

# [ 정 정 대 비 표 ]

## ■ 정정 집합투자기구 및 정정 서류

편 드 명	BNK K200지수 2배 레버리지 증권투자신탁(주식-파생형)
정 정 서 류	(간이)투자설명서
정 정 사 유	최근 결산기 재무제표 확정 및 기업공시서식 개정사항 반영
효 력 발 생 일	2022년 09월 30일

## ■ 정정대비표

### [간이투자설명서]

항목	정정사유	정정 전	정정 후
<b>[요약정보]</b>			
	결산에 따른 위험 등급 관련 문구 변경	BNK자산운용(주)는 이 투자신탁의 <b>투자대상자산의 종류 및 위험도 등</b> 을 감안하여 <b>1등급</b> 으로 분류하였습니다.	BNK자산운용(주)는 이 투자신탁의 <b>실제 수익률 변동성</b> 을 감안하여 <b>1등급</b> 으로 분류하였습니다.
투자비용	최근 결산기 재무제표 확정	-	- 최근 결산일 또는 2022.09.13 기준으로 업데이트
투자실적 추이(연평균 수익률)	최근 결산기 재무제표 확정	-	- 최근 결산일 또는 2022.09.13 기준으로 업데이트
운용전문인력	-	-	- 2022.09.13 기준으로 업데이트

### [투자설명서]

항목	정정사유	정정 전	정정 후
<b>[요약정보]</b>			
	결산에 따른 위험 등급 관련 문구 변경	BNK자산운용(주)는 이 투자신탁의 <b>투자대상자산의 종류 및 위험도 등</b> 을 감안하여 <b>1등급</b> 으로 분류하였습니다.	BNK자산운용(주)는 이 투자신탁의 <b>실제 수익률 변동성</b> 을 감안하여 <b>1등급</b> 으로 분류하였습니다.
투자비용	최근 결산기 재무제표 확정	-	- 최근 결산일 또는 2022.09.13 기준으로 업데이트
투자실적 추이(연평균 수익률)	최근 결산기 재무제표 확정	-	- 최근 결산일 또는 2022.09.13 기준으로 업데이트
운용전문인력	-	-	- 2022.09.13 기준으로 업데이트
<b>제2부. 집합투자기구에 관한 사항</b>			
2. 집합투자기구의 연혁	-	-	- 2022.09.30: <u>최근 결산기 재무제표 확정 및 기업공시서식 개정사항 반영</u>

5. 운용전문인력에 관한 사항	-	-	- 2022.09.13 기준으로 업데이트
10. 집합투자기구의 투자위험	결산에 따른 위험등급 관련 문구 변경 및 위험등급 적용을 위해 산출한 실제 수익률 변동성 추가	<p>아래 참조 - &lt;정정 전&gt; 가. ~ 다. (생략) 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 - 집합투자업자는 설정 후 3년이 미경과한 펀드의 경우 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 투자신탁 위험등급을 매우 높은 위험(1등급)에서 매우 낮은 위험(6등급)까지 6단계로 분류하고 있습니다. 이 투자신탁은 레버리지 펀드로 수익구조 등이 특수하여 투자시 주의가 필요한 집합투자기구로 1등급(매우 높은 위험)으로 분류됩니다. 따라서 이 투자신탁은 "레버리지 효과 및 관련 위험", "이 투자신탁이 일일등락률 기준 레버리지 수익을 추구한다는 점" 및 "시장의 움직임 및 변동성" 등을 충분히 이해하고 감내할 수 있는 투자자에게 적합합니다.</p> <p>[BNK자산운용 투자위험 등급 분류기준 - 설정 후 3년 미경과 시]</p>	<p>아래 참조 - &lt;정정 후&gt; 가. ~ 다. (현행과 동일) 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 집합투자업자는 설정 후 3년이 경과한 펀드의 경우 실제 수익률 변동성을 감안하여 투자신탁 위험등급을 매우 높은 위험(1등급)에서 매우 낮은 위험(6등급)까지 6단계로 분류하고 있습니다. 이 투자신탁은 레버리지 펀드로 수익구조 등이 특수하여 투자시 주의가 필요한 집합투자기구로 실제 수익률 변동성(최근 결산일 기준 이전 3년간 주간 수익률의 표준편차)은 43.8656%이며, 6단계의 투자위험등급 중 1등급(매우 높은 위험)으로 분류됩니다. 따라서 이 투자신탁은 "레버리지 효과 및 관련 위험", "이 투자신탁이 일일등락률 기준 레버리지 수익을 추구한다는 점" 및 "시장의 움직임 및 변동성" 등을 충분히 이해하고 감내할 수 있는 투자자에게 적합합니다. (최근결산일 : 2022.6.30) &lt;삭 제&gt;</p>
13. 보수 및 수수료에 관한 사항	최근 결산기 재무제표 확정 및 기업공시서식 개정사항 반영	-	- 최근 결산일 기준으로 업데이트 - 보수 및 수수료 부분 비용 관련 주석 추가
<b>제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항</b>			
-	최근 결산기 재무제표 확정	-	- 최근 결산일 또는 2022.09.13 기준으로 업데이트
<b>제4부. 집합투자기구의 관련회사에 관한 사항</b>			
1. 집합투자업자에 관한 사항	최근 결산기 재무제표 확정	-	- 2022.09.13 기준으로 업데이트

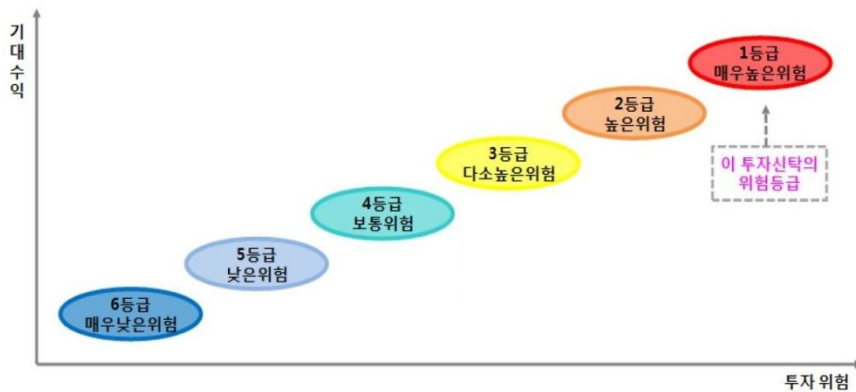
<정정 전>

**라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형**

집합투자업자는 설정 후 3년이 미경과한 펀드의 경우 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 투자신탁 위험등급을 매우 높은 위험(1등급)에서 매우 낮은 위험(6등급)까지 6단계로 분류하고 있습니다. 이 투자신탁은 레

버리지 펀드로 수익구조 등이 특수하여 투자시 주의가 필요한 집합투자기구로 **1등급(매우 높은 위험)**으로 분류됩니다. 따라서 이 투자신탁은 "레버리지 효과 및 관련 위험", "이 투자신탁이 일일등락률 기준 레버리지 수익을 추구한다는 점" 및 "시장의 움직임 및 변동성" 등을 충분히 이해하고 감내할 수 있는 투자자에게 적합합니다.

※ 상기 위험등급분류는 설정 후 3년이 경과시 실제 수익률 변동성으로 등급분류기준이 변경되면서 투자위험 등급이 변동될 수 있습니다. 또한 이 투자위험 등급분류는 BNK자산운용의 내부 기준에 따른 위험등급이며, 판매회사는 판매회사별 특성을 반영하여 위험등급을 재분류할 수 있습니다.



※ 상기 위험등급분류는 설정 후 3년이 경과시 실제 수익률 변동성으로 등급분류기준이 변경되면서 투자위험등급이 변동될 수 있습니다.

**[BNK자산운용 투자위험 등급분류기준 - 설정 후 3년 미경과 시]**

위험등급		분류기준
1등급	매우 높은 위험	- 레버리지 등 수익구조가 특수하여 투자시 주의가 필요한 집합투자기구 - 최대손실률이 20%를 초과하는 파생결합증권에 주로 투자하는 집합투자기구 - 기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
2등급	높은 위험	- 고위험자산에 80% 이상 투자하는 집합투자기구 - 기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
3등급	다소 높은 위험	- 고위험자산에 80% 미만으로 투자하는 집합투자기구 - 최대손실률이 20% 이하인 파생결합증권에 주로 투자하는 집합투자기구 - 기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
4등급	보통 위험	- 고위험자산에 50% 미만으로 투자하는 집합투자기구 - 중위험자산에 최소 60% 이상 투자하는 집합투자기구 - 기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
5등급	낮은 위험	- 저위험자산에 최소 60% 이상 투자하는 집합투자기구 - 수익구조상 원금보존추구형 파생결합증권에 주로 투자하는 집합투자기구 - 기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구
6등급	매우 낮은 위험	- 단기금융집합투자기구(MMF) - 단기 국공채 등에 주로 투자하는 집합투자기구 - 기타 이와 유사한 위험수준을 갖는 집합투자기구

- "고위험자산"은 주식, 상품, REITs, 투기등급채권(BB+등급 이하), 파생상품 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산
- "중위험자산"은 채권(BBB- 등급 이상), CP(A3등급 이상), 담보부 대출 및 대출채권 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산
- "저위험자산"은 국공채, 지방채, 회사채(A-등급 이상), CP(A2-등급 이상), 현금성 자산 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산
- 해외투자펀드는 국내펀드 분류기준을 준용하되 환헤지여부·투자국가 등을 고려하여 필요시 위험등급을 조정함
- 위에 명시되지 않은 펀드의 위험 등급은 투자대상·손실가능성 등을 고려하여 내부 심의위원회에서 정함

**[위험등급 분류기준 - 설정 후 3년 경과 시]**

위험등급	1등급	2등급	3등급	4등급	5등급	6등급
	매우높은위험	높은위험	다소높은위험	보통위험	낮은위험	매우낮은위험

수익률 변동성 <sup>주1)</sup> (표준편차)	25%초과	25%이하	15%이하	10%이하	5%이하	0.5%이하
-------------------------------------	-------	-------	-------	-------	------	--------

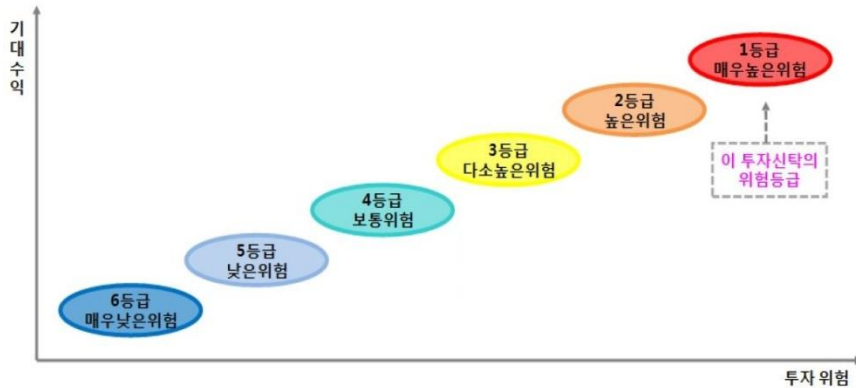
주1) 수익률 변동성(표준편차) : 일정 기간동안 투자신탁의 수익률이 평균수익률과 대비하여 변동한 범위를 측정하기 위한 통계량으로서, 최근 결산일 기준 이전 3년간 주간수익률의 연환산 표준편차 값을 계산하여 이 투자신탁의 위험 정도를 나타내는 지표로 사용하였습니다. 수익률 변동성(표준편차) 값이 클수록 미래 수익률에 대한 불확실성이 증가하여 투자신탁의 위험이 커지게 됨을 의미합니다.

※ 이 투자위험 등급분류는 BNK자산운용의 내부 기준에 따른 위험등급이며, 판매회사는 판매회사별 특성을 반영하여 위험등급을 재분류할 수 있습니다.

<정정 후>

라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형

집합투자업자는 설정 후 3년이 경과한 펀드의 경우 실제 수익률 변동성을 감안하여 투자신탁 위험등급을 매우 높은 위험(1등급)에서 매우 낮은 위험(6등급)까지 6단계로 분류하고 있습니다. 이 투자신탁은 레버리지 펀드로 수익구조 등이 특수하여 투자시 주의가 필요한 집합투자기구로 실제 수익률 변동성(최근 결산일 기준 이전 3년간 주간 수익률의 표준편차)은 **43.8656%**이며, 6단계의 투자위험등급 중 **1등급(매우 높은 위험)**으로 분류됩니다. 따라서 이 투자신탁은 "레버리지 효과 및 관련 위험", "이 투자신탁이 일일등락률 기준 레버리지 수익을 추구한다는 점" 및 "시장의 움직임 및 변동성" 등을 충분히 이해하고 감내할 수 있는 투자자에게 적합합니다. (최근결산일 : 2022.6.30)



※ 상기 위험등급분류는 설정 후 3년이 경과시 실제 수익률 변동성으로 등급분류기준이 변경되면서 투자위험등급이 변동될 수 있습니다.

[위험등급 분류기준 - 설정 후 3년 경과 시]

위험등급	1등급	2등급	3등급	4등급	5등급	6등급
	매우높은위험	높은위험	다소높은위험	보통위험	낮은위험	매우낮은위험
수익률 변동성 <sup>주1)</sup> (표준편차)	25%초과	25%이하	15%이하	10%이하	5%이하	0.5%이하

주1) 수익률 변동성(표준편차) : 일정 기간동안 투자신탁의 수익률이 평균수익률과 대비하여 변동한 범위를 측정하기 위한 통계량으로서, 최근 결산일 기준 이전 3년간 주간수익률의 연환산 표준편차 값을 계산하여 이 투자신탁의 위험 정도를 나타내는 지표로 사용하였습니다. 수익률 변동성(표준편차) 값이 클수록 미래 수익률에 대한 불확실성이 증가하여 투자신탁의 위험이 커지게 됨을 의미합니다.

※ 이 투자위험 등급분류는 BNK자산운용의 내부 기준에 따른 위험등급이며, 판매회사는 판매회사별 특성을 반영하여 위험등급을 재분류할 수 있습니다.

<끝>.