

## 투자설명서 변경 내용

□ 대상펀드명 : 트러스톤 밸류웨이40 증권투자신탁[채권혼합]

□ 변경 사유 : ① 모투자신탁의 투자대상자산 및 투자전략 추가

- ② 투자위험등급 산정기준 변경(주간 수익률의 표준편차 → 일간 수익률의 최대손실 예상액)
- ③ 제10기 재무제표 확정에 따른 갱신
- ④ 기업공시서식 개정사항 반영
- ⑤ 예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영

□ 효력발생일 : 2024. 8. 7.

□ 변경 내용

항 목	정정사유	정 정 전	정 정 후
투자결정시 유의사항 안내			
투자결정시 유의사항 안내	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규 정 개정사항 반영	7. 집합투자증권은 집합투자 기구의 운용실적에 따라 손 익이 결정되는 실적배당상품 으로 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않 으며, 특히 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 집 합투자증권을 매입하는 경우 에도 은행예금과 달리 예금 자보호법에 따라 <u>예금보험공 사가 보호하지</u> 않습니다.	7. 집합투자증권은 집합투자 기구의 운용실적에 따라 손 익이 결정되는 실적배당상품 으로 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않으며, 특히 예금 자보호법의 적용을 받는 은 행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 은행예금 과 달리 예금자보호법에 따 라 <u>보호되지</u> 않습니다.
요약정보			
-	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규 정 개정사항 반영	집합투자증권은 「예금자보호 법」에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않는 실적배당상품 이며, (생 략)	집합투자증권은 「예금자보호 법」에 따라 <u>보호되지</u> 않는 실적배당상품이며, (생 략)
투자비용	동종유형 총보수 최근 기준으로 기재	-	<u>2024. 6. 28. 기준</u>



트러스톤자산운용

	제 10 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 7. 24. 기준</u>
투자실적 추이(연평균 수익률)	제 10 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 7. 24. 기준</u>
운용전문인력	최근 기준으로 기재	-	<u>2024. 6. 30. 기준</u>
투자자유 의사향	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영	집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.	집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 <u>보호되지</u> 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.
주요투자위험	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영	투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 운용실적에 따라 손익이 결정되는 실적배당상품으로 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재합니다. (생략) 또한 이 투자신탁은 은행 예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않으며, 특히 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않습니다.	투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 운용실적에 따라 손익이 결정되는 실적배당상품으로 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재합니다. (생략) 또한 이 투자신탁은 은행 예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않으며, 특히 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않습니다.

## 제 2 부 집합투자기구에 관한 사항

2. 집합투자기구의 연혁	연혁 업데이트	[이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 연혁] - 트러스톤중기채권증권모투자신탁[채권] <신 설>	[이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 연혁] - 트러스톤중기채권증권모투자신탁[채권] <u>2023.06.23</u>
---------------	---------	--	--

		<p>- <u>자투자신탁 추가(트러스톤 중기채권 증권자투자신탁[채권])</u>  <u>2024.08.07</u></p> <p>- <u>환매일정 변경 : 2(3)영업일 기준으로 4(4)영업일에 지급 → 3(4)영업일 기준으로 3(4)영업일에 지급</u></p> <p>- <u>투자대상자산 추가(단기사채, 기업어음증권)</u></p>	<p>- <u>트러스톤중장기증권모투자신탁[채권]</u>  <u>2024.08.07</u>  <u>투자대상자산 추가(단기사채)</u></p>
5. 운용전문인력 가. 운용전문인력	최근 기준으로 기재	-	<u>2024. 6. 30. 기준</u>
5. 운용전문인력 나. 운용중인 집합투자 기구에 관한 사항	최근 기준으로 기재	-	<u>2024. 6. 30. 기준</u>
5. 운용전문인력 다. 운용전문인력 최근 변경 내역	최근 3 년 경과 내역 삭제	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모 투자신탁의 운용전문인력 최 근 변경 내역]</p> <p>- <u>트러스톤중기채권증권모투 자신탁[채권]</u>  <u>책임운용역 : 신흥섭</u>  <u>(2020.01.09~2020.07.21)</u></p>	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모 투자신탁의 운용전문인력 최 근 변경 내역]</p> <p>- <u>트러스톤중기채권증권모투 자신탁[채권]</u>  <u>〈삭 제〉</u></p>
8. 집합투자기구의 투 자대상 가. 투자대상	모투자신탁의 투자대 상자산 추가(단기채 권) 및 기재 명확화	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모 투자신탁의 주요 투자 대상]</p> <p>(1) <u>트러스톤중기채권증권모 투자신탁[채권]</u></p> <p>1) 채권 : 사채권(신용평가등 급 A-이상, 사모사채권, 자산</p>	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모 투자신탁의 주요 투자 대상]</p> <p>(1) <u>트러스톤중기채권증권모 투자신탁[채권]</u></p> <p>1) 채권 : 사채권(<u>취득시</u> 신 용평가등급 A-이상(<u>전자증권</u></p>

		유동화계획에 따라 발행되는 사채, 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권은 제외)	<u>법 제 59 조에 따른 단기사채의 경우 취득시 신용평가등급 A2 이상</u> ), 사모사채권, 자산유동화계획에 따라 발행되는 사채, 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권은 제외)
모투자신탁의 투자대상자산 추가(기업어음증권)	3) <u>양도성예금증서</u> 〈신 설〉		3) <u>어음</u> ▶ <u>기업어음증권(신용평가등급 A2 이상, 기업이 사업에 필요한 자금을 조달하기 위하여 발행한 약속어음으로 법 시행령 제 4 조에서 정하는 요건을 갖춘 것)</u> ▶ <u>기업어음증권을 제외한 어음(신용평가등급 A2 이상)</u> ▶ <u>양도성 예금증서</u>
환매조건부 매수 삭제 및 번호 정정	7) <u>환매조건부 매수</u> 8) (생략) 9) (생략) 10) (생략)		<u>〈삭 제〉</u> 7) (현행과 같음) 8) (현행과 같음) 9) (현행과 같음)
환매조건부 매수 추가 및 번호 정정	11) (생략) 〈신 설〉		10) (현행과 같음) ▶ <u>환매조건부 매수</u>
번호 정정	12) (생략)		11) (현행과 같음)
기재 정정	나) 다음에 해당하는 사유로 불가피하게 위의 4)~9)의 투자한도를 초과하는 경우에는 초과일부터 3개월까지(생략)		나) 다음에 해당하는 사유로 불가피하게 위의 4)~8)의 투자한도를 초과하는 경우에는 초과일부터 3개월까지(생략)

	<p>모투자신탁의 투자대상자산 추가(단기채권) 및 기재 명확화</p> <p>환매조건부 매수 삭제 및 번호 정정</p> <p>환매조건부 매수 추가 및 번호 정정</p> <p>번호 정정</p> <p>기재 정정</p>	<p>(2) 트러스톤 중장기 증권 모투자신탁[채권]</p> <p>1) 채권 : 사채권(신용평가등급 A-이상, 사모사채권, 자산유동화계획에 따라 발행되는 사채, 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권은 제외)</p> <p>7) <u>환매조건부 매수</u></p> <p>8) (생략)</p> <p>9) (생략)</p> <p>10) (생략)</p> <p>11) (생략)</p> <p>〈신설〉</p> <p>12) (생략)</p> <p>나) 다음에 해당하는 사유로 불가피하게 위의 4)~9)의 투자한도를 초과하는 경우에는 초과일부터 3개월까지 (생략)</p>	<p>(2) 트러스톤 중장기 증권 모투자신탁[채권]</p> <p>1) 채권 : 사채권(<u>취득시</u> 신용평가등급 A-이상(<u>전자증권법 제59조에 따른 단기사채의 경우 취득시 신용평가등급 A2 이상</u>), 사모사채권, 자산유동화계획에 따라 발행되는 사채, 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권은 제외)</p> <p>〈삭제〉</p> <p>7) (현행과 같음)</p> <p>8) (현행과 같음)</p> <p>9) (현행과 같음)</p> <p>10) (현행과 같음)</p> <p>▶ <u>환매조건부 매수</u></p> <p>11) (현행과 같음)</p> <p>나) 다음에 해당하는 사유로 불가피하게 위의 4)~8)의 투자한도를 초과하는 경우에는 초과일부터 3개월까지 (생략)</p>
<p>8. 집합투자기구의 투자대상</p> <p>나. 투자제한</p>	기재 정정	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 투자제한]</p> <p>(1) 중기채권증권모투자신탁[채권]/트러스톤 중장기 증권 모투자신탁[채권]</p> <p>1) 이해관계인과의 거래 : - 제 17 조 제 2 항 제 1 호에 따른 단기 대출</p>	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 투자제한]</p> <p>(1) 중기채권증권모투자신탁[채권]/트러스톤 중장기 증권 모투자신탁[채권]</p> <p>1) 이해관계인과의 거래 : - 법 제 83 조제 4 항에 따른 단기 대출</p>

<p>9. 집합투자기구의 투자전략, 투자방침 및 수익구조</p> <p>가. 투자전략 및 위험관리</p>	<p>모투자신탁의 투자전략 추가</p>  <p>번호 정정</p>  <p>기재 구체화</p>	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 투자전략]</p> <p>1) 투자전략</p> <p><input type="checkbox"/> 채권 모투자신탁의 투자전략</p> <p>트러스트중기채권증권모투자신탁[채권]/트러스트중장기증권모투자신탁[채권]</p> <p>&lt;신 설&gt;</p> <p>(3) (생략)</p> <p>2) 위험관리 전략</p> <p><input type="checkbox"/> 채권 위험관리 전략</p> <p>&lt;신 설&gt;</p>	<p>[이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 투자전략]</p> <p>1) 투자전략</p> <p><input type="checkbox"/> 채권 모투자신탁의 투자전략</p> <p>트러스트중기채권증권모투자신탁[채권]/트러스트중장기증권모투자신탁[채권]</p> <p><b>(3) 크레딧 전략</b></p> <p><b>(4) (현행과 같음)</b></p> <p>2) 위험관리 전략</p> <p><input type="checkbox"/> 채권 위험관리 전략</p> <p><b>세부 위험관리 전략 기재 구체화</b></p>
<p>10. 집합투자기구의 투자위험</p>	<p>예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영</p>	<p>이 투자신탁은 원본을 보장하지 않습니다. (생략) 또한, 이 투자신탁은 예금자보호법의 적용을 받는 은행의 예금과 달리 실적에 따른 수익을 취득하므로 은행 등에서 판매하는 경우에도 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않습니다. (생략)</p>	<p>이 투자신탁은 원본을 보장하지 않습니다. (생략) 또한, 이 투자신탁은 예금자보호법의 적용을 받는 은행의 예금과 달리 실적에 따른 수익을 취득하므로 은행 등에서 판매하는 경우에도 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않습니다. (생략)</p>
<p>10. 집합투자기구의 투자위험</p> <p>가. 일반위험</p>	<p>예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영</p>	<p>투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 실적배당상품으로 은행 예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호를 하지</u> 않습니다. (생략)</p>	<p>투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 실적배당상품으로 은행 예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않습니다. (생략)</p>

10. 집합투자기구의 투자위험 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형	투자위험등급 산정기준 변경	표준편차 : 6.21%  <신 설>  <트러스트자산운용 집합투자 기구 위험등급 분류기준> 2) 설정된 후 3년 경과된 경우 <u>표준편차</u>	<u>일간 수익률의 최대 손실 예상액(97.5% VaR 모형 사용) : 12.34%</u>  - 위험등급 변경 내역 : <u>2024.8.7 : 투자위험등급 산정 기준을 최근 결산일 기준 이전 3년간 “주간 수익률의 표준편차”에서 “일간 수익률의 최대 손실 예상액” 기준으로 변경</u>  <트러스트자산운용 집합투자 기구 위험등급 분류기준> 2) 설정된 후 3년 경과된 경우 <u>위험등급 기준표(97.5% VaR 모형 사용)</u>
11. 매입, 환매, 전환 절차 및 기준가격 적용 기준 나. 환매	기업공시서식 개정사항 반영	1) 환매방법 및 절차, 환매 신청 가능시간 <신 설>	1) 환매방법 및 절차, 환매 신청 가능시간 <u>&lt;환매 가능 여부 및 환매 수수료 부과 여부&gt;</u>
13. 보수 및 수수료에 관한 사항 나. 집합투자기구에 부과되는 보수 및 비용	동종유형 총보수 최근 기준으로 기재 제 10 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-  -	<u>2024. 6. 28. 기준</u>  <u>2024. 7. 24. 기준</u>
제3부 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항			
1. 재무정보	제 10 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 7. 24. 기준</u>
2. 연도별 설정 및 환매 현황	제 10 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 7. 24. 기준</u>
3. 집합투자기구의 운용실적	제 10 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 7. 24. 기준</u>

제 4 부 집합투자기구 관련회사에 관한 사항

1. 집합투자업자에 관한 사항 가. 회사 개요	최근 기준으로 기재 회사연혁 추가	- 〈신 설〉	<u>2024. 6. 30. 기준</u> <u>2022.11 종합자산운용사</u> <u>전환</u>
1. 집합투자업자에 관한 사항 다. 최근 2 개 사업연도 요약 재무내용	최근 기준으로 기재	<u>제 25 기(2022.12.31)</u> <u>제 24 기(2021.12.31)</u>	<u>제 26 기(2023.12.31)</u> <u>제 25 기(2022.12.31)</u>
1. 집합투자업자에 관한 사항 라. 운용자산 규모	최근 기준으로 기재	-	<u>2024. 6. 30. 기준</u>
3. 집합투자재산 관리 회사에 관한 사항(신탁 업자)	신탁업자 정보 업데이트	주소 및 연락처 : <u>서울특별시</u> <u>중구 을지로 55 (02-</u> <u>2002-1111)</u> 연혁 : 〈신 설〉	주소 및 연락처 : <u>서울특별시</u> <u>중구 을지로 35(을지로 1 가)</u> <u>(1599-1111)</u> 연혁 : <u>1971 년 6 월 설립,</u> <u>2015 년 9 월 외환은행</u> <u>합병</u>