

변경 대비표

□ 대상펀드명 : 트러스톤 인덱스알파 증권투자신탁[주식-파생형]

□ 변경 사항 : ① 부책임 운용역 추가(윤상민)

- ② 투자위험등급 산정기준 변경 (주간 수익률의 표준편차 → 일간 수익률의 최대손실 예상액)
- ③ 제14기 재무제표 확정에 따른 갱신
- ④ 기업공시서식 개정사항 반영
- ⑤ 예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영
- ⑥ 소득세법 개정사항 반영

□ 효력발생일 : 2024. 9. 27.

□ 변경 내용

항 목	정정사유	정 정 전	정 정 후
투자결정시 유의사항 안내			
투자결정시 유의사항 안내	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영	7. 집합투자증권은 집합투자기구의 운용실적에 따라 손익이 결정되는 실적배당상품으로 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않으며, 특히 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 은행예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않습니다.	7. 집합투자증권은 집합투자기구의 운용실적에 따라 손익이 결정되는 실적배당상품으로 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않으며, 특히 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 은행예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않습니다.
요약정보			
-	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영	이 집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않는 실적배당상품이며, 국내 주식 및 주식관련 장내파생상품에 투자하는 모투자신탁에 투자하는 자투자신탁으로 장기적으로 안정적인 자본이득을 추구하나 주식	이 집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 <u>보호되지</u> 않는 실적배당상품이며, 국내 주식 및 주식관련 장내파생상품에 투자하는 모투자신탁에 투자하는 자투자신탁으로 장기적으로 안정적인 자본이득을 추구나 주식의 가격 변동, 이



		의 가격 변동, 이자율 등 기타 거시경제지표의 변화에 따른 위험이 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.	자율 등 기타 거시경제지표의 변화에 따른 위험이 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.
투자비용	제 14 기 재무제표 확정에 따른 갱신 동종유형 총보수 최근 기준으로 기재	- -	<u>2024. 9. 6. 기준</u> <u>2024. 7. 31. 기준</u>
운용전문인력	부책임 운용역 추가 최근 기준으로 기재	<신 설> -	<u>부책임운용역 : 윤상민</u> <u>2024. 8. 31. 기준</u>
투자자 유의사항	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영	집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.	집합투자증권은 「예금자보호법」에 따라 <u>보호되지</u> 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.
주요투자 위험	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규정 개정사항 반영	투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 운용실적에 따라 손익이 결정되는 실적배당상품으로 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재합니다. 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전적으로 투자자가 부담하게 되고, 집합투자업자나 판매회사 등 어떤 당사자도 투자손실에 대하여 책임을 지지 아니합니다. 또한 이 투자신탁은 은행 예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않으며, 특히 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 예금자보호법에 따라 <u>예금보험공사가 보호하지</u> 않습니다.	투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 운용실적에 따라 손익이 결정되는 실적배당상품으로 투자원본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재합니다. 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전적으로 투자자가 부담하게 되고, 집합투자업자나 판매회사 등 어떤 당사자도 투자손실에 대하여 책임을 지지 아니합니다. 또한 이 투자신탁은 은행 예금과 달리 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않으며, 특히 예금자보호법의 적용을 받는 은행 등에서 집합투자증권을 매입하는 경우에도 예금자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않습니다.

제 2 부 집합투자기구에 관한 사항



5. 운용전문인력 가. 운용전문인력	부책임 운용역 추가 최근 기준으로 기재	<신 설> -	<u>부책임운용역 : 윤상민</u> <u>2024. 8. 31. 기준</u>
5. 운용전문인력 나. 운용중인 집합투 자기구에 관한 사항	부책임 운용역 추가 최근 기준으로 기재	<신 설> -	<u>부책임운용역 : 윤상민</u> <u>2024. 8. 31. 기준</u>
5. 운용전문인력 다. 운용전문인력 최 근 변경 내역	부책임 운용역 추가 최근 3년 경과내역 삭 제	<신 설> <u>부책임운용역 : 강현중</u> <u>(2021.06.03~2021.07.20)</u>	<u>부책임운용역 : 윤상민</u> <u><삭 제></u>
10. 집합투자기구의 투자위험	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규 정 개정사항 반영	이 투자신탁은 원본을 보장하 지 않습니다. 따라서, 투자원 본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재하며 투자 금액의 손실 내지 감소의 위 험은 전적으로 투자자가 부담 하며, 집합투자업자나 판매회 사 등 어떤 당사자도 투자손 실에 대하여 책임을 지지 아 니합니다. 또한, 이 투자신탁 은 예금자보호법의 적용을 받 는 은행의 예금과 달리 실적 에 따른 수익을 취득하므로 은행 등에서 판매하는 경우에 도 예금자보호법에 따라 <u>예금 보험공사가 보호하지</u> 않습니 다.	이 투자신탁은 원본을 보장하 지 않습니다. 따라서, 투자원 본의 전부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재하며 투자 금액의 손실 내지 감소의 위 험은 전적으로 투자자가 부담 하며, 집합투자업자나 판매회 사 등 어떤 당사자도 투자손 실에 대하여 책임을 지지 아 니합니다. 또한, 이 투자신탁 은 예금자보호법의 적용을 받 는 은행의 예금과 달리 실적 에 따른 수익을 취득하므로 은행 등에서 판매하는 경우에 도 예금자보호법에 따라 <u>보호 되지</u> 않습니다.
10. 집합투자기구의 투자위험 가. 일반위험	예금보험관계 표시 및 설명·확인에 관한 규 정 개정사항 반영	투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 실적배당상품 으로 은행 예금과 달리 예금 자보호법에 따라 <u>예금보험공 사가 보호하지</u> 않습니다. 따라 서 투자원본의 전부 또는 일 부에 대한 손실의 위험이 존 재하며 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전적으로 투자 자가 부담하게 되고, 집합투자 업자나 판매회사 등 어떤 당	투자원본에 대한 손실위험 : 이 투자신탁은 실적배당상품 으로 은행 예금과 달리 예금 자보호법에 따라 <u>보호되지</u> 않 습니다. 따라서 투자원본의 전 부 또는 일부에 대한 손실의 위험이 존재하며 투자금액의 손실 내지 감소의 위험은 전 적으로 투자자가 부담하게 되 고, 집합투자업자나 판매회사 등 어떤 당사자도 투자손실에

		사자도 투자손실에 대하여 책임을 지지 아니합니다.	대하여 책임을 지지 아니합니다.								
10. 집합투자기구의 투자위험 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형	투자위험등급 산정기준 변경	표준편차 : 16.96% <신 설> <트러스트자산운용 집합투자기구 위험등급 분류기준> 1) 설정된 후 3년 경과된 경우 표준편차	<u>일간 수익률의 최대 손실 예상액(97.5% VaR 모형 사용) : 37.24%</u> - 위험등급 변경 내역 : <u>2024.9.27 : 투자위험등급 산정 기준을 최근 결산일 기준 이전 3년간 “주간 수익률의 표준편차”에서 “일간 수익률의 최대 손실 예상액” 기준으로 변경</u> <트러스트자산운용 집합투자기구 위험등급 분류기준> 1) 설정된 후 3년 경과된 경우 <u>위험등급 기준표(97.5% VaR 모형 사용)</u>								
11. 매입, 환매, 전환절차 및 기준가격 적용기준 나. 환매	기업공시서식 개정사항 반영	1) 환매방법 및 절차, 환매 신청 가능시간 <신 설>	1) 환매방법 및 절차, 환매 신청 가능시간 <u><환매 가능 여부 및 환매 수수료 부과 여부></u> <table border="1" data-bbox="1098 1391 1426 1675"> <thead> <tr> <th rowspan="2">중도 환매 불가</th> <th colspan="2">중도환매 허용</th> </tr> <tr> <th>중도 환매시 비용 발생</th> <th>중도 환매시 비용 발생하지 않음</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>-</td> <td>-</td> <td>○</td> </tr> </tbody> </table>	중도 환매 불가	중도환매 허용		중도 환매시 비용 발생	중도 환매시 비용 발생하지 않음	-	-	○
중도 환매 불가	중도환매 허용										
	중도 환매시 비용 발생	중도 환매시 비용 발생하지 않음									
-	-	○									
13. 보수 및 수수료에 관한 사항 나. 집합투자기구에 부과되는 보수 및 비용	제 14 기 재무제표 확정에 따른 갱신 동종유형 총보수 최근 기준으로 기재	- -	<u>2024. 9. 6. 기준</u> <u>2024. 7. 31. 기준</u>								

14. 이익 배분 및 과세에 관한 사항 나. 과세	소득세법 개정사항 반영	4) 연금저축계좌 가입자에 대한 과세 [연금저축계좌 과세 주요 사항] 분리과세한도 : <u>1,200만원</u> (공적연금소득 제외) <u>1,200만원</u> 초과시 종합과세 또는 15% 분리과세 선택 가능 (단, <u>23.1.1</u> 이후 연금수령하는 분부터 적용)	4) 연금저축계좌 가입자에 대한 과세 [연금저축계좌 과세 주요 사항] 분리과세한도 : <u>1,500만원</u> (공적연금소득 제외) <u>1,500만원</u> 초과시 종합과세 또는 15% 분리과세 선택 가능 (단, <u>24.1.1</u> 이후 연금수령하는 분부터 적용)
--------------------------------	--------------	---	---

제 3 부 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항

1. 재무정보	제 14 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 9. 6. 기준</u>
2. 연도별 설정 및 환매 현황	제 14 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 9. 6. 기준</u>
3. 집합투자기구의 운용실적	제 14 기 재무제표 확정에 따른 갱신	-	<u>2024. 9. 6. 기준</u>

제 4 부 집합투자기구 관련회사에 관한 사항

1. 집합투자업자에 관한 사항 가. 회사 개요	최근 기준으로 기재 회사연혁 추가	- <신 설>	<u>2024. 8. 31. 기준</u> <u>2022.11 종합자산운용사로 전환</u>
1. 집합투자업자에 관한 사항 다. 최근 2개 사업연도 요약 재무내용	최근 기준으로 기재	<u>제 25 기(2022.12.31)</u> <u>제 24 기(2021.12.31)</u>	<u>제 26 기(2023.12.31)</u> <u>제 25 기(2022.12.31)</u>
1. 집합투자업자에 관한 사항 라. 운용자산 규모	최근 기준으로 기재	-	<u>2024. 8. 31. 기준</u>