

기초지수

S&P GSCI Crude Oil Enhanced Index ER지수는 선물시장(NYMEX)에 상장된 WTI원유 선물가격의 움직임을 나타내는 지수로서, 선물투자시 발생하는 롤오버비용(Roll over Cost)을 반영하여 산출되는 지수입니다.

기본정보

| | |
|-------------|---------------------------|
| 최초설정일 | 2010년 7월 30일 |
| 기초자산 | 원유선물 |
| 순자산총액 | 22,842백만원 |
| 1주당순자산(NAV) | 4,709.77원 |
| 총보수율(TER) | 연 0.69 % |
| 분배금기준일 | 투자신탁 회계기간종료일 |
| 집합투자업자(운용) | 미래에셋자산운용 |
| 신탁업자(자산보관) | 한국씨티은행 |
| 일반사무관리회사 | 한국펀드파트너스 |
| AP/LP | 홈페이지(www.tigeretf.com) 참조 |

거래정보

| | |
|------------------|-----------------------|
| 상장거래소 | KRX 유가증권시장 |
| 종목명 | TIGER 원유선물Enhanced(H) |
| 상장코드 | 130680 |
| 블룸버그 티커 (펀드) | 130680 KS |
| 블룸버그 티커 (기초지수) | SPGSCLP |
| 결제일 | T+2 |
| 설정단위(CU) | 50,000주 |
| 거래단위 | 1주 |
| 일거래량(최근3개월 일평균) | 74,837주 |
| 일거래대금(최근3개월 일평균) | 345백만원 |

분배현황(최근 2년)

| | | |
|--------|----------|----------|
| 분배금지급일 | 주당분배율(%) | 주당분배금(원) |
| - | - | 0 |

투자 포인트

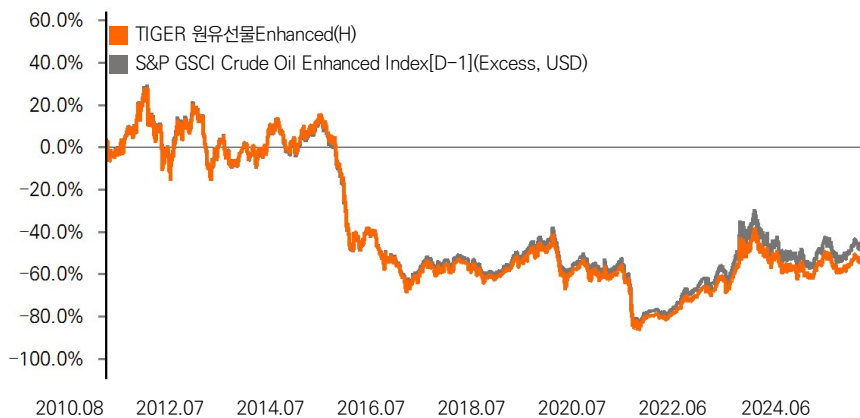
1. 원유 선물에 편리하게 투자 가능
2. 다이내믹 롤오버 방식을 통해 롤오버 리스크 최소화 추구
3. 원-달러 환헤지를 통해 환율 리스크 축소

운용성과 (%)

| 구분 | 1M | 3M | 6M | 1Y | 3Y | YTD | 설정이후 | 변동성 |
|-------------------------|------|------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| TIGER 원유선물Enhanced(H) | 5.21 | 2.23 | 12.25 | 25.86 | 40.52 | 12.24 | -52.90 | 24.26 |
| S&P GSCI Crude Oil enha | 5.51 | 2.34 | 13.04 | 27.88 | 43.85 | 16.73 | -45.62 | 27.63 |

* 위의 수익률 정보 및 아래 그래프는 운용기간 중 발생한 분배금 재투자율 가정하였음.
변동성: 최근 1년간 일간수익률 기준 표준편차 연환산 (운용기간 1년 이내인 경우 전체 운용일수 기준)

누적성과 그래프



주요보유현황

| 구분 | 종목명 | 구분 | 만기일 | 계약수량 (액면수량) | 평가금액 (백만) | 비중(%) |
|-----|----------------------------|----|----------|-------------|-----------|-------|
| 파생 | CRUDE OIL FUT NYMX AUG | 매수 | 24.07.22 | 62 | 6,977 | 30.54 |
| 파생 | CRUDE OIL FUT NYMX AUG | 매수 | 24.07.22 | 46 | 5,176 | 22.66 |
| 파생 | CRUDE OIL FUT NYMX AUG | 매수 | 24.07.22 | 32 | 3,601 | 15.76 |
| 파생 | CRUDE OIL FUT NYMX AUG | 매수 | 24.07.22 | 14 | 1,575 | 6.90 |
| ETF | Global X S&P Crude Oil Fut | | | 3,500,000 | 3,459 | 15.14 |
| ETF | TIGER 미국달러선물인버스2X | | | 300,000 | 1,772 | 7.76 |
| ETF | Invesco DB Oil Fund | | | 60,000 | 1,315 | 5.76 |
| ETF | United States 12 Month Oil | | | 10,000 | 560 | 2.45 |
| ETF | TIGER KOFR금리액티브(합성) | | | 5,000 | 529 | 2.32 |

※ ETF는 실적배당상품으로 운용결과에 따른 이익 또는 손실이 투자자에게 귀속됩니다. ※ 예금자보호법에 따라 예금보험공사가 보호하지 않으며, 원본의 손실이 발생할 수 있습니다. ※ ETF를 취득하기 전에 (투자대상, 환매방법 및 보수 등에 관하여) 투자설명서를 반드시 읽어 주시기 바랍니다. ※ 과거의 운용실적이 미래의 운용수익을 보장하지 않습니다.