

# 정 정 신 고 [보 고]

2022년 7월 20일

1. 정정대상 공시서류: 투자설명서
2. 정정대상 공시서류의 최초제출일: 2009. 5. 4.
3. 정정사항: (1) 2022년 7월자 글로벌 투자설명서 발행  
(2) 펀드 결산일 경과에 따른 위험등급 변동성 갱신

항목	정정사유	정정 전	정정 후
제2부 9. 집합투자기구의 투자전략, 투자방침 및 수익구조 - 가. 투자전략 및 위험관리 - 프랭클린 K2 얼터너티브 스트레티지 펀드	글로벌 투자설명서 갱신	<p><b>투자방침</b> 본 펀드는 광범위한 환경(E) 특성(기후변화, 자연자본, 오염 및 폐기물) 및 사회적(S) 특성(인적자본, 제3물책임, 이해관계자의 반대)을 촉진하고자 합니다. 본 펀드 포트폴리오의 최소 90%에 적용되는 ESG 평가 체계는 포트폴리오 구성시 이에 따라야 합니다.</p> <p>포트폴리오 수준에서는, 본 펀드는 총 포트폴리오의 평가등급이 BBB 이상이고 MSCI ESG 점수가 5.0 이상일 것을 목표로 합니다. BBB 등급은 4.286점 내지 5.714점(최종산업조정기업점수(Final Industry-Adjusted Company Score))에 해당하므로 5.0점은 BBB의 등급 중위수에 해당합니다. MSCI ESG 평가방법에 관한 보다 자세한 정보는 <a href="https://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/esg-ratings">https://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/esg-ratings</a>에서 확인하실 수 있습니다. 하지만, 본 펀드는 이러한 등급 및/또는 배정을 하회하는 자산을 보유할 수 있으며, 이 경우 (i) 본 펀드의 등급이 BBB 아래로 하락하는 경우, 집합투자업자는 90일 이내에 펀드 점수를 BBB 이상으로 달성하기 위하여 각 공동집합투자업자의 자산 부분을 재조정하고, (ii) 본 펀드의 점수가 5.0 미만으로 하락하는 경우, 집합투자업자는 ESG 점수를 낮추는 원인인 포트폴리오 자산을 파악하고 다음 분기 동안 관련 공동집합투자업자와 논의합니다. 시간이 경과함에 따라 공동집합투자업자의 점수가 개선되지 않는 경우, 집합투자업자는 주주들의 이익을 고려하여 공동집합투자업자와 상관이 배분합니다. 본 펀드 포트폴리오 자산의 가중평균 ESG 점수는 본 펀드 투자 후보군의 평균 ESG 점수보다 높습니다.</p>	<p><b>투자방침</b> <u>이러한 대체전략에 따라</u>, 본 펀드는 광범위한 환경(E) 특성(기후변화, 자연자본, 오염 및 폐기물) 및 사회적(S) 특성(인적자본, 제3물책임, 이해관계자의 반대)을 촉진하고자 합니다. <b>[삭제됨]</b></p> <p>포트폴리오 수준에서는, <u>집합투자업자는 각 투자전략의 기초자산에 대한 가중평균 MSCI ESG 점수를 바탕으로 본 펀드의 월간 ESG 점수를 산정합니다.</u> 본 펀드는 가중평균 ESG 점수가 투자 종목(universe)의 MSCI ESG 중위값 또는 5.25점 중 높은 값을 초과하는 것을 목표로 합니다. 투자 종목은 현재 MSCI ESG 점수를 보유한 모든 발행인으로 정의됩니다. MSCI 귀속 ESG 점수가 없는 홀딩스는 본 펀드 또는 그 투자 종목의 ESG 점수에 기여하지 않습니다. 본 펀드 ESG 점수가 전술한 최소 ESG 기준에 미달하는 경우, 집합투자업자는 90일 이내에 포트폴리오를 재조정합니다. MSCI ESG 평가방법에 관한 보다 자세한 정보는 <a href="https://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/esg-ratings">https://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/esg-ratings</a>에서 확인하실 수 있습니다. <b>[삭제됨]</b></p>
제2부 10. 집합투자기구의 투자위험 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형	펀드 결산일 경과에 따른 위험등급 변동성 갱신	<p>최근 펀드 결산일(2022.6.30) 기준으로 각 하위펀드별 변동성 갱신 및 그에 따른 위험등급 조정.</p> <p>※ 위험등급 및 위험등급기준 변동 사항은 이하 &lt;참조 1&gt;을 참고하시기 바라며, 아래 기재된 하위펀드 이외에는 위험등급 변동사항이 없습니다.</p>	

주) 위 정오표는 주요 정정 사항을 나타낸 것으로서 구체적인 내용은 투자설명서 본문을 참고하시기 바랍니다.

**<참조 1> 위험등급 및 위험등급기준이 변동된 하위펀드**

하위펀드	위험등급 산정기준		회계종료일 기준 최근 3년간 연환산 표준편차		투자위험 등급	
	정정전 (2021.6.30기준)	정정후 (2022.6.30기준)	정정전 (2021.6.30기준)	정정후 (2022.6.30기준)	정정전 (2021.6.30기준)	정정후 (2022.6.30기준)
프랭클린 테크놀로지 펀드	변동성	변동성	<u>24.61%</u>	<b><u>27.19%</u></b>	<u>2</u>	<b><u>1</u></b>
프랭클린 NextStep 다이나믹 그로스 펀드	변동성	변동성	<u>14.89%</u>	<b><u>15.20%</u></b>	<u>3</u>	<b><u>2</u></b>
템플턴 차이나 펀드	변동성	변동성	<u>20.02%</u>	<b><u>27.25%</u></b>	<u>2</u>	<b><u>1</u></b>
템플턴 이스턴 유럽 펀드	변동성	변동성	<u>23.41%</u>	<b><u>28.87%</u></b>	<u>2</u>	<b><u>1</u></b>
템플턴 글로벌 인컴 펀드	변동성	변동성	<u>19.04%</u>	<b><u>13.16%</u></b>	<u>2</u>	<b><u>3</u></b>