

## 파인만 인덱스프리미엄증권 자투자신탁 2 호(주식-파생형)

효력발생일: 2023 년 10 월 27 일

### 일괄신고서/투자설명서 변경

기재 정정 사유:

1. 기업공시서식 및 개정사항 반영
2. 모펀드 한도 변경

항목	정정요구·명령 관련 요구	변경사유	변경 전	변경 후
제 2 부. 집합투자기구에 관한 사항				
2. 집합투자기구의 연혁	아니오	정보 업데이트	-	- 개정사항 반영 및 모펀드 투자한도 변경 <b>&lt;업데이트&gt;</b>
6. 집합투자기구의 구조 나. 모자형 구조	아니오	투자한도 변경	모투자신탁수익증권 <u>100%</u> <u>이하</u>	모투자신탁수익증권 <b>60% 이상</b>
8. 집합투자기구의 투자대상 가. 투자대상  [이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 투자대상]	아니오	투자한도 변경 개정사항 반영	① 모투자신탁수익증권 <u>100% 이하</u> ② 단기대출(법 시행령 제 83 조제 3 항의 금융기관에 대한 30 일 이내의 금전의 대여를 말한다) ② 채 권 법 제 4 조제 3 항의 규정에 의한 국채증권, 지방채증권, 특수채증권(법률에 의하여 직접 설립된 법인이 발행한 채권을 말한다), 사채권(취득시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, 사모사채 및 자산유동화에 관한 법률에	① 모투자신탁수익증권 <b>60% 이상</b> ② 단기대출(법 시행령 제 83 조제 4 항의 금융기관에 대한 30 일 이내의 금전의 대여를 말한다) ② 채 권 법 제 4 조제 3 항의 규정에 의한 국채증권, 지방채증권, 특수채증권(법률에 의하여 직접 설립된 법인이 발행한 채권을 말한다), 사채권(취득시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, 사모사채 및 자산유동화에 관한 법률에 의한

항목	정정요구·명령 관련 요구	변경사유	변경 전	변경 후
			<p>의한 자산유동화계획에 따라 발행하는 사채 및 주택저당채권유동화회사법 또는 <u>한국주택금융공사법</u>에 따라 발행되는 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권은 제외한다) (이하 “채권”이라 한다)</p> <p>④ 자산유동화증권</p> <p>자산유동화에 관한 법률에 의한 자산유동화계획에 따라 발행되는 사채, 주택저당채권유동화회사법 또는 <u>한국주택금융공사법</u>에 따라 발행되는 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권 (이하 “자산유동화증권”이라 한다</p> <p>⑥ 집합투자증권 등 <u>5%</u> 이하 &lt;주석 추가&gt;</p>	<p>자산유동화계획에 따라 발행하는 사채 및 <u>한국주택금융공사법</u>에 따라 발행되는 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권은 제외한다) (이하 “채권”이라 한다)</p> <p>④ 자산유동화증권</p> <p>자산유동화에 관한 법률에 의한 자산유동화계획에 따라 발행되는 사채, 또는 <u>한국주택금융공사법</u>에 따라 발행되는 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권(이하 “자산유동화증권”이라 한다</p> <p>⑥ 집합투자증권 등 <u>40%</u> 이하 <u>주 1) 집합투자기구의 이익 증대 등 다음과 각 목과 같은 목적을 위해 증권 대여를 진행할 수 있음</u> <u>가. 수익률 증진: 부수적인 운용전략으로 대차거래를 통해 수수료를 수취할 수 있으며, 안정적 대차거래 관리와 장기적 관점의 대차 수수료 수익을 추구</u> <u>나. 기타 효율적, 안정적 운용</u> <u>주 2) 효율적 운용, 보유 자산의 시장위험 헤지, 환매 대응, 유동성 확대, 담보제공 등의 목적을 위해 증권 차입을 진행할 수 있음</u></p>
9. 집합투자기구의 투자전략 및 수익구조 나. 수익구조	아니오	투자한도 변경	모투자신탁수익증권 <u>100%</u> 이하	모투자신탁수익증권 <u>60% 이상</u>

항목	정정요구·명령 관련 요구	변경사유	변경 전	변경 후
- 모자형 구조				
10. 집합투자기구의 투자위험 다. 기타 투자위험	아니오	기업공시서식 개정사항 반영	<위험 추가>	- 증권대차거래 위험 <u>증권대차거래가 일어나는 펀드의 경우 예탁결제원 등 시장참여자들의 관리로 발생할 가능성은 극히 낮으나 해당 대차증권의 미상환, 관련 담보의 부족 등의 위험이 발생할 수 있습니다.</u>
제 3 부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항				
1. 재무정보 가. 요약재무정보	아니오	기업공시서식 개정사항 반영	<주석 추가>	<p>주 1) 매매회전율이란 <u>주식매매의 빈번한 정도를 나타내는 지표로서 해당 운용기간동안 매도한 주식가액을 같은 기간동안 평균적으로 보유한 주식가액으로 나누어 산출합니다. 1 회계년도동안의 평균적인 주식투자규모가 100 억원이고, 주식매도금액 또한 100 억원인 경우 매매회전율은 100%(연기준)로 합니다.</u></p> <p>주 2) 기타수익에는 증권대여에 따른 수수료 수익 등이 포함(16 기 0 백만원 15 기 0 백만원 14 기 0 백만원 발생)</p> <p>3) 기타비용에는 증권차입에 따른 수수료 수익 등이 포함(16 기 0 백만원, 15 기 0 백만원, 14 기 0 백만원 발생)</p> <p>&lt;항목 추가&gt;</p> <p>&lt;운용과정에서 발생하는 거래비용&gt;, &lt;주식의 매매회전율&gt;</p>
제 4 부. 집합투자기구 관련회사에 관한 사항				

항목	정정요구·명령 관련 요구	변경사유	변경 전	변경 후
4. 일반사무관리회사에 관한 사항 가. 회사의 개요	아니오	사명 변경	- 신한아이타스(주)	- <u>신한펀드파트너스(주)</u>

**간이투자설명서 변경**

1. 기재 정정 사유

항목	정정요구·명령 관련 요구	변경사유	변경 전	변경 후
간이투자설명서 전반		정보 업데이트	-	업데이트