

투자설명서 변경 주요내용

1. 투자신탁의 명칭 : 브이아이 사회책임투자 증권 투자신탁[주식]

2. 변경시행일 : 2024년 06월 20일

3. 변경사유

- ① 투자신탁 결산에 따른 갱신
- ② 투자위험등급 산정기준 변경(표준편차 → 최대손실예상액)
- ③ 실제 수익률 변동성 변경 : 표준편차 18.23% → 97.5% VaR 36.46%
- ④ 기업공시서식 개정사항 반영
- ⑤ 예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영
- ⑥ 고유재산 투자에 관한 사항(자금 회수 예정)

4. 변경사항(투자설명서)

구분	변경 전	변경 후
일괄신고서 표지	금융위원회가 ____ 유의하시기 바랍니다. 또한 이 집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 예금보험공사가 보호하지 않는 실적배당상품으로 ____ 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.	금융위원회가 ____ 유의하시기 바랍니다. 또한 이 집합투자증권은 「예금자보호법」에 의한 보호를 받지 않는 실적배당상품으로 ____ 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.
투자결정시 유의사항	7. 집합투자증권은 ____ 실적배당상품으로 「예금자보호법」에 따라 예금보험공사가 보호하지 아니하며, 특히 「예금자보호법」의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 은행예금과 달리 예금보험공사가 보호하지 않습니다.	7. 집합투자증권은 ____ 실적배당상품으로 「예금자보호법」에 따라 보호되지 아니하며, 특히 「예금자보호법」의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 「예금자보호법」에 따라 보호되지 않습니다.
제2부. 집합투자기구에 관한 사항		
5. 운용전문인력에 관한 사항	-	(업데이트)
10. 집합투자기구의 투자위험	이 투자신탁은 원본을 보장하지 않습니다. ____ 은행 등에서 판매하는 경우에도 「예금자보호법」에	이 투자신탁은 원본을 보장하지 않습니다. ____ 은행 등에서 판매하는 경우에도 「예금자보호법」에

	따라 예금보험공사가 보호하지 않습니다.	따라 보호되지 않습니다.
10. 집합투자기구의 투자위험 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형	※ 실제 수익률 변동성(실제 연환산 표준편차 : 최직근 결산일 기준 과거 3년간 수익률 변동성) : 18.23% (변경전) [위험등급 기준표(실제 수익률 변동성 기준)]	※ 실제 수익률 변동성(최직근 결산일 기준 과거 3년간 일간수익률의 최대손실예상액, 97.5% VaR) : 36.46% (변경후) [시장위험 등급 기준표(97.5% VaR 모형 사용)]
11. 매입, 환매, 전환절차 및 기준가격 적용기준 나. 환매	<기업공시서식 반영>	환매 가능 및 환매수수료 부과 여부
13. 보수 및 수수료에 관한 사항	-	(업데이트)
제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항		
1. 재무정보 2. 연도별 설정 및 환매현황 3. 집합투자기구의 운용실적	-	(업데이트)
제4부. 집합투자기구 관련회사에 관한 사항		
1. 집합투자업자에 관한 사항 다. 최근 2개 사업연도 요약 연결재무내용 라. 운용자산 규모	-	(업데이트)
제5부. 기타 투자자보호를 위해 필요한 사항		
5. 집합투자업자의 고유재산 투자에 관한 사항 가. 투자금액	[투자금 회수계획] 투자기간 이후 시장상황에 따라 2회이상 분할하여 회수 예정	[투자금 회수계획] 2회이상 분할하여 회수 예정 (1차) 2024.06.17 : 투자금액의 50% 이하 환매신청 (2차) 1차 이후 1개월 이상이 경과한 후 : 투자금 전액 회수 예정
5. 집합투자업자의 고유재산 투자에 관한 사항 나. 추가 투자금액	[투자금 회수계획] 시장상황에 따라 탄력적 회수	[투자금 회수계획] 2회이상 분할하여 회수 예정 (1차) 2024.06.17 : 투자금액의 50% 이하 환매신청 (2차) 1차 이후 1개월 이상이 경과한 후 : 투자금 전액 회수 예정

(변경전)

[위험등급 기준표(실제 수익률 변동성 기준)]

등급	1등급	2등급	3등급	4등급	5등급	6등급
	(매우 높은 위험)	(높은 위험)	(다소 높은 위험)	(보통 위험)	(낮은 위험)	(매우 낮은 위험)
표준편차	25%초과	25%이하	15%이하	10%이하	5%이하	0.5%이하

(변경후)

[시장위험 등급 기준표(97.5% VaR 모형 사용)]

등급	1등급	2등급	3등급	4등급	5등급	6등급
	(매우 높은 위험)	(높은 위험)	(다소 높은 위험)	(보통 위험)	(낮은 위험)	(매우 낮은 위험)
97.5% VaR	50% 초과	50% 이하	30% 이하	20% 이하	10% 이하	1% 이하

주1) 이 투자위험등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.

주2) 과거 3년 일간수익률에서 2.5퍼센타일에 해당하는 손실률의 절대값에 변환산 보정계수($\sqrt{250}$)를 곱해 산출

주3) VaR(Value at Risk)는 포트폴리오 손실 위험 측정을 위해 이용되는 위험 측정수단입니다. 상기 표상 VaR값 ○○%의 의미는 펀드의 과거 3년 동안 일간수익률을 고려 시 최대 ○○%의 손실(신뢰구간 97.5%)이 발생할 수 있음을 의미합니다.

끝.