

미래에셋코스피200인덱스증권투자신탁1호(주식-파생형) [54669]

투자위험등급 1등급[매우 높은 위험]				
1	2	3	4	5
매우 높은 위험	높은 위험	보통 위험	낮은 위험	매우 낮은 위험

이 간이투자설명서는 '미래에셋코스피200인덱스증권투자신탁1호(주식-파생형)투자신탁'의 투자설명서의 내용 중 중요사항을 발췌한 요약한 정보를 담고 있습니다. 따라서 **동 집합투자증권을 매입하기 전 투자설명서를 읽어보시기 바랍니다.**

미래에셋자산운용(주)는 이 투자신탁의 투자대상 종류 및 위험도 등을 감안하여 1등급으로 분류하였습니다. 이 투자위험 등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.

I. 집합투자기구의 개요

투자자 유의사항	<ul style="list-style-type: none"> * 집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 예금보험공사가 보호하지 않는 실적배당 상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다. * 금융위원회가 투자설명서의 기재사항이 진실 또는 정확하다는 것을 인정하거나 그 증권의 가치를 보증 또는 승인하지 아니함을 유의하시기 바랍니다. * 간이투자설명서는 증권신고서 효력발생일까지 기재사항 중 일부가 변경될 수 있으며, 개방형 집합투자증권인 경우 효력발생일 이후에도 변경될 수 있습니다. 		
집합투자기구 특징	1. 투자대상자산 : 이 투자신탁은 국내 주식(주식을 기초자산으로 하는 장내파생상품을 포함한다)을 법 시행령 제94조제2항 제4호에서 규정하는 주된 투자대상자산으로 하여 한국거래소가 발표하는 주가지수인 “KOSPI200지수” 수익률 추종을 목적으로 합니다. 2. 투자전략 : 이 투자신탁은 KOSPI200 지수 수익률을 추종하기 위하여 지수구성종목의 완전 또는 부분복제를 실행하여 안정적 지수수익률 달성을 추구합니다. 또한 장내파생상품을 적극적으로 활용하여 무위험차익거래 등을 통해 추가수익률을 동시에 추구합니다. 이 투자신탁은 투자 목적 달성을 위해 추적오차를 최소화할 추구합니다. (보수 차감전, 세전 수익률 기준)		
분류	투자신탁, 증권(주식파생형), 개방형, 추가형, 종류형		
집합투자업자	미래에셋자산운용(주)((전화) ☎ 1577-1640)		
모집(판매) 기간	모집 개시 이후 특별한 사유가 없는 한 영업일에 한하여 모집, 판매됩니다.	모집(매출) 총액	10조좌(단, 모집예정 금액 한도 내에서 존속기간 동안 계속 모집 가능)
효력발생일	2016년 04월 29일	존속 기간	정해진 신탁계약기간은 없음.
판매회사	각 판매회사 본·지점(판매회사에 대한 자세한 내용은 협회 및 집합투자업자의 인터넷 홈페이지를 참고하시기 바랍니다)		

종류(Class)	가입자격	수수료율		
		선취 판매수수료	후취 판매수수료	환매수수료
종류A	제한없음	0.800% 이내	-	-
종류C-e	온라인 가입자	-	-	-

종류(Class)	보수(연, %)			
	판매회사 보수	운용 등	기타비용	총보수비용
종류A	0.350	0.35	0.01	0.71
종류C-e	0.450	0.35	0.01	0.81

※ 주식 사항	<ul style="list-style-type: none"> * 위에 기재된 종류(클래스)는 대표적인 종류를 명시한 것으로서 그 외의 종류에 대한 세부사항은 “투자설명서”를 참고하시기 바랍니다. * 각 보수의 지급 시기 : 최초설정일로부터 매 3개월 후급 * 수익자는 증권거래비용, 기타 관리비용 등 총보수·비용 이외에 추가비용을 부담할 수 있습니다.
---------------	--

매입 방법	1.15시이전 : 자금을 납입하는 영업일(D)로 부터 제2영업일에 공고되는 기준가격을 적용 2.15시 경과후 : 자금을 납입하는 영업일(D)로 부터 제3영업일에 공고되는 기준가격을 적용	환매 방법	1.15시이전 : 환매청구일(D)로 부터 제2영업일에 공고되는 기준가격을 적용하여, 제4영업일에 환매대금을 지급 2.15시 경과후 : 환매청구일(D)로 부터 제3영업일에 공고되는 기준가격을 적용하여, 제4영업일에 환매대금을 지급
----------	--	----------	--

기준가	-산정방법 : 기준가격[당해 종류 수익증권의 기준가격]은 기준가격은 공고·게시일 전날의 재무상태표상에 계상된 투자신탁[당해 종류 수익증권의 상당액] 자산총액에서 부채총액을 차감한 금액(순자산총액)을 공고·게시일 전날의 수익증권[당해 종류 수익증권] 총좌수로 나누어 산정하며, 1000좌 단위로 1원미만 셋째자리에서 4사5입하여 1원미만 둘째자리까지 계산합니다. - 공시장소 : 판매회사 영업점, 집합투자업자·판매회사·한국금융투자협회 인터넷 홈페이지		
-----	---	--	--

II. 집합투자기구의 투자정보

(1) 투자전략

1. 투자 목적

이 투자신탁은 국내 주식(주식을 기초자산으로 하는 장내파생상품을 포함한다)을 법 시행령 제94조제2항제4호에서 규정하는 주된 투자대상자산으로 하여 한국거래소가 발표하는 주가지수인 “KOSPI200지수” 수익률 추종을 목적으로 합니다.

그러나, 위의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 집합투자업자, 신탁업자, 판매회사 등이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다.

2. 투자전략

- 기본운용전략

이 투자신탁은 KOSPI200 지수 수익률을 추종하기 위하여 지수구성종목의 완전 또는 부분복제를 실행하여 안정적 지수수익률 달성을 추구합니다. 또한 장내파생상품을 적극적으로 활용하여 무위험차익거래 등을 통해 추가수익률을 동시에 추구합니다.

이 투자신탁은 투자 목적 달성을 위해 추적오차율 최소화를 추구합니다. (보수 차감전, 세전 수익률 기준)

[추적오차(Tracking Error) 관리방안]

추적오차율 = 표준편차(과거1년간 펀드의 일간 수익률 - 과거1년간 벤치마크의 일간 수익률)

이 투자신탁은 상기 방식으로 계산된 추적오차율이 10% 이상 발생하지 않도록 운용하며, 추적오차율 허용범위를 초과하게 되는 경우 1개월 이내에 추적오차율이 10%이하가 되도록 리밸런싱합니다. 다만, 상기 관리방안이 추적오차 최소화를 보장해 주는 것은 아닙니다.

* 추적오차율 계산 시 일간 수익률 산정기간이 1년 미만일 경우에는 해당기간의 추적오차율을 연환산하여 산출함.

[차익거래 전략]

이 투자신탁은 상장주식(현물) 뿐만 아니라 선물옵션과 같은 파생상품도 적극적으로 활용하게 되는데, 이 경우 현물 가격과 선물가격 간 비정상적인 괴리가 발생하는 경우 무위험차익거래를 통해 추가적인 수익을 추구하게 됩니다. 이때 보유종목에 대한 대량의 매수 및 매도를 수반함으로써 위와 같이 비교적 높은 거래비용이 발생하게 되는데, 차익거래는 이러한 거래비용을 상쇄하고도 남을만큼 수익이 기대되는 경우에만 실행합니다. 따라서 차익거래기회의 많고 적음에 따라 거래비용 수준이 다른 펀드에 비해 높아질 수 있습니다.

※ 비교지수 : KOSPI 200

<KOSPI200: 한국거래소(KRX)가 작성하여 발표>

- 한국거래소가 주가지수선물 및 옵션의 거래 대상으로 개발한 지수(1994년)
- 유가증권시장 종목 중 시장 대표성 업종대표성 및 유동성을 감안하여 200종목으로 구성
- 기준일 및 기준지수 : 1990년 1월 3일 100p
- 지수정보확인처 : <http://www.krx.co.kr>

위의 투자전략과 관련하여 본 투자신탁이 제시하는 투자목적 또는 성과목표가 반드시 달성된다는 보장은 없습니다.

3. 수익구조

이 투자신탁은 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다.

4. 운용전문인력

성명	출생 년도	직위	운용현황 (16.03.31기준)		주요 운용경력 및 이력	성과보수가 약정 된 집합투자기구	
			운용증인집합 투자기구수	운용자산 규모			
윤병호	1981	팀장	1개	114억원	(10년~11년) 대우증권 (11년~12년) 미래에셋맵스자산운용	-개	-억원

성명	출생 년도	직위	운용현황(16.03.31기준)		주요 운용경력 및 이력	성과보수가 약정 된 집합투자기구	
			운용중인집합 투자기구수	운용자산 규모			
					(12년~현재)미래에셋자산운용 금융공학 본부		

* 운용전문인력의 최근 과거 3년 이내에 운용한 집합투자기구의 명칭, 집합투자재산의 규모와 수익률 등은 금융투자협회 홈페이지(www.kofia.or.kr)에서 확인할 수 있습니다.

5. 투자실적 추이

연도 (기간)	최근 1년차 '14.11.01~'15.10.31	최근 2년차 '13.11.01~'14.10.31	최근 3년차 '12.11.01~'13.10.31	최근 4년차 '11.11.01~'12.10.31	최근 5년차 '10.11.01~'11.10.31
종류A	1.75	-4.86	7.49	-0.30	3.54
투자신탁	2.46	-4.19	8.24	0.39	4.28
비교지수	-0.42	-6.17	6.69	0.12	2.84

상기사항은 대표종류 수익률만 기재하였으며, 나머지 종류에 대한 수익률은 투자설명서를 참고하시기 바랍니다.

(2) 주요 투자위험 및 위험관리

1. 주요 투자위험

주요투자위험	투자위험 주요 내용
원본손실위험	이 집합투자기구는 원본을 보장하지 않습니다. 집합투자기구의 운용실적에 따라 손익이 결정되는 실적배당상품으로 예금자보호법의 적용을 받지 아니하며, 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 매입한 경우에도 은행예금과 달리 예금자보호법에 따라 예금보험공사가 예금자 보호를 하지 않습니다.
주요 운용위험	주식의 가치는 여러 거시경제지표의 변화에 따라서도 급변할 수 있습니다. 특히, 주식은 변동성이 큰 특징이 있으며, 주식투자 시에는 투자원금의 손실 가능성이 매우 큰 위험이 있습니다. 추적대상 지수와 유사한 수익률 실현을 그 투자목적으로 하는 집합투자기구라고 할지라도 아래의 여러 가지 현실적 제약으로 인하여 추적대상 지수와 유사한 수익률이 실현되지 아니할 가능성이 있습니다. 따라서 이 집합투자기구의 수익률과 추적대상 지수의 수익률이 동일하거나 유사할 것을 전제로 하는 투자자는 당해 추적오차로 인하여 예상하지 못한 손실을 실현할 수도 있습니다. ※현실적 제약요소 : 지수 구성종목 변경에 따른 매매시 시장 충격, 상/하한가, 거래정지 등으로 인한 미체결, 인덱스운용시 활용하는 모델의 지수추적 괴리, 환율변동(해외투자시), 운용/판매 등 각종 보수, 위탁매매수수료, 지적재산권 수수료와 같은 여러 가지 운용관련 비용발생, 너무 작은 운용규모, 대량 또는 빈번한 설정/해지 등 이 집합투자기구는 시장(혹은 비교지수) 수익률 달성을 목표로 하기 때문에 시장(혹은 비교지수) 수익률 하락에 직접적으로 영향을 받습니다. 즉, 시장수익률 하락시 수익률하락 방어를 목적으로 하는 포트폴리오 조정 등 별도의 노력을 수행하지 않음에 유의하시기 바랍니다.
파생상품 투자위험	이 투자신탁은 파생상품에 일부 투자할 수 있으나, 파생상품은 작은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대 효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 훨씬 높은 위험에 노출될 수 있습니다. 위험에 관한 지표(파생상품 거래에 따른 만기 손익 구조, 시나리오법에 의한 손익변동, 최대손실금액 등)는 “미래에셋자산운용(주) 홈페이지”에 공시되어 있으니 참고하시기 바랍니다.

이 외 주요 투자위험에 관한 자세한 설명은 "투자설명서"를 참고하시기 바랍니다.

2. 투자위험 등급 분류

이 투자신탁은 주식을 주된 투자대상으로 하기 때문에 5등급 중 1등급에 해당되는 매우 높은 수준의 투자위험을 지니고 있습니다.

따라서, 위와 같은 위험 수준을 감내할만한 위험선호도를 가지고 있는 투자자에게 적합합니다.

이 위험등급분류는 집합투자업자인 미래에셋자산운용의 내부 기준에 따른 위험등급입니다. 판매회사는 판매회사별 특성을 반영하여 위험등급을 재분류할 수 있습니다.

나. 위험관리

이 투자신탁은 법령에서 정하는 예외적인 경우를 제외하고는 동일 종목에 대해 10% 이하로 투자함으로써 기본적으로 분산 투자를 통해 포트폴리오의 위험을 관리합니다.

III. 집합투자기구의 기타정보

(1) 과세

※ 수익자는 국내 상장주식 등의 매매·평가손익을 제외한 과세소득(이자, 배당 등)에 대하여 소득세 등(개인 15.4%, 내국법인 15.4% 원천징수)을 부담합니다. 이러한 소득은 개인의 경우 연간 금융소득 합계액(이자소득과 배당소득)이 2천만원을 초과하는 경우에는 2천만원을 초과하는 금액을 다른 종합소득과 합산하여 개인소득세율로 종합과세 됩니다. 과세 및 세제혜택 조건 등에 대한 자세한 사항은 “투자설명서”를 참고하시기 바랍니다.

(2) 전환 절차 및 방법

해당사항없음

(3) 집합투자기구의 요약 재무정보

이에 관한 세부사항은 "투자설명서"를 참고하시기 바랍니다

[집합투자기구 공시 정보 안내]

※ 집합투자기구 공시 정보 안내

- * 증권신고서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr)
- * 투자설명서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr), 한국금융투자협회(kofia.or.kr), 집합투자업자(<http://investments.miraeasset.com>) 및 판매회사 홈페이지
- * 정기보고서(영업보고서, 결산서류) : 금융감독원 홈페이지(www.fss.or.kr) 및 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr)
- * 자산운용보고서 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(<http://investments.miraeasset.com>)
- * 수시공시 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(<http://investments.miraeasset.com>)

[알림]

“KOSPI200 지수”는 미래에셋자산운용주식회사에게 라이선스 이용이 허가된 한국거래소의 서비스표입니다.