 관리하도록 규정하고 있습니다. 이에 따라 투자자의 자산은 안전하게 관리됩니다.

일반사무관리회사

펀드 기준가 산정 등 일반 사무 관리 업무를 맡는 회사입니다.

투자매매/중개업자

펀드의 매매를 주 업무로 하는 회사입니다. 은행, 증권사, 보험사 등이 이에 속합니다.
※ 투자매매/중개업자는 투자자를 보호하기 위하여 펀드 판매와 관련된 법령 및 표준투자자권유준칙을 준수할 의무가 있습니다.

금융투자협회 펀드코드

한국금융투자협회가 각 펀드에 부여하는 5자리 고유 코드입니다. 각종 정보를 조회할 때 펀드 이름 대신 쓸 수 있습니다.

주식형 펀드

일반적으로 집합투자재산의 60% 이상을 주식에 투자하는 펀드입니다.

채권형 펀드

펀드의 60% 이상을 채권에 투자합니다. 일반적으로 주식에는 투자하지 않습니다.

주식혼합/채권혼합형 펀드

주식과 채권에 모두 투자할 수 있는 펀드입니다. 주식에 50% 이상을 투자할 수 있으면 '주식혼합형', 주식에 50% 미만만 투자할 수 있으면 '채권혼합형'이라고 합니다.

기준가격

펀드를 매매하거나 결과를 배분할 때 적용하는 가격입니다. 펀드를 매매하거나 배분하기 전날의 순자산총액을 이날까지 발행한 수익증권 총량으로 나누고 이에 1000을 곱하여 표시합니다. 통상 소수점 아래 셋째자리에서 반올림합니다.

모자형 펀드

자펀드는 모펀드에서 발행한 집합투자증권을 취득하며, 그 운용은 모펀드가 합니다. 모자형 펀드는 다음 요건을 모두 충족해야 설정 및 설립을 할 수 있습니다.
1. 자펀드는 모펀드에서 발행한 집합투자증권 이외의 집합투자증권을 취득할 수 없습니다.
2. 모펀드에서 발행한 집합투자증권은 자펀드만이 취득할 수 있습니다.
3. 모펀드와 자펀드의 집합투자업자는 동일해야 합니다.

개방형 펀드

투자자가 원하면 언제든지 환매할 수 있는 펀드입니다.

폐쇄형 펀드

정해진 기한까지 환매할 수 없는 펀드입니다.

추가형 펀드

언제든지 추가로 투자할 수 있는 펀드입니다.

단위형 펀드

모집 시기, 즉 판매 기간이 정해져 있어 그 기간 외에는 가입할 수 없는 펀드입니다.

종류형 펀드

펀드는 하나지만 그 안에 서로 다른 투자자그룹(클래스)을 두고 각 그룹에 판매보수와 수수료를 다르게 적용하는 상품입니다. 보통은 멀티클래스 펀드라고 합니다. 보수와 수수료가 달라 그룹별 기준가격에는 차이가 있지만 각 그룹은 하나로 간주되어 통합 운용됩니다. 따라서 자산운용 및 평가방법은 동일합니다.

보수

펀드를 운용하고 관리하는 데 드는 비용입니다. 다시 말해 재산을 운용하고 관리해 준 대가로 고객이 내는 비용입니다. 이는 일반적으로 연율로 표시합니다. 보수의 종류는 집합투자업자에게 지불하는 운용보수, 투자매매/중개업자에게 지불하는 판매보수 등이 있습니다. 보수율은 일반적으로 상품마다 다릅니다.

기타비용

위탁매매 수수료, 회계감사 비용, 유가증권 등의 예탁 및 결제 비용 등 통상 반복적으로 발생하는 비용을 말합니다.

매매회전율

주식 매매의 빈도를 나타내는 지표입니다. 해당 운용 기간에 매도한 주식가액을 같은 기간에 평균적으로 보유한 주식가액으로 나누어 산출합니다. 예를 들어 일정 기간의 주식 매입 규모가 100억 원이고 주식 매도 규모 또한 100억 원이면 매매회전율은 100%가 됩니다.

매매수수료 비율

해당 운용기간 중 펀드에서 유가증권 및 파생상품 등을 매매하는 데 든 수수료 총액을 펀드의 순자산총액(보수, 비용 차감 전 기준)으로 나눈 비율입니다. 매매수수료율은 펀드의 비용과 비례합니다.