

기준가격 변경사실 공시

자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행령 262조 1항에 따라 다음과 같이 오차한도를 초과한 기준가격의 변경 사실을 보고합니다.

발생일자	2019.12.31 (영업기준가)
변경사유	해당 펀드에서 편입하고 있는 PARVEST 전환사채(LU0086913125) 종목의 종가가 EUR 198.04로 잘못 적용됨을 확인. EUR 198.04 종가는 12월 30일 21시에 당 팀의 기준가 및 해외종가 검증 프로세스 과정에서 사무수탁사와 같이 블룸버그에 고시 된 종가와 일치함을 확인함. 그러나 기준가 산출 이후 12월 30일 23시경 알 수 없는 이유로 해당 종목의 블룸버그 종가가 EUR 198.04에서 EUR 177.41로 변경 됨. 이로 인해 EUR 75,212,21만큼 기준가에 평가손익 과대 계상됨. 2019년 12월 31일 상기의 오류를 인지하지 못한 상태에서 과대 평가이익이 반영 된 기준가가 산출되어 공시됨.

일자	펀드코드	KRZ코드	펀드명	통화	기준가(전)	기준가(후)	차액
2019-12-31	251870		유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종)	KRW	1,153.50	1,038.82	-114.68
2019-12-31	251871	KRZ501924301	유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종A1)	KRW	1,103.41	993.43	-109.98
2019-12-31	251872	KRZ501924302	유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종A-e)	KRW	1,086.59	978.38	-108.21
2019-12-31	251873	KRZ501924303	유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종C1)	KRW	1,075.01	967.79	-107.22
2019-12-31	251874	KRZ501924304	유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종C-e)	KRW	1,108.35	997.94	-110.41
2019-12-31	251876	KRZ501924306	유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종C-w)	KRW	1,167.66	1,051.90	-115.76
2019-12-31	251877	KRZ501924307	유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종S)	KRW	1,127.76	1,015.46	-112.3
2019-12-31	251892	KRZ50192430A	유럽전환사채1호(H)[채권혼합-재간접형](종S-P)	KRW	1,172.48	1,055.78	-116.7