

변경대비표

[투자설명서]

1. 집합투자기구 명칭 : **NH-Amundi 1.5 배 레버리지 인덱스 증권투자신탁[주식-파생형]**
2. 효력발생일 : 2021 년 5 월 21 일
3. 주요정정사유:
 - 비교지수 변경(KOSPI 200 Daily Return 1.5 배 Index→코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수)
 - 기업공시서식 작성기준 개정사항(2021.05.07)반영내역 수정(요약정보상 고난도금융투자상품 적용일 추가 기재)

4. 정정내역

구분	변경전	변경후
[요약정보]	이 투자신탁은 파생상품의 매매에 따른 위험평가액이 투자신탁 자산총액의 20%를 초과하여 투자할 수 있으며, 이로 인한 손실이 발생할 수 있습니다.	이 투자신탁은 파생상품의 매매에 따른 위험평가액이 투자신탁 자산총액의 20%를 초과하여 투자할 수 있으며, 이로 인한 손실이 발생할 수 있습니다. (<u>고난도금융투자상품은 2021 년 5 월 10 일부터 적용됩니다</u>)
[요약정보] 투자목적 및 투자전략	이 투자신탁은 증권시장에 대한 위험선호도가 높은 투자자를 위한 상품으로서 주식 및 주식관련장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 증권시장의 상승에 따른 자본이익의 극대화 및 시장상승 대비 초과수익 획득의 추구를 투자목적으로 하며 특히 다음과 같은 투자목적으로 운용됩니다. 주식관련장내파생상품을 이용하여 레버리지(Leverage; 지렛대)효과를 일으켜 증권시장에 대한 위험노출수준을 투자신탁 순자산총액의 1.5 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 1.5 배의 수익률 추종합니다.	이 투자신탁은 증권시장에 대한 위험선호도가 높은 투자자를 위한 상품으로서 주식 및 주식관련장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 증권시장의 상승에 따른 자본이익의 극대화 및 시장상승 대비 초과수익 획득의 추구를 투자목적으로 하며 특히 다음과 같은 투자목적으로 운용됩니다. 주식관련장내파생상품을 이용하여 레버리지(Leverage; 지렛대)효과를 일으켜 증권시장에 대한 위험노출수준을 투자신탁 순자산총액의 1.5 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 1.5 배의 <u>수준의 수익률에 연동하는 코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수</u> 를 추종합니다.
[요약정보] 투자실적추이 (연평균 수익률)	(주 1) 비교지수: KOSPI 200 의 일간수익률 1.5X (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음)	(주 1) 비교지수: <u>코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수</u> (2021.05.21 이전): KOSPI 200 Daily

(단위, %)		<p>Return 1.5 배 Index (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음)</p> <p>(주 2) <u>비교지수 변경사유: 이 투자신탁의 비교지수 변경은 거래소시장에 공정하게 형성된 지수의 사용, 투자자가 신뢰가능한 가격으로 매일 발표되는 투명한 지수의 사용 및 공신력있는 한국거래소에서 산출되는 객관적이고 공정한 지수의 사용을 위함입니다.</u></p>
제 2 부. 7. 집합투자기구의 투자목적	<p>이 투자신탁은 증권시장에 대한 위험선호도가 높은 투자자를 위한 상품으로서 주식 및 주식관련장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 증권시장의 상승에 따른 자본이익의 극대화 및 시장상승 대비 초과수익 획득의 추구를 투자목적으로 하며 특히 다음과 같은 투자목적으로 운용됩니다.</p> <p>○ 주식관련장내파생상품을 이용하여 레버리지(Leverage; 지렛대)효과를 일으켜 증권시장에 대한 위험노출수준을 투자신탁 순자산총액의 1.5 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 1.5 배의 수익률 추종</p>	<p>이 투자신탁은 증권시장에 대한 위험선호도가 높은 투자자를 위한 상품으로서 주식 및 주식관련장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 증권시장의 상승에 따른 자본이익의 극대화 및 시장상승 대비 초과수익 획득의 추구를 투자목적으로 하며 특히 다음과 같은 투자목적으로 운용됩니다.</p> <p>○ 주식관련장내파생상품을 이용하여 레버리지(Leverage; 지렛대)효과를 일으켜 증권시장에 대한 위험노출수준을 투자신탁 순자산총액의 1.5배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200지수의 일일등락률의 1.5배 <u>수준의 수익률에 연동하는 코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수를 추종</u></p>
제2부. 9. 가. (1) 주식 및 주식관련장내파생 상품 투자전략	<p>- 주식과 주식관련장내파생상품을 이용하여 KOSPI200 지수의 일일등락률의 1.5 배 수준의 수익을 추구하는 것을 전략의 기본으로 합니다.</p> <p>(중략)</p> <p>※ 이 투자신탁은 KOSPI 200 지수 일일등락률의 1.5 배 수준의 성과를 추구하는 것을 투자전략의 기본으로 하지만 증권시장상황, KOSPI 200 주가지수선물 및 현물 지수와 가격차이 등의 다양한 요인에 의하여</p>	<p>- 주식과 주식관련장내파생상품을 이용하여 KOSPI200지수의 일일등락률의 1.5배 수준의 <u>수익률에 연동하는 코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수를 추종하는 것을</u> 전략의 기본으로 합니다.</p> <p>(현행과 같음)</p> <p>※ 이 투자신탁은 KOSPI 200 지수 일일등락률의 1.5배 수준의 <u>수익률에 연동하는 코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수를 추종하는</u> 투자전략의 기본으로 하지만 증권시장상황, KOSPI 200주가지수선물 및 현물 지수와</p>

	일일등락률의 1.5 배 수준을 초과하거나 미달할 수도 있습니다. 즉, 상기의 투자전략이 반드시 KOSPI 200 지수 일일등락률의 1.5 배의 성과를 보장하지는 않습니다.	가격차이 등의 다양한 요인에 의하여 일일등락률의 1.5배 수준을 초과하거나 미달할 수도 있습니다. 즉, 상기의 투자전략이 반드시 KOSPI 200 지수 일일등락률의 1.5배의 성과를 보장하지는 않습니다.
제2부. 9. 가.(2) 위험관리	<ul style="list-style-type: none"> - 비교지수(벤치마크)와의 추적오차를 통제하는 Risk 관리 방법: <ul style="list-style-type: none"> • KOSPI200지수 일일등락률의1.5배 수준의 수익률을 추구하기 위해 주식현물 Basket 과 장내 파생상품(KOSPI 200지수선물 등)을 사용하며, KOSPI200지수 선물가격과 KOSPI200지수의 가격차이로 인한 추적오차가 발생할 수 있습니다. 	<ul style="list-style-type: none"> - 비교지수(벤치마크)와의 추적오차를 통제하는 Risk 관리 방법: <ul style="list-style-type: none"> • KOSPI200지수 일일등락률의1.5배 수준의 수익률에 연동하는 코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수를 추종하기 위해 주식현물 Basket 과 장내 파생상품(KOSPI 200지수선물 등)을 사용하며, KOSPI200지수 선물가격과 KOSPI200지수의 가격차이로 인한 추적오차가 발생할 수 있습니다.
제2부. 9.가. (3) 투자신탁의 비교지수(벤치마크)	<ul style="list-style-type: none"> - KOSPI 200 Daily Return 1.5 Index KOSPI 200 Daily Return 1.5 Index 산출식: 당일 벤치마크 지수 = 전일 벤치마크 지수 x [1+{당일 KOSPI200 지수 등락률 x 1.5-CD 금리(3 월물)/365 x 50%}] - 상기의 비교지수(벤치마크)는 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 1.5배 수준의 수익률을 추종하는 이 투자신탁의 속성과 주식관련장내파생상품 투자에 따르는 비용을 감안하였습니다. 	<ul style="list-style-type: none"> - 코스피 200 현선물 레버리지1.5X 지수) - 상기의 비교지수(벤치마크)는 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 1.5배 수준의 수익률에 연동하는 코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수를 추종하는 이 투자신탁의 속성과 주식관련장내파생상품 투자에 따르는 비용을 감안하였습니다. • <u>지수산출기관: 한국거래소(KRX)</u> • <u>지수개요: 코스피 200 현선물 레버리지1.5X 지수는 코스피 200 (현물)지수 움직임의 100%, 코스피 200 선물지수 움직임의 50%의 합에 연동하는 지수로서 아래의 산출방법에 따라 산출합니다.</u> • <u>산출방법: 코스피 200 현선물 레버리지1.5X 지수는 다음의 산식에 따라 산출하며, 소수점 셋째자리에서 반올림하여 소수점 둘째자리로 표시합니다.</u> $IDX_t = IDX_{t-1} \times \left[1 + \left(\frac{S_t}{S_{t-1}} - 1 \right) + 0.5 \times \left(\frac{F_t}{F_{t-1}} - 1 \right) \right]$ <p>상기 산식에서 사용된 변수는 다음의 정의를 따릅니다.</p> <p>1. t : 지수산출시점, $t - 1$: 직전</p>

		<p>거래일</p> <p>2. IDX_t : 지수산출시점의 코스피 200 현선물 레버리지1.5X지수</p> <p>3. IDX_{t-1} : 직전거래일의 코스피 200 현선물 레버리지1.5X지수 증가</p> <p>4. S_t : 지수산출시점의 코스피 200 지수</p> <p>5. S_{t-1} : 직전거래일의 코스피 200 지수 증가</p> <p>6. F_t : 지수산출시점의 코스피 200 선물지수</p> <p>7. F_{t-1} : 직전거래일의 코스피 200 선물지수 증가</p> <p>※지수관련정보는 http://data.krx.co.kr/contents/MDC/MDI/mdiLoader/index.cmd?menuId=MDC0201 에서 확인 가능합니다.</p> <p>※변경 전 비교지수 및 비교지수 변경사유 - 변경 전 비교지수(2021년 5월 21일 이전): KOSPI 200 Daily Return 1.5 Index KOSPI 200 Daily Return 1.5 Index 산출식: 당일 벤치마크 지수 = 전일 벤치마크 지수 x [1 + {당일 KOSPI200지수 등락률 x 1.5-CD금리(3월물)/365 x 50%}]</p> <p>- 비교지수 변경사유</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 거래소시장에 공정하게 형성된 지수의 적용 2. 신뢰가능한 가격으로 매일 발표되는 투명한 지수의 적용 3. 공신력있는 한국거래소에서 산출되는 객관적인 지수의 적용
--	--	---

변경대비표

[간이투자설명서]

1. 집합투자기구 명칭 : **NH-Amundi 1.5 배 레버리지 인덱스 증권투자신탁(주식-파생형)**
2. 효력발생일 : 2021 년 5 월 21 일
3. 주요정정사유: 비교지수 변경(KOSPI 200 Daily Return 1.5 배 Index→코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수)
4. 정정내역

구분	변경전	변경후
[요약정보] 투자목적 및 투자전략	이 투자신탁은 증권시장에 대한 위험선호도가 높은 투자자를 위한 상품으로서 주식 및 주식관련장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 증권시장의 상승에 따른 자본이익의 극대화 및 시장상승 대비 초과수익 획득의 추구를 투자목적으로 하며 특히 다음과 같은 투자목적으로 운용됩니다. 주식관련장내파생상품을 이용하여 레버리지(Leverage; 지렛대)효과를 일으켜 증권시장에 대한 위험노출수준을 투자신탁 순자산총액의 1.5 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 1.5 배의 수익률 추종합니다.	이 투자신탁은 증권시장에 대한 위험선호도가 높은 투자자를 위한 상품으로서 주식 및 주식관련장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 증권시장의 상승에 따른 자본이익의 극대화 및 시장상승 대비 초과수익 획득의 추구를 투자목적으로 하며 특히 다음과 같은 투자목적으로 운용됩니다. 주식관련장내파생상품을 이용하여 레버리지(Leverage; 지렛대)효과를 일으켜 증권시장에 대한 위험노출수준을 투자신탁 순자산총액의 1.5 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 1.5 배의 <u>수준의 수익률에</u> <u>연동하는 코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수를</u> 추종합니다.
[요약정보] 투자실적추이 (연평균 수익률) (단위, %)	(주 1) 비교지수: KOSPI 200 의 일간수익률 1.5X (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음)	(주 1) 비교지수: <u>코스피 200 현선물 레버리지 1.5X 지수</u> (2021.05.21 이전): KOSPI 200 Daily Return 1.5 배 Index (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음) (주 2) <u>비교지수 변경사유: 이 투자신탁의 비교지수 변경은 거래소시장에 공정하게 형성된 지수의 사용, 투자자가 신뢰가능한 가격으로 매일 발표되는 투명한 지수의 사용 및 공신력있는 한국거래소에서 산출되는</u>

		<u>객관적이고 공정한 지수의 사용을 위함입니다.</u>
--	--	-------------------------------------