

삼성KODEX KRX300레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형](펀드 코드: CE604)

| 투자 위험 등급 1등급(매우 높은 위험) | | | | | |
|---------------------------|-------|----------|-------|-------|----------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 매우 높은 위험 | 높은 위험 | 다소 높은 위험 | 보통 위험 | 낮은 위험 | 매우 낮은 위험 |

삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 **투자대상 자산의 종류 및 위험도**를 감안하여 **1등급**으로 분류하였습니다.

집합투자증권은 『예금자보호법』에 따라 예금보험공사가 보호하지 않는 실적배당상품입니다.

해당 집합투자기구는 **주식 및 주식관련 장내파생상품**을 주된 투자대상으로 하여 신탁재산의 **60% 이상**을 투자하되, 신탁재산의 10%를 초과하여 위험회피 외의 목적으로 파생상품에 투자하는 레버리지 전략을 실행함에 따라 **레버리지투자위험, 추적오차 발생위험, 파생상품 투자위험 등이 있으므로 투자에 신중**을 기하여 주시기 바랍니다.

이 요약정보는 삼성KODEX KRX300레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]의 투자설명서의 내용 중 중요사항을 발췌·요약한 핵심정보를 담고 있습니다. 따라서 자세한 정보가 필요하신 경우에는 **동 집합투자증권을 매입하기 이전에 투자설명서를 반드시 참고하시기 바랍니다.**

[요약정보]

| | | | | | | | | | | | |
|--------------------------|---|------------|-------------------|-------------------|-------------------|---|--------|-----|-----|-----|-----|
| 투자목적 및 투자전략 | 이 투자신탁은 주식 및 주식관련 장내파생상품을 주된 투자대상으로 하여 신탁재산의 60% 이상을 투자하되, 신탁재산의 10%를 초과하여 위험회피 외의 목적으로 파생상품에 투자하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수인 KRX300 지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하여 운용할 계획입니다. | | | | | | | | | | |
| 분류 | 투자신탁, 증권(주식파생형), 개방형(중도환매가능), 추가형(추가납입가능), 상장지수투자신탁 | | | | | | | | | | |
| 투자비용 | 투자자가 부담하는 수수료, 총보수 및 비용 | | | | | 1,000만원 투자시 투자자가 부담하는 투자기간별 총보수·비용 예시 (단위 : 천원) | | | | | |
| | 명칭 | 판매수수료 | 총보수 | 판매보수 | 동종유형 총보수 | 총보수·비용 | 1년 | 2년 | 3년 | 5년 | 10년 |
| | 삼성KODEX KRX300레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형] | 없음 | 0.640% | 0.050% | | 0.674% | 67 | 137 | 209 | 366 | 830 |
| | (주1) 구체적인 투자비용은 투자설명서' 제2부. 집합투자기구에 관한 사항 중 13. 보수 및 수수료에 관한 사항'을 참고하시기 바랍니다. (주2) ' 동종유형 총보수 '는 한국금융투자협회에서 공시하는 동종유형 집합투자기구 전체의 평균 총보수비용을 의미합니다. (주3) '1,000만원 투자시 투자자가 부담하는 투자기간별 총비용 예시'는 투자자가 1,000만원을 투자했을 경우 향후 투자기간별 지불하게 되는 총비용 (판매수수료 + 총보수비용)을 의미합니다. 선취판매수수료 및 총보수·비용은 일정하고, 이익금은 모두 재투자하며, 연간 투자수익률은 5%로 가정하되, 기타비용(증권거래 비용 및 금융비용 제외)의 변동, 보수의 인상 또는 이하 여부 등에 따라 실제 부담하게 되는 보수 및 비용이 달라질 수 있습니다. | | | | | | | | | | |
| 투자실적 추이 (연평균 수익률) | 명칭 | 최초설정일 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 | 설정일 이후 | | | | |
| | | | 21/06/18~22/06/17 | 20/06/18~22/06/17 | 19/06/18~22/06/17 | | | | | | |
| | 삼성KODEX KRX300레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형] | 2018-10-15 | -45.57 | 10.31 | 8.51 | | 5.15 | | | | |
| | 비교지수(%) | 2018-10-15 | -47.25 | 6.75 | 4.93 | | 1.46 | | | | |
| | 수익률 변동성(%) | 2018-10-15 | 28.14 | 35.82 | 43.35 | | 41.27 | | | | |
| | - 비교지수 : KRX300 레버리지 지수*100%(비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음) - 연평균 수익률은 해당 기간동안의 누적수익률을 기하평균방식으로 계산한 것으로 집합투자기구 총비용 지급후 해당기간동안의 세전평균 수익률을 나타내는 수치입니다. - 수익률 변동성(표준편차)은 해당기간 펀드의 연환산 중간수익률이 평균수익률에서 통상적으로 얼마만큼 등락했는지를 보여주는 수치로서, 변동성이 높을수록 수익률 등락이 빈번해 펀드의 손실위험이 높다는 것을 의미합니다. | | | | | | | | | | |

**운용전문
인력**

| 성명 | 생년 | 직위 | 운용현황 | | 동종집합투자기구 연평균 수익률(파생형) | | | | 운용 경력년수 |
|-----|------|--------|--------------|----------|--------------------------|--------|---------|--------|------------|
| | | | 집합투자 기구 수 | 운용규모 | 운용역 | | 운용사 | | |
| | | | | | 최근1년 | 최근2년 | 최근1년 | 최근2년 | |
| 박성철 | 1987 | 책임(VP) | 12개 | 89,540억원 | 5.64% | -2.49% | -17.36% | 23.61% | 6년 3개월 |

- 상기인은 이 투자신탁의 투자전략 수립 및 투자의사결정 등에 주도적·핵심적 역할을 수행하는 운용전문인력입니다.
- 운용중인 다른 집합투자기구 중 성과보수가 약정된 집합투자기구 : 해당사항없음
- 위의 집합투자기구 수에는 모자형투자신탁의 모투자신탁은 포함되어 있지 않습니다.
- 운용전문인력의 최근 과거 3년 이내에 운용한 집합투자기구의 명칭, 집합투자재산의 규모와 수익률 등은 금융투자협회 홈페이지(www.kofia.or.kr)에서 확인할 수 있습니다.
- 동종집합투자기구 연평균 수익률은 해당 집합투자업자가 분류한 동일 유형 집합투자기구의 평균운용성과이며, 해당 운용전문인력의 평균운용성과는 해당 회사근무기간 중 운용한 성과를 의미합니다.
- '운용경력년수'는 해당 운용전문인력이 과거 집합투자기구를 운용한 기간을 모두 합산한 기간입니다.


**투자자
유의사항**

- 집합투자증권은 『예금자보호법』에 따라 예금보험공사가 보호하지 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 가하여 주시기 바랍니다.
- 금융위원회가 투자설명서의 기재사항이 진실 또는 정확하다는 것을 인정하거나 그 증권의 가치를 보증 또는 승인하지 아니함을 유의하시기 바랍니다.
- 간이투자설명서보다 자세한 내용이 필요하시어 투자설명서의 교부를 요청하시면 귀하의 집합투자증권 매입 이전까지 교부 하오니 참고하시기 바랍니다.
- 간이투자설명서는 증권신고서 효력발생일까지 기재사항 중 일부가 변경될 수 있으며, 개방형 집합투자증권인 경우 효력발생일 이후에도 변경될 수 있습니다.
- 이 집합투자증권의 투자위험등급을 확인하시고, 귀하의 투자 경력이나 투자성향에 적합한 상품인지 신중한 투자결정을 하시기 바랍니다.
- 증권신고서, 투자설명서상 기재된 투자전략에 따른 투자목적 또는 성과목표는 반드시 실현된다는 보장은 없습니다. 또한 과거의 투자실적이 장래에도 실현된다는 보장은 없습니다.
- 집합투자기구가 설정 후 1년이 경과하였음에도 설정액이 50억원 미만(소규모펀드)인 경우 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하거나 임의해지 될 수 있으니, 투자 시 소규모펀드 여부를 확인 하시기 바람여 소규모펀드 해당여부는 금융투자협회, 판매회사, 자산운용사 홈페이지에서 확인할 수 있습니다.

**주요투자
위험**

| 구분 | 투자위험의 주요내용 |
|------------------|---|
| 추적오차 발생위험 | 이 투자신탁은 KRX300 지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하는 것을 목적으로 하고 있으나, 투자신탁보수, 위탁매매수수료 등 관련 비용의 지출 등 현실적 제한으로 인하여 기초지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수와 동일한 수익률이 실현되지 아니할 가능성이 있으며, 추적오차가 크게 발생할 수 있습니다. 따라서 이 투자신탁의 수익률과 기초지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수가 동일할 것을 전제로 하는 투자는 당해 추적오차로 인하여 예상하지 못한 손실을 실현할 수도 있습니다. |
| 레버리지투자위험 | 이 투자신탁은 주식, 집합투자증권, 환매조건부 매도, 증권의 차입 및 파생상품 등을 활용하여 순자산보다 더 큰 주식투자비중을 유지하는 투자신탁으로 KRX300 지수의 변동에 따라 그 투자성결과 더 큰 폭으로 변동하는 특성을 가지고 있습니다. 그러므로, KRX300 지수가 지속적으로 하락할 경우에는 더 큰 손실을 볼 수 있고 KRX300 지수가 큰 폭의 변동성을 보이면서 움직이는 경우에는 지수의 성과조차 추적하지 못 할 수 있습니다. 또한, 파생상품을 이용하여 레버리지 투자를 완성하므로 파생상품의 내재변동성 및 민감도에 따라 다른 수익이 실현될 수도 있으며 투자한 파생상품과 관련 증권 또는 지수 등과 불완전 상관관계로 손실이 발생할 수 있습니다. 아울러, KRX300 지수의 기대수익과 변동성 등의 시장상황에 대한 이해와 재무적인 사전지식에 기반하여 투자를 결정하여야 하며 이런 사전적인 검토에도 불구하고 기대와는 다른 수익을 실현할 수 있습니다. |
| 레버리지 복리효과에 의한 위험 | 이 투자신탁은 파생상품을 활용하여 KRX300 지수 일간변동률의 양(陽)의 2배를 일간단위로만 추구(상승할 경우에도 2배, 하락할 경우에도 2배를 추구)하는 투자신탁으로 투자기간, 시장평균성과, 변동성, 왜도 및 척도 등에 따라서 투자자는 결과적으로 양(陽)의 2배를 확보하지 못하고, 경우에 따라서는 지수의 성과에 크게 미치지 못하는 결과를 맞을 수 있습니다. |

| | | | |
|--|--|---|---------------------------------------|
| 주요투자 위험 | 구분 | 투자위험의 주요내용 | |
| | 레버리지 투자방 법상의 위험 | 이 투자신탁은 주식, 집합투자증권, 환매조건부 증권의 매도, 증권의 차입 및 파생상품 등을 활용하여 순자산보다 더 큰 주식투자비중을 유지하는 투자신탁으로서 일간 주식시장 성과의 양(陽)의 2배수를 추구합니다. 동 전략을 추구하는 과정에서 주식시장의 변동성에 따라서 빈번한 선물거래가 이뤄지거나 현물주식거래가 이뤄질 수 있어서 일반적인 투자신탁보다 더 높은 매매회전율을 보일 수 있습니다. 그리고 장중에 주식시장의 변동성이 확대될 경우에는 레버리지 비율이 더 확대되거나 감소할 수 있습니다. 일반적으로는 주가가 상승할 경우에는 레버리지 비율이 감소하고 주가가 하락할 경우에는 레버리지 비율이 증가하므로 주가하락시 더 큰 하락 폭을 유지할 수 있습니다. 그러므로, 변동성이 커지는 시점에는 상대적으로 더 큰 손실을 볼 수 있으며 경우에 따라서는 레버리지 비율이 극단적으로 감소하거나 증가할 수 있습니다. | |
| | 누적수익률과 괴 리위험 | 이 투자신탁은 KRX300 지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하여 투자신탁재산을 운용함을 그 운용목적으로 합니다. 이는 일간단위로 기초지수가 오를 경우에도 양(陽)의 2배수를 추구하고 떨어질 때에도 양(陽)의 2배수를 추구하는 것이므로 투자기간 전체에 대해서 누적하여 양(陽)의 2배수를 추구할 수 있다는 것을 의미하지 않습니다. | |
| | ETF 손익구조 오 차위험 | 이 투자신탁은 KRX300 지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하여 투자신탁재산을 운용함을 목적으로 하고 있으므로, 시간이 경과함에 따라 투자신탁에 영향을 주는 다양한 요인에 의해 누적적으로는 KRX300 지수 누적수익률의 양(陽)의 2배수를 추적하지 못할 수 있습니다. 즉, 일시적으로 또는 지속적으로 이 투자신탁과 KRX300 지수의 누적수익률간의 음(陰)의 상관관계가 나타날 수도 있습니다. | |
| | 레버리지 불가능 위험 | 이 투자신탁은 주식, KRX300 지수를 기초지수로 하는 집합투자증권, KRX300 지수 관련 파생상품 및 현금성 자산 등으로 포트폴리오를 구성할 예정이며 증권의 차입 및 환매조건부 매도 등 기타 효율적인 방법을 통하여 레버리지전략을 달성할 예정입니다. 다만, 급격한 시장 변동, 자금시장의 유동성 악화 및 기타 레버리지 전략을 수행할 수 없는 다양한 상황이 도래하는 경우 투자목적 달성을 하지 못할 수 있습니다. | |
| 투자대상 집합투 자증권과 기초지 수의 괴리에 따 른 위험 | 이 투자신탁은 KRX300 지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하는 목적을 달성하기 위해 KRX300 지수를 추종하는 집합투자증권에 투자합니다. 이 투자신탁이 투자한 집합투자증권의 일간변동률과 기초지수 일간변동률간에 차이가 발생하는 경우, 이 투자신탁의 1좌당 순자산가치의 일간변동률과 기초지수 일간변동률의 2배수한 값과 괴리가 발생할 수 있습니다. 이러한 경우가 지속되는 경우, 복리로 누적된 오차로 인해 그 괴리가 더욱 확대될 수 있으며, 이로 인해 이 투자신탁의 투자목적 달성을 하지 못할 수 있습니다. | | |
| 매입 방법 | 개인투자자 : 장내 매수 법인투자자 : 장내 매수, 설정 청구 | 환매 방법 | 개인투자자 : 장내 매도 법인투자자 : 장내 매도, 환매 청구 |
| 환매 수수료 | 없음 | | 없음 |
| 기준가 | 산정방법 | 당일에 공고되는 기준가격은 그 직전일의 재무상태표상에 계산된 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 차감한 금액(이하 "순자산총액"이라 한다)을 직전일의 수익증권 총 좌수로 나누어 1좌 단위로 4사5입하여 원미만 둘째 자리까지 계산합니다. 이 투자신탁의 기준가격은 1좌당 가격으로 공고합니다. | |
| | 공시장소 | 판매회사 또는 지정참가회사 영업점, 집합투자업자(http://www.samsungfund.com) · 판매회사 또는 지정참가회사 · 한국금융투자협회(www.kofia.or.kr), 증권시장 인터넷홈페이지 | |
| 과세 | 구분 | 과세의 주요내용 | |
| | 집합투자기구 수익자 | 집합투자기구 단계에서는 별도의 소득과세 부담이 없는 것이 원칙 입니다. 거주자와 일반법인이 받는 집합투자기구로부터의 과세 이익에 대해서는 15.4%(지방소득세 포함) 세율로 원천징수 됩니다. 단, 연간 금융소득합계액이 기준금액을 초과하는 경우에는 기준금액을 초과하는 금액을 다른 종합소득과 합산하여 개인소득세율로 종합과세 됩니다. * 세계혜택제좌 등 투자자의 과세에 관한 사항은 투자설명서 제2부, 14. 이익 배분 및 과세에 관한 사항을 참고하시기 바랍니다. | |
| 전환절차 및 방법 | 1. 이연판매보수(CDSC) 적용기준 및 내용 - 해당사항없음 2. 전환형 구조 - 해당사항 없음 | | |

| | | | |
|---|--|---------------------|---|
| 집합투자업자 | 삼성자산운용주식회사 (대표전화:02-3774-7600, 콜센터:080-377-4777) | | |
| 모집기간 | 2018년 9월 20일부터 모집을 개시하며 모집개시일 이후 특별한 사정이 없는 한 계속 모집할 수 있습니다. | 모집·매출 총액 | 추가로 설정할 수 있는 수익증권의 총좌수는 10조좌입니다. |
| 효력발생일 | 2022. 6.22 | 존속기간 | 해당사항 없음 |
| 판매회사 | 집합투자업자(http://www.samsungfund.com) 및 금융투자협회(www.kofia.or.kr) 홈페이지 참조 | | |
| 참조 | 집합투자업자의 사업목적, 요약 재무정보에 관한 사항은 투자설명서 제4부, 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항을 참조하시기 바랍니다. | | |
| [집합투자기구 공시 정보 안내] | | | |
| <ul style="list-style-type: none"> ● 증권신고서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr) ● 투자설명서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr), 한국금융투자협회(dis.kofia.or.kr) 집합투자업자(http://www.samsungfund.com) 및 판매회사 홈페이지 ● 정기보고서(영업보고서, 결산서류) : 금융감독원 홈페이지(www.fss.or.kr) 및 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) ● 자산운용보고서 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(http://www.samsungfund.com) ● 수시공시 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(http://www.samsungfund.com) | | | |
| | | |  |