

	보도 자료			자본시장 밸류업 도약하는 대한민국
	보도	배포 즉시	배포	

담당부서	유가증권시장본부 증권상품시장부	문의	이자영 팀장(02-3774-9381) 윤채현 대리(02-3774-9387)
------	---------------------	----	--

## 제목 : KB, 한국, 신한, 미래에셋자산운용 ETF 5종목 신규상장

### 1 상장개요

□ 한국거래소(이사장 정은보)는 KB, 한국, 신한, 미래에셋자산운용의 ETF 5종목을 '25. 2. 18(화), 유가증권시장에 상장할 예정

#### 【신규상장 종목 개요】

구분	RISE 테슬라미국채타겟 커버드콜혼합(합성)	RISE 미국은행TOP10	ACE FTSE WGBI Korea
자산운용사	KB자산운용	KB자산운용	한국투자신탁운용
기초(비교)지수	KEDI 테슬라미국30년국채15% 타겟프리미엄 혼합지수(TR)	KEDI 미국 은행 TOP10 지수	FTSE Korean Government Bond Index(TR)
지수산출기관	한국경제신문	한국경제신문	FTSE
복제방법	합성(패시브)	실물(패시브)	실물(패시브)
신탁원본액(E)*	100억원	100억원	200억원
1좌당 가격(E)*	1만원	1만원	10만원
총보수(운용보수)	0.25%(0.209%)	0.20%(0.159%)	0.15%(0.13%)
AP/LP	미래, 삼성, 메리츠, 한국	미래, 삼성, 키움, 메리츠	키움, 한국

구분	SOL 중단기회사채(A-이상)액티브	TIGER 미국소비트렌드액티브
자산운용사	신한자산운용	미래에셋자산운용
기초(비교)지수	KIS 중단기크레딧플러스채권 (AA+~A-)지수(총수익)	Mirae Asset US Consumer Trend 지수 (Net Total Return)
지수산출기관	KIS자산평가	Mirae Asset Global Indices
복제방법	실물(액티브)	실물(액티브)
신탁원본액(E)*	600억원	100억원
1좌당 가격(E)*	5만원	1만원
총보수(운용보수)	0.05%(0.039%)	0.79%(0.73%)
AP/LP	NH, 메리츠, 미래, 키움, 한국	(AP) 메리츠, 키움, 한국, 삼성, 미래 (LP) 메리츠, 키움, 한국, 삼성

\* 신탁원본액 및 1좌당 가격은 상장일 전일 최종 확정

※ 상장일(2025. 2. 18) 기준 ETF 상장종목수 : 총 949종목

## 2 상장배경 및 주요특징

- (RISE 테슬라미국채타겟커버드콜혼합(합성)) 테슬라 주식과 미국 장기국채를 30:70으로 혼합하고, 테슬라 콜옵션과 미국채ETF 콜옵션을 각각 매도하여 프리미엄을 수취하는 월분배형 ETF
- 테슬라 콜옵션 매도 비중은 주식의 5% 수준으로 하고, 미국채 ETF 콜옵션 매도 비중을 시장 상황에 따라 조절하여 목표로 하는 프리미엄 수준을 추구할 예정

- (RISE 미국은행TOP10) 미국 상장 종목 중 미국에 본사를 둔  
상업·투자은행 시가총액 상위 10종목에 투자하는 상품
- 미국 금융섹터 중 은행에만 투자하는 첫 ETF로, 미국의 금융규제  
완화 시 수혜를 기대할 수 있는 투자수단
- (ACE FTSE WGBI Korea) FTSE WGBI\* 중 한국 국채로 구성된  
FTSE WGBI Korea 지수를 추종하는 패시브 상품
  - \* 세계국채지수(World Government Bond Index). 26개국(한국 포함) 국채로 구성된  
선진국 채권지수로 주요 연기금 등 초우량 글로벌 투자자의 추종 비중이 높은  
대표적인 글로벌 채권지수로 평가
  - 세계 3대 채권지수 중 하나인 FTSE WGBI에 한국 편입이 확정  
됨에 따라 국내외 채권 펀드 및 기관투자자 등의 국채 매입  
수요에 대응하는 투자수단이 될 것으로 기대
- (SOL 중단기회사채(A-이상)액티브) 신용등급이 A- 이상인  
만기 3년 이내의 회사채에 투자하는 액티브 ETF
  - 발행·유통이 활발한 신용등급 A- 이상 회사채에 분산 투자함으로써  
신용리스크를 낮추면서도 국채 투자 대비 높은 수익을 기대할 수 있는  
투자수단
- (TIGER 미국소비트렌드액티브) 美 소비재 관련 기업 중 소비  
트렌드를 주도하는 기업을 선별하여 투자하는 액티브 ETF
  - 액티브 운용 전략으로서 다양한 대안 데이터\*를 활용하여 미국  
소비 트렌드를 파악하고 종목 편출입 및 비중 조정

\* 브랜드 결제액, 웹사이트 방문율, 검색량, 설문조사 등

### 3 투자 유의사항 및 참고사항

- 운용비용, 구성종목 교체 등에 따라 지수성과와 운용성과 간의 괴리가 발생할 수 있으며, 기초지수 등 고유의 상품구조에 대한 정확한 이해 필요
  - (합성 ETF 특성) 거래상대방과의 장외파생상품 계약을 이용하여 상품을 운용함에 따라 추가적인 비용이 발생하고, 동 비용에 의해 지수성과와 운용성과 간의 괴리가 발생할 수 있음에 주의
  - (환노출 ETF 특성) ETF 편입 자산에 대한 별도의 환헤지를 하지 않으므로 향후 환율 변동위험에 노출 가능
  - (액티브 ETF 특성) 운용능력에 따라 ETF 운용성과가 달라질 수 있으며, 추적오차가 크게 발생할 수 있음을 인지할 필요
  - 총보수 이외에 기초지수 사용료, 매매비용, 회계감사비용 등의 기타비용이 추가적으로 발생할 수 있음에 주의 필요
  - 투자자 이해를 돕기 위해 매일의 납부자산구성내역(PDF)을 CHECK 단말기, 거래소 및 자산운용사 ETF 홈페이지에 제공할 예정
- ※ 상품 설명 및 투자위험 등 동 상품에 대한 보다 상세한 내용은 금융감독원 전자공시 시스템([dart.fss.or.kr](http://dart.fss.or.kr))의 투자설명서 등을 참고
- ※ 첨부 : 기초(비교)지수 구성방법
- ※ 한국거래소 보도자료는 홈페이지(<http://www.krx.co.kr>)에 수록되어 있습니다.

**첨부**

**기초(비교)지수 구성방법**

□ RISE 테슬라미국채타겟커버드콜혼합(합성)

<b>기초지수명</b>	KEDI 테슬라미국30년국채15%타겟프리미엄 혼합지수(TR)		
<b>산출기관</b>	한국경제신문		
<b>유니버스</b>	테슬라 고정커버드콜 지수(하위지수1), KEDI 미국장기국채테슬라연동커버드콜 지수(하위지수2)		
<b>선정기준</b>	① 테슬라 고정커버드콜 지수 - 주식 : 미국 증시에 상장된 테슬라 주식 - 매도 대상 옵션 : 매주 결제(표준 만기일은 금요일)되는 테슬라 Weekly ATM 콜옵션  ② KEDI 미국장기국채테슬라연동커버드콜 지수 ○ 채권ETF 포트폴리오: 미국 상장 미국 국채 추종 ETF 중 AUM 3억달러 이상, 총보수율(TER) 0.15% 이하인 ETF들을 대상으로, 매도 대상 콜옵션의 기초자산 ETF와 추적오차가 최소화된 ETF 포트폴리오 구성 - ETF 10종목 이상(최대 20종목)으로 구성하되 콜옵션 기초자산 ETF는 필수적으로 포함하며, 20종목을 초과할 경우 총보수율이 낮은 종목을 우선 편입 ○ 매도 대상 콜옵션 : 미국 상장 20년 이상 만기 미국 국채를 추종하는 ETF 가운데 AUM이 가장 높고, 장내 거래되는 옵션이 있는 종목(현재 TLT US)의 옵션만기 요일(월/수/금)별 ATM 콜옵션		
<b>구성종목수</b>	15종목(테슬라 1종목, 채권 ETF 14종목) & 콜옵션		
<b>비중결정방식</b>	하위지수1 30%, 하위지수2 70%		
<b>정기변경</b>	- 하위지수 정기변경 : 일별 - 테슬라 옵션 : 주별(표준주간 만기일은 매주 금요일) - 미국30년국채ETF 옵션: 옵션만기 요일(지수발표일 기준 월/수/금) - 채권형 ETF포트폴리오: 월별(매주 첫 번째 금요일)		
<b>CAP 비율</b>	테슬라 30%, 하위지수2 내 개별 채권ETF 25%		
<b>산출기준일</b>	2019.01.03.= 1,000pt	공식산출일	2024.11.15
<b>산출시간</b>	한국시간 기준 8:30AM 종가		

□ RISE 미국은행TOP10

기초지수명	KEDI 미국 은행 TOP10 지수		
산출기관	한국경제신문		
유니버스	미국 증권거래소(뉴욕증권거래소, 나스닥 등)에 상장된 보통주		
선정기준	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 정기변경일 기준 유동 시가총액 \$1Bn 이상인 기업</li> <li>- 정기변경일 기준 3개월 일 평균 거래대금이 \$1Mn 이상인 기업</li> <li>- 본사의 위치가 미국인 기업</li> <li>- KEDI-Akros Industry Classification Standard (KAICS) Primary Level 5 분류 기준 다음 분류에 해당하는 기업</li> <li>· Commercial Banking, Investment Banking and Securities Intermediation</li> </ul>		
구성종목수	10종목		
비중결정방식	시가총액 가중		
정기변경	1, 4, 7, 10월		
CAP 비율	20%		
산출기준일	2019.01.04. (1,000pt)	공식산출일	2024.11.15.
산출시간	한국시간 기준 8:30AM 종가		

□ ACE FTSE WGBI Korea

기초지수명	FTSE Korean Government Bond Index(TR)		
산출기관	FTSE		
유니버스	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 채권: 국고채</li> <li>- 제외 종목 : 통안채, 변동금리채, 2003년 이전에 발행된 10년물, 주택채권, 고정금리영구채, 전환사채 등</li> </ul>		
선정기준	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 채권 : 한국 정부 발행 국고채</li> <li>- 만기 : 잔존만기 1년 미만 종목 제외</li> <li>- 최소발행금액 : 1조원</li> </ul>		
구성종목수	62종목		
비중결정방식	시가총액 가중		
정기변경	매월		
CAP 비율	-		
산출기준일	2004.12.31 (100.00pt)	공식산출일	2007.12.31
산출시간	한국시간 기준 16:00 종가		

## □ SOL 중단기회사채(A-이상)액티브

기초지수명	KIS 중단기크레딧플러스채권(AA+~A-)지수(총수익)		
산출기관	KIS자산평가		
유니버스	KIS자산평가의 가격평가 가능한 국내채권 전체 종목		
선정기준	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 신용등급 AA+ ~ A-, 만기 3개월~3년 이하 국내 채권</li> <li>- 회사채, 기타금융채(여전채 등)</li> </ul>		
구성종목수	2,225종목('25.1.31 기준)		
비중결정방식	시가총액 비중		
정기변경	일별 리밸런싱		
CAP 비율	동일발행사 편입한도 10%		
산출기준일	2019.01.02. 및 100.00pt	공식산출일	2024.11.08.
산출시간	매 영업일 19:00 종가지수 발표		

□ TIGER 미국소비트렌드액티브

<b>기초지수명</b>	Mirae Asset US Consumer Trend 지수 (Net Total Return)		
<b>산출기관</b>	Mirae Asset Global Indices		
<b>유니버스</b>	- 미국 주식시장에 상장된 종목 중 아래 요건을 충족하는 종목 1) 6개월 평균거래대금 200만 달러 이상(기존 구성종목의 경우 최소 160만 달러 이상) 2) 유동주식 비율이 10% 이상 3) 최근 6개월 거래일 중 90% 이상 거래 4) GICS 산업 분류가 소비관련 아래 6개의 카테고리에 속하는 종목		
	카테고리(대분류)	소분류	GICS Industry Group 기준
	경기소비재 (Discretionary Goods)	-	- Consumer Durables & Apparel - Technology Hardware & Equipment - Automobiles & Components
	필수소비재 (Staples Goods)	-	-Food, Beverage & Tobacco -Household & Personal Products
	리테일 & 이커머스 (Retail & e-Commerce)	-	-Consumer Discretionary Distribution & Retail -Consumer Staples Distribution & Retail
	미디어 & 통신 (Media & Telecommunication)	-	-Media & Entertainment -Telecommunication Services
	소비자 서비스 (Consumer Service)	-	-Consumer Services
	기타 서비스 (Other Services)	테크&투자, 운송, 헬스케어	-Financial Services -Transportation -Health Care Equipment & Services -Pharmaceuticals, Biotechnology & Life Sciences
<b>선정기준</b>	- 각 대분류 별 시가총액 상위 20개 종목 선정 - 단, 소분류가 존재하는 기타 서비스의 경우 핀테크 & 투자, 운송, 헬스케어 각 상위 8개, 6개, 6개 종목을 편입하여 총 20개 종목을 편입		
<b>구성종목수</b>	120종목		
<b>비중결정방식</b>	동일가중 방식		
<b>정기변경</b>	정기변경: 연 4회 분기별 리밸런싱(매년 3, 6, 9, 12월 마지막 영업일)		
<b>CAP 비율</b>	-		
<b>산출기준일</b>	2019.03.29. = 1,000.0pt	<b>공식산출일</b>	2024년 11월 22일
<b>산출시간</b>	(한국시간): 23:30~06:00(서머타임: 22:30~05:00) (미국시간): 09:30~16:00		