

변경 대비표

□ 대상펀드명 : 트러스톤 인덱스알파 증권투자신탁[주식-파생형]

□ 변경 사항 : ① 제12기 재무제표 확정에 따른 갱신
 ② 자본시장법 및 시행령 개정사항 반영
 ③ 기업공시서식 개정사항 반영
 ④ 집합투자기구의 투자위험 기재 보완

□ 효력발생일 : 2022. 10. 7.

□ 변경 내용

항 목	정정사유	정 정 전	정 정 후
투자결정시 유의사항 안내			
투자결정시 유의사항 안내	기업공시서식 작성기준 반영	10. 집합투자기구가 설정 후 1 년이 경과하였음에도 설정액이 50 억원 미만(소규모펀드)인 경우 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하거나 임의해지 될 수 있으니, 투자 시 소규모펀드 여부를 확인해야 하며 소규모펀드 해당여부는 금융투자협회, 판매회사, 자산운용사 홈페이지에서 확인할 수 있습니다.	10. 집합투자기구가 설정 후 1 년(성과보수를 수취하거나, <u>고유재산 투자금이 일정 액수 이상인 집합투자기구의 경우 2 년</u>)이 되는 날에 <u>설정액이 50 억원 미만인 경우 소규모펀드로서</u> 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하거나 임의해지 될 수 있으니, 투자 시 소규모펀드 여부를 확인해야 하며 소규모펀드 해당여부는 금융투자협회, 판매회사, 자산운용사 홈페이지에서 확인할 수 있습니다.

요약정보

투자비용	동종유형 총보수 최근 기준으로 기재 제 12 기 재무제표 확정 에 따른 갱신	2022. 3. 31. 기준 -	2022. 8. 31. 기준 2022. 9. 6. 기준
투자실적추이 (연평균 수익률)	제 12 기 재무제표 확정 에 따른 갱신	-	2022. 9. 6. 기준
운용전문인력	최근 기준으로 기재	2022. 4. 30. 기준	2022. 8. 31. 기준



트러스톤자산운용

투자자 유의사항	기업공시서식 작성기준 반영	집합투자기구가 설정 후 1년이 경과하였음에도 설정액이 50 억원 미만(소규모펀드)인 경우 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하거나 임의해지 될 수 있으니, 투자 시 소규모펀드 여부를 확인해야 하며 소규모펀드 해당여부는 금융투자협회, 판매회사, 자산운용사 홈페이지에서 확인할 수 있습니다.	집합투자기구가 설정 후 1년(성과보수를 수취하거나, 고유재산 투자금이 일정 액수 이상인 집합투자기구의 경우 2 년)이 되는 날에 설정액이 50 억원 미만인 경우 소규모펀드로서 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하거나 임의해지 될 수 있으니, 투자 시 소규모펀드 여부를 확인해야 하며 소규모펀드 해당여부는 금융투자협회, 판매회사, 자산운용사 홈페이지에서 확인할 수 있습니다.
매입방법	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	15 시 30 분 이전: 제 2 영업일 기준가격으로 매입 15 시 30 분 경과후: 제 3 영업일 기준가격으로 매입	15 시 30 분 이전: 2 영업일 기준가격으로 매입 15 시 30 분 경과후: 3 영업일 기준가격으로 매입
환매방법	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	15 시 30 분 이전: 제 2 영업일 기준가격으로 제 4 영업일에 지급 15 시 30 분 경과후: 제 3 영업일 기준가격으로 제 4 영업일에 지급	15 시 30 분 이전: 2 영업일 기준가격으로 4 영업일에 지급 15 시 30 분 경과후: 3 영업일 기준가격으로 4 영업일에 지급

제 2 부 집합투자기구에 관한 사항

2. 집합투자기구의 연혁 [이 투자신탁이 투자하는 모투자신탁의 연혁]	모투자신탁 연혁 업데이트	〈신 설〉	- 트러스톤인덱스알파증권모투자신탁[주식-파생형] 2022.06.30 : 자투자신탁 추가 - 트러스톤 TDF2030 증권자투자신탁[혼합-재간접형] - 트러스톤 TDF2040 증권자투자신탁[혼합-재간접형] - 트러스톤 TDF2050 증권자투자신탁[혼합-재간접형]
---	---------------	-------	---



5. 운용전문인력 가. 운용전문인력 나. 운용중인 집합투자 기구에 관한 사항	최근 기준으로 기재	2022. 4. 30. 기준	2022. 8. 31. 기준
8. 집합투자기구의 투 자대상 가. 투자 대상 [이 투자신탁이 투자 하는 모투자신탁의 주 요 투자 대상]	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	주택저당채권유동화회사법 가)(생략) 나) 다음에 해당하는 사유 로 불가피하게 위의 5)~10)의 투자한도를 초과 하는 경우에는 초과일부터 3 개월까지(부도 등으로 처분 이 불가능한 투자대상자산은 그 처분이 가능한 시기까지) 는 그 투자한도에 적합한 것 으로 봄 ① ~ ⑤(생략)	〈삭제〉 가)(현행과 같음) 나) 다음에 해당하는 사유 로 불가피하게 위의 5)~10)의 투자한도를 초과 하는 경우에는 초과일부터 3 개월까지(부도 등으로 처분 이 불가능한 투자대상자산은 그 처분이 가능한 시기까지) <u>로 하며, 금융투자업규정 제 4-54 조 2 규정에 대한 집합 투자기구의 집합투자재산의 경우는 6 개월까지(법 시행 령 제 81 조제 3 항제 3 호의 경우 이를 따른다))는 그 투 자한도에 적합한 것으로 봄</u> ① ~ ⑤(현행과 같음)
8. 집합투자기구의 투 자대상 나. 투자제한 [이 투자신탁이 투자 하는 모투자신탁의 주 자제한]	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	주택저당채권유동화회사법 <u>주택저당채권유동화회사법에 따른 주택저당채권유동화회 사</u> 다음의 해당하는 경우에는 투자비율을 적용하지 아니함 (가) 다음에 해당하는 사유 로 불가피하게 위의 2),3),4),5)의 투자한도를 초과하는 경우에는 초과일부 터 3개월까지(부도 등으로 처분이 불가능한 투자대상자 산은 그 처분이 가능한 시기	〈삭제〉 〈삭제〉 다음의 해당하는 경우에는 투자비율을 적용하지 아니함 (가) 다음에 해당하는 사유 로 불가피하게 위의 2),3),4),5)의 투자한도를 초과하는 경우에는 초과일부 터 3개월까지(부도 등으로 처분이 불가능한 투자대상자 산은 그 처분이 가능한 시기

		까지)는 그 투자한도에 적합한 것으로 봄 ① ~ ⑤ (생략) (나) (생략)	까지로 하며, 금융투자업규정 제4-54조2 규정에 대한 집합투자기구의 집합투자재산의 경우는 6개월까지(법시행령 제81조제3항제3호의 경우 이를 따른다))는 그 투자한도에 적합한 것으로 봄 ① ~ ⑤ (현행과 같음) (나) (현행과 같음)
10. 집합투자기구의 투자 위험 나. 특수위험	집합투자기구의 투자 위험 기재 보완	〈신설〉	증권대여위험 : 이 투자신탁에서 보유하고 있는 자산을 대여할 경우, 중개회사 및 거래상대방의 시스템 및 운영 오류나 거래상대방의 파산으로 인해 자산의 회수가 적시에 이루어지지 않아 투자신탁의 투자자산 매매가 원활히 이루어지지 않을 수 있으며, 이로 인한 투자자는 기회비용 부담과 투자원금액 손실이 발생할 수 있습니다. 증권차입위험 : 이 투자신탁의 운용 전략에 따라 투자증권을 차입할 경우, 차입자산을 공매도(short selling)하여 해당 자산의 반환 시점에 예상과 달리 그 자산의 가치가 급등하게 되면, 매도시점보다 높은 가격으로 매수함으로써 인해 그 차액(매도가-매수가)만큼 투자원금액 손실을 초래할 수 있습니다.
10. 집합투자기구의 투자 위험 다. 기타 투자 위험	자본시장법 시행령 개정 사항 반영	집합투자기구 해지의 위험 : 수익자 전원이 동의한 경우, 투자신탁의 수익증권 전부에 대한 환매의 청구를	집합투자기구 해지의 위험 : 수익자 전원이 동의한 경우, 투자신탁의 수익증권 전부에 대한 환매의 청구를

		받아 신탁계약을 해지하는 경우, 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다)을 설정한 후 1년이 되는 날에 원본액 50억원 미만인 경우 또는 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다)을 설정하고 1년이 지난 후 1개월간 계속하여 투자신탁의 원본액이 50억원 미만인 경우 집합투자업자가 투자신탁을 해지하는 등의 사유로 투자자의 동의 없이 투자신탁이 해지될 수 있습니다.	받아 신탁계약을 해지하는 경우, 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다)을 설정한 후 1년(<u>성과보수를 수취하거나, 고유재산 투자금이 일정 액수 이상인 집합투자기구의 경우 2년</u>)이 되는 날에 원본액 50억원 미만인 경우 또는 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다)을 설정하고 1년(<u>성과보수를 수취하거나, 고유재산 투자금이 일정 액수 이상인 집합투자기구의 경우 2년</u>)이 지난 후 1개월간 계속하여 투자신탁의 원본액이 50억원 미만인 경우 집합투자업자가 투자신탁을 해지하는 등의 사유로 투자자의 동의 없이 투자신탁이 해지될 수 있습니다.
10. 집합투자기구의 투자 위험 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형	제 12 기 재무제표 확정 에 따른 갱신	<u>표준편차 : 22.07%</u>	<u>표준편차 : 21.85%</u>
11. 매입, 환매, 전환 절차 및 기준가격 적용기준 가. 매입	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	2) 매입청구시 적용되는 기준가격 ① 15시 30분[오후 3시 30분] 이전 자금을 납입한 경우 : 자금을 납입한 영업일로부터 제2영업일에 공고되는 수익증권의 기준가격 적용	2) 매입청구시 적용되는 기준가격 ① 15시 30분[오후 3시 30분] 이전 자금을 납입한 경우 : 자금을 납입한 영업일로부터 2영업일에 공고되는 수익증권의 기준가격 적용

		② 15시 30분[오후 3시 30분] 경과 후 자금을 납입한 경우 : 자금을 납입한 영업일로부터 <u>제3영업일</u> 에 공고되는 수익증권의 기준가격 적용 ③ (생략)	② 15시 30분[오후 3시 30분] 경과 후 자금을 납입한 경우 : 자금을 납입한 영업일로부터 <u>3영업일</u> 에 공고되는 수익증권의 기준가격 적용 ③ (현행과 같음)
11. 매입, 환매, 전환 절차 및 기준가격 적용기준 나. 환매	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	2) 환매시 적용되는 기준가격 및 환매대금 지급시기 ① 15시 30분[오후 3시 30분] 이전 환매를 청구한 경우 : 환매를 청구한 날로부터 <u>제2영업일</u> 에 공고되는 수익증권의 기준가격을 적용하여 <u>제4영업일</u> 에 환매금액 지급 ② 15시 30분[오후 3시 30분] 경과 후 환매를 청구한 경우 : 환매를 청구한 날로부터 <u>제3영업일</u> 에 공고되는 수익증권의 기준가격을 적용하여 <u>제4영업일</u> 에 환매금액 지급	2) 환매시 적용되는 기준가격 및 환매대금 지급시기 ① 15시 30분[오후 3시 30분] 이전 환매를 청구한 경우 : 환매를 청구한 날로부터 <u>2영업일</u> 에 공고되는 수익증권의 기준가격을 적용하여 <u>4영업일</u> 에 환매금액 지급 ② 15시 30분[오후 3시 30분] 경과 후 환매를 청구한 경우 : 환매를 청구한 날로부터 <u>3영업일</u> 에 공고되는 수익증권의 기준가격을 적용하여 <u>4영업일</u> 에 환매금액 지급
12. 기준가격 산정기준 및 집합투자재산의 평가 가. 기준가격의 산정 및 공시	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	<u>대차대조표</u>	<u>재무상태표</u>
13. 보수 및 수수료에 관한 사항 나. 집합투자기구에 부과되는 보수 및 비용	제 12 기 재무제표 확정에 따른 갱신 동종유형 총보수 최근 기준으로 기재 기업공시서식 작성기준 반영	- <u>2022. 3. 31. 기준</u> 주 3) 증권거래비용은 회계기간이 경과한 경우에는 직	<u>2022. 9. 6. 기준</u> <u>2022. 7. 29. 기준</u> 주 3) 증권거래비용은 회계기간이 경과한 경우에는 직

		전 회계연도의 증권거래비용을 추정치로 사용하며, 회계기간이 경과하지 아니한 경우에는 다른 클래스의 증권거래비용을 추정치로 사용하였습니다. 또한 증권거래비용은 총보수비용에 포함되지 아니하였습니다. <신 설> <신 설>	전 회계연도의 증권거래비용을 추정치로 사용하며, 회계기간이 경과하지 아니한 경우에는 다른 클래스의 증권거래비용을 추정치로 사용하였습니다. 또한 증권거래비용은 총보수비용에 포함되지 아니하였습니다. <u>이 투자신탁에서 직전 회계연도에 발생한 증권거래비용은 14,076,745 원입니다.</u> <u>[직전 회계연도 : 2021.09.07~2022.09.06]</u> <u>* 증권거래비용에 포함되는 항목 : 주식·채권·수익증권·파생상품·기타 증권 등 자산매매수수료 등 (단, 세 부지출내역은 편드별로 상이할 수 있습니다.)</u> <u>주 6) 금융비용은 총보수비용에 포함되지 아니하였으며, 직전 회계연도에 금융비용은 발생하지 않았습니다.</u> <u>[직전 회계연도: 2021.09.07~2022.09.06]</u>
--	--	--	---

제 3 부 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항

1. 재무정보	제 12 기 재무제표 확정 에 따른 갱신	-	<u>2022. 9. 6. 기준</u>
2. 연도별 설정 및 환 매 현황	제12기 재무제표 확정 에 따른 갱신	-	<u>2022. 9. 6. 기준</u>
3. 집합투자기구의 운 용실적	제12기 재무제표 확정 에 따른 갱신	-	<u>2022. 9. 6. 기준</u>

제 4 부 집합투자기구 관련회사에 관한 사항

1. 집합투자업자에 관 한 사항 가. 회사 개요	최근 기준으로 기재	<u>2022. 4. 30. 기준</u>	<u>2022. 8. 31. 기준</u>
----------------------------------	------------	------------------------	------------------------

1. 집합투자업자에 관한 사항 라. 운용자산 규모	최근 기준으로 기재	<u>2022. 4. 30. 기준</u>	<u>2022. 8. 31. 기준</u>
3. 집합투자재산 관리 회사에 관한 사항(신탁업자) 나. 주요업무	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	(1) 주요업무 (생략) - 집합투자업자의 집합투자 재산 운용지시에 대한 감시 업무, 투자신탁재산 평가의 공정성 및 기준가격 산정의 적정성 여부 등의 확인업무	(1) 주요업무 (현행과 같음) - 집합투자업자의 집합투자 재산 운용지시에 대한 감시 업무, 투자신탁재산 평가의 공정성 및 기준가격 산정의 적정성 여부, <u>투자신탁재산 명세서와 신탁업자가 보관·관리 중인 집합투자재산의 내역이 일치하는지 여부</u> 등의 확인업무

제 5 부 기타 투자자보호를 위해 필요한 사항

1. 투자자의 권리에 관한 사항 가. 수익자총회 등	자본시장법 및 시행령 개정사항 반영	(3) 수익자총회 결의사항 <u>제 5 영업일</u>	(3) 수익자총회 결의사항 <u>5 영업일</u>
2. 집합투자기구의 해지에 관한 사항 나. 임의해지	자본시장법 시행령 개정사항 반영	(1) 집합투자업자는 아래의 경우 금융위원회의 승인을 받지 않고 투자신탁을 해지할 수 있으며, 이 경우 집합투자업자는 그 해지사실을 지체 없이 금융위원회에 보고하여야 합니다. ① ~ ② (생략) ③ 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다. 이하 같다)으로서 설정한 후 1년이 되는 날에 원본액이 50 억원 미만인 경우	(1) 집합투자업자는 아래의 경우 금융위원회의 승인을 받지 않고 투자신탁을 해지할 수 있으며, 이 경우 집합투자업자는 그 해지사실을 지체 없이 금융위원회에 보고하여야 합니다. ① ~ ② (현행과 같음) ③ 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다. 이하 같다)으로서 설정한 후 1년(<u>법 시행령 제 81 조제 3 항제 1 호의 집합투자기구의 경우에는 설정 이후 2 년</u>)이 되는 날에 원본액이 50 억원 미만인 경우

		④ 투자신탁을 설정하고 1년이 지난 후 1개월간 계속하여 투자신탁의 원본액이 50억원 미만인 경우 (2) ~ (3) (생략)	④ 투자신탁을 설정하고 1년(<u>법 시행령 제 81 조제 3 항제 1 호의 집합투자기구의 경우에는 설정 이후 2 년</u>)이 지난 후 1개월간 계속하여 투자신탁의 원본액이 50억원 미만인 경우 (2) ~ (3) (현행과 같음)
3. 집합투자기구의 공시에 관한 사항 나. 수시공시	자본시장법 시행령 개정 사항 반영	(2) 수시공시 투자신탁이나 투자익명조합의 집합 투자업자는 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 사항이 발생한 경우 이를 지체 없이 집합투자업자·판매회사·협회의 인터넷 홈페이지 공시 그리고 집합투자업자·판매회사의 본·지점, 그 밖의 영업소 게시 및 전자우편을 이용하여 공시하여야 합니다. ① ~ ⑦ (생략) ⑧ 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다. 이하 같다)으로서 설정 이후 1년(이 되는 날에 원본액이 50억원 미만인 경우 그 사실과 해당 투자신탁이 법 제 192 조 제 1 항 단서에 따라 해지될 수 있다는 사실 ⑨ 투자신탁이 설정되고 1년이 지난 후 1개월간 계속하여 원본액이 50억원 미만인 경우 그 사실과 해당 투	(2) 수시공시 투자신탁이나 투자익명조합의 집합 투자업자는 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 사항이 발생한 경우 이를 지체 없이 집합투자업자·판매회사·협회의 인터넷 홈페이지 공시 그리고 집합투자업자·판매회사의 본·지점, 그 밖의 영업소 게시 및 전자우편을 이용하여 공시하여야 합니다. ① ~ ⑦ (현행과 같음) ⑧ 투자신탁(존속하는 동안 투자금을 추가로 모집할 수 있는 투자신탁으로 한정한다. 이하 같다)으로서 설정 이후 1년(<u>법 시행령 제 81 조제 3 항제 1 호의 집합투자기구의 경우에는 설정 이후 2 년</u>)이 되는 날에 원본액이 50억원 미만인 경우 그 사실과 해당 투자신탁이 법 제 192 조 제 1 항 단서에 따라 해지될 수 있다는 사실 ⑨ 투자신탁이 설정되고 1년(<u>법 시행령 제 81 조제 3 항제 1 호의 집합투자기구의 경우에는 설정 이후 2 년</u>)이

		자신탁이 법 제 192 조 제 1 항 단서에 따라 해지될 수 있다는 사실 ⑩ (생 략)	지난 후 1 개월간 계속하여 원본액이 50 억원 미만인 경 우 그 사실과 해당 투자신탁 이 법 제 192 조 제 1 항 단 서에 따라 해지될 수 있다는 사실 ⑩ (현행과 같음)
--	--	--	--