

이스트스프링 원자재 스마트 초이스 특별자산투자신탁 제1호[원자재-파생형] 클래스 C-F

2019년 2월 말 기준

투자목적 및 전략

이 투자신탁은 원자재시장 인덱스인 Citi CUBES DJ-UBSCI Weighted ER Index와 개별 원자재 인덱스인 Citi CUBES 8 Trend Allocator ER Index의 성과와 연계된 장외파생상품에 투자하여 원자재 인덱스의 상승에 따른 수익을 추구합니다.

<기초자산 소개>

Citi CUBES DJ-UBSCI (Dow Jones-UBS Commodity Index) Weighted ER Index:

- 개별 원자재 선물로 구성된 전통적인 원자재 지수인 Bloomberg Commodity Index와 동일한 비중으로 개별 원자재에 대한 투자비중 유지
- 개별 원자재에 대한 투자비중은 직전 월 마지막 영업일의 Bloomberg Commodity Index의 개별 원자재 투자 비중을 기준으로 매월 첫번째 영업일에 투자비중 조정

Citi CUBES 8 Trend Allocator ER Index:

- 원자재 시장의 4개 주요섹터 (에너지, 귀금속, 비철금속 및 농산물) 가운데 가장 유동성이 풍부한 8개의 개별 원자재 선물을 투자대상으로 하여 인덱스를 구성
- 8개의 개별 원자재 가운데 매월 말 기준으로 과거 3개월 수익률이 가장 우수한 최대 4개의 개별 원자재에 동일비중(개별 원자재 투자비중 각 25%)으로 투자

펀드내역

펀드규모 239억 원

펀드유형 특별자산파생 투자신탁(원자재-파생형)

- 파생상품 투자: 50% 이상
- 채권 투자: 95% 이하

설정일 2012년 3월 14일

벤치마크

Citi CUBES DJ-UBSCI Weighted ER Index(USD) 57% + Citi CUBES 8 Trend Allocator ER Index (USD) 38% + 유동성 5%

신탁업자 한국씨티은행

환매대금 지급일

구분	기준가격 적용일	환매대금 지급일
17시 이전	4영업일	6영업일
17시 경과후	5영업일	7영업일

투자위험등급 4등급 (보통 위험)

1	2	3	4	5	6
---	---	---	---	---	---

보수 및 수수료

보수(순자산총액 기준)

-클래스 C-F 연 0.4335% (판매 0.03%)
(운용 0.40%, 신탁 및 사무관리 0.035%)

선취판매수수료

없음

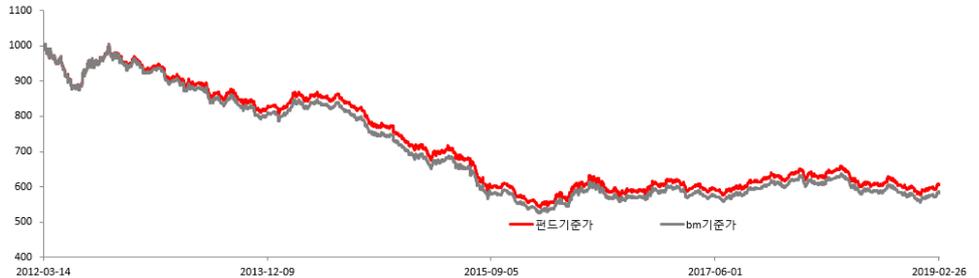
환매수수료

없음

펀드 운용 성과(보수 차감 후 세전 수익률)

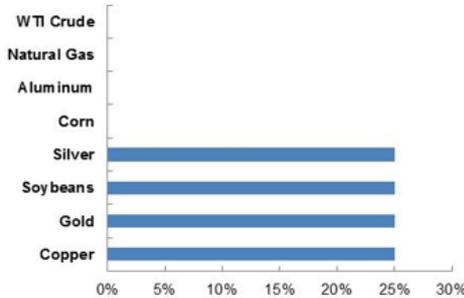
	1개월	3개월	6개월	1년	3년	5년	설정 이후
클래스 C-F	1.22%	1.90%	-0.67%	-4.96%	9.00%	-29.24%	-39.43%
벤치마크 수익률	1.16%	1.71%	-1.00%	-5.41%	8.65%	-30.03%	-41.64%

*상기 투자실적은 과거 실적을 나타낸 뿐 미래의 운용실적을 보장하는 것은 아닙니다.
*클래스별 설정일이 달라 설정 이후 수익률은 클래스별로 상이하며, 보수 수준 차이로 인해 클래스별 성과는 차이가 날 수 있습니다.

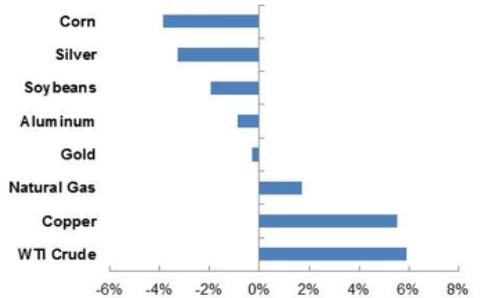


하위 인덱스 별 원자재 구성현황 (2019년 2월말)

< Citi CUBES 8 Trend Allocator ER Index >



< 섹터 별 성과 mom(%) >



<펀드기준가 및 하위 인덱스 별 편입비중 추이>



펀드 운용현황

2월 한 달간 Citi CUBES 8 Trend Allocator Plus Index가 상승함에 따라 펀드 기준가는 상승하였습니다. 펀드에서는 한 달 동안 은, 금, 구리, 대두에 추가적으로 투자하였습니다. 유가는 이란 및 베네수엘라 제재와 OPEC의 감산 소식 등으로 인하여 전월에 이어 상승세가 지속되었습니다. 금 가격은 유가 오름세에 따른 인플레이션 헤지 수요 유입에도, 매파적으로 해석된 1월 FOMC 등이 금 가격 상단을 제한하였습니다. 비철 금속은 무역 협상 진전과 광산 가동 중단 등으로 상승하는 모습을 보였으며, 곡물 가격은 연초 가격 상승을 야기한 기상 이슈등의 해소로 인하여 하락 하였습니다.

* 본 자료는 고객에 대한 단순 정보제공의 목적으로 작성된 것으로 수익증권의 매입을 권유하거나 광고하기 위하여 작성된 자료가 아닙니다. * 따라서 본 자료는 당사 홈페이지 외에 게시할 수 없으며 기존 가입고객 이외에는 교부할 수 없습니다. * 집합투자상품은 예금자보호법에 따라 예금보험공사가 보호하지 않으며, 운용 결과에 따른 이익 또는 손실이 투자자에게 귀속됩니다. * 본 상품을 취득하시기 전에 투자대상, 환매방법 및 보수 등에 관하여 (간이)투자설명서를 반드시 읽어보시기 바랍니다. * 본 자료에 수록된 시장전망 및 운용계획은 특정시점의 시장상황을 바탕으로 서술한 것으로서 고객과의 합의나 확약을 위하여 작성된 것이 아니며, 실제의 운용 및 실적 수익률은 시장상황의 변화에 따라 본 자료에 수록된 내용과 다르게 이루어 질 수 있습니다. * 본 자료에 포함된 모든 정보는 당사의 승인 없이 복제되어 유통될 수 없습니다. * 과거의 운용실적이 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아니며 종류형 집합투자증권에 부과되는 보수·수수료의 차이로 운용실적이 달라질 수 있습니다. * 해외투자상품의 경우 환율의 변동에 따라 자산가치가 변동되거나, 투자대상국의 시장, 정치 및 경제상황 등에 따른 위험으로 자산가치의 손실이 발생할 수 있으며, 환율변동에 의한 환차익은 과세 대상입니다. * 영국 프루덴셜 그룹은 미국에 본사를 두고 있는 푸르덴셜 파이낸셜과 아무런 제휴관계가 없습니다.