

채권절대수익추구형

국내에서 발행되는 채무증서로 신용평가기관들이 부여한 신용등급이 있으며 정부, 공공기관 및 특수법인, 상법상의 주식 회사가 발행한 채권에 주로 투자하며 채권 절대 수익을 추구하는 펀드(BM: KIS CD INDEX)

기준일: 2020년 12월 31일

연도	보수공제전 수익률 (%)	벤치마크 수익률 (%)	포트폴리오 수	분산도 (%)	컴포지트 3년 표준편차	벤치마크 3년 표준편차	컴포지트 총자산 (억원)	회사 총자산 (억원)	무보수 자산비중 (%)
2017	-	-	-	-	-	-	1,000	91,808	
2018	2.84	1.66	≤5	-	-	-	1,027	65,049	-
2019	-	-	-	-	-	-	-	76,386	-
2020	-	-	-	-	-	-	-	84,839	-

단절구간

연도	구간	보수공제전 수익률(%)	벤치마크 수익률 (%)
2017	09/19 ~ 12/31	0.11	-
2019	01/01 ~ 06/20	1.44	-
2019	06/29 ~ 07/03	0.04	-

트러스트자산운용(주)는 국제투자성과기준(GIPS®)을 준수하여 이 보고서를 준비하고 제시합니다.

1. **컴포지트 생성일:** 2017년 9월 12일
2. **성과계산기간:** 2017년 9월 12일부터 2020년 12월 31일
3. **벤치마크:** KIS CD INDEX
4. **운용통화:** 한국 원화(KRW)
5. **파생상품 사용여부:** 컴포지트에 포함된 포트폴리오들은 헤지 목적 외의 레버리지와 파생상품을 사용하지 않음

- i. 트러스트자산운용(주)는 한국의 고객에게 자산운용서비스를 제공하는 회사입니다. 회사 총자산 가치는 회사에 의해 독립적으로 운용되는 재량권이 있는 자산과 재량권이 없는 자산들의 시장가치 총계입니다. 여기에는 보수를 받는 자산뿐만 아니라 보수를 받지 않는 자산도 포함됩니다.
- ii. 트러스트자산운용(주)는 2004년 1월 1일부터 2010년 12월 31일 까지 (주)KG제로인에, 2011년 1월 1일부터 2020년 12월 31일까지의 기간 동안 한국펀드평가((주)KBP펀드평가)에 의해 검증을 받았습니니다. 검증보고서의 사본은 요청 시 제공 가능합니다.
- iii. 검증은 회사가 전체 회사 차원에서 GIPS기준의 모든 컴포지트 구축 필수조항을 준수했는지, 회사의 정책과 절차가 GIPS기준에 따라 성과를 계산하고 제시하도록 고안되었는지 여부를 평가합니다. 검증은 특정 컴포지트 제시자료의 정확성을 보장하지 않습니다.
- iv. 이 컴포지트 내에 포트폴리오는 순자산가치 50억원 이상이 편입기준이며, 이 최소 순자산가치의 80%를 하회한 일자에 컴포지트에서 편출, 최소 순자산가치 이상이 되는 일자에 편입됩니다. 컴포지트 내의 포트폴리오의 중대한 현금흐름은 전일 해당 포트폴리오의 순자산가치의 ± 20% 이상의 현금흐름으로 정의됩니다. (-)중대한 현금흐름의 경우 5영업일전부터 발생일까지, (+) 중대한 현금흐름의 경우 발생일로부터 5영업일간 컴포지트에서 일시적으로 편출됩니다. 또한 포트폴리오의 신규설정 시 5영업일 후에 컴포지트에 편입됩니다.
- v. 보수공제 전 수익률은 거래비용만이 공제되고, 운용보수와 수탁보수 및 기타보수는 공제하지 않은 수익률입니다. 수익률은 환급할 수 없는 원천세를 공제하고 제시되었습니다.
- vi. 분산도는 컴포지트 내의 1년 이상 운용된 포트폴리오들을 대상으로 동일가중 표준편차를 이용하여 계산되었습니다. 단, 컴포지트 내의 포트폴리오 수가 5개를 초과한 경우에만 생성하였습니다.
- vii. 다음의 정보는 요청 시 제공 가능합니다.
 - 성과 결과의 계산 및 보고에 대한 회사의 정책과 절차에 관한 추가정보
 - 컴포지트에 대한 완전한 목록과 개요 또는 설명서
 - 검증보고서 사본
- viii. 본 자료는 회사 및 상품에 대한 이해를 돕기 위하여 작성한 것이므로 실제 판매되는 상품과는 다소 상이할 수 있습니다. 본 자료는 단순히 참고용으로 제작한 자료이므로, 어떤 경로를 통해서든 본 자료의 전부 또는 일부를 교부 받은 투자자는 상품가입 전에 증권신고서, 신탁계약서, 투자설명서를 참고하여 상품의 내용을 충분히 인지하신 후 자신의 판단과 책임 하에 투자여부를 결정하시기 바랍니다. 또한, 본 자료는 참고자료로 신뢰할 수 있다고 판단되는 각종 자료와 통계자료를 이용하여 작성된 것이나 본 자료의 내용이 향후 결과에 대한 보증이 될 수 없습니다. 또한 운용결과에 따라 이익 또는 손실이 발생할 수도 있으며, 그 결과는 투자자에게 귀속됩니다.