

## 파생상품 ETF 거래 위험고지

■ 자본시장법 제93조 제1항에 따른 집합투자기구로서 레버리지 ETF, 인버스 ETF 등 기초지수 변화의 음의 배율 또는 1배를 초과한 배율로 연동하여 운용하는 것을 목표로 하는 상장지수집합투자기구의 집합투자증권(이하 "파생상품 ETF"라 한다)을 매매하는 경우의 유의사항을 사전에 충분히 인지할 수 있도록 위탁자에게 교부하는 것입니다.

■ 아래 사항은 파생상품 ETF에 수반되는 위험과 관련하여 귀하가 알아야 할 사항을 간략하게 서술한 것으로 귀하의 파생상품 ETF거래와 관련하여 발생할 수 있는 모든 위험과 중요 사항을 전부 기술한 것은 아닙니다.

**투자판단 및 상품의 상세한 내용은 투자 설명서를 반드시 참고하시기 바랍니다.**

\* 투자설명서 등은 거래소 정보데이터시스템 (<http://data.krx.co.kr>), 자산운용사 홈페이지를 통해 확인하시기 바랍니다.

■ 파생상품 ETF를 거래하시기 전에 다음 매매 유의사항의 내용을 충분히 파악하시고 귀하의 재산상황 등을 감안하여 투자결정에 신중을 기하여야 합니다.

1. ETF란 특정 지수 및 특정자산의 가격 움직임과 수익률이 연동되도록 설계된 펀드로서 거래소에 상장되어 주식처럼 거래(유통)되는 펀드이며, 레버리지 ETF, 인버스 ETF 등 기초지수의 변화의 음의 배율 또는 1배를 초과한 배율로 연동하여 운용하는 것을 목표로 하는 집합투자증권을 "파생상품 ETF"라 합니다.

2. 추적지수 수익률이  $\pm 1$ 배를 초과하는 레버리지형은 추적지수의 누적수익률이 플러스(+)이거나 0%(제로)에 가까움에도 불구하고 투자원금의 손실이 발생할 수 있습니다.

3. 추적지수 수익률이 음의 배율을 추구하는 인버스ETF는 추적지수의 누적수익률이 마이너스(-)이거나 0%(제로)에 가까움에도 불구하고 투자원금의 손실이 발생할 수 있습니다.

※레버리지/인버스 상품은 벤치마크의 일일수익률에 배수 및 역의 수익률을 추구합니다. 따라서,벤치마크의 기간수익률과 ETF의 누적수익률은 크게 차이가 날 수 있습니다. 레버리지/인버스ETF를 장기 보유할 경우 기대 수익과 다른 결과가 나올 수 있사오니 유의하시기 바랍니다.

4. 파생상품 ETF 투자위험등급은 **1등급(매우높은위험)**으로 분류됩니다.

※레버리지,인버스ETF는 일반적인 주식 투자보다 높은 위험을 감내할 수 있고 동시에 주식 시장의 변동성 등 재무적인 지식을 보유한 투자자에게 적합한 고위험 상품입니다.

5. "파생상품 ETF"를 매매하는 경우 ETF 본래의 투자위험 이외에 동 파생상품 ETF를 1영업일 초과하여 보유하는 경우 복리효과 등에 따라 당해 파생상품 ETF가 추구하는 투자목표를 달성하지 못할 수 있고 변동성이 큰 시장상황에서는 단기에 예상치 못한 손실이 발생할 수 있으므로 파생상품 ETF 투자에 유의하시기 바랍니다.

6. 개인(전문투자자 제외)인 위탁자가 목표로 하는 기초자산의 가격 또는 지수 변화에 1배를 초과한 배율(음의 배율을 포함한다)로 연동하는 ETF에 대한 매수주문을 위탁하는 때에는 기본예탁금 적용기준\*에서 정한 금액 이상의 현금 또는 대용증권을 기본예탁금으로 회사에 예탁하여야 하며, 기본예탁금 미충족시에는 회사가 주문 수락을 거부할 수 있습니다.

\* 회사는 한국거래소 유가증권시장 업무규정 시행세칙 제111조의3제2항에 따라 기본예탁금적용기준을 정하고 있음

7. 개인\*인 위탁자가 목표로 하는 기초자산의 가격 또는 지수 변화에 1배를 초과한 배율(음의 배율을 포함한다)로 연동하는 ETF를 투자하고자 할 경우 사전에 금융투자교육원([www.kifin.or.kr](http://www.kifin.or.kr))에서 운영하는 온라인 교육을 이수하여야 합니다.

\* 전문투자자, 외국인, 투자일임계약 또는 비지정형 금전신탁계약에 따라 거래하려는 개인투자자의 경우에는 사전교육 대상에서 제외

8. 거래소는 투자자의 주의환기가 필요하다고 인정되는 경우, 일정기준에 해당하는 ETF를 투자유의종목으로 지정\*할 수 있으며, 투자유의종목으로 지정된 종목에 대해서 매매체결방법 변경\*\* 또는 매매거래를 정지할 수 있습니다. 또한 해당 종목은 대용증권에서도 제외됩니다.

\*한국거래소 유가증권시장 상장규정 시행세칙 제134조의6에 따라 장종료시 실시간 괴리율이 관리의무 비율의 2배 이상(국내기초자산6% 이상, 해외기초자산 12%이상)인 경우 「적출→지정예고→지정」의 3단계 절차로 지정 또는 호가·매매거래상황 등을 감안하여 투자자보호에 필요한 경우 지정할 수 있음

\*\*정규시장 매매거래시간 중 30분 단위 단일가매매 3매매일 적용(해제요건 미충족시 3매매일 단위로 지정기간 및 단일가매매 연장)

- ETF의 시장가격과 실시간 증권당 지표가치가 달라 괴리가 발생 할 수 있으며, 지표가치에서 이격된 가격으로 투자할 경우 지수의 움직임과 투자성고가 일치하지 않을 수 있습니다. 투자여부 결정시 실시간 지표가치와 괴리율 수준을 반드시 확인하시기 바랍니다.

9. 파생상품ETF는 유동성이 풍부하지 못한 종목에 투자하는 경우 환금성에 제약이 발생할 수 있고, 일정한 조건을 충족하지 못하는 경우에는 상장폐지가 될 수 있어 예기치 못한 손실이 발생 할 수 있습니다.

10. ETF의 분배금(배당)은 국내주식의 배당처럼 다른 금융소득과 합산하여 2천만원 초과 시 금융소득 종합과세 대상으로 적용됩니다.

11.이 금융상품은 예금자보호법에 따라 보호되지 않습니다

▣ 민원·상담·분쟁조정 연락처

본 상품과 관련하여 의문사항 또는 불편사항이 있는 경우 회사의 상담센터(☎1588-0365)로 문의 또는 인터넷홈페이지([www.shinhansec.com](http://www.shinhansec.com))를 통해 확인하시기 바라며, 고객님께서도 상품 내용 및 이에 따르는 위험을 충분히 이해하신 다음에 해당 상품투자를 신중하게 결정하시기 바랍니다.

민원이 있을 경우 당사 MTS 및 홈페이지 상의 전자민원을 통한 접수가 가능하며 소비자보호부(☎02-3772-3000) 또는 금융감독원(국번 없이 ☎1332), 금융감독원 e-금융민원센터(<http://www.fcsc.kr>) 등의 도움을 요청할 수 있습니다..

본인은 상기 내용에 대해 충분히 설명을 듣고 숙지하였으며, 본인의 판단과 책임으로 거래를 하는 것을 확인합니다.

## 신한투자증권주식회사

※이 서류는 금융소비자보호 법령 및 내부통제 기준에 따른 절차를 거쳐 제공됩니다.