

미래에셋 전략배분TDF2045혼합자산 자투자신탁

작성운용기간

2022년 06월 13일 ~ 2022년 09월 12일

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 1 2 3 4 5 6

이 투자신탁은 모두자산신탁을 주된 투자대상자산으로 하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다.

시장동향

해당 기간 글로벌 증시는 높은 변동성을 보였습니다. 7월 미국에서 경기 침체 신호들이 일부 나타났습니다. 미국 GDP 성장률이 2분기 연속으로 마이너스 성장을 나타냈고, 미국 국채 10년물 금리보다 2년물 금리가 높아지는 장단기 금리 역전이 나타났습니다. 향후 경기 둔화에 대한 우려가 높아지면서 장기 금리 위주로 채권 금리가 하락했고, 성장주 중심으로 증시가 반등했습니다. 하지만, 8월 잭슨홀 미팅에서 연준 의장이 경기 둔화를 감수하더라도 물가 안정에 집중하겠다고 밝혀 금리 인상에 대한 부담감이 높아졌습니다. 6월, 7월 연준은 기준금리를 한 번에 75bp씩 인상하는 자이언트 스텝을 단행했습니다. 유럽 지역에서도 에너지 가격 상승이 두드러지게 나타나면서, 높은 인플레이션에 대응하기 위해 기준금리를 인상했습니다. 달라는 주요 통화 대비 강세를 나타내며, 원화 대비 +8.84% 절상되었습니다. 국제 유가는 해당 기간 WTI(서부텍사스산원유) 선물 기준 -27.3% 하락했습니다.

운용성과

펀드(운용펀드 기준)의 수익률은 소폭 하락하였습니다.

펀드를 구성하는 4가지 전략(자본수익, 멀티인컴, 시장중립, 기본수익) 중 자본수익, 시장중립 전략은 플러스 성과를 기록했습니다. 자본수익 전략 내에서도 성과가 엇갈렸는데, '미래에셋글로벌ESG사회책임투자인덱스증권모투자신탁(주식)'은 +4.67% 상승한 반면, '미래에셋마켓플러스증권모투자신탁(주식)'은 -9.25% 하락했습니다. 멀티인컴 전략에 속한 '미래에셋글로벌EMP인컴배분증권모투자신탁(주식혼합)'은 +3.03% 상승했고, 시장중립 전략 내에 '미래에셋밸런스롱숏증권모투자신탁(채권혼합)'은 +0.30%의 성과를 기록했습니다. 기본수익 전략에서는 '미래에셋글로벌증권모투자신탁(채권)'이 -0.85% 하락했습니다.

운용 계획

미국 중앙은행은 경기 침체를 일부 감수하더라도 금리 인상을 지속할 전망이다. 정책 여력 측면에서 각국은 차별화된 투자 기회를 제공할 것으로 보이며, 여전히 해결되지 않은 지정학적 위험 등을 고려할 때 이익의 안정성이 높고 부채 비율이 낮은 퀄리티 자산과 달러 등이 포트폴리오 리스크관리에 도움이 될 것으로 판단합니다. 금리 상승에 피해를 입을 수 있는 자산에 대해서는 보수적으로 접근할 계획입니다. 전략배분TDF는 멀티인컴, 시장중립 전략을 활용한 전략적 자산배분을 활용해 기대수익과 위험을 동시에 살피며 균형감있게 운용하겠습니다.

기간수익률

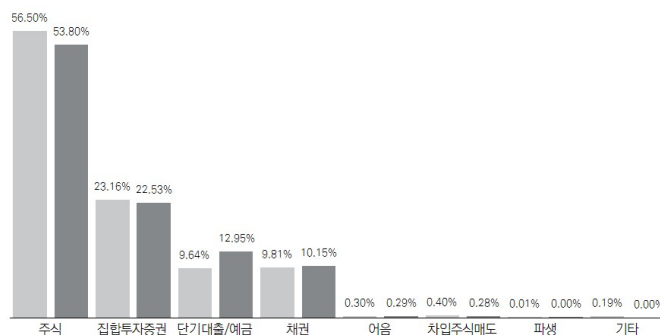
(단위: %)

비교시점	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
	2022.06.12-2022.09.12	2022.03.12-2022.09.12	2021.12.12-2022.09.12	2021.09.12-2022.09.12	2020.09.12-2022.09.12	2019.09.12-2022.09.12	2017.09.12-2022.09.12
운용펀드	-0.01	-2.15	-9.90	-9.66	12.31	29.34	42.47

※ 위 투자실적은 과거 실적을 나타낼 뿐 미래의 운용실적을 보장하는 것은 아닙니다.
 ※ 위 펀드의 투자실적은 펀드의 종류별로 수익률이 달라질 수 있으므로 자세한 사항은 운용상세 보고서를 참고 하시기 바랍니다.

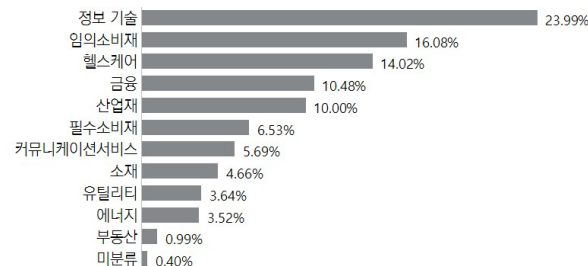
자산구성현황

■ 전기말 ■ 당기말



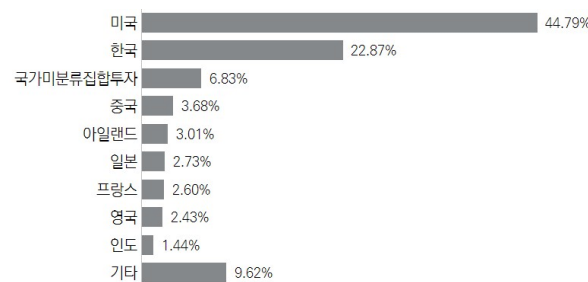
※ 선물, 스왑거래의 경우 비중에서 생략됩니다.

업종별 투자비중 (당기말 기준)



※ 위 업종구분은 한국거래소/GICS(Global Industry Classification Standard)의 업종구분을 따릅니다.
 ※ 위 업종구분은 주식총자산 대비 비중입니다.

국가별 투자비중 (당기말 기준)



※ 펀드의 국가별 비중은 자산의 발행국을 기준으로 합니다. (중국, 홍콩, 타이완 구분) 따라서 실제 자산이 거래되는 국가와의 차이가 발생할 수 있습니다. 또한, 재간접펀드의 경우 피투자펀드의 발행국과 해당 피투자펀드가 실제 투자하는 국가에 차이가 발생할 수 있습니다.
 ※ 타 운용사의 집합투자기구 및 외화수익증권 등을 재간접 투자 방식으로 담는 경우에는 투자종목 산정이 명확하지 않아 '국가미분류집합투자'로 표기됩니다.
 ※ 위 국가별 투자비중은 단기대출 및 예금을 제외한 비중입니다.

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

1. 펀드의 개요

기본정보 펀드의 설정일, 운용기간, 펀드의 특징 등 펀드의 기본 사항입니다.

펀드의 종류	공모집합투자기구 투자신탁/혼합자산/추가형/개방형/모자형/종류형
고난도 펀드	해당하지않음
레버리지(차입 등) 한도	-
존속기간	이 상품은 추가형 상품으로 종료일이 없습니다.
자산운용사	미래에셋자산운용
일반사무관리회사	한국펀드파트너스
펀드재산보관회사(신탁업자)	KB국민은행
판매회사	당사 홈페이지에서 확인하실 수 있습니다. (http://investments.miraesasset.com)
상품의 특징(투자전략)	이 투자신탁은 투자대상 모두투자신탁을 투자목적 및 투자전략 등에 따라 기본수익전략, 시장중립전략, 멀티인컴전략, 자본수익전략 등 4개의 전략으로 구분하며, 특정 목표시점 이 가까워짐에 따라 자본수익전략의 모두투자신탁 비중을 점차 축소하고, 기본수익전략, 시장중립전략, 멀티인컴전략의 모두투자신탁 비중을 점차 확대하여 투자 합니다.

펀드명	최초설정일	금융투자협회 펀드코드
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁	2017.03.13	BM747
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류A-e	2017.09.20	BM749
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류C-e	2018.08.16	BM751
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류C-P	2017.03.21	BM755
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류C-Pe	2017.03.21	BM757
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류C-P2	2017.03.24	BM762
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류A	2018.01.23	BM748
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류C	2017.07.27	BM750
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류F	2017.12.14	BM752
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류C-P2K	2020.08.28	D1246
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류C-P2e	2017.08.14	BU547
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁 종류S	2017.09.27	BM753

재산현황 당기말과 전기말 간의 펀드 순자산 총액과 펀드 기준가격의 추이입니다.

(단위: 백만원, 원, %)

펀드 명칭	항목	전기말	당기말	증감률
미래에셋전략배분TDF2045혼합자산 투자신탁	자산 총액	779,047	795,005	2.05
	부채 총액	908	2,070	127.94
	순자산총액	778,139	792,934	1.90
	기준가격	1,468.75	1,468.63	-0.01
종류A-e	기준가격	1,303.46	1,300.99	-0.19
종류C-e	기준가격	1,279.33	1,276.52	-0.22
종류C-P	기준가격	1,437.58	1,433.41	-0.29
종류C-Pe	기준가격	1,436.15	1,433.24	-0.20
종류C-P2	기준가격	1,434.98	1,431.10	-0.27
종류A	기준가격	1,238.92	1,235.64	-0.26
종류C	기준가격	1,320.02	1,315.70	-0.33
종류F	기준가격	965.37	964.26	-0.11
종류C-P2K	기준가격	1,054.82	1,052.47	-0.22
종류C-P2e	기준가격	1,344.65	1,342.06	-0.19

종류S	기준가격	1,319.94	1,317.66	-0.17
-----	------	----------	----------	-------

※ 자산총액 : 펀드운용자금 총액입니다.
 ※ 부채총액 : 펀드에서 발생한 비용의 총액입니다. 단, 미지급해지대금과 미지급분배금 등을 포함하는 값입니다.
 ※ 순자산총액 : 자산-부채로서 순수한 펀드자금의 총액입니다.
 ※ 자산/부채/순자산 총액 증감률은 작성 단위(백만원) 이하 수치인 '원' 단위까지 계산에 포함되지 때문에 증감률이 과다하게 표시될 수 있으니, 투자자분들께서는 이점 유의 바랍니다.
 ※ 기준가격 : 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

펀드의 구성 이 펀드가 투자하는 모펀드 각각의 투자비중입니다.

모펀드 명칭	투자비중
미래에셋OCIO베스트캡렉스증권모투자신탁(주식-재간접형)	2.21%
미래에셋시스마트베타마켓헤지증권모투자신탁(주식-재간접형)	0.09%
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산모투자신탁(일반상품-파생형)	0.54%
미래에셋글로벌솔루션증권모투자신탁(주식-재간접형)	5.85%
미래에셋브릭스인덱스증권모투자신탁(주식)	2.62%
미래에셋밸런스롱숏증권모투자신탁(채권혼합)	4.75%
미래에셋마켓플러스증권모투자신탁(주식)	1.85%
미래에셋배당프리미엄증권모투자신탁(주식혼합)	1.28%
미래에셋장기성장포커스증권모투자신탁(주식)	0.01%
미래에셋글로벌증권모투자신탁(채권)	4.05%
미래에셋코리안다인기증권모투자신탁(채권)	2.14%
미래에셋인사이트증권모투자신탁(주식혼합)	18.67%
미래에셋글로벌인컴증권모투자신탁(채권혼합)	4.42%
미래에셋부동산인프라혼합자산모투자신탁(재간접형)	4.01%
미래에셋글로벌배당프리미엄증권모투자신탁(주식혼합)	9.08%
미래에셋글로벌EMP인컴배분증권모투자신탁(주식혼합-재간접형)	5.57%
미래에셋MSCIAC월드인덱스증권모투자신탁(주식)	11.46%
미래에셋글로벌사회책임ESG인덱스증권모투자신탁(주식)	20.61%
미래에셋글로벌펀드셀렉트증권모투자신탁(주식-재간접형)	0.78%

※ 투자비중은 자펀드가 보유한 모펀드의 수익증권 평가금액을 기준으로 산출합니다.

2. 수익률 현황

기간 수익률 각 기간의 펀드 수익률 입니다.

비교지수 : 없음

이 투자신탁은 다양한 국가 및 자산에 투자하는 모두투자신탁에 분산투자되며 투자목적 달성을 위해 모두투자신탁의 투자비중이 유연하게 조절될 수 있어 비교지수를 채택하지 않았습니다.

(단위: %)

비교시점	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
	2022.06.12-2022.09.12	2022.03.12-2022.09.12	2021.12.12-2022.09.12	2021.09.12-2022.09.12	2020.09.12-2022.09.12	2019.09.12-2022.09.12	2017.09.12-2022.09.12
운용펀드	-0.01	-2.15	-9.90	-9.66	12.31	29.34	42.47
종류A-e	-0.19	-2.52	-10.40	-10.33	10.67	26.47	
종류C-e	-0.22	-2.58	-10.49	-10.44	10.40	25.99	
종류C-P	-0.29	-2.71	-10.68	-10.69	9.78	24.85	34.15
종류C-Pe	-0.20	-2.54	-10.44	-10.38	10.56	26.25	36.73
종류C-P2	-0.27	-2.67	-10.62	-10.62	9.95	25.15	34.69
종류A	-0.26	-2.67	-10.61	-10.60	10.00	25.28	
종류C	-0.33	-2.79	-10.78	-10.83	9.45	24.30	33.16

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

종류F	-0.11	-2.37	-10.19	-10.05	11.37	28.09	
종류C-P2K	-0.22	-2.58	-10.49	-10.45	10.37		
종류C-P2e	-0.19	-2.52	-10.41	-10.34	10.64	26.40	37.01
종류S	-0.17	-2.48	-10.36	-10.27	10.83	26.75	

※ 기타자산의 경우 자산의 특성에 맞게 주요내용만을 기재하고 있어, 자산구성현황의 기타비율과 상이할 수 있습니다.

추적 오차

펀드명	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산모투자신탁(일반상품-파생형)	4.70	5.24	8.18
미래에셋브릭스인덱스증권모투자신탁(주식)	4.73	11.83	13.84
미래에셋MSCIAC월드인덱스증권모투자신탁(주식)	2.55	2.81	2.51
미래에셋글로벌사회책임ESG인덱스증권모투자신탁(주식)	2.31	2.36	2.13

※ 추적오차란 일정기간 동안 펀드가 추종하는 특정 비교지수의 변동을 얼마나 충실히 따라갔는지를 보여주는 지표입니다. 이는 비교지수 수익률 대비 해당 펀드의 일간 수익률 차이의 표준편차로 기재하며 추적오차의 수치가 적을수록 해당 기간 동안 펀드가 비교지수와 유사하게 움직였음을 의미합니다.

3. 자산현황

주요 자산보유 현황 (당기말 기준)

펀드자산총액에서 파생상품의 거래는 발생시 모두 기재되며, 전체 보유자산(주식, 채권, 단기대출 및 예금 등)의 상위 10종목, 자산총액의 5%초과 보유종목 및 발행주식 총수의 1%초과 종목의 보유내역을 보여줍니다.

주식

(단위: 주, 백만원, %)

종목명/업종명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	비고
Microsoft Corp / 정보 기술	80,789	28,791	3.62	미국	
Tesla Inc / 임의소비재	36,128	14,153	1.78	미국	
Amazon.com Inc / 임의소비재	54,425	9,730	1.22	미국	
미래에셋앰스리츠 / 부동산	292,395	1,222	0.15	대한민국	총발행수량 1% 초과종목비율(1.45)

집합투자증권

집합투자기구에 투자함으로써 별도의 수수료가 부과됩니다.

(단위: 좌, 백만원, %)

종목	종류	집합투자업자	설정원본 (피투자펀드 기준)	순자산 금액	비중	비고
iShares MSCI EM SRI UCITS ETF	집합투자증권	BlackRock	1,657,431	15,517	1.95	
맥쿼리인프라	집합투자증권	Macquarie	1,133,839	14,286	1.80	
iShares Core MSCI Emerging Markets ETF	집합투자증권	BlackRock Fund Advisors	132,396	8,695	1.09	

단기대출 및 예금

(단위: 백만원, %)

구분	금융기관	단기대출/예금 일자	단기대출/예금 금액	적용금리	상환(만기)일	비중	비고
예금	KB국민은행		61,615	2.07		7.75	자산 5%초과
외화예금	KB국민은행		20,876	0.00		2.63	
콜론	한국증권금융(주)	2022.09.08	11,492	2.48	2022.09.13	1.45	

기타

(단위: 백만원, %)

구분	종목명	취득가액	비중	비고
기타자산	REPO	12,285	1.55	

장내파생상품 계약현황

(단위: 백만원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 C 202210 327.5	매도	11	0	
코스피200 C 202210 330.0	매도	10	0	
코스피200 C 202210 335.0	매도	9	0	
코스피200 C 202210 340.0	매도	7	0	
코스피200 C 202210 337.5	매도	7	0	
코스피200 C 202210 320.0	매도	6	0	
코스피200 C 202210 322.5	매도	5	0	
코스피200 C 202210 317.5	매도	5	0	
코스피200 C 202210 310.0	매도	4	0	
코스피200 C 202210 315.0	매도	2	0	
코스피200 C 202210 325.0	매도	2	0	
코스피200 C 202210 312.5	매도	2	0	
코스피200 C 202210 332.5	매도	2	0	
코스피200 C 202210 342.5	매도	1	0	
선물2022년12월물	매도	102	7,880	
MSCI World Index Sep22	매수	25	2,733	
MSCI EmgMkt Sep22	매수	39	2,583	
선물2022년12월물	매수	21	1,647	
코스피200 C 202210 345.0	매도	0	0	
코스닥150선물2022년12월물	매도	89	989	
BRENT CRUDE FUT ICE DEC 22	매수	5	560	
WTI CRUDE FUTURE	매수	4	475	
NATURAL GAS FUTR	매수	2	266	
CORN FUT CBOT DEC 2022	매수	4	189	
COTTON NO.2 FUTR Dec22	매수	3	178	
S-Oil선물2210	매도	171	166	
LG생활건강선물2210	매도	22	144	
SOYBEAN FUTURE NOV 22	매수	1	135	
삼성전기선물2210	매도	98	134	
GASOLINE RBOB FUT DEC 22	매수	1	128	
DB하이텍선물2210	매도	305	127	
WHEAT FUTURE(CBT) Dec22	매수	2	115	
NY HARB ULSD FUT DEC 22	매수	1	112	
GOLD 100 OZ FUTR DEC22	매수	0	101	
COFF ROBUSTA 10TN NOV 112	매수	3	100	
LIVE CATTLE FUT CME DEC 2022	매수	1	94	
MILL WHEAT EURO DEC 122	매수	4	93	
SOYBEAN OIL FUTR DEC22	매수	2	87	
LOW SU GASOIL G DEC22	매수	1	76	
ALUMINIUM 3MO (\$) (LME) DEC 122	매수	1	76	
COPPER 3MO (\$) (LME) DEC 122	매수	0	74	
SILVER FUTURE DEC22	매수	1	71	
ALUMINIUM 3MO (\$) (LME) NOV 112	매수	1	65	

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

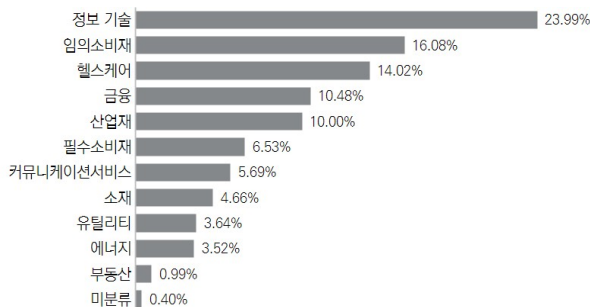
3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
LEAD 3MO (\$) (LME) DEC 122	매수	1	65	
ZINC 3MO (\$) (LME) NOV 112	매수	1	61	
KC HRW WHEAT FUT DEC22	매수	1	53	
LEAN HOGS FUTURE DEC 22	매수	1	52	
WHITE SUGAR (LIF) DEC 122	매수	1	47	
COCOA FUTURE DEC 122	매수	2	46	
RED WHEAT DEC 122	매수	1	44	
LUMBER FUTURE NOV 22	매수	1	42	
RAPESEED EURO NOV 22	매수	1	42	
SOYBEAN MEAL FUTR DEC 22	매수	1	40	
RUBBER FUT (OSE) FEB 23	매수	4	39	
SUGAR FUT CBOT MAR 2023	매수	1	39	
FCOJ-A FUTURE NOV 22	매수	1	29	
LEAD 3MO (\$) (LME) NOV 112	매수	0	28	
NICKEL 3MO (\$) (LME) DEC 122	매수	0	25	
NICKEL 3MO (\$) (LME) NOV 112	매수	0	25	
OAT FUTURE DEC 22	매수	1	22	
TIN 3MO (\$) (LME) OCT 102	매수	0	20	
TIN 3MO (\$) (LME) DEC 122	매수	0	20	
삼성전자선물2210	매수	33	19	
ZINC 3MO (\$) (LME) DEC 122	매수	0	15	
ZINC 3MO (\$) (LME) DEC 2022	매수	0	15	
ALUMINIUM 3MO (\$) (LME) DEC 2022	매수	0	11	
ALUMINIUM 3MO (\$) (LME) OCT 2022	매수	0	11	
LEAD 3MO (\$) (LME) OCT 2022	매수	0	9	
SPX US 09/16/22 C4300 INDEX	매도	11	1	
SX5E 09/16/22 C3750 INDEX	매도	17	0	
UKX 09/16/22 C7550 INDEX	매도	1	0	
AS51 09/15/22 C7150 INDEX	매도	7	0	
NKY 09/09/22 C28750 INDEX	매도	1	0	

※ 공모집합투자기구의 경우 보다 상세한 투자대상자산 내역은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다. 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다. (인터넷 주소 <http://dis.kofia.or.kr>)
 ※ 타 운용사의 집합투자기구 및 외화수익증권을 재간접 투자 방식으로 담는 경우에는 피투자펀드의 투자종목 표기를 생략하고 있습니다. 단, 모자형의 경우 해당 자펀드가 투자하고 있는 모펀드의 비율에 따라 종목을 산정하여 기재하고 있습니다.

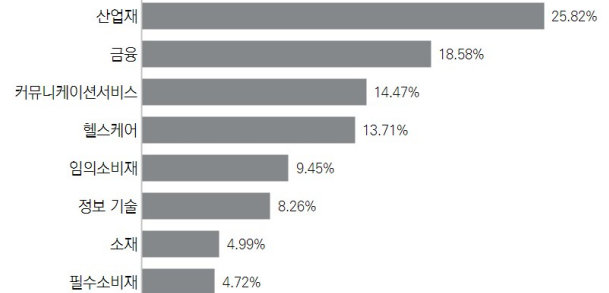
업종별 투자비중 (당기말 기준)

매수(LONG) 포지션



※ 위 업종구분은 한국 거래소/GICS(Global Industry Classification Standard)의 업종구분을 따릅니다.
 ※ 위 업종구분은 주식총자산 대비 비중입니다.

매도(SHORT) 포지션



※ 위 업종구분은 한국 거래소/GICS(Global Industry Classification Standard)의 업종구분을 따릅니다.
 ※ 위 업종구분은 주식총자산 대비 비중입니다.

롱숏투자비중 현황

(당기말 기준) (단위: %)

매수(LONG)포지션	매도(SHORT)포지션	순(NET)포지션
99.48	0.51	98.96

※ 순(NET)포지션은 매수 (LONG)포지션에서 매도(SHORT)포지션을 차감한 비율입니다.
 ※ 위 투자비율은 파생상품 및 집합투자증권(ETF 포함)의 거래를 제외한 주식자산 내 비중입니다.

매도(SHORT)포지션 현황

(당기말 기준) (단위: 원, %)

매도(SHORT)포지션 금액	전체자산 대비 비중
2,230,950,409	0.28

※ 위 매도(SHORT)포지션 비중은 전체자산 대비 비중으로서 주식자산 내 비중과 상이할 수 있습니다.

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1** **2** **3** **4** **5** **6**

환헤지에 관한 사항

환헤지란?	환헤지는 환율변동으로 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총 외화자산의 평가액 대비, 환헤지 규모를 비율로 표시한 것을 말합니다.
펀드 수익률에 미치는 효과	- 환율 하락(원화강세) : 펀드 내 기초자산은 환율 하락분 만큼 환 평가손실이 발생하나, 상대적으로 환헤지로 인해 환헤지 비율 분만큼의 환헤지 이익이 발생한다. - 환율 상승(원화약세) : 펀드 내 기초자산은 환율 상승분 만큼 환 평가이익이 발생하나, 상대적으로 환헤지로 인해 환헤지 비율 분만큼의 환헤지 손실이 발생한다.
투자설명서 또는 핵심상품설명서상의 목표 환헤지 비율	미래에셋글로벌밸류스탁모투자신탁(주식-재간접형), 미래에셋MSCIAC월드인덱스증권모투자신탁(주식), 미래에셋글로벌EMP인컴배분증권모투자신탁(주식혼합-재간접형), 미래에셋글로벌사회책임ESG인덱스증권모투자신탁(주식) - 이 투자신탁은 환헤지를 실행하지 않을 계획입니다. 다만, 해당 통화의 급격한 변동으로 인하여 환헤지를 통한 위험축소가 필요하다고 판단되는 경우 등에 운용역은 환헤지 전략을 실행할 수 있습니다. 미래에셋글로벌밸류프리미엄증권모투자신탁(주식혼합), 미래에셋밸류스탁플러스증권모투자신탁(채권혼합) - 이 투자신탁은 헤지 비용 등을 감안하여 효과적으로 환헤지 실행이 가능한 외화자산에 대하여 80% 수준의 환헤지를 목표로 합니다. 미래에셋인사이트증권모투자신탁(주식혼합) - 이 투자신탁은 투자 자산이 특정 통화에 집중되어 투자할 경우 환헤지가 가능한 외화자산에 대하여 100% 수준으로 환헤지를 추구할 예정이지만 보유 자산의 가치 변동으로 인해 헤지비용이 달라질 수 있습니다. 미래에셋부동산인프라혼합자산모투자신탁(재간접형) - 이 투자신탁은 효과적으로 환헤지가 가능한 통화(미국달러(USD), 유로(EURO), 일본엔(JPY))에 대해서 80% 이상 수준에서 환헤지를 추구할 예정입니다. 미래에셋글로벌인컴증권모투자신탁(채권혼합), 미래에셋글로벌증권모투자신탁(채권) - 이 투자신탁은 외환시장상황 변경 및 운용역의 투자전략 상 투자신탁의 위험축소를 목적으로 환헤지를 시행할 수 있습니다. 다만, 설정/헤지 또는 투자증권의 매매로 인하여 헷지 대상 기초자산의 규모가 급변하는 경우에는 일시적으로 초과 헤지포지션이 발생할 수 있습니다. 미래에셋글로벌밸류스탁증권모투자신탁(주식-재간접형) - 이 투자신탁은 헤지 비용 등을 감안하여 효과적으로 환헤지가 가능한 원/미국달러(USD)에 대해서 70% 이상 수준으로 환헤지를 추구할 예정입니다. 미래에셋로저스Commodity인덱스특별자산모투자신탁(일반상품-파생형), 미래에셋브릭스인덱스증권모투자신탁(주식) - 이 투자신탁은 외화자산 대비 90% 이상 환헤지를 실행할 계획입니다.
환헤지 비용 및 환헤지로 인한 손익	환헤지비용은 환헤지관련 파생상품의 계약환율에 포함되어 있어 별도의 산출이 불가능하며 환헤지로 발생한 손익사항 역시 환율변동에 따른 자산가치의 상승/하락과 상응하는 환헤지손익을 정확히 산출하는 것은 불가능합니다.

(단위: %)

기준일 현재 환헤지 비율	43.62
----------------------	-------

환헤지를 위한 파생상품 보유현황 및 평가 금액

(단위: 만, 만원)

종목	거래상대	기초자산	매수(도)구분	만기일	계약수	평가금액
FX스왑 USD 220614-42	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.15	12	16,003
FX스왑 USD 220614-85	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.15	684	944,541
FX스왑 USD 220616-A0	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.09.15	45	61,550
FX스왑 USD 220620-55	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.21	948	1,308,756
FX스왑 USD 220620-74	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.21	919	1,268,795
FX스왑 USD 220621-29	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.09.15	45	61,550
FX스왑 USD 220622-57	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.13	778	1,073,578
FX스왑 USD 220624-A5	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.09.15	22	30,775
FX스왑 USD 220628-70	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.21	42	57,672
FX스왑 USD 220628-80	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.15	27	36,930
FX스왑 USD 220706-49	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.16	723	998,048
FX스왑 EUR 220708-18	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	0	126
FX스왑 EUR 220708-19	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	22	30,003
FX스왑 GBP 220708-20	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	0	71
FX스왑 GBP 220708-21	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	2	3,971
FX스왑 JPY 220708-22	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	120	1,151
FX스왑 JPY 220708-23	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	979	9,414

종목	거래상대	기초자산	매수(도)구분	만기일	계약수	평가금액
FX스왑 AUD 220708-24	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	5	4,464
FX스왑 CAD 220708-25	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	3	3,140
FX스왑 USD 220708-43	ANZ	통화	매도	2022.09.20	16	21,514
FX스왑 USD 220708-44	ANZ	통화	매도	2022.09.20	25	34,701
FX스왑 USD 220708-45	ANZ	통화	매도	2022.09.20	20	27,229
FX스왑 USD 220708-46	ANZ	통화	매도	2022.09.20	0	241
FX스왑 USD 220708-47	ANZ	통화	매도	2022.09.20	14	19,731
FX스왑 USD 220708-48	ANZ	통화	매도	2022.09.20	19	26,888
FX스왑 USD 220708-49	ANZ	통화	매도	2022.09.20	48	65,785
FX스왑 USD 220708-50	ANZ	통화	매도	2022.09.20	15	21,380
FX스왑 USD 220708-51	ANZ	통화	매도	2022.09.20	57	78,668
FX스왑 GBP 220713-52	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.23	140	222,633
FX스왑 USD 220713-64	신한은행	통화	매도	2022.09.23	361	497,790
FX스왑 USD 220715-25	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.27	12	16,624
FX스왑 USD 220715-26	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.27	1	1,927
FX스왑 USD 220715-27	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.27	15	21,241
FX스왑 USD 220715-28	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.27	21	29,043
FX스왑 USD 220715-29	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.27	16	21,533
FX스왑 USD 220715-30	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.27	56	76,914
FX스왑 USD 220715-51	ANZ	통화	매도	2022.09.27	3	3,608
FX스왑 USD 220715-56	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	60	82,881
FX스왑 USD 220715-57	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	10	13,346
FX스왑 USD 220715-58	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	8	11,190
FX스왑 USD 220715-59	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	18	24,812
FX스왑 USD 220715-60	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	20	28,116
FX스왑 USD 220715-61	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	4	5,497
FX스왑 USD 220715-62	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	4	5,214
FX스왑 USD 220715-63	State Street (FX)	통화	매도	2022.09.27	4	5,396
FX스왑 AUD 220719-48	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.13	107	99,265
FX스왑 JPY 220719-49	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.13	6,945	66,870
FX스왑 USD 220719-50	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.13	599	826,126
FX스왑 AUD 220719-58	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.13	44	41,302
FX스왑 CHF 220719-59	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.13	25	35,419
FX스왑 EUR 220719-60	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.13	92	126,852
FX스왑 GBP 220719-61	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.13	53	84,391
FX스왑 JPY 220719-62	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.13	1,016	9,787
FX스왑 USD 220719-63	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.13	327	451,488
FX스왑 GBP 220720-39	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.30	21	32,580
FX스왑 USD 220720-40	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.30	820	1,132,185
FX스왑 EUR 220720-58	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.30	62	84,998
FX스왑 GBP 220720-59	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.30	55	86,879
FX스왑 USD 220726-91	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.20	682	941,425
FX스왑 USD 220727-A1	한국씨티은행	통화	매수	2022.09.20	9	12,932
FX스왑 USD 220727-AM	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.07	393	542,396
FX스왑 EUR 220727-AN	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.07	308	425,115

미래에셋전락배분TDF2045혼합자산자투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

종목	거래상대	기초 자산	매수(도) 구분	만기일	계약수	평가금액
FX스왑 AUD 220728-20	한국씨티은행	통화	매수	2022.10.13	18	16,869
FX스왑 USD 220728-23	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	9	13,037
FX스왑 USD 220729-30	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.23	171	235,919
FX스왑 GBP 220729-31	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.30	19	29,865
FX스왑 USD 220729-41	한국씨티은행	통화	매수	2022.10.12	30	41,821
FX스왑 USD 220729-54	ANZ	통화	매도	2022.10.12	29	39,886
FX스왑 USD 220729-55	ANZ	통화	매도	2022.10.12	0	496
FX스왑 USD 220729-56	ANZ	통화	매도	2022.10.12	1	1,224
FX스왑 USD 220729-57	ANZ	통화	매도	2022.10.12	8	10,520
FX스왑 USD 220729-58	ANZ	통화	매도	2022.10.12	2	2,742
FX스왑 USD 220729-81	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	27	36,628
FX스왑 USD 220729-82	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	15	20,643
FX스왑 USD 220729-83	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	33	45,622
FX스왑 USD 220729-84	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	19	26,242
FX스왑 USD 220729-85	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	43	59,901
FX스왑 USD 220729-86	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	14	19,638
FX스왑 USD 220729-87	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	5	7,045
FX스왑 USD 220729-88	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	36	50,128
FX스왑 USD 220729-89	State Street (FX)	통화	매도	2022.10.12	15	20,833
FX스왑 GBP 220801-54	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.10.13	6	8,849
FX스왑 USD 220801-56	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.09.15	20	27,082
FX스왑 JPY 220802-17	한국씨티은행	통화	매도	2022.09.20	4	41
FX스왑 USD 220803-46	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.14	931	1,284,979
FX스왑 USD 220805-19	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	49	67,508
FX스왑 USD 220805-20	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	8	10,781
FX스왑 USD 220805-21	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	38	52,064
FX스왑 USD 220805-22	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	18	25,070
FX스왑 USD 220805-23	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	11	15,252
FX스왑 USD 220805-24	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	34	47,068
FX스왑 USD 220805-25	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	20	27,752
FX스왑 USD 220805-26	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	8	11,344
FX스왑 USD 220805-27	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.18	23	31,731
FX스왑 USD 220805-74	ANZ	통화	매도	2022.10.18	1	1,856
FX스왑 USD 220805-75	ANZ	통화	매도	2022.10.18	20	27,515
FX스왑 USD 220808-40	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.09	577	795,345
FX스왑 CNH 220808-49	한국씨티은행	통화	매수	2022.11.08	1	1,179
FX스왑 USD 220808-55	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.09	137	188,470
FX스왑 USD 220810-45	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.21	851	1,173,917
FX스왑 USD 220811-37	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.07	188	259,405
FX스왑 USD 220812-34	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	17	23,496
FX스왑 USD 220812-35	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	34	47,061
FX스왑 USD 220812-36	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	6	8,730
FX스왑 USD 220812-37	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	12	16,456
FX스왑 USD 220812-38	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	45	62,340
FX스왑 USD 220812-39	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	7	9,847

종목	거래상대	기초 자산	매수(도) 구분	만기일	계약수	평가금액
FX스왑 USD 220812-40	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	2	2,166
FX스왑 USD 220812-41	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	29	40,348
FX스왑 USD 220812-42	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.25	2	2,605
FX스왑 USD 220812-68	ANZ	통화	매도	2022.10.25	1	771
FX스왑 USD 220812-69	ANZ	통화	매도	2022.10.25	2	2,862
FX스왑 USD 220812-70	ANZ	통화	매도	2022.10.25	27	37,723
FX스왑 USD 220812-71	ANZ	통화	매도	2022.10.25	27	37,720
FX스왑 USD 220812-72	ANZ	통화	매도	2022.10.25	19	25,995
FX스왑 USD 220812-73	ANZ	통화	매도	2022.10.25	40	55,487
FX스왑 USD 220816-95	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	887	1,222,936
FX스왑 EUR 220816-96	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	38	52,392
FX스왑 GBP 220816-97	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	33	52,427
FX스왑 JPY 220816-98	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	3,974	38,344
FX스왑 CHF 220816-99	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	3	4,875
FX스왑 AUD 220816-A0	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	17	16,048
FX스왑 CAD 220816-A1	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	25	26,043
FX스왑 USD 220816-AX	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	795	1,096,089
FX스왑 USD 220816-AY	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	139	191,959
FX스왑 EUR 220816-AZ	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	49	68,413
FX스왑 EUR 220816-B0	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	7	9,636
FX스왑 GBP 220816-B1	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	15	24,328
FX스왑 JPY 220816-B2	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	2,506	24,181
FX스왑 JPY 220816-B3	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	2,367	22,837
FX스왑 CHF 220816-B4	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	12	16,799
FX스왑 CHF 220816-B5	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	2	2,964
FX스왑 AUD 220816-B6	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	61	57,076
FX스왑 AUD 220816-B7	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	28	25,944
FX스왑 USD 220816-BJ	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	293	404,612
FX스왑 USD 220816-BK	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	28	38,065
FX스왑 USD 220817-78	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.28	294	405,364
FX스왑 USD 220817-79	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.28	205	282,812
FX스왑 EUR 220817-80	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.10.28	273	378,212
FX스왑 USD 220819-22	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.01	4	4,869
FX스왑 USD 220819-23	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.01	1	1,953
FX스왑 USD 220819-30	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.10	41	56,395
FX스왑 USD 220819-51	ANZ	통화	매도	2022.11.01	26	35,183
FX스왑 USD 220819-52	ANZ	통화	매도	2022.11.01	5	6,803
FX스왑 USD 220819-53	ANZ	통화	매도	2022.11.01	33	45,037
FX스왑 USD 220819-54	ANZ	통화	매도	2022.11.01	16	22,054
FX스왑 USD 220819-70	State Street (FX)	통화	매도	2022.11.01	50	68,419
FX스왑 USD 220819-71	State Street (FX)	통화	매도	2022.11.01	18	25,416
FX스왑 USD 220819-72	State Street (FX)	통화	매도	2022.11.01	5	7,086
FX스왑 USD 220819-73	State Street (FX)	통화	매도	2022.11.01	45	61,545
FX스왑 USD 220819-74	State Street (FX)	통화	매도	2022.11.01	12	16,054
FX스왑 USD 220822-36	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.10	41	56,396

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산자투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

종목	거래상대	기초 자산	매수(도) 구분	만기일	계약수	평가금액
FX스왑 JPY 220824-25	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.04	1,196	11,536
FX스왑 USD 220824-43	한국씨티은행	통화	매수	2022.11.08	0	417
FX스왑 USD 220824-44	한국씨티은행	통화	매수	2022.11.08	1	963
FX스왑 USD 220824-45	한국씨티은행	통화	매수	2022.10.25	1	781
FX스왑 GBP 220824-67	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.04	103	162,865
FX스왑 EUR 220824-68	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.04	67	92,216
FX스왑 EUR 220824-69	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.04	111	153,693
FX스왑 USD 220824-70	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.04	390	537,268
FX스왑 USD 220826-55	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	44	60,002
FX스왑 USD 220826-56	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	11	15,675
FX스왑 USD 220826-57	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	1	1,704
FX스왑 USD 220826-58	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	39	53,453
FX스왑 USD 220826-59	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	8	10,351
FX스왑 USD 220826-60	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	27	37,566
FX스왑 USD 220826-61	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	13	17,778
FX스왑 USD 220826-62	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	15	20,674
FX스왑 USD 220826-63	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	25	34,647
FX스왑 USD 220826-64	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	9	12,932
FX스왑 USD 220826-65	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	25	34,192
FX스왑 USD 220826-66	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	0	268
FX스왑 USD 220826-67	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	10	13,314
FX스왑 USD 220826-68	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	5	6,347
FX스왑 USD 220826-73	한국씨티은행	통화	매도	2022.10.20	55	75,437
FX스왑 USD 220830-19	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.25	7	9,717
FX스왑 USD 220830-47	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.25	90	124,573
FX스왑 EUR 220830-81	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.10.07	34	47,236
FX스왑 JPY 220831-32	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.14	9,996	96,472
FX스왑 USD 220831-33	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.14	607	836,315
FX스왑 USD 220831-61	한국씨티은행	통화	매수	2022.11.25	4	5,830
FX스왑 JPY 220831-72	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.14	33,322	321,575
FX스왑 USD 220831-73	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.14	120	164,907
FX스왑 USD 220901-38	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.09.15	42	57,488
FX스왑 USD 220902-51	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	3	3,452
FX스왑 USD 220902-52	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	5	7,394
FX스왑 USD 220902-53	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	21	29,476
FX스왑 USD 220902-54	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	44	60,374
FX스왑 USD 220902-55	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	14	19,575
FX스왑 USD 220902-56	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	43	58,836
FX스왑 USD 220902-57	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	17	23,307
FX스왑 USD 220902-58	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	8	11,608
FX스왑 USD 220902-59	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	41	55,854
FX스왑 USD 220902-60	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	16	22,422
FX스왑 HKD 220902-61	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	16	2,730
FX스왑 EUR 220902-67	한국씨티은행	통화	매수	2022.11.10	2	2,855
FX스왑 EUR 220902-72	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.10.13	7	9,625

종목	거래상대	기초 자산	매수(도) 구분	만기일	계약수	평가금액
FX스왑 USD 220902-73	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.10.13	70	96,066
FX스왑 USD 220902-75	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.11.25	7	9,717
FX스왑 EUR 220902-84	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.10.07	17	23,618
FX스왑 HKD 220905-32	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.15	14	2,438
FX스왑 USD 220905-33	한국씨티은행	통화	매도	2022.11.08	4	5,036
FX스왑 USD 220905-34	한국씨티은행	통화	매수	2022.10.18	2	2,397
FX스왑 USD 220905-35	한국씨티은행	통화	매수	2022.09.20	2	3,311
FX스왑 USD 220905-41	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.10.21	85	117,874
FX스왑 USD 220905-53	ANZ	통화	매도	2022.11.15	2	3,385
FX스왑 USD 220906-23	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.09.15	22	30,775
FX스왑 USD 220907-19	한국씨티은행	통화	매수	2022.10.12	1	964
FX스왑 USD 220907-20	한국씨티은행	통화	매수	2022.10.25	1	1,120
FX스왑 USD 220907-43	홍콩상하이은행	통화	매도	2022.11.18	778	1,071,870
FX스왑 USD 220908-28	한국씨티은행	통화	매수	2022.10.18	2	2,970
FX스왑 JPY 220908-43	홍콩상하이은행	통화	매수	2022.11.14	1,709	16,490

4. 펀드매니저(운용전문인력)현황

운용을 담당하는 펀드매니저 정보입니다.

(단위: 개, 억원)

이름	김정욱	운용중인 펀드의 수	9
연령	42	운용중인 펀드의 규모	40,602
직위	운용전문인력	성과보수가 있는 펀드 및 일임계약	개수: 0
협회등록번호	2115000354		운용규모: 0
이름	허준혁	운용중인 펀드의 수	59
연령	48	운용중인 펀드의 규모	60,999
직위	해외위탁운용역	성과보수가 있는 펀드 및 일임계약	개수: 1
협회등록번호	2109000973		운용규모: 2
이름	Rahul Chadha	운용중인 펀드의 수	69
연령	47	운용중인 펀드의 규모	53,294
직위	해외위탁운용역	성과보수가 있는 펀드 및 일임계약	개수: 0
협회등록번호			운용규모: 0
이름	Ryan Coyle	운용중인 펀드의 수	48
연령	43	운용중인 펀드의 규모	57,279
직위	해외위탁운용역	성과보수가 있는 펀드 및 일임계약	개수: 0
협회등록번호			운용규모: 0

* 기준일자 : 2022년 08월 31일

* 공모집합투자기구의 경우 펀드매니저 변경내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다. (인터넷 주소 : <http://dis.kofia.or.kr>)

5. 비용현황

총보수 비용 비율

펀드에서 부담하는 보수, 기타비용 및 매매중개 수수료를 연간단위로 환산한 수치입니다.

(단위: 연환산, %)

펀드	구분	총보수/비용 비율(A)* 매매/중개수수료 비율(B)**		합계(A+B)
		전기	당기	
운용펀드	전기	0.18	0	0.18
	당기	0.18	0	0.18

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

펀드	구분	총보수/비용 비율(A)*		매매/중개수수료 비율(B)**		합계(A+B)	
		전기	당기	전기	당기	전기	당기
종류A-e	전기	0.94		0.12		1.06	
	당기	0.94		0.07		1.01	
종류C-e	전기	1.06		0.12		1.18	
	당기	1.06		0.08		1.14	
종류C-P	전기	1.34		0.12		1.46	
	당기	1.34		0.08		1.42	
종류C-Pe	전기	0.99		0.12		1.11	
	당기	0.99		0.08		1.07	
종류C-P2	전기	1.26		0.12		1.38	
	당기	1.26		0.08		1.34	
종류A	전기	1.24		0.12		1.36	
	당기	1.24		0.08		1.32	
종류C	전기	1.49		0.12		1.61	
	당기	1.49		0.08		1.57	
종류F	전기	0.62		0.11		0.73	
	당기	0.62		0.07		0.69	
종류C-P2K	전기	1.07		0.12		1.19	
	당기	1.07		0.08		1.15	
종류C-P2e	전기	0.95		0.12		1.07	
	당기	0.95		0.08		1.03	
종류S	전기	0.87		0.12		0.99	
	당기	0.87		0.07		0.94	

*총보수 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균 잔액(보수, 비용 차감 전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수, 비용수준을 나타냅니다.

※ 다른 집합투자증권에 투자하는 펀드의 경우, 총보수 비용비율에 '피투자집합투자기구 보수'를 포함하고 있습니다. '피투자집합투자기구 보수'는 '추정치'이며 실제보수는 이와 상이할 수 있습니다. '피투자집합투자기구 기타비용'은 해당 정보를 알기 어려워 포함되지 않았습니다.

**매매, 중개수수료 비율이란 매매, 중개수수료를 순자산 연평균 잔액(보수, 비용 차감 전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 실제 부담하게 되는 매매, 중개수수료의 수준을 나타냅니다.

※ 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

보수 및 비용지급 현황

펀드에서 부담하는 보수, 기타비용, 매매중개수수료 및 증권거래세입니다.

(단위: 백만원, %)

구분	전기		당기	
	금액	비율**	금액	비율**
자산운용사	750	0.10	743	0.10
판매회사	837	0.11	830	0.11
종류A-e	3	0.00	3	0.00
종류C-e	2	0.00	2	0.00
종류C-P	117	0.01	114	0.01
종류C-Pe	54	0.01	53	0.01
종류C-P2	287	0.04	289	0.04
종류A	3	0.00	3	0.00
종류C	6	0.00	6	0.00
종류C-P2K	18	0.00	18	0.00
종류C-P2e	347	0.04	343	0.04
종류S	0	0.00	0	0.00

구분	전기		당기	
	금액	비율**	금액	비율**
펀드재산보관회사(신탁업자)	59	0.01	59	0.01
일반사무관리회사	39	0.01	39	0.01
보수 합계	1,685	0.22	1,671	0.22
기타비용*	74	0.01	67	0.01
조사분석서비스비용	0	0.00	0	0.00
매매결제서비스비용	246	0.03	157	0.02
증권거래세	92	0.01	74	0.01

* 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적/반복적으로 지출된 비용이며, 매매/중개수수료는 제외된 것입니다.

** 비율 : 펀드의 순자산총액 대비 비율

6. 투자자산매매내용

매매주식규모 및 회전을

해당기간의 매매량, 매매금액, 매매회전을 합니다.

(단위: 백만원, %)

매수		매도		매매회전율*	
수량	매매금액	수량	매매금액	해당분기	연환산
1,428,941	49,839	2,989,344	70,720	15.51	61.53

*매매회전율(해당분기)이란 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균 금액으로 나눈 비율을 말합니다. (ETF를 포함한 집합투자증권 등 제외) 매매회전율이 높으면 매매거래수수료 및 증권거래세가 발생해 투자자의 펀드비용이 증가합니다. 또한, 타 운용사의 집합투자기구 및 외화수익증권을 재간접 투자 방식으로 담는 경우에는 회전을 산출에서 제외됩니다. 단, 모자형의 경우 해당 자펀드가 투자하고 있는 모펀드의 비율에 따라 가중치로 안분하여 기재하고 있습니다.

최근 3분기 매매회전을 추이

최근 3분기의 매매회전을 추이입니다.

(단위: %)

기간	매매회전율
2021.12.13 ~ 2022.03.12	16.14
2022.03.13 ~ 2022.06.12	21.14
2022.06.13 ~ 2022.09.12	15.51

7. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

- 해당사항 없음 (당기말 기준)

8. 동일한(해당) 집합투자업자가 운영하는 집합투자구에 대한 투자현황

(단위: 주, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
미래에셋고배당포커스증권투자신탁1호(주식)종류F	107,913,490,912	2,327,646,969	2.20
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
미래에셋마켓플러스증권투자신탁(주식)종류F	7,262,340,933	2,007,839,265	27.60

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1** **2** **3** **4** **5** **6**

투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋장기성장포커스증권투자 자산신탁1호(주식)종류F	6,415,558,318	890,177,542	13.90
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋코어테크증권투자신탁(주식) 종류F	377,723,129,458	255,621,771	0.10
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋클린테크증권투자신탁(주식) 종류F	19,165,315,126	3,161,888,454	16.50
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋베트남증권투자신탁1호(H-USD)(주식-파생형)종류F	53,328,719,882	13,166,216,220	24.70
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋베트남배당IPO증권투자신탁(UH)(주식)종류F	11,490,549,126	832,100,736	7.20
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋인도중형포커스증권투자신탁1호(주식)종류F	86,583,715,291	12,589,529,036	14.50
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋MSCIAC월드인덱스증권투자신탁(주식-파생형)(H)종류F	14,036,121,820	9,362,452,407	66.70
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋이머징달러회사채증권투자신탁1호(H)(채권)종류F	12,788,200,088	6,001,258,910	46.90
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋인도채권투자1호(채권)종류F	22,441,211,851	5,977,693,910	26.60
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋중국위안화우량채권증권투자신탁(채권)종류F	12,463,487,140	1,883,236,178	15.10
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋글로벌투자적격채권증권투자신탁(H)(채권)종류F	23,696,867,714	5,036,428,799	21.30
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋배당프리미엄증권(주식혼합)C-F	276,607,973,004	2,707,864,498	1.00
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋차이나배당프리미엄증권투자신탁1호(주식혼합)종류F	2,440,889,506	1,128,307,491	46.20
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋밸류투자신탁1호(주식)종류F	234,141,793,883	1,000,380,145	0.40
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋서울중견고속도로전문투자형사모특별자산투자신탁2호	46,417,258,704	500,000,000	1.10
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋스튜디오엔터테인먼트사모부동산투자신탁1호	18,025,983,082	1,000,000,000	5.50
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋밸류투자신탁2-3호	110,500,000,000	500,000,000	0.50
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋밸류투자신탁6호	35,663,956,298	501,297,007	1.40

투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋밸류투자신탁7호	22,588,644,841	1,028,843,763	4.60
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋밸류투자신탁8호	34,486,197,583	470,515,703	1.40
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋배당프리미엄증권(주식혼합)C-F	276,607,973,004	6,765,082,738	2.40
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋글로벌사회책임ESG인덱스증권투자신탁(주식-파생형)(H)종류F	571,115,606	366,411,395	64.20
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
미래에셋배당프리미엄증권(주식혼합)C-F	276,607,973,004	2,088,366,607	0.80
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 차이나과창판STAR50(합성)	27,350,000	71,100	0.30
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 글로벌메타버스액티브	24,980,000	2,800,000	11.20
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 코스피고배당	1,590,000	29,365	1.80
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 200 IT	25,040,000	2,630	0.00
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 배당성장	780,000	27,259	3.50
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 가격조정	200,000	36,781	18.40
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 200 건설	33,740,000	310,000	0.90
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 200 중공업	21,640,000	20,164	0.10
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 농산물선물Enhanced(H)	4,200,000	75,000	1.80
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER AI코리아크로스액티브	2,300,000	323,933	14.10
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER AI코리아크로스액티브	2,300,000	300,000	13.00
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 200커뮤니케이션서비스	320,000	1,820	0.60
투자대상 집합투자지구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자지구명	발행총수(A)		
TIGER 차이나반도체FACTSET	3,560,000	77,600	2.20

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 차이나클린에너지SOLACTIVE	4,400,000	59,000	1.30
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER KRX300	1,300,000	6,954	0.50
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 글로벌멀티에셋TIF액티브	1,100,000	85,192	7.70
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 구리실물	2,350,000	12,000	0.50
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 로우볼	1,660,000	74,154	4.50
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 로우볼	1,660,000	18,807	1.10
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 미국MSCI리츠(합성 H)	12,850,000	3,200,000	24.90
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 단기통안채	16,136,000	250,400	1.60
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 단기통안채	16,136,000	90,000	0.60
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 200	64,200,000	27,101	0.00
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 200	64,200,000	146,385	0.20
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 200	64,200,000	694,653	1.10
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 200 경기소비재	340,000	1,613	0.50
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 모멘텀	280,000	27,043	9.70
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 모멘텀	280,000	10,000	3.60
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 200 헬스케어	1,860,000	4,385	0.20
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 200 산업재	940,000	7,751	0.80
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 우량가치	1,230,000	72,317	5.90

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 차이나전기차SOLACTIVE	230,360,000	38,100	0.00
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 차이나전기차SOLACTIVE	230,360,000	600,000	0.30
투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
TIGER 차이나항생테크	57,800,000	56,300	0.10

* 펀드가 재간접구조 등 동일(해당) 집합투자업자가 운용하는 다른 펀드에 투자하는 경우 기재하고 있습니다. 또한, 모자형의 경우 해당 자펀드가 투자하고 있는 모펀드의 동일(해당) 집합투자업자 투자자산을 기재하고 있습니다.

9. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

유동성 위험: 환매금지형 집합투자기구가 아님에도 불구하고, 투자대상 자산이 매각이 어려운 자산일 경우 환매에 대응하기 위한 자산의 중도매각이 어려워 환매에 제때 응하지 못할 수 있습니다. 또한 매각이 된다고 하더라도 중도매각에 따른 추가적인 손실이 발생할 수도 있습니다.

금리 변동위험: 채권의 가치는 이자율 등 여러 거시경제지표의 변화에 따른 가격변동 위험에 노출됩니다. 일반적으로 채권은 시장이자율이 상승하는 경우 채권가격을 결정하는 할인율이 함께 상승함에 따라 그 가치가 하락하는 특징이 있으며, 이로 인해 채권투자시에도 투자원금의 손실 가능성을 전혀 배제할 수는 없습니다.

부도 등의 위험: 이 집합투자기구가 투자하는 종목의 발행회사 신용상태가 급격히 악화되거나, 장외파생상품투자의 경우 거래상대방이 파산하거나 신용위기를 경험하는 경우에는 투자자금 전액의 회수가 불가능할 수도 있습니다.

국가 위험: 이 집합투자기구는 해외에 투자할 수 있기 때문에 투자대상국가의 시장, 정치 및 경제상황 등에 따른 위험에 매우 많이 노출이 되어 있습니다. 해당국가 정부정책 및 제도의 변화로 인해 예상치 못한 자산가치의 손실이 발생할 수 있으며, 외국인에 대한 투자제한 조처 등 변화 등의 정책적 변화 및 사회전반적인 투명성 부족으로 인한 공시자료의 신뢰성 등의 위험도 있습니다.

장외파생상품 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 투자시에는 거래상대방이 파산하거나 신용위기를 경험하는 경우 투자자금 전액회수가 불가능할 수도 있는 등 장외파생상품에 투자하는 경우보다 훨씬 큰 신용위험을 부담할 수 있습니다. 한편, 장외시장은 통상 유동성이 부족하므로 원하는 시점에 원하는 가격으로 거래를 종결하지 못할 수 있습니다.

부동산 및 인프라 자산 투자위험: 부동산, 인프라 관련 자산의 가치는 해당지역의 경제성장을 물가상승률, 이자율 등 여러 거시경제지표의 변화 및 기타 가격변동 위험에 노출됩니다. 또한, 부동산, 인프라 관련 집합투자기구 등 간접적인 방법으로 부동산, 인프라 관련 자산에 투자하게 되는 경우라도 부동산, 인프라 관련 자산에 직접 투자하는 것과 동일한 위험수준에 노출됩니다.

재간접구조: 주요 투자대상인 피투자집합투자기구의 집합투자증권은 개별적인 운용전략하에 운용되며 개별적인 포트폴리오를 보유하고 있습니다. 또한 운용전략에 따라 그 세부내역의 전부 또는 일부가 공개되지 않을 수 있기 때문에 투자하는 집합투자증권에 대한 정보를 충분히 얻지 못할 수 있습니다. 결과적으로 타 집합투자증권에 주로 투자하는 투자신탁의 투자자는 직접 자산을 투자하는 투자신탁에 비해 상대적으로 더 높은 기회비용과 손실을 부담할 위험이 있습니다.

환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

동 펀드 운용기간 동안 환매중단 된 경우는 없었으며 적절한 유동성을 상시 확보하여 향후에도 없을 것으로 판단됩니다.

주요 위험관리 방안

펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

법령의 예외적인 경우를 제외하고는 동일 종목에 대해 10% 이하로 투자함으로써 기본적으로 분산 투자를 통해 포트폴리오의 위험을 관리합니다

재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한수단 등

이 투자신탁이 투자하는 피투자펀드의 위험관리를 위해, 정기적으로 정기적인 운용정보 요청권리 유무, 제공받을 수 있는 운용정보 / 주기적인 운용보고서 입수 여부를 점검하고 있습니다.

환매중단, 상황연기 등과 관련된 환매재계, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등

동 펀드 운용기간 동안 환매중단 된 경우는 없었으며 적절한 유동성을 상시 확보하여 향후에도 발생하지 않도록 관리하고 있습니다.

미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁

3등급-다소 높은위험 **1 2 3 4 5 6**

자전거래 현황

(단위: 백만원)

자전거래 규모	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
매수금액	-	-	-	-
매도금액	-	-	-	-

최근 1년간 자전거래 발생시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차 등

해당사항 없습니다.

주요 비상대응계획

내부 위기상황 지표를 설정하고 일간으로 모니터링합니다. 위기단계별 대응 프로세스를 마련했으며, 펀드의 유동성과 투자전략을 점검하며 전사적인 차원의 위기대응을 실시합니다.

10. 공지사항

고객님이 가입하신 펀드는 "자본시장과 금융투자업에 관한 법률"의 적용을 받습니다.

이 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의해 [미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁]의 자산운용회사인 [미래에셋자산운용]이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 KB국민은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 투자자의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹을 통해 조회할 수 있습니다.

펀드는 모자형구조의 펀드로서, 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용등의 정보는 가입한 [미래에셋전략배분TDF2045혼합자산투자신탁]이 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여드리고 있습니다.

1) 작성기준일로부터 최근 3개월간 발생한 펀드 수시공시사항
- 수시공시에 대한 사항은 금융투자협회 전자공시(<http://dis.kofia.or.kr/>) 펀드공시/수시공시를 참조하시기 바랍니다.

2) 작성기준일로부터 최근 3개월간 발생한 소규모펀드 공시사항
해당사항 없음

11. 자산운용보고서 확인방법 안내

- 이 자산운용보고서의 내용은 펀드 전체에 관한 내용입니다. 투자자의 계좌별 수익률 정보 확인 및 고객정보의 변경은 펀드를 가입하신 판매 회사 지점에 연락하시거나 판매회사의 홈페이지를 통하여 확인하시기 바랍니다.
- 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행령 제92조(자산운용보고서)에서 정한바에 따라 이메일로 자산운용보고서를 받아 보실 수 있습니다. 자산운용보고서는 3개월마다 정기적으로 고객님의 발송해 드리고 있으며, 이메일 수령 신청을 통해 더욱 편리하게 자산운용보고서를 관리하실 수 있습니다. 단, 공모 단기금융집합투자기구(MMF)를 운용하는 경우에는 1개월, 환매금지형집합투자기구(상장)를 운용하는 경우에는 3개월마다 집합투자업자, 판매회사, 한국금융투자협회의 인터넷 홈페이지를 이용하여 공시합니다.
- E-mail전환신청은 가입하신 판매회사에서 변경하실 수 있습니다.
- 미래에셋자산운용 고객센터 : 1577-1640
미래에셋자산운용 홈페이지 : <http://investments.miraeasset.com>
금융투자협회 전자공시 서비스 : <http://dis.kofia.or.kr>