

신한자산운용(주)

우150-712 서울시 영등포구 여의도대로 70, 신한금융투자타워 18층 전화(02)767-5789

문서번호 : 신한자산운용(M1)제 22 - 39 호 2022.11.28
수신 : 신한투자증권, 우리은행, 한국포스증권, 신한은행, 농협은행, 하나은행
미래에셋증권, BNK투자증권
참조 : HSBC 은행, KB증권(신한-국민은행)
제목 : 기준가 재작업의 건

- 귀사의 익일 변창하심을 기원합니다.
- 당사가 운용하는 펀드의 기준가를 아래와 같은 사유로 재처리 요청 드립니다.

- 다 음 -

- 일자: 2022년 11월 28일(영업기준가)
- 대상펀드

펀드코드	펀드명
270850	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중)
270870	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중)
2P1952	KBIZ 멀티에셋 MAN 일반사모(H)[재간접형]

- 사유: 2022.11.25 ETF (KBSTAR 23-11 회사채(AA-이상)액티브)불완전발행시장 설정거래에 대해 부족한 채권에 대한 가치를 계산하는 과정에서 채권 액면당 단가가 아닌 만당 단가를 사용해 계산하여 취득가가 과대하게 계상되고 이에 따른 평가손실이 발생함.
- 재발방지대책: ETF 평가단가 수기입력에 대한 전일 대비 변경을 검증 로직 시스템 구현
- 기준가 변경내역: 첨부파일참조

상기와 같은 사유로 업무에 불편을 끼쳐 드려 죄송합니다.
시스템 및 여러 제반요건을 면밀히 검토하여 동일한 상황이 발생하지 않도록 업무에 만전을 기하겠습니다.

신한자산운용(주)
펀드관리실장 김보근



(첨부)

펀드리스트

펀드명	예탁원 종목코드
TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중)	000000000000
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중A1)	KRZ502511621
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중A-e)	KRZ502511622
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C1)	KRZ502511624
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-e)	KRZ502511625
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-pe)	KRZ502511629
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-r)	KRZ50251162A
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-re)	KRZ50251162C
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-s)	KRZ50251162D
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중S)	KRZ50251162F
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중S-P)	KRZ50251162G
TRF안정형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중S-R)	KRZ50251162H
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중)	000000000000
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중A1)	KRZ502511701
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중A-e)	KRZ502511702
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C1)	KRZ502511704
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-e)	KRZ502511705
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-pe)	KRZ502511709
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-r)	KRZ50251170A
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-re)	KRZ50251170B
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중C-s)	KRZ50251170D
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중S)	KRZ50251170F
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중S-P)	KRZ50251170G
TRF성장형OCIO솔루션[혼합-재간접형](중S-R)	KRZ50251170H

기준가 재산출 내역

처리일자	펀드코드	펀드명	사전기준가	사후기준가	차이
2022-11-25	270850	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중)	965.79	978.06	12.27
2022-11-25	270851	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 A1)	969.42	981.73	12.31
2022-11-25	270852	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 A-e)	969.43	981.75	12.32
2022-11-25	270854	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C1)	968.31	980.61	12.3
2022-11-25	270855	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-e)	969.4	981.72	12.32
2022-11-25	270859	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-pe)	974.57	986.95	12.38
2022-11-25	270861	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-r)	963.44	975.69	12.25
2022-11-25	270863	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-re)	971.5	983.85	12.35
2022-11-25	270864	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-s)	963.81	976.06	12.25
2022-11-25	270866	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 S)	978	991	13
2022-11-25	270867	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 S-P)	961.42	973.65	12.23
2022-11-25	270868	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 S-R)	961.6	973.82	12.22
2022-11-25	270870	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중)	966.51	972.69	6.18
2022-11-25	270871	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 A1)	968	974.19	6.19
2022-11-25	270872	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 A-e)	968	974.19	6.19
2022-11-25	270874	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C1)	966.88	973.07	6.19
2022-11-25	270875	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-e)	966.84	973.03	6.19
2022-11-25	270879	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-pe)	979.11	985.37	6.26
2022-11-25	270881	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-r)	960.17	966.31	6.14
2022-11-25	270882	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](중 C-re)	966.45	972.63	6.18

2022-11-25	270884	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-s)	964.53	970.7	6.17
2022-11-25	270886	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S)	982.49	988.78	6.29
2022-11-25	270887	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-P)	957.68	963.82	6.14
2022-11-25	270888	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-R)	951.89	958.76	6.87
2022-11-26	270850	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종)	965.83	978.1	12.27
2022-11-26	270851	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A1)	969.46	981.77	12.31
2022-11-26	270852	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A-e)	969.46	981.78	12.32
2022-11-26	270854	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C1)	968.34	980.64	12.3
2022-11-26	270855	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-e)	969.45	981.76	12.31
2022-11-26	270859	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-pe)	974.59	986.98	12.39
2022-11-26	270861	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-r)	963.46	975.71	12.25
2022-11-26	270863	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-re)	971.53	983.88	12.35
2022-11-26	270864	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-s)	963.84	976.09	12.25
2022-11-26	270866	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S)	978	991	13
2022-11-26	270867	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-P)	961.48	973.68	12.2
2022-11-26	270868	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-R)	961.63	973.85	12.22
2022-11-26	270870	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종)	966.53	972.71	6.18
2022-11-26	270871	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A1)	968.02	974.21	6.19
2022-11-26	270872	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A-e)	968.01	974.2	6.19
2022-11-26	270874	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C1)	966.89	973.08	6.19
2022-11-26	270875	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-e)	966.85	973.03	6.18
2022-11-26	270879	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-pe)	979.12	985.38	6.26
2022-11-26	270881	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-r)	960.18	966.32	6.14
2022-11-26	270882	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-re)	966.46	972.64	6.18
2022-11-26	270884	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-s)	964.54	970.71	6.17
2022-11-26	270886	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S)	982.51	988.79	6.28
2022-11-26	270887	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-P)	957.71	963.82	6.11
2022-11-26	270888	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-R)	951.89	958.76	6.87
2022-11-27	270850	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종)	965.87	978.14	12.27
2022-11-27	270851	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A1)	969.5	981.81	12.31
2022-11-27	270852	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A-e)	969.51	981.83	12.32
2022-11-27	270854	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C1)	968.37	980.67	12.3
2022-11-27	270855	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-e)	969.49	981.8	12.31
2022-11-27	270859	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-pe)	974.62	987	12.38
2022-11-27	270861	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-r)	963.49	975.73	12.24
2022-11-27	270863	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-re)	971.56	983.9	12.34
2022-11-27	270864	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-s)	963.87	976.12	12.25
2022-11-27	270866	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S)	978	991	13
2022-11-27	270867	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-P)	961.51	973.74	12.23
2022-11-27	270868	TRF 안정형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-R)	961.66	973.88	12.22
2022-11-27	270870	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종)	966.55	972.73	6.18
2022-11-27	270871	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A1)	968.04	974.23	6.19
2022-11-27	270872	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 A-e)	968.04	974.22	6.18
2022-11-27	270874	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C1)	966.9	973.09	6.19
2022-11-27	270875	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-e)	966.85	973.04	6.19
2022-11-27	270879	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-pe)	979.12	985.38	6.26
2022-11-27	270881	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-r)	960.19	966.33	6.14
2022-11-27	270882	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-re)	966.46	972.64	6.18
2022-11-27	270884	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 C-s)	964.55	970.72	6.17
2022-11-27	270886	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S)	982.52	988.8	6.28
2022-11-27	270887	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-P)	957.74	963.85	6.11
2022-11-27	270888	TRF 성장형 OCIO 솔루션[혼합-재간접형](종 S-R)	951.89	958.76	6.87