

변경대비표

[투자설명서]

1. 집합투자기구 명칭 : **NH-Amundi 코리아 2 배 레버리지 증권투자신탁[주식-파생형]**
2. 효력발생일 : 2021 년 5 월 21 일
3. 주요정정사유: 비교지수 변경(KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index → 코스피 200 레버리지 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 2 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2 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 2 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2 배 수준의 <u>수익률에 연동하는 코스피 200 레버리지 지수를 추종합니다.</u>
[요약정보] 투자실적추이 (연평균 수익률) (단위, %)	(주 1) 비교지수: KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음) <신설>	(주 1) 비교지수 : <u>코스피 200 레버리지 지수</u> (2021.05.21 이전): KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음) (주 2) 비교지수 변경사유: 이 투자신탁의 <u>비교지수 변경은 거래소시장에 공정하게 형성된 지수의 사용, 투자자가 신뢰가능한 가격으로 매일 발표되는 투명한 지수의 사용 및 공신력있는 한국거래소에서 산출되는 객관적이고 공정한 지수의 사용을</u>

		<u>위험입니다.</u>
제2부. 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 2 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2 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 2 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2 배 <u>수준의 수익률에 연동하는 코스피 200 레버리지</u> 지수를 추종</p>
제2부. 9. 가. (1) 주식 및 주식관련장내파생상품 투자전략	<p>◆ 기본투자전략</p> <p>- 주식과 주식관련장내파생상품을 이용하여 KOSPI200 지수의 일일등락률의 2 배 수준의 수익을 추구하는 것을 전략의 기본으로 합니다.</p> <p>(중략)</p> <p>※ 이 투자신탁은 KOSPI 200 지수 일일등락률의 2 배 수준의 성과를 추구하는 것을 투자전략의 기본으로 하지만 증권시장상황, KOSPI 200 주가지수선물 및 현물 지수와의 가격차이 등의 다양한 요인에 의하여 일일등락률의 2 배 수준을 초과하거나 미달할 수도 있습니다. 즉, 상기의 투자전략이 반드시 KOSPI 200 지수 일일등락률의 2 배의 성과를 보장하지는 않습니다.</p>	<p>◆ 기본투자전략</p> <p>- 주식과 주식관련장내파생상품을 이용하여 KOSPI200지수의 일일등락률의 2배 <u>수준의 수익률에 연동하는 코스피 200 레버리지 지수를 추종하는</u> 것을 전략의 기본으로 합니다.</p> <p>(현행과 같음)</p> <p>※ 이 투자신탁은 KOSPI 200 지수 일일등락률의 2배 수준의 <u>수익률에 연동하는 코스피 200 레버리지 지수를 추종하는</u> 것을 투자전략의 기본으로 <u>하지만</u>, 증권시장상황, KOSPI 200주가지수선물 및 현물 지수와의 가격차이 등의 다양한 요인에 의하여 일일등락률의 2배 수준을 초과하거나 미달할 수도 있습니다. 즉, 상기의 투자전략이 반드시 KOSPI 200 지수 일일등락률의 2배의 성과를 보장하지는 않습니다.</p>
제2부. 9. 가.(2) 위험관리	<p>- 비교지수(벤치마크)와의 추적오차를 통제하는 Risk 관리 방법:</p> <p>• KOSPI200 지수 일일등락률의 2 배</p>	<p>- 비교지수(벤치마크)와의 추적오차를 통제하는 Risk 관리 방법:</p> <p>• KOSPI200 지수 일일등락률의 2 배</p>

	<p>수준의 수익률을 추구하기 위해 주식현물 Basket 과 장내 파생상품 (KOSPI 200 지수선물 등)을 사용하며, KOSPI200 지수 선물가격과 KOSPI200 지수의 가격차이로 인한 추적오차가 발생할 수 있습니다.</p> <p>(이하생략)</p>	<p>수준의 수익률에 <u>연동하는 코스피 200 레버리지 지수를 추종하기</u> 위해 주식현물 Basket 과 장내 파생상품 (KOSPI 200 지수선물 등)을 사용하며, KOSPI200 지수 선물가격과 KOSPI200 지수의 가격차이로 인한 추적오차가 발생할 수 있습니다.</p> <p>(현행과 같음)</p>
제2부. 9.가. (3) 투자신탁의 비교지수(벤치마크)	<p>- KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index</p> <p>상기의 비교지수(벤치마크)는 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2 배 수준의 수익률을 추종하는 이 투자신탁의 속성과 주식관련장내파생상품 투자에 따르는 비용을 감안하였습니다.</p> <p>KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index 산출식:</p> <p>당일 벤치마크 지수 = 전일 벤치마크 지수 x [1+{당일 KOSPI200 지수 등락률 x 2-CD 금리(3 월물)/365}]</p>	<p>- <u>코스피 200 레버리지 지수</u></p> <p>상기의 비교지수(벤치마크)는 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2배 수준의 수익률에 <u>연동하는 코스피 200레버리지 지수를 추종하는</u> 이 투자신탁의 속성과 주식관련장내파생상품 투자에 따르는 비용을 감안하였습니다.</p> <ul style="list-style-type: none"> · <u>지수산출기관: 한국거래소(KRX)</u> · <u>지수개요: 코스피 200 레버리지지수(KOSPI 200 Leverage)는 코스피 200 지수의 2 배 수익률에 연동하는 지수로서 2010 년 2 월 22 일부터 한국거래소에서 산출·발표하고 있습니다.</u> · <u>기준일 및 기준지수: 2010.02.19, 208.70</u> · <u>산출방법: 코스피 200 레버리지 지수는 다음의 산식에 따라 산출하며, 소수점 셋째자리에서 반올림하여 소수점 둘째자리로 표시합니다.</u> $L_t = L_{t-1} \times \left[1 + \left\{ K \times \left(\frac{S_t}{S_{t-1}} - 1 \right) - (K-1) \times \frac{r}{365} \times D_{t,t-1} \right\} \right]$ <p>1. <u>t : 지수산출시점, t - 1 : 직전 거래일</u></p> <p>2. <u>L t : 지수산출시점의 코스피 200 레버리지지수</u></p> <p><u>L t - 1 : 직전 거래일의 코스피 200 레버리지지수의 종가지수</u> 다만, 기준시점의 코스피 200 레버리지지수의 종가지수(L t)는 <u>코스피 200 지수의 종가지수(F t)</u>로 하며, 기준시점은 2010년</p>

		<p>2월 19일로 함</p> <p>3. K_t : 2 (코스피 200 지수의 변화에 연동하는 배율)</p> <p>4. S_t : 지수산출시점의 코스피 200 지수</p> <p>S_{t-1} : 직전 거래일의 코스피 200 종가지수</p> <p>5. r_t : 금리. 여기서, "금리"란 한국금융투자협회가 산출하는 만기가 91일인 양도성예금증서의 전일 오전의 연 수익률(오전에 산출된 수익률이 없는 경우에는 전일의 최종 연 수익률)을 말함</p> <p>6. $D_{t,t-1}$: 직전 거래일($t-1$)부터 지수산출시점 전일(휴장일 포함)까지의 일수</p> <p>※지수관련정보는 http://data.krx.co.kr/contents/MDC/MDI/mdiLoader/index.cmd?menuId=MDC0201에서 확인 가능합니다.</p> <p>※변경 전 비교지수 및 비교지수 변경사유</p> <p>- 변경 전 비교지수(2021년 5월 21일 이전): KOSPI 200 Daily Return 2배 Index</p> <p>KOSPI 200 Daily Return 2배 Index 산출식: 당일 벤치마크 지수 = 전일 벤치마크 지수 $\times [1 + \{\text{당일 KOSPI200지수 등락률} \times 2 - \text{CD 금리}(3\text{월물})/365\}]$</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 코리아 2 배 레버리지 증권투자신탁[주식-파생형]**
2. 효력발생일 : 2021 년 5 월 21 일
3. 주요정정사유: 비교지수 변경(KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index → 코스피 200 레버리지 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 2 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2 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 2 배 수준으로 유지함으로써 KOSPI 200 지수의 일일등락률의 2 배 수준의 <u>수익률에 연동하는 코스피 200 레버리지 지수를 추종합니다.</u>
[요약정보] 투자실적추이 (연평균 수익률) (단위, %)	(주 1) 비교지수: KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음) <신설>	(주 1) 비교지수 : <u>코스피 200 레버리지 지수</u> (2021.05.21 이전): KOSPI 200 Daily Return 2 배 Index (비교지수 성과에는 <u>투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음</u>) (주 2) 비교지수 변경사유: 이 투자신탁의 <u>비교지수 변경은 거래소시장에 공정하게 형성된 지수의 사용, 투자자가 신뢰가능한 가격으로 매일 발표되는 투명한 지수의 사용 및 공신력있는 한국거래소에서 산출되는 객관적이고 공정한 지수의 사용을</u>

		<u>위함입니다.</u>
--	--	---------------