TRUSTON 트러스톤자산운용

서울시 성동구 뚝섬로1길 10 (성수동1가)
(전화 02-6308-0500, http://www.trustonasset.com)

자산운용보고서

트러스톤 든든한 다이나믹코리아 플러스 목표전환 증권투자신탁 [채권-재간접형]

2021년06월08일 ~ 2021년09월07일

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

펀드 운용경과 및 운용계획

고객 여러분, 안녕하십니까,
저희 트러스톤자산운용을 믿고 소중한 자산을 맡겨주신 고객님께 진심으로 감사의 말씀을 올립니다. 저희 트러스톤자산운용은 급변하는 시장 속에서 시장을 따라가며 단기적인 수익률을 쫓기 보다는 저희의 투자원칙을 지켜나가려고 합니다. 투자에 신뢰를 더하는, 존경받는 자산운용사로서 끊임없이 정진할 것을 약속드리며, 3개월간의 운용성과와 향후 운용계획에 대해 간략히 설명 드리겠습니다.

운용 경과

펀드는 목표 전환 이후 단기채권 ETF들을 편입하여 운용중이며, 지난 3개월 동안 펀드는 +0.07%의 수익률을 기록하였습니다. (운용펀드 기준)

운용 계획

동 펀드는 목표전환 이후 안정적인 캐리 수익 획득을 위해 단기채권 ETF를 편입 보유하고 있습니다. 현재의 포트폴리오 구성을 유지하는 가운데, 자금 흐름에 따라 보유 수량을 조정하여 대응할 계획입니다.

채권&솔루션부문 CIO 손석근
솔루션본부장 신홍섭

CONTENTS

펀드의 개요

수익률 현황

자산 현황

투자운용전문인력 현황

비용 현황

투자자산매매내역

자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

공지사항

[참고] 펀드용어정리

1. 펀드의 개요

■기본정보

적용 법률 : 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		금융투자협회 펀드코드	투자위험등급
트러스톤든든한다이나믹코리아플러스목표전환증권투자신탁[채권-재간접형]		BL818	5등급(낮은 위험)
수수료선취-오프라인(A)		BL824	
펀드의 종류	채권-재간접형, 단위형, 종류형	최초설정일	2017.03.08
운용기간	2021.06.08 ~ 2021.09.07	존속기간	2022.03.08
자산운용회사	트러스톤자산운용(주)	펀드재산보관회사	IBK기업은행
판매회사[주2)]	www.trustonasset.com	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	투자신탁재산의 60% 이상을 국내 증권시장에 상장된 채권관련 상장지수집합투자기구의 집합투자증권에 투자하여 비교지수를 초과하는 투자수익률 달성을 추구합니다. 국내 채권에 투자하는 상장지수집합투자증권 중에서 성과분석 등을 통하여 위험대비 운용성과가 우수하고, 각각의 벤치마크 대비 운용성과가 우수한 채권 관련 상장지수집합투자증권에 투자합니다.		

주2)판매회사 : 자세한 사항은 트러스톤자산운용 홈페이지를 참고하시기 바랍니다.

■재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
트러스톤든든한다이나믹코리아플러스목표전환증권투자신탁[채권-재간접형]	자산 총액 (A)	13	13	-0.04
	부채 총액 (B)	0	0	-72.22
	순자산총액 (C=A-B)	13	13	-0.03
	발행 수익증권 총 수 (D)	12	12	-0.10
	기준가격주) (E=C/D×1000)	1,041.68	1,042.39	0.07
종류(Class)별 기준가격 현황				
수수료선취-오프라인(A)	기준가격	1,041.29	1,041.64	0.03

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

2. 수익률 현황

■기간 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
트러스톤든든한다이나믹코리아플러스목표전환증권투자신탁[채권-재간접형]	0.07	0.17	0.33	0.46
(비교지수 대비 성과)	(-0.07)	(-0.09)	(-0.06)	(-0.05)
종류(Class)별 현황				
수수료선취-오프라인(A)	0.03	0.10	0.22	0.32
(비교지수 대비 성과)	(-0.11)	(-0.16)	(-0.16)	(-0.19)
비교지수(벤치마크)	0.14	0.26	0.39	0.51

주) 비교지수(벤치마크) : CALL X 100%

※ 상기의 수익률은 과거의 운용실적으로 미래의 성과를 보장하는 것은 아니며 당 펀드는 종류형 집합투자증권으로 종류별 보수 · 수수료의 차이로 운용실적이 달라질 수 있습니다.

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
트러스톤든든한다이나믹코리아플러스목표전환증권투자신탁[채권-재간접형]	0.46	4.20	5.75	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.05)	(1.76)	(2.26)	-
종류(Class)별 현황				
수수료선취-오프라인(A)	0.32	3.73	4.64	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.19)	(1.29)	(1.15)	-
비교지수(벤치마크)	0.51	2.44	3.49	-

주) 비교지수(벤치마크) : CALL X 100%

※ 상기의 수익률은 과거의 운용실적으로 미래의 성과를 보장하는 것은 아니며 당 펀드는 종류형 집합투자증권으로 종류별 보수 · 수수료의 차이로 운용실적이 달라질 수 있습니다.

■손익현황

(단위 : 백만원)

구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	0.00	0.00	0.00	0.04	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.01	0.00	0.04
당 기	0.00	0.00	0.00	0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.01

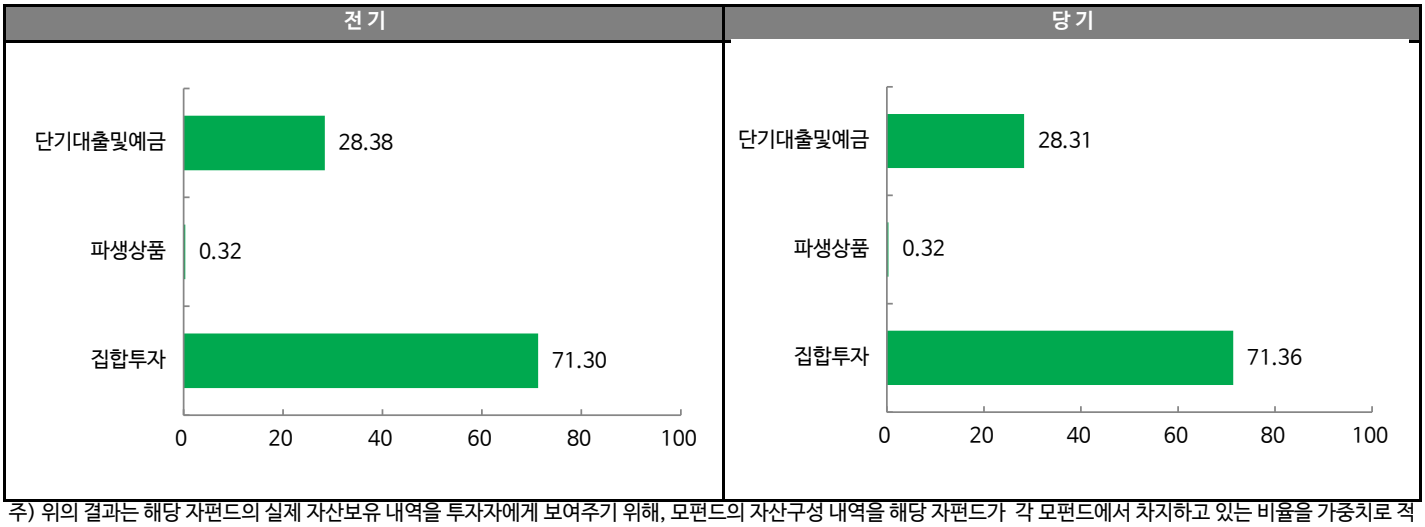
3. 자산현황

■자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구 분	증 권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	0	0	9	0	0	0	0	0	4	0	13
	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(71.36)	(0.32)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(28.31)	(0.00)	(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.

▶투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	집합투자증권	KBSTAR 단기통안채	24.18	6	단기상품	증거금(CLSA증권)	0.32
2	집합투자증권	KODEX 단기채권	23.79				
3	집합투자증권	KOSEF 단기자금	23.40				
4	단기상품	은대(기업은행)	17.14				
5	단기상품	콜론(신한금융투자)	11.18				

※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

▶집합투자증권

(단위 : 계약, 백만원)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KBSTAR 단기통안채	수익증권	KB자산운용	3	3	대한민국	KRW	24.18
KODEX 단기채권	수익증권	삼성자산운용	3	3	대한민국	KRW	23.79
KOSEF 단기자금	수익증권	키움투자자산운용	3	3	대한민국	KRW	23.40

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

▶단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	기업은행	2017-03-08	2	0.46		대한민국	KRW
단기대출	신한금융투자	2021-09-07	1	0.78	2021-09-08	대한민국	KRW
증거금	CLSA증권		0	0.00		대한민국	KRW

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

4. 투자운용인력

■투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	출생년도	운용 중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
신홍섭	**상무**	1974년	10	6,424	1	1,083	2109000900

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 변경 내역

운용자산	구분	기간	운용전문인력
주식	책임운용역	2018.03.23 - 2020.01.29	이무광
	부책임운용역	2017.03.08 - 2018.03.22	이무광
채권	책임운용역	2017.03.08 - 2020.01.08	문성호
		2020.01.09 - 현재	신홍섭

주) 2021년 9월 기준일 현재 3년간 운용전문인력 변경 내역입니다.

5. 비용현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구 분		전기		당기	
			금액	비율	금액	비율
트러스톤든든한다이나믹코리아플러스목표전환증권투자신탁[채권-재간접형]	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.중개수수료	단순매매.중개수수료	0	0.01	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.00
	증권거래세		0	0.00	0	0.00
수수료선취-오프라인(A)	자산운용사		0	0.02	0	0.02
	판매회사		0	0.01	0	0.01
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.00	0	0.00
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		0	0.03	0	0.03
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0	0.01	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.02	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.00
	증권거래세		0	0.00	0	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

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

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
		총보수 · 비용비율	중개수수료 비율	합성총보수. 비용비율	매매 · 중개수수료 비율
트러스톤든든한다이나믹코리아플러스목표전환증권투자신탁[채권-재간접형]	전기	0.0000	0.0238	0.0000	0.0238
	당기	0.0000	0.0296	0.0000	0.0296
종류(Class)별 현황					
수수료선취-오프라인(A)	전기	0.1386	0.0000	0.1386	0.0238
	당기	0.1384	0.0000	0.1384	0.0296

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

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평잔액(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

- 채권-재간접형 집합투자기구로 해당사항 없음

■ 최근 3분기 매매회전율 추이

- 채권-재간접형 집합투자기구로 해당사항 없음

7. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

: 트러스톤자산운용은 동 펀드에 고유재산을 투자하지 않았습니다.

8. 공지사항

---

* 고객님이 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률의 적용을 받습니다.
* 이 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의해 트러스톤든든한다이나믹코리아플러스목표전환증권투자신탁[채권-재간접형]의 자산운용회사인 트러스톤자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 기업은행의 확인을 받아 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다.

각종 보고서 확인 : 트러스톤자산운용(주) http://www.trustonasset.com
금융투자협회 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.
수익증권	자본시장법상 유가증권의 일종으로 자산운용회사가 일반 대중으로부터 자금을 모아 펀드를 만들때 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 대가로 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 금융위원회의 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.