eastspring investments
이스트스프링자산운용코리아

A Prudential plc (UK) company

이스트스프링 자산운용 보고서

이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2022년 07월 02일 – 2022년 08월 11일

- 이 상품은 [주식형 펀드] 로서, [추가 입금이 가능한 추가형이고, 다양한 판매보수의 종류를 선택할 수 있는 종류형 펀드입니다.]
- 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월)동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

▶공지사항

- 고객님이 가입하신 펀드는 [자본시장과 금융투자업에 관한 법률]의 적용을 받습니다.
- 이 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의해 [이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]]의 자산운용회사인 [이스트스프링자산운용코리아]이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 [국민은행]의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다.
- 투자자의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 통해 조회할 수 있습니다.

이스트스프링자산운용코리아 소개

이스트스프링자산운용코리아(Eastspring Asset Management Korea Co. Ltd.)는 170여년 전통의 역사를 가진 영국 프루덴셜 금융그룹(Prudential plc)의 자산운용 부문 브랜드 중 하나인 이스트스프링 인베스트먼트(Eastspring Investments)의 일원으로서 한국에서 개인 및 기관 고객을 대상으로 금융 상품과 자산운용 서비스를 제공하고 있습니다. 영국 프루덴셜 그룹이 굿모닝투자신탁을 2002년 인수하며 대주주가 된 이래 PCA투신운용, PCA자산운용의 사명을 거쳐, 2012년 그룹 차원에서 아시아 자산운용 사업 부문을 이스트스프링 인베스트먼트로 브랜드를 변경하며 현재의 이스트스프링자산운용코리아가 되었습니다.

*이스트스프링자산운용 코리아는 영국에서 설립된 프루덴셜 금융그룹(Prudential plc)의 일원입니다. 영국 프루덴셜 금융그룹은 미국의 푸르덴셜 (Prudential Financial Inc.)과 영국 M&G plc의 자회사인 Prudential Assurance Company의 관계회사가 아닙니다.

영국 프루덴셜 금융그룹 및 이스트스프링 글로벌

이스트스프링 인베스트먼트(Eastspring Investments)는 영국 프루덴셜 금융그룹(Prudential plc)에 속한 아시아에 핵심 기반을 둔 글로벌 자산운용사입니다. '고객의 미래에 투자하는 아시아의 투자 전문가 (Experts in Asia, Invested in Your Future)'라는 뚜렷한 목표를 바탕으로 고객분들의 다양한 투자 수요를 만족시키기 위한 혁신적인 투자 솔루션을 제공하고 있습니다.

글로벌 시장에 대한 경험과 아시아 시장에 대한 깊은 이해는 이스트스프링 인베스트먼트만의 경쟁력입니다. 이스트스프링은 고객, 임직원, 파트너, 주주 그리고 우리가 속한 공동체 그 모두를 위한 미래에 확고한 투자를 이어나가고 있습니다.

25년이 넘는 기간동안 이스트스프링 인베스트먼트는 북미, 유럽의 판매 사무소를 비롯해 11개 아시아 시장[1]에서 꾸준히 성장하며, 글로벌 기관 및 개인투자자들을 위해 미달러 기준 2,480억 규모[2]의 주식, 채권, 멀티에셋, 퀀트, 대체 전략 자산을 운용하고 있습니다.

이스트스프링 인베스트먼트의 각 부문별 다양성을 기반으로 형성된 열린 대화와 토론 문화는, 투자자들을 위한 최선의 투자 아이디어와 높은 확신을 가진 투자 견해를 추구하는데 큰 역할을 담당하고 있습니다. 우리는 글로벌 지속가능성 움직임에 동참하고 있으며 UN 책임투자 원칙에 서명한 회원사입니다. 이스트스프링 투자팀은 투자 철학과 투자 과정에 ESG요소를 반영하고 있습니다.

이스트스프링 인베스트먼트는 고객분들을 위한 양질의 투자 성과를 달성하기 위해 열정과 최선을 다해 전념하고 있습니다.

[1] 11개 아시아 국가 : 인도네시아, 홍콩, 일본, 말레이시아, 한국, 싱가포르, 대만, 베트남, 태국, 중국, 인도

[2] 2020년 12월말 기준

Contents

02 이스트스프링자산운용 소개
03 CEO 인사말
04 펀드 브리핑
06 펀드용어 해설
07 1. 펀드의 개요
2. 수익률현황
08 3. 자산 현황
4. 투자운용전문인력 현황
5. 비용 현황
09 6. 투자자산 매매내역
7. 동일한(해당) 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황
8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

각종 보고서 확인

- 이스트스프링자산운용코리아(주) : www.eastspringinvestments.co.kr
- 금융투자협회 : http://dis.kofia.or.kr

CEO 인사말

eastspring investments
이스트스프링자산운용코리아
A Prudential plc (UK) company

항상 저희 이스트스프링에 보내주시는 관심과 후원에 깊이 감사드립니다. 이스트스프링자산운용 코리아는 170여년 전통의 영국 프루덴셜 금융그룹(Prudential plc)의 일원으로서 아시아 중심의 글로벌 자산운용사인 이스트스프링 인베스트먼트(Eastspring Investments) 내에서 핵심적인 역할을 하고 있습니다. 이스트스프링 인베스트먼트(Eastspring Investments)는 아시아 지역의 11개 나라에서 약 270조원에 달하는 고객자산을 운용하고 있습니다. 이스트스프링의 운용기술과 경험이 모회사인 영국 프루덴셜 금융그룹의 리스크 관리 노하우와 결합하여, 투자가들이 신뢰할 수 있는 최고의 상품과 서비스를 제공하기 위해 노력하고 있습니다.

이스트스프링자산운용 코리아는 국내에 운용조직을 두고 전통적인 국내 액티브 주식형, 채권형 펀드뿐만 아니라 인덱스 펀드, 퀀트 기법을 접목한 EMP(ETF Managed Portfolio)펀드 등 다양한 전략의 상품을 직접 운용하고 있습니다. 여기에 더 나아가 이스트스프링 아시아 지역 본부와 미국의 관계사 PPMA 등과 끊임없이 투자 의견을 교환하며 중국 A주, 이머징 시장 주식, 미국 투자적격회사채, 아시아 로우볼 주식 등 선진/신흥 시장의 다양한 자산과 전략에 투자할 수 있는 상품도 꾸준히 국내 시장에 소개하고 있습니다. 이렇게 다양한 상품 라인업으로 국내 투자자들이 시장 상황과 개개인의 수익-위험 선호도에 맞는 상품을 선택할 수 있도록 폭넓은 투자기회를 제공하고 있습니다.

이스트스프링은 또한 전사적으로 국제 책임투자원칙(UN Principles for Responsible Investment)을 도입해 투자 결정 과정에 ESG(환경, 사회, 지배구조) 요소를 적극 반영하고 있습니다. 이에 발맞춰 이스트스프링자산운용코리아는 2019년 책임투자위원회를 신설하고 스튜어드십코드 도입을 완료하였으며, 기존의 지속성장기업 주식형 펀드의 운용을 더욱 체계화하여 사회책임투자 운용사로서의 역량도 더욱 확대하고 있습니다. 또한 끊임없는 연구 자세로 기존 액티브 운용에 산학 연구의 결과로 얻은 딥러닝 알고리즘 시스템을 보완하는 등 운용 프로세스를 강화하는데도 꾸준히 노력하고 있습니다.

세계 각국 중앙은행들의 선제적 금리인하와 유동성 공급으로 세계경제는 경기하강세를 잘 관리하며 금융시장의 강세를 유도해왔습니다. 그러나 이과정에서 만성화된 과잉유동성은 상황에 따라 새로운 위기를 만들어 낼 수도 있는 잠재적 위험을 안고 있는 것도 사실입니다. 따라서 투자에 있어서의 엄격한 규율과 리스크 관리 역량이 그 어느때 보다 중요해졌다고 생각합니다.

'고객의 미래에 투자하는 아시아의 투자 전문가 (Experts in Asia, Invested in Your Future)'로서 그리고 고객의 든든한 자산운용 조력자로서 이스트스프링자산운용은 이러한 상황들을 주시하며 투자가들의 후생을 위한 노력을 지속해 나가겠습니다.

이스트스프링자산운용코리아 대표이사 사장 박 천 웅

* 이스트스프링자산운용 코리아는 영국에서 설립된 프루덴셜 금융그룹(Prudential plc)의 일원입니다. 영국 프루덴셜 금융그룹은 미국의 푸르덴셜(Prudential Financial Inc.)과 영국 M&G plc의 자회사인 Prudential Assurance Company의 관계회사가 아닙니다.

내가가입한펀드브리핑

이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2022년 07월 02일 – 2022년 08월 11일

eastspring investments

내 펀드의 운용경과를 살펴보겠습니다.

펀드매니저
박소영

7월 FOMC에서 75bps 수준의 금리 인상을 단행하였으나, 이는 시장에서 유가를 중심으로 한 인플레이션과 긴축 사이클이 정점을 지났다는 인식으로 전환되며 증시의 반등을 이끌었습니다. 특히, 국내 주요 기업의 2분기 실적이 견조한 수출과 원화 약세 등의 요인으로 선방함에 따라 한국 증시의 저평가 매력이 부각되는 주요 원인으로 작용하였습니다.

당월 매매는 실적 변동성이 증가한 화학, 섬유의복, 기계 업종과 기존에 방어적인 역할을 충분히 한 통신업종을 차익실현하여 하반기와 내년 실적 개선 가시성이 높은 2차전지, 미디어/엔터 및 자동차/부품 업종과 낙폭과대 성장주 중 성장 가시성이 높은 인터넷 업종에서 선별적으로 비중을 확대했습니다.

업종별로는 전자부품, 자동차, 조선 업종에서의 종목선택 효과가 긍정적으로 작용했고, 화학, 인터넷, 의약 업종에서의 종목선택 효과가 성과에 부정적으로 작용했습니다. 종목단에서는 2분기 실적 서프라이즈와 하반기 실적 개선 가시성이 높은 현대차와 2차전지소재 핵심 경쟁력과 확장성을 보유한 LG화학과 북미공장신설 결정으로 성장 가시성이 높아진 삼성SDI가 긍정적으로 기여했습니다. 반면 중국 정부의 폴리실리콘 가격 강세 제한 개입 가능성으로 조정 받은 OCI와 풍력에 대한 정책적 지원책 발표 지연과 실적 부진으로 조정받은 씨에스윈드가 부정적으로 작용하였으며, 수급우려가 해소되어 반등한 LG에너지솔루션을 비중을 확대해 나가는 과정에서 시장비중보다 적게 보유했던 점이 성과에 부정적이었습니다.

내 펀드의 최근 3개월, 1년, 5년 수익률은?

(단위 : %)

펀드명	최근 3개월 수익률	최근 1년 수익률	최근 5년 수익률
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]	**-4.14**	**-21.34**	**28.67**
(비교지수대비 성과)	(-1.50)	(0.30)	(19.87)
비 교 지 수	-2.64	-21.64	8.80

* 비교지수 : KOSPI 100%

※상기 투자실적은 과거 실적을 나타낼 뿐 미래의 운용실적을 보장하는 것은 아닙니다.
※상기 펀드의 투자실적은 펀드의 종류형별로 수익률이 달라질 수 있으므로 자세한 사항은 보고서 본문을 참조하시기 바랍니다.
※상기 펀드의 비교지수 변경 내역은 보고서 본문을 참조하시기 바랍니다.
※클래스별 설정일이 달라 설정 이후 수익률은 클래스 별로 상이하며, 보수 수준 차이로 인해 클래스별 성과는 차이가 날 수 있습니다. 상기 수익률은 단순 누적 수익률이며, 보수 공제 전 세전 수익률 기준입니다.

내가가입한펀드브리핑

이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2022년 07월 02일 – 2022년 08월 11일

eastspring investments

내 펀드의 투자환경 및 운용계획을 살펴보겠습니다.

6월과 7월의 자이언트스텝과 빅스텝 이후 연준의 2023년 점도표는 3.8%로 추가 예상 금리 인상폭은 지금까지 금리 인상폭의 절반도 남지 않았습니다. 따라서 금리 인상속도 및 강도에 대한 부담이 완화되었다고 보며 연준의 경기 둔화는 인정하나 경기 침체는 아니라는 스탠스는 시장이 다소 안도할 수 있는 기반을 형성했다고 판단합니다. 다만 연준에서 견조하다고 보는 고용 부문에서 신규실업급여 청구 건수가 7-8개월내 최고치로 상승하여 향후 고용지표에 부정적인 영향을 미칠 가능성을 염두에 두고 경기의 침체 시나리오도 배제하지 않고 있습니다.

연초 이후 20% 이상 조정 받은 KOSPI 대비 기업들의 실적 하향 조정폭은 적었습니다. 따라서 향후 실적의 방향성을 가늠하기 위한 환율, 수출 물량, 원자재 가격, (친환경) 정책적 지원 등과 같은 변수들을 지속적으로 체크해야 할 필요가 있습니다. KOSPI 할인율은 12.1%로 2005년 이후 최고 수준이며 12개월 예상 PBR이 0.8x로 밴드 하단임을 감안하면 추가적인 큰 폭의 이익 하향 조정이 되지 않는 한 valuation상 하방 경직성이 존재할 것으로 보고 불확실한 매크로 상황에서 기업별 이익의 방향성에 주목할 계획입니다. KOSPI는 평균적으로 12개월 예상 순이익의 방향성에 3개월 정도 선행함을 감안하면 4분기와 내년 이익 회복 여력 보유 기업 선별에 더욱 중요하게 작용할 것으로 예상합니다. 경기 둔화 국면에서 시장의 변동성이 증가하고 있어 기업의 실적과 내재가치에 더욱 집중해야 할 시기입니다. 특히 시장 이익에서 30% 이상 비중을 차지하는 반도체 업종의 실적 반등 시기와 그 보다 선행할 주가 반등 시기 감안 시 선제적인 비중 확대가 중요하다고 판단하며 최대한 기회비용을 최소화하기 위해 관련 지표들을 면밀하게 모니터해 나가겠습니다. 또한 낙폭과대 성장주 중에서도 성장 가시성이 높으며 valuation이 부담스럽지 않아진 종목들의 비중 확대 기회도 점진적으로 모색해 나갈 계획입니다.

기업들의 비재무적인 체력의 개선이 재무성과와 주주가치 상승으로 연결된다는 믿음을 갖고 기업의 장기적인 기회과 리스크를 점검하기위한 ESG 관점에서의 커뮤니케이션을 지속적으로 강화해 나갈 계획입니다.

펀드용어 해설

eastspring investments

펀드용어 해설

집합투자기구(펀드)

집합투자기구란 대중으로부터 자금을 모아 그 금액을 주식이나 채권 등에 투자하여 얻은 수익실적에 따라 배당하는 금융상품을 말합니다.

집합투자증권

집합투자증권은 집합투자기구(펀드)의 수익권을 말하며, 펀드(집합투자기구)에 투자했다고 하는 것은 이 집합투자증권을 보유하게 된 것을 말합니다.

금융투자협회 코드

모든 집합투자기구에는 금융투자협회가 부여하는 5 자리의 고유 코드가 존재하며, 집합투자기구의 명칭뿐 아니라 이 코드를 이용하여 해당 집합투자기구의 정보에 대한 조회가 가능합니다.

추가형

투자자가 원하는 경우 언제든지 추가로 자금 납부가 가능한 집합투자기구입니다.

개방형

투자자가 원하는 경우 언제든지 환매청구가 가능한 집합투자기구입니다.

단위형

추가로 매입 신청(자금 납부)가 불가능한 집합투자기구입니다.

폐쇄형

펀드 만기일 전까지 별도의 환매 청구가 불가능한 집합투자기구입니다.

종류형

클래스형이라고도 불립니다. 클래스 펀드란 하나의 펀드내에서 클래스(Class) 별로 서로 다른 판매보수와 수수료 체계를 적용하는 상품을 말합니다. 보수와 수수료의 차이로 클래스별 기준 가격은 다르게 산출되지만, 각 클래스는 하나의 펀드로 간주되어 통합 운용되므로 자산운용 및 평가 방법은 동일하게 적용됩니다.

모자형

모집합투자기구가 발행하는 집합투자증권을 자집합투자기구가 취득하는 구조를 말합니다.

기준가격

집합투자기구의 매입 · 환매 및 분배시 적용되는 가격으로, 기준가격의 산정은 전일의 집합투자재산 순자산총액을 전일의 집합투자기구의 잔존 집합투자증권 수량으로 나누어 1,000을 곱한 가격으로 표시하고, 소수점 셋째 자리에서 반올림합니다.

보수

보수란 집합투자재산을 운용 및 관리해준 대가로 고객이 지불하는 비용입니다. 이는 통상 연율로 표시되며, 집합투자업자 보수, 판매업자 보수, 신탁업자 보수, 사무수탁 보수 등이 있습니다. 보수율은 상품마다 다르게 책정되는 것이 일반적입니다.

비교지수

벤치마크로 불리기도 하며, 펀드성과 비교를 위해 정해놓은 지수입니다. 일반적으로 액티브펀드의 경우 비교지수 대비 초과수익을 목표로 운용되며, 인덱스펀드는 비교지수의 추종을 목적으로 합니다.

환헤지

해외자산에 투자하는 집합투자기구는 대부분 외국통화로 자산을 사들이게 되며, 운용기간 중에 환율이 하락(원화강세)하면 환차손(환율 변동에 따른 손실)이 발생할 수 있습니다. 따라서 해외자산에 투자하는 집합투자기구의 경우 선물환 계약(미리 정해놓은 환율을 만기 때 적용하는 것) 등을 이용하여 환율 변동에 따른 손실 위험을 제거하는 환헤지 전략을 구사하기도 합니다.

장내파생상품과 장외파생상품

파생상품이란 기초자산 상품으로부터 파생된 자산 상품을 말합니다. 파생상품 중 선물, 장내옵션이 장내파생상품이며 장외옵션, 스왑, 선도거래를 장외파생상품이라 합니다. 장외거래는 보통 유연성이 있고, 맞춤형 거래가 가능하다는 특징이 있습니다.

변동성

주식, 채권 등의 투자 대상이 일정기간 가격이 변동하는 정도를 말하며 변동성이 높을수록 가격이 변동할 확률이 높다는 것을 나타냅니다.

롱 전략

일반적으로 알고 있는 자산의 매매기법으로, 자산을 사서 오를때까지 기다렸다가 오른 가격에 파는 것을 추구하는 전략을 말합니다.

숏 전략

매도 전략을 뜻하는 말로, 주식의 경우 가격 하락이 예상되는 종목을 미리 빌려서 팔고 나중에 가격이 떨어졌을 때 같은 종목을 사서 싸게 되갚는 매매 기법을 말합니다. 주식 외의 다른 자산에서도 구사가 가능하며, 일반적으로 가격 하락을 예상하며 구사하는 매매 전략을 말합니다.

이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2022년 07월 02일 – 2022년 08월 11일

eastspring investments
이스트스프링자산운용코리아
A Prudential plc (UK) company

1 펀드의 개요

2등급(높은 위험)

1	2	3	4	5	6

▶기본 정보 [적용법률 : 자본시장과 금융투자업에 관한 법률]

펀드 명칭	금융투자협회 펀드코드
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]	31892
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식] 클래스 C5	96602
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식] 클래스 C–E	29166
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식] 클래스 S–P	BC426
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식] 클래스 C–F	49364

고난도 펀드	해당없음
최초설정일	2001.04.02
운용기간	2022.07.02 – 2022.08.11
존속기간	2001.04.02 – 2022.08.12
펀드의 종류	투자신탁,증권펀드(주식형),추가형,개방형,종류형
자산운용회사	이스트스프링자산운용코리아
판매회사	IBK투자증권,신한금융투자,HSBC은행 외 5개
펀드재산보관회사(신탁업자)	국민은행
일반사무관리회사	신한아이타스
상품의 특징 (투자전략)	신탁재산의 대부분을 내재가치 대비 저평가된 대형 우량주 중심의 국내 주식에 투자하여 주식의 가격 상승에 따른 자본이익의 극대화를 추구합니다. 수익자는 국내에서 발행되어 거래되는 국내 주식에 직접 투자하는 위험과 유사한 위험을 부담할 수 있으며 주식은 다양한 경제변수에 연동되어 수익이 변동되는 위험을 가지고 있습니다. 그러나 이 투자신탁의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없습니다.

주) 펀드의 자세한 판매회사는 금융투자협회 홈페이지 [http://dis.kofia.or.kr],
운용사 홈페이지 [www.eastspringinvestments.co.kr] 에서 확인하실 수 있습니다.

▶재산현황

아래 표를 통하여 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액,
순자산총액 및 기준가격의 추이를 비교하실 수 있습니다.

(단위 : 백만원, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]	자산총액	5,389	4,362	–19.06
	부채총액	76	0	–99.98
	순자산총액	5,313	4,362	–17.90
	기준가격	1,158.55	1,233.21	6.44
종류(Class)별 기준가격 현황				
클래스 C5	기준가격	1,032.06	1,096.54	6.25
클래스 C–E	기준가격	1,192.04	1,266.89	6.28
클래스 S–P	기준가격	1,008.05	1,071.98	6.34
클래스 C–F	기준가격	1,127.46	1,199.15	6.36

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다. (원단위로 표시)

▶분배금내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

분배금 지급일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2022.08.12	825	3,537	1,233.21	1,000.00	

2 수익률 현황

▶수익률 현황 [기준일자 : 2022년 08월 11일]

(단위 : %)

펀드명칭	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]	–4.14	–10.30	–14.64	–21.34	4.71	40.34	28.67
(비교지수대비 성과)	(–1.50)	(–2.15)	(–0.93)	(0.30)	(0.36)	(10.10)	(19.87)
비 교 지 수	–2.64	–8.15	–13.71	–21.64	4.35	30.24	8.80

※ 클래스별 설정일이 달라 설정 이후 수익률은 클래스 별로 상이하며, 보수 수준 차이로 인해 클래스별 성과는 차이가 날 수 있습니다. 상기 수익률은 단순 누적 수익률이며, 보수 공제 전 세전 수익률 기준입니다

종류(Class)별 현황							
클래스 C5	–4.59	–11.09	–15.76	–22.72	1.18	33.31	18.12
(비교지수대비 성과)	(–1.95)	(–2.94)	(–2.05)	(–1.08)	(–3.17)	(3.07)	(9.32)
비 교 지 수	–2.64	–8.15	–13.71	–21.64	4.35	30.24	8.80
클래스 C–E	–4.52	–10.96	–15.59	–22.51	1.72	34.40	19.69
(비교지수대비 성과)	(–1.88)	(–2.81)	(–1.88)	(–0.87)	(–2.63)	(4.16)	(10.89)
비 교 지 수	–2.64	–8.15	–13.71	–21.64	4.35	30.24	8.80
클래스 S–P	–4.37	–10.71	–15.23	–22.06	–	–	–
(비교지수대비 성과)	(–1.73)	(–2.56)	(–1.52)	(–0.42)	–	–	–
비 교 지 수	–2.64	–8.15	–13.71	–21.64	–	–	–
클래스 C–F	–4.33	–10.64	–15.13	–21.94	3.17	37.26	23.99
(비교지수대비 성과)	(–1.69)	(–2.49)	(–1.42)	(–0.30)	(–1.18)	(7.02)	(15.19)
비 교 지 수	–2.64	–8.15	–13.71	–21.64	4.35	30.24	8.80

* 비교지수 : KOSPI 100%

* 클래스별 설정일이 달라 설정 이후 수익률은 클래스 별로 상이하며, 보수 수준 차이로 인해 클래스별 성과는 차이가 날 수 있습니다. 상기 수익률은 단순 누적 수익률이며, 보수 공제 후 세전 수익률 기준입니다.

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

주) (지속성장기업증권[주식]C4) 은 2022.05.16 로 전액상환되어 보고서기준일 시점 원본액이 0임으로 수익률 정보를 기재하지 않습니다. 자세한 사항은 판매사에게 문의 부탁드립니다.
주1) 지속성장기업증권[주식]S–P 미운용기간 2020.08.20 ~ 2020.09.24

▶손익현황

(단위 : 백만원)

구 분	증 권				파생상품		단기대출 및예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외			
전기	–933	–	–	–	–	–	0	–1	–933
당기	302	–	–	–	–	–	0	0	302

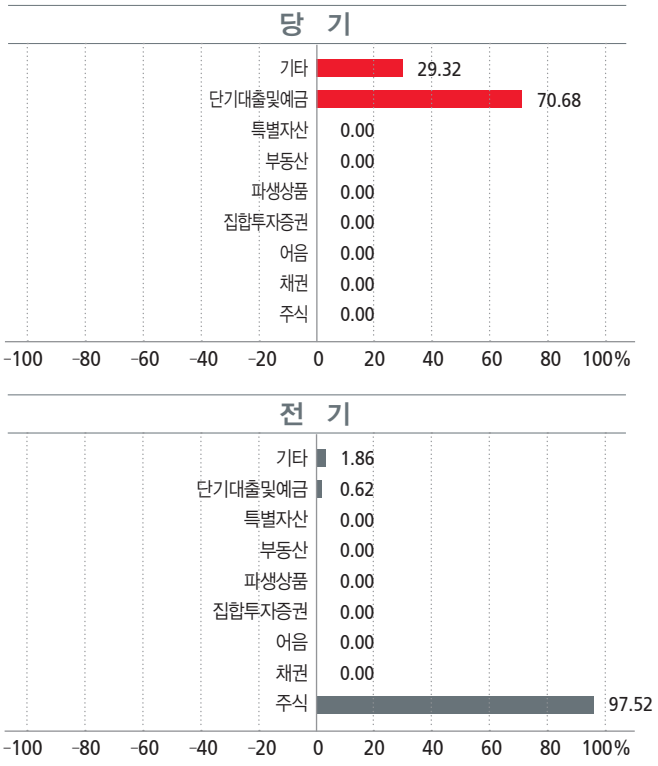
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2022년 07월 02일 – 2022년 08월 11일

eastspring investments
이스트스프링자산운용코리아
A Prudential plc (UK) company

3 자산 현황

▶자산구성현황



[자산구성현황] (단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증 권				파생상품		단기대출 및예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외			
KRW	–	–	–	–	–	–	3,083	1,279	4,362
	–	–	–	–	–	–	(70.68)	(29.32)	(100.00)
합계	–	–	–	–	–	–	3,083	1,279	4,362
	–	–	–	–	–	–	(70.68)	(29.32)	(100.00)

* ( ) : 구성 비중

▶ 주요 자산보유 현황

펀드자산 총액에서 상위 10종목, 자산총액의(파생상품의 경우 위험평가액) 5% 초과 보유종목 및 발행주식 총수의 1% 초과 종목의 보유내역을 보여줍니다.

※ 보다 상세한 투자대상자산 내역은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실수 있습니다. (인터넷 주소 : http://dis.kofia.or.kr) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

단기대출 및 예금

(단위 : 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	비고
예금	국민은행		3,083	1.84		70.68

기타

(단위 : 백만원)

종류	금액	비고
미수입금	1,266	29.03

4 투자운용전문인력 현황

▶투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	운용중인 다른 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		주요 경력 및 운용내역	협회 등록번호
		개수	운용규모	개수	운용규모		
박소영	책임운용 전문인력	3	90	–	–	삼성증권,국민연금, Lombard Odier	2112000620

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자의사 결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

※ 펀드의 운용전문인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷주소 http://dis.kofia.or.kr) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다

▶운용전문인력 변경내역 해당사항 없음

5 비용 현황

▶보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원, %)

펀드 명칭	구분		전기		당기	
			금액	비율(%)*	금액	비율(%)*
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]	자산운용회사		9.53	0.16	3.56	0.07
	판매회사		4.82	0.08	1.79	0.04
	클래스 C5		4.50	0.25	1.67	0.11
	클래스 C–E		0.01	0.19	0.00	0.08
	클래스 S–P		0.00	0.05	0.00	0.02
	클래스 C–F		0.31	0.01	0.12	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0.74	0.01	0.28	0.01
	일반사무관리회사		0.22	0.00	0.08	0.00
	보수 합계		15.31	0.26	5.72	0.12
	기타비용**		0.03	0.00	0.02	0.00
	매매·중개 수수료	단순매매·중개 수수료	2.31	0.04	2.94	0.06
		조사분석업무 등 서비스 수수료	3.46	0.06	4.41	0.09
		합계	5.77	0.10	7.35	0.15
	증권거래세		6.90	0.12	14.57	0.30

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적 · 반복적으로 지출된 비용으로서 매매 · 중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 해당사항 없음

이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2022년 07월 02일 – 2022년 08월 11일

eastspring investments
이스트스프링자산운용코리아
A Prudential plc (UK) company

▶총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

펀드 명칭	구분	해당 펀드			상위펀드 비용합산		
		총보수 · 비용 비율 (A)	매매 • 중개수수료비율(B)	합계 (A+B)	총보수 · 비용 비율 (A)	매매 • 중개수수료비율(B)	합계 (A+B)
이스트스프링 지속성장기업 증권투자신탁[주식]	전기	0.00	0.39	0.39	0.00	0.39	0.39
	당기	0.00	1.33	1.33	0.00	1.33	1.33
종류(class)별 현황							
클래스 C5	전기	1.71	–	1.71	1.71	0.39	2.10
	당기	1.71	–	1.71	1.71	1.30	3.02
클래스 C-E	전기	1.44	–	1.44	1.44	0.39	1.83
	당기	1.43	–	1.43	1.44	1.22	2.66
클래스 S-P	전기	0.89	–	0.89	0.89	0.39	1.28
	당기	0.89	–	0.89	0.89	1.45	2.35
클래스 C-F	전기	0.74	–	0.74	0.74	0.39	1.13
	당기	0.74	–	0.74	0.74	1.34	2.09

주1) 총보수, 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수와 기타비용총액을 순자산 연평잔액(보수 • 비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수 • 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.

6 투자자산매매내역

▶매매주식규모 및 회전율

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율주1)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
11,949	761	97,595	6,339	134.09	1,193.68

주1) 해당운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율
주2) 다수의 모펀드에 투자하는 경우, 자펀드가 투자하는 모펀드의 비율에 따라 가중치로 안분하였습니다.
모펀드의 세부 구성은 〈펀드구성〉을 참고해 주시기 바랍니다.

▶최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

2021.10.02 ~ 2022.01.01	2022.01.02 ~ 2022.04.01	2022.04.02 ~ 2022.07.01
43.51	52.89	51.74

주) 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.23%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드 비용이 증가합니다.

7 동일한(해당) 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

해당사항 없음

8 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

① 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

본 투자신탁은 투자대상 자산 시장 전체의 가격하락 등 거시경제지표의 변화에 따라 투자신탁 재산의 가치하락 위험에 노출됩니다.

② 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

본 투자신탁은 일반 주식 등 비교적 유동성이 풍부한 투자대상자산에 투자하고 환매중단 등이 발생할 가능성은 매우 낮습니다.

▶ 주요 위험 관리 방안

① 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

일간으로 자산편입 내역 및 거래내역, 펀드 환매규모, LCR (Liquidity Coverage Ratio), 기준가격 변동률, 이벤트 발생 가능성 등을 모니터링하고 있으며, 주요 이슈 발생시 리스크관리위원회 등에 보고 및 대응하고 있습니다.

② 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한 · 수단 등

본 투자신탁은 재간접펀드 관련 해당사항이 없습니다.

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

본 투자신탁은 일반 주식 등 비교적 유동성이 풍부한 투자대상자산에 투자하고 환매중단 등이 발생할 가능성은 매우 낮습니다. 그럼에도, 환매중단 등의 이슈와 관련된 대응 및 절차 등을 "Risk Events Contingency Plan"에 규정하고 관련 지표를 일별로 모니터링하고 있습니다.

▶ 자전거래 현황

해당사항 없음

▶ 자전거래 사유, 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차

해당사항 없음

▶ 주요 비상대응계획

"Risk Events Contingency Plan"에 따라 시장위험, 신용위험, 유동성위험 관련 7개의 지표를 일별로 모니터링하고, 지표의 크기에 따라 3단계의 위기단계를 각각 정의하고, 각 단계별 회사내 각 관련 부서의 대응계획을 마련하였습니다.