

# 변경대비표(ETF)

## 1. 대상 펀드:

no.	펀드명	투자대상 자산 추가	거래상대방 추가	모펀드 투자대상 자산 추가	결산	변동성	기업 공시 서식
1	미래에셋 TIGER 미국달러 SOFR 금리액티브특별자산상장지수투자신탁(금리-파생형)(합성)	○	○	-	-	-	-
2	미래에셋 TIGERCDD1 년금리액티브증권상장지수투자신탁(채권혼합-파생형)(합성)	○	-	-	-	-	-
3	미래에셋 TIGER 차이나 CSI300 증권상장지수투자신탁(주식-파생형)	-	-	○	-	-	-
4	미래에셋 TIGER 경기방어혼합증권상장지수투자신탁(채권혼합)	-	-	-	○	○	○

## 2. 변경 사항:

- 1) 투자대상자산 추가
- 2) 거래상대방 추가
- 3) 모투자신탁 투자대상자산 추가
- 4) 펀드 결산에 따른 재무정보 및 주요 수치 업데이트
- 5) 투자위험등급 관련 변동성 값 등 업데이트
- 6) 기업공시서식 개정사항 반영

## 3. 효력발생예정일: 2024년 07월 31일 (수)

## 4. 변경 내용:

- 1) 투자대상자산 추가

[집합투자규약]

미래에셋TIGER미국달러SOFR금리액티브특별자산상장지수투자신탁(금리-파생형)(합성)

항목	변경 전	변경 후
제 15 조 (투자대상자산 등)	2. 법 제 4 조제 7 항 규정에 의한 파생결합증권으로 증권사가 만기에 기초지수의 수익률에 연동하는 수익의 지급을 약속하고 발행하는 것으로서 유가증권 시장 상장규정에 따라 상장되어 거래되는 상장지수증권(이하 '상장지수증권'이라 한다)	2. 법 제4조제7항의 규정에 의거하여 다음 각 목의 요건을 충족하는 증권(이하 "파생결합증권"이라 한다) 가. 증권사가 만기에 기초지수의 수익률에 연동하는 수익의 지급을 약속하고 발행하는 것으로서 증권시장에 상장되어 거래되는 증권 중 SOFR 금리 관련 상장지수증권(ETN)

	3. <생략> 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, <신설> 사모사채 <중략> 제외한다) <이하 생략>	나. SOFR 금리에 연계된 수익구조를 가지고 있는 파생결합증권(SOFR 금리 관련 DLS) 3. <생략> 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, <b>상법 제 469 조제 2 항 제 3 호에 따른 사채로서 법 제 4 조제 7 항제 1 호에 해당하는 채무증권 중 SOFR 금리에 연계된 것(SOFR 금리 연계 파생결합사채)</b> 을 포함한다. 사모사채 <중략> 제외한다) <이하 생략>
제 16 조 (투자대상자산 취득한도)	2. <b>상장지수증권</b> 에의 투자는 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 한다	2. <b>파생결합증권</b> 에의 투자는 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 한다
제 17 조 (운용 및 투자 제한)	2. 나.지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다), 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는 인수한 어음만 해당한다], <신설> (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우	2. 나.지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다) <b>및</b> 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는 인수한 어음만 해당한다], <b>파생결합증권</b> , (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우

**미래에셋TIGERCD1년금리액티브증권상장지수투자신탁(채권혼합-파생형)(합성)**

항목	변경 전	변경 후
제 15 조 (투자대상자산 등)	1. <생략> 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, <신설>  사모사채 <중략> 제외한다) <생략> <이하 생략> <신설>	1. <생략> 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, <b>상법 제 469 조제 2 항 제 3 호에 따른 사채로서 법 제 4 조제 7 항제 1 호에 해당하는 채무증권 중 CD 금리에 연계된 것을(CD 금리 연계 파생결합사채)</b> 을 포함한다. 사모사채 <중략> 제외한다) <이하 생략> <b>5. 법 제 4 조제 7 항의 규정에 의거하여 다음 각 목의 요건을 충족하는 증권(이하 "파생결합증권"이라 한다)</b> 가. 증권사가 만기에 기초지수의 수익률에 연동하는 수익의 지급을 약속하고 발행하는 것으로서 증권시장에 상장되어 거래되는 증권 중 CD 금리 관련 상장지수증권(CD 금리 관련 ETN) 나. CD 금리에 연계된 수익구조를 가지고 있는 파생결합증권(CD 금리 관련 DLS)
제 16 조 (투자대상자산 취득한도)	집합투자업자는 제 15 조의 규정에 의하여 투자신탁재산을 운용 함에 있어 다음 각호에서 정하는 바에 따라 따른다. 1. ~ 4. <생략> <b>5. &lt;신설&gt;</b>	집합투자업자는 제 15 조의 규정에 의하여 투자신탁재산을 운용 함에 있어 다음 각호에서 정하는 바에 따라 따른다. 1. ~ 4. <생략> <b>5. 파생결합증권에의 투자는 투자신탁 자산총액의 40% 이하로 한다.</b>
제 17 조 (운용 및 투자 제한)	2.나.지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다), 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는 인	2.나.지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다) <b>및</b> 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는

	수한 어음만 해당한다], <신설> (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우	인수한 어음만 해당한다], <b>파생결합증권</b> , (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우
--	--	--

[투자설명서]

- 미래에셋TIGER미국달러SOFR금리액티브특별자산상장지수투자신탁(금리-파생형)(합성)

항목	변경 전	변경 후
제 2 부. 8. 가. 투자대상	<p>[채권] &lt;생략&gt; 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, &lt;신설&gt; 사모사채 (중략) 제외한다) &lt;이하 생략&gt;</p> <p><b>[상장지수증권]</b> 법 제 4 조제 7 항 규정에 의한 파생결합증권으로 증권사가 만기에 기초지수의 수익률에 연동하는 수익의 지급을 약속하고 발행하는 것으로서 유가증권시장 상장규정에 따라 상장되어 거래되는 상장지수증권</p>	<p>[채권] &lt;생략&gt; 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, <b>상법 제 469 조제 2 항 제 3 호에 따른 사채로서 법 제 4 조제 7 항제 1 호에 해당하는 채무증권 중 SOFR 금리에 연계된 것을(SOFR 금리 연계 파생결합 사채)을 포함한다.</b> 사모사채 (중략) 제외한다) &lt;이하 생략&gt;</p> <p><b>[파생결합증권]</b> 법 제4조제7항의 규정에 의거하여 다음 각 목의 요건을 충족하는 증권(이하 “파생결합증권”이라 한다) 가. 증권사가 만기에 기초지수의 수익률에 연동하는 수익의 지급을 약속하고 발행하는 것으로서 증권시장에 상장되어 거래되는 증권 중 SOFR 금리 관련 상장지수증권(ETN) 나. SOFR 금리에 연계된 수익구조를 가지고 있는 파생결합증권(SOFR 금리 관련 DLS)</p>
제 2 부. 8. 나. 투자제한	<p>[동일종목 투자(예외)] 나.지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다), 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는 인수한 어음만 해당한다], &lt;신설&gt; (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우</p>	<p>[동일종목 투자(예외)] 나.지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다) 및 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는 인수한 어음만 해당한다], <b>파생결합증권</b>, (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우</p>

- 미래에셋TIGERCD1년금리액티브증권상장지수투자신탁(채권혼합-파생형)(합성)

항목	변경 전	변경 후
제 2 부. 8. 가. 투자대상	<p>[채권] &lt;생략&gt; 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, &lt;신설&gt; 사모사채 &lt;중략&gt; 제외한다) &lt;이하 생략&gt;</p> <p>&lt;신설&gt;</p>	<p>[채권] &lt;생략&gt; 사채권(취득 시 신용평가등급이 A- 이상이어야 하며, <b>상법 제 469 조제 2 항 제 3 호에 따른 사채로서 법 제 4 조제 7 항제 1 호에 해당하는 채무증권 중 CD 금리에 연계된 것을(CD 금리 연계 파생결합사채)을 포함한다.</b> 사모사채 &lt;중략&gt; 제외한다) &lt;이하 생략&gt;</p> <p><b>[파생결합증권]</b></p>

		<p>법 제 4 조제 7 항의 규정에 의거하여 다음 각 목의 요건을 충족하는 증권(이하 "파생결합증권"이라 한다)</p> <p>가. 증권사가 만기에 기초지수의 수익률에 연동하는 수익의 지급을 약속하고 발행하는 것으로서 증권시장에 상장되어 거래되는 증권 중 CD 금리 관련 상장지수증권(CD 금리 관련 ETN)</p> <p>나. CD 금리에 연계된 수익구조를 가지고 있는 파생결합증권(CD 금리 관련 DLS)</p> <p>(40% 이하)</p>
제 2 부. 8. 나. 투자제한	<p>[동일종목 투자(예외)]</p> <p>나. 지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다), 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는 인수한 어음만 해당한다], &lt;신설&gt; (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우</p>	<p>[동일종목 투자(예외)]</p> <p>나. 지방채증권, 특수채증권(가목에 해당하는 것은 제외한다) 및 직접 법률에 따라 설립된 법인이 발행한 어음[기업어음증권 및 법 시행령 제 79 조제 2 항제 5 호 각목의 금융기관이 할인·매매·중개 또는 인수한 어음만 해당한다], <b>파생결합증권</b>, (중략) 에 투자신탁 자산총액의 30%까지 투자하는 경우</p>

## 2) 거래상대방 추가

### [투자설명서]

항목	변경 전	변경 후
제 2 부. 9. 가. (1) 투자전략(운용전략 및 투자방침)	<p>이 투자신탁이 투자하는 장외파생상품(스왑)의 주요 계약 내용은 다음과 같습니다.</p> <p>- 스왑계약 거래상대방(신용등급, 기준일자):</p> <p>삼성증권(AA+, 2023.08.23),  메리츠증권(AA-, 2023.08.18),  키움증권(AA-, 2023.08.24),  미래에셋증권(AA, 2023.08.23),  NH 투자증권(AA+, 2023.08.04),  한국투자증권(AA, 2023.08.14)</p> <p>&lt;추가&gt;</p>	<p>이 투자신탁이 투자하는 장외파생상품(스왑)의 주요 계약 내용은 다음과 같습니다.</p> <p>- 스왑계약 거래상대방(신용등급, 기준일자):</p> <p>삼성증권 (AA+, 2024.06.24)  메리츠증권(AA-, 2024.06.13),  키움증권(AA-, 2024.06.26),  미래에셋증권(AA, 2024.06.19),  NH투자증권(AA+, 2024.06.28),  한국투자증권(AA, 2024.06.25)</p> <p><b>KB 증권 (AA+, 2024.06.20)</b></p>

## 3) 모투자신탁 투자대상자산 추가

### [투자설명서]

항목	변경 전	변경 후
<p>[제 2 부 별첨 1]</p> <p>1. 미래에셋차이나 A 주증권모투자신탁(주식·파생형)</p> <p>나. (1)투자대상</p>	<p>&lt;신설&gt;</p>	<p>[장외파생상품]</p> <p>법 제 5 조제 1 항 및 제 3 항의 규정에 의한 장외파생상품으로서 주식·채권·통화나 주식·채권·통화의 가격, 이자율, 지표, 단위 또는 이를 기초로 하는 지수 등에 연계된 것(다만, 통화관련장외파생상품의 경우 위험회피목적을 위한 거래에 한한다) (이하 "장외파생상품"이라 한다)</p>

<p>[제 2 부 별첨 1] 1. 미래에셋차이나 A 주증권모투자신탁(주 식-파생형) 나. (2)투자제한</p>	<p>&lt;신설&gt;</p>	<p>[파생상품 투자] 같은 거래상대방과의 장외파생상품 매매에 따른 거래상대방 위험평가액이 이 투자신탁 자산총액의 10%를 초과하여 투자하는 행위</p> <p>[파생상품 투자] 법 시행령 제 80 조제 5 항에서 정하는 적격 요건을 갖추지 못한 자와 장외파생상품을 매매하는 행위</p>
<p>[제 2 부 별첨 1] 2. 미래에셋차이나 A 주관련증권모투자신탁(주식-파생재간접 형) 나. (1)투자대상</p>	<p>&lt;신설&gt;</p>	<p>[장외파생상품] 법 제 5 조제 1 항 및 제 3 항의 규정에 의한 장외파 생상품으로서 주식·채권·통화나 주식·채권·통화의 가격, 이자율, 지표, 단위 또는 이를 기초로 하는 지 수 등에 연계된 것(다만, 통화관련장외파생상품의 경우 위험회피목적을 위한 거래에 한한다) (이하 “장외파생상품”이라 한다)</p>
<p>[제 2 부 별첨 1] 2. 미래에셋차이나 A 주관련증권모투자신탁(주식-파생재간접 형) 나. (2)투자제한</p>	<p>&lt;신설&gt;</p>	<p>[파생상품 투자] 같은 거래상대방과의 장외파생상품 매매에 따른 거래상대방 위험평가액이 이 투자신탁 자산총액의 10%를 초과하여 투자하는 행위</p> <p>[파생상품 투자] 법 시행령 제 80 조제 5 항에서 정하는 적격 요건을 갖추지 못한 자와 장외파생상품을 매매하는 행위</p>

4) 펀드 결산에 따른 재무정보 및 주요 수치 업데이트

항목	변경 전	변경 후
요약정보 <투자비용>	-	<u>총보수·비용(피투자집합투자 기구 보수포함) 업데이트</u>
제 2 부. 13. 보수 및 수수료에 관한 사항	-	<u>총보수·비용(피투자집합투자기구 보수포함) 및 증 권거래비용 등 업데이트</u>
제 3 부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항	-	<u>재무정보 및 주요 수치 업데이트</u>
제 5 부. 4. 가. 이해관계인과의 거래내 역	-	<u>이해관계인과의 거래내역 업데이트</u>

5) 투자위험등급 관련 변동성 값 등 업데이트

[97.5% VaR\*]

펀드명	변경 전 등급 표준편차	변경 후 등급 97.5% VaR	변경 전(%) 표준편차	변경 후(%) 97.5% VaR
미래에셋TIGER경기방어혼합증권상장지수투자신탁(채권혼합)	4	4	<u>5.27</u>	<u>10.98</u>

\*2024.3.1 시행일 이후 결산기가 도래하는 증권신고서(정정신고서 포함)부터 적용

6) 기업공시서식 개정사항 반영

[투자설명서]

항목	변경 전	변경 후
제 2 부. 11. 매입, 환매 및 기준가격 적용기준 나. 환매	(5) 환매 가능 여부 및 환매수수료 부과에 관한 사항 <신설>	(5) 환매 가능 여부 및 환매수수료 부과에 관한 사항 이 투자신탁은 환매수수료를 부과하지 않습니다. [별첨 1]

\*2024.3.1 시행일 이후 결산기가 도래하는 증권신고서(정정신고서 포함)부터 적용

[별첨1]

중도환매 불가	중도환매 허용	
	중도환매시 비용발생	중도환매시 비용 미발생
X	X	O

미래에셋자산운용(주)