

## KB자산운용 투자설명서(간이투자설명서 포함) 변경 안내(변경대비표)

다음과 같이 투자설명서(간이투자설명서 포함) 변경을 안내해 드립니다.

### 1. 대상 펀드 및 변경 내용

#### - KB RISE ESG 사회책임투자 증권 상장지수 투자신탁(주식)

구분	변경전	변경후
투자설명서	<p><b>제2부. 7. 집합투자기구의 투자목적</b></p> <p>- 이 투자신탁은 ESG 집합투자기구로서, 기초지수인 KRX ESG 사회책임경영지수(S)(KRX ESG Social Index)의 구성 종목에 주로 투자합니다. 기초지수는 한국ESG기준원의 ESG 평가 대상 기업을 유니버스로 하여 사회책임 평가항목 점수 상위기업에 해당하는 종목을 유동시가총액방식으로 산출하는 지수입니다.</p>	<p><b>제2부. 7. 집합투자기구의 투자목적</b></p> <p>- 이 투자신탁은 ESG 집합투자기구로서, 기초지수인 KRX ESG 사회책임경영지수(S)(KRX ESG Social Index)의 구성 종목에 주로 투자합니다. 기초지수는 <b>한국ESG기준원의 ESG평가 3요소 중 사회 부문 점수가 우수한 종목을 구성종목으로 하여 개별종목의 유동시가총액 비중으로 가중하여 산출하는 지수입니다.</b></p>
	<p><b>제2부. 9. 집합투자기구의 투자전략, 투자방침 및 수익구조</b></p> <p>가. 투자전략 및 위험관리</p> <p>1) ~ 3) 생략</p> <p>4) 기초지수의 소개</p> <p>(가) 지수의 개요: 국내 유가증권 및 코스닥 상장기업 중 한국ESG기준원의 ESG 평가 대상 기업을 유니버스로 하여 사회책임 평가항목 점수 상위기업에 해당하는 종목을 유동시가총액방식으로 산출하는 지수입니다.</p> <p>※ ESG: 환경(Environment), 사회(Social), 지배구조(Governance)의 요소를 의미하며, 기업의 지속가능한 발전성을 판단하기 위한 지표로, UN의 사회책임투자 원칙(PRI)에서 투자 의사 결정 시 고려하도록 하는 핵심 요소를 의미. 기존의 재무적 관점에서 벗어나 기업의 지속가능성에 영향을 미치는 ESG와 같은 비재무적 요소를 고려 및 반영하는 투자를 사회적 책임투자(Social Responsibility Investment)라고 말함</p> <p>(나) 지수산출기관: 한국거래소</p> <p>(다) 지수 산출 방법 등</p> <p>- 기준일 및 기준지수: 2012년 01월 02일, 1,000pt</p> <p>- 산출방식: 유동시가총액가중방식</p> <p>- 정기변경: 연 1회(매년 12월 두 번째 금요일)</p> <p>- 종목구성 방법</p> <p>① 유니버스 선정: 심사연도 7월말 기준 한국ESG</p>	<p><b>제2부. 9. 집합투자기구의 투자전략, 투자방침 및 수익구조</b></p> <p>가. 투자전략 및 위험관리</p> <p>1) ~ 3) 생략</p> <p>4) 기초지수의 소개</p> <p>(가) 지수의 개요: 국내 유가증권 및 코스닥 상장기업 중 한국ESG기준원의 <b>ESG평가 3요소 중 사회 부문 점수가 우수한 종목을 구성종목으로 하여 개별종목의 유동시가총액 비중으로 가중하여 산출하는 지수</b>입니다.</p> <p>※ ESG: 환경(Environment), 사회(Social), 지배구조(Governance)의 요소를 의미하며, 기업의 지속가능한 발전성을 판단하기 위한 지표로, UN의 사회책임투자 원칙(PRI)에서 투자 의사 결정 시 고려하도록 하는 핵심 요소를 의미. 기존의 재무적 관점에서 벗어나 기업의 지속가능성에 영향을 미치는 ESG와 같은 비재무적 요소를 고려 및 반영하는 투자를 사회적 책임투자(Social Responsibility Investment)라고 말함</p> <p>(나) 지수산출기관: 한국거래소</p> <p>(다) 지수 산출 방법 등</p> <p>- 기준일 및 기준지수: 2012년 01월 02일, 1,000pt</p> <p>- 산출방식: 유동시가총액가중방식</p> <p>- 정기변경: 연 1회(매년 12월 두 번째 금요일)</p> <p><b>- 개별종목 Cap: 27%</b></p> <p>① 유니버스 선정: <b>한국ESG기준원의 ESG 평가대</b></p>

	<p>기준원이 발표하는 당해연도 ESG 평가대상 해당 종목을 기초 유니버스로 활용합니다.</p> <p>② 편입대상 종목 선정: 기초 유니버스 중 대기업, 중견기업, 중소기업 별로 사회책임점수가 높은 순으로 총 130종목을 선정합니다.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ 대기업(상호출자제한 기업집단 및 금융기관) 30개사, 중소기업(중소기업 기본법 제2조 상의 중소기업) 30개사, 중견기업(대기업, 중소기업 이외의 기업) 70개사</li> <li>▪ 다만 코스닥 기업은 최소 30종목이 될 때까지 추가 편입함</li> <li>▪ 한국ESG기준원이 발표하는 당해연도 ESG 평가 대상에 해당하는 종목임에도 불구하고, 지수 구성 종목으로 적합하지 아니하다고 인정되는 종목은 제외함</li> </ul> <p>③ 종목편입 비중 결정: 최종 편입대상 종목들은 매 정기변경일 전일의 종가를 기준으로 개별 구성 종목의 시가총액 비중이 유동시가총액 비중과 동일하게 되도록 조정한 유동시가총액가중방식으로 비중을 결정합니다.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ 최종 편입대상 종목의 각 편입 비중은 최대 27%로 제한됩니다.</li> </ul>	<p><u>상이 아니거나 사회점수가 0점인 종목을 제외한 KRX BMI 구성종목을 기초 유니버스로 활용합니다.</u></p> <p>② 편입대상 종목 선정:</p> <p><u>[1단계] 기초 유니버스 중 코스피지수 및 코스닥지수 구성종목으로 구분하여 최근 3개년 사회점수 평균이 높은 순서로 총 100종목을 선정합니다.</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ 코스피: 최근 3개년 사회점수 평균 기준 상위 70사</li> <li>▪ 코스닥: 최근 3개년 사회점수 평균 기준 상위 30사</li> </ul> <p><u>[2단계] 1단계에서 선정되지 않은 평가대상종목 중 심사연도 사회점수 순위가 높은 순서로 20종목을 추가로 선정합니다. 만약 사회점수 순위가 동일한 경우 최근 3개년 사회점수 평균이 높은 종목을 선정합니다.</u></p> <p><u>[3단계] 2단계까지 선정되지 않은 기존 구성종목 중 다음 요건을 어느 하나 이상 충족하는 종목은 구성 종목에서 제외하지 않습니다.</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ 심사기준일 기준으로 해당 종목의 지수 내 편입비중이 10%를 초과</li> <li>▪ 해당 종목의 평가대상종목 내 심사연도 사회점수 순위가 전체 평가대상종목수의 25% 이내</li> </ul>
--	---	---

2. 변경(예정)일: 2024년 11월 29일(금)