

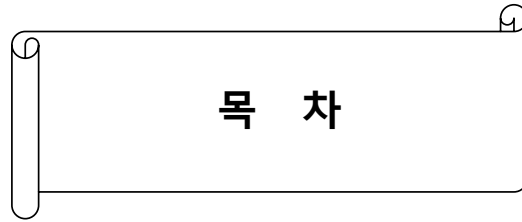
트러스톤 칭기스칸 플러스알파 증권자투자신탁[채권혼합] [채권혼합형 펀드]

(운용기간 : 2014년07월19일 ~ 2014년10월18일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

트러스톤자산운용(주)

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



1. 펀드의 개요

2. 수익률 현황

3. 자산현황

4. 투자운용전문인력 현황

5. 비용현황

6. 투자자산매매내역

7. 공지사항

<참고 - 펀드용어정리>

1. 펀드의 개요

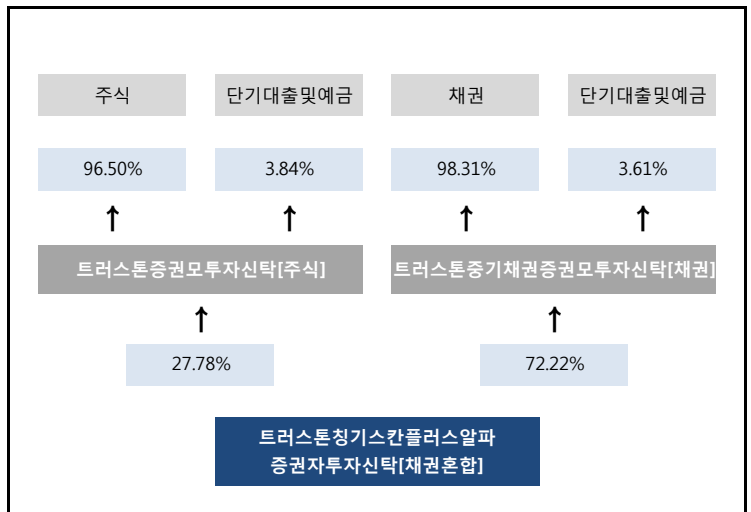
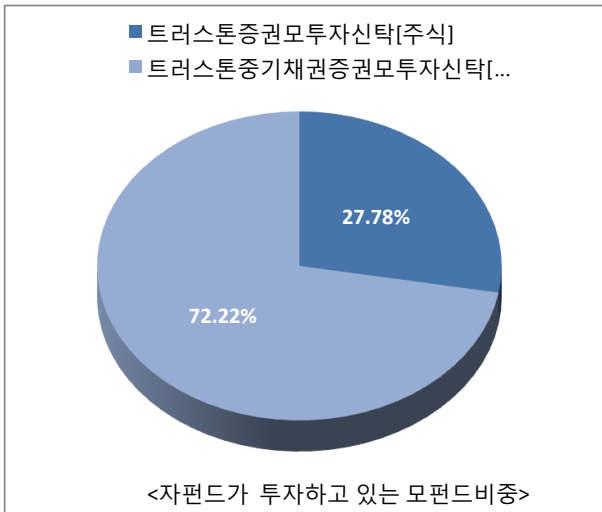
■ 기본정보

적용 법률 : 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
트러스트칭기스칸플러스알파증권자투자신탁(채권혼합)		3등급	A0026
A			A0027
C			A0028
Ce			A0029
Cp			AH597
S			AQ411
S-P			AQ412
펀드의 종류	채권혼합형, 추가형, 종류형	최초설정일	2011.04.19
운용기간	2014.07.19 ~ 2014.10.18	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	트러스트자산운용(주)	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사 ^{주)}	www.trustonasset.com	일반사무관리회사	외환펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 안정적인 수익을 추구하기 위하여 채권에 주로 투자하는 모투자신탁에 투자신탁재산의 80% 이하를 투자하고, 투자신탁재산의 40%이하를 주식에 주로 투자하는 모투자신탁에 투자하여 장기적으로 안정적인 자본이득 및 이자수익을 추구합니다. 또한 모투자신탁의 운용실적에 따른 손익에 따라 이익 또는 손실이 발생합니다.		

주)판매회사 : 자세한 사항은 홈페이지를 참조하시기바랍니다.

■ 펀드구성



※ 자펀드 자산현황을 100으로 가정하였을때 각 모펀드의 집합투자증권을 얼마만큼 투자하고 있는지를 보여줍니다.

■ 자산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
트러스트칭기스칸플러스알파증권 자투자신탁(채권혼합)	자산 총액 (A)	9,653	6,458	-33.09
	부채 총액 (B)	15	17	17.66
	순자산총액 (C=A-B)	9,638	6,441	-33.17
	발행 수익증권 총 수 (D)	9,205	6,118	-33.54
	기준가격주) (E=C/D×1000)	1,046.98	1,052.85	0.56
종류(Class)별 기준가격 현황				
A	기준가격	1,035.12	1,038.67	0.34
C	기준가격	1,036.29	1,038.56	0.22
Ce	기준가격	1,027.61	1,030.40	0.27
Cp	기준가격	1,024.93	1,027.64	0.26
S	기준가격	1,020.07	1,024.28	0.41
S-P	기준가격	1,019.90	1,024.25	0.43

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.

2. 수익률현황

■ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
트러스트칭기스칸플러스알파 증권자투자신탁(채권혼합)	0.56	2.60	4.82	5.62
비교지수(벤치마크)	-1.05	-0.06	1.39	0.30
(비교지수 대비 성과)	(1.61)	(2.66)	(3.43)	(5.32)
종류(Class)별 현황				
A	0.34	2.16	4.17	4.74
(비교지수 대비 성과)	(1.39)	(2.22)	(2.77)	(4.44)
C	0.22	1.91	3.78	4.23
(비교지수 대비 성과)	(1.27)	(1.97)	(2.39)	(3.92)
Ce	0.27	2.02	3.94	4.44
(비교지수 대비 성과)	(1.32)	(2.08)	(2.55)	(4.13)
Cp	0.26	2.00	3.92	4.41
(비교지수 대비 성과)	(1.31)	(2.06)	(2.53)	(4.10)
S	0.41	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(1.46)	-	-	-
S-P	0.43	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(1.47)	-	-	-
비교지수(벤치마크)	-1.05	-0.06	1.39	0.30

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 30% + KIS국고채1~2년 65% + CALL 5.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
트러스톤칭기스칸플러스알파 증권투자신탁[채권혼합]	5.62	11.35	19.83	-
비교지수(벤치마크)	0.30	4.00	9.53	-
(비교지수 대비 성과)	(5.32)	(7.35)	(10.29)	-
종류(Class)별 현황				
A	4.74	9.50	16.92	-
(비교지수 대비 성과)	(4.44)	(5.51)	(7.38)	-
C	4.23	8.42	15.66	-
(비교지수 대비 성과)	(3.92)	(4.42)	(6.13)	-
Ce	4.44	8.87	16.18	-
(비교지수 대비 성과)	(4.13)	(4.87)	(6.65)	-
Cp	4.41	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(4.10)	-	-	-
S	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
S-P	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.30	4.00	9.53	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 30% + KIS국고채1~2년 65% + CALL 5.0%

※ 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	86	60	0	0	1	0	0	0	0	2	0	149
당기	23	68	0	0	3	0	0	0	0	3	0	97

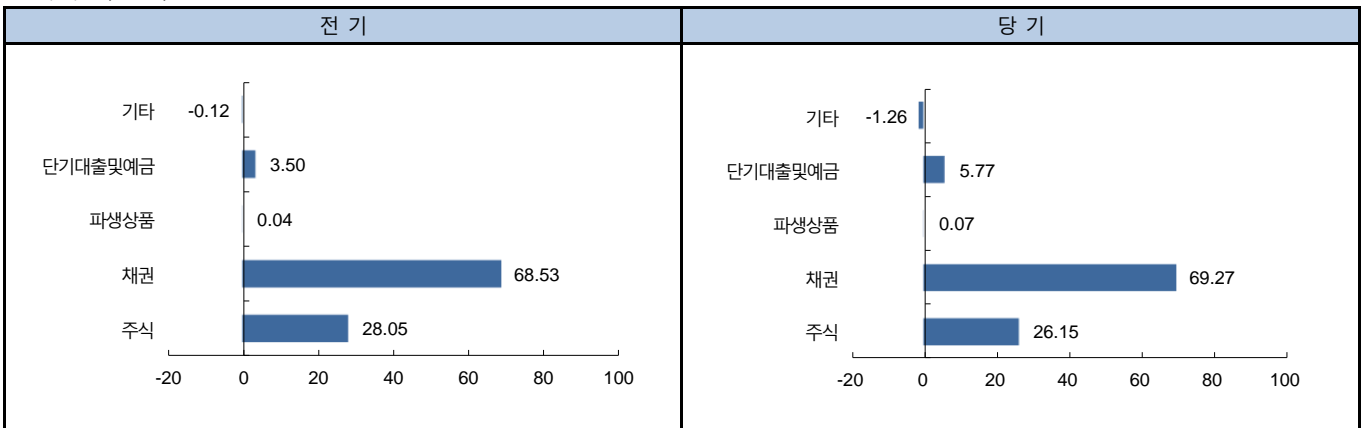
3. 자산현황

■ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	1,689 (26.15)	4,473 (69.27)	0 (0.00)	0 (0.00)	5 (0.07)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	373 (5.77)	-81 (-1.26)	6,458 (100.00)

* () : 구성 비중

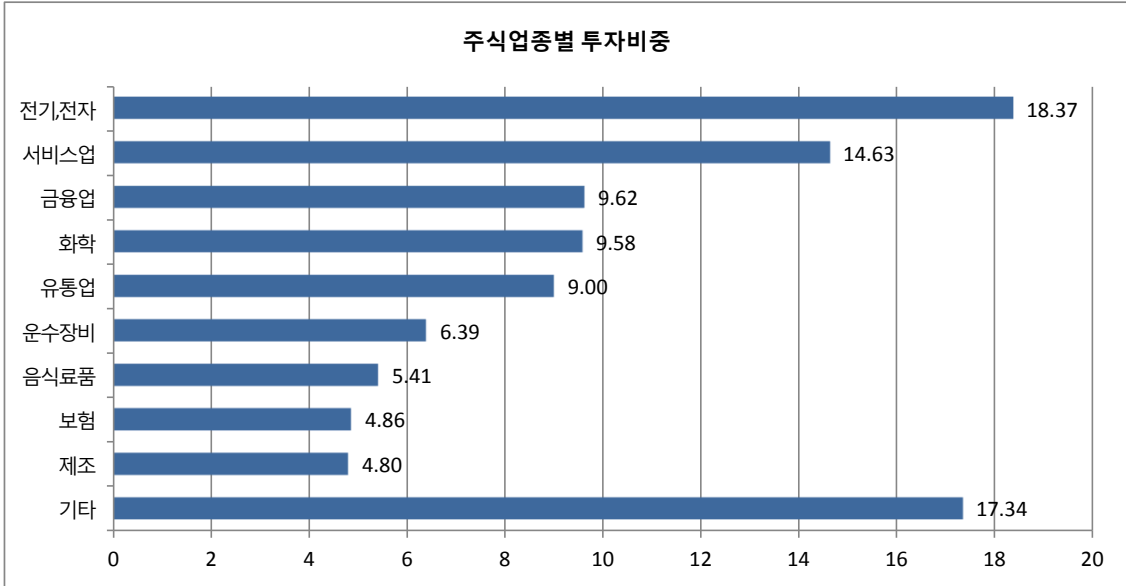


주) 위의 결과는 해당 자펀드의 실제 자산보유 내역을 투자자에게 보여주기 위해, 모펀드의 자산구성 내역을 해당 자펀드가 각 모펀드에서 차지하고 있는 비율을 가중치로 적용하여 안분한 결과입니다. 실제 수익증권 기준으로 작성한 결과와 비교하여 상이한 결과가 발생할 수 있습니다.

주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	18.37	6	운수장비	6.39
2	서비스업	14.63	7	음식료품	5.41
3	금융업	9.62	8	보험	4.86
4	화학	9.58	9	제조	4.80
5	유통업	9.00	10	기타	17.34



투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권 국고02750-1606(13-3)	25.32	6	채권 한국전력764	4.27
2	채권 국고03500-1609(11-5)	12.11	7	채권 현대카드407	3.68
3	채권 통안0222-1610-02	7.08	8	채권 삼성카드2007	3.60
4	채권 국고02750-1512(12-6)	6.58	9	주식 삼성전자	2.35
5	단기상품 콜론(신한은행)	5.67	10	파생상품 3년국채 F 201412	1.90

※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.

각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	140	152	2.35	대한민국	KRW	전기,전자	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고02750-1606(13-3)	1,605	1,635	대한민국	KRW	2013-06-10	2016-06-10		RF	25.32
국고03500-1609(11-5)	760	782	대한민국	KRW	2011-09-10	2016-09-10		RF	12.11
통안0222-1610-02	456	457	대한민국	KRW	2014-10-02	2016-10-02		RF	7.08
국고02750-1512(12-6)	418	425	대한민국	KRW	2012-12-10	2015-12-10		RF	6.58
한국전력764	266	276	대한민국	KRW	2011-10-11	2016-10-11		AAA	4.27
현대카드407	228	238	대한민국	KRW	2011-06-03	2016-06-03		AA+	3.68
삼성카드2007	228	232	대한민국	KRW	2012-09-21	2016-09-21		AA+	3.60

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

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
3년국채 F 201412	매수	1	123	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
단기대출	신한은행	2014-10-17	366	1.96	2014-10-20	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	
정인기	상무	1971년	8	10,954	8	5,200	2109000656
안홍익	부장	1976년	17	15,324	14	12,014	2109001761
문성호	차장	1977년	21	1,980	-	-	2109001217

주) 성명이 굵은 글씨로 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.

▶ 운용전문인력 변경내역

구분	기간	운용전문인력
주식	2012.08.09 - 현재	정인기
주식	2012.08.09 - 2014.08.28	이무영
채권	2011.04.19 - 2014.08.28	여종훈
채권	2014.08.29 - 현재	문성호

(주 1) 2014.10월 기준 최근 3년간의 운용전문인력 변경 내역입니다.

5. 비용현황

■ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구 분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
트러스트칭기스칸플러스알파증권 자투자신탁(채권혼합)	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	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	2	0.02	1	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.02	1	0.01
		합계	3	0.04	2	0.02
	증권거래세	3	0.04	1	0.01	
A	자산운용사	3	0.07	4	0.08	
	판매회사	4	0.12	7	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	8	0.21	11	0.21	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.02	1	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.02	0	0.01
		합계	2	0.04	1	0.02
	증권거래세	1	0.04	1	0.01	
C	자산운용사	3	0.07	3	0.08	
	판매회사	8	0.25	9	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	11	0.33	13	0.34	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.02	1	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.02	0	0.01
		합계	1	0.04	1	0.02
	증권거래세	1	0.03	1	0.02	
Ce	자산운용사	0	0.07	0	0.08	
	판매회사	0	0.20	0	0.20	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.28	0	0.29	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.02	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.01
		합계	0	0.04	0	0.02
	증권거래세	0	0.04	0	0.02	

(단위 : 백만원, %)

	구 분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
Cp	자산운용사	0	0.07	0	0.08	
	판매회사	0	0.21	0	0.21	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.29	0	0.29	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매· 중개 수수료	단순매매·중개수수료	0	0.02	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.01
		합계	0	0.04	0	0.02
	증권거래세	0	0.03	0	0.01	
S	자산운용사	0	0.07	0	0.08	
	판매회사	0	0.06	0	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.14	0	0.15	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매· 중개 수수료	단순매매·중개수수료	0	0.03	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.01
		합계	0	0.05	0	0.02
	증권거래세	0	0.05	0	0.01	
S-P	자산운용사	0	0.07	0	0.08	
	판매회사	0	0.04	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.11	0	0.13	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매· 중개 수수료	단순매매·중개수수료	0	0.03	0	0.01
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.01
		합계	0	0.05	0	0.02
	증권거래세	0	0.06	0	0.02	

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

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

■ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율	합성총보수·비용비율	매매·중개수수료 비율
트러스트칭기스칸플러스알파증권 자투자신탁(채권혼합)	전기	-0.0018	0.0004	0.0041	0.1834
	당기	-0.0003	0.0005	0.0087	0.1471
종류(Class) 별 현황					
A	전기	0.8392	0	0.8456	0.18
	당기	0.8393	0	0.8482	0.1287
C	전기	1.3394	0	1.3426	0.1854
	당기	1.3393	0	1.348	0.161
Ce	전기	1.1359	0	1.142	0.1789
	당기	1.1361	0	1.145	0.1413
Cp	전기	1.1654	0	1.1739	0.1651
	당기	1.1664	0	1.175	0.1238
S	전기	0.5784	0	0.5907	0.1972
	당기	0.5849	0	0.5929	0.0823
S-P	전기	0.4631	0	0.4742	0.2216
	당기	0.5333	0	0.541	0.0832

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 회전을

트러스트증권모투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
321,018	13,659	90,035	7,364	18.62	73.87

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

■ 최근 3분기 매매회전율 추이

트러스트증권모투자신탁(주식)

(단위 : %)

14년01월19일 ~14년04월18일	14년04월19일 ~14년07월18일	14년07월19일 ~14년10월18일
50.92	41.74	18.62

7. 공지사항

* 고객님의 가입하신 펀드는 모자형 구조로써 이 자산운용보고서의 자산구성현황, 보유종목, 보수 및 비용 등의 정보는 고객님의 가입한 트러스트 칭기스칸 플러스알파 증권자투자신탁(채권혼합)가 투자하고 있는 비율에 따라 안분한 결과를 보여주고 있습니다.

* 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률의 적용을 받습니다.

* 이 보고서는 자본시장법에 의해 트러스트칭기스칸플러스알파증권자투자신탁(채권혼합)의 자산운용회사인 트러스트자산운용(주)이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '국민은행'의 확인을 받아 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 트러스트자산운용(주)
금융투자협회

<http://www.trustonasset.com> / 02-6308-0500
<http://dis.fundservice.net>

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.