

정 정 신 고 (보고)

2026년 2월 13일

1. 정정대상 공시서류 : 투자설명서

2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2021년 12월 27일

3. 정정사항

- 법시행령 제130조 제2항에 의거 최근 결산기의 재무제표 확정으로 인한 정정(기타비용, 증권거래비용 등 업데이트 포함)
- 설정기간 3년 경과에 따른 투자위험등급 산정기준 변경(VaR)
- 최근 결산일 기준 이전 3년간 일간수익률의 최대손실예상액(VaR)에 따른 투자위험등급 변경
- 채권평가회사 추가(이지자산평가)
- 책임운용전문인력 변경 (황우택→김원재, 2026.02.13 시행)
- 부책임운용전문인력 변경 (김원재→황우택, 2026.02.13 시행)

항 목	정정요구 · 명령관련 여부	정정사유	정정전	정정후
투자설명서 전 체	아니오	최근 결산일 기준 이전 3년간 일간 수익률의 최대손 실예상액(VaR)에 따른 투자위험등 급 변경	2등급(높은 위험)	1등급(매우 높은 위험)
제2부. 5. 운용전문인 력	아니오	책임운용전문인력 변경	<u>황우택</u>	<u>김원재</u>
		부책임운용전문인 력 변경	<u>김원재</u>	<u>황우택</u>
제2부. 10. 라. 이 집합투 자기구에 적합 한 투자자 유형	아니오	설정기간 3년 경 과에 따른 투자위 험등급 산정기준 변경(VaR) 최근 결산일 기준 이전 3년간 일간 수익률의 최대손 실예상액(VaR)에 따른 투자위험등	<u>- 이 투자신탁은</u> <u>"FactSet USChina</u> <u>Electric&Autonomous</u> <u>Vehicle Index"를 비교</u> <u>지수로 하여 비교지수</u> <u>대비 초과성과를 목표</u> <u>로 투자신탁재산을 운</u> <u>용하는 것을 목적으로</u> <u>해외 거래소에 상장된</u> <u>주식에 60%이상 투자</u>	<u>- 이 투자신탁은 최근</u> <u>결산일 기준 이전 3년</u> <u>간 일간수익률의 최대</u> <u>손실예상액(VaR)에 따</u> <u>른 수익률 변동성이</u> <u>54.55%이므로 6개의</u> <u>투자위험등급 중 위험</u> <u>도가 매우 높은 1등급</u> <u>으로 분류됩니다.</u>

		급 변경	<p><u>하여 수익을 추구하므로 6개의 투자위험등급 중 위험도가 높은 2등급으로 분류됩니다.</u></p> <p>(중략)</p> <p><u>- 상기의 투자위험등급은 추후 설정기간 3년이 경과하는 경우 특별한 사정이 없는 한 실제 수익률 변동성 (예 : 최근 결산일 기준 이전 3년간 일간 수익률의 최대손실예상액)으로 등급분류기준이 변경되면서 투자위험등급이 변경될 수 있습니다.</u></p> <p>(붙임1) 집합투자기구 위험등급 분류기준</p>	<p>(현행과 같음)</p> <p><u>- 상기의 투자위험등급은 추후 매결산시마다 수익률 변동성을 재산정하게 되며 이 경우 투자위험등급이 변경될 수 있습니다.</u></p> <p>(붙임2) 집합투자기구 위험등급 분류기준</p>
제2부. 13. 나. 집합투자구에 부과되는 보수 및 비용 ※ 1,000만원을 투자할 경우 투자자가 부담하게 되는 수수료 및 보수·비용의 투자기간 별 예시	아니오	정기갱신	-	최근 결산기 기준 작성
제3부. 1. 재무정보 2. 연도별 설정 및 환매 현황 3. 집합투자구의 운용실적	아니오	정기갱신	-	최근 결산기 기준, 작성기준일 기준 작성

제4부. 1. 다. 최근 2개 사업연도 요약 재무내용 라. 운용자산 규모	아니오	정기갱신	-	작성기준일 기준 작성
제4부. 6. 채권 평가회사에 관 한 사항	아니오	채권평가회사 추 가	(신설)	이지자산평가(주)
제5부. 4. 이해 관계인 등과의 거래에 관한 사 항	아니오	정기갱신	-	작성기준일 기준 작성

(붙임 1)

[집합투자기구 위험등급 분류기준 및 상세설명]

위험등급	분류기준	상세설명(주)
1 등급	매우 높은 위험	①레버리지 등 수익구조가 특수하여 투자시 주의가 필요한 집합투자기구 ②국내·외 부동산, 자원 등 실물관련자산(중위험자산 제외)에 50%를 초과하여 투자하는 집합투자기구 ③최대손실률이 20%를 초과하는 파생결합증권에 주로 투자하는 집합투자기구 ④기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
2 등급	높은 위험	①고위험자산에 80% 이상 투자하는 집합투자기구 ②기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
3 등급	다소 높은 위험	①고위험자산에 80% 미만으로 투자하는 집합투자기구 ②최대손실률이 20% 이하인 파생결합증권에 주로 투자하는 집합투자기구 ③기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
4 등급	보통 위험	①고위험자산에 50% 미만으로 투자하는 집합투자기구 ②중위험자산에 최소 60% 이상 투자하는 집합투자기구 ③기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구

5 등급	낮은 위험	①저위험자산에 최소 60% 이상 투자하는 집합투자기구 ②수익구조상 원금보존추구형 파생결합증권에 주로 투자하는 집합투자기구 ③기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
6 등급	매우 낮은 위험	①단기금융집합투자기구(MMF) ②단기 국공채 등에 주로 투자하는 집합투자기구 ③기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구

- (주) 1. 집합투자기구 위험등급 분류기준은 당해 투자신탁의 집합투자업자인 한국투자신탁운용의 내부기준입니다. 따라서, 판매회사 또는 다른 집합투자업자의 집합투자기구 위험등급 분류기준과는 차이가 있을 수 있습니다.
2. 설정된 후 3년이 경과한 집합투자기구는 특별한 사정이 없는 한 실제 수익률 변동성(예 : 최근 결산일 기준 이전 3년간 일간 수익률의 최대손실예상액)을 기준으로 위험등급을 구분합니다. 따라서, 설정된 후 3년이 경과하지 않은 집합투자기구는 추후 실제 수익률 변동성으로 등급분류기준이 변경되면서 위험등급이 변경될 수 있습니다.
3. ①고위험자산이란 주식, 상품(Commodity), 리츠, 지분(유한회사, 합자회사, 조합 등), 투기등급채권 등 자산, 파생상품, 이러한 고위험자산으로 구성된 집합투자기구의 집합투자증권 등 이와 유사한 위험을 갖는 자산들을 의미합니다.
- [투기등급채권 등 자산이란 투기등급채권(BB+이하), 투기등급 CP(B+이하), 후순위채권, 신종자본증권, 조건부자본증권(contingent convertible bond, CoCo bond) 등 이와 유사한 위험을 갖는 자산들을 의미합니다]
- ②중위험자산이란 채권(BBB 급), CP(A3 급), 담보부 대출 및 대출채권, 투자원금에 대해 정부의 신용보강이 있는 부동산 또는 특별자산, 이러한 중위험자산으로 구성된 집합투자기구의 집합투자증권 등 이와 유사한 위험을 갖는 자산들을 의미합니다.
- ③저위험자산이란 국공채, 지방채, 회사채(A-이상), CP(A2-이상), 현금성자산, 이러한 저위험자산으로 구성된 집합투자기구의 집합투자증권 등 이와 유사한 위험을 갖는 자산들을 의미합니다.
4. 해외자산에 투자하는 집합투자기구의 경우 국내자산에 준하여 분류하되, 환헤지 여부, 투자국가 등을 고려하여 위험등급이 상향될 수 있습니다.
5. 파생상품 또는 파생결합증권에 투자하는 집합투자기구의 경우 기초자산, 거래상대방의 신용등급 및 담보수준 등을 감안하여 위험등급이 상향 또는 하향될 수 있습니다.
6. 상기에 명시되지 않은 집합투자기구의 경우 투자대상, 손실가능성 등을 고려하여 별도로 분류합니다.
7. 상기 분류에 따른 동일유형임에도 불구하고 편입자산의 구체적인 운용내용에 따라 집합투자업자가 별도로 위험등급을 달리 분류할 수 있습니다.

(붙임 2)

※ 수익률 변동성의 의미

수익률변동성은 과거 3년 일간 수익률에서 2.5 퍼센타일에 해당하는 손실률의 절대값에 연환산 보정계수($\sqrt{250}$)를 곱해 산출한 97.5% VaR(Value at Risk) 모형을 사용합니다.

[집합투자기구 위험등급 분류기준 (97.5% VaR 모형 사용)]

등급	1 등급	2 등급	3 등급	4 등급	5 등급	6 등급
	매우높은위험	높은위험	다소높은위험	보통위험	낮은위험	매우낮은위험
97.5% VaR	50% 초과	50% 이하	30% 이하	20% 이하	10% 이하	1% 이하

(주) 1. 집합투자기구 위험등급 분류기준은 당해 투자신탁의 집합투자업자인 한국투자신탁운용의 내부기준입니다.

따라서, 판매회사 또는 다른 집합투자업자의 집합투자기구 위험등급 분류기준과는 차이가 있을 수 있습니다.

2. 설정된 후 3년이 경과한 집합투자기구는 특별한 사정이 없는 한 실제 수익률 변동성(예 : 최근 결산일 기준 이전 3년간 일간 수익률의 최대손실예상액)을 기준으로 위험등급을 구분합니다. 다만, 상기 분류기준에도 불구하고 상품의 특성에 따라 집합투자업자가 별도로 위험등급을 달리 분류할 수 있습니다.