

트러스톤칭기스칸MKF녹색성장증권투자신탁[주식] [주식형 펀드]

(운용기간 : 2014년05월29일 ~ 2014년07월16일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(2개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

트러스톤자산운용(주)

서울시 영등포구 여의대로 66,10층
(전화 02-6308-0500, <http://www.trustonasset.com>)

고객 여러분 안녕하십니까?

트러스톤자산운용의 녹색성장산업에 특화된 공모펀드인 트러스톤칭기스칸MKF녹색성장 펀드의 마지막 운용보고서를 보내드립니다.

지난 5년간 트러스톤자산운용을 믿고 소중한 자산을 맡겨주신 고객님께 다시 한 번 진심으로 감사 드립니다. 트러스톤칭기스칸MKF녹색성장 펀드는 2009년 5월말에 전세계적인 에너지 혁명이 앞으로 최소 10년 이상 세계경제를 지배할 것이라고 판단하여 의욕적으로 출시하였습니다. 지금도 전세계적으로 태양광, LED, 전기차 등 에너지 산업의 혁명은 지속되고 있고 관련 회사들은 성장을 거듭하고 있으나 에너지 가격이 전반적으로 하락하고 국내 공모펀드 시장도 특정 스타일펀드에 대한 관심이 약해지면서 트러스톤칭기스칸MKF녹색성장 펀드가 우수한 성과에도 불구하고 운용을 지속해 나가기 위한 규모에는 미달하여 운용을 종료하게 되었습니다.

2014년 5월 29일부터 2014년 7월 16일까지는 펀드를 정리하면서 벤치마크를 하회하였으나 지난 5년간은 +73.3%상승하여 KOSPI가 동기간 동안 40.6% 상승한 것과 비교하면 32.7%p를 초과하는 우수한 성과를 고객님들께 돌려드릴 수 있었던 것을 기쁘게 생각합니다. 동기간 동안 에너지 가격은 오히려 하락하면서 녹색성장지수를 이루고 있는 에너지관련주 등 대형주들은 오히려 동기간 동안 시장을 하회하는 성과를 보였으나, 트러스톤칭기스칸MKF녹색성장 펀드는 보다 경쟁력 있는 새로운 종목들의 편입함으로써 지속적으로 시장을 상회하는 성과를 올릴 수 있었습니다.


이러한 성과는 매니저의 역량이 아닌 트러스톤자산운용이 가지고 있는 운용철학과 운용시스템에 기반하여 도출할 수 있었던 성과였습니다. 연 2,000회가 넘는 탐방과 3년 이상의 수익추정에 기반한 투자결정 과정을 통해 장기적으로 성과를 낼 수 있는 기업에 집중하였고 매니저 한 명의 능력에 의존하지 않고 회사 전체의 역량에 기반한 운용을 지속해 나아가고 있습니다. 비록 트러스톤칭기스칸MKF녹색성장 펀드를 통한 인연은 여기까지이나 앞으로도 저희 트러스톤자산운용의 운용철학과 시스템에 대한 지속적인 신뢰를 보내주신다면 꾸준하고 우수한 성과로 보답하도록 하겠습니다.

지난 5년간 트러스톤자산운용에 보내주신 신뢰에 다시 한 번 감사드리며, 앞으로도 이러한 믿음에 부응하여 고객님들의 소중한 재산을 위해서 최선을 다할 것을 약속 드립니다.

항상 건강하시고 평안하시기 바랍니다.

트러스톤자산운용 CIO 황성택
주식운용3본부 본부장 정인기
주식운용3본부 3팀 안홍익 拜上





목 차

1. 펀드의 개요

2. 수익률 현황

3. 자산현황

4. 투자운용전문인력 현황

5. 비용현황

6. 투자자산매매내역

7. 공지사항

<참고 - 펀드용어정리>

1. 펀드의 개요

■ 기본정보 적용 법률 : 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
트러스트칭기스칸MKF녹색성장증권투자신탁(주식)		1등급	93786
A클래스			93790
C4클래스			93794
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형	최초설정일	2009.05.29
운용기간	2014.05.29 ~ 2014.07.16	존속기간	2014.07.17
자산운용회사	트러스트자산운용(주)	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사 ^{주)}	www.trustonasset.com	일반사무관리회사	외환펀드서비스
상품의 특징	세계는 지금 기후변화로 상징되는 '환경'위기와 고유가로 대표되는 '자원'위기에 동시에 직면해 있습니다. 위기에 직면함에 따라 세계 각국은 자원의 효율적·환경 친화적 이용에 국력을 집중하고 있으며 녹색성장관련 기업의 중요성이 높아지고 있습니다. 이러한 경제패러다임의 변화와 정부의 적극적인 지원으로 녹색성장관련 기업들의 성장 가능성이 높아지고 있습니다. 따라서 이 투자신탁은 성장잠재력 확보가 가능할 것으로 기대되는 태양광, 그린카, LED, 풍력, 원자력·핵융합, 4대강 정비, 폐기물처리, 연료전지, 바이오연료, 지열, 전력IT, CDM&탄소시장, 수처리 등의 사업분야에서 성장이 예상되는 녹색성장관련 국내 기업의 주식에 주로 투자하여 KOSPI수익률을 초과하는 투자 수익률 달성을 추구하는 투자신탁입니다.		

주)판매회사 : 트러스트자산운용(주) 홈페이지를 참고하시기 바랍니다.

■ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
트러스트칭기스칸MKF녹색성장 증권투자신탁(주식)	자산 총액 (A)	686	202	-70.59
	부채 총액 (B)	16	0	-99.80
	순자산총액 (C=A-B)	670	202	-69.89
	발행 수익증권 총 수 (D)	638	208	-67.43
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,050.30	970.99	-2.90
종류(Class)별 기준가격 현황				
A	기준가격	997.58	966.34	-3.13
C4	기준가격	1,099.50	968.49	-3.15

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산 총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

※ 분배금 내역

(단위 : 백만원, 백만좌)

구분	분배금지급일	분배금지급금액	분배후수탁고	기준가격(원)		비고
				분배금 지급전	분배금 지급후	
트러스트MKF녹색성장(주식)(운용)	2014-07-17	0	208	970.99	970.99	
트러스트MKF녹색성장(주식)A	2014-07-17	0	189	966.34	966.34	
트러스트MKF녹색성장(주식)C4	2014-07-17	0	19	968.49	968.49	

2. 수익률 현황

■ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
트러스톤칭기스칸MKF 녹색성장증권투자신탁[주식]	-2.94	2.96	0.90	8.67
비교지수(벤치마크)	1.07	2.87	-1.04	7.88
(비교지수 대비 성과)	(-4.01)	(0.09)	(1.94)	(0.79)
종류(Class)별 현황				
A	-3.36	2.10	-0.37	6.85
(비교지수 대비 성과)	(-4.42)	(-0.77)	(0.67)	(-1.03)
C4	-3.40	2.01	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.47)	(-0.86)	-	-
비교지수(벤치마크)	1.07	2.87	-1.04	7.88

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 100%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
트러스톤칭기스칸MKF 녹색성장증권투자신탁[주식]	8.67	20.91	-1.48	73.27
비교지수(벤치마크)	7.88	10.77	-6.14	40.58
(비교지수 대비 성과)	(0.79)	(10.15)	(4.66)	(32.68)
종류(Class)별 현황				
A	6.85	16.92	-6.44	59.71
(비교지수 대비 성과)	(-1.03)	(6.16)	(-0.30)	(19.12)
C4	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	7.88	10.77	-6.14	40.58

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 100%

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

■ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	35	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	35
당기	-11	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-11

3. 자산현황

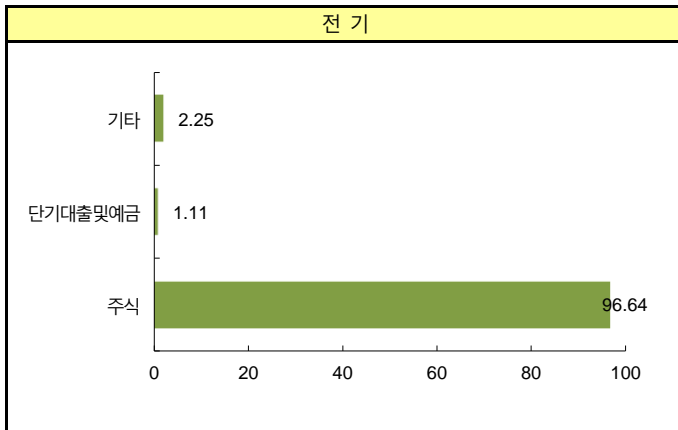
■ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	202 (99.96)	0 (0.04)	202 (100.00)

* () : 구성 비중

주) 2014년 7월 16일 기준 당기 투자신탁의 자산구성현황은 투자신탁 해지(2014.7.17)로 인하여 단기대출 및 예금으로만 구성됨



주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

■ 업종별(국내주식) 투자비중

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	단기상품 콜론(대우증권)	95.73	6		
2	단기상품 은대(국민은행)	4.23	7		
3			8		
4			9		
5			10		

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.

(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>)

단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

주) 2014년 7월 16일 기준 당기 투자신탁의 자산구성현황은 투자신탁 해지(2014.7.17)로 인하여 단기대출 및 예금으로만 구성되었습니다.

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2013-03-31	9	2.07		대한민국	KRW
단기대출	대우증권	2014-07-16	193	2.55	2014-07-17	대한민국	KRW

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

■ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	출생 년도	운용중인 다른 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
안홍익	부장	1976년	16	13,999	14	12,079	2109001761

주) 성명이 굵게 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

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

5. 비용현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

구분	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
트러스톤칭기스칸MKF녹색성장 증권투자신탁[주식]	자산운용사	0	0.00	0	0.00	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.00	
	기타비용**	0	0.01	0	0.01	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.02	0	0.06
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.04
		합계	0	0.03	0	0.10
	증권거래세	1	0.10	2	0.42	
A	자산운용사	2	0.18	0	0.10	
	판매회사	2	0.22	1	0.12	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	3	0.41	1	0.23	
	기타비용**	0	0.01	0	0.01	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.02	0	0.06
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.04
		합계	0	0.03	0	0.10
	증권거래세	1	0.10	2	0.41	
C4	자산운용사	0	0.18	0	0.10	
	판매회사	0	0.27	0	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.46	0	0.25	
	기타비용**	0	0.01	0	0.01	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.02	0	0.09
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.06
		합계	0	0.04	0	0.14
	증권거래세	0	0.11	0	0.70	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

▶ 총 보수,비용 비율

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
트러스트칭기스칸MKF녹색성장 증권투자신탁[주식]	전기	0.0499	0.1032	0.0499	0.1032
	당기	0.05	0.1561	0.05	0.1561
종류(Class)별 현황					
A	전기	1.6994	0	1.7494	0.1033
	당기	1.6992	0	1.7493	0.1546
C4	전기	1.8935	0	1.9436	0.1239
	당기	1.8934	0	1.9437	0.329

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

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(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. 투자자산 매매내역

■ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	21,153	654	150.76	1122.98

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식이액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

■ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

13년12월01일 ~14년02월28일	14년03월01일 ~14년05월28일	14년05월29일 ~14년07월16일
15.11	34.40	150.76

7. 공지사항

* 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률의 적용을 받습니다.

* 이 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의해 트러스트칭기스칸MKF녹색성장증권투자신탁[주식]의 자산운용회사인 트러스트자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 국민은행의 확인을 받아 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다.

각종 보고서 확인 : 트러스트자산운용(주)
금융투자협회

<http://www.trustonasset.com>
<http://dis.kofia.or.kr>

참 고 : 펀드 용어 정리

용 어	내 용
금융투자협회 펀드코드	금융투자협회에서 펀드에 부여하는 고유의 코드이며, 이를 이용하여 집합투자기구의 각종 정보에 대한 조회가 가능합니다.
추가형	추가로 설정이 가능한 집합투자기구입니다.
수익증권	자본시장법상 유가증권의 일종으로 자산운용회사가 일반 대중으로부터 자금을 모아 펀드를 만들 때 이 펀드에 투자한 투자자들에게 출자비율에 따라 나눠주는 권리증서를 말합니다. 투자신탁에 가입(매입)한다는 것은 이 수익증권을 산다는 의미입니다.
보수	투자신탁의 운용 및 관리와 관련된 비용입니다. 다시 말해 재산을 운용 및 관리해 준 댓가로 고객이 지불하는 비용입니다. 이는 통상 연율로 표시되며, 신탁보수에는 운용, 판매, 수탁보수 등이 있습니다. 보수율은 상품마다 다르게 책정되는 것이 일반적입니다.
집합투자업자	투자자는 은행,증권사,보험사 등의 판매회사에서 펀드에 가입하지만 이렇게 투자자로부터 모집한 자금으로 실제 주식 등의 유가증권에 투자, 운용하는 회사는 집합투자업자입니다. 집합투자업자는 투자자로부터 자금을 모은 위탁자가 되어 펀드의 운용을 업으로 하는 자로서 금융감독위원회의 인가를 받은 회사를 말합니다.
신탁업자	신탁업자란 펀드재산의 보관 및 관리를 영업으로 하는 회사를 말합니다. 현행법은 집합투자업자가 투자자로부터 위탁받은 재산을 운용회사의 고유재산과 분리하여 관리하도록 규정하고 있으며, 이에 따라 투자자의 투자자금은 신탁업자에 안전하게 보관,관리되고 있습니다.
일반사무관리회사	집합투자업자의 위탁을 받아 펀드기준가 산정 등의 업무를 수행하는 회사를 말합니다.
판매회사	판매회사란 펀드의 판매, 환매 등을 주된 업무로 하는 회사를 말하며, 투자자에게 펀드를 판매하는 은행,증권사, 보험사 등이 이에 속합니다. 판매회사는 투자자 보호를 위하여 판매와 관련된 주요 법령 및 판매행위준칙을 준수할 의무가 있습니다.
매매수수료 비율	해당 운용기간 중 펀드에서 지출되는 유가증권 및 파생상품등의 매매수수료 총액을 펀드의 순자산 총액으로 나눈 비율입니다.