

## <요약정보>

<간이투자설명서>

(작성기준일 : 2018.08.29.)

맥쿼리 인덱스프리미엄증권 자투자신탁2호(주식-파생형) (펀드코드: 64325)

| 투자위험등급        |       |          |       |       |          |
|---------------|-------|----------|-------|-------|----------|
| 3등급[다소 높은 위험] |       |          |       |       |          |
| 1             | 2     | 3        | 4     | 5     | 6        |
| 매우 높은 위험      | 높은 위험 | 다소 높은 위험 | 보통 위험 | 낮은 위험 | 매우 낮은 위험 |

이 간이투자설명서는 맥쿼리 인덱스프리미엄증권 자투자신탁2호(주식-파생형)의 투자설명서의 내용 중 중요사항을 발췌 요약한 정보를 담고 있습니다. 따라서 동 집합투자증권을 매입하기 전 투자설명서를 읽어보시기 바랍니다.

맥쿼리투자신탁운용주식회사는 이 투자신탁의 **실제 수익률 변동성을 감안하여 3등급으로 분류하였습니다**. 이 투자위험 등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.

### 1. 집합투자기구의 개요

|           |  |          |                    |
|-----------|--|----------|--------------------|
| 투자자 유의사항  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 예금보험공사가 보호하지 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.</li> <li>• 금융위원회가 투자설명서의 기재사항이 진실 또는 정확하다는 것을 인정하거나 그 증권의 가치를 보증 또는 승인하지 아니함을 유의하시기 바랍니다.</li> <li>• 간이투자설명서는 증권신고서 효력발생일까지 기재사항 중 일부가 변경될 수 있으며, 개방형 집합투자증권인 경우 효력발생일 이후에도 변경될 수 있습니다.</li> <li>• 증권신고서, 투자설명서상 기재된 투자전략에 따른 투자목적 또는 성과목표가 반드시 실현된다는 보장은 없으며, 과거의 투자실적이 미래에도 실현된다는 보장은 없습니다.</li> </ul> <p style="color: red;">※ 추가적인 투자자 유의사항은 투자설명서 '투자결정시 유의사항 안내' 참조하시기 바랍니다.</p> |          |                    |
| 집합투자기구 특징 | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 국내주식 및 주식관련장내파생상품에 주로 투자하는 모투자신탁을 주된 투자대상자산으로 하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다.</li> <li>• 맥쿼리 인덱스프리미엄증권 모투자신탁(주식-파생형)에 100% 이하 투자 모투자신탁은 KOSPI200지수를 구성하는 현물과 KOSPI200을 기초로 하는 선물 및 합성선물 등으로 포트폴리오를 구성하여 시장수익률을 추적하는 전략을 추구합니다.</li> </ul>  |          |                    |
| 분류        | 투자신탁, 증권(주식파생형), 개방형(중도환매가능), 추가형, 모자형   |          |                    |
| 집합투자업자    | 맥쿼리투자신탁운용주식회사 (☎ 02-3703-9800)   |          |                    |
| 모집[판매]기간  | 추가형으로 계속 모집 가능   | 모집[매출]총액 | 3조좌                |
| 효력발생일     | 2018년 09월 04일  | 존속기간     | 별도로 정해진 신탁계약기간은 없음 |
| 판매회사      | 집합투자업자(www.macquarie.co.kr/mim), 한국금융투자협회(www.kofia.or.kr) 인터넷 홈페이지를 참고  |          |                    |

|             |                     |
|-------------|---------------------|
| 가입자격        | 제한없음                |
| 선취/후취 판매수수료 | (선취) 납입금액의 0.50% 이내 |
| 환매수수료       | -                   |

|              |          |   |
|--------------|----------|---|
| 보수<br>(연, %) | 판매       | 0.2000  |
|              | 운용 등     | 집합투자업자: 0.3000, 신탁업자: 0.0250, 일반사무관리회사: 0.0150  |
|              | 기타       | 0.0022  |
|              | 총보수비용    | 0.5422  |
|              | 합성 총보수비용 | 0.6001  |
| ※주석사항        |          | <p>주1) 기타비용은 증권에의 위탁 및 결제비용 등 이 투자신탁에서 경상적, 반복적으로 지출되는 비용 (증권거래비용 및 금융비용 제외)등에 해당하는 것으로 회계기간이 경과한 경우에는 직전 회계연도의 기타비용 비율을 추정치로 사용하며, 회계기간이 경과하지 아니한 경우에는 작성일까지의 기타비용 비율을 연환산하여 추정치로 사용하므로 실제 비용은 이와 상이할 수 있습니다. [직전 회계연도 : 2017.01.19 ~ 2018.01.18]</p> <p>주2) 총보수 및 비용 비율은 이 투자신탁에서 지출되는 보수와 기타비용 총액을 순자산 연평잔액(보수·비용 차감후 기준)으로 나누어 산출합니다.</p> <p>주3) 수익자는 증권거래비용, 기타 관리비용 등 총보수·비용 이외에 추가적인 비용을 부담할 수 있습니다.</p> <p>주4) 선취판매수수료는 매입시, 후취판매수수료와 환매수수료는 환매시, 전환수수료는 전환시 부과되며, 보수는 최초 설정일로부터 매3개월 후급으로 지급됩니다.</p> |

|      |  |      |   |
|------|--|------|---|
| 매입방법 | 15시 30분 이전: 2영업일<br>기준가 매입<br>15시 30분 경과후:<br>3영업일 기준가 매입  | 환매방법 | 15시 30분 이전: 2영업일<br>기준가로 4영업일 지급<br>15시 30분 경과후: 3영업일<br>기준가로 4영업일 지급 |
| 기준가  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• 산정방법                     <ul style="list-style-type: none"> <li>- 당일 기준가격 = (전일 투자신탁 자산총액 - 부채총액)/전일 수익증권 총좌수</li> <li>- 1,000좌 단위로 원미만 셋째자리에서 4사5입하여 원미만 둘째자리까지 계산</li> </ul> </li> <li>• 공시장소                     <ul style="list-style-type: none"> <li>- 서류공시 : 판매회사 영업점에서 게시 및 공시</li> <li>- 전자공시 : 집합투자업자, 판매회사, 한국금융투자협회 인터넷 홈페이지에 공시</li> </ul> </li> </ul> |      |   |

## II. 집합투자기구의 투자정보

### (1) 투자전략

#### 1. 투자목적

이 투자신탁은 국내주식 및 주식관련장내파생상품에 주로 투자하는 모투자신탁을 주된 투자대상자산으로 하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다.

**그러나 상기의 투자목적이 반드시 달성된다는 보장은 없으며, 집합투자업자, 신탁업자, 판매회사 등 이 투자신탁과 관련된 어떠한 당사자도 투자원금의 보장 또는 투자목적의 달성을 보장하지 아니합니다.**

#### 2. 투자전략

이 투자신탁은 모투자신탁의 수익증권에 주로 투자합니다.

##### (1) 운용전략

맥쿼리 인덱스프리미엄증권 모투자신탁(주식-파생형)

① 기본 운용전략

비교지수(벤치마크)\*인 KOSPI200 수익률을 추적하는 전략을 추구합니다. 이 투자신탁은 펀드매니저의 주관적 장세 판단에 따른 자산배분을 하지 아니하고, KOSPI200지수를 구성하는 현물과 KOSPI200을 기초로 하는 선물 및 합성선물 등으로 포트폴리오를 구성하여 비교지수(벤치마크)인 KOSPI200 수익률을 추적하는 전략을 추구합니다.

KOSPI200을 구성하는 주식과 KOSPI200을 기초로 하는 주식관련장내파생상품에 투자하여 포트폴리오를 구성합니다.

KOSPI200 대비 초과수익 추구를 위해 정량적분석(Quantitative Analysis)에 의한 스코어링(Scoring: 종목별 점수 부여) 기법을 이용합니다.

② 초과수익전략

현물 및 선물간 가격괴리 발생시 현선물 차익거래전략을 실행합니다.

③ 리밸런싱(포트폴리오재조정) 전략

원칙적으로 1개월마다 리밸런싱을 실행합니다.

리밸런싱 기준은 KOSPI200 종목에 대한 스코어링 결과에 따라 낮은 종목들을 제외하고, 당사가 관리하는 투자 유니버스의 편입 및 편출에 따라 리밸런싱을 실행합니다.

KOSPI200 구성종목에 대한 한국거래소의 정기 및 수시 편입, 퇴출에 따라 리밸런싱을 하고, 종목별 이벤트 발생시 등 예기치 못한 상황 발생시에는 수시로 리밸런싱을 실행합니다.

④ KOSPI200 추적오차 허용범위

원칙적으로 연 5% 이내 관리를 추구합니다.

\* 비교 지수(벤치마크) : KOSPI200

비교지수는 이 투자신탁의 성과비교 등을 위해 사용하고 있으며 시장상황 및 투자전략의 변경, 새로운 비교지수의 등장에 따라 이 비교지수는 변경될 수 있습니다. 이 경우 변경 등록 후 법령에서 정한 절차에 따라 공시될 예정입니다.

3. 수익구조

이 투자신탁에 투자하는 수익자는 투자대상이 되는 자산가치의 가격변동에 따라 손익이 결정됩니다.

4. 운용전문인력

(2018년 8월 기준)

| 성명  | 출생<br>년도 | 직위              | 운용현황           |                      | 주요 운용경력 및 이력  |
|-----|----------|-----------------|----------------|----------------------|---|
|     |          |                 | 운용중인<br>다른 펀드수 | 운용중인 다른<br>자산 규모(억원) |   |
| 노승원 | 1984     | 책임운<br>용인력      | -              | -                    | - 現 맥쿼리투자신탁운용 주식운용본부<br>2010.12~2015.10 유안타증권<br>건국대학교 응용통계학과                             |
| 정성엽 | 1982     | 부책임<br>운용인<br>력 | 8              | 116                  | - 現 맥쿼리투자신탁운용 주식액티브팀<br>2015.02~2016.03 비전투자자문<br>2011.05~2012.05 타임폴리오투자자문<br>한양대학교 경영학과 |

주1) 운용전문인력의 주요 운용경력(운용한 집합투자기구의 명칭, 집합투자재산의 규모 및 수익률) 및 이력은 한국 금융투자협회 홈페이지(www.kofia.of.kr)에서 확인할 수 있습니다.

5. 투자실적 추이

※ 연도별 수익률 추이(세전 기준, 단위:%)

| 기간 | 최근<br>1년차 | 최근<br>2년차              | 최근<br>3년차              | 최근<br>4년차              | 최근<br>5년차              |
|----|-----------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
|    |           | 17.02.20<br>~ 18.02.19 | 16.02.20<br>~ 17.02.19 | 15.02.20<br>~ 16.02.19 | 14.02.20<br>~ 15.02.19 |

|                        |       |       |       |       |       |
|------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 맥쿼리<br>인덱스프리미엄 2 호(파생) | 19.08 | 15.51 | -4.91 | 0.13  | -2.95 |
| 비교지수                   | 17.77 | 14.23 | -6.03 | -1.01 | -3.52 |

주 1) 비교지수 : KOSPI200

- 2) 비교지수의 수익률에는 운용보수 등 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않았습니다.
- 3) 마지막 수익률 측정대상기간이 6 개월을 초과하고 1 년 미만인 경우(예:8 개월)로서 주식 또는 주식관련 상품(주가지수연계증권 등)에 투자하는 경우에는 해당 기간의 수익률인 '기간 수익률'을 말합니다.
- 4) 마지막 수익률 측정대상기간이 6 개월을 초과하고 1 년 미만인 경우(예:8 개월)로서 주식 또는 주식관련 상품(주가지수연계증권 등)에 투자하지 않는 경우에는 해당 기간의 수익률을 연간 수익률로 환산한 '연환산 수익률'을 말합니다.
- 5) 연도별 수익률은 해당되는 각 1 년간의 단순 누적수익률로 투자기간동안 이 투자신탁 수익률의 변동성을 나타내는 수치입니다.

## (2) 주요 투자위험 및 위험관리

### 1. 주요 투자위험

| 구 분                            | 투자위험의 주요내용  |
|--------------------------------|---|
| 투자원본에 대한<br>손실위험               | 이 투자신탁은 투자 실적에 따른 실적배당상품으로 관련법령은 이에 대해서는 원리금을 보장하거나 보호하지 않습니다. 따라서 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재하며 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전적으로 투자자가 부담하며, 집합투자업자나 판매회사 등 어떤 당사자도 투자손실에 대하여 책임을 지지 아니합니다.   |
| 주식등<br>가격변동위험                  | 모투자신탁의 신탁재산을 국내 주식 등에 투자함으로써 이 투자신탁은 증권등의 가격 변동, 이자율등 기타 거시경제지표의 변화에 따른 위험에 노출됩니다. 또한, 신탁재산의 가치는 투자대상종목 발행 회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화에 따라 급격히 변동될 수 있습니다.  |
| 파생상품<br>투자위험                   | 파생상품은 작은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 높은 위험에 노출되어 있습니다. 또한 옵션매도에 따른 이론적인 손실범위는 무한대이므로 기초자산에 대한 투자나 옵션매수의 경우에 비하여 높은 위험에 노출될 수 있습니다.  |
| 장외파생상품<br>위험                   | 일반적으로 장외시장의 거래는 거래소를 통한 장내거래에 비하여 정부의 규제나 감독이 엄격하지 않습니다. 또한, 거래소의 정산이행보증과 같이 장내거래 참여자들에게 제공되는 보호조치들이 장외거래에는 제공되지 않습니다. 따라서, 장외파생상품투자에 투자 시에는 거래상대방이 파산하거나 신용위기를 경험하는 경우 투자자금 전액회수가 불가능할 수도 있는 등 장내파생상품에 투자하는 경우보다 훨씬 큰 신용위험을 부담할 수 있습니다. 한편, 장외시장은 통상 유동성이 부족하므로 원하는 시점에 원하는 가격으로 거래를 종결하지 못할 수 있습니다. |
| 추적오차<br>(tracking error)<br>위험 | 추적대상 지수와 유사한 수익률 실현을 그 투자목적으로 하는 집합투자기구라고 할지라도 아래의 여러 가지 현실적 제약으로 인하여 추적대상 지수와 유사한 수익률이 실현되지 아닐 가능성이 있습니다. 따라서 이 집합투자기구의 수익률과 추적대상 지수의 수익률이 동일하거나 유사할 것을 전제로 하는 투자자는 당해 추적오차로 인하여 예상하지 못한 손실을 실현할 수도 있습니다.  |

※ 집합투자기구의 투자위험에 대한 세부사항은 '투자설명서 제2부. 집합투자기구에 관한 사항 중 10. 집합투자기구의 투자위험'을 참고하시기 바랍니다.

### ※ 위험에 관한 지표공시

이 투자신탁은 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 가액의

10%를 초과하여 투자할 수 있는 집합투자기구로 위험에 관한 지표를 집합투자업자의 인터넷홈페이지([www.macquarie.co.kr/mim](http://www.macquarie.co.kr/mim))를 이용하여 투자자에게 공시합니다.

| 위험지표       | 설명                                  | 공시주기           |
|------------|-------------------------------------|----------------|
| 계약금액       | 파생상품 거래금액                           | 파생상품 거래 후 익일까지 |
| 만기시점의 손익구조 | 기초자산의 가격변동에 따라 투자신탁의 손익이 발생하는 구간 설명 |                |
| 시나리오별 손익구조 | 시장가격이 불리하게 변동될 경우의 최대손실예상금액         | 매일             |

## 2. 투자위험에 적합한 투자자 유형

이 투자신탁은 설정 후 3년이 경과하여 수익률 변동성을 기준으로 위험등급을 산정하였습니다. 위험등급 적용을 위해 산출한 실제 연환산 표준편차는 12.01%로, 맥쿼리투자신탁운용의 투자위험등급 분류기준에 따라 이 투자신탁은 6단계 등급 체계 중 3등급에 해당되는 다소 높은 위험 수준의 투자위험을 지닌 것으로 분류하였습니다.

따라서 이 투자신탁은 국내 주식 및 주식관련파생상품에 주로 투자하여 KOSPI200수익률과 비슷한 수준의 수익을 추구하고자 하지만 위험 등급 3등급에 해당하는 다소 높은 위험 수준의 투자위험을 지니고 있다는 것을 잘 이해하는 투자자에 적합합니다.

실제 수익률 변동성은 매년 결산시점에 측정하며 이 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 수익률 변동성은 최직근 결산일을 기준으로 이전 3년간 펀드의 주간수익률의 연환산 표준편차로 계산하였습니다. 추후 매 결산시마다 실제 수익률 변동성을 재측정하게 되며, 이 경우 투자위험등급이 변동될 수 있습니다.

주1) 상기의 투자위험등급은 집합투자업자의 분류기준에 의한 등급으로, 판매회사에서 제시하는 등급과는 상이할 수 있습니다. 따라서, 이 투자신탁을 가입하시기 전에 해당 판매회사의 투자위험등급을 확인하시기 바랍니다.

## 3. 위험관리

- ① 투자유니버스관리  
당사의 기준에서 정한 조건에 부합하는 종목만 유니버스에 편입될 수 있으며, 유니버스 이외의 종목은 준법감시인이 승인하지 않을 경우를 제외하고는 투자를 제한하는 등의 위험관리를 합니다.
- ② 분산투자를 통한 리스크 관리  
투자대상자산을 법과 규정 등에서 정한 한도를 초과하여 집중 투자하지 않고 분산투자함으로써 위험을 축소하고자 합니다.
- ③ 신용평가관리  
당사의 기준에 의한 투자대상 및 규약에서 정한 신용등급이상의 자산에 투자함으로써 위험을 관리합니다.
- ④ 성과평가 및 보고  
벤치마크 대비 성과, 동일유형의 경쟁상품 대비 상대적 성과, 각종 발생할 수 있는 위험요소들에 대해 수시/정기적으로 모니터링 하고 최고위층에 보고합니다.

## III. 집합투자기구의 기타 정보

### (1) 과 세

- 양도차익(해외주식 매매차익 포함)에 대하여 소득세 등(개인, 일반법인 15.4%)을 부담합니다.
- 국내 상장주식 등에 대한 매매·평가 손익을 과세대상에서 제외하고 있으므로 국내 상장주식 등의 매매·평가 손실이 채권 이자, 주식 배당, 비상장주식 평가 등에서 발생하는 이익보다 큰 경우 수익자 입장에서는 투자손실이 발생했음에도 불구하고 과세될 수 있음을 유의하시기 바랍니다.
- 개인의 연간 금융소득(이자소득 및 배당소득) 합계액이 금융소득종합과세 기준금액을 초과하는 경우에는 금융소득종합과세 기준금액을 초과하는 금액을 다른 종합소득과 합산하여 개인소득세율로 종합과세 됩니다.
- 세제혜택이 적용되는 집합투자기구 및 종류 수익증권의 경우에는 과세내용이 달라질 수 있으므로, 자세한 내용은 투자설명서를 참고하시기 바랍니다.

## (2) 전환절차 및 방법

해당사항 없습니다.

## (3) 집합투자기구의 요약 재무정보

집합투자기구의 재무정보에 대한 내용은 '투자설명서 제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항 중 1. 재무정보'를 참고하시기 바랍니다.

---

### [집합투자기구 공시 정보 안내]

- 증권신고서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr)
- 투자설명서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr), 한국금융투자협회(www.kofia.or.kr), 집합투자업자(www.macquarie.co.kr/mim) 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(www.macquarie.co.kr/mim)
- 수시공시 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(www.macquarie.co.kr/mim)