

정 정 신 고 (보 고)

2022년 3월 23일

1. 정정대상 공시서류 : 일괄신고서

삼성퇴직연금OCIO솔루션밸런스증권투자신탁[채권혼합-재간접형]

2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2019.7.12

3. 정정 사유

- 투자신탁 명칭 변경(삼성 퇴직연금 TLF 7 증권투자신탁[채권혼합-재간접형]→삼성퇴직연금OCIO솔루션밸런스증권투자신탁[채권혼합-재간접형])
- 세부 운용전략 변경(듀레이션 범위 6~8년→4~8년)
- 법령 개정사항 반영

4. 정정사항

항 목	정 정 전	정 정 후				
펀드명	삼성 퇴직연금 TLF 7 증권투자신탁[채권혼합-재간접형]	삼성퇴직연금OCIO솔루션밸런스증권투자신탁[채권혼합-재간접형]				
요약정보						
투자실적추이 (연평균 수익률)	-	업데이트				
운용전문인력	-	업데이트				
제2부. 집합투자기구에 관한 사항						
2. 집합투자기 구의 연혁	(추 가)	<table><tr><th>변경시행일</th><th>변경사항</th></tr><tr><td>2022. 3.30</td><td>투자신탁 명칭 변경(삼성 퇴직 연금TLF7증권투자신탁[채권혼 합-재간접형]→삼성퇴직연금 OCIO솔루션밸런스증권투자신탁 [채권혼합-재간접형]) 및 세 부 운용전략 변경(듀레이션 범 위 6~8년→4~8년)</td></tr></table>	변경시행일	변경사항	2022. 3.30	투자신탁 명칭 변경(삼성 퇴직 연금TLF7증권투자신탁[채권혼 합-재간접형]→삼성퇴직연금 OCIO솔루션밸런스증권투자신탁 [채권혼합-재간접형]) 및 세 부 운용전략 변경(듀레이션 범 위 6~8년→4~8년)
		변경시행일	변경사항			
2022. 3.30	투자신탁 명칭 변경(삼성 퇴직 연금TLF7증권투자신탁[채권혼 합-재간접형]→삼성퇴직연금 OCIO솔루션밸런스증권투자신탁 [채권혼합-재간접형]) 및 세 부 운용전략 변경(듀레이션 범 위 6~8년→4~8년)					
5. 운용전문인	가. 운용전문인력 현황	가. 운용전문인력 현황				

항 목	정 정 전	정 정 후
력	-	업데이트
8. 집합투자기 구의 투자대상	가. 투자대상 (추 가)	가. 투자대상 집합투자업자는 투자신탁자산을 다음의 투 자대상(투자대상 중 자본시장법 제4조에 따 른 증권에 대하여는 그 증권에 표시될 수 있 거나 표시되어야 할 권리가 전자증권법에 따 라 전자등록된 경우 해당 권리를 포함한다. 이하 같다) 및 투자 방법으로 운용합니다.
9. 집합투자기 구의 투자전략, 투자방침 및 수익구조	가. 투자 전략 및 위험 관리 (2)세부운용전략 1)이 투자신탁은 포트폴리오의 듀레이션을 7년 으로 유지함을 그 목표로 하여 기준수익률 및 듀레이션을 고려하여 산출된 기대수익률에서 위험지표 및 시장상황 등을 종합적으로 고려하 여 최종 자산배분안을 결정합니다. 2) 국내 채권 관련 자산의 투자비중을 투자신탁 재산의 60%이상의 범위에서, 그 외 해외 채권, 국내외 주식 및 대체자산 관련 자산의 비중을 4 0%이내의 범위에서 자산배분 합니다. (3) 운용 프로세스 1) 투자목표 분석 - 듀레이션 (7년, 허용범위 ± 1년 이내) 및 기대수익률에 대한 목표를 설정하고 이에 맞는 투자대상자산을 설정합니다. 2)~3) (생략) 4) 포트폴리오 구축 ① 부채연계 포트폴리오 - 퇴직연금 확정급여형(DB) 부채 듀레이션(7 년)과 유사한 듀레이션을 가지는 국내 채권 자 산을 편입하여, 퇴직부채 변동과 연계 될 수 있 는 포트폴리오	가. 투자 전략 및 위험 관리 (2)세부운용전략 1)이 투자신탁은 포트폴리오의 국내 채권 듀레 이션 7년을 기준 듀레이션으로 운용하며, 금리 시장환경에 따라 안정적으로 운용하기 위해 4~8년 수준의 듀레이션 허용 범위 내에서 금리 상승 리스크 제어 및 탄력적 운용을 하 고자 합니다. 또한, 기준수익률 및 듀레이션을 고려하여 산출된 기대수익률에서 위험지표 및 시장상황 등을 종합적으로 고려하여 최종 자산 배분안을 결정합니다. 2) 국내 채권 관련 자산의 투자비중을 투자신탁 재산의 60%이상의 범위에서, 그 외 해외 채권, 국내외 주식 및 대체자산 관련 자산의 비중을 4 0%이내의 범위에서 자산배분 합니다. (3) 운용 프로세스 1) 투자목표 분석 기준 듀레이션 7년(허용범위 4년~8년) 및 기 대수익률에 대한 목표를 설정하고 이에 맞는 투 자대상자산을 설정합니다. 2)~3) (현행과 같음) 4) 포트폴리오 구축 ① 부채연계 포트폴리오 - 퇴직연금 확정급여형(DB) 부채 듀레이션(7 년) 및 금리시장 환경 등을 반영한 듀레이션 (4년~8년) 이 구성될 수 있도록 국내 채권 자산 을 편입하여, 퇴직부채 변동과 연계 될 수 있는 포트폴리오
제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항		
3. 집합투자기 구의 운용실적	-	업데이트
제4부. 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항		
1. 집합투자업 자에 관한 사항	라. 운용자산 규모	라. 운용자산 규모 업데이트
제5부. 기타 투자자보호를 위해 필요한 사항		
1. 투자자의 권 리에 관한 사항	가. 수익자총회 (3) 수익자총회 결의사항 수익자총회는 법령 또는 신탁계약에서 정한 사 항에 대하여만 의결할 수 있습니다. 법령에서 정하고 있는 사항은 다음과 같으며 그 이외에 이 투자신탁의 신탁계약에서 별도로 정하고 있 는 수익자총회 결의사항은 없습니다. 1) (생략)	가. 수익자총회 (3) 수익자총회 결의사항 수익자총회는 법령 또는 신탁계약에서 정한 사 항에 대하여만 의결할 수 있습니다. 법령에서 정 하고 있는 사항은 다음과 같으며 그 이외에 이 투자신탁의 신탁계약에서 별도로 정하고 있는 수익자총회 결의사항은 없습니다. 1) (생략)

항 목	정 정 전	정 정 후
	<p>2) 신탁업자의 변경(합병, 분할, 분할합병, 법 시행령 제216조에서 정한 각 사유 제외) (추 가)</p> <p>3) ~ 5) (생략)</p> <p>6) 집합투자업자의 합병·분할·분할합병, 금융위원회의 조치 또는 명령에 따른 집합투자업자의 변경이 아닌 집합투자업자의 변경 (추 가)</p>	<p>2) 신탁업자의 변경(합병, 분할, 분할합병, 법 시행령 제216조에서 정한 각 사유 제외). 다만, 신탁업자의 중대한 법 위반 외의 사유로 신탁업자가 객관적이고 합리적인 이유 없이 변경될 경우 신탁업자는 그러한 수익자총회의 결의일로부터 직전 180일(이하 "손실보상기간") 동안 매일의 투자신탁 순자산총액을 누적하여 합한 금액을 손실보상기간 일수로 나눈 평균가액에 신탁업자보수율과 손실보상기간의 일수를 곱한 금액(이하 "신탁업자 손실보상금")을 수익자총회 결의일로부터 10영업일 이내 투자신탁재산에서 인출한다. 신탁업자 변경에 따른 신탁업자손실보상금 인출은 신탁업자의 판단 및 결정 하에 이루어지는 것이며, 집합투자업자는 신탁업자의 손실보상금 인출이 원만하게 이루어질 수 있도록 협조를 다한다.</p> <p>3) ~ 5) (생략)</p> <p>6) 집합투자업자의 합병·분할·분할합병, 금융위원회의 조치 또는 명령에 따른 집합투자업자의 변경이 아닌 집합투자업자의 변경. 다만, 집합투자업자의 중대한 법 위반 외의 사유로 집합투자업자가 객관적이고 합리적인 이유 없이 변경될 경우, 집합투자업자는 손실보상기간 동안 매일의 투자신탁 순자산총액을 누적하여 합한 금액을 손실보상기간 일수로 나눈 평균가액에 집합투자업자보수율과 손실보상기간의 일수를 곱한 금액과 집합투자업자가 투자신탁 설정과 관련하여 집합투자업자 고유재산으로 지급했거나 지급할 것이 예정되어 있는 비용(법률자문료 등)의 합(이하 "집합투자업자 손실보상금")을 수익자총회 결의일로부터 10영업일 이내 투자신탁재산에서 인출한다. 집합투자업자 변경에 따른 집합투자업자 손실보상금 인출은 집합투자업자의 판단 및 결정 하에 이루어지는 것이며, 신탁업자는 집합투자업자의 손실보상금 인출이 원만하게 이루어질 수 있도록 협조를 다한다.</p>
3. 집합투자기구의 공시에 관한 사항	<p>가. 정기보고서 (2) 자산운용보고서</p> <p>1) 집합투자업자는 자산운용보고서를 작성하여 신탁업자의 확인을 받아 3 개월마다 1 회 이상 당해 수익자에게 교부하여야 합니다. 자산운용보고서를 교부하는 경우에는 수익증권을 판매한 판매회사 또는 전자등록기관을 통하여 기준일로부터 2 개월 이내에 직접 또는 전자우편의 방법으로 교부하여야 합니다.</p> <p>다만, (추 가) 수익자에게 전자우편 주소가 없는 등의 경우에는 집합투자업자·판매회사 및 한국금융투자협회의 인터넷 홈페이지 공시와 집합투자업자·판매회사의 본·지점 및 영</p>	<p>가. 정기보고서 (2) 자산운용보고서</p> <p>1) 집합투자업자는 자산운용보고서를 작성하여 신탁업자의 확인을 받아 3 개월마다 1 회 이상 당해 수익자에게 교부하여야 합니다. 자산운용보고서를 교부하는 경우에는 수익증권을 판매한 판매회사 또는 전자등록기관을 통하여 기준일로부터 2 개월 이내에 직접, 전자우편 또는 이와 비슷한 전자통신의 방법으로 교부하여야 합니다.</p> <p>다만, 투자자가 해당 집합투자기구에 투자한 금액이 100만원 이하이거나 수익자에게 전자우편 주소가 없는 등의 경우에는 집합투자업자·판매회사 및 한국금융투자협회의 인터넷 홈페이지</p>

항 목	정 정 전	정 정 후
	<p>업소에 게시하는 방법에 따라 공시하는 것으로 갈음할 수 있으며, 수익자가 우편발송을 원하는 경우에는 우편발송으로 교부하여야 합니다.</p>	<p>이지를 이용하여 공시하는 것으로 갈음할 수 있으며, 수익자가 우편발송을 원하는 경우에는 우편발송으로 교부하여야 합니다.</p>
3. 집합투자기구의 공시에 관한 사항	<p>나. 수시공시</p> <p>(1) 신탁계약 변경에 관한 공시</p> <p>1) 집합투자업자는 신탁계약을 변경하고자 하는 경우에는 신탁업자와 변경계약을 체결하여야 합니다. 이 경우 신탁계약 중 다음에 해당하는 사항의 변경은 수익자총회의 결의를 거쳐야 합니다.</p> <p>① (생략)</p> <p>② 신탁업자의 변경(합병, 분할, 분할합병, 법 시행령 제216조에서 정한 각 사유 제외) (추가)</p> <p>③ ~ ⑤ (생략)</p> <p>⑥ 집합투자업자의 합병·분할·분할합병, 금융위원회의 조치 또는 명령에 따른 집합투자업자의 변경이 아닌 집합투자업자의 변경 (추가)</p> <p>(2) 수시공시</p> <p>2) 환매연기 또는 환매재개의 결정 및 그 사유</p> <p>3) ~ 4) (생략)</p> <p>5) 투자설명서의 변경. 다만, 법령 등의 개정 또는 금융위원회의 명령에 따라 변경하거나 신탁계약의 변경에 의한 투자설명서 변경, 단순한 자구수정 등 경미한 사항을 변경하는 경우는 제외</p>	<p>나. 수시공시</p> <p>(1) 신탁계약 변경에 관한 공시</p> <p>1) 집합투자업자는 신탁계약을 변경하고자 하는 경우에는 신탁업자와 변경계약을 체결하여야 합니다. 이 경우 신탁계약 중 다음에 해당하는 사항의 변경은 수익자총회의 결의를 거쳐야 합니다.</p> <p>① (생략)</p> <p>② 신탁업자의 변경(합병, 분할, 분할합병, 법 시행령 제216조에서 정한 각 사유 제외). 다만, 신탁업자의 중대한 법 위반 외의 사유로 신탁업자가 객관적이고 합리적인 이유 없이 변경될 경우 신탁업자는 손실보상기간 동안의 신탁업자 손실보상금을 수익자총회 결의일로부터 10영업일 이내 투자신탁재산에서 인출한다. 신탁업자 변경에 따른 신탁업자손실보상금 인출은 신탁업자의 판단 및 결정 하에 이루어지는 것이며, 집합투자업자는 신탁업자의 손실보상금 인출이 원만하게 이루어질 수 있도록 협조를 다한다.</p> <p>③ ~ ⑤ (생략)</p> <p>⑥ 집합투자업자의 합병·분할·분할합병, 금융위원회의 조치 또는 명령에 따른 집합투자업자의 변경이 아닌 집합투자업자의 변경. 다만, 집합투자업자의 중대한 법 위반 외의 사유로 집합투자업자가 객관적이고 합리적인 이유 없이 변경될 경우, 집합투자업자는 손실보상기간 동안의 집합투자업자 손실보상금을 수익자총회 결의일로부터 10영업일 이내 투자신탁재산에서 인출한다. 집합투자업자 변경에 따른 집합투자업자 손실보상금 인출은 집합투자업자의 판단 및 결정 하에 이루어지는 것이며, 신탁업자는 집합투자업자의 손실보상금 인출이 원만하게 이루어질 수 있도록 협조를 다한다.</p> <p>(2) 수시공시</p> <p>2) 환매연기 또는 환매재개의 결정 및 그 사유(법 제230조에 따른 환매금지형집합투자기구의 만기를 변경하거나 만기상환을 거부하는 결정 및 그 사유를 포함한다)</p> <p>3) ~ 4) (생략)</p> <p>5) 투자설명서의 변경. 다만, 다음 각 목의 어느 하나에 해당하는 경우는 제외한다.</p> <p>가. 법 및 법시행령의 개정 또는 금융위원회의 명령에 따라 투자설명서를 변경하는 경우</p> <p>나. 집합투자계약의 변경에 따라 투자설명서를 변경하는 경우</p> <p>다. 투자설명서의 단순한 자구수정 등 경미</p>

항 목	정 정 전	정 정 후
		<p>한 사항을 변경하는 경우 라. 투자운용인력의 변경이 있는 경우로서 법 제123조제3항제2호에 따라 투자설명서 를 변경하는 경우</p>