



문서번호 : TRUSTON펀드회계2020-968

2020년 12월 2일

수신 : 참조

발신 : 트러스트자산운용(주)

제목 : 기준가 정정 통보의 건

1. 귀사의 무궁한 발전을 기원합니다.
2. 운용일 기준 2020년 11월 30일, 당사 운용중인 T01500 트러스트다이나믹아시아증권모투자신탁[주식혼합-파생형] 에서 새로 편입한 CFD 종목에 환율이 잘못 반영되어 자산의 단가 및 평가손익이 잘못 산출 되었습니다. 이에 기준가가 과소 계상되었음을 알려드리며 해당 펀드 및 기준가 정정 내역은 첨부해드립니다.
3. 기준가격 오류일인 2020년 12월 1일에 설정/해지 확정 분은 없었으며, 이에 수익자와 관련된 이해관계에 영향 없음을 확인하였습니다.
4. 영업일 2020년 12 월 1일 기준가부터 정상적으로 계산되어 공지가 되었으며, 해당 기간 오류내역은 2020년 12월 1일 예탁원을 통하여 정정하였습니다.

- 아 래 -

(1) 기 간 : 2020년 12월 1일 (영업일기준)

(2) 펀 드 명

협회 종목 코드	펀드명
KR5363AR4921	트러스트다이나믹아시아(모)[주식혼합-파생형]
KR5363AR4954	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]A
KR5363AR4970	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]Ae
KR5363AR4996	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]C2
KR5363AR5001	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]C3
KR5363AR5019	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]C4
KR5363AR5027	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]Ce
K55363BI9498	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]Cp
KR5363AR5068	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]S
K55363BI9514	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]S-P
K55363BI9522	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]Cp2
K55363BI9506	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]Cp-E
K55363BU1192	트러스트다이나믹아시아(자)[주식혼합-파생형]Cp2-E



트러스톤자산운용

04779 서울시 성동구 뚝섬로1길 10
T 02 6308 0500 F 02 6308 0688
www.trustonasset.com

(3) 기준가 변경 내용 : 첨부파일 참조

- 첨부 : 1. 기준가 변경내역
2. NH투자증권 사유서

수신처 참조: KB증권, 하나은행, 한국포스증권, 현대차투자증권, 미래에셋생명, 삼성생명보험,
신한은행 끝.

트러스톤자산운용(주)
대표이사 황성택·김영호



운용일	영업일	펀드코드	예탁원 종목코드	펀드명	변경전 기준가	변경후 기준가	차이	과표기준가 변경 전	과표기준가 변경 후	차이
2020-11-30	2020-12-01	T01500	KRZ502106270	트러스트다이내믹아시아증권모투자신탁[주식혼합-파생형]	1,043.74	1,066.75	23.01	1,036.18	1,059.19	23.01
2020-11-30	2020-12-01	T01600	KRZ502106281	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형](운용)	1,043.32	1,065.95	22.63	1,035.62	1,058.26	22.64
2020-11-30	2020-12-01	T016A0	KRZ502106281	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]A클래스	986.63	1,008.10	21.47	979.20	1,000.66	21.46
2020-11-30	2020-12-01	T016AE	KRZ502106282	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]Ae클래스	1,000.37	1,022.12	21.75	992.90	1,014.65	21.75
2020-11-30	2020-12-01	T016C2	KRZ502106284	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]C2클래스	1,022.43	1,044.69	22.26	1,010.90	1,033.17	22.27
2020-11-30	2020-12-01	T016C3	KRZ502106285	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]C3클래스	944.29	964.84	20.55	935.88	956.43	20.55
2020-11-30	2020-12-01	T016C4	KRZ502106286	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]C4클래스	967.40	988.44	21.04	979.37	1,000.41	21.04
2020-11-30	2020-12-01	T016CE	KRZ502106287	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]Ce클래스	994.51	1,016.13	21.62	987.02	1,008.64	21.62
2020-11-30	2020-12-01	T016CP	KRZ50210628B	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]Cp클래스	986.40	1,007.86	21.46	978.82	1,000.28	21.46
2020-11-30	2020-12-01	T016S0	KRZ50210628A	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]S클래스	1,005.32	1,027.17	21.85	996.87	1,018.73	21.86
2020-11-30	2020-12-01	T016SP	KRZ50210628D	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]S-P클래스	1,003.15	1,024.95	21.80	995.61	1,017.42	21.81
2020-11-30	2020-12-01	T216CP	KRZ50210628E	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]Cp2클래스	957.80	978.63	20.83	965.32	986.15	20.83
2020-11-30	2020-12-01	TE16CP	KRZ50210628C	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]Cp-E클래스	1,000.03	1,021.78	21.75	992.54	1,014.28	21.74
2020-11-30	2020-12-01	TE16P2	KRZ50210628G	트러스트다이내믹아시아증권자투자신탁[주식혼합-파생형]Cp2-E클래스	969.38	990.47	21.09	977.72	998.80	21.08

수신: 트러스톤 자산운용

1. 귀사의 무궁한 발전을 기원합니다.
2. 2020년 11월 30일자 스왑 거래와 관련하여 스왑 평가손실이 과대 산정되어 아래와 같이 수정하고자 하오니 업무에 협조해 주시기 바랍니다.

- 아 래 -

1. 펀드명 : 트러스톤 다이نام믹 아시아증권 모 투자신탁[주식혼합-파생형]
2. 스왑 기준가격(표시)및 평가손익(표시) 변경:

변경 전

거래번호	기초자산 (코드)	방향	기초통화	표시통화	기준가격 (표시)	평가가격 (표시)	잔고수량	평가손익 (표시)
TDLSF0203147	7453 JP EQUITY	S	JPY	KRW	3,673.6557	23,916.0456	5,700	-115,381,622

변경 후

거래번호	기초자산 (코드)	방향	기초통화	표시통화	기준가격 (표시)	평가가격 (표시)	잔고수량	평가손익 (표시)
TDLSF0203147	7453 JP EQUITY	S	JPY	KRW	24,072.4996	23,916.0456	5,700	891,788

※평가손익 변동분((변경전)-(변경후)): 116,273,410원

3. 스왑보고서 재발송일: 2020년 12월 1일
4. 사유 및 조치사항: 스왑 신규거래 입력과 관련하여 7453 JP 종목의 적용환율 오기로 스왑 평가손실이 과대 산정된 사안으로 현재 수정조치 하였고, 재발방지를 위한 내부 체크로직을 반영 하였습니다. 향후에는 이러한 일이 발생하지 않도록 내부확인절차를 더욱 강화하도록 하겠습니다.

NH투자증권주식회사

Prime Brokerage부

