

이스트스프링 자산운용 보고서

이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2023년 12월 02일 – 2024년 03월 01일

- 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

- 고객님의 가입하신 펀드는 [자본시장과 금융투자업에 관한 법률]의 적용을 받습니다.
- 이 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의해 [이스트스프링 뉴블루칩30지수 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 176년¹ 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 프루덴셜 (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 시장에서 꾸준히 성장하며, 글로벌 기관 및 개인투자자들을 위해 미달러 기준 2,160억 규모²의 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 2024년 기준

² 2023년 9월말 기준



Sales and Investment Office Sales Office Joint Venture

Contents

- 02 이스트스프링자산운용 소개
- 03 CEO 인사말
- 04 펀드 브리핑
- 06 펀드용어 해설
- 07 1. 펀드의 개요
- 2. 수익률현황
- 08 3. 자산 현황
- 09 4. 투자운용전문인력 현황
- 5. 비용 현황
- 6. 투자자산 매매내역
- 7. 동일한(해당) 집합투자업자가 운영하는 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



항상 저희 이스트스프링에 보내주시는 관심과 후원에 깊이 감사드립니다. 이스트스프링자산운용 코리아는 176년 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 290조원(기준일 : 2023년 9월말)에 달하는 고객자산을 운용하고 있습니다. 이스트스프링의 운용기술과 경험이 모회사인 영국 프루덴셜 금융그룹의 리스크 관리 노하우와 결합하여, 투자자들이 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 영국 프루덴셜 금융 그룹의 관계사 등과 끊임없이 투자 의견을 교환하며 중국 A주, 글로벌 이머징 시장 주식, 미국 투자적격회사채, 골드 펀드 등 선진/신흥 및 대체 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 이스트스프링자산운용 코리아는 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.

유례없는 글로벌 인플레이션 및 그로 인한 각국 중앙은행들의 금리 인상 기조, 그리고 미-중 갈등, 우크라이나 전쟁과 같은 지정학적 요인 등은 상황에 따라 한국을 포함한 글로벌 경제 및 금융 시장에 새로운 위기를 만들어 낼 수도 있는 잠재적 리스크를 지속시키고 있습니다. 반면 ChatGPT 등 기술혁신과 금리인상 사이클 종식에 대한 기대는 새로운 투자 기회를 제공할 수도 있을 것입니다. 따라서 투자에 있어서 기회 요소의 탐색 및 철저한 기업 분석, 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 투자자들의 후생을 위한 노력을 지속해 나가겠습니다.

이스트스프링자산운용코리아 대표이사 사장

박천웅

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

내가 가입한 펀드 브리핑

이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2023년 12월 02일 - 2024년 03월 01일



펀드매니저
오세인

내 펀드의 운용경과를 살펴보겠습니다.

23년 12월 KOSPI는 전월 대비 4.73% 상승한 2,655.28pt, KOSDAQ 은 4.20% 상승한 866.57pt로 마감하였습니다. 인플레이션 하향 안정화 추세 이어지는 가운데 12월 미국 FOMC(연방준비위원회)는 추가 기준금리 인상 가능성이 매우 낮다는 의견을 표명하였습니다. 이를 바탕으로 24년 이후 완화적 통화정책 기대감이 높아지면서 국내외 증시는 상승세를 이어갔습니다. 반도체업종 중심의 수출 개선세가 나타나고 있는 점도 국내 증시에 호재로 작용하였습니다.

24년 1월 KOSPI는 전월 대비 5.96% 하락한 2,497.09pt, KOSDAQ 은 7.77% 하락한 799.24pt로 마감하였습니다. 지난 해 말 큰 폭으로 상승한 국내 주식시장은 연초 이후 미국의 3월 조기 인하 기대감 후퇴, 중국경기 부진 등 악재와 함께 큰 폭으로 하락하였습니다. 반도체업종 중심으로 수출 개선에 대한 기대감은 유효하나 중국 경기 부진 등으로 주요 기업 이익의 불확실성이 우려로 작용하는 가운데 보험, 은행 등 금융업종이 상승세를 보인 반면 철강, 전자부품, 화장품, 화학, 조선 등 업종은 상대적으로 부진한 흐름을 보였습니다

24년 2월 KOSPI는 전월 대비 5.82% 상승한 2,642.36pt, KOSDAQ 은 7.97% 상승한 862.96pt로 마감하였습니다. 전월 큰 폭으로 하락한 국내 주식시장은 글로벌 AI반도체 업황 호조에 따른 국내 반도체 기업들의 수혜 및 금융당국의 "기업 밸류업(기업가치 제고)" 프로그램에 대한 기대감에 힘입어 반등에 성공하였습니다. 자동차, 금융, 유틸리티 업종 내 순자산 대비 저평가 기업들의 월간 상승 폭이 컸던 반면 의약, 인터넷서비스 등 상대적 고평가 업종은 부진한 주가 흐름을 보였습니다. 원달러 환율은 강보합세를 보이며 1,331.5 원으로 마감하였고 WTI 기준 국제 유가는 증동지역 지정학적 위험 고조로 79.22달러로 전월 대비 상승 마감하였습니다. 동 기간 국내 주식 시장에서 외국인 투자자는 약 8조 2천억원을 순매수한 반면 국내 기관 및 개인 투자자는 각각 약 8천9백억원, 약 6조 6천억원 순매도하였습니다.



내 펀드의 최근 3개월, 1년, 5년 수익률은?

(단위 : %)

펀드명	최근 3개월 수익률	최근 1년 수익률	최근 5년 수익률
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]	9.29	9.72	21.06
(비교지수대비 성과)	(0.67)	(1.22)	(9.83)
비교지수	8.62	8.50	11.23

* 비교지수 : 뉴블루칩30지수 100%

- ※상기 투자실적은 과거 실적을 나타낼 뿐 미래의 운용실적을 보장하는 것은 아닙니다.
- ※상기 펀드의 투자실적은 펀드의 종류별로 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.

내가 가입한 펀드 브리핑

이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2023년 12월 02일 - 2024년 03월 01일

eastspring
investments



내 펀드의 투자환경 및 운용계획을 살펴보겠습니다.

3월 국내 증시에 대해서 긍정적으로 전망합니다. 전세계 AI 반도체 수요가 증가하는 상황에서 반도체 등 IT 수출이 양호한 성장세를 보이고 시작했다는 점, 장기간 부진했던 대중국 수출이 최근 개선세를 보이고 있다는 점 그리고 미국의 설비 및 생산설비 투자 증가에 따라 기계 등 산업재 수출 흐름도 개선세를 보일 것으로 예상되는 점은 기업 이익 개선 측면에서 국내 증시에 우호적으로 작용할 것입니다. 이와 더불어 금융당국의 "기업밸류업(기업가치제고)" 프로그램의 지속적인 추진이 예상되는 점도 국내 기업들의 주주환원 확대 기대로 이어지며 국내 증시 안정세를 지원할 것으로 예상합니다. 높은 서비스 물가 등으로 각국 중앙은행들의 조기 기준금리 인하 기대감이 낮아진 상황에서 미국 상업용 부동산 위험, 증시 급등의 부담 등 단기 변동성 확대 요인에 대해서는 경계심을 유지하나 IT를 중심으로 한 수출 개선세의 확산 및 금융당국의 증시에 우호적인 정책에 기반하여 국내 증시는 견조한 흐름을 이어갈 것으로 기대합니다. 금리는 당분간 높은 수준에서 유지될 것으로 예상하여 고금리 수혜주인 금융주와 순현금 보유 기업을 긍정적으로 판단합니다. 또한, 금리의 고점이 가시화되고 있다는 점에서 그간 가격 조정이 컸던 배당주, 리츠 등에도 긍정적으로 판단합니다.

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)이 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 되겠다는 매매 기법을 말합니다. 주식 외의 다른 자산에서도 구사가 가능하며, 일반적으로 가격 하락을 예상하며 구사하는 매매 전략을 말합니다.

이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2023년 12월 02일 - 2024년 03월 01일



1 펀드의 개요

2등급(높은 위험)

1 2 3 4 5 6

▶ 기본 정보 [적용법률 : 자본시장과 금융투자업에 관한 법률]

펀드명칭	금융투자협회 펀드코드
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]	39384
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식] 클래스 A	93191
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식] 클래스 A-W	82281
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식] 클래스 C5	96586

고난도 펀드	해당없음
최초설정일	2003.12.02
운용기간	2023.12.02 - 2024.03.01
존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(주식형), 추가형, 개방형, 종류형
자산운용회사	이스트스프링자산운용코리아
판매회사	미래에셋증권
펀드재산보관회사(신탁업자)	국민은행
일반사무관리회사	신한펀드파트너스
상품의 특징 (투자전략)	이 투자신탁은 뉴블루칩30지수를 구성하고 있는 국내 주식을 주된 투자대상 자산으로 하여 뉴블루칩30지수의 수익률을 추종하는 것을 목적으로 합니다. 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 목적이 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 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]	자산총액	13,116	13,508	2.99
	부채총액	382	31	-91.92
	순자산총액	12,734	13,477	5.84
	기준가격	1,117.47	1,221.30	9.29
종류(Class)별 기준가격 현황				
클래스 A	기준가격	1,143.33	1,245.63	8.95
클래스 A-W	기준가격	1,141.24	1,246.31	9.21
클래스 C5	기준가격	1,136.40	1,238.08	8.95

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 해당사항 없음

2 수익률 현황

▶ 수익률 현황 [기준일자 : 2024년 03월 01일]

(단위: %)

펀드명칭	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]	9.29	4.59	4.44	9.72	-2.03	-11.36	21.06
(비교지수대비 성과)	(0.67)	(0.94)	(1.11)	(1.22)	(3.50)	(4.87)	(9.83)
비교지수	8.62	3.65	3.33	8.50	-5.53	-16.23	11.23

* 클래스별 설정일이 달라 설정 이후 수익률은 클래스 별로 상이하하며, 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 A	8.95	3.91	3.41	8.29	-4.57	-14.83	13.29
(비교지수대비 성과)	(0.33)	(0.26)	(0.08)	(-0.21)	(0.96)	(1.40)	(2.06)
비교지수	8.62	3.65	3.33	8.50	-5.53	-16.23	11.23
클래스 A-W	9.21	4.42	4.18	9.37	-2.67	-12.24	19.09
(비교지수대비 성과)	(0.59)	(0.77)	(0.85)	(0.87)	(2.86)	(3.99)	(7.86)
비교지수	8.62	3.65	3.33	8.50	-5.53	-16.23	11.23
클래스 C5	8.95	3.91	3.41	8.29	-4.58	-14.83	13.29
(비교지수대비 성과)	(0.33)	(0.26)	(0.08)	(-0.21)	(0.95)	(1.40)	(2.06)
비교지수	8.62	3.65	3.33	8.50	-5.53	-16.23	11.23

* 비교지수 : 뉴블루칩30지수 100%

* 클래스별 설정일이 달라 설정 이후 수익률은 클래스 별로 상이하하며, 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.

▶ 추적오차

(단위: %)

기간	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
추적오차	1.0602	0.8627	0.7067

주) 추적오차란 일정기간 동안 인덱스펀드가 추종하는 특정 비교지수의 변동을 얼마나 충실히 따라갔는지를 보여주는 지표로서 비교지수 수익률 대비 해당 인덱스펀드의 일간 수익률 차이의 표준편차로 기재합니다. 추적오차의 수치가 적을수록 해당 기간 동안 인덱스펀드가 비교지수와 유사하게 움직였음을 의미합니다.

▶ 손익현황

(단위: 백만원)

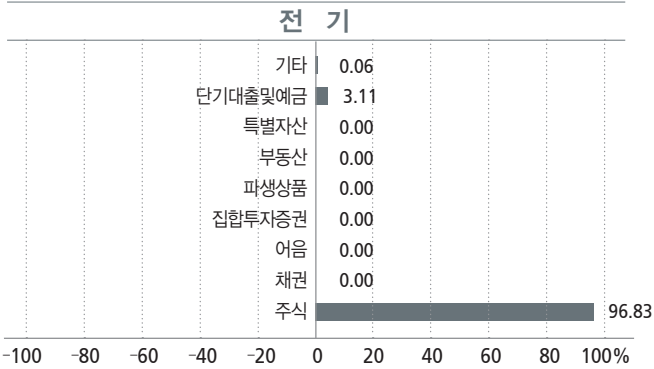
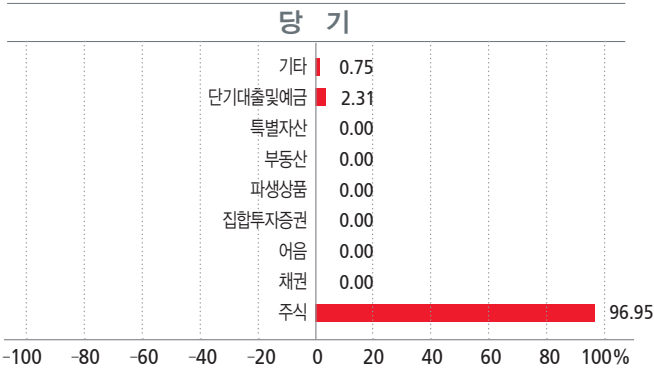
구분	증권				파생상품		단기대출 및예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외			
전기	-566	-	-	-	-28	-	2	-1	-592
당기	1,104	-	-	-	71	-	3	-1	1,176

이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2023년 12월 02일 - 2024년 03월 01일

3 자산 현황

▶ 자산구성현황



[자산구성현황]

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권			파생상품		단기대출 및예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	장내	장외			
KRW	13,096 (96.95)	-	-	-	-	311 (2.31)	101 (0.75)	13,508 (100.00)
합계	13,096 (96.95)	-	-	-	-	311 (2.31)	101 (0.75)	13,508 (100.00)

* () : 구성비중

주) 파생상품(선물 제외)은 손익이 자산에 영향을 미치므로, 위의 표에는 손익만 표기됩니다.

주) 선물(장내파생상품)은 손익이 위탁증거금(기타자산)에 일일정산되므로, 장내파생상품 칸에 표기되지 않습니다. 펀드에 편입된 선물 계약의 평가액은 아래와 같습니다.

선물매수 평가액 : 381백만원 / 선물위탁증거금 : 2백만원

▶ 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 결산 보고서를 참고하실 수 있습니다. (인터넷 주소 : <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

주식 - Long(매수)

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	비고
삼성전자	37,753	2,771	20.51	-
SK하이닉스	7,002	1,094	8.10	-
LG에너지솔루션	1,709	686	5.08	-
삼성바이오로직스	757	586	4.34	-
기타	4,446	554	4.10	-

주식 - Long(매수)

(단위 : 주, 백만원, %)

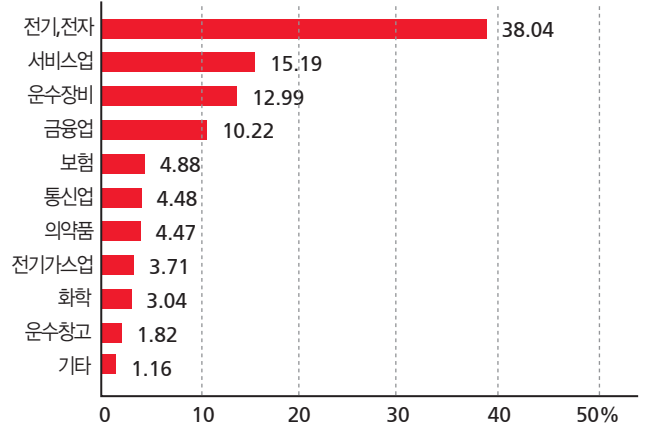
종목명	보유수량	평가금액	비중	비고
현대차	2,080	521	3.86	-
한국전력	19,582	486	3.60	-
NAVER	2,372	463	3.42	-
삼성생명	4,162	403	2.99	-
하이브	1,825	363	2.69	-

장내파생상품

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
2024-03 삼성전자개별선물	매수	520	381	-

▶ 업종별(국내주식) 투자비중 - Long(매수)



* 본 그래프는 기준일 현재 펀드에 편입되어 있는 주식의 업종별 비율을 나타냅니다.

주) 보유비율 = 평가액 / 총평가액 * 100

주) 업종기준은 코스콤 기준

4 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 역원)

성명	직위	운용중인 다른 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약운용규모		주요 경력 및 운용내역	협회 등록번호
		개수	운용규모	개수	운용규모		
오세인	책임운용 전문인력	6	3,489	-	-	교보약사자산운용	2115001163

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사 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

이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2023년 12월 02일 - 2024년 03월 01일

5 비용 현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원, %)

펀드 명칭	구분	전기		당기		
		금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]	자산운용회사	9.20	0.07	9.25	0.07	
	판매회사	0.89	0.01	0.67	0.01	
	클래스 A	0.38	0.25	0.41	0.25	
	클래스 A-W	-	-	-	-	
	클래스 C5	0.51	0.25	0.26	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.98	0.01	0.98	0.01	
	일반사무관리회사	0.57	0.00	0.57	0.00	
	보수 합계	11.64	0.09	11.47	0.09	
	기타비용**	1.14	0.01	1.15	0.01	
	매매· 중개 수수료	단순매매·중개 수수료	1.16	0.01	1.90	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.29	0.00	0.48	0.00
		합계	1.45	0.01	2.38	0.02
증권거래세	5.24	0.04	8.24	0.06		

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 : 해당사항 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

펀드 명칭	구분	해당 펀드			상위펀드 비용합산		
		총보수· 비용비율(A)	매매·중개수 수수료비율(B)	합계 (A+B)	총보수· 비용비율(A)	매매·중개수 수수료비율(B)	합계 (A+B)
이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]	전기	0.04	0.04	0.08	0.04	0.04	0.08
	당기	0.04	0.07	0.11	0.04	0.07	0.11
종류(class)별 현황							
클래스 A	전기	1.33	-	1.33	1.37	0.05	1.41
	당기	1.33	-	1.33	1.37	0.07	1.44
클래스 A-W	전기	0.33	-	0.33	0.37	0.04	0.41
	당기	0.33	-	0.33	0.37	0.07	0.44
클래스 C5	전기	1.33	-	1.33	1.37	0.05	1.41
	당기	1.33	-	1.33	1.36	0.04	1.40

주1) 총보수, 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 기타비용총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(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 회전을

(단위 : 주, 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 ^{주1)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
51,324	3,954	118,456	4,573	35.82	143.69

주1) 해당운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율

주2) 다수의 모펀드에 투자하는 경우, 자펀드가 투자하는 모펀드의 비율에 따라 가중치로 안분하였습니다. 모펀드의 세부 구성은 <펀드구성>을 참고해 주시기 바랍니다.

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

2023.03.02 ~ 2023.06.01	2023.06.02 ~ 2023.09.01	2023.09.02 ~ 2023.12.01
33.51	40.52	20.61

주) 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료 및 증권거래세 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드 비용이 증가합니다.

7 동일한(해당) 집합투자업자가 운영하는 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 투자 신탁 자산의 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), 기준 가격 변동률, 이벤트 발생 가능성 등을 모니터링하고 있으며, 주요 이슈 발생시 리스크관리 위원회 등에 보고 및 대응하고 있습니다.

② 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한·수단 등

본 투자신탁은 재간접펀드 관련 해당사항이 없습니다.

③ 환매중단, 상황연기 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.

이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]

운용기간 : 2023년 12월 02일 - 2024년 03월 01일

수시공시사항

수시공시사항	일자	펀드명	공시내용
투자설명서 및 규약 변경	2023.12.28	이스트스프링 뉴블루칩30지수 증권투자신탁[주식]	<ul style="list-style-type: none"> - 최근 결산에 따른 집합투자기구 재무정보 및 주요 수치 업데이트 - 최근 결산일 기준 수익률변동성 변경 - 소득세법 개정사항(2023.01.01) 반영 - 기업공시서식 작성기준 개정사항(2023.02.20) 반영 - 자본시장법 및 시행령 개정사항(2019.06.25, 2021.10.21) 반영 - 일반사무관리회사에 관한 사항 변경 반영