

정 정 신 고 (보 고)

2025년 9월 24일

1. 정정대상 공시서류 : 일괄신고서

삼성ETF를 담은 TDF 증권투자신탁[채권혼합-재간접형]

2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2020. 4. 1

3. 정정 사유

- 목표 환헤지 비율 수정
- 법령 개정사항 반영 등

4. 정정요구 · 명령 관련 여부 : 아니오

5. 정정사항

| 항 목 | 정 정 전 | | 정 정 후 | | | | | | | | | |
|-------------------|--|--|-------|------------|------------|--|---|--|----|------------|------------|---|
| 요약정보 | | | | | | | | | | | | |
| 투자실적 추이 운용전문인력 | - | | 업데이트 | | | | | | | | | |
| 주요투자위험 | <table><tr><th>구분</th><th>투자위험의 주요내용</th></tr><tr><td>환율변동 위험</td><td>이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 고, 미 실현 손익에 대해서는 주 기적으로 환헷지 비율을 조정하여 최대한 환 위험을 회피하고자 합니 다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비 용, 투자수단의 유용성, 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤란한 경우에 는 달러 표시 자산 일부 또는 전체 에 대하여 환 위험에 노출될 수 있 습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에 도 (추 가) 투자신탁 설정· 해지의</td></tr></table> | | 구분 | 투자위험의 주요내용 | 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 고, 미 실현 손익에 대해서는 주 기적으로 환헷지 비율을 조정하여 최대한 환 위험을 회피하고자 합니 다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비 용, 투자수단의 유용성, 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤란한 경우에 는 달러 표시 자산 일부 또는 전체 에 대하여 환 위험에 노출될 수 있 습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에 도 (추 가) 투자신탁 설정· 해지의 | <table><tr><th>구분</th><th>투자위험의 주요내용</th></tr><tr><td>환율변동 위험</td><td>이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 고, (삭 제)주기적으로 환헷지 비율 을 조정하여 최대한 환 위험을 회피 하고자 합니다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비용, 투자수단의 유용성 , 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤 란한 경우에는 달러 표시 자산 일부 또는 전체에 대하여 환 위험에 노 출될 수 있습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에도 외환시장의 상황, 양국간의 금리차로 인한 환헷지</td></tr></table> | | 구분 | 투자위험의 주요내용 | 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 고, (삭 제) 주기적으로 환헷지 비율 을 조정하여 최대한 환 위험을 회피 하고자 합니다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비용, 투자수단의 유용성 , 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤 란한 경우에는 달러 표시 자산 일부 또는 전체에 대하여 환 위험에 노 출될 수 있습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에도 외환시장의 상황, 양국간의 금리차로 인한 환헷지 |
| 구분 | 투자위험의 주요내용 | | | | | | | | | | | |
| 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 고, 미 실현 손익에 대해서는 주 기적으로 환헷지 비율을 조정하여 최대한 환 위험을 회피하고자 합니 다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비 용, 투자수단의 유용성, 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤란한 경우에 는 달러 표시 자산 일부 또는 전체 에 대하여 환 위험에 노출될 수 있 습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에 도 (추 가) 투자신탁 설정· 해지의 | | | | | | | | | | | |
| 구분 | 투자위험의 주요내용 | | | | | | | | | | | |
| 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 고, (삭 제) 주기적으로 환헷지 비율 을 조정하여 최대한 환 위험을 회피 하고자 합니다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비용, 투자수단의 유용성 , 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤 란한 경우에는 달러 표시 자산 일부 또는 전체에 대하여 환 위험에 노 출될 수 있습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에도 외환시장의 상황, 양국간의 금리차로 인한 환헷지 | | | | | | | | | | | |

| 항 목 | 정 정 전 | | 정 정 후 | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|---|--|--|--|-------|--|---------|---|---|--|----|----------|--------|---|---------|--|
| | | 반복, 가격변동, 최소 환헷지 거래 규모 등으로 인하여, 이 투자신탁에서 투자하는 달러 표시 자산의 환위험에 대하여 100% 헷지를 하는 것은 불가능하기 때문에 달러 표시 순자산액±일정 범위에서 환헷지가 이루어집니다. 이에 따라 환헷지를 하는 경우에도 달러 표시 순자산액에 미달되거나 초과되는 부분은 환율변동위험에 노출됩니다. 이 투자신탁은 외화자산을 편입하고 있는 원화 표시 자산에 대해서는 환헷지를 수행하지 않아 실질적으로 환율 변동위험에 노출되어 있습니다. | | 효율성 저하, 투자신탁 설정·해지의 반복, 가격변동, 최소 환헷지 거래규모 등으로 인하여 운용역의 판단으로 환헷지 전략을 실시하지 않거나 환헷지 비율을 조정할 수 있습니다. 운용역의 판단으로 투자대상자산의 100%에 대한 헷지를 목표로 하는 경우에도 투자대상 자산의 가치 변동으로 인해 운용기간 중 일정하게 100% 환헷지 효과를 기대하기는 어려울 수 있습니다. 이 투자신탁은 외화자산을 편입하고 있는 원화 표시 자산에 대해서는 환헷지를 수행하지 않아 실질적으로 환율 변동위험에 노출되어 있습니다. | | | | | | | | | | | | |
| 제2부. 집합투자기구에 관한 사항 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5. 운용전문인력 | - | | 업데이트 | | | | | | | | | | | | | |
| 7. 집합투자기구의 투자목적 | 다. 이 투자신탁은 미달러 표시자산에의 투자로 인해 발생하는 환율변동 위험을 회피하기 위하여 달러화를 활용한 원화-달러화 환헷지 전략을 기본적으로 실시할 계획입니다. 그러나, 환헷지 수단인 통화 관련 장내 또는 장외파생상품의 급격한 가격 변동 및 외환관련 파생시장 혼란 발생시 등에는 헷지 거래가 전액 또는 일부 실행되지 못할 수 있습니다. 아울러, 외환시장의 상황, 투자신탁의 규모, 해당 통화거래의 기초조건 및 환헷지 수단 (추 가) 등의 영향으로 투자신탁재산 일부 또는 전부가 환위험에 노출될 수 있으며, 또한 이러한 외부적인 요건을 고려하여 운용역의 판단으로 (추 가) 일정 기간 환위험에 노출될 수 있습니다. | | 다. 이 투자신탁은 미달러 표시자산에의 투자로 인해 발생하는 환율변동 위험을 회피하기 위하여 달러화를 활용한 원화-달러화 환헷지 전략을 기본적으로 실시할 계획입니다. 그러나, 환헷지 수단인 통화 관련 장내 또는 장외파생상품의 급격한 가격 변동 및 외환관련 파생시장 혼란 발생시 등에는 헷지 거래가 전액 또는 일부 실행되지 못할 수 있습니다. 아울러, 외환시장의 상황, 투자신탁의 규모, 해당 통화거래의 기초조건 및 환헷지 수단 및 국가 간 금리차에 따른 FX 스왑포인트(프리미엄, 디스카운트) 등의 영향으로 투자신탁재산 일부 또는 전부가 환위험에 노출될 수 있으며, 또한 이러한 외부적인 요건을 고려하여 운용역의 판단으로 환헷지 전략을 실시하지 않거나 환헷지 비율을 조정할 수 있어 일정 기간 환위험에 노출될 수 있습니다. | | | | | | | | | | | | | |
| 8. 집합투자기구의 투자대상 | 나. 투자 제한 <table><tr><th>구분</th><th>투자제한의 내용</th></tr><tr><td>(추 가)</td><td></td></tr><tr><td>투자한도 초과</td><td>아래의 사유로 인하여 불가피하게 위의 투자한도(이해관계인과의 거래 제한 제외)를 초과하게 된 경우에는 초과일부터 3월 이내에 그 투자한도에 적합하도록 하여야 한다. 다만, 부도 등으로 처분이 불가능하거나 투자신탁재산에 현저한 손실을 초래하지 아니하고는 처분</td></tr></table> | | 구분 | 투자제한의 내용 | (추 가) | | 투자한도 초과 | 아래의 사유로 인하여 불가피하게 위의 투자한도(이해관계인과의 거래 제한 제외)를 초과하게 된 경우에는 초과일부터 3월 이내에 그 투자한도에 적합하도록 하여야 한다. 다만, 부도 등으로 처분이 불가능하거나 투자신탁재산에 현저한 손실을 초래하지 아니하고는 처분 | 나. 투자 제한 <table><tr><th>구분</th><th>투자제한의 내용</th></tr><tr><td>파생상품매매</td><td>파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 가액의 100분의 100을 초과하여 투자하는 행위</td></tr><tr><td>투자한도 초과</td><td>아래의 사유로 인하여 불가피하게 위의 투자한도(이해관계인과의 거래 제한 제외)를 초과하게 된 경우에는 초과일부터 3개월 까지(부도 등으로 처분이 불가능하거나 투자신탁재산에 현저한 손실을 초래하지 않으면 처분이 불가능한 투자대상 자산은 그 처분이 가능한 시</td></tr></table> | | 구분 | 투자제한의 내용 | 파생상품매매 | 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 가액의 100분의 100을 초과하여 투자하는 행위 | 투자한도 초과 | 아래의 사유로 인하여 불가피하게 위의 투자한도(이해관계인과의 거래 제한 제외)를 초과하게 된 경우에는 초과일부터 3개월 까지(부도 등으로 처분이 불가능하거나 투자신탁재산에 현저한 손실을 초래하지 않으면 처분이 불가능한 투자대상 자산은 그 처분이 가능한 시 |
| 구분 | 투자제한의 내용 | | | | | | | | | | | | | | | |
| (추 가) | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 투자한도 초과 | 아래의 사유로 인하여 불가피하게 위의 투자한도(이해관계인과의 거래 제한 제외)를 초과하게 된 경우에는 초과일부터 3월 이내에 그 투자한도에 적합하도록 하여야 한다. 다만, 부도 등으로 처분이 불가능하거나 투자신탁재산에 현저한 손실을 초래하지 아니하고는 처분 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 구분 | 투자제한의 내용 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 파생상품매매 | 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 가액의 100분의 100을 초과하여 투자하는 행위 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 투자한도 초과 | 아래의 사유로 인하여 불가피하게 위의 투자한도(이해관계인과의 거래 제한 제외)를 초과하게 된 경우에는 초과일부터 3개월 까지(부도 등으로 처분이 불가능하거나 투자신탁재산에 현저한 손실을 초래하지 않으면 처분이 불가능한 투자대상 자산은 그 처분이 가능한 시 | | | | | | | | | | | | | | | |

| 항 목 | 정 정 전 | | 정 정 후 | | | | | | | | | |
|-------------------------------|---|--|-------|---------------------------|---|--|---|----------------|----|------------|---------|--|
| | | 이 불가능한 투자대상자산은 그 처분이 가능한 시기까지 이를 그 투자한도에 적합한 것으로 본다. | | 기까지)는 그 투자한도에 적합한 것으로 본다. | | | | | | | | |
| 9. 집합투자기구의 투자전략, 투자방침 및 수익 구조 | <p>가. 투자 전략 및 위험 관리</p> <p>(5) 이 투자신탁은 미달러 표시자산에의 투자로 인해 발생하는 환율변동 위험을 회피하기 위하여 미달러화를 활용한 원화-달러화 환헷지 전략을 기본적으로 실시할 계획입니다. 그러나, 환헷지 수단인 통화 관련 통화 관련 장내파생상품[주로 선물(Futures)]또는 장외파생상품[주로 선물환(Forward)]의 급격한 가격 변동 및 외환 관련 파생시장 혼란 발생시 등에는 헷지 거래가 전액 또는 일부 실행되지 못할 수 있습니다. 아울러, 외환시장의 상황, 투자신탁의 규모, 해당 통화 거래의 기초여건 및 환헷지 수단 (추 가) 등의 영향으로 미달러 표시자산 일부 또는 전부가 환위험에 노출될 수 있으며, 또한 이러한 외부적인 요건을 고려하여 운용역의 판단으로 (추 가) 일정 기간 환위험에 노출될 수 있습니다.</p> <p>(7) 환헷지란__실시할 경우 거래 수수료 또는 추가적인 비용이 소요됩니다. (추 가)</p> <p>(8) 이 투자신탁의 환헷지 전략에 따른 목표 환헷지 비율과 환헷지가 수익률에 미치는 효과는 아래와 같습니다.</p> <table><tr><td>목표</td></tr><tr><td>달러표시자산의 80-110</td></tr></table> | | 목표 | 달러표시자산의 80-110 | <p>가. 투자 전략 및 위험 관리</p> <p>(5) 이 투자신탁은 미달러 표시자산에의 투자로 인해 발생하는 환율변동 위험을 회피하기 위하여 미달러화를 활용한 원화-달러화 환헷지 전략을 기본적으로 실시할 계획입니다. 그러나, 환헷지 수단인 통화 관련 통화 관련 장내파생상품[주로 선물(Futures)]또는 장외파생상품[주로 선물환(Forward)]의 급격한 가격 변동 및 외환 관련 파생시장 혼란 발생시 등에는 헷지 거래가 전액 또는 일부 실행되지 못할 수 있습니다. 아울러, 외환시장의 상황, 투자신탁의 규모, 해당 통화 거래의 기초여건 및 환헷지 수단및 국가 간 금리차에 따른 FX 스왑포인트(프리미엄, 디스카운트) 등의 영향으로 미달러 표시자산 일부 또는 전부가 환위험에 노출될 수 있으며, 또한 이러한 외부적인 요건을 고려하여 운용역의 판단으로 환헷지 전략을 실시하지 않거나 환헷지 비율을 조정할 수 있어 일정 기간 환위험에 노출될 수 있습니다.</p> <p>(7) 환헷지란__실시할 경우 거래 수수료 또는 추가적인 비용이 소요됩니다. 이 투자신탁은 달러표시자산에 대하여 운용역의 판단으로 목표 환헷지 비율을 60~110 % 이내에서 조정할 수 있습니다. 환노출도를 높여서 운용할 경우 국가간 금리차에 따른 FX 스왑포인트(프리미엄, 디스카운트)가 적게 부과된다는 장점이 있으나, 달러표시 자산이 환율변동위험에 노출된다는 단점이 있습니다. 반면 환헷지비율을 높여서 운용할 경우 환율변동으로 인한 투자신탁재산의 위험이 방지되는 장점이 있으나, 국가간 금리차에 따른 FX 스왑포인트(프리미엄, 디스카운트)가 보다 크게 부과될 수 있다는 단점이 있으니 유의하시기 바랍니다.</p> <p>(8) 이 투자신탁의 환헷지 전략에 따른 목표 환헷지 비율과 환헷지가 수익률에 미치는 효과는 아래와 같습니다.</p> <table><tr><td>목표</td></tr><tr><td>달러표시자산의 60-110</td></tr></table> | | 목표 | 달러표시자산의 60-110 | | | | |
| 목표 | | | | | | | | | | | | |
| 달러표시자산의 80-110 | | | | | | | | | | | | |
| 목표 | | | | | | | | | | | | |
| 달러표시자산의 60-110 | | | | | | | | | | | | |
| 10. 집합투자기구의 투자위험 | <p>나. 특수위험</p> <table><tr><td>구분</td><td>투자위험의 주요내용</td></tr><tr><td>환율변동 위험</td><td>이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하</td></tr></table> | | 구분 | 투자위험의 주요내용 | 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 | <p>나. 특수위험</p> <table><tr><td>구분</td><td>투자위험의 주요내용</td></tr><tr><td>환율변동 위험</td><td>이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하</td></tr></table> | | 구분 | 투자위험의 주요내용 | 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 |
| 구분 | 투자위험의 주요내용 | | | | | | | | | | | |
| 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 | | | | | | | | | | | |
| 구분 | 투자위험의 주요내용 | | | | | | | | | | | |
| 환율변동 위험 | 이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래를 통해 달러 표시 자산에 대한 환위험을 회피하는 것을 목표로 하 | | | | | | | | | | | |

| 항 목 | 정 정 전 | 정 정 후 |
|---------------------------------|---|---|
| | <p>고, 미 실현 손익에 대해서는 주기적으로 환헷지 비율을 조정하여 최대한 환 위험을 회피하고자 합니다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비용, 투자수단의 유용성, 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤란한 경우에는 달러 표시 자산 일부 또는 전체에 대하여 환 위험에 노출될 수 있습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에도 (추 가) 투자신탁 설정·해지의 반복, 가격변동, 최소 환헷지 거래 규모 등으로 인하여, 이 투자신탁에서 투자하는 달러 표시 자산의 환위험에 대하여 100% 헷지 하는 것은 불가능하기 때문에 달러 표시 순자산액±일정 범위에서 환헷지가 이루어집니다. 이에 따라 환헷지를 하는 경우에도 달러 표시 순자산액에 미달되거나 초과되는 부분은 환율변동위험에 노출됩니다. 이 투자신탁은 외화자산을 편입하고 있는 원화 표시 자산에 대해서는 환헷지를 수행하지 않아 실질적으로 환율 변동위험에 노출되어 있습니다.</p> | <p>고, (삭 제)주기적으로 환헷지 비율을 조정하여 최대한 환 위험을 회피하고자 합니다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비용, 투자수단의 유용성, 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수 등에 따라 환 위험을 회피하기 곤란한 경우에는 달러 표시 자산 일부 또는 전체에 대하여 환 위험에 노출될 수 있습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에도 외환시장의 상황, 양국간의 금리차로 인한 환헷지 효율성 저하, 투자신탁 설정·해지의 반복, 가격변동, 최소 환헷지 거래규모 등으로 인하여 운용역의 판단으로 환헷지 전략을 실시하지 않거나 환헷지 비율을 조정할 수 있습니다. 운용역의 판단으로 투자대상 자산의 100%에 대한 헷지를 목표로 하는 경우에도 투자대상 자산의 가치 변동으로 인해 운용기간 중 일정하게 100% 환헷지 효과를 기대하기는 어려울 수 있습니다. 이 투자신탁은 외화자산을 편입하고 있는 원화 표시 자산에 대해서는 환헷지를 수행하지 않아 실질적으로 환율 변동위험에 노출되어 있습니다.</p> |
| 제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항 | | |
| 3. 집합투자기구의 운용실적 | - | 업데이트 |
| 제4부. 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항 | | |
| 1. 집합투자업자에 관한 사항 | 라. 운용자산규모 - | 라. 운용자산규모 업데이트 |
| 제5부. 기타 투자자보호를 위해 필요한 사항 | | |
| 3. 집합투자기구의 공시에 관한 사항 | <p>나. 수시공시 (2) 수시공시 다음에서 정하는 사항이 발생한 경우 지체없이 집합투자업자 __영업소에 게시 및 전자우편을 이용하여 수익자에게 통보하여야 합니다. 1) ~ 6) (생략) 7) 집합투자업자 또는 일반사무관리회사가 기준가격을 잘못 산정하여 이를 변경하는 경우 그 내용 (추 가)</p> | <p>나. 수시공시 (2) 수시공시 다음에서 정하는 사항이 발생한 경우 지체없이 집합투자업자 __영업소에 게시 및 전자우편을 이용하여 수익자에게 통보하여야 합니다. 1) ~ 6) (생략) 7) 집합투자업자 또는 일반사무관리회사가 기준가격을 잘못 산정하여 이를 변경하는 경우 그 내용(법시행령 제262조제1항 후단에 따라 공고·게시하는 경우에 한한다)</p> |